

## 【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】	2023年4月25日
【発行者名】	東京海上アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 横田 靖博
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	尾崎 正幸
【電話番号】	03 - 3212 - 8421
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	東京海上・円資産インデックスバランスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	上限 1兆円
【縦覧に供する場所】	該当なし

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

東京海上・円資産インデックスバランスファンド

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

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

当初の1口当たり元本は1円です。

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

### (3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額

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

委託会社のお問い合わせ先（以下「委託会社サービスデスク」といいます。）

東京海上アセットマネジメント サービスデスク

0120-712-016（土日祝日・年末年始を除く9時～17時）

### (5)【申込手数料】

申込時の手数料はありません。

### (6)【申込単位】

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

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

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

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

### (7)【申込期間】

2023年4月26日から2023年10月25日まで

上記申込期間中の毎営業日にお申込みを受け付けます。

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

### (8)【申込取扱場所】

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

### (9)【払込期日】

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

各取得申込日の発行価額の総額は各追加信託が行われる日に、販売会社から、委託会社の指定する口座を経由して、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、取引所( )における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置を取った場合には、販売会社は、受益権の取得申込の受付を中止すること、および既に受け付けた取得申込の受付を取り消すことができます。  
( )金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます(以下、本書において同じ。)
- e. 取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込を行うものとします。(ただし、既に取引口座をお持ちの場合を除きます。)
- f. 分配金再投資コースの場合には、申込の際、取得申込者と販売会社の間で、自動けいぞく(累積)投資に関する契約を締結する必要があります。  
上記の契約について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約等が用いられることがあります。この場合、当該別の名称に読替えるものとします(以下同じ。)
- g. 定時定額購入サービスを選択した取得申込者は、販売会社との間で定時定額購入サービスに関する取り決めを行います。

日本以外の地域における発行

該当ありません。

振替受益権について

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

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

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

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

基本的性格

当ファンドは、追加型投信/国内/資産複合に属します。

当ファンドの商品分類表および属性区分表は、以下の通りです。

商品分類表

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

属性区分表

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

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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

#### 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

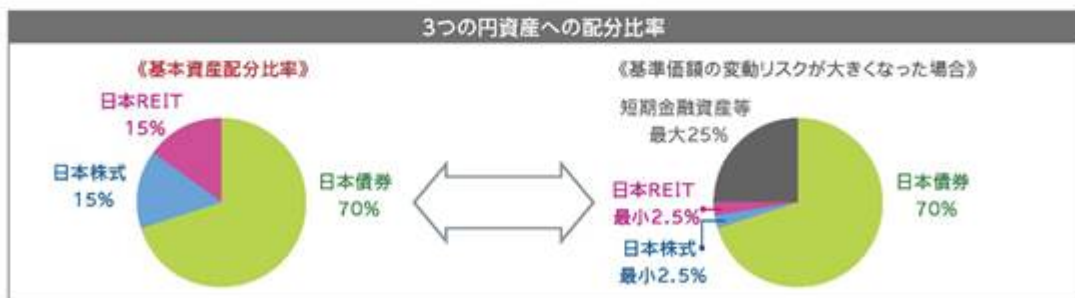
主として国内の債券や株式、不動産投資信託（REIT）を主要投資対象とするマザーファンドへの投資を通じて、国内の複数の資産（債券・株式・REIT）に分散投資します。

2

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

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

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



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

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

次ページへ続く

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



## ● 価格変動リスクとは

価格が下落した場合だけでなく、上昇した場合も含めた「**値動きの振れ幅の程度**」をいいます。

リスクの大小を数値で表す場合、一般的には「**標準偏差**」を用います。標準偏差とは、価格の変化率（リターン）のばらつき度合いを示す指標です。

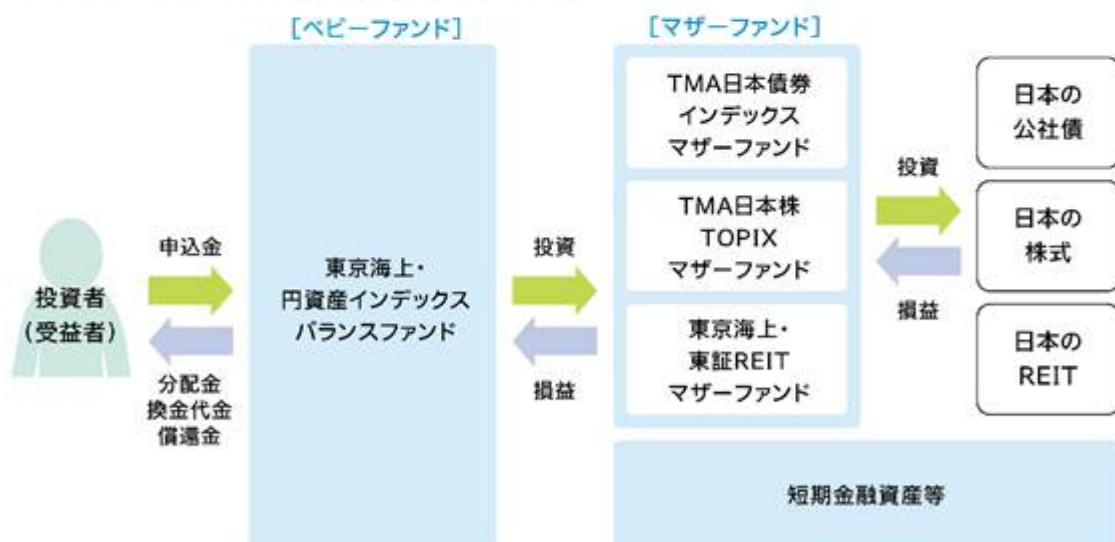
標準偏差が小さいほど値動きが緩やかでリスクは小さく、標準偏差が大きいほど値動きは荒くリスクが大きいことを示します。

<各マザーファンドが対象とする指数について>

- NOMURA-BPI(総合)とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下、NFRCといいます。)が公表する日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表す代表的な指標です。NOMURA-BPIは、NFRCの知的財産です。NFRCは、ファンドの運用成績等に関し、一切責任ありません。
- TOPIXは、株式会社J P X総研が算出する株価指数であり、日本の株式市場を広くに網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。TOPIXの指数値およびTOPIXにかかる標準または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下、J P Xといいます。)の知的財産であり、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・ノウハウおよびTOPIXにかかる標準または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。
- 東証REIT指数は、株式会社J P X総研が算出する株価指数であり、東証市場に上場するREIT全銘柄を対象とした浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。東証REIT指数の指数値および東証REIT指数にかかる標準または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下、J P Xといいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

## ファンドの仕組み

- ファミリーファンド方式により運用を行います。



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

次ページへ続く

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

## 主な投資制限

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

## 分配方針

◎年1回決算を行います。

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

《イメージ図》

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

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

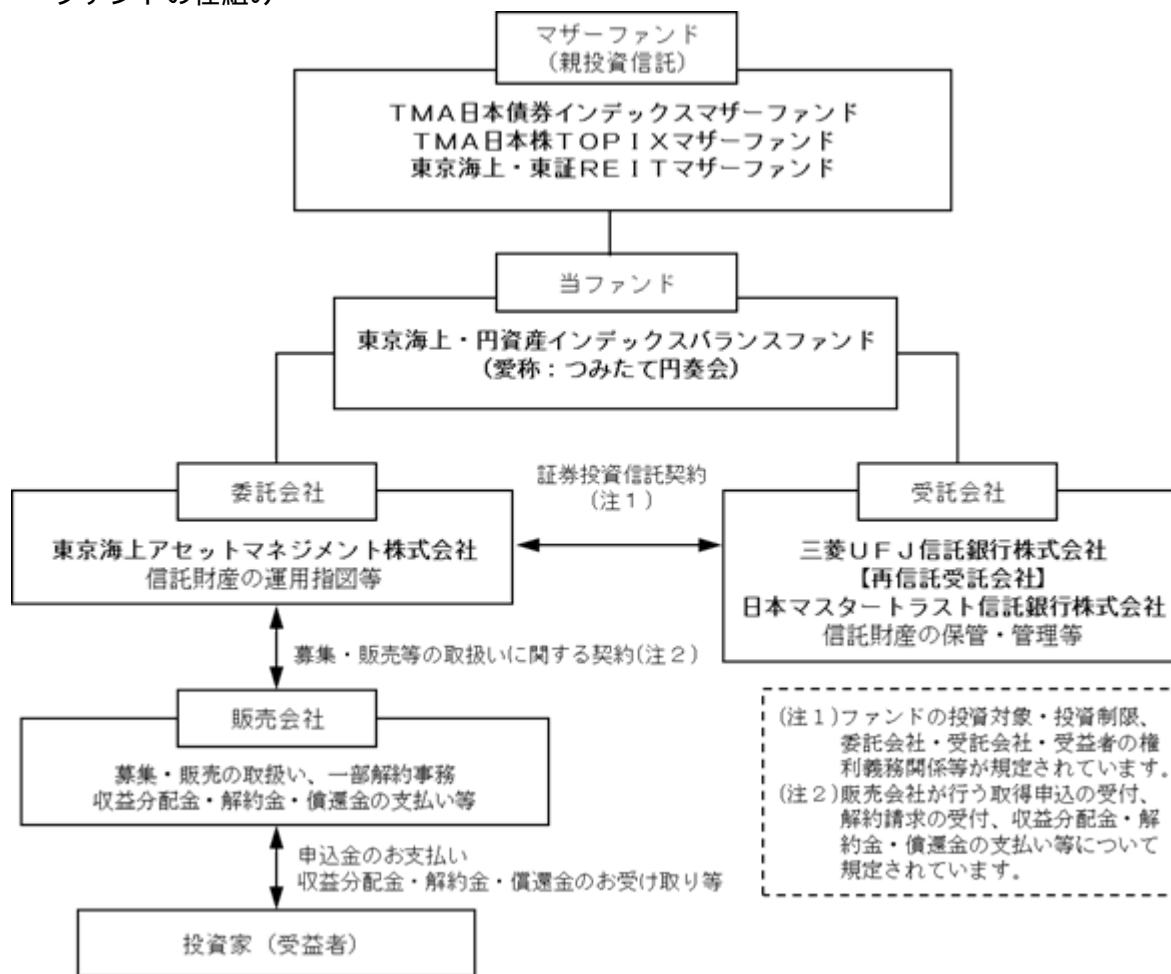
資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

**(2) 【ファンドの沿革】**

2017年10月11日 ファンドの設定、運用開始

**(3) 【ファンドの仕組み】**

ファンドの仕組み

**委託会社の概況**

- ・名称 東京海上アセットマネジメント株式会社
- ・資本金の額 20億円（2023年1月末日現在）
- ・会社の沿革

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

**・大株主の状況（2023年1月末日現在）**

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

**2 【投資方針】****(1) 【投資方針】**

## 1. 基本方針

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

## 2. 運用方法

### (1) 主要投資対象

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

TMA日本債券インデックスマザーファンド受益証券

TMA日本株TOPIXマザーファンド受益証券

東京海上・東証REITマザーファンド受益証券

### (2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

原則として月次でリバランスを実施します。

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

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

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

NOMURA - B P I（総合）に連動する投資成果の達成を目標とします。

**2. 運用方法****(1) 投資対象**

わが国の公社債を主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

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

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

**3. 運用制限**

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

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

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

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

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

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

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

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

**TMA日本株TOPIXマザーファンド****1. 基本方針**

TOPIXに連動する投資成果の達成を目標とします。

**2. 運用方法****(1) 投資対象**

TOPIXに採用されている銘柄を主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

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。

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

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

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

**3. 運用制限**

(1) 株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

**東京海上・東証REITマザーファンド****1. 基本方針**

東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果の達成を目標とします。

**2. 運用方法****(1) 投資対象**

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

**(2) 投資態度**

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

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

原則として、REITへの組入比率を高位に維持します。

**3. 運用制限**

(1) 株式への直接投資は行いません。

(2) 外貨建資産への直接投資は行いません。

(3) 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

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

**(2)【投資対象】**

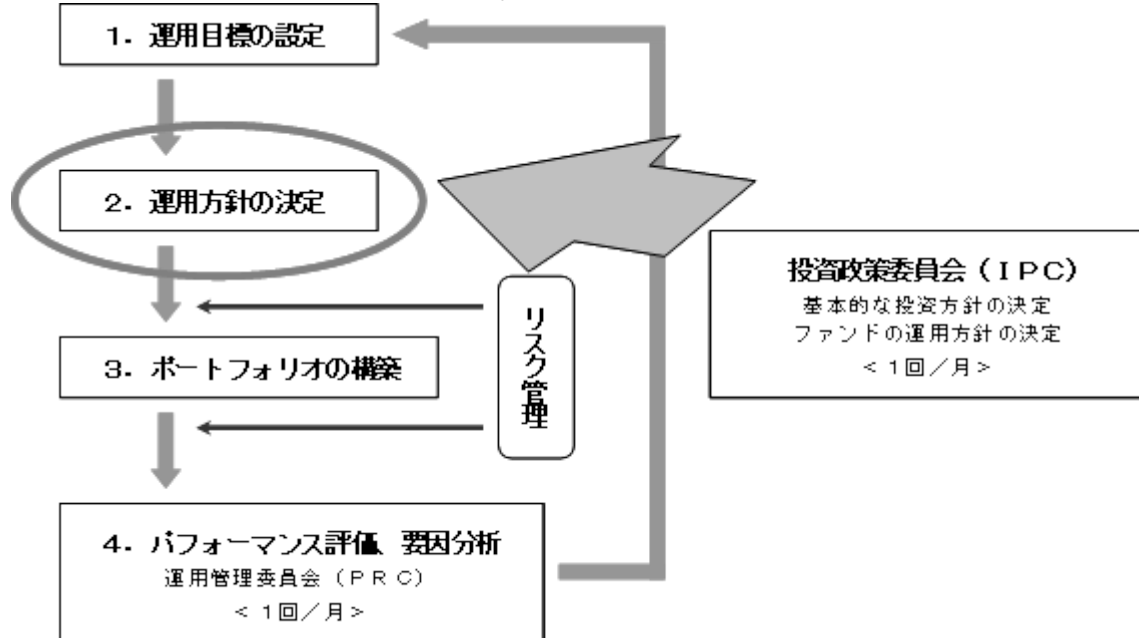
1. 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
  - (1) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条で定めるものをいいます。以下同じ。）
    - 有価証券
    - デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限りません。）
    - 金銭債権（ に掲げるものに該当するものを除きます。）
    - 約束手形（金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。）
  - (2) 次に掲げる特定資産以外の資産  
為替手形
2. 委託会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



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

### (3) 【運用体制】

当ファンドの運用体制は以下の通りです。



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

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

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

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

（上記の体制や人員等については、2023年1月末日現在）

#### (4)【配分方針】

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

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

信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

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

計算期末において信託財産に損失が生じた場合は、次期に繰越します。

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

#### (5)【投資制限】

運用の基本方針に基づく制限（約款別紙「運用の基本方針」）

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

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

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

投資する株式等の範囲(約款第19条)

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

信用取引(約款第21条)

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

先物取引等(約款第22条)

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

スワップ取引(約款第23条)

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

金利先渡取引および為替先渡取引(約款第24条)

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

デリバティブ取引等に係る投資制限(約款第24条の2)

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

## 有価証券の貸付（約款第25条）

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

## 有価証券の空売（約款第26条）

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

## 有価証券の借入（約款第27条）

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

## 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第28条）

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

## 外国為替予約取引（約款第29条）

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

## 信用リスク集中回避のための投資制限（約款第29条の2）

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

## 資金の借入（約款第35条）

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

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

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

### 3【投資リスク】

#### 1．投資リスク

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

##### (1) 価格変動リスク

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

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

投資信託は預貯金や保険と異なります。

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

##### 株価変動リスク

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

組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

##### 金利変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### REITの価格変動リスク

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

##### 流動性リスク

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

##### (2) デリバティブ取引のリスク

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

#### 2．その他の留意事項

##### (1) 一般的な留意事項

投資信託は、その商品性格から次の特徴をご理解のうえご購入ください。

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

##### (2) 法令・税制・会計等の変更可能性

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

##### (3) その他の留意点

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

一部解約金、収益分配金および償還金の支払は全て販売会社を通じて行われます。

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

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

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

当ファンドは、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。

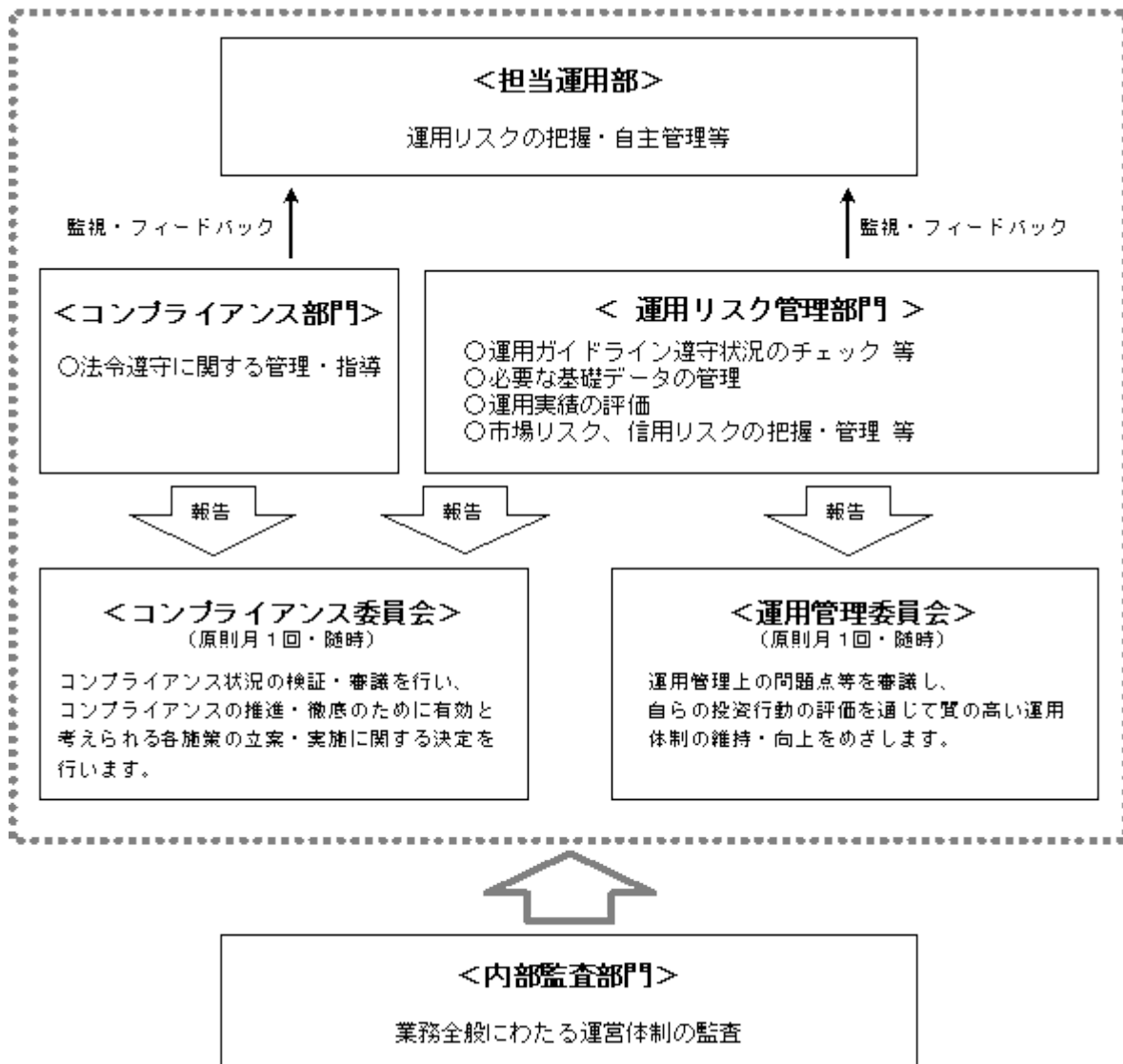
### 3. 管理体制

#### <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

2018年2月～2023年1月

ファンドの年間騰落率および  
分配金再投資基準価額の推移

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

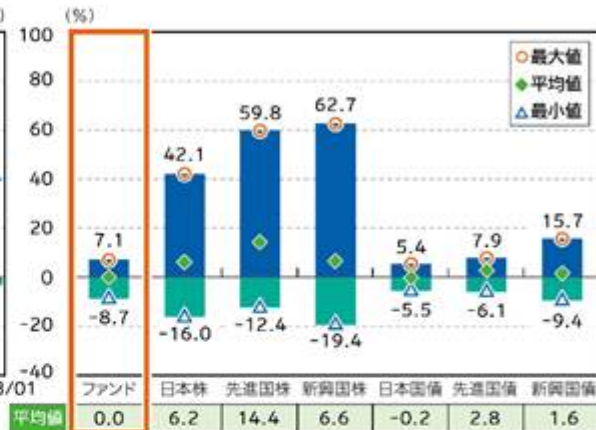


※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものと計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。

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

ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

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



※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

※ファンドは2018年10月以降の年間騰落率を用いています。

## 代表的な資産クラスと指数名

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

## 指数について

●TOPIXの指数値およびTOPIXにかかる標準または商標は、株式会社J P X 総研または株式会社J P X 総研の関連会社（以下、J P X といいます。）の知的財産であり、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・ノウハウおよびTOPIXにかかる標準または商標に関するすべての権利はJ P X が有します。J P X は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P X は責任を負いません。 ●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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。 ●FTSE世界国債インデックスは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 ●JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

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

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

申込時の手数料はありません。

### (2)【換金（解約）手数料】

換金時（解約時）の手数料はありません。

### (3)【信託報酬等】

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

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

信託報酬の配分（税抜）については以下の通りとします。

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

\*1 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価

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

\*3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

### (4)【その他の手数料等】

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用であり、毎日、純資産総額に対し、年率0.011%（税抜0.01%）を乗じて得た金額（ただし、年99万円（税抜90万円）の1日分相当額を上限とします。）を計上し、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

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

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

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

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

### (5)【課税上の取扱い】

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

#### < 個人の受益者に対する課税 >

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315% および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。申告不要制度の適用がありますが、総合課税または申告分離課税を選択することも可能です。いずれの場合も配当控除の適用はありません。申告分離課税を選択した場合の税率は、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。収益分配金のうち課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）（1）は課税されません。

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

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

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

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

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

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

#### < 法人の受益者に対する課税 >

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

#### < 確定拠出年金に対する課税 >

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

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

\* 上記は、2023年1月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容等が変更される場合があります。

## 5【運用状況】

以下は2023年1月31日現在の運用状況です。

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

### (1)【投資状況】

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	179,904,589	82.23
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		38,858,277	17.76
合計（純資産総額）		218,762,866	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	41,250,747,460	97.57
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		1,024,221,341	2.42
合計（純資産総額）		42,274,968,801	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	1,027,260,000	2.42

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

#### TMA日本債券インデックスマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	23,787,030,690	90.35
地方債証券	日本	1,227,963,400	4.66
特殊債券	日本	199,723,000	0.75
社債券	日本	1,134,440,961	4.30
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		24,255,356	0.09
合計（純資産総額）		26,324,902,695	100.00

#### 東京海上・東証REITマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	11,782,621,550	96.83
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		385,640,397	3.16
合計（純資産総額）		12,168,261,947	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	321,166,500	2.63

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

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## a. 主要銘柄の明細

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	TMA日本債券インデックス マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	124,874,229	1.2321	153,869,647	1.2243	152,883,518	69.88
2	TMA日本株TOPIXマ ザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	7,903,479	1.7783	14,054,763	1.7737	14,018,400	6.40
3	東京海上・東証REITマ ザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	9,488,923	1.3739	13,036,943	1.3703	13,002,671	5.94

## 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	82.23
合計	82.23

## 【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	793,400	2,051.45	1,627,624,919	1,896.50	1,504,683,100	3.55
2	ソニーグループ	日本	電気機器	株式	102,700	12,280.36	1,261,193,053	11,580.00	1,189,266,000	2.81
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	906,100	797.45	722,569,445	952.70	863,241,470	2.04
4	キーエンス	日本	電気機器	株式	14,500	54,329.52	787,778,040	59,280.00	859,560,000	2.03
5	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	185,700	3,645.72	677,011,857	3,892.00	722,744,400	1.70
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	103,600	4,155.35	430,494,608	5,652.00	585,547,200	1.38
7	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	127,700	3,612.78	461,352,039	4,090.00	522,293,000	1.23
8	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	84,600	5,098.05	431,295,030	6,144.00	519,782,400	1.22
9	任天堂	日本	その他製品	株式	92,100	6,158.24	567,173,904	5,625.00	518,062,500	1.22
10	第一三共	日本	医薬品	株式	125,800	2,624.00	330,099,802	4,064.00	511,251,200	1.20
11	日立製作所	日本	電気機器	株式	74,000	5,973.62	442,047,880	6,782.00	501,868,000	1.18
12	信越化学工業	日本	化学	株式	24,900	18,278.21	455,127,429	19,075.00	474,967,500	1.12
13	東京エレクトロン	日本	電気機器	株式	10,300	57,413.49	591,358,947	45,170.00	465,251,000	1.10
14	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	111,000	5,280.77	586,165,470	4,144.00	459,984,000	1.08
15	KDDI	日本	情報・通信業	株式	113,000	4,128.28	466,495,640	4,059.00	458,667,000	1.08
16	HOYA	日本	精密機器	株式	31,300	13,731.69	429,802,197	14,200.00	444,460,000	1.05
17	三井物産	日本	卸売業	株式	113,200	3,327.63	376,687,716	3,820.00	432,424,000	1.02
18	三菱商事	日本	卸売業	株式	96,700	4,558.46	440,803,082	4,336.00	419,291,200	0.99
19	みずほフィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	204,200	1,627.60	332,356,600	2,027.50	414,015,500	0.97
20	伊藤忠商事	日本	卸売業	株式	95,400	4,069.09	388,191,186	4,183.00	399,058,200	0.94
21	ダイキン工業	日本	機械	株式	17,600	22,900.50	403,048,800	22,470.00	395,472,000	0.93
22	東京海上ホールディングス	日本	保険業	株式	142,400	2,516.43	358,341,037	2,714.00	386,473,600	0.91
23	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	116,800	3,390.19	395,974,192	3,207.00	374,577,600	0.88
24	ソフトバンク	日本	情報・通信業	株式	236,300	1,513.28	357,588,064	1,486.50	351,259,950	0.83
25	オリエンタルランド	日本	サービス業	株式	15,900	22,970.75	365,234,925	21,580.00	343,122,000	0.81
26	セブン&アイ・ホールディングス	日本	小売業	株式	53,600	5,593.56	299,814,816	6,127.00	328,407,200	0.77
27	村田製作所	日本	電気機器	株式	44,200	8,011.42	354,104,813	7,394.00	326,814,800	0.77
28	ファナック	日本	電気機器	株式	14,200	21,236.84	301,563,188	22,905.00	325,251,000	0.76
29	S M C	日本	機械	株式	4,700	66,589.18	312,969,168	65,350.00	307,145,000	0.72
30	富士通	日本	電気機器	株式	14,800	17,723.71	262,310,950	18,510.00	273,948,000	0.64

## TMA日本債券インデックスマザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	額面	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
							単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	第146回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2025/12/20	375,000,000	100.48	376,807,500	100.24	375,915,000	1.42
2	第357回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2029/12/20	339,000,000	99.39	336,948,660	98.02	332,297,970	1.26

3	第144回利付国債 (5年)	日本	国債証券	0.100	2025/06/20	330,000,000	100.40	331,333,200	100.22	330,745,800	1.25
4	第143回利付国債 (5年)	日本	国債証券	0.100	2025/03/20	319,000,000	100.35	320,124,550	100.23	319,746,460	1.21
5	第142回利付国債 (5年)	日本	国債証券	0.100	2024/12/20	309,000,000	100.31	309,978,450	100.23	309,726,150	1.17
6	第147回利付国債 (5年)	日本	国債証券	0.005	2026/03/20	308,000,000	100.15	308,464,040	99.93	307,805,960	1.16
7	第145回利付国債 (5年)	日本	国債証券	0.100	2025/09/20	306,000,000	100.41	307,274,180	100.23	306,722,160	1.16
8	第348回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2027/09/20	290,000,000	100.16	290,490,100	99.74	289,266,300	1.09
9	第354回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2029/03/20	291,000,000	99.69	290,120,670	98.70	287,237,370	1.09
10	第358回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2030/03/20	288,000,000	99.23	285,802,280	97.85	281,813,760	1.07
11	第148回利付国債 (5年)	日本	国債証券	0.005	2026/06/20	281,000,000	100.16	281,455,220	99.88	280,665,610	1.06
12	第347回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2027/06/20	280,000,000	100.27	280,770,000	99.84	279,571,600	1.06
13	第149回利付国債 (5年)	日本	国債証券	0.005	2026/09/20	280,000,000	100.08	280,247,800	99.80	279,440,000	1.06
14	第355回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2029/06/20	278,000,000	99.54	276,727,210	98.47	273,746,600	1.03
15	第350回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2028/03/20	274,000,000	100.07	274,216,460	99.41	272,399,840	1.03
16	第153回利付国債 (5年)	日本	国債証券	0.005	2027/06/20	270,000,000	99.63	269,018,520	99.43	268,469,100	1.01
17	第359回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2030/06/20	275,000,000	99.08	272,477,660	97.43	267,932,500	1.01
18	第362回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2031/03/20	277,000,000	98.67	273,329,980	96.64	267,714,960	1.01
19	第364回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2031/09/20	272,000,000	98.62	268,250,460	96.25	261,802,720	0.99
20	第356回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2029/09/20	263,000,000	99.60	261,967,180	98.25	258,402,760	0.98
21	第366回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.200	2032/03/20	265,000,000	99.50	263,700,600	97.12	257,383,900	0.97
22	第349回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2027/12/20	258,000,000	100.12	258,309,600	99.58	256,937,040	0.97
23	第360回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2030/09/20	262,000,000	98.90	259,129,450	97.13	254,480,600	0.96
24	第368回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.200	2032/09/20	253,000,000	99.58	251,959,470	99.71	252,284,010	0.95
25	第352回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2028/09/20	254,000,000	99.97	253,923,800	99.08	251,673,360	0.95
26	第141回利付国債 (5年)	日本	国債証券	0.100	2024/09/20	250,000,000	100.28	250,706,400	100.21	250,530,000	0.95
27	第351回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2028/06/20	252,000,000	100.02	252,068,040	99.25	250,125,120	0.95

28	第361回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2030/12/20	258,000,000	98.92	255,229,080	96.85	249,888,480	0.94
29	第363回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2031/06/20	258,000,000	98.56	254,296,050	96.43	248,797,140	0.94
30	第346回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2027/03/20	234,000,000	100.34	234,811,980	99.95	233,901,720	0.88

## 東京海上・東証REITマザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	1,343	566,000.00	760,138,000	567,000.00	761,481,000	6.25
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	1,151	560,000.00	644,560,000	557,000.00	641,107,000	5.26
3	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	5,810	100,100.00	581,581,000	100,300.00	582,743,000	4.78
4	日本プロロジスリート投資法人	日本	投資証券	1,941	292,500.00	567,742,500	294,300.00	571,236,300	4.69
5	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	投資証券	3,724	153,200.00	570,516,800	151,900.00	565,675,600	4.64
6	GLP投資法人	日本	投資証券	3,716	144,200.00	535,847,200	146,700.00	545,137,200	4.47
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	1,736	280,100.00	486,253,600	282,800.00	490,940,800	4.03
8	オリックス不動産投資法人	日本	投資証券	2,294	179,000.00	410,626,000	178,700.00	409,937,800	3.36
9	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	2,576	149,800.00	385,884,800	147,800.00	380,732,800	3.12
10	アドバンス・レジデンス投資法人	日本	投資証券	1,151	326,500.00	375,801,500	317,500.00	365,442,500	3.00
11	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	3,713	85,700.00	318,204,100	82,200.00	305,208,600	2.50
12	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	5,068	56,000.00	283,808,000	55,300.00	280,260,400	2.30
13	日本プライムリアルティ投資法人	日本	投資証券	787	357,500.00	281,352,500	352,000.00	277,024,000	2.27
14	産業ファンド投資法人	日本	投資証券	1,721	147,400.00	253,675,400	143,900.00	247,651,900	2.03
15	積水ハウス・リート投資法人	日本	投資証券	3,460	71,400.00	247,044,000	71,000.00	245,660,000	2.01
16	アクティビア・プロパティーズ投資法人	日本	投資証券	608	391,000.00	237,728,000	389,000.00	236,512,000	1.94
17	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	398	579,000.00	230,442,000	583,000.00	232,034,000	1.90
18	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	776	301,000.00	233,576,000	296,100.00	229,773,600	1.88
19	ラサールロジポート投資法人	日本	投資証券	1,410	156,600.00	220,806,000	157,300.00	221,793,000	1.82
20	フロンティア不動産投資法人	日本	投資証券	427	503,000.00	214,781,000	501,000.00	213,927,000	1.75
21	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	670	312,500.00	209,375,000	308,500.00	206,695,000	1.69
22	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	日本	投資証券	455	449,500.00	204,522,500	453,500.00	206,342,500	1.69
23	森ヒルズリート投資法人	日本	投資証券	1,354	151,300.00	204,860,200	147,600.00	199,850,400	1.64
24	イオンリート投資法人	日本	投資証券	1,275	147,200.00	187,680,000	143,600.00	183,090,000	1.50
25	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	1,596	109,000.00	173,964,000	108,700.00	173,485,200	1.42
26	ヒューリックリート投資法人	日本	投資証券	1,077	154,400.00	166,288,800	155,200.00	167,150,400	1.37
27	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	844	198,400.00	167,449,600	193,600.00	163,398,400	1.34
28	三菱地所物流リート投資法人	日本	投資証券	396	403,500.00	159,786,000	408,500.00	161,766,000	1.32
29	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	536	294,400.00	157,798,400	288,900.00	154,850,400	1.27
30	東急リアル・エステート投資法人	日本	投資証券	772	199,900.00	154,322,800	195,800.00	151,157,600	1.24

## b. 投資有価証券の種類

## TMA日本株TOPIXマザーファンド

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
----	-------	----	---------



株式	国内		
		水産・農林業	0.08
		鉱業	0.29
		建設業	1.89
		食料品	3.35
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.17
		化学	6.03
		医薬品	5.25
		石油・石炭製品	0.47
		ゴム製品	0.67
		ガラス・土石製品	0.68
		鉄鋼	0.84
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.58
		機械	5.07
		電気機器	16.96
		輸送用機器	7.28
		精密機器	2.58
		その他製品	2.26
		電気・ガス業	1.19
		陸運業	2.84
		海運業	0.59
		空運業	0.48
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	8.52
		卸売業	5.76
		小売業	4.54
		銀行業	6.46
		証券、商品先物取引業	0.77
		保険業	2.34
		その他金融業	1.11
		不動産業	1.86
		サービス業	5.12
合 計			97.57

## TMA日本債券インデックスマザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	90.35
地方債証券	4.66
特殊債券	0.75
社債券	4.30
合 計	100.09

## 東京海上・東証REITマザーファンド

種類	投資比率(%)
投資証券	96.83
合 計	96.83

## 投資不動産物件

TMA日本株TOPIXマザーファンド  
該当事項はありません。

TMA日本債券インデックスマザーファンド  
該当事項はありません。

東京海上・東証REITマザーファンド  
該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

## TMA日本株TOPIXマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/ 売建	数量 (枚)	帳簿価額	評価額(円)	投資 比率(%)
株価指数先物取引	日本	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	52	997,549,200.00	1,027,260,000	2.42

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

## TMA日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

## 東京海上・東証REITマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/ 売建	数量 (枚)	帳簿価額	評価額(円)	投資 比率(%)
株価指数先物取引	日本	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	177	322,051,500.00	321,166,500	2.63

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

## (3)【運用実績】

## 【純資産の推移】

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1計算期間末	(2018年 1月25日)	1	1	1.0294	1.0294
第2計算期間末	(2019年 1月25日)	4	4	1.0243	1.0243
第3計算期間末	(2020年 1月27日)	44	44	1.0829	1.0829
第4計算期間末	(2021年 1月25日)	76	76	1.0180	1.0180
第5計算期間末	(2022年 1月25日)	134	134	1.0267	1.0267
第6計算期間末	(2023年 1月25日)	218	218	1.0010	1.0010
2022年 1月末日		136		1.0286	
2月末日		136		1.0207	
3月末日		141		1.0308	
4月末日		147		1.0253	
5月末日		157		1.0263	
6月末日		176		1.0159	
7月末日		184		1.0258	
8月末日		188		1.0259	
9月末日		202		1.0093	
10月末日		207		1.0140	
11月末日		209		1.0124	
12月末日		214		0.9975	
2023年 1月末日		218		0.9960	

## 【分配の推移】

該当事項はありません。

## 【収益率の推移】

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第1計算期間	2017年10月11日～2018年 1月25日	2.9
第2計算期間	2018年 1月26日～2019年 1月25日	0.5
第3計算期間	2019年 1月26日～2020年 1月27日	5.7
第4計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	6.0
第5計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	0.9
第6計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	2.5

## (4) 【設定及び解約の実績】

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2017年10月11日～2018年 1月25日	1,081,855		1,081,855
第2計算期間	2018年 1月26日～2019年 1月25日	3,969,342	218,643	4,832,554
第3計算期間	2019年 1月26日～2020年 1月27日	48,695,808	12,789,758	40,738,604
第4計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	60,312,399	26,011,910	75,039,093
第5計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	106,661,951	50,413,953	131,287,091
第6計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	123,183,694	36,463,073	218,007,712

## &lt; 参考情報 &gt;

基準日：2023年1月31日

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。  
※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2017年10月11日です。

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第2期	2019/01/25	0円
第3期	2020/01/27	0円
第4期	2021/01/25	0円
第5期	2022/01/25	0円
第6期	2023/01/25	0円
設定来累計		分配実績なし

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

## 主要な資産の状況

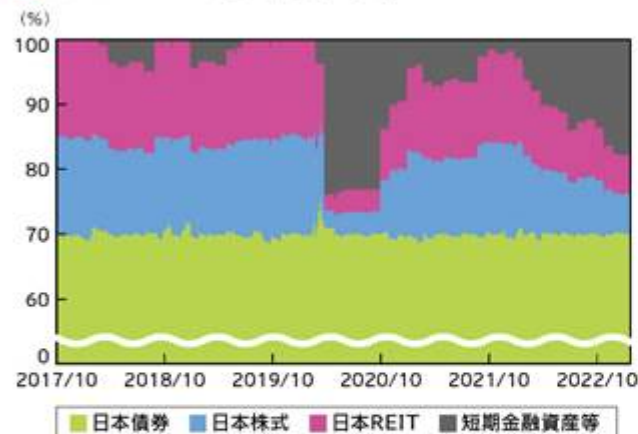
## 各マザーファンド組入比率、騰落率

マザーファンド	組入比率	基本資産 配分	差	騰落率				
				1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年
日本債券	69.9%	70.0%	-0.1%	-0.28%	-2.04%	-3.40%	-4.78%	-6.71%
日本株式	6.4%	15.0%	-8.6%	+4.40%	+2.61%	+3.28%	+7.16%	+26.39%
日本REIT	5.9%	15.0%	-9.1%	-3.17%	-6.58%	-7.86%	-2.50%	-7.56%
短期金融資産等	17.8%	-	+17.8%					

※比率は、純資産総額に占める割合です。

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

## 各マザーファンド組入比率の推移



※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

## 各マザーファンドの組入上位銘柄

## TMA日本債券インデックスマザーファンド

	銘柄	クーポン	比率
1	第146回利付国債(5年)	0.100%	1.4%
2	第357回利付国債(10年)	0.100%	1.3%
3	第144回利付国債(5年)	0.100%	1.3%

## TMA日本株TOPIXマザーファンド

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.6%
2	ソニーグループ	2.8%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.0%

## 東京海上・東証REITマザーファンド

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	6.3%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.3%
3	日本都市ファンド投資法人	4.8%

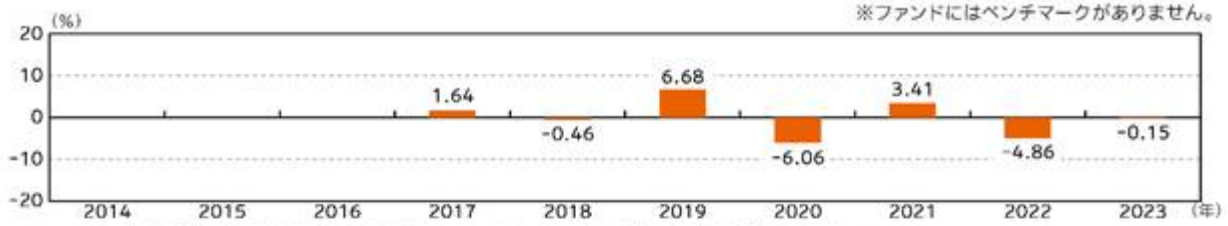
※比率は、各マザーファンドの純資産総額に占める割合です。

次ページへ続く

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

基準日:2023年1月31日

## 年間収益率の推移



※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しており、設定日以降を表示しています。

※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

- a. 受益者は、自己に帰属する受益権につき、一部解約の実行請求（解約請求）の方法によりご換金の請求を行うことができます。
- b. ご換金のお申込みは販売会社で受け付けます。なお、販売会社の買取りによるご換金の請求については、販売会社にお問い合わせください。
- c. 解約請求による換金のお申込みは、毎営業日に行うことができます。
- d. 解約単位は、販売会社やお申込みのコース等によって異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- e. 解約請求のお申込みの受付は、原則として午後3時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みは翌営業日受付としてお取り扱いします。
- f. 解約時の価額（解約価額）は、解約請求受付日の基準価額とします。  
信託財産留保額はありません。  
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、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよび既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日を解約請求受付日とする解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にその請求を受け付けたものとして取扱います。
- k. 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口解約には制限を設ける場合があります。ただし、確定拠出年金制度に基づく受益者である場合には制限はありません。
- 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。
公社債等	原則として、以下のいずれかの価額で評価します。 a. 日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値） b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く） c. 価格情報会社の提供する価額

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

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

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

#### (4)【計算期間】

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

#### (5)【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

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

#### 信託約款の変更

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

#### 関係会社との契約の更改等

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

#### 運用報告書

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

#### 公告

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

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

#### 4【受益者の権利等】

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

##### 収益分配金の請求権

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

##### 償還金の請求権

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

##### 換金（解約）請求権

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

##### 買取請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、第6期計算期間(2022年1月26日から2023年1月25日まで)の財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【東京海上・円資産インデックスバランスファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 [2022年 1月25日現在]	第6期 [2023年 1月25日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,753,852	38,666,783
親投資信託受益証券	131,040,022	179,647,928
未収入金	428,130	490,240
流動資産合計	135,222,004	218,804,951
資産合計		
	135,222,004	218,804,951
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	157,302	133,212
未払受託者報酬	13,825	22,615
未払委託者報酬	248,763	406,932
未払利息	3	18
その他未払費用	6,840	11,213
流動負債合計	426,733	573,990
負債合計		
	426,733	573,990
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	131,287,091	218,007,712
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,508,180	223,249
（分配準備積立金）	1,263,007	1,993,620
元本等合計	134,795,271	218,230,961
純資産合計		
	134,795,271	218,230,961
負債純資産合計		
	135,222,004	218,804,951

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	第6期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1	114
有価証券売買等損益	185,618	4,304,949
営業収益合計	185,619	4,304,835
<b>営業費用</b>		
支払利息	1,307	10,157
受託者報酬	24,023	39,214
委託者報酬	432,247	705,646
その他費用	11,843	19,415
営業費用合計	469,420	774,432
営業利益又は営業損失（ ）	283,801	5,079,267
経常利益又は経常損失（ ）	283,801	5,079,267
当期純利益又は当期純損失（ ）	283,801	5,079,267
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（ ）	884,731	246,201
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,347,270	3,508,180
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,732,242	2,491,228
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,732,242	2,491,228
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,402,800	943,093
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,402,800	943,093
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,508,180	223,249

## (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6期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第5期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	第6期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25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。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期 [2022年 1月25日現在]	第6期 [2023年 1月25日現在]
1. 1 期首元本額	75,039,093円	131,287,091円
期中追加設定元本額	106,661,951円	123,183,694円
期中一部解約元本額	50,413,953円	36,463,073円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	131,287,091口	218,007,712口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	第6期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
<p>1 分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（742,805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（7,781,065円）及び分配準備積立金（520,202円）より、分配対象額は9,044,072円（1万口当たり688.86円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>1 分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（982,742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（14,064,167円）及び分配準備積立金（1,010,878円）より、分配対象額は16,057,787円（1万口当たり736.55円）であります。分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

区 分	第5期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	第6期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

## ・金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期 [2022年 1月25日現在]	第6期 [2023年 1月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。  (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。	(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 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	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つた場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

第5期（自 2021年1月26日 至 2022年1月25日）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	740,268円
合計	740,268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6期（自 2022年1月26日 至 2023年1月25日）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,996,244円
合計	2,996,244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5期 [2022年 1月25日現在]		第6期 [2023年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0267円 (10,267円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0010円 (10,010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	T M A日本株T O P I Xマザーファンド	7,844,364	13,950,416	
	T M A日本債券インデックスマザーファンド	123,940,209	152,756,307	
	東京海上・東証R E I Tマザーファンド	9,417,950	12,941,205	
親投資信託受益証券 合計		141,202,523	179,647,928	
合計		141,202,523	179,647,928	

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

（ご参考）

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

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	[2022年 1月25日現在]	[2023年 1月25日現在]
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,684,192,024	1,078,615,211
株式	2	37,625,910,930	41,363,773,320
派生商品評価勘定			33,155,700
未収配当金		53,245,514	67,065,375
前払金		50,585,000	
流動資産合計		39,413,933,468	42,542,609,606
資産合計		39,413,933,468	42,542,609,606
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		82,000,700	
前受金			29,504,000
未払解約金		57,624,581	92,999,979
未払利息		1,781	523
流動負債合計		139,627,062	122,504,502
負債合計		139,627,062	122,504,502
純資産の部			
元本等			
元本	1	23,726,938,838	23,852,460,915
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		15,547,367,568	18,567,644,189
元本等合計		39,274,306,406	42,420,105,104
純資産合計		39,274,306,406	42,420,105,104
負債純資産合計		39,413,933,468	42,542,609,606

## (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 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25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。	同左

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	[2022年 1月25日現在]	[2023年 1月25日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	23,205,064,108円	23,726,938,838円
同期中における追加設定元本額	10,647,555,407円	5,866,161,102円
同期中における一部解約元本額	10,125,680,677円	5,740,639,025円
同期末における元本額	23,726,938,838円	23,852,460,915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 >	97,698,496円	36,060,550円
円資産バランスファンド2019 - 05 < 適格機関投資家限定 >	356,829,745円	131,700,571円
円資産バランスファンド2019 - 09 < 適格機関投資家限定 >	263,486,331円	97,231,433円
円資産バランスファンド2019 - 12 < 適格機関投資家限定 >	362,049,570円	133,598,486円
東京海上セレクション・日本株 T O P I X	15,780,191,330円	16,706,542,164円
東京海上・円資産インデックスバランス ファンド	10,832,087円	7,844,364円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035	137,306,023円	324,325,891円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	70,755,058円	176,536,831円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	46,416,303円	111,856,787円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	98,180,784円	195,274,138円
TMA日本株式インデックスVA<適格機関投資家限定>	609,512,309円	777,803,719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>	199,901,079円	269,737,004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>	1,325,201,502円	1,771,350,438円
東京海上・TOPIXインデックスファンド<適格機関投資家限定>	4,071,292,052円	2,895,680,866円
円資産バランスオープン<適格機関投資家 限定>	223,319,366円	82,378,826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）	73,966,803円	134,538,847円
計	23,726,938,838円	23,852,460,915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	23,726,938,838口	23,852,460,915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 873,030,000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 860,160,000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 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び 投資法人に関する法律」（昭和 26年法律第198号）第2条第4項 に定める証券投資信託であり、 有価証券等の金融商品への投資 を信託約款に定める「運用の基 本方針」に基づき行なっており ます。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融 商品は「重要な会計方針に係る 事項に関する注記」の「有価証 券の評価基準及び評価方法」に 記載の有価証券及びデリバティ ブ取引であります。デリバティ ブ取引には、先物取引が含まれ ております。当該有価証券及び デリバティブ取引には、性質に 応じてそれぞれ価格変動リス ク、流動性リスク、信用リス ク等があります。	同左

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

・ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2022年 1月25日現在]	[2023年 1月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>

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

## (有価証券に関する注記)

(自 2021年1月26日 至 2022年1月25日)

## 売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,620,082,033円
合計	1,620,082,033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2022年1月25日まで)を指しております。

(自 2022年1月26日 至 2023年1月25日)

## 売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,108,736,452円
合計	1,108,736,452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(2022年3月23日から2023年1月25日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

(2022年1月25日現在)

(単位：円)

区 分	種 類	契約額等	うち 1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,727,945,000		1,646,040,000	81,905,000
	東証株価指数先物	1,727,945,000		1,646,040,000	81,905,000
合 計		1,727,945,000		1,646,040,000	81,905,000

(2023年1月25日現在)

(単位:円)

区 分	種 類	契約額等	うち	時 価	評価損益
			1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,015,921,000		1,049,135,000	33,214,000
	東証株価指数先物	1,015,921,000		1,049,135,000	33,214,000
	合 計	1,015,921,000		1,049,135,000	33,214,000

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

[2022年 1月25日現在]		[2023年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6553円 16,553円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7784円 17,784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	
ニッセイ	20,500	531.00	10,885,500	
マルハニチロ	3,300	2,432.00	8,025,600	
サカタのタネ	2,600	4,055.00	10,543,000	
ホクト	2,600	1,881.00	4,890,600	
I N P E X	73,900	1,472.00	108,780,800	
石油資源開発	2,900	4,275.00	12,397,500	
K & Oエナジーグループ	3,000	2,010.00	6,030,000	
ショーボンドホールディングス	2,600	5,360.00	13,936,000	
ミライト・ワン	5,900	1,579.00	9,316,100	
ベステラ	4,900	981.00	4,806,900	
安藤・間	12,900	860.00	11,094,000	
東急建設	10,700	658.00	7,040,600	
コムシスホールディングス	7,100	2,411.00	17,118,100	
東建コーポレーション	800	7,840.00	6,272,000	
ヤマウラ	4,800	1,055.00	5,064,000	
オリエンタル白石	21,700	308.00	6,683,600	
大成建設	13,700	4,470.00	61,239,000	
大林組	47,500	992.00	47,120,000	
清水建設	44,500	717.00	31,906,500	
長谷工コーポレーション	14,300	1,486.00	21,249,800	



鹿島建設	33,900	1,566.00	53,087,400
西松建設	3,300	4,045.00	13,348,500
三井住友建設	13,600	418.00	5,684,800
奥村組	2,700	3,015.00	8,140,500
東鉄工業	2,900	2,669.00	7,740,100
戸田建設	19,900	706.00	14,049,400
熊谷組	2,700	2,650.00	7,155,000
東亜建設工業	2,800	2,474.00	6,927,200
五洋建設	20,900	644.00	13,459,600
住友林業	11,400	2,400.00	27,360,000
日本基礎技術	5,800	530.00	3,074,000
大和ハウス工業	39,400	3,117.00	122,809,800
積水ハウス	46,300	2,499.50	115,726,850
北陸電気工事	4,800	689.00	3,307,200
中電工	2,400	2,109.00	5,061,600
関電工	7,000	859.00	6,013,000
きんでん	7,900	1,420.00	11,218,000
日本電設工業	4,400	1,609.00	7,079,600
エクシオグループ	6,700	2,319.00	15,537,300
新日本空調	2,800	1,918.00	5,370,400
九電工	2,800	3,350.00	9,380,000
三機工業	4,200	1,533.00	6,438,600
日揮ホールディングス	15,800	1,714.00	27,081,200
中外炉工業	2,200	1,711.00	3,764,200
ヤマト	6,500	729.00	4,738,500
高砂熱学工業	4,900	1,820.00	8,918,000
三晃金属工業	1,400	3,490.00	4,886,000
大気社	2,400	3,505.00	8,412,000
日比谷総合設備	3,600	1,981.00	7,131,600
インフロニア・ホールディングス	16,200	1,035.00	16,767,000
レイズネクスト	5,700	1,315.00	7,495,500
ニッポン	4,000	1,607.00	6,428,000
日清製粉グループ本社	16,000	1,620.00	25,920,000
鳥越製粉	6,000	588.00	3,528,000
日本甜菜製糖	1,500	1,653.00	2,479,500
D M三井製糖ホールディングス	3,700	2,001.00	7,403,700
森永製菓	3,400	3,790.00	12,886,000
江崎グリコ	4,100	3,545.00	14,534,500
山崎製パン	11,500	1,508.00	17,342,000
亀田製菓	1,900	4,290.00	8,151,000
寿スピリッツ	1,700	8,480.00	14,416,000
カルビー	7,600	2,929.00	22,260,400
森永乳業	2,800	4,745.00	13,286,000
ヤクルト本社	10,300	9,310.00	95,893,000
明治ホールディングス	8,800	6,700.00	58,960,000

雪印メグミルク	2,900	1,783.00	5,170,700
プリマハム	2,400	2,148.00	5,155,200
日本ハム	4,800	3,780.00	18,144,000
丸大食品	3,000	1,461.00	4,383,000
S Foods	2,400	2,861.00	6,866,400
伊藤ハム米久ホールディングス	10,600	705.00	7,473,000
サッポロホールディングス	5,200	3,070.00	15,964,000
アサヒグループホールディングス	32,200	4,296.00	138,331,200
キリンホールディングス	62,800	1,994.50	125,254,600
宝ホールディングス	11,600	1,051.00	12,191,600
オエノンホールディングス	11,800	255.00	3,009,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	9,500	1,348.00	12,806,000
サントリー食品インターナショナル	9,400	4,360.00	40,984,000
ダイドーグループホールディングス	1,200	4,760.00	5,712,000
伊藤園	4,900	4,155.00	20,359,500
キーコーヒー	3,700	2,099.00	7,766,300
ユニカフェ	3,600	896.00	3,225,600
ジャパンフーズ	3,800	1,077.00	4,092,600
日清オイリオグループ	2,000	3,140.00	6,280,000
不二製油グループ本社	3,100	2,019.00	6,258,900
J-オイルミルズ	4,400	1,557.00	6,850,800
キッコーマン	9,800	6,840.00	67,032,000
味の素	34,100	4,262.00	145,334,200
キューピー	8,300	2,213.00	18,367,900
ハウス食品グループ本社	5,000	2,737.00	13,685,000
カゴメ	5,600	3,075.00	17,220,000
アリアケジャパン	1,800	4,240.00	7,632,000
ニチレイ	6,500	2,685.00	17,452,500
東洋水産	7,500	5,150.00	38,625,000
日清食品ホールディングス	5,200	10,090.00	52,468,000
フジッコ	3,600	1,893.00	6,814,800
ロック・フィールド	3,300	1,569.00	5,177,700
日本たばこ産業	92,700	2,675.50	248,018,850
ユーグレナ	13,600	999.00	13,586,400
片倉工業	2,400	1,756.00	4,214,400
グンゼ	1,300	4,175.00	5,427,500
東洋紡	5,900	1,014.00	5,982,600
倉敷紡績	3,000	2,205.00	6,615,000
日本毛織	6,400	959.00	6,137,600
帝国繊維	2,300	1,534.00	3,528,200
帝人	13,800	1,300.00	17,940,000
東レ	93,900	783.90	73,608,210
日本フエルト	8,000	410.00	3,280,000
セーレン	3,700	2,308.00	8,539,600

小松マテーレ	6,100	764.00	4,660,400
ワコールホールディングス	3,500	2,397.00	8,389,500
ホギメディカル	2,300	3,570.00	8,211,000
T S Iホールディングス	11,000	492.00	5,412,000
ゴールドウイン	2,400	9,670.00	23,208,000
デサント	3,400	3,195.00	10,863,000
特種東海製紙	1,600	2,870.00	4,592,000
王子ホールディングス	54,400	529.00	28,777,600
日本製紙	6,500	935.00	6,077,500
三菱製紙	1,800	281.00	505,800
北越コーポレーション	13,500	830.00	11,205,000
大王製紙	6,900	985.00	6,796,500
レンゴー	9,700	910.00	8,827,000
ザ・パック	1,900	2,530.00	4,807,000
クラレ	21,100	1,051.00	22,176,100
旭化成	92,700	952.70	88,315,290
共和レザー	5,800	517.00	2,998,600
レゾナック・ホールディングス	12,600	2,225.00	28,035,000
住友化学	108,100	491.00	53,077,100
日産化学	7,000	6,000.00	42,000,000
クレハ	1,000	8,510.00	8,510,000
石原産業	5,000	1,097.00	5,485,000
片倉コープアグリ	3,300	1,732.00	5,715,600
日本曹達	1,900	4,085.00	7,761,500
東ソー	19,300	1,622.00	31,304,600
トクヤマ	3,000	1,837.00	5,511,000
セントラル硝子	2,900	2,798.00	8,114,200
東亜合成	8,600	1,175.00	10,105,000
大阪ソーダ	1,900	4,180.00	7,942,000
デンカ	5,100	2,652.00	13,525,200
信越化学工業	24,900	17,475.00	435,127,500
堺化学工業	2,400	1,813.00	4,351,200
エア・ウォーター	13,600	1,557.00	21,175,200
日本酸素ホールディングス	13,200	2,096.00	27,667,200
日本パーカライジング	7,500	951.00	7,132,500
ステラ ケミファ	2,000	2,567.00	5,134,000
日本触媒	1,700	5,390.00	9,163,000
カネカ	3,300	3,340.00	11,022,000
三菱瓦斯化学	12,000	1,851.00	22,212,000
三井化学	12,200	3,055.00	37,271,000
J S R	14,800	2,946.00	43,600,800
東京応化工業	2,300	6,480.00	14,904,000
三菱ケミカルグループ	96,500	731.50	70,589,750
K Hネオケム	3,700	2,770.00	10,249,000
ダイセル	20,700	947.00	19,602,900

住友ベークライト	1,900	4,245.00	8,065,500
積水化学工業	29,500	1,919.00	56,610,500
日本ゼオン	11,900	1,320.00	15,708,000
アイカ工業	3,900	3,065.00	11,953,500
UBE	6,000	1,988.00	11,928,000
旭有機材	2,700	2,918.00	7,878,600
タイガースポリマー	7,200	405.00	2,916,000
ミライアル	3,000	1,543.00	4,629,000
日本化薬	9,000	1,181.00	10,629,000
ADEKA	6,600	2,136.00	14,097,600
日油	4,200	5,440.00	22,848,000
ハリマ化成グループ	4,700	837.00	3,933,900
花王	34,800	5,230.00	182,004,000
ニイタカ	2,300	1,966.00	4,521,800
三洋化成工業	1,100	4,180.00	4,598,000
日本ペイントホールディングス	62,600	1,194.00	74,744,400
関西ペイント	14,600	1,709.00	24,951,400
中国塗料	6,900	1,006.00	6,941,400
太陽ホールディングス	3,100	2,356.00	7,303,600
DIC	4,500	2,375.00	10,687,500
サカタインクス	6,600	1,071.00	7,068,600
東洋インキSCホールディングス	3,300	1,828.00	6,032,400
富士フイルムホールディングス	27,700	6,920.00	191,684,000
資生堂	29,800	6,484.00	193,223,200
ライオン	16,400	1,422.00	23,320,800
高砂香料工業	2,100	2,545.00	5,344,500
マンダム	4,100	1,420.00	5,822,000
ミルボン	1,700	5,590.00	9,503,000
ファンケル	6,600	2,656.00	17,529,600
コーセー	2,900	14,130.00	40,977,000
コタ	3,700	1,702.00	6,297,400
ポーラ・オルビスホールディングス	6,100	1,789.00	10,912,900
ノエビアホールディングス	1,000	5,610.00	5,610,000
エステー	3,300	1,582.00	5,220,600
長谷川香料	2,900	3,080.00	8,932,000
小林製薬	4,200	9,170.00	38,514,000
荒川化学工業	4,500	995.00	4,477,500
メック	2,700	2,475.00	6,682,500
タカラバイオ	4,900	1,745.00	8,550,500
JCU	2,700	3,185.00	8,599,500
デクセリアルズ	5,200	2,769.00	14,398,800
アース製薬	1,200	5,000.00	6,000,000
大成ラミック	1,700	3,000.00	5,100,000
クミアイ化学工業	8,600	860.00	7,396,000
日本農薬	8,800	697.00	6,133,600

日東電工	10,200	8,110.00	82,722,000
レック	6,400	998.00	6,387,200
前澤化成工業	4,200	1,372.00	5,762,400
エフピコ	2,600	3,445.00	8,957,000
天馬	2,500	2,201.00	5,502,500
信越ポリマー	5,000	1,235.00	6,175,000
ニフコ	5,300	3,315.00	17,569,500
バルカー	1,800	2,775.00	4,995,000
ユニ・チャーム	29,600	4,930.00	145,928,000
協和キリン	16,500	2,930.00	48,345,000
武田薬品工業	127,700	4,220.00	538,894,000
アステラス製薬	138,000	1,977.50	272,895,000
住友ファーマ	11,100	897.00	9,956,700
塩野義製薬	19,200	6,296.00	120,883,200
日本新薬	3,700	6,760.00	25,012,000
中外製薬	44,500	3,463.00	154,103,500
科研製薬	1,900	3,815.00	7,248,500
エーザイ	18,000	8,316.00	149,688,000
ロート製薬	16,200	2,332.00	37,778,400
小野薬品工業	29,200	2,921.50	85,307,800
久光製薬	4,100	3,965.00	16,256,500
持田製薬	1,900	3,450.00	6,555,000
参天製薬	26,800	1,022.00	27,389,600
ツムラ	4,300	2,753.00	11,837,900
キッセイ薬品工業	1,900	2,553.00	4,850,700
生化学工業	6,900	842.00	5,809,800
栄研化学	3,700	1,658.00	6,134,600
鳥居薬品	2,100	3,080.00	6,468,000
JCRファーマ	5,000	1,687.00	8,435,000
東和薬品	2,700	2,044.00	5,518,800
ゼリア新薬工業	4,000	2,180.00	8,720,000
第一三共	125,800	4,390.00	552,262,000
キョーリン製薬ホールディングス	4,000	1,716.00	6,864,000
大幸薬品	9,700	388.00	3,763,600
大塚ホールディングス	32,500	4,226.00	137,345,000
大正製薬ホールディングス	2,900	5,480.00	15,892,000
ペプチドリーム	8,000	2,069.00	16,552,000
あすか製薬ホールディングス	4,600	1,281.00	5,892,600
サワイグループホールディングス	2,700	3,935.00	10,624,500
ニチレキ	4,700	1,347.00	6,330,900
出光興産	16,200	3,375.00	54,675,000
ENEOSホールディングス	255,500	477.20	121,924,600
コスモエネルギーホールディングス	6,600	3,765.00	24,849,000
横浜ゴム	8,600	2,112.00	18,163,200
TOYO TIRE	7,900	1,524.00	12,039,600

ブリヂストン	45,800	4,876.00	223,320,800
住友ゴム工業	13,600	1,149.00	15,626,400
オカモト	1,300	3,835.00	4,985,500
ニッタ	2,000	2,833.00	5,666,000
住友理工	2,800	651.00	1,822,800
バンドー化学	6,800	1,019.00	6,929,200
日東紡績	2,700	2,020.00	5,454,000
A G C	14,100	4,735.00	66,763,500
日本山村硝子	4,800	538.00	2,582,400
日本電気硝子	5,200	2,418.00	12,573,600
住友大阪セメント	2,700	3,240.00	8,748,000
太平洋セメント	8,800	2,116.00	18,620,800
日本ヒューム	6,900	669.00	4,616,100
東海カーボン	12,800	1,121.00	14,348,800
東洋炭素	2,000	4,060.00	8,120,000
T O T O	9,600	5,040.00	48,384,000
日本碍子	16,800	1,764.00	29,635,200
日本特殊陶業	11,800	2,560.00	30,208,000
M A R U W A	700	17,630.00	12,341,000
フジインコーポレーテッド	1,700	6,810.00	11,577,000
ニチアス	3,600	2,437.00	8,773,200
ニチハ	1,900	2,735.00	5,196,500
日本製鉄	67,600	2,731.50	184,649,400
神戸製鋼所	26,500	692.00	18,338,000
J F Eホールディングス	37,800	1,713.00	64,751,400
東京製鐵	7,100	1,373.00	9,748,300
共英製鋼	3,500	1,400.00	4,900,000
大和工業	2,400	5,180.00	12,432,000
大阪製鐵	2,100	1,275.00	2,677,500
淀川製鋼所	2,200	2,732.00	6,010,400
丸一鋼管	4,900	2,827.00	13,852,300
大同特殊鋼	2,100	4,735.00	9,943,500
山陽特殊製鋼	3,000	2,436.00	7,308,000
愛知製鋼	1,100	2,304.00	2,534,400
大平洋金属	3,300	2,037.00	6,722,100
新日本電工	19,800	389.00	7,702,200
三菱製鋼	4,000	1,133.00	4,532,000
シンニッタン	12,500	235.00	2,937,500
日本軽金属ホールディングス	4,100	1,605.00	6,580,500
三井金属鉱業	4,100	3,395.00	13,919,500
東邦亜鉛	2,500	2,194.00	5,485,000
三菱マテリアル	9,500	2,235.00	21,232,500
住友金属鉱山	18,100	5,333.00	96,527,300
D O W Aホールディングス	4,100	4,460.00	18,286,000
古河機械金属	4,200	1,319.00	5,539,800

U A C J	3,500	2,520.00	8,820,000	
古河電気工業	3,900	2,473.00	9,644,700	
住友電気工業	54,200	1,537.00	83,305,400	
フジクラ	20,000	989.00	19,780,000	
タツタ電線	2,700	713.00	1,925,100	
リョービ	4,500	1,206.00	5,427,000	
アサヒホールディングス	7,600	2,053.00	15,602,800	
トーカロ	4,800	1,241.00	5,956,800	
S U M C O	26,900	1,982.00	53,315,800	
東洋製罐グループホールディングス	8,200	1,658.00	13,595,600	
横河ブリッジホールディングス	4,000	1,900.00	7,600,000	
駒井ハルテック	1,600	1,557.00	2,491,200	
三和ホールディングス	13,200	1,265.00	16,698,000	
文化シャッター	6,400	1,148.00	7,347,200	
三協立山	5,300	651.00	3,450,300	
L I X I L	23,500	2,162.00	50,807,000	
ノーリツ	4,800	1,467.00	7,041,600	
長府製作所	2,300	2,064.00	4,747,200	
リンナイ	2,700	9,970.00	26,919,000	
日東精工	9,600	509.00	4,886,400	
東プレ	4,900	1,230.00	6,027,000	
高周波熱錬	7,000	683.00	4,781,000	
バイオラックス	4,600	1,763.00	8,109,800	
日本発條	15,600	878.00	13,696,800	
三益半導体工業	2,500	2,596.00	6,490,000	
日本製鋼所	5,200	2,684.00	13,956,800	
三浦工業	6,200	3,255.00	20,181,000	
タクマ	6,100	1,269.00	7,740,900	
オークマ	1,500	5,080.00	7,620,000	
芝浦機械	2,700	2,827.00	7,632,900	
アマダ	22,600	1,143.00	25,831,800	
アイダエンジニアリング	6,000	799.00	4,794,000	
F U J I	5,400	2,127.00	11,485,800	
牧野フライス製作所	1,900	4,515.00	8,578,500	
オーエスジー	7,100	1,983.00	14,079,300	
旭ダイヤモンド工業	10,700	729.00	7,800,300	
D M G 森精機	9,200	1,969.00	18,114,800	
ディスコ	2,400	39,000.00	93,600,000	
日東工器	3,000	1,546.00	4,638,000	
島精機製作所	3,100	1,963.00	6,085,300	
日阪製作所	5,200	847.00	4,404,400	
ナブテスコ	8,700	3,700.00	32,190,000	
S M C	4,700	65,000.00	305,500,000	
ユニオンツール	1,200	3,370.00	4,044,000	
オイレス工業	4,300	1,518.00	6,527,400	

サトーホールディングス	4,000	2,070.00	8,280,000	
小松製作所	69,900	3,125.00	218,437,500	
住友重機械工業	7,600	2,790.00	21,204,000	
日立建機	6,400	3,075.00	19,680,000	
巴工業	2,400	2,416.00	5,798,400	
井関農機	3,800	1,217.00	4,624,600	
ローツエ	1,200	10,140.00	12,168,000	
タカキタ	10,000	436.00	4,360,000	
クボタ	75,800	1,918.50	145,422,300	
月島機械	4,800	1,032.00	4,953,600	
帝国電機製作所	2,900	2,411.00	6,991,900	
新東工業	3,700	714.00	2,641,800	
小森コーポレーション	6,700	885.00	5,929,500	
鶴見製作所	3,300	2,013.00	6,642,900	
荏原製作所	5,400	5,520.00	29,808,000	
西島製作所	4,500	1,506.00	6,777,000	
ダイキン工業	17,600	22,955.00	404,008,000	
栗田工業	7,900	5,930.00	46,847,000	
椿本チエイン	2,100	3,070.00	6,447,000	
ダイフク	7,800	7,160.00	55,848,000	
タダノ	8,100	943.00	7,638,300	
フジテック	5,600	3,225.00	18,060,000	
C K D	3,900	2,007.00	7,827,300	
平和	3,900	2,338.00	9,118,200	
S A N K Y O	3,200	5,180.00	16,576,000	
日本金銭機械	7,100	1,166.00	8,278,600	
フクシマガリレイ	1,400	4,370.00	6,118,000	
竹内製作所	4,100	2,811.00	11,525,100	
アマノ	3,700	2,409.00	8,913,300	
グローリー	4,200	2,231.00	9,370,200	
大和冷機工業	5,900	1,214.00	7,162,600	
セガサミーホールディングス	13,500	2,029.00	27,391,500	
リケン	600	2,338.00	1,402,800	
ホシザキ	8,800	4,630.00	40,744,000	
大豊工業	6,400	650.00	4,160,000	
日本精工	30,800	725.00	22,330,000	
N T N	40,100	270.00	10,827,000	
ジェイテクト	14,900	935.00	13,931,500	
不二越	1,700	3,755.00	6,383,500	
日本トムソン	6,400	594.00	3,801,600	
T H K	8,900	2,724.00	24,243,600	
ユーシン精機	6,100	686.00	4,184,600	
キッツ	7,400	810.00	5,994,000	
マキタ	18,000	3,485.00	62,730,000	
日立造船	16,800	836.00	14,044,800	



三菱重工業	25,000	5,059.00	126,475,000
I H I	10,500	3,895.00	40,897,500
スター精密	3,700	1,664.00	6,156,800
日清紡ホールディングス	9,000	962.00	8,658,000
イビデン	8,800	5,280.00	46,464,000
コニカミノルタ	32,800	552.00	18,105,600
ブラザー工業	18,100	1,994.00	36,091,400
ミネベアミツミ	25,200	2,189.00	55,162,800
日立製作所	74,000	6,917.00	511,858,000
東芝	28,800	4,539.00	130,723,200
三菱電機	148,800	1,405.00	209,064,000
富士電機	8,900	5,330.00	47,437,000
安川電機	16,700	4,890.00	81,663,000
明電舎	3,900	1,917.00	7,476,300
東芝テック	1,600	3,690.00	5,904,000
マブチモーター	3,800	3,680.00	13,984,000
日本電産	36,000	7,145.00	257,220,000
東光高岳	3,300	2,205.00	7,276,500
ダイヘン	2,200	4,165.00	9,163,000
日新電機	4,400	1,332.00	5,860,800
オムロン	13,200	7,153.00	94,419,600
日東工業	3,500	2,426.00	8,491,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,200	2,262.00	11,762,400
メルコホールディングス	1,700	3,420.00	5,814,000
テクノメディカ	1,800	1,821.00	3,277,800
日本電気	20,000	4,610.00	92,200,000
富士通	14,800	18,850.00	278,980,000
沖電気工業	4,700	730.00	3,431,000
サンケン電気	1,700	7,220.00	12,274,000
アイホン	2,700	1,914.00	5,167,800
ルネサスエレクトロニクス	93,100	1,352.50	125,917,750
セイコーエプソン	18,000	1,991.00	35,838,000
ワコム	14,000	633.00	8,862,000
アルバック	3,300	6,070.00	20,031,000
E I Z O	1,500	3,615.00	5,422,500
日本信号	5,200	1,055.00	5,486,000
能美防災	2,600	1,692.00	4,399,200
ホーチキ	3,900	1,437.00	5,604,300
エレコム	6,100	1,340.00	8,174,000
パナソニック ホールディングス	170,100	1,171.50	199,272,150
シャープ	17,800	1,071.00	19,063,800
アンリツ	9,700	1,280.00	12,416,000
富士通ゼネラル	4,400	3,705.00	16,302,000
ソニーグループ	102,700	11,665.00	1,197,995,500
T D K	23,900	4,610.00	110,179,000

アルプスアルパイン	12,500	1,291.00	16,137,500
日本トリム	1,300	2,985.00	3,880,500
フォスター電機	4,900	938.00	4,596,200
ヨコオ	2,500	2,236.00	5,590,000
ホシデン	5,900	1,560.00	9,204,000
ヒロセ電機	2,300	16,850.00	38,755,000
日本航空電子工業	3,800	2,246.00	8,534,800
アイコム	2,200	2,574.00	5,662,800
横河電機	14,700	2,246.00	33,016,200
アズビル	9,400	3,660.00	34,404,000
日本光電工業	6,200	3,325.00	20,615,000
堀場製作所	2,800	5,970.00	16,716,000
アドバンテスト	11,800	9,840.00	116,112,000
キーエンス	14,500	59,940.00	869,130,000
日置電機	1,000	6,590.00	6,590,000
シスメックス	12,200	8,643.00	105,444,600
OBARA GROUP	1,800	3,695.00	6,651,000
コーセル	7,100	1,109.00	7,873,900
イリソ電子工業	1,900	4,350.00	8,265,000
オプテックスグループ	4,300	2,060.00	8,858,000
千代田インテグレ	2,400	2,293.00	5,503,200
レーザーテック	7,300	26,380.00	192,574,000
スタンレー電気	10,700	2,688.00	28,761,600
ウシオ電機	8,700	1,726.00	15,016,200
日本セラミック	1,900	2,370.00	4,503,000
図研	2,500	3,035.00	7,587,500
日本電子	3,400	3,845.00	13,073,000
カシオ計算機	12,200	1,356.00	16,543,200
ファナック	14,200	22,270.00	316,234,000
ローム	6,600	10,340.00	68,244,000
浜松ホトニクス	11,200	7,060.00	79,072,000
三井ハイテック	1,800	6,900.00	12,420,000
新光電気工業	5,800	3,830.00	22,214,000
京セラ	22,100	6,682.00	147,672,200
太陽誘電	7,900	4,505.00	35,589,500
村田製作所	44,200	7,578.00	334,947,600
双葉電子工業	7,700	560.00	4,312,000
ニチコン	6,100	1,279.00	7,801,900
日本ケミコン	3,800	1,653.00	6,281,400
KOA	4,200	1,958.00	8,223,600
小糸製作所	16,000	2,118.00	33,888,000
ミツバ	7,500	481.00	3,607,500
SCREENホールディングス	2,900	9,690.00	28,101,000
キヤノン電子	3,500	1,560.00	5,460,000
キヤノン	78,400	2,939.00	230,417,600

リコー	38,100	1,010.00	38,481,000	
象印マホービン	4,100	1,618.00	6,633,800	
東京エレクトロン	10,300	46,380.00	477,714,000	
イノテック	2,800	1,351.00	3,782,800	
トヨタ紡織	5,800	1,885.00	10,933,000	
ユニプレス	7,300	771.00	5,628,300	
豊田自動織機	11,100	7,930.00	88,023,000	
モリタホールディングス	6,100	1,172.00	7,149,200	
デンソー	30,300	6,923.00	209,766,900	
東海理化電機製作所	3,600	1,461.00	5,259,600	
川崎重工業	11,800	2,926.00	34,526,800	
日産自動車	199,100	444.40	88,480,040	
いすゞ自動車	44,700	1,605.00	71,743,500	
トヨタ自動車	793,400	1,905.00	1,511,427,000	300,000株
日野自動車	21,000	530.00	11,130,000	
三菱自動車工業	64,300	497.00	31,957,100	
武蔵精密工業	5,300	1,719.00	9,110,700	
日産車体	4,800	863.00	4,142,400	
新明和工業	5,400	1,047.00	5,653,800	
極東開発工業	4,200	1,465.00	6,153,000	
トピー工業	3,300	1,647.00	5,435,100	
ティラド	1,600	2,722.00	4,355,200	
NOK	7,600	1,207.00	9,173,200	
フタバ産業	5,900	373.00	2,200,700	
KYB	2,700	3,615.00	9,760,500	
プレス工業	17,300	438.00	7,577,400	
アイシン	10,400	3,710.00	38,584,000	
マツダ	48,800	1,007.00	49,141,600	
今仙電機製作所	5,900	700.00	4,130,000	
本田技研工業	116,800	3,147.00	367,569,600	
スズキ	27,400	4,720.00	129,328,000	
SUBARU	44,400	2,082.00	92,440,800	
ヤマハ発動機	21,800	3,175.00	69,215,000	
エクセディ	3,700	1,650.00	6,105,000	
豊田合成	4,500	2,095.00	9,427,500	
愛三工業	7,300	725.00	5,292,500	
ヨロズ	4,300	722.00	3,104,600	
エフ・シー・シー	3,300	1,398.00	4,613,400	
シマノ	5,800	23,245.00	134,821,000	
テイ・エス テック	6,500	1,584.00	10,296,000	
テルモ	46,000	3,817.00	175,582,000	
クリエートメディック	4,000	882.00	3,528,000	
島津製作所	18,700	3,970.00	74,239,000	
ブイ・テクノロジー	2,200	2,732.00	6,010,400	
東京精密	2,600	4,605.00	11,973,000	

マニー	5,700	1,915.00	10,915,500
ニコン	23,000	1,261.00	29,003,000
トプコン	9,000	1,626.00	14,634,000
オリンパス	90,200	2,418.00	218,103,600
理研計器	1,500	4,630.00	6,945,000
タムロン	2,500	3,095.00	7,737,500
HOYA	31,300	14,350.00	449,155,000
朝日インテック	18,800	2,287.00	42,995,600
シチズン時計	20,800	598.00	12,438,400
メニコン	5,600	2,845.00	15,932,000
セイコーグループ	3,600	2,877.00	10,357,200
ニプロ	10,600	1,038.00	11,002,800
パラマウントベッドホールディングス	3,900	2,523.00	9,839,700
バンダイナムコホールディングス	13,400	8,615.00	115,441,000
アイフィスジャパン	4,400	603.00	2,653,200
パイロットコーポレーション	2,000	4,540.00	9,080,000
フジシールインターナショナル	3,400	1,645.00	5,593,000
タカラトミー	6,700	1,266.00	8,482,200
タカノ	4,100	675.00	2,767,500
大建工業	3,000	2,188.00	6,564,000
凸版印刷	20,700	2,058.00	42,600,600
大日本印刷	17,100	3,000.00	51,300,000
NISSHA	4,200	1,903.00	7,992,600
アシックス	13,600	2,954.00	40,174,400
小松ウオール工業	2,200	1,859.00	4,089,800
ヤマハ	8,800	4,990.00	43,912,000
クリナップ	8,700	647.00	5,628,900
ピジョン	9,500	2,057.00	19,541,500
キングジム	6,300	902.00	5,682,600
リンテック	2,800	2,186.00	6,120,800
イトーキ	9,700	693.00	6,722,100
任天堂	92,100	5,574.00	513,365,400
三菱鉛筆	5,000	1,426.00	7,130,000
タカラスタンダード	3,700	1,391.00	5,146,700
コクヨ	6,800	1,824.00	12,403,200
オカムラ	6,500	1,421.00	9,236,500
美津濃	2,400	2,810.00	6,744,000
東京電力ホールディングス	126,500	466.00	58,949,000
中部電力	50,700	1,281.00	64,946,700
関西電力	55,200	1,238.00	68,337,600
中国電力	22,100	669.00	14,784,900
北陸電力	14,700	508.00	7,467,600
東北電力	35,500	662.00	23,501,000
四国電力	14,000	724.00	10,136,000
九州電力	33,100	718.00	23,765,800

北海道電力	16,600	453.00	7,519,800	
沖縄電力	5,100	1,030.00	5,253,000	
電源開発	12,300	2,066.00	25,411,800	
レノバ	4,500	2,290.00	10,305,000	
東京瓦斯	29,300	2,530.00	74,129,000	
大阪瓦斯	27,700	2,042.00	56,563,400	
東邦瓦斯	7,100	2,374.00	16,855,400	
北海道瓦斯	3,600	1,676.00	6,033,600	
西部ガスホールディングス	2,200	1,732.00	3,810,400	
静岡ガス	5,700	1,066.00	6,076,200	
東武鉄道	14,900	3,055.00	45,519,500	
相鉄ホールディングス	4,900	2,207.00	10,814,300	
東急	38,600	1,657.00	63,960,200	
京浜急行電鉄	19,700	1,348.00	26,555,600	
小田急電鉄	20,100	1,674.00	33,647,400	
京王電鉄	7,400	4,635.00	34,299,000	
京成電鉄	9,800	3,770.00	36,946,000	
富士急行	2,600	4,640.00	12,064,000	
東日本旅客鉄道	25,000	7,392.00	184,800,000	
西日本旅客鉄道	17,900	5,588.00	100,025,200	
東海旅客鉄道	11,400	16,130.00	183,882,000	
西武ホールディングス	21,000	1,476.00	30,996,000	
西日本鉄道	3,600	2,397.00	8,629,200	
近鉄グループホールディングス	14,800	4,220.00	62,456,000	
阪急阪神ホールディングス	18,500	3,895.00	72,057,500	
南海電気鉄道	6,700	2,843.00	19,048,100	
京阪ホールディングス	6,400	3,545.00	22,688,000	
名古屋鉄道	14,600	2,152.00	31,419,200	
ヤマトホールディングス	20,200	2,100.00	42,420,000	
山九	3,600	4,810.00	17,316,000	
センコーグループホールディングス	8,600	975.00	8,385,000	
トナミホールディングス	600	3,620.00	2,172,000	
ニッコンホールディングス	3,400	2,424.00	8,241,600	
福山通運	2,400	3,075.00	7,380,000	
セイノーホールディングス	6,400	1,188.00	7,603,200	
日立物流	800	8,900.00	7,120,000	
C & F ロジホールディングス	3,500	1,228.00	4,298,000	
九州旅客鉄道	10,300	2,943.00	30,312,900	
S Gホールディングス	26,200	1,867.00	48,915,400	
NIPPON EXPRESSホールディングス	5,000	7,350.00	36,750,000	
日本郵船	40,200	3,242.00	130,328,400	
商船三井	25,700	3,395.00	87,251,500	
川崎汽船	14,000	2,872.00	40,208,000	
飯野海運	10,700	911.00	9,747,700	

日本航空	34,300	2,747.00	94,222,100
A N Aホールディングス	38,200	2,885.00	110,207,000
三菱倉庫	3,900	2,958.00	11,536,200
三井倉庫ホールディングス	2,300	3,690.00	8,487,000
住友倉庫	5,000	1,971.00	9,855,000
東陽倉庫	13,900	268.00	3,725,200
安田倉庫	5,300	940.00	4,982,000
上組	7,600	2,641.00	20,071,600
キムラユニティー	6,500	797.00	5,180,500
キューソー流通システム	3,600	916.00	3,297,600
エーアイテイー	3,900	1,462.00	5,701,800
N E C ネットエスアイ	5,200	1,759.00	9,146,800
システナ	23,200	409.00	9,488,800
デジタルアーツ	1,600	5,700.00	9,120,000
日鉄ソリューションズ	2,200	3,340.00	7,348,000
T I S	15,600	3,720.00	58,032,000
J N Sホールディングス	12,500	317.00	3,962,500
グリー	13,100	702.00	9,196,200
コーエーテクモホールディングス	10,300	2,444.00	25,173,200
ブレインパッド	6,000	747.00	4,482,000
K L a b	11,500	425.00	4,887,500
ネクソン	36,400	3,135.00	114,114,000
エイチーム	6,600	784.00	5,174,400
コロブラ	9,800	663.00	6,497,400
サイバーリンクス	4,500	999.00	4,495,500
C A R T A H O L D I N G S	2,800	1,681.00	4,706,800
S H I F T	1,200	25,250.00	30,300,000
ティーガイア	3,100	1,648.00	5,108,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,000	2,176.00	8,704,000
G M O ペイメントゲートウェイ	3,400	12,220.00	41,548,000
ザッパラス	10,800	353.00	3,812,400
インターネットイニシアティブ	10,000	2,366.00	23,660,000
ラクス	9,000	1,826.00	16,434,000
チェンジ	5,600	2,355.00	13,188,000
マネーフォワード	4,300	4,995.00	21,478,500
電算システムホールディングス	2,500	2,181.00	5,452,500
フェイス	4,000	499.00	1,996,000
野村総合研究所	29,300	3,260.00	95,518,000
C Eホールディングス	10,000	504.00	5,040,000
インテージホールディングス	4,700	1,563.00	7,346,100
ラクスル	3,400	2,910.00	9,894,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,400	1,670.00	4,008,000
S a n s a n	7,900	1,680.00	13,272,000

フジ・メディア・ホールディングス	10,800	1,082.00	11,685,600
オービック	5,000	20,960.00	104,800,000
ジャストシステム	3,400	3,165.00	10,761,000
Zホールディングス	218,800	378.80	82,881,440
トレンドマイクロ	8,500	6,300.00	53,550,000
日本オラクル	2,600	8,880.00	23,088,000
フューチャー	5,500	1,665.00	9,157,500
CAC Holdings	3,900	1,456.00	5,678,400
SBテクノロジー	2,800	1,931.00	5,406,800
オービックビジネスコンサルタント	2,300	4,990.00	11,477,000
伊藤忠テクノソリューションズ	7,500	3,125.00	23,437,500
大塚商会	8,500	4,230.00	35,955,000
サイボウズ	3,800	2,609.00	9,914,200
電通国際情報サービス	2,500	4,170.00	10,425,000
デジタルガレージ	2,500	4,580.00	11,450,000
ウェザーニューズ	1,000	7,090.00	7,090,000
日本エンタープライズ	33,500	129.00	4,321,500
ネットワンシステムズ	6,600	3,540.00	23,364,000
アルゴグラフィックス	2,500	3,760.00	9,400,000
エイベックス	5,300	1,730.00	9,169,000
BIPROGY	5,200	3,385.00	17,602,000
兼松エレクトロニクス	1,700	4,605.00	7,828,500
TBSホールディングス	5,400	1,516.00	8,186,400
日本テレビホールディングス	9,800	1,046.00	10,250,800
テレビ朝日ホールディングス	3,700	1,325.00	4,902,500
スカパーJ S A Tホールディングス	15,500	498.00	7,719,000
テレビ東京ホールディングス	2,200	1,942.00	4,272,400
日本電信電話	185,700	3,899.00	724,044,300
KDDI	113,000	4,096.00	462,848,000
ソフトバンク	236,300	1,489.50	351,968,850
光通信	1,800	19,030.00	34,254,000
GMOインターネットグループ	6,900	2,579.00	17,795,100
KADOKAWA	9,400	2,464.00	23,161,600
ゼンリン	6,500	810.00	5,265,000
松竹	1,000	10,810.00	10,810,000
東宝	9,200	4,785.00	44,022,000
東映	400	17,260.00	6,904,000
エヌ・ティ・ティ・データ	44,000	2,003.00	88,132,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,900	2,013.00	5,837,700
DTS	3,100	3,025.00	9,377,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,800	6,220.00	48,516,000
カプコン	15,300	4,225.00	64,642,500
SCSK	10,600	2,077.00	22,016,200
アイネス	3,900	1,361.00	5,307,900

T K C	2,000	3,605.00	7,210,000	
富士ソフト	1,600	7,660.00	12,256,000	
N S D	4,800	2,313.00	11,102,400	
コナミグループ	6,000	6,400.00	38,400,000	
ソフトバンクグループ	84,600	6,183.00	523,081,800	
伊藤忠食品	800	4,930.00	3,944,000	
エレマテック	4,300	1,697.00	7,297,100	
双日	17,700	2,559.00	45,294,300	
アルフレッサ ホールディングス	13,500	1,621.00	21,883,500	
横浜冷凍	6,500	1,086.00	7,059,000	
神戸物産	11,900	3,855.00	45,874,500	
あい ホールディングス	3,200	2,149.00	6,876,800	
ダイワボウホールディングス	5,800	1,942.00	11,263,600	
マクニカホールディングス	3,600	3,395.00	12,222,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,400	839.00	2,852,600	
レスターホールディングス	3,000	2,192.00	6,576,000	
O C H Iホールディングス	3,000	1,311.00	3,933,000	
T O K A Iホールディングス	7,800	853.00	6,653,400	
シップヘルスケアホールディングス	5,000	2,530.00	12,650,000	
明治電機工業	2,800	1,125.00	3,150,000	
コメダホールディングス	3,100	2,398.00	7,433,800	
エコートレーディング	6,000	720.00	4,320,000	
ナガイレーベン	3,000	1,930.00	5,790,000	
三菱食品	1,900	3,075.00	5,842,500	
松田産業	2,300	2,367.00	5,444,100	
第一興商	2,400	4,000.00	9,600,000	
メディパルホールディングス	14,600	1,724.00	25,170,400	
アズワン	2,400	5,770.00	13,848,000	
尾家産業	3,200	918.00	2,937,600	
ドウシシャ	3,000	1,635.00	4,905,000	
丸文	6,300	1,050.00	6,615,000	
橋本総業ホールディングス	4,300	1,077.00	4,631,100	
日本ライフライン	6,400	951.00	6,086,400	
進和	2,800	2,124.00	5,947,200	
オーハシテクニカ	3,900	1,503.00	5,861,700	
白銅	2,000	2,672.00	5,344,000	
伊藤忠商事	95,400	4,161.00	396,959,400	
丸紅	122,300	1,592.50	194,762,750	
長瀬産業	7,200	2,049.00	14,752,800	
豊田通商	13,900	5,360.00	74,504,000	
兼松	4,000	1,515.00	6,060,000	
三井物産	113,200	3,910.00	442,612,000	
日本紙パルプ商事	1,100	4,935.00	5,428,500	
山善	6,300	1,040.00	6,552,000	
住友商事	93,400	2,329.00	217,528,600	



内田洋行	1,100	4,680.00	5,148,000
三菱商事	96,700	4,445.00	429,831,500
キヤノンマーケティングジャパン	3,300	3,055.00	10,081,500
西華産業	3,500	1,647.00	5,764,500
菱洋エレクトロ	2,700	2,399.00	6,477,300
東京産業	4,700	768.00	3,609,600
阪和興業	3,000	4,005.00	12,015,000
岩谷産業	3,800	5,570.00	21,166,000
アステナホールディングス	12,200	416.00	5,075,200
三愛オブリ	5,600	1,310.00	7,336,000
稲畑産業	3,900	2,479.00	9,668,100
ワキタ	6,400	1,194.00	7,641,600
東邦ホールディングス	4,000	2,082.00	8,328,000
サンゲツ	3,800	2,269.00	8,622,200
シナネンホールディングス	1,600	3,935.00	6,296,000
伊藤忠エネクス	5,800	1,098.00	6,368,400
サンリオ	5,200	4,675.00	24,310,000
リョーサン	2,900	3,070.00	8,903,000
三信電気	2,600	2,509.00	6,523,400
モスフードサービス	2,200	3,060.00	6,732,000
加賀電子	2,300	4,255.00	9,786,500
立花エレテック	2,500	1,821.00	4,552,500
フォーバル	4,600	1,060.00	4,876,000
PALTA C	2,100	4,705.00	9,880,500
日鉄物産	1,300	9,240.00	12,012,000
トラスコ中山	4,300	2,081.00	8,948,300
オートバックスセブン	5,200	1,417.00	7,368,400
加藤産業	2,000	3,565.00	7,130,000
杉本商事	2,400	2,025.00	4,860,000
因幡電機産業	3,700	2,783.00	10,297,100
ミスミグループ本社	22,200	3,245.00	72,039,000
スズケン	5,800	3,390.00	19,662,000
ジェコス	5,200	889.00	4,622,800
ローソン	3,200	5,120.00	16,384,000
サンエー	1,700	4,055.00	6,893,500
エービーシー・マート	2,000	6,900.00	13,800,000
ハードオフコーポレーション	4,300	1,242.00	5,340,600
アスクル	5,300	1,726.00	9,147,800
ゲオホールディングス	4,300	1,844.00	7,929,200
アダストリア	2,700	2,141.00	5,780,700
ジーフット	8,900	295.00	2,625,500
エディオン	5,900	1,296.00	7,646,400
あみやき亭	1,900	2,919.00	5,546,100
ハニーズホールディングス	3,700	1,425.00	5,272,500
ジズホールディングス	1,900	4,000.00	7,600,000

ビックカメラ	8,600	1,207.00	10,380,200
D C Mホールディングス	8,200	1,184.00	9,708,800
M o n o t a R O	21,900	1,991.00	43,602,900
J . フロント リテイリング	18,000	1,212.00	21,816,000
ドトール・日レスホールディングス	5,300	1,768.00	9,370,400
マツキヨココカラ&カンパニー	9,600	6,570.00	63,072,000
Z O Z O	11,500	3,245.00	37,317,500
トレジャー・ファクトリー	2,600	2,130.00	5,538,000
三越伊勢丹ホールディングス	24,100	1,418.00	34,173,800
ウエルシアホールディングス	9,000	2,913.00	26,217,000
クリエイトSDホールディングス	2,100	3,450.00	7,245,000
シュッピン	4,300	1,112.00	4,781,600
オイシックス・ラ・大地	4,300	2,156.00	9,270,800
ジョイフル本田	4,500	1,935.00	8,707,500
すかいらーくホールディングス	18,900	1,528.00	28,879,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	6,000	1,117.00	6,702,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,600	1,477.00	5,317,200
あさひ	3,400	1,394.00	4,739,600
コスモス薬品	1,600	12,780.00	20,448,000
トーエル	3,900	740.00	2,886,000
セブン&アイ・ホールディングス	53,600	6,129.00	328,514,400
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	11,600	965.00	11,194,000
ツルハホールディングス	3,600	9,610.00	34,596,000
サンマルクホールディングス	2,800	1,737.00	4,863,600
トリドールホールディングス	5,200	2,784.00	14,476,800
クスリのアオキホールディングス	1,500	7,440.00	11,160,000
FOOD & LIFE COMPANIES	10,000	3,080.00	30,800,000
ノジマ	4,800	1,377.00	6,609,600
カッパ・クリエイト	5,700	1,428.00	8,139,600
ライトオン	5,200	566.00	2,943,200
良品計画	18,000	1,435.00	25,830,000
バリミキホールディングス	5,500	269.00	1,479,500
アドヴァングループ	5,200	892.00	4,638,400
G - 7ホールディングス	4,300	1,578.00	6,785,400
コーナン商事	2,500	3,280.00	8,200,000
エコス	2,900	1,877.00	5,443,300
マルシェ	11,800	393.00	4,637,400
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	33,400	2,408.00	80,427,200
西松屋チェーン	5,600	1,497.00	8,383,200
ゼンショーホールディングス	7,500	3,285.00	24,637,500
サイゼリヤ	2,900	3,150.00	9,135,000
魚力	2,400	2,166.00	5,198,400

ユナイテッドアローズ	3,100	1,722.00	5,338,200	
ハイデイ日高	2,800	2,032.00	5,689,600	
YU-WA Creation Holdings	12,300	200.00	2,460,000	
コロワイド	6,800	1,803.00	12,260,400	
壱番屋	1,000	4,700.00	4,700,000	
スギホールディングス	3,200	5,750.00	18,400,000	
薬王堂ホールディングス	2,600	2,669.00	6,939,400	
スクロール	4,900	724.00	3,547,600	
木曽路	2,400	2,119.00	5,085,600	
千趣会	14,000	396.00	5,544,000	
ケーヨー	7,500	897.00	6,727,500	
上新電機	2,300	1,968.00	4,526,400	
日本瓦斯	8,000	2,052.00	16,416,000	
ロイヤルホールディングス	4,900	2,434.00	11,926,600	
いなげや	3,600	1,308.00	4,708,800	
チヨダ	2,800	791.00	2,214,800	
ライフコーポレーション	2,100	2,778.00	5,833,800	
AOKIホールディングス	8,500	683.00	5,805,500	
コメリ	1,700	2,657.00	4,516,900	
青山商事	6,000	875.00	5,250,000	
しまむら	1,800	12,230.00	22,014,000	
高島屋	11,600	1,801.00	20,891,600	
松屋	6,200	1,183.00	7,334,600	
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,700	1,272.00	11,066,400	
丸井グループ	12,000	2,172.00	26,064,000	
アクシアル リテイリング	2,000	3,490.00	6,980,000	
イオン	52,900	2,611.00	138,121,900	
イズミ	2,400	2,886.00	6,926,400	
平和堂	3,100	2,109.00	6,537,900	
フジ	3,200	1,841.00	5,891,200	
ヤオコー	1,400	6,750.00	9,450,000	
ゼビオホールディングス	3,500	920.00	3,220,000	
ケーズホールディングス	13,100	1,157.00	15,156,700	
Genky DrugStores	1,300	3,715.00	4,829,500	
ブックオフグループホールディングス	4,400	1,238.00	5,447,200	
アインホールディングス	2,200	5,640.00	12,408,000	
ヤマダホールディングス	55,700	471.00	26,234,700	
ニトリホールディングス	6,300	17,060.00	107,478,000	
吉野家ホールディングス	5,400	2,339.00	12,630,600	
王将フードサービス	700	5,950.00	4,165,000	
ブレナス	3,000	2,634.00	7,902,000	
ミニストップ	3,200	1,411.00	4,515,200	
アークス	3,000	2,155.00	6,465,000	
パローホールディングス	3,900	1,831.00	7,140,900	

ファーストリテイリング	2,300	77,440.00	178,112,000	
サンドラッグ	5,000	3,650.00	18,250,000	
ヤマザワ	2,300	1,315.00	3,024,500	
ベルーナ	10,200	684.00	6,976,800	
いよぎんホールディングス	11,900	716.00	8,520,400	
しずおかフィナンシャルグループ	34,300	1,076.00	36,906,800	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	8,400	944.00	7,929,600	
めぶきフィナンシャルグループ	59,500	326.00	19,397,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,900	2,821.00	11,001,900	
九州フィナンシャルグループ	16,400	465.00	7,626,000	
ゆうちょ銀行	37,400	1,143.00	42,748,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	71,300	568.00	40,498,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,400	1,054.00	9,907,600	
三十三フィナンシャルグループ	100	1,638.00	163,800	
第四北越フィナンシャルグループ	2,800	2,898.00	8,114,400	
ひろぎんホールディングス	13,200	660.00	8,712,000	
おきなわフィナンシャルグループ	2,000	2,344.00	4,688,000	
十六フィナンシャルグループ	2,500	3,030.00	7,575,000	
北國フィナンシャルホールディングス	2,100	4,180.00	8,778,000	
プロクレアホールディングス	2,600	2,259.00	5,873,400	
あいちフィナンシャルグループ	4,200	2,318.00	9,735,600	
SBI新生銀行	6,200	2,350.00	14,570,000	
あおぞら銀行	7,700	2,622.00	20,189,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	906,100	962.20	871,849,420	300,000株
りそなホールディングス	177,300	729.90	129,411,270	
三井住友トラスト・ホールディングス	25,800	4,741.00	122,317,800	
三井住友フィナンシャルグループ	103,600	5,660.00	586,376,000	
千葉銀行	45,500	970.00	44,135,000	
群馬銀行	19,900	492.00	9,790,800	
武蔵野銀行	1,300	2,198.00	2,857,400	
七十七銀行	4,800	2,170.00	10,416,000	
秋田銀行	2,800	1,833.00	5,132,400	
山形銀行	3,200	1,271.00	4,067,200	
岩手銀行	2,900	2,049.00	5,942,100	
東邦銀行	8,100	236.00	1,911,600	
東北銀行	2,800	1,023.00	2,864,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	10,700	3,015.00	32,260,500	
スルガ銀行	13,200	418.00	5,517,600	
八十二銀行	22,400	552.00	12,364,800	
山梨中央銀行	4,300	1,181.00	5,078,300	
大垣共立銀行	3,100	1,900.00	5,890,000	
福井銀行	1,500	1,619.00	2,428,500	
滋賀銀行	3,100	2,749.00	8,521,900	
南都銀行	3,100	2,625.00	8,137,500	
百五銀行	12,300	403.00	4,956,900	

京都銀行	4,500	5,940.00	26,730,000
紀陽銀行	4,700	1,591.00	7,477,700
ほくほくフィナンシャルグループ	9,200	1,001.00	9,209,200
山陰合同銀行	10,500	783.00	8,221,500
鳥取銀行	3,000	1,170.00	3,510,000
百十四銀行	4,000	2,009.00	8,036,000
阿波銀行	3,000	2,128.00	6,384,000
大分銀行	1,900	2,149.00	4,083,100
宮崎銀行	1,700	2,609.00	4,435,300
佐賀銀行	2,500	1,791.00	4,477,500
琉球銀行	8,400	932.00	7,828,800
セブン銀行	38,200	264.00	10,084,800
みずほフィナンシャルグループ	204,200	2,027.50	414,015,500
山口フィナンシャルグループ	11,500	876.00	10,074,000
長野銀行	3,900	1,399.00	5,456,100
名古屋銀行	1,600	3,480.00	5,568,000
北洋銀行	20,400	271.00	5,528,400
愛媛銀行	3,900	916.00	3,572,400
トマト銀行	3,100	1,051.00	3,258,100
京葉銀行	11,400	597.00	6,805,800
栃木銀行	18,500	302.00	5,587,000
トモニホールディングス	13,900	385.00	5,351,500
フィデアホールディングス	2,600	1,455.00	3,783,000
池田泉州ホールディングス	35,200	250.00	8,800,000
F P G	9,700	1,067.00	10,349,900
S B Iホールディングス	20,800	2,752.00	57,241,600
ジャフコ グループ	6,700	2,365.00	15,845,500
大和証券グループ本社	100,700	606.00	61,024,200
野村ホールディングス	256,000	517.00	132,352,000
岡三証券グループ	13,900	427.00	5,935,300
丸三証券	12,700	428.00	5,435,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	20,100	382.00	7,678,200
水戸証券	13,600	299.00	4,066,400
いちよし証券	7,100	634.00	4,501,400
松井証券	9,000	778.00	7,002,000
マネックスグループ	19,600	490.00	9,604,000
極東証券	6,100	609.00	3,714,900
アイザワ証券グループ	7,400	729.00	5,394,600
かんぽ生命保険	15,800	2,329.00	36,798,200
S O M P Oホールディングス	24,000	5,767.00	138,408,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	31,800	4,245.00	134,991,000
第一生命ホールディングス	74,500	3,061.00	228,044,500
東京海上ホールディングス	142,400	2,774.00	395,017,600

T & Dホールディングス	36,500	2,032.00	74,168,000	
全国保証	3,900	4,860.00	18,954,000	
クレディセゾン	11,100	1,692.00	18,781,200	
芙蓉総合リース	1,600	8,770.00	14,032,000	
みずほリース	2,100	3,425.00	7,192,500	
東京センチュリー	3,000	4,530.00	13,590,000	
日本証券金融	8,900	1,166.00	10,377,400	
アイフル	35,000	381.00	13,335,000	
リコーリース	1,600	3,785.00	6,056,000	
イオンフィナンシャルサービス	9,500	1,310.00	12,445,000	
アコム	31,600	313.00	9,890,800	
オリエントコーポレーション	7,500	1,155.00	8,662,500	
オリックス	95,200	2,270.50	216,151,600	
三菱HCキャピタル	52,300	664.00	34,727,200	
日本取引所グループ	38,500	1,903.00	73,265,500	
アサックス	5,500	595.00	3,272,500	
NECキャピタルソリューション	2,300	2,265.00	5,209,500	
大東建託	5,300	14,130.00	74,889,000	
いちご	22,600	298.00	6,734,800	
ヒューリック	34,100	1,049.00	35,770,900	
野村不動産ホールディングス	9,000	2,836.00	25,524,000	
オープンハウスグループ	5,500	4,965.00	27,307,500	
東急不動産ホールディングス	46,700	638.00	29,794,600	
飯田グループホールディングス	12,400	2,142.00	26,560,800	
パーク24	12,700	2,214.00	28,117,800	
三井不動産	63,600	2,407.00	153,085,200	
三菱地所	92,700	1,675.00	155,272,500	
平和不動産	3,300	3,665.00	12,094,500	
東京建物	14,800	1,584.00	23,443,200	
京阪神ビルディング	4,100	1,356.00	5,559,600	
住友不動産	26,900	3,158.00	84,950,200	
テーオーシー	7,300	669.00	4,883,700	
スターツコーポレーション	3,400	2,533.00	8,612,200	
空港施設	7,500	520.00	3,900,000	
ゴールドクレスト	3,500	1,704.00	5,964,000	
エスリード	2,500	1,955.00	4,887,500	
AVANTIA	6,500	794.00	5,161,000	
イオンモール	7,700	1,820.00	14,014,000	
カチタス	5,000	3,055.00	15,275,000	
日本空港ビルデング	5,600	6,830.00	38,248,000	
MIXI	3,400	2,518.00	8,561,200	
日本M&Aセンターホールディングス	27,600	1,743.00	48,106,800	
UTグループ	3,800	2,608.00	9,910,400	
パソナグループ	2,900	2,111.00	6,121,900	
エス・エム・エス	6,300	3,430.00	21,609,000	

パーソルホールディングス	15,500	2,838.00	43,989,000
クックパッド	18,600	223.00	4,147,800
学情	3,700	1,420.00	5,254,000
スタジオアリス	2,200	2,161.00	4,754,200
シミックホールディングス	3,500	1,780.00	6,230,000
N J S	2,500	2,144.00	5,360,000
総合警備保障	5,400	3,530.00	19,062,000
カカクコム	12,800	2,160.00	27,648,000
アイロムグループ	2,500	2,391.00	5,977,500
ディップ	3,300	3,925.00	12,952,500
キャリアデザインセンター	3,300	1,472.00	4,857,600
ベネフィット・ワン	6,900	2,126.00	14,669,400
エムスリー	29,500	3,632.00	107,144,000
アウトソーシング	10,100	991.00	10,009,100
ディー・エヌ・エー	6,900	1,785.00	12,316,500
博報堂D Yホールディングス	20,000	1,389.00	27,780,000
ぐるなび	13,100	399.00	5,226,900
ファンコミュニケーションズ	11,300	419.00	4,734,700
W D Bホールディングス	1,400	2,126.00	2,976,400
インフォマート	25,000	414.00	10,350,000
クイック	3,400	2,060.00	7,004,000
電通グループ	14,900	4,300.00	64,070,000
H . U . グループホールディングス	3,900	2,807.00	10,947,300
日本空調サービス	7,200	709.00	5,104,800
オリエンタルランド	15,900	21,115.00	335,728,500
ダスキン	3,300	3,040.00	10,032,000
ラウンドワン	18,900	460.00	8,694,000
リゾートトラスト	6,900	2,356.00	16,256,400
ビー・エム・エル	2,800	3,325.00	9,310,000
りらいあコミュニケーションズ	4,700	1,457.00	6,847,900
リソー教育	20,800	364.00	7,571,200
早稲田アカデミー	4,800	1,155.00	5,544,000
ユー・エス・エス	17,400	2,098.00	36,505,200
サイバーエージェント	36,700	1,243.00	45,618,100
楽天グループ	68,400	658.00	45,007,200
テー・オー・ダブリュー	19,000	291.00	5,529,000
エン・ジャパン	4,600	2,493.00	11,467,800
テクノプロ・ホールディングス	9,700	3,980.00	38,606,000
インターワークス	8,700	367.00	3,192,900
アイ・アールジャパンホールディングス	3,200	1,881.00	6,019,200
ジャパンマテリアル	4,900	2,420.00	11,858,000
キャリアリンク	2,000	2,720.00	5,440,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	1,112.00	4,336,800
リクルートホールディングス	111,000	4,266.00	473,526,000
エラン	6,300	997.00	6,281,100

日本郵政	191,900	1,114.00	213,776,600	
ベイカレント・コンサルティング	12,600	5,530.00	69,678,000	
MS - J a p a n	4,400	1,066.00	4,690,400	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,300	1,819.00	11,459,700	
リログループ	9,500	2,215.00	21,042,500	
共立メンテナンス	3,300	5,830.00	19,239,000	
建設技術研究所	1,900	3,350.00	6,365,000	
東京都競馬	2,300	3,930.00	9,039,000	
カナモト	3,600	2,255.00	8,118,000	
トランス・コスモス	2,700	3,370.00	9,099,000	
乃村工藝社	7,700	921.00	7,091,700	
日本管財	3,200	2,549.00	8,156,800	
白洋舎	2,700	1,814.00	4,897,800	
セコム	15,000	7,758.00	116,370,000	
セントラル警備保障	2,100	2,565.00	5,386,500	
メイテック	4,700	2,507.00	11,782,900	
応用地質	3,300	2,134.00	7,042,200	
船井総研ホールディングス	3,400	2,794.00	9,499,600	
ベネッセホールディングス	5,900	1,982.00	11,693,800	
イオンディライト	2,000	3,065.00	6,130,000	
ダイセキ	3,400	4,455.00	15,147,000	
ステップ	3,000	1,790.00	5,370,000	
合 計	16,811,700	-	41,363,773,320	

(注) 備考欄の数値は、差入委託証拠金代用有価証券としての担保差入れ株式数です。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。



## 「TMA日本債券インデックスマザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	[2022年 1月25日現在]	[2023年 1月25日現在]
		金額（円）	金額（円）
<b>資産の部</b>			
流動資産			
コール・ローン		71,130,638	172,460,380
国債証券		19,275,688,910	23,707,574,480
地方債証券		1,147,601,300	1,231,403,200
特殊債券		302,629,000	199,875,000
社債券		1,190,312,197	1,137,284,547
未収入金			161,149,650
未収利息		30,402,940	36,098,359
前払費用		1,082,882	1,590,628
流動資産合計		22,018,847,867	26,647,436,244
資産合計		22,018,847,867	26,647,436,244
<b>負債の部</b>			
流動負債			
未払金			283,486,860
未払解約金		19,281,361	20,329,955
未払利息		75	83
流動負債合計		19,281,436	303,816,898
負債合計		19,281,436	303,816,898
<b>純資産の部</b>			
元本等			
元本	1	17,045,546,776	21,374,821,874
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		4,954,019,655	4,968,797,472
元本等合計		21,999,566,431	26,343,619,346
純資産合計		21,999,566,431	26,343,619,346
負債純資産合計		22,018,847,867	26,647,436,244

## (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 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時 価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示す る価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社 の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値 (平均値)等で評価しております。

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25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。	同左

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	[2022年 1月25日現在]	[2023年 1月25日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首にお ける当該親投資信託の元本額	14,840,406,534円	17,045,546,776円
同期中における追加設定元本額	4,350,928,344円	6,239,322,394円
同期中における一部解約元本額	2,145,788,102円	1,910,047,296円
同期末における元本額	17,045,546,776円	21,374,821,874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 >	742,152,891円	740,017,614円
円資産バランスファンド2019 - 05 < 適格機 関投資家限定 >	2,710,606,047円	2,702,697,087円
円資産バランスファンド2019 - 09 < 適格機 関投資家限定 >	2,001,529,487円	1,995,337,655円
円資産バランスファンド2019 - 12 < 適格機 関投資家限定 >	2,750,256,361円	2,741,645,200円
東京海上セレクション・日本債券インデッ クス	3,499,610,089円	4,119,021,651円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1 回決算型)	274,448,183円	335,799,208円
東京海上・円資産インデックスバラン スファンド	74,378,615円	123,940,209円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035	166,165,124円	448,775,451円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	77,029,594円	198,477,144円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	45,230,199円	112,567,400円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	75,172,530円	154,405,490円

TMA日本債券インデックスVA<適格機関投資家限定>	88,262,058円	51,539,061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>	528,985,806円	746,831,532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>	1,753,322,194円	2,452,205,866円
円資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	1,696,618,095円	1,690,539,491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）	561,779,503円	2,761,021,815円
計	17,045,546,776円	21,374,821,874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	17,045,546,776口	21,374,821,874口

（注）\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

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

・ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2022年 1月25日現在]	[2023年 1月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	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。

（有価証券に関する注記）

（自 2021年1月26日 至 2022年1月25日）

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	131,059,200円
地方債証券	3,957,300円
特殊債券	581,000円
社債券	5,225,981円
合計	140,823,481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11月11日から2022年1月25日まで)を指しております。

(自 2022年1月26日 至 2023年1月25日)

#### 売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	285,222,370円
地方債証券	9,216,300円
特殊債券	806,000円
社債券	9,455,887円
合計	304,700,557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(2022年11月11日から2023年1月25日まで)を指しております。

(1口当たり情報に関する注記)

[2022年 1月25日現在]		[2023年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額	1.2906円	1口当たり純資産額	1.2325円
(1万口当たり純資産額)	12,906円)	(1万口当たり純資産額)	12,325円)

### (3) 附属明細表

#### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式

該当事項はありません。

##### (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
国債証券	第432回利付国債(2年)	37,000,000	37,022,200	
	第433回利付国債(2年)	37,000,000	37,020,350	
	第434回利付国債(2年)	273,000,000	273,147,420	
	第435回利付国債(2年)	210,000,000	210,111,300	
	第436回利付国債(2年)	120,000,000	120,060,000	
	第437回利付国債(2年)	131,000,000	131,061,570	
	第438回利付国債(2年)	115,000,000	115,048,300	
	第439回利付国債(2年)	190,000,000	190,085,500	
	第440回利付国債(2年)	73,000,000	73,034,310	
	第441回利付国債(2年)	48,000,000	48,024,000	
	第442回利付国債(2年)	20,000,000	20,008,800	

第139回利付国債(5年)	169,000,000	169,270,400	
第140回利付国債(5年)	150,000,000	150,250,500	
第141回利付国債(5年)	250,000,000	250,492,500	
第142回利付国債(5年)	309,000,000	309,673,620	
第143回利付国債(5年)	319,000,000	319,752,840	
第144回利付国債(5年)	330,000,000	330,828,300	
第145回利付国債(5年)	306,000,000	306,850,680	
第146回利付国債(5年)	375,000,000	376,083,750	
第147回利付国債(5年)	308,000,000	307,950,720	
第148回利付国債(5年)	281,000,000	280,808,920	
第149回利付国債(5年)	280,000,000	279,591,200	
第150回利付国債(5年)	152,000,000	151,615,440	
第151回利付国債(5年)	225,000,000	224,115,750	
第152回利付国債(5年)	227,000,000	227,000,000	
第153回利付国債(5年)	180,000,000	179,055,000	
第154回利付国債(5年)	216,000,000	215,550,720	
第5回利付国債(40年)	36,000,000	40,179,600	
第6回利付国債(40年)	64,000,000	69,457,920	
第7回利付国債(40年)	79,000,000	81,832,150	
第8回利付国債(40年)	65,000,000	62,372,700	
第9回利付国債(40年)	91,000,000	63,757,330	
第10回利付国債(40年)	119,000,000	98,326,130	
第11回利付国債(40年)	79,000,000	62,804,210	
第12回利付国債(40年)	83,000,000	58,665,230	
第13回利付国債(40年)	80,000,000	56,098,400	
第14回利付国債(40年)	77,000,000	57,647,590	
第15回利付国債(40年)	63,000,000	51,425,640	
第333回利付国債(10年)	63,000,000	63,461,790	
第334回利付国債(10年)	30,000,000	30,259,800	
第335回利付国債(10年)	180,000,000	181,542,600	
第336回利付国債(10年)	68,000,000	68,665,040	
第337回利付国債(10年)	65,000,000	65,388,700	
第338回利付国債(10年)	101,000,000	101,887,790	
第339回利付国債(10年)	160,000,000	161,553,600	
第340回利付国債(10年)	70,000,000	70,751,100	
第341回利付国債(10年)	90,000,000	90,782,100	
第342回利付国債(10年)	200,000,000	200,564,000	
第343回利付国債(10年)	195,000,000	195,495,300	
第344回利付国債(10年)	215,000,000	215,430,000	
第345回利付国債(10年)	160,000,000	160,185,600	
第346回利付国債(10年)	234,000,000	234,000,000	
第347回利付国債(10年)	280,000,000	279,692,000	
第348回利付国債(10年)	290,000,000	289,396,800	
第349回利付国債(10年)	258,000,000	257,058,300	
第350回利付国債(10年)	274,000,000	272,673,840	

第351回利付国債(10年)	252,000,000	250,518,240	
第352回利付国債(10年)	260,000,000	258,115,000	
第353回利付国債(10年)	185,000,000	183,386,800	
第354回利付国債(10年)	281,000,000	278,111,320	
第355回利付国債(10年)	278,000,000	274,594,500	
第356回利付国債(10年)	263,000,000	259,399,530	
第357回利付国債(10年)	339,000,000	333,850,590	
第358回利付国債(10年)	288,000,000	283,772,160	
第359回利付国債(10年)	275,000,000	269,555,000	
第360回利付国債(10年)	273,000,000	266,920,290	
第361回利付国債(10年)	258,000,000	251,591,280	
第362回利付国債(10年)	260,000,000	253,146,400	
第363回利付国債(10年)	258,000,000	250,794,060	
第364回利付国債(10年)	272,000,000	264,073,920	
第365回利付国債(10年)	234,000,000	227,185,920	
第366回利付国債(10年)	265,000,000	260,553,300	
第367回利付国債(10年)	218,000,000	217,596,700	
第368回利付国債(10年)	187,000,000	187,888,250	
第1回利付国債(30年)	5,000,000	5,818,700	
第2回利付国債(30年)	24,000,000	27,469,440	
第3回利付国債(30年)	20,000,000	22,796,800	
第5回利付国債(30年)	40,000,000	45,755,200	
第18回利付国債(30年)	4,000,000	4,713,720	
第21回利付国債(30年)	7,000,000	8,261,470	
第22回利付国債(30年)	8,000,000	9,646,240	
第25回利付国債(30年)	5,000,000	5,904,850	
第26回利付国債(30年)	11,000,000	13,144,560	
第27回利付国債(30年)	8,000,000	9,669,200	
第28回利付国債(30年)	20,000,000	24,168,400	
第29回利付国債(30年)	50,000,000	59,674,000	
第31回利付国債(30年)	44,000,000	51,062,000	
第32回利付国債(30年)	13,000,000	15,250,170	
第33回利付国債(30年)	45,000,000	50,574,600	
第34回利付国債(30年)	53,000,000	61,216,590	
第35回利付国債(30年)	40,000,000	44,944,800	
第36回利付国債(30年)	53,000,000	59,507,870	
第37回利付国債(30年)	64,000,000	70,785,280	
第38回利付国債(30年)	66,000,000	71,783,580	
第39回利付国債(30年)	65,000,000	71,808,100	
第40回利付国債(30年)	58,000,000	62,976,980	
第41回利付国債(30年)	56,000,000	59,730,160	
第42回利付国債(30年)	65,000,000	69,254,900	
第43回利付国債(30年)	56,000,000	59,599,680	
第44回利付国債(30年)	57,000,000	60,595,560	
第45回利付国債(30年)	60,000,000	61,468,800	

第46回利付国債(30年)	65,000,000	66,491,750	
第47回利付国債(30年)	67,000,000	69,700,100	
第48回利付国債(30年)	68,000,000	68,058,480	
第49回利付国債(30年)	68,000,000	67,940,840	
第50回利付国債(30年)	73,000,000	64,220,290	
第51回利付国債(30年)	77,000,000	59,907,540	
第52回利付国債(30年)	72,000,000	58,662,720	
第53回利付国債(30年)	74,000,000	61,579,100	
第54回利付国債(30年)	72,000,000	62,622,000	
第55回利付国債(30年)	70,000,000	60,705,400	
第56回利付国債(30年)	69,000,000	59,663,610	
第57回利付国債(30年)	75,000,000	64,662,000	
第58回利付国債(30年)	79,000,000	67,910,770	
第59回利付国債(30年)	77,000,000	64,426,670	
第60回利付国債(30年)	76,000,000	66,627,680	
第61回利付国債(30年)	76,000,000	63,185,640	
第62回利付国債(30年)	81,000,000	63,694,350	
第63回利付国債(30年)	79,000,000	60,177,460	
第64回利付国債(30年)	78,000,000	59,185,620	
第65回利付国債(30年)	85,000,000	64,484,400	
第66回利付国債(30年)	82,000,000	62,027,260	
第67回利付国債(30年)	80,000,000	63,789,600	
第68回利付国債(30年)	84,000,000	66,808,560	
第69回利付国債(30年)	96,000,000	78,351,360	
第70回利付国債(30年)	107,000,000	87,127,960	
第71回利付国債(30年)	82,000,000	66,678,300	
第72回利付国債(30年)	82,000,000	66,651,240	
第73回利付国債(30年)	84,000,000	68,117,280	
第74回利付国債(30年)	76,000,000	66,936,240	
第75回利付国債(30年)	130,000,000	123,561,100	
第76回利付国債(30年)	7,000,000	6,807,430	
第67回利付国債(20年)	30,000,000	30,666,600	
第70回利付国債(20年)	40,000,000	41,352,800	
第71回利付国債(20年)	45,000,000	46,395,900	
第74回利付国債(20年)	20,000,000	20,803,200	
第75回利付国債(20年)	30,000,000	31,358,100	
第76回利付国債(20年)	10,000,000	10,409,800	
第78回利付国債(20年)	10,000,000	10,456,700	
第79回利付国債(20年)	10,000,000	10,480,700	
第80回利付国債(20年)	20,000,000	21,009,200	
第81回利付国債(20年)	28,000,000	29,487,360	
第82回利付国債(20年)	40,000,000	42,230,800	
第83回利付国債(20年)	15,000,000	15,913,050	
第84回利付国債(20年)	60,000,000	63,478,200	
第85回利付国債(20年)	20,000,000	21,314,200	



第86回利付国債(20年)	20,000,000	21,440,000	
第87回利付国債(20年)	25,000,000	26,721,250	
第88回利付国債(20年)	20,000,000	21,544,400	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	21,476,400	
第90回利付国債(20年)	65,000,000	70,103,150	
第93回利付国債(20年)	8,000,000	8,629,200	
第94回利付国債(20年)	8,000,000	8,662,240	
第95回利付国債(20年)	16,000,000	17,525,600	
第99回利付国債(20年)	20,000,000	21,869,800	
第100回利付国債(20年)	20,000,000	22,053,800	
第105回利付国債(20年)	20,000,000	22,098,000	
第106回利付国債(20年)	20,000,000	22,209,600	
第107回利付国債(20年)	8,000,000	8,865,440	
第108回利付国債(20年)	25,000,000	27,413,750	
第111回利付国債(20年)	11,000,000	12,327,260	
第112回利付国債(20年)	10,000,000	11,143,800	
第113回利付国債(20年)	5,000,000	5,588,550	
第115回利付国債(20年)	10,000,000	11,280,300	
第116回利付国債(20年)	40,000,000	45,316,000	
第117回利付国債(20年)	60,000,000	67,554,600	
第120回利付国債(20年)	25,000,000	27,243,250	
第121回利付国債(20年)	30,000,000	33,389,400	
第122回利付国債(20年)	35,000,000	38,694,250	
第123回利付国債(20年)	58,000,000	65,549,280	
第124回利付国債(20年)	40,000,000	44,900,000	
第125回利付国債(20年)	45,000,000	51,368,850	
第126回利付国債(20年)	31,000,000	34,884,920	
第127回利付国債(20年)	25,000,000	27,936,000	
第128回利付国債(20年)	20,000,000	22,400,800	
第129回利付国債(20年)	28,000,000	31,134,040	
第130回利付国債(20年)	54,000,000	60,194,340	
第131回利付国債(20年)	45,000,000	49,786,200	
第132回利付国債(20年)	52,000,000	57,684,640	
第133回利付国債(20年)	71,000,000	79,370,190	
第134回利付国債(20年)	46,000,000	51,544,840	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	44,450,400	
第136回利付国債(20年)	60,000,000	66,147,600	
第137回利付国債(20年)	58,000,000	64,565,600	
第138回利付国債(20年)	47,000,000	51,449,020	
第139回利付国債(20年)	52,000,000	57,417,360	
第140回利付国債(20年)	78,000,000	86,895,900	
第141回利付国債(20年)	86,000,000	95,778,200	
第142回利付国債(20年)	72,000,000	80,866,080	
第143回利付国債(20年)	111,000,000	122,492,940	
第144回利付国債(20年)	90,000,000	98,451,900	

第145回利付国債(20年)	119,000,000	132,458,900	
第146回利付国債(20年)	106,000,000	117,966,340	
第147回利付国債(20年)	120,000,000	132,207,600	
第148回利付国債(20年)	108,000,000	117,723,240	
第149回利付国債(20年)	111,000,000	120,882,330	
第150回利付国債(20年)	129,000,000	138,874,950	
第151回利付国債(20年)	144,000,000	151,574,400	
第152回利付国債(20年)	151,000,000	158,740,260	
第153回利付国債(20年)	148,000,000	157,054,640	
第154回利付国債(20年)	145,000,000	151,923,750	
第155回利付国債(20年)	144,000,000	147,108,960	
第156回利付国債(20年)	147,000,000	138,931,170	
第157回利付国債(20年)	146,000,000	133,781,260	
第158回利付国債(20年)	154,000,000	146,333,880	
第159回利付国債(20年)	138,000,000	132,475,860	
第160回利付国債(20年)	131,000,000	127,073,930	
第161回利付国債(20年)	130,000,000	123,922,500	
第162回利付国債(20年)	107,000,000	101,595,430	
第163回利付国債(20年)	124,000,000	117,264,320	
第164回利付国債(20年)	119,000,000	110,447,470	
第165回利付国債(20年)	119,000,000	109,959,570	
第166回利付国債(20年)	116,000,000	110,099,080	
第167回利付国債(20年)	116,000,000	106,293,120	
第168回利付国債(20年)	116,000,000	104,082,160	
第169回利付国債(20年)	116,000,000	101,835,240	
第170回利付国債(20年)	120,000,000	104,794,800	
第171回利付国債(20年)	133,000,000	115,533,110	
第172回利付国債(20年)	133,000,000	116,954,880	
第173回利付国債(20年)	133,000,000	116,428,200	
第174回利付国債(20年)	130,000,000	113,202,700	
第175回利付国債(20年)	143,000,000	126,296,170	
第176回利付国債(20年)	159,000,000	139,913,640	
第177回利付国債(20年)	120,000,000	103,351,200	
第178回利付国債(20年)	118,000,000	103,209,880	
第179回利付国債(20年)	128,000,000	111,617,280	
第180回利付国債(20年)	120,000,000	110,378,400	
第181回利付国債(20年)	125,000,000	116,891,250	
第182回利付国債(20年)	145,000,000	140,349,850	
国債証券 合計	24,153,000,000	23,707,574,480	

地方債証券	第781回東京都公募公債	100,000,000	99,018,000	
	平成30年度第11回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,989,000	
	第26回神奈川県公募公債(20年)	20,000,000	21,369,200	
	第6回大阪府公募公債(20年)	50,000,000	55,145,000	
	平成28年度第2回京都府公募公債(15年)	50,000,000	48,335,000	
	第2回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	105,099,000	
	第4回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,503,000	
	平成31年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	97,888,000	
	平成29年度第7回広島県公募公債	100,000,000	99,340,000	
	平成25年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	100,597,000	
	平成27年度第3回福岡県公募公債	200,000,000	202,104,000	
	令和4年度第1回長野県公募公債(10年)	100,000,000	97,068,000	
	令和元年度第3回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	96,948,000	
地方債証券 合計		1,220,000,000	1,231,403,200	
特殊債券	第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,184,000	
	第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,691,000	
特殊債券 合計		200,000,000	199,875,000	

社債券	第106回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,839,000	
	第33回道路債券	100,000,000	120,923,000	
	第23回国際協力銀行債券	100,000,000	105,553,000	
	第101回都市再生債券	100,000,000	102,507,000	
	第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,247,000	25,107,283	
	第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,069,000	28,010,459	
	第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,848,000	26,744,667	
	第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,786,000	28,817,138	
	第16回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	100,673,000	
	第118回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,526,000	
	第83回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,743,000	
	第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,599,000	
	第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	94,841,000	
	第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,401,000	
社債券 合計	1,104,950,000	1,137,284,547		
合計	26,677,950,000	26,276,137,227		

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

## 「東京海上・東証REITマザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	[2022年 1月25日現在]	[2023年 1月25日現在]
		金額（円）	金額（円）
<b>資産の部</b>			
流動資産			
コール・ローン		225,468,000	238,738,949
投資証券		12,712,447,000	11,860,332,800
未収入金		198,400,467	216,832,007
未収配当金		65,250,557	80,021,894
前払金		18,944,000	11,388,710
差入委託証拠金		16,280,000	20,001,000
流動資産合計		13,236,790,024	12,427,315,360
資産合計		13,236,790,024	12,427,315,360
<b>負債の部</b>			
流動負債			
派生商品評価勘定		20,514,280	12,912,680
未払解約金		203,641,811	213,960,520
未払利息		238	115
流動負債合計		224,156,329	226,873,315
負債合計		224,156,329	226,873,315
<b>純資産の部</b>			
元本等			
元本	1	9,592,289,990	8,878,547,954
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,420,343,705	3,321,894,091
元本等合計		13,012,633,695	12,200,442,045
純資産合計		13,012,633,695	12,200,442,045
負債純資産合計		13,236,790,024	12,427,315,360

## (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 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25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。	同左

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	[2022年 1月25日現在]	[2023年 1月25日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	6,077,766,991円	9,592,289,990円
同期中における追加設定元本額	7,366,347,707円	4,323,943,581円
同期中における一部解約元本額	3,851,824,708円	5,037,685,617円
同期末における元本額	9,592,289,990円	8,878,547,954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 >	114,042,614円	45,597,655円
円資産バランスファンド2019 - 05 < 適格機関投資家限定 >	416,524,290円	166,532,045円
円資産バランスファンド2019 - 09 < 適格機関投資家限定 >	307,565,326円	122,946,689円
円資産バランスファンド2019 - 12 < 適格機関投資家限定 >	422,617,346円	168,931,910円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	12,617,300円	9,417,950円
東京海上・円資産バランスファンド（3倍型）（毎月決算型）	231,181,639円	円
東京海上・円資産バランスファンド（3倍型）（年1回決算型）	272,177,684円	円
東京海上・東証REITインデックスファンド < 適格機関投資家限定 >	7,468,548,157円	8,090,839,031円
円資産バランスオープン < 適格機関投資家限定 >	260,678,773円	104,165,944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）	86,336,861円	170,116,730円

計	9,592,289,990円	8,878,547,954円
2. 1 本書における開示対象ファンドの計算期間 末日における当該親投資信託の受益権の総 数	9,592,289,990口	8,878,547,954口

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

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、先物取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2022年 1月25日現在]	[2023年 1月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左

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

## (有価証券に関する注記)

(自 2021年1月26日 至 2022年1月25日)

## 売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	345,421,638円
合計	345,421,638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1月26日から2022年1月25日まで)を指しております。

(自 2022年1月26日 至 2023年1月25日)

## 売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	418,141,376円
合計	418,141,376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(2022年1月26日から2023年1月25日まで)を指しております。



(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

(2022年1月25日現在)

(単位:円)

区 分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	296,814,000		276,316,000	20,498,000
	東証REIT指数先物	296,814,000		276,316,000	20,498,000
	合 計	296,814,000		276,316,000	20,498,000

(2023年1月25日現在)

(単位:円)

区 分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	334,944,710		322,051,500	12,893,210
	東証REIT指数先物	334,944,710		322,051,500	12,893,210
	合 計	334,944,710		322,051,500	12,893,210

(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)

[2022年 1月25日現在]		[2023年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3566円 13,566円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3741円 13,741円)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位: 円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	234	28,454,400	
	サンケイリアルエステート投資法人	369	32,988,600	
	S O S i L A 物流リート投資法人	573	75,234,900	
	東海道リート投資法人	140	16,800,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	398	230,442,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,354	204,860,200	
	産業ファンド投資法人	1,721	253,675,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,151	375,801,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	844	167,449,600	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人	608	237,728,000	
	G L P 投資法人	3,716	535,847,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	536	157,798,400	
	日本プロロジスリート投資法人	1,941	567,742,500	
	星野リゾート・リート投資法人	201	150,750,000	
	O n e リート投資法人	201	49,526,400	
	イオンリート投資法人	1,275	187,680,000	
	ヒューリックリート投資法人	1,077	166,288,800	
	日本リート投資法人	374	124,542,000	
	積水ハウス・リート投資法人	3,460	247,044,000	
	トーセイ・リート投資法人	255	33,328,500	
	ケネディクス商業リート投資法人	501	123,496,500	
	ヘルスケア & メディカル投資法人	284	47,513,200	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	299	33,248,800	
	野村不動産マスターファンド投資法人	3,724	570,516,800	
	いちごホテルリート投資法人	191	21,850,400	
	ラサールロジポート投資法人	1,410	220,806,000	
	スターアジア不動産投資法人	1,438	78,371,000	
	マリモ地方創生リート投資法人	176	22,158,400	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	455	204,522,500	
	大江戸温泉リート投資法人	186	11,513,400	
投資法人みらい	1,399	61,835,800		
森トラスト・ホテルリート投資法人	270	36,585,000		
三菱地所物流リート投資法人	396	159,786,000		
C R E ロジスティクスファンド投資法人	446	80,369,200		
ザイマックス・リート投資法人	187	21,935,100		

タカラレーベン不動産投資法人	504	49,543,200	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	502	69,978,800	
日本ビルファンド投資法人	1,343	760,138,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,151	644,560,000	
日本都市ファンド投資法人	5,810	581,581,000	
オリックス不動産投資法人	2,294	410,626,000	
日本プライムリアルティ投資法人	787	281,352,500	
N T T 都市開発リート投資法人	1,107	149,887,800	
東急リアル・エステート投資法人	772	154,322,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	847	91,221,900	
ユナイテッド・アーバン投資法人	2,576	385,884,800	
森トラスト総合リート投資法人	823	120,322,600	
インヴィンシブル投資法人	5,068	283,808,000	
フロンティア不動産投資法人	427	214,781,000	
平和不動産リート投資法人	787	120,253,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	776	233,576,000	
福岡リート投資法人	596	98,936,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	670	209,375,000	
いちごオフィスリート投資法人	944	80,145,600	
大和証券オフィス投資法人	239	149,614,000	
阪急阪神リート投資法人	520	75,296,000	
スターツプロシード投資法人	200	45,160,000	
大和ハウスリート投資法人	1,736	486,253,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	3,713	318,204,100	
大和証券リビング投資法人	1,596	173,964,000	
ジャパンエクセレント投資法人	1,056	133,056,000	
投資証券 合計	68,634	11,860,332,800	
合計	68,634	11,860,332,800	

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。

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

2023年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	219,176,323 円
負債総額	413,457 円
純資産総額（ - ）	218,762,866 円
発行済数量	219,650,693 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.9960 円

（ご参考：親投資信託の現況）

### TMA日本株TOPIXマザーファンド

2023年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	42,404,851,832 円
負債総額	129,883,031 円
純資産総額（ - ）	42,274,968,801 円
発行済数量	23,833,878,496 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.7737 円

### TMA日本債券インデックスマザーファンド

2023年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	26,749,864,818 円
負債総額	424,962,123 円
純資産総額（ - ）	26,324,902,695 円
発行済数量	21,501,362,495 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.2243 円

### 東京海上・東証REITマザーファンド

2023年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	12,182,083,515 円
負債総額	13,821,568 円
純資産総額（ - ）	12,168,261,947 円
発行済数量	8,879,994,676 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.3703 円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

### 1. 名義書換

該当事項はありません。

### 2. 受益者に対する特典

特典はありません。

### 3. 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

### 4. 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

### 5. 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

### 6. 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

### 7. 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）にお支払いします。

### 8. 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

2023年1月末日現在、資本金の額は20億円です。なお、会社の発行可能株式総数は160,000株であり、38,300株を発行済みです。

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

投資信託の投資運用の意思決定プロセスは以下の通りです。

運用本部で運用計画案、収益分配方針案等の運用の基本方針案を作成します。

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

決定された運用の基本方針に基づき、具体的運用計画を策定し、運用を行います。

売買の執行はトレーディング部が行います。

運用部門とは独立した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。

2023年1月末日現在、委託会社が運用を行っている証券投資信託（親投資信託を除きます。）は次の通りです。

	本数	純資産総額（百万円）
追加型公社債投資信託	0	0
追加型株式投資信託	166	4,284,716
単位型公社債投資信託	2	3,570
単位型株式投資信託	11	39,279
合計	179	4,327,566

### 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37期事業年度(2021年4月1日から2022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(2022年4月1日から2022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36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金	22,550,090	21,389,756
前払費用	235,902	319,734
未収委託者報酬	2,973,733	2,902,834
未収収益	2,375,688	2,610,213
未収入金	3,865	1,692
その他の流動資産	21,479	22,412
<b>流動資産計</b>	<b>28,160,759</b>	<b>27,246,644</b>
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	* 1 530,601	* 1 459,081
建物	354,556	342,403
器具備品	176,045	116,678
無形固定資産	137,430	228,727
電話加入権	3,795	3,795
ソフトウェア	89,839	188,720
ソフトウェア仮勘定	43,795	36,211
投資その他の資産	3,057,965	3,576,825
投資有価証券	49,477	42,253
関係会社株式	1,673,049	1,673,049
その他の関係会社有価証券	71,200	521,200
長期前払費用	45,424	40,588
敷金	474,324	474,324
その他長期差入保証金	10,030	21,230
繰延税金資産	734,459	804,178
<b>固定資産計</b>	<b>3,725,997</b>	<b>4,264,634</b>
<b>資産合計</b>	<b>31,886,757</b>	<b>31,511,279</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払金	2,979,963	3,183,398
未払手数料	1,349,326	1,306,204
その他未払金	1,630,636	1,877,194
未払費用	429,654	398,447
未払消費税等	468,610	277,096
未払法人税等	1,378,000	1,152,000
預り金	45,524	46,775
前受収益	2,329	2,286
賞与引当金	273,836	287,955
その他の流動負債	946	7
<b>流動負債計</b>	<b>5,578,864</b>	<b>5,347,968</b>
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	802,176	845,039
<b>固定負債計</b>	<b>802,176</b>	<b>845,039</b>
<b>負債合計</b>	<b>6,381,041</b>	<b>6,193,007</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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	23,099,322	22,912,741
利益準備金	500,000	500,000
その他利益剰余金	22,599,322	22,412,741
特別償却準備金	0	-
繰越利益剰余金	22,599,322	22,412,741



評価・換算差額等	6,393	5,529
その他有価証券評価差額金	6,393	5,529
純資産合計	25,505,715	25,318,271
負債・純資産合計	31,886,757	31,511,279

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	17,997,091	18,065,913
運用受託報酬	9,745,973	10,405,866
投資助言報酬	59,827	66,255
その他営業収益	453,173	532,829
営業収益計	28,256,066	29,070,864
営業費用		
支払手数料	8,444,858	8,365,057
広告宣伝費	233,667	216,312
調査費	6,150,198	6,860,898
調査費	2,540,308	2,728,988
委託調査費	3,609,889	4,131,910
委託計算費	118,443	115,017
営業雑経費	278,728	259,680
通信費	44,106	38,574
印刷費	189,670	175,527
協会費	26,080	24,866
諸会費	10,102	11,208
図書費	8,768	9,504
営業費用計	15,225,895	15,816,967
一般管理費		
給料	3,799,821	3,925,627
役員報酬	129,108	128,277
給料・手当	2,761,131	2,779,798
賞与	909,581	1,017,551
交際費	4,415	4,546
寄付金	3,449	2,632
旅費交通費	13,735	17,590
租税公課	170,294	167,411
不動産賃借料	375,691	468,092
退職給付費用	156,614	161,994
賞与引当金繰入	273,836	287,955
固定資産減価償却費	139,782	165,703
法定福利費	596,481	630,892
福利厚生費	10,114	12,315
諸経費	394,336	487,975
一般管理費計	5,938,574	6,332,736
営業利益	7,091,595	6,921,159
営業外収益		
受取利息	455	206
受取配当金	* 1 7,512	* 1 5,672
匿名組合投資利益	* 1 60,878	-
雑益	9,958	13,622
営業外収益計	78,804	19,500
営業外費用		
為替差損	44,450	66,106
雑損	5,811	23,333
営業外費用計	50,261	89,440
経常利益	7,120,138	6,851,219

特別損失		
器具備品除却損	0	610
特別損失計	0	610
税引前当期純利益	7,120,138	6,850,609
法人税、住民税及び事業税	2,197,641	2,169,313
法人税等調整額	14,721	69,337
法人税等合計	2,182,919	2,099,975
当期純利益	4,937,219	4,750,633

**(3)【株主資本等変動計算書】**

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

第37期(自 2021年4月1日 至 2022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	22,599,322
当期変動額						
剰余金の配当						4,937,214
特別償却準備金の取崩					0	0
当期純利益						4,750,633
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	186,580
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	-	22,412,741

	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	-	-			-
当期純利益	4,750,633	4,750,633			4,750,633
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			863	863	863
当期変動額合計	186,580	186,580	863	863	187,444
当期末残高	22,912,741	25,312,741	5,529	5,529	25,318,271

## 注記事項

（重要な会計方針）

第37期 自 2021年4月1日 至 2022年3月31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 当事業年度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</p>

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. 収益及び費用の計上基準

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。

### (1) 運用報酬

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。

### (重要な会計上の見積り)

第36期 2021年3月31日現在	第37期 2022年3月31日現在
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。	同左

### (会計方針の変更)

第37期 自 2021年4月1日 至 2022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 2020年3月31日)等を当事業年度の期首から適用し、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。

また、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識関係」注記については記載しておりません。

「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)等を当事業年度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)」を当事業年度の期首から早期適用しております。なお、当該変更による財務諸表に与える影響はございません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日)第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

(貸借対照表関係)

第36期 2021年3月31日現在	第37期 2022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 148,089千円	建物 182,121千円
器具備品 458,314千円	器具備品 501,021千円

(損益計算書関係)

第36期 自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	第37期 自 2021年4月1日 至 2022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 2,000千円	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	上記のほか、関係会社に対する営業外収益のうち、雑益の合計額は営業外収益の総額の100分の10を超えており、その金額は8,520千円であります。

(株主資本等変動計算書関係)

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) 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

第37期(自 2021年4月1日 至 2022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	2021年4月1日 現在	増加	減少	2022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

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

(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  
2022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	4,750,617千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	124,037円
(ニ) 基準日	2022年3月31日
(ホ) 効力発生日	2022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36期 自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	第37期 自 2021年4月1日 至 2022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。	(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 同左

<p>市場リスク 未収委託者報酬には、運用資産の悪化から回収できず当社が損失を被るリスクが存在しますが、過去の回収実績からリスクは僅少であると判断しております。</p> <p>投資有価証券については、管理部門において定期的に時価を把握する体制としております。</p> <p>流動性リスク 当社は、日々資金残高管理を行っており流動性リスクを管理しております。</p>	<p>市場リスク 同左</p> <p>流動性リスク 同左</p>
--	--

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

第36期（2021年3月31日現在）

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。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
投資有価証券 其他有価証券	49,477	49,477	-
資産計	49,477	49,477	-

（注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

（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

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  
該当事項はありません。

（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

（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
投資有価証券 其他有価証券のうち満期が あるもの	8,474	16,416	5,279	-
合計	8,474	16,416	5,279	-

第37期（2022年3月31日現在）

2022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。

(単位：千円)

	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	42,253	42,253	-
敷金	474,324	474,362	37
資産計	516,578	516,616	37

(注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

(注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。これらの貸借対照表計上額は、それぞれ以下のとおりです。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額
関係会社株式	
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	520,000

(注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、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。

(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

(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
投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	-	21,628	538	-
合計	-	21,628	538	-

### 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

第37期(2022年3月31日現在)

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	-	42,253	-	42,253
資産計	-	42,253	-	42,253

## (2)時価で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	-	474,362	-	474,362
資産計	-	474,362	-	474,362

(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)

第36期 2021年3月31日現在	第37期 2022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 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>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 521,200千円）は、市場価格のない株式等又は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>	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	<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>37,421</td> <td>28,638</td> <td>8,783</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>4,832</td> <td>5,645</td> <td>813</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>42,253</td> <td>34,283</td> <td>7,970</td> </tr> </tbody> </table>	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	37,421	28,638	8,783	貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの証券投資信託	4,832	5,645	813	合計	42,253	34,283	7,970
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	37,421	28,638	8,783																														
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの証券投資信託	4,832	5,645	813																														
合計	42,253	34,283	7,970																														
<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>	<p>3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 同左</p>																																

## (収益認識関係)

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

（単位：千円）

	運用報酬	成功報酬	合計
委託者報酬	18,065,913	-	18,065,913
運用受託報酬	10,155,263	250,602	10,405,866
投資助言報酬	66,255	-	66,255
その他営業収益	532,829	-	532,829
合計	28,820,261	250,602	29,070,864

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事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度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

	第37期 自 2021年4月1日 至 2022年3月31日
顧客との契約から生じた債権（期首残高）	5,349,421千円
顧客との契約から生じた債権（期末残高）	5,513,048千円

（\*）なお、当事業年度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。

（退職給付関係）

	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	<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>
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。

## 第37期

自 2021年4月1日  
至 2022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	800,611千円
勤務費用	69,820千円
利息費用	3,143千円
数理計算上の差異の発生額	9,121千円
退職給付の支払額	29,833千円
退職給付債務の期末残高	852,862千円

## (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	852,862千円
未積立退職給付債務	852,862千円
未認識数理計算上の差異	7,823千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	845,039千円
退職給付引当金	845,039千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	845,039千円

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	69,820千円
利息費用	3,143千円
数理計算上の差異の費用処理額	267千円
その他	10,130千円
確定給付制度に係る退職給付費用	82,826千円

## (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、79,167千円であります。

## (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36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
繰延税金資産		
退職給付引当金	245,626千円	258,750千円
未払金	3,859千円	3,366千円
賞与引当金	83,848千円	88,171千円
未払法定福利費	10,817千円	11,424千円
未払事業所税	3,840千円	3,958千円
未払事業税	81,915千円	61,773千円
未払調査費	79,792千円	90,375千円
減価償却超過額	86,208千円	53,430千円
繰延資産超過額	6,297千円	8,569千円
未払確定拠出年金	1,901千円	2,038千円

未収実績連動報酬	31,761千円	31,195千円
未払費用	101,413千円	195,620千円
繰延税金資産小計	737,281千円	808,674千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	737,281千円	808,674千円
繰延税金負債		
特別償却準備金	0千円	-
前払費用	-	2,055千円
その他有価証券評価差額金	2,821千円	2,440千円
繰延税金負債合計	2,821千円	4,495千円
繰延税金資産の純額	734,459千円	804,178千円

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36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022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36期 自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	第37期 自 2021年4月1日 至 2022年3月31日
<p>[セグメント情報]</p> <p>当社は「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として運用(投資運用業)を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。</p> <p>当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。</p>	<p>[セグメント情報]</p> <p>同左</p>

[関連情報]	[関連情報]						
<p>1. 製品及びサービスごとの情報 単一のサービス区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>2. 地域ごとの情報 (1) 営業収益 本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。</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 5,399,003千円</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>	<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 (単位：千円)</p> <table border="1" data-bbox="735 421 1386 499"> <thead> <tr> <th>日本</th> <th>その他</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>26,067,627</td> <td>3,003,236</td> <td>29,070,864</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 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 4,883,617千円</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	26,067,627	3,003,236	29,070,864
日本	その他	合計					
26,067,627	3,003,236	29,070,864					

## (関連当事者情報)

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。

第37期（自 2021年4月1日 至 2022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

第37期	
自 2021年4月1日 至 2022年3月31日	
1株当たり純資産額	661,051円47銭
1株当たり当期純利益金額	124,037円43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	25,318,271千円
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	25,318,271千円
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	4,750,633千円
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	4,750,633千円
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 (2022年9月30日現在)		
資産の部		
流動資産		
現金・預金		17,994,626
前払費用		367,597
未収委託者報酬		2,946,097
未収収益		3,610,460
未収入金		70,671
その他の流動資産		21,822
流動資産計		25,011,275
固定資産		
有形固定資産	* 1	429,724
建物		324,725
器具備品		104,998
無形固定資産		273,797
電話加入権		3,795
ソフトウェア		233,770
ソフトウェア仮勘定		36,231
投資その他の資産		3,827,207
投資有価証券		46,115
関係会社株式		1,668,529
その他の関係会社有価証券		521,200
長期前払費用		33,730
敷金		474,324
その他長期差入保証金		21,230
繰延税金資産		1,062,078
固定資産計		4,530,728
資産合計		29,542,004
負債の部		
流動負債		
未払金		3,234,993
未払手数料		1,321,684
その他未払金		1,913,309
未払費用		416,430
未払消費税等	* 2	245,577
未払法人税等		1,367,000
預り金		55,011
前受収益		13,288
賞与引当金		553,291
その他の流動負債		2
流動負債計		5,885,596
固定負債		
退職給付引当金		877,359
固定負債計		877,359
負債合計		6,762,955
純資産の部		
株主資本		22,774,241
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	20,374,241
利益準備金	500,000
その他利益剰余金	19,874,241
繰越利益剰余金	19,874,241
評価・換算差額等	4,807
その他有価証券評価差額金	4,807
純資産合計	22,779,048
負債・純資産合計	29,542,004

## 中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		8,414,996
運用受託報酬		5,607,564
投資助言報酬		44,381
その他営業収益		334,427
営業収益計		14,401,371
営業費用		
支払手数料		3,853,230
広告宣伝費		90,593
調査費		3,725,578
調査費		1,453,274
委託調査費		2,272,304
委託計算費		60,171
営業雑経費		136,343
通信費		29,024
印刷費		81,348
協会費		12,709
諸会費		7,967
図書費		5,294
営業費用計		7,865,917
一般管理費		
給料		1,588,913
役員報酬		41,826
給料・手当		1,415,861
賞与		131,225
交際費		6,167
旅費交通費		55,849
租税公課		89,915
不動産賃借料		234,045
退職給付費用		79,604
賞与引当金繰入		553,291
固定資産減価償却費	* 1	73,707
法定福利費		317,168
福利厚生費		9,139
諸経費		219,934
一般管理費計		3,227,737
営業利益		3,307,716

営業外収益	
受取利息	69
受取配当金	3,874
雑益	4,981
営業外収益計	8,924
営業外費用	
為替差損	68,678
雑損	6,021
営業外費用計	74,699
経常利益	3,241,941
特別利益	
投資有価証券売却益	480
特別利益計	480
特別損失	
器具備品除却損	141
特別損失計	141
税引前中間純利益	3,242,280
法人税、住民税及び事業税	1,287,744
法人税等調整額	257,580
法人税等合計	1,030,164
中間純利益	2,212,116

## 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	22,412,741
当中間期変動額					
剰余金の配当					4,750,617
中間純利益					2,212,116
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	-	-	-	-	2,538,500
当中間期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	19,874,241

	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	22,912,741	25,312,741	5,529	5,529	25,318,271
当中間期変動額					
剰余金の配当	4,750,617	4,750,617			4,750,617
中間純利益	2,212,116	2,212,116			2,212,116

株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)			722	722	722
当中間期変動額合計	2,538,500	2,538,500	722	722	2,539,222
当中間期末残高	20,374,241	22,774,241	4,807	4,807	22,779,048

## 注記事項

## (重要な会計方針)

当中間会計期間 自 2022年4月1日 至 2022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。

## (中間貸借対照表関係)

	当中間会計期間 (2022年9月30日現在)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	建物	199,799千円
	器具備品	439,033千円
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 2022年4月1日 至 2022年9月30日	
1 減価償却実施額	有形固定資産	46,482千円
	無形固定資産	27,225千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 自 2022年4月1日 至 2022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				
2022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・・・・・・・・・・4,750,617千円				
(ロ) 1株当たり配当額・・・・・・・・・・124,037円				
(ハ) 基準日・・・・・・・・・・2022年3月31日				
(ニ) 効力発生日・・・・・・・・・・2022年6月30日				

## (金融商品関係)

当中間会計期間(2022年9月30日現在)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

2022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	46,115	46,115	-
敷金	474,324	474,573	248
資産計	520,439	520,688	248

(注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

(注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。

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額
関係会社株式	
子会社株式	1,640,302
関連会社株式	28,227
その他の関係会社有価証券	520,000

(注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 其他有価証券	-	46,115	-	46,115
資産計	-	46,115	-	46,115

### (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			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
敷金	-	474,573	-	474,573
資産計	-	474,573	-	474,573

(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（2022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	25,091	16,555	8,535
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	21,023	22,630	1,606
合計		46,115	39,185	6,929

## （収益認識関係）

当中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

（単位：千円）

	運用報酬	成功報酬	合計
委託者報酬	8,414,996	-	8,414,996
運用受託報酬	5,607,564	-	5,607,564
投資助言報酬	44,381	-	44,381
その他営業収益	334,427	-	334,427
合計	14,401,371	-	14,401,371

## 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

	当中間会計期間 自 2022年4月1日 至 2022年9月30日
顧客との契約から生じた債権（期首残高）	5,513,048千円
顧客との契約から生じた債権（期末残高）	6,556,557千円

（\*）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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022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
12,643,672	1,757,698	14,401,371

(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)	2,123,905	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 2022年4月1日 至 2022年9月30日	
1株当たり純資産額	594,753円23銭
1株当たり中間純利益金額	57,757円60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おりません。	
(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	22,779,048千円
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	22,779,048千円
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	2,212,116千円
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	2,212,116千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株



#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常の実行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（2022年3月末日現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

#### <参考情報：再信託受託会社の概要>

- ・ 名称 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 10,000百万円（2022年3月末日現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額（ ）	事業の内容
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。
SMB C日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社SBI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	17,495百万円	
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

( ) 2022年3月末日現在。

### 2【関係業務の概要】

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

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

### 3【資本関係】

資本関係はありません。

### 第3【その他】

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

# 独立監査人の監査報告書

2022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2022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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

## 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、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. 上記の監査報告書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

2023年4月5日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 久保 直毅

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上・円資産インデックスバランスファンドの2022年1月26日から2023年1月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上・円資産インデックスバランスファンドの2023年1月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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。

## 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. 上記の監査報告書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

2022年12月5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2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間(2022年4月1日から2022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2022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(2022年4月1日から2022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. 上記の監査報告書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。