

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式 特化型 (課税上は株式投資信託として取扱われます。)	
信託期間	無期限 (2003年3月18日設定)	
運用方針	信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。	
主要投資対象	東海3県ファンド (確定拠出年金)	TMA東海3県マザーファンド
	TMA東海3県マザーファンド	東海3県に本社があり、証券取引所に上場している日本法人の株式 (これらに準じるものを含みます。)
投資制限	東海3県ファンド (確定拠出年金)	株式への投資割合は、制限なし 外貨建資産への実質投資割合は、20%以下
	TMA東海3県マザーファンド	株式への投資割合は、制限なし 外貨建資産への投資割合は、20%以下
分配方針	毎決算時 (原則として6月20日) に経費控除後の利子、配当等収益および売買益などのうちから、基準価額水準等を勘案して、分配を行う方針です。	

- 当ファンドは特化型運用を行います。特化型ファンドとは、投資対象に一般社団法人投資信託協会の規則に定める支配的な銘柄が存在し、または存在することとなる可能性が高いファンドをいいます。
- 当ファンドの主要投資対象には寄与度 (投資対象候補銘柄の時価総額に占める割合) が10%を超えるまたは超える可能性の高い支配的な銘柄が存在するため、特定の銘柄への投資が集中することがあり、当該支配的な銘柄に経営破綻や経営・財務状況の悪化等が生じた場合には、大きな損失が発生することがあります。

東海3県ファンド (確定拠出年金)

第19期 運用報告書 (全体版)
(決算日 2021年6月21日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。
さて、「東海3県ファンド (確定拠出年金)」は、このたび、第19期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。
今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

東京都千代田区丸の内1-8-2 鉄鋼ビルディング

お問い合わせ窓口
東京海上アセットマネジメント サービスデスク 0120-712-016
受付時間：営業日の9時～17時
<https://www.tokiomarineam.co.jp/>

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額		参 考	指 数		株 式 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 期 金 騰 落		騰 落	中 率		
	円	円	%		%		%	百万円
15期(2017年 6 月20日)	29,124	0	24.9	1,617.25	26.4		99.1	1,652
16期(2018年 6 月20日)	32,617	0	12.0	1,752.75	8.4		99.0	2,053
17期(2019年 6 月20日)	27,893	0	△14.5	1,559.90	△11.0		98.2	1,808
18期(2020年 6 月22日)	27,115	0	△ 2.8	1,579.09	1.2		98.3	1,934
19期(2021年 6 月21日)	34,150	0	25.9	1,899.45	20.3		98.7	2,540

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		参 考	指 数		株 式 組 入 比 率
		騰 落	率		騰 落	率	
(期 首)	円		%		%		%
2020年 6 月22日	27,115	—		1,579.09	—		98.3
6 月末	26,923	△ 0.7		1,558.77	△ 1.3		98.0
7 月末	24,619	△ 9.2		1,496.06	△ 5.3		98.6
8 月末	27,882	2.8		1,618.18	2.5		98.9
9 月末	28,545	5.3		1,625.49	2.9		98.7
10月末	27,718	2.2		1,579.33	0.0		99.0
11月末	29,818	10.0		1,754.92	11.1		99.8
12月末	31,200	15.1		1,804.68	14.3		99.6
2021年 1 月末	30,914	14.0		1,808.78	14.5		99.7
2 月末	32,177	18.7		1,864.49	18.1		95.6
3 月末	35,121	29.5		1,954.00	23.7		98.9
4 月末	33,573	23.8		1,898.24	20.2		99.2
5 月末	34,303	26.5		1,922.98	21.8		98.4
(期 末)							
2021年 6 月21日	34,150	25.9		1,899.45	20.3		98.7

(注) 騰落率は期首比です。

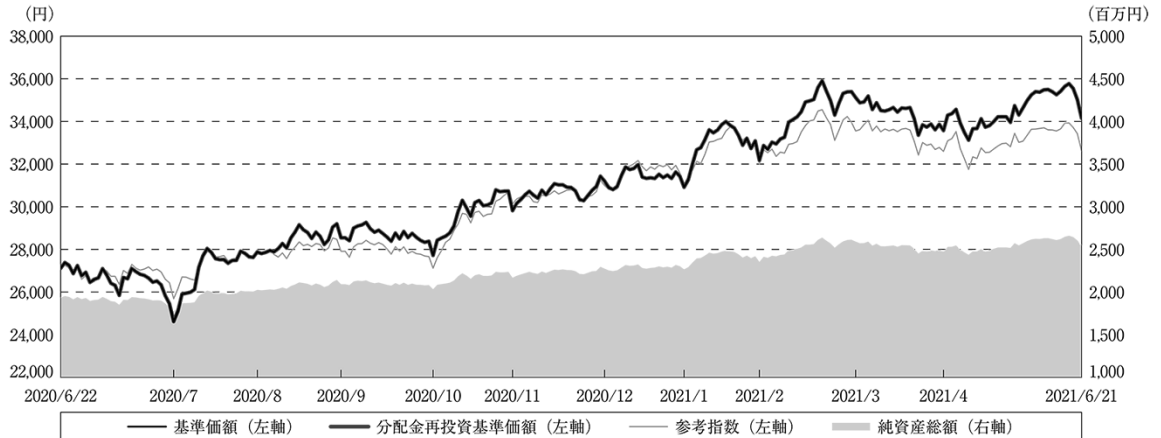
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

参考指数はTOPIX（東証株価指数）です。
TOPIXは、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

○運用経過

(2020年6月23日～2021年6月21日)

■期中の基準価額等の推移



(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、期首(2020年6月22日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

(注) 参考指数は、TOPIX(東証株価指数)です。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・主要各国による大規模な財政・金融政策
- ・新型コロナウイルスワクチンの開発や普及による経済活動正常化への期待

マイナス要因

- ・米国大統領選挙などの政治的な不確実性
- ・財政支出拡大や景気回復期待による米国長期金利の上昇

■投資環境

主要各国の大規模な財政・金融政策や新型コロナウイルスワクチンの開発進展を背景に新型コロナウイルスの感染拡大による企業業績の落ち込みからの回復が期待された一方、2020年11月の米国大統領選挙および連邦議会選挙を控えて政治的な不確実性が高まったことなどから、国内株式市場は期初から方向感のない展開となりました。

期半ば以降は、米国大統領選挙でバイデン民主党候補が勝利し、連邦議会選挙も上下両院で民主党が多数派となったことから大規模な財政支援策への期待が高まったことや、欧米で新型コロナウイルスワクチンが承認され世界的に経済活動正常化への期待が高まったことなどから、国内株式市場は大きく上昇しました。

期末にかけては、米国の財政支出拡大や景気回復期待による長期金利の上昇が嫌気されたことや米国の利上げ時期の前倒しが懸念されて上値は重くなりましたが、前期末対比で上昇しました。

■ポートフォリオについて

＜東海3県ファンド(確定拠出年金)＞

「TMA東海3県マザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持しました。

当ファンドの基準価額は、マザーファンドの値動きを反映し、25.9%上昇しました。

＜TMA東海3県マザーファンド＞

東海3県(愛知、岐阜、三重)に本社を置き、この地域を支える代表的な企業50社の株式に投資するファンドです。「時価総額の大きさに応じて投資する戦略」と「配当利回りの大きさに応じて投資する戦略」を組み合わせることによって、東海3県の経済成長を享受しながら、相対的に高い配当利回りを追求します。

当マザーファンドでは、輸送用機器、機械、陸運業などの銘柄が大きなウェイトを占めています。当期においては、2020年7月初旬と10月初旬、2021年1月初旬と4月初旬に、基本運用方針に基づき、投資対象銘柄の見直しおよび組入比率を調整するリバランス(投資配分の調整)を行いました。

当期、輸送用機器の銘柄を中心に株価が上昇し、基準価額は27.2%上昇しました。

・プラス寄与した主な業種と銘柄

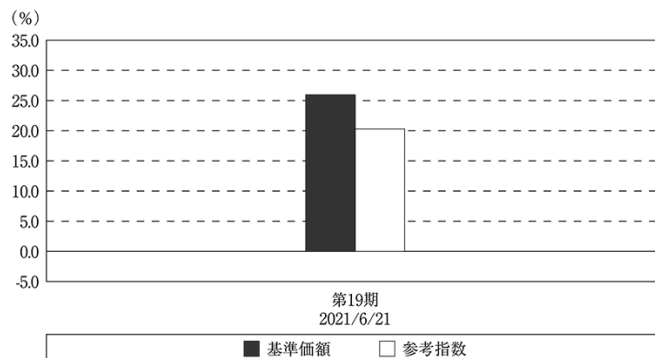
輸送用機器：デンソー、豊田自動織機

■当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けていません。

グラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

基準価額と参考指数の対比(期別騰落率)



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 参考指数は、TOPIX(東証株価指数)です。

■分配金

当期においては、当ファンドが確定拠出年金向けに設定されたファンドであるという性格を鑑み、収益分配を行わないこととしました。収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

◇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第19期
	2020年6月23日～ 2021年6月21日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	— %
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	25,285

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

<東海3県ファンド(確定拠出年金)>

「TMA東海3県マザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持します。

<TMA東海3県マザーファンド>

引き続き、個別銘柄の投資比率は「時価総額の大きさに応じて投資する戦略」と「配当利回りの大きさに応じて投資する戦略」を組み合わせることにより決定し、東海3県の経済成長を享受しながら、相対的に高い配当利回りを追求します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年6月23日～2021年6月21日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 325	% 1.075	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(159)	(0.527)	* 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
(販 売 会 社)	(133)	(0.439)	* 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
(受 託 会 社)	(33)	(0.110)	* 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	7	0.023	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
(株 式)	(7)	(0.023)	* 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) そ の 他 費 用	2	0.006	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(2)	(0.006)	* 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	334	1.104	
期中の平均基準価額は、30,232円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

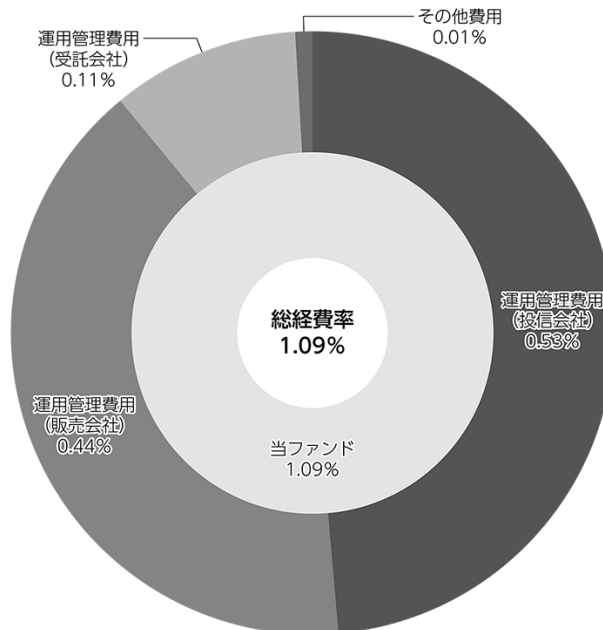
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものをみます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.09%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2020年6月23日～2021年6月21日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
TMA東海3県マザーファンド	98,729	372,025	79,959	303,033

○株式売買比率

(2020年6月23日～2021年6月21日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
	TMA東海3県マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	4,742,370千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,926,373千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.53

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2020年6月23日～2021年6月21日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2021年6月21日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
TMA東海3県マザーファンド	589,152	607,923	2,540,208

○投資信託財産の構成

(2021年6月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA東海3県マザーファンド	2,540,208	99.5
コール・ローン等、その他	13,785	0.5
投資信託財産総額	2,553,993	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年6月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,553,993,736
TMA東海3県マザーファンド(評価額)	2,540,208,110
未収入金	13,785,626
(B) 負債	13,785,626
未払解約金	558,766
未払信託報酬	13,159,804
その他未払費用	67,056
(C) 純資産総額(A－B)	2,540,208,110
元本	743,840,171
次期繰越損益金	1,796,367,939
(D) 受益権総口数	743,840,171口
1万口当たり基準価額(C／D)	34,150円

- (注) 当ファンドの期首元本額は713,599,262円、期中追加設定元本額は120,186,520円、期中一部解約元本額は89,945,611円です。
- (注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。
- (注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2020年6月23日～2021年6月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	502,720,657
売買益	539,332,716
売買損	△ 36,612,059
(B) 信託報酬等	△ 24,384,790
(C) 当期損益金(A＋B)	478,335,867
(D) 前期繰越損益金	87,002,126
(E) 追加信託差損益金	1,231,029,946
(配当等相当額)	(1,314,712,511)
(売買損益相当額)	(△ 83,682,565)
(F) 計(C＋D＋E)	1,796,367,939
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F＋G)	1,796,367,939
追加信託差損益金	1,231,029,946
(配当等相当額)	(1,315,497,776)
(売買損益相当額)	(△ 84,467,830)
分配準備積立金	565,337,993

- (注) (A)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。
- (注) (B)信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。
- (注) (E)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。
- (注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	47,322,596円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	129,445,310円
c. 信託約款に規定する収益調整金	1,315,497,776円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	388,570,087円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	1,880,835,769円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	25,285円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2021年6月21日現在)

<TMA東海3県マザーファンド>

下記は、TMA東海3県マザーファンド全体(2,224,623千口)の内容です。

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
建設業 (1.0%)			
東建コーポレーション	9.4	8.9	88,466
食料品 (0.9%)			
カゴメ	31.7	29.7	86,516
化学 (1.5%)			
アイカ工業	35.7	35.6	136,882
ゴム製品 (ー%)			
住友理工	91.9	—	—
ガラス・土石製品 (4.8%)			
日本碍子	119.8	90.6	170,871
日本特殊陶業	99.7	87.6	142,350
MARUWA	—	4.1	43,665
ニチハ	32.5	28.8	83,174
鉄鋼 (1.1%)			
大同特殊鋼	26.9	19.9	104,873
金属製品 (1.5%)			
リンナイ	15.7	13.1	134,668
機械 (8.9%)			
オークマ	25.8	10.1	52,621
F U J I	54	39.4	97,239
オーエスジー	56.8	39.9	71,540
DMG森精機	121.8	46.2	88,380
CKD	24.5	24.3	56,327
ジェイテクト	195.9	112.8	126,336
マキタ	76.7	65.5	324,880
電気機器 (4.3%)			
イビデン	46	33.1	194,959
ブラザー工業	100.3	87.4	195,950
輸送用機器 (32.8%)			
トヨタ紡織	101.4	74.2	162,943
豊田自動織機	90	71.2	666,432
デンソー	172.8	98.3	716,508
東海理化電機製作所	81	57.2	95,810
トヨタ自動車	91.2	88.4	851,999
アイシン	100.2	84.2	386,057
豊田合成	60.4	49.9	130,288
精密機器 (2.4%)			
朝日インテック	67.1	57	143,811
メニコン	12.1	10.1	73,528

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
電気・ガス業 (5.2%)			
中部電力	222.2	245.4	331,535
東邦瓦斯	30.1	26.1	145,377
陸運業 (10.0%)			
東海旅客鉄道	31.8	41.4	704,628
名古屋鉄道	53.9	45.6	92,887
セイノーホールディングス	91.5	87.1	122,985
卸売業 (7.6%)			
豊田通商	117.4	89.9	454,894
サンゲツ	51.4	87	132,501
スズケン	33.2	35.2	115,104
小売業 (5.6%)			
セリア	28.8	29.6	117,808
ネクステージ	—	22.4	38,976
アトム	50.6	49.4	37,791
荏番屋	14.5	17.7	84,783
スギホールディングス	20	16.6	143,590
パローホールディングス	38	39.9	88,578
銀行業 (2.3%)			
十六銀行	41.5	—	—
大垣共立銀行	36.1	56.6	103,521
百五銀行	235.4	347.7	103,962
その他金融業 (3.3%)			
三菱HCキャピタル	365	519.9	302,581
サービス業 (6.8%)			
リゾートトラスト	85.3	51.9	92,537
ユー・エス・エス	118.7	104.6	189,953
ジャパンマテリアル	37.4	49.1	62,651
トーカイ	15.7	24	57,768
メイテック	24.7	21.1	128,499
ダイセキ	27.7	20.7	93,667
合 計	株 数 ・ 金 額	3,712	3,396
	銘柄数<比率>	50	50
			<98.7%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 合計欄の< >内は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の比率です。

TMA 東海 3 県マザーファンド

運用報告書 第18期（決算日 2021年3月1日）

（計算期間 2020年3月3日～2021年3月1日）

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		参 考	指 数		株 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰	落 中 率		期 騰	落 中 率		
	円	%			%	%	百万円
14期(2017年3月1日)	33,576	19.6	1,553.09		19.4	99.2	11,194
15期(2018年3月1日)	37,828	12.7	1,740.20		12.0	99.1	10,457
16期(2019年3月1日)	35,234	△ 6.9	1,615.72	△	7.2	99.4	9,668
17期(2020年3月2日)	32,110	△ 8.9	1,525.87	△	5.6	99.3	8,360
18期(2021年3月1日)	40,089	24.8	1,902.48		24.7	98.8	9,098

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		参 考	指 数		株 組 入 比 率
	騰 落	率		騰 落	率	
(期 首)	円	%			%	%
2020年3月2日	32,110	—	1,525.87	—	—	99.3
3月末	29,642	△ 7.7	1,403.04	△	8.0	96.9
4月末	31,141	△ 3.0	1,464.03	△	4.1	97.4
5月末	33,201	3.4	1,563.67		2.5	97.5
6月末	32,618	1.6	1,558.77		2.2	98.0
7月末	29,856	△ 7.0	1,496.06	△	2.0	98.5
8月末	33,839	5.4	1,618.18		6.0	98.7
9月末	34,673	8.0	1,625.49		6.5	98.4
10月末	33,702	5.0	1,579.33		3.5	98.6
11月末	36,278	13.0	1,754.92		15.0	99.4
12月末	37,989	18.3	1,804.68		18.3	99.6
2021年1月末	37,675	17.3	1,808.78		18.5	99.6
2月末	39,245	22.2	1,864.49		22.2	95.4
(期 末)						
2021年3月1日	40,089	24.8	1,902.48		24.7	98.8

(注) 騰落率は期首比です。

参考指数はTOPIX（東証株価指数）です。
TOPIXは、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

○運用経過

(2020年3月3日～2021年3月1日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：32,110円

期 末：40,089円

騰落率： 24.8%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、大規模な財政・金融政策が実施されたこと
- ・新型コロナウイルスワクチンの接種開始により、経済活動正常化への期待が高まったこと

マイナス要因

- ・新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に伴い、景気減速懸念が高まったこと



(注) 参考指数は、期首(2020年3月2日)の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) 参考指数は、TOPIX(東証株価指数)です。

■投資環境

当期の国内株式市場は上昇しました。

期初、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う景気減速が懸念され、世界的に株式市場が下落するなか、国内株式市場も大幅に下落しました。

その後、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、大規模な財政・金融政策が実施されたことや、事前予想を上回る国内企業業績の下支えを受けて、国内株式市場は上昇基調で推移しました。

期後半は、米国大統領選挙でバイデン民主党候補が勝利し大型の財政支援策への期待が高まったことや、欧米を中心に新型コロナウイルスワクチン接種が開始されたことなどをを受けて経済活動正常化への期待が高まったことから、国内株式市場は上昇しました。

■ポートフォリオについて

東海3県(愛知、岐阜、三重)に本社を置き、この地域を支える代表的な企業約50社の株式に投資するファンドです。「時価総額の大きさに応じて投資する戦略」と「配当利回りの大きさに応じて投資する戦略」の2つの戦略を組み合わせることによって、東海3県の経済成長を享受しながら、相対的に高い配当利回りを追求します。当マザーファンドは、東海3県の産業構造などを反映して、輸送用機器セクター、機械セクターなどの銘柄が大きなウェイトを占めています。

当期は2020年4月、7月、10月、2021年1月に、運用の基本方針に基づき、投資対象銘柄の見直しおよび組入比率を調整する定期的なリバランス(投資配分比率の調整)を行いました。その結果、住友理工、武蔵精密工業、東祥を除外し、MARUWA、東建コーポレーション、CKDを新規に組み入れました。

以上の運用の結果、基準価額は24.8%上昇しました。

- ・プラス寄与した主な業種と銘柄

輸送用機器セクター：デンソー、豊田自動織機

商社セクター：豊田通商

○今後の運用方針

引き続き、個別銘柄の投資比率は「時価総額の大きさに応じて投資する戦略」と「配当利回りの大きさに応じて投資する戦略」の2つを組み合わせることにより決定し、東海3県の経済成長を享受しながら、相対的に高い配当利回りを追求します。

○1万口当たりの費用明細

(2020年3月3日～2021年3月1日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 8 (8)	% 0.022 (0.022)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
合 計	8	0.022	
期中の平均基準価額は、34,154円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2020年3月3日～2021年3月1日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 974	千円 1,656,956	千株 1,212	千円 2,803,438

(注) 金額は受渡代金です。

○株式売買比率

(2020年3月3日～2021年3月1日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	4,460,395千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,600,564千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.51

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2020年3月3日～2021年3月1日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2021年3月1日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
建設業 (1.1%)			
東建コーポレーション	—	11.8	101,952
食料品 (1.0%)			
カゴメ	36.2	28	91,840
化学 (1.6%)			
アイカ工業	39.2	37.9	143,830
ゴム製品 (—%)			
住友理工	66.9	—	—
ガラス・土石製品 (5.1%)			
日本碍子	118.1	98.3	190,800
日本特殊陶業	92.7	85.7	159,487
MARUWA	—	3.7	39,146
ニチハ	30.7	23	70,495
鉄鋼 (0.6%)			
大同特殊鋼	25.3	11.8	53,572
金属製品 (1.6%)			
リンナイ	16.6	13	142,610
機械 (9.1%)			
オークマ	18.3	10	59,900
F U J I	52	35.5	92,016
オーエスジー	48	38	74,632
DMG森精機	89.2	48.4	78,650
CKD	—	22.8	54,286
ジェイテクト	153.6	133.4	150,742
マキタ	79.2	64.6	303,297
電気機器 (3.8%)			
イビデン	49.3	33.9	151,533
ブラザー工業	96.9	87.7	193,027
輸送用機器 (30.4%)			
トヨタ紡織	97.1	77.9	133,754
豊田自動織機	91.9	74.1	680,979
デンソー	153	108.5	715,883
東海理化電機製作所	63	55.9	99,613
トヨタ自動車	98.2	85.9	680,757
武蔵精密工業	68.2	—	—
アイシン精機	93.7	79	295,460
豊田合成	54.6	43.8	124,698
精密機器 (2.7%)			
朝日インテック	67.9	56.5	175,432

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
メニコン	13	10	64,000
電気・ガス業 (5.3%)			
中部電力	244.5	243.6	321,673
東邦瓦斯	34	25.4	158,750
陸運業 (10.9%)			
東海旅客鉄道	31.8	43.6	757,768
名古屋鉄道	55.3	41.3	112,707
セイノーホールディングス	92.1	72.2	109,671
卸売業 (7.8%)			
豊田通商	110.3	92.7	429,664
サンゲツ	49.7	81	127,980
スズケン	33.8	35.5	145,372
小売業 (4.7%)			
セリア	35.7	26.5	92,485
アトム	51.1	46.3	45,374
老番屋	14.7	15	74,175
スギホールディングス	21.5	18.1	139,008
パローホールディングス	46.7	32	74,080
銀行業 (4.1%)			
十六銀行	39.2	71.2	142,684
大垣共立銀行	43	53.6	110,576
百五銀行	253.3	371	114,268
その他金融業 (3.1%)			
三菱UFJリース	362	465.3	274,527
サービス業 (7.1%)			
リゾートトラスト	62.9	55.5	103,618
ユー・エス・エス	112	102.5	207,767
ジャパンマテリアル	38.3	42.4	58,342
東洋	15.7	—	—
トーカイ	20.3	28.5	62,301
メイテック	21.6	22.4	128,800
ダイセキ	23.9	23	79,235
合 計	株 数 ・ 金 額	3,626	3,387
	銘柄数<比率>	50	50

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

○投資信託財産の構成

(2021年3月1日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	8,993,228	95.2
コール・ローン等、その他	456,640	4.8
投資信託財産総額	9,449,868	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年3月1日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,449,868,596
コール・ローン等	453,028,396
株式(評価額)	8,993,228,000
未収配当金	3,612,200
(B) 負債	351,125,968
未払解約金	351,125,625
未払利息	343
(C) 純資産総額(A－B)	9,098,742,628
元本	2,269,644,583
次期繰越損益金	6,829,098,045
(D) 受益権総口数	2,269,644,583口
1万口当たり基準価額(C／D)	40,089円

(注) 当親ファンドの期首元本額は2,603,793,277円、期中追加設定元本額は292,911,410円、期中一部解約元本額は627,060,104円です。

(元本の内訳)

東海3県ファンド 1,663,849,973円
東海3県ファンド(確定拠出年金) 603,070,946円
TMA東海3県日本株式VA<適格機関投資家限定> 2,723,664円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況

(2020年3月3日～2021年3月1日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	203,839,888
受取配当金	203,879,801
受取利息	948
その他収益金	2,108
支払利息	△ 42,969
(B) 有価証券売買損益	1,837,109,691
売買益	1,988,219,005
売買損	△ 151,109,314
(C) 当期損益金(A＋B)	2,040,949,579
(D) 前期繰越損益金	5,757,028,413
(E) 追加信託差損益金	688,269,906
(F) 解約差損益金	△1,657,149,853
(G) 計(C＋D＋E＋F)	6,829,098,045
次期繰越損益金(G)	6,829,098,045

(注) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。
(注) (E)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) (F)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。