【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2022年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・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）
【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・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）
（なお、愛称として「年金ぷらす」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。）
※愛称の「年金ぷらす」とは、将来の年金受給とは別の、「ゆとりあるセカンドライフ」に備えた資産づくりをめざすことを意味しており、当ファンドをお申込みいただくことで年金額が上乗せされることを意味するものではありません。当ファンドは投資信託であり、元本が保証されているものではありません。また、公的年金や企業年金ではなく、生命保険会社等が提供する年金商品とも異なります。

(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】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額
基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。
●委託会社のお問い合わせ先（以下「委託会社サービスデスク」といいます。）
東京海上アセットマネジメント　サービスデスク
０１２０－７１２－０１６（土日祝日・年末年始を除く９時～17時）

(5)【申込手数料】

① 発行価格に2.2%（税抜２%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が含まれます。
② 分配金再投資コース（下記「(6)申込単位」をご参照ください。）の収益分配金の再投資により取得する口数については、手数料はありません。

(6)【申込単位】

① 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。

② 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時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。）
③ 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】

2022年４月26日から2022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。ただし、お申込み日が以下の日のいずれかに該当する場合には、取得のお申込みの受付を行いません。
・ニューヨーク証券取引所の休業日

・ロンドン証券取引所の休業日
※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額に申込手数料を加算し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】
① 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。ただし、お申込み日が上記「(7)申込期間」に記載の申込不可日のいずれかに該当する場合には、取得のお申込みの受付を行いません。
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号ロ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。
② 日本以外の地域における発行
該当ありません。
③ 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】

① 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日本債券マザーファンド受益証券」、「東京海上・ＪＰＸ日経400インデックスマザーファンド受益証券」、「ＴＭＡ日本株アクティブマザーファンド受益証券」、「ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド受益証券」、「ＴＭＡ外国債券マザーファンド受益証券」、「ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド受益証券」、「ＴＭＡ外国株式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。

② 基本的性格

当ファンドは、追加型投信／内外／資産複合に属します。

当ファンドの商品分類表および属性区分表は、以下の通りです。

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）
単位型投信 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合

属性区分表

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

（注）当ファンドは、組入比率を変更することがありますが、機動的に変更を行うものではないため、「資産配分固定型」としています。
※当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。
※投資形態が、ファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資することとなりますので、商品分類表と属性区分表の投資対象資産が異なります。
※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型投信	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

	不動産投信（リート）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	ＭＭＦ（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会の「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定められるＭＭＦをいいます。
	ＭＲＦ（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会の「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定められるＭＲＦをいいます。
	ＥＴＦ	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	特殊型	目論見書または投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	目論見書または投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	目論見書または投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	目論見書または投資信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	目論見書または投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	目論見書または投資信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		格付等クレジットによる属性	目論見書または投資信託約款において、上記債券の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記債券に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記します。
	不動産投信		目論見書または投資信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産		目論見書または投資信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。

	資産複合	資産配分 固定型	目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。
		資産配分 変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
決算頻度	年１回		目論見書または投資信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年２回		目論見書または投資信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年４回		目論見書または投資信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年６回（隔月）		目論見書または投資信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）		目論見書または投資信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々		目論見書または投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他		上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド		目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ ファンズ		一般社団法人投資信託協会の「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定されるファンド・オブ・ファンズをいいます。

為替ヘッジ	あり	目論見書または投資信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経２２５	目論見書または投資信託約款において、日経２２５に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	ＴＯＰＩＸ	目論見書または投資信託約款において、ＴＯＰＩＸに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記指数にあてはまらない全てのものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	目論見書または投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動（一定倍の連動若しくは逆連動を含む。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	目論見書または投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	目論見書または投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他型	目論見書または投資信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

③ 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。

④ ファンドの特色

1 **公的年金の基本ポートフォリオ＊を参照し、国内外の複数の資産に分散投資することにより、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。**

＊公的年金のうち「国民年金」と「厚生年金保険」の積立金を管理・運用する年金積立金管理運用独立行政法人（以下、ＧＰＩＦ）の基本ポートフォリオです。
ファンドは、東京海上アセットマネジメントが公的年金の基本ポートフォリオを参照して、独自に基本資産配分比率を決定するものであり、公的年金やＧＰＩＦと何ら関係を有するものではありません。
ファンドの運用は、ＧＰＩＦの投資成果に連動することをめざすものではありません。また、生命保険会社等が提供する年金商品とは異なります。

- 中長期的なリターンをより重視する観点から、公的年金の基本ポートフォリオを参照し、各投資対象資産（日本債券・日本株式・外国債券・外国株式）の基本資産配分比率を決定します。
- 主としてマザーファンドへの投資を通じて、国内外の複数の資産（日本債券・日本株式・外国債券・外国株式）に分散投資します。
- 各資産への投資にあたっては、市場平均と同程度の投資成果をめざすインデックスファンドと、市場平均を上回る投資成果をめざすアクティブファンドを、各資産ごとに、それぞれ50％程度ずつ組み合わせます。
- 基本資産配分比率を基準に、原則として各資産ごとに一定の範囲内（±5％）に収まるように調整します。
- 実質組入外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジは行いません。

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。

• 各マザーファンドへの投資割合は、以下の基本投資比率とします。

	基本資産配分比率	マザーファンド	基本投資比率	主な投資対象	投資目的
日本債券	25%	TMA日本債券インデックスマザーファンド	12.5%	日本債券（国債、社債等）	NOMURA－BPI(総合)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
		TMA日本債券マザーファンド	12.5%	日本債券（国債、社債等）	NOMURA－BPI(総合)をベンチマークとし、これを上回る投資成果を目標とします。
日本株式	25%	東京海上・ＪＰＸ日経400インデックスマザーファンド	12.5%	日本株式（ＪＰＸ日経400採用銘柄）	ＪＰＸ日経インデックス400(ＪＰＸ日経400)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
		TMA日本株アクティブマザーファンド	12.5%	日本株式	TOPIXをベンチマークとし、これを上回る投資成果を目標とします。
外国債券	25%	TMA外国債券インデックスマザーファンド	12.5%	外国債券（先進国の国債）	FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
		TMA外国債券マザーファンド	12.5%	外国債券（先進国の国債）	FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)をベンチマークとし、これを上回る投資成果を目標とします。
外国株式	25%	TMA外国株式インデックスマザーファンド	12.5%	外国株式（先進国の株式）	MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
		TMA外国株式マザーファンド	12.5%	外国株式（先進国の株式）	MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)をベンチマークとし、これを上回る投資成果を目標とします。

上記は、2022年1月末現在のものですので、公的年金の基本ポートフォリオが変更された場合には、委託会社の判断により「基本資産配分比率」、「基本投資比率」および「投資対象資産」を変更することがあります。

<各マザーファンドが対象とする指数について>

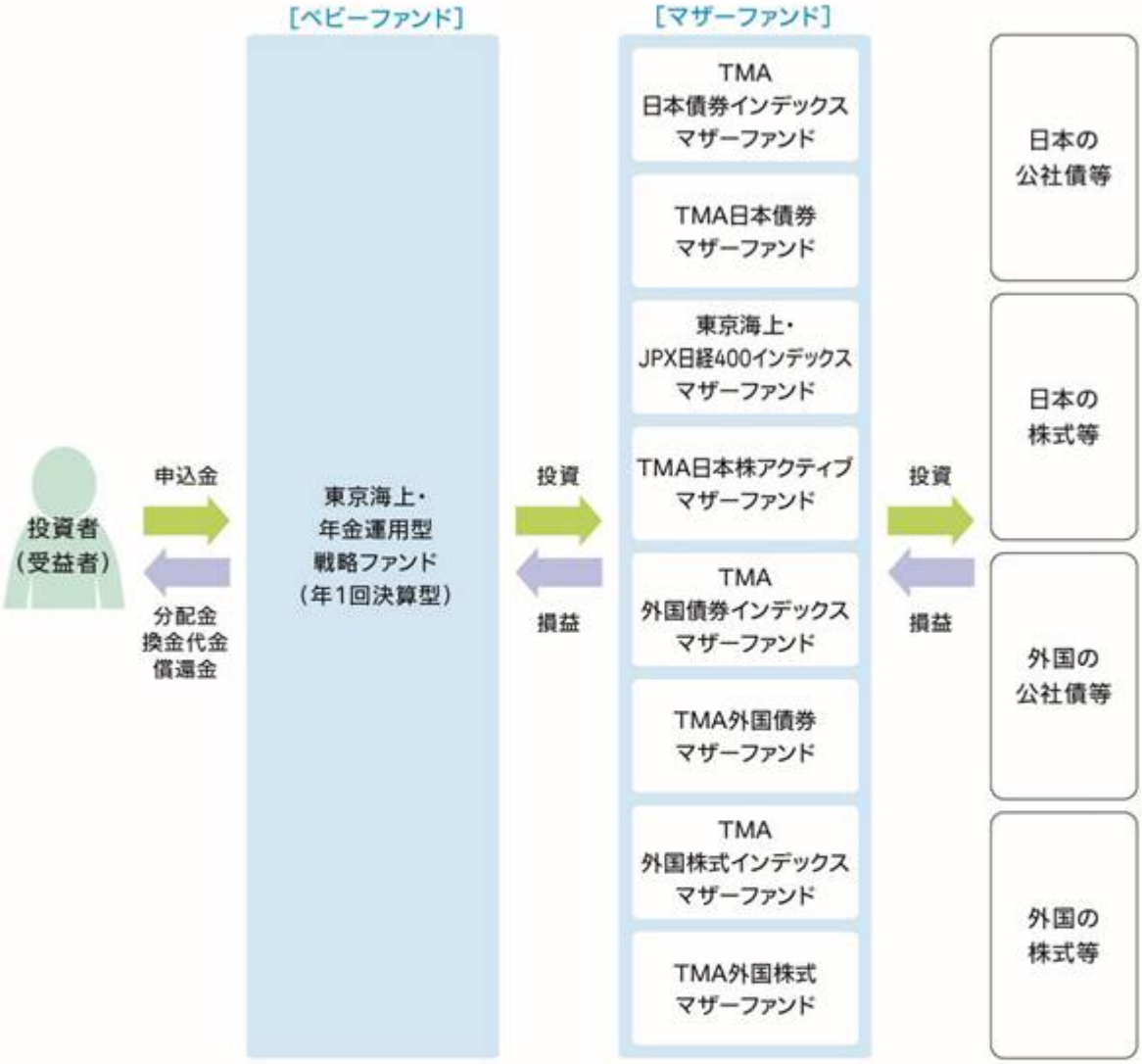
- 「NOMURA－BPI（野村ボンド・パフォーマンス・インデックス）（総合）」とは、野村證券が公表する日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表す代表的な指標です。NOMURA－BPIは、野村證券の知的財産です。野村證券は、ファンドの運用成績等に関し、一切責任ありません。
- 「ＪＰＸ日経インデックス400」は、東京証券取引所のプライム市場、スタンダード市場、グロース市場を主市場とする普通株式等のうち、時価総額、売買代金、ROE等を基に、株式会社ＪＰＸ総研（以下、ＪＰＸ総研といいます。）および株式会社日本経済新聞社（以下、日経といいます。）が選定した、原則400銘柄で構成される株価指数です。起算日は2013年８月30日・基準値は10000ポイントです。ＪＰＸ日経インデックス400は、ＪＰＸ総研および日経によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、ＪＰＸ総研および日経は、ＪＰＸ日経インデックス400自体およびＪＰＸ日経インデックス400を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。ＪＰＸ総研および日経は、ＪＰＸ日経インデックス400を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。ファンドは、委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、ＪＰＸ総研および日経は、その運用およびファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。
- 「TOPIX」は、株式会社ＪＰＸ総研が算出する株価指数であり、日本の株式市場を広範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にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下、ＪＰＸ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にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸ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、ＪＰＸ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ＪＰＸは責任を負いません。
- 「FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- 「MSCIコクサイ指数」とは、MSCI社が発表している日本を除く主要先進国の株式市場の動きを捉える代表的な株価指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。

次ページへ続く

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

ファンドの仕組み

- ファミリーファンド方式により運用を行います。



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

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には制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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。

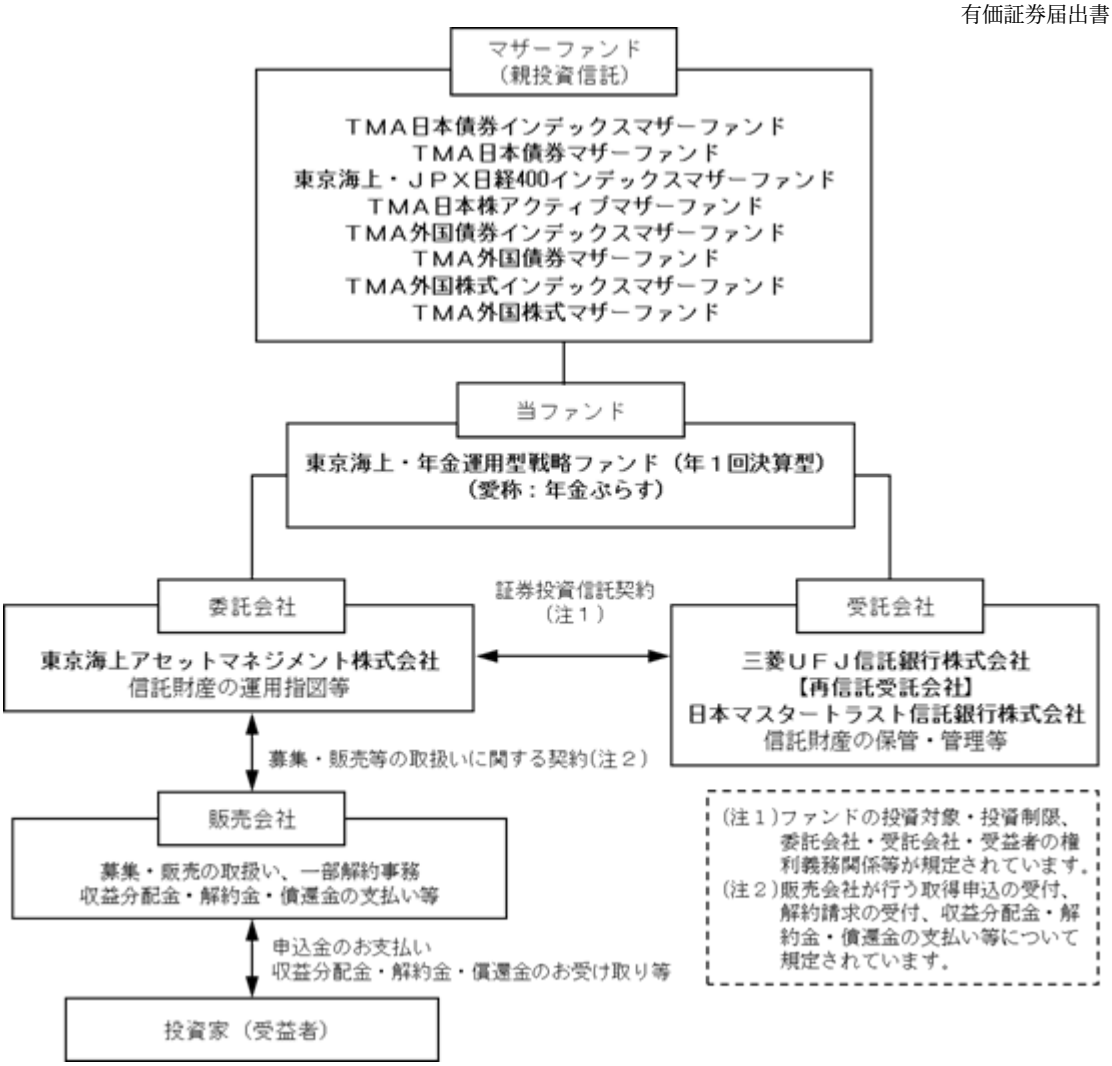
資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【ファンドの沿革】

2015年７月17日　　ファンドの設定、運用開始
2016年10月15日　　信託期間を2031年１月24日までから無期限に変更

(3)【ファンドの仕組み】

① ファンドの仕組み



② 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（2022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
2016年10月	東京海上不動産投資顧問株式会社と合併

・大株主の状況（2022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。

投資対象資産	ファンド名
日本債券	ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド
	ＴＭＡ日本債券マザーファンド
日本株式	東京海上・ＪＰＸ日経400インデックスマザーファンド
	ＴＭＡ日本株アクティブマザーファンド
外国債券	ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド
	ＴＭＡ外国債券マザーファンド
外国株式	ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド
	ＴＭＡ外国株式マザーファンド

(2) 投資態度

①主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の複数の資産（日本債券、日本株式、外国債券、外国株式）に分散投資し、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公的年金の基本ポートフォリオを参照し、各投資対象資産の配分比率（「基本資産配分比率」）を決定します。
③各投資対象資産内におけるマザーファンド受益証券の投資比率（「基本投資比率」）は、各投資対象資産の「基本資産配分比率」のそれぞれ50%とします。
④資産配分は、「基本資産配分比率」を基準に、原則として各投資対象資産毎に一定の範囲内（±５%）に収まるように調整します。
⑤実質組入外貨建資産は、原則として為替ヘッジを行いません。
⑥公的年金の基本ポートフォリオが変更された場合には、委託会社の判断により「基本資産配分比率」、「基本投資比率」および「投資対象資産」を変更することがあります。
⑦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。
⑧資金動向、市況動向、残存期間等の事情によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。

＜参考情報＞マザーファンドの運用の基本方針、主な投資対象と投資制限（要約）

◇TMA日本債券インデックスマザーファンド

１．基本方針

ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）に連動する投資成果の達成を目標とします。

２．運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

①主としてわが国の公社債に投資し、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）に連動する投資成果を目指して運用を行うことを基本とします。

②信託財産の効率的な運用に資するため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額および債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

３．運用制限

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

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

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

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

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

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

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

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

◇TMA日本債券マザーファンド

１．基本方針

①安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目標とし、日本の債券に投資します。
②ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ(総合)をベンチマークとし、これを上回る投資成果を目標とします。

２．運用方法

(1) 投資対象

日本の債券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

①ポートフォリオは、イールド選択（金利選択）、スプレッド選択および銘柄選択を付加価値の源泉として構築します。

――イールド選択（金利選択）――

金融政策やインフレ指標等の分析から長短金利の方向性を予測し、たとえば金利低下を予測する場合はデュレーション＊を長期化、金利上昇を予測する場合はデュレーションを短期化する戦略をとります。

＊デュレーションとは、金利の変化に対する債券価格の変動性を示す指標です。その値が大きいほど、金利の変化に対して価格の動きが大きいことを意味します。

――スプレッド選択――

債券の信用度や流動性等の分析によりスプレッド（国債との利回り較差。信用度が低い企業の発行する債券は国債に比べて、より利回りが高い）の妥当性や変化の方向性を見定め、スプレッド縮小を予測する場合は、スプレッド縮小の恩恵を得られる社債等の比率を高めるなどの戦略をとります。

――銘柄選択――

債券の残存期間と最終利回りの関係を分析し、相対的に高利回りな銘柄を選別します。社債等においては、ファンドマネージャーによる企業訪問で得た情報等を分析し銘柄を選択します。

②基本的には債券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債券組入比率の調整を機動的に行います。

３．運用制限

(1) 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。（ただし、転換社債の転換、新株引受権の行使および新株予約権の行使により取得する場合に限ります。）
(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。

◇東京海上・ＪＰＸ日経400インデックスマザーファンド

１．基本方針

ＪＰＸ日経インデックス400（ＪＰＸ日経400）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ＪＰＸ日経インデックス400（ＪＰＸ日経400）に採用されている銘柄に投資します。

(2) 投資態度

①ＪＰＸ日経インデックス400（ＪＰＸ日経400）に採用されている銘柄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。
②流動性、機動性、コスト等の観点から、株価指数先物取引等を行うことがあります。
③原則として、株式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) 上場投資信託証券等を除く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。

◇TMA日本株アクティブマザーファンド

１．基本方針

①信託財産の中長期的な成長を目標とし、日本法人の株式に投資します。

②ＴＯＰＩＸをベンチマークとし、これを上回る投資成果を目標とします。

２．運用方法

(1) 投資対象

証券取引所に上場あるいは店頭市場に登録している日本法人の株式（これらに準じるものも含みます。）を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

①ポートフォリオは、セクター判断（業種配分）と銘柄選択を付加価値の源泉として構築します。

②セクター判断は、以下要領で行います。

ベンチマークに採用されている銘柄を当社独自の業種区分により分類し、各業種の株価時価総額ウエイトを算出したものをベースとし、以下の判断、要因を勘案の上、業種基準ポートフォリオを決定します。

―― ファンダメンタルズ、バリュエーション、テクニカルの以下３視点による計量分析に定性的判断を加味します。

・業種共通のマクロ指標と各業種ごとのセミマクロ指標によるファンダメンタルズ分析

・業種別ＰＥＲ、ＰＢＲ等によるバリュエーション分析

・計量的アプローチを用いたテクニカル分析

―― 構造的（長期的）要因と循環的（短期的）要因を考慮します。

③当該企業の成長性と株価の割安度の双方をミックスした当社独自の分析システムの活用と、年間1,500件以上の企業訪問などによる徹底した調査・分析を基に行います。

―― 成長性、割安度双方の視点のミックス（ＧＡＲＰ：Growth at a Reasonable Price）

・成長性――ＲＯＥ、経常増益率、利益予想変化 など

・割安度――株価純資産倍率、株価収益率、キャッシュフロー倍率 など

―― アナリスト、ファンド・マネージャーによる企業訪問など調査・分析

銘柄選択の着眼点としては、市場動向分析や競合状態分析による「事業環境の予測」およびコスト分析、差異化分析や事業戦略分析による同業他社比較における「競争優位の評価」などが中心となります。

④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。

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) 同一銘柄の株式への投資割合は、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。

(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10%以下とします。

◇TMA外国債券インデックスマザーファンド

１．基本方針

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

２．運用方法

(1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

①主として外国の公社債に投資し、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行うことを基本とします。

②組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行いません。

③信託財産の効率的な運用に資するため、債券先物取引や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、組入有価証券の時価総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産および外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

３．運用制限

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

(2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

(8) デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

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

◇ＴＭＡ外国債券マザーファンド

１．基本方針

①信託財産の中長期的な成長を目標とし、主に外国の国債に投資します。

②ＦＴＳＥ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)をベンチマークとし、これを上回る投資成果を目標とします。

２．運用方法

(1) 投資対象

外国の国債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

①ポートフォリオは、国別配分、デュレーション調整、銘柄選択を付加価値の源泉として構築します。

――国別配分――

各国のファンダメンタルズ（経済の基礎的条件）等を分析することにより金利・為替動向を予測し、それを基に各国債券市場の期待収益率を算出し、期待収益率が高い国の配分を高め、期待収益率が低い国の配分を低める戦略をとります。

――デュレーション調整――

各国の金融政策やインフレ指標等を分析し、金利低下を予測する国の債券のデュレーションを長期化、金利上昇を予測する国の債券のデュレーションを短期化する戦略をとります。

――銘柄選択――

国別にデュレーションを決定した後に、債券の残存期間と最終利回りの関係を表す曲線等を分析し、割安な銘柄群から選択します。

②外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

③基本的には債券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債券組入比率の調整を機動的に行います。

３．運用制限

(1) 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。（ただし、転換社債の転換、新株引受権の行使および新株予約権の行使により取得する場合に限ります。）

(2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

◇TMA外国株式インデックスマザーファンド

１．基本方針

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

２．運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

①主として外国の株式に投資し、ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行うことを基本とします。

②組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行いません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払にかかわる為替予約取引等を行うことができます。

③信託財産の効率的な運用に資するため、株価指数先物取引や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額ならびに株価指数先物取引や外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

３．運用制限

(1) 株式への投資割合には、制限を設けません。

(2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

(7) デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

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

◇TMA外国株式マザーファンド

１．基本方針

①信託財産の中長期的な成長を目標とし、外国の株式に投資します。

②ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）をベンチマークとし、これを上回る投資成果を目標とします。

２．運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

①ポートフォリオは、個別銘柄の調査・分析に基づいた銘柄選択を付加価値の源泉として構築します。

――調査対象銘柄の選定――

当社が独自に開発した業種別銘柄選別モデルを活用し、主にＭＳＣＩコクサイ指数の構成銘柄から調査対象銘柄を絞り込みます。

――個別銘柄の調査・分析――

アナリスト・ファンドマネージャーが企業訪問等による情報収集・分析を行います。

――ポートフォリオの構築――

個別銘柄の情報・分析をもとに、国別配分・業種配分を勘案してポートフォリオを構築します。

②外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

③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。

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、制限を設けません。

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

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

(5) 同一銘柄の株式への投資割合は、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。

(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10%以下とします。

※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出来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レーションを勘案しポートフォリオを構築します。
※「東京海上・JPX日経400インデックスマザーファンド」の運用にあたっては、完全法を用いてJPX日経インデックス400に連動するようポートフォリオを構築します。
※「TMA外国債券インデックスマザーファンド」の運用にあたっては、層化抽出法を用いてFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動するよう、残存期間別、国別、通貨別毎の時価ウェイトとデュレーションを勘案しポートフォリオを構築します。
※「TMA外国株式インデックスマザーファンド」の運用にあたっては、リスクモデルを使用し、最適化法を用いてMSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）に連動するようポートフォリオを構築します。

(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。）
① 有価証券
② 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す。）
③ 金銭債権（①④に掲げるものに該当するものを除きます。）
④ 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日本債券マザーファンド」、「東京海上・JPX日経400インデックスマザーファンド」、「TMA日本株アクティブマザーファンド」、「TMA外国債券インデックスマザーファンド」、「TMA外国債券マザーファンド」、「TMA外国株式インデックスマザーファンド」、「TMA外国株式マザーファンド」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書
(2) 国債証券
(3) 地方債証券
(4) 特別の法律により法人の発行する債券
(5) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
(6) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
(7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
(8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
(9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
(10) コマーシャル・ペーパー
(11) 新株引受権証券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）および新株予約権証券
(12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(1)から(11)までの証券または証書の性質を有するもの
(13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
(14) 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）
(15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
(16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
(17) 預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
(18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
(19) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
(20) 抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます。）

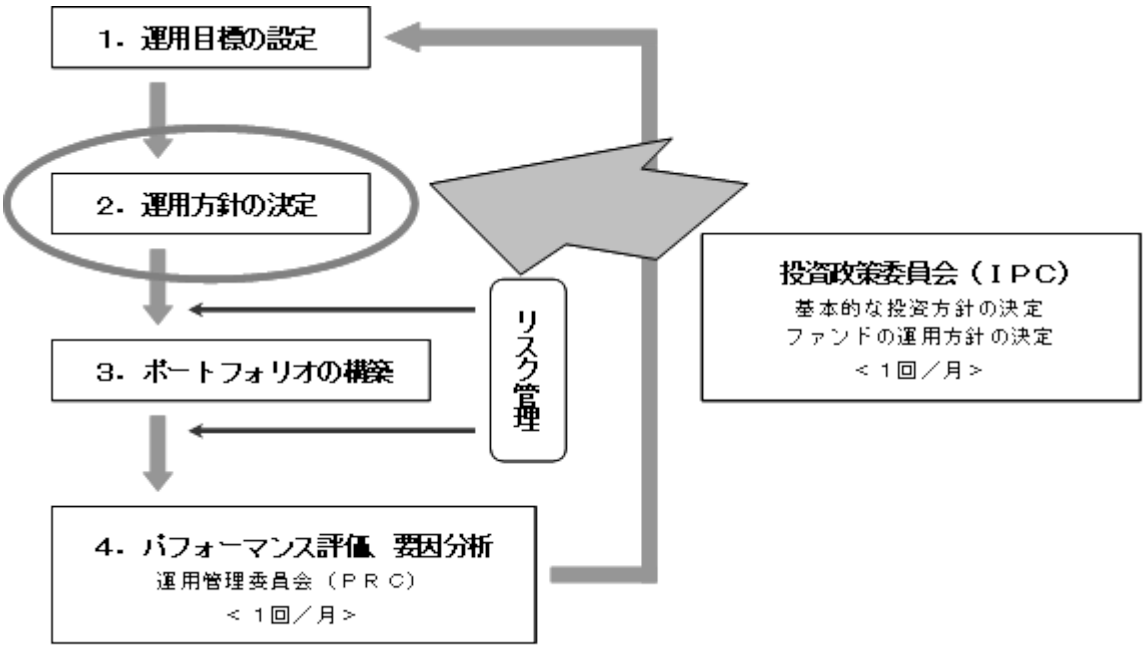
(21)貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
(22)受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定めるものをいい、上記(1)から(21)に該当するものを除きます。）
(23)外国の者に対する権利で上記(21)および(22)の有価証券の性質を有するもの
なお、(1)の証券または証書、(12)および(17)の証券または証書のうち(1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(2)から(6)までの証券、(12)および(17)の証券または証書のうち(2)から(6)までの証券の性質を有するものならびに(14)の投資法人債券を以下「公社債」といい、(13)の証券および(14)の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

３．委託会社は、信託金を、上記２．に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
(1) 預金
(2) 指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
(3) コール・ローン
(4) 手形割引市場において売買される手形
(5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
(6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

４．上記２．の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記３．に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(3)【運用体制】

当ファンドの運用体制は以下の通りです。



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

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

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

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

（上記の体制や人員等については、2022年１月末日現在）

(4)【分配方針】

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。

① 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。

② 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等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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。

③ 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。

④ 分配金は、毎計算期間終了後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して５営業日まで）から、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）

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】

① 運用の基本方針に基づく制限（約款別紙「運用の基本方針」）

a.株式への実質投資割合には制限を設けません。

b.外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

c.委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

※信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。（以下同じ）

d.委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券ならびに取引所に上場し、かつ当該取引所において常時売却可能な投資信託証券、また既に組入れていた株式等が転換等により投資信託証券に該当することとなった投資信託証券を除きます。）の時価総額とマザーファンドに属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

e.委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

f.委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

g.委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

② 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。

③ 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。

④ 先物取引等（約款第22条）

a.委託会社は、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、日本国内の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

c.委託会社は、日本国内の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

⑤ 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たときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。

⑥ 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たときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。

⑦ デリバティブ取引等に係る投資制限（約款第25条）

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。

⑧ 有価証券の貸付（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たときは、担保の受入の指図を行うものとします。

⑨ 有価証券の空売（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、信託財産において有しない有価証券または下記「⑩ 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。

⑩ 有価証券の借入（約款第28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たときは、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。

⑪ 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第29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。

⑫ 外国為替予約取引（約款第30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。

⑬ 信用リスク集中回避のための投資制限（約款第31条）

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

⑭ 資金の借入（約款第37条）

a.委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

b.一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

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

d.借入金の利息は信託財産中から支弁します。

3【投資リスク】

1．投資リスク

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

(1) 価格変動リスク

当ファンドは、主に株式や公社債など値動きのある証券を実質的な投資対象としますので、基準価額は変動します。したがって、当ファンドは元本が保証されているものではありません。
委託会社の運用指図によって信託財産に生じた利益および損失は、全て投資家に帰属します。
投資信託は預貯金や保険と異なります。
当ファンドへの投資には主に以下のリスクが想定され、これらの影響により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

① 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。

② 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。

③ 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。

④ 為替変動リスク
外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動の他、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国・地域の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向にすすんだ場合には、基準価額が下落する要因となります。

⑤ カントリーリスク
投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想以上に下落したり、投資方針に沿った運用が困難となることがあります。

⑥ 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が、実際の価格変動が委託会社の見通しと異なった場合に当ファンドが損失を被るリスクを伴います。

2．その他の留意事項

(1) 一般的な留意事項

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

(2) 法令・税制・会計等の変更可能性

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

(3) その他の留意点

① 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。

② 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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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。

⑦ 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。

⑧ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全額が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

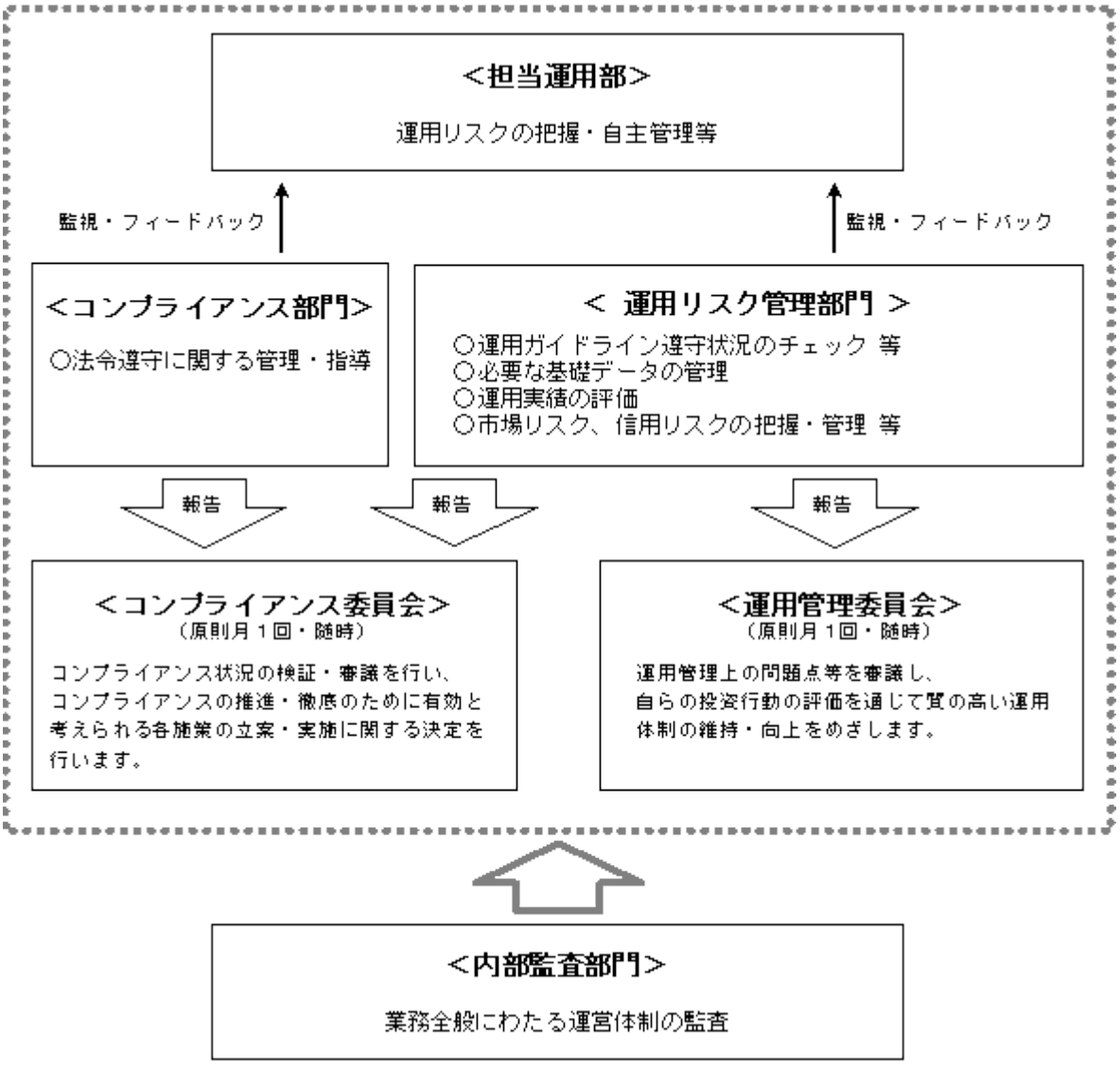
３．管理体制

＜リスク管理体制＞

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

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

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



＜流動性リスク管理＞

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

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

参考情報

2017年2月～2022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

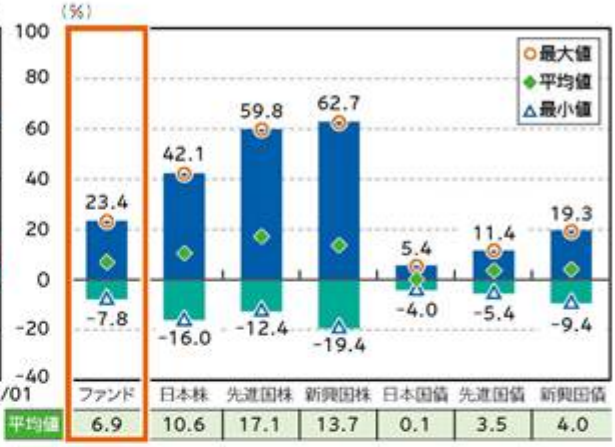
過去5年間の各月末における分配金再投資基準価額と直近1年間の騰落率を表示したものです。

※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して計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。

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

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

代表的な資産クラスと指数名

日本株	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
先進国株	MSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
日本国債	NOMURA-BPI（国債）
先進国債	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・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に係る標章または商標は、JPX総研またはJPX総研の関連会社（以下、JPX）の知的財産であり、指数値の算出・公表、利用等、TOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXに係る標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出・公表の方法の変更、指数値の算出・公表の停止、TOPIXに係る標章または商標の変更・使用の停止を行う場合があります。 ●MSCIコクサイ指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。 ●MSCIエマージング・マーケット・インデックスの著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。 ●NOMURA-BPI（国債）に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券に帰属します。 ●FTSE世界国債インデックスは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 ●JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・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】

① 発行価格に2.2%（税抜２%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。申込手数料には、消費税等が含まれます。
申込手数料は、商品の説明、購入に関する事務コスト等の対価として、申込時にご負担いただくものです。
② 分配金再投資コースの収益分配金の再投資により取得する口数については、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】

① 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1.3695%（税抜1.245%）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。
② ①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。
③ 信託報酬の配分（税抜）については以下の通りとします。

委託会社＊1	販売会社＊2	受託会社＊3
年率0.6%	年率0.6%	年率0.045%

＊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】

① 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。
② 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。
③ 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。
④ 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ます。）ならびに解約時および償還時の損益については、確定申告により、上場株式等（特定公社債および公募公社債投信を含みます。）の利子所得および配当所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）ならびに譲渡所得等との間で損益通算を行うことができます。

少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアＮＩＳＡ」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超過額に対する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、2022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2022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	2,738,726,972	99.99
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		223,677	0.00
合計（純資産総額）		2,738,950,649	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	19,296,239,120	88.06

地方債証券	日本	1,146,385,200	5.23
特殊債券	日本	302,475,000	1.38
社債券	日本	1,188,506,783	5.42
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		△21,437,520	△0.09
合計（純資産総額）		21,912,168,583	100.00

ＴＭＡ日本債券マザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	47,937,759,380	51.71
社債券	日本	42,199,830,585	45.52
	アメリカ	1,092,080,000	1.17
	フランス	497,603,000	0.53
	イギリス	300,429,000	0.32
	小計	44,089,942,585	47.56
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		674,357,397	0.72
合計（純資産総額）		92,702,059,362	100.00

東京海上・ＪＰＸ日経400インデックスマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	3,888,828,210	95.26
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		193,307,181	4.73
合計（純資産総額）		4,082,135,391	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	189,850,000	4.65

(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日本株アクティブマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	76,128,981,270	99.21
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		599,584,214	0.78
合計（純資産総額）		76,728,565,484	100.00

TMA外国債券インデックスマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	4,857,373,640	47.37
	カナダ	200,392,156	1.95
	ドイツ	732,696,570	7.14
	イタリア	893,502,400	8.71
	フランス	991,752,065	9.67
	オーストラリア	165,859,604	1.61
	イギリス	592,249,129	5.77
	シンガポール	45,808,997	0.44
	マレーシア	53,116,489	0.51
	オランダ	174,385,120	1.70
	スペイン	584,562,592	5.70
	ベルギー	233,044,559	2.27
	スウェーデン	27,908,509	0.27
	ノルウェー	24,266,771	0.23
	オーストリア	133,490,539	1.30
	フィンランド	55,748,378	0.54
	デンマーク	43,486,701	0.42
	メキシコ	71,153,710	0.69
	アイルランド	84,366,221	0.82
	イスラエル	45,216,281	0.44
	ポーランド	44,328,205	0.43
	中華人民共和国	88,875,585	0.86
	小計	10,143,584,221	98.93
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		108,791,553	1.06
合計（純資産総額）		10,252,375,774	100.00

TMA外国債券マザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	12,485,383,424	46.46
	カナダ	752,576,455	2.80
	ドイツ	1,952,009,320	7.26

	イタリア	2,476,937,874	9.21
	フランス	2,897,083,280	10.78
	オーストラリア	932,262,996	3.46
	イギリス	1,874,669,521	6.97
	シンガポール	17,775,914	0.06
	オランダ	361,026,393	1.34
	スペイン	1,299,946,545	4.83
	ベルギー	448,916,869	1.67
	スウェーデン	62,954,604	0.23
	オーストリア	330,245,131	1.22
	メキシコ	695,991,560	2.59
	ポーランド	63,619,654	0.23
	小計	26,651,399,540	99.18
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		217,985,892	0.81
合計（純資産総額）		26,869,385,432	100.00

TMA外国株式インデックスマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	44,970,311,068	69.15
	カナダ	2,378,092,405	3.65
	ドイツ	1,729,406,844	2.65
	イタリア	348,192,165	0.53
	フランス	2,082,963,891	3.20
	オーストラリア	1,212,862,741	1.86
	イギリス	2,885,068,395	4.43
	スイス	2,145,872,790	3.30
	バミューダ	152,396,682	0.23
	香港	447,139,962	0.68
	シンガポール	216,305,523	0.33
	ニュージーランド	72,773,993	0.11
	オランダ	1,207,414,876	1.85
	スペイン	472,804,743	0.72
	ベルギー	166,144,653	0.25
	スウェーデン	686,537,752	1.05
	ノルウェー	143,525,412	0.22
	オーストリア	46,323,515	0.07
	ルクセンブルク	57,015,182	0.08
	フィンランド	244,056,076	0.37
	デンマーク	495,078,315	0.76
	アイルランド	1,128,720,532	1.73
	イスラエル	97,467,086	0.14
	ポルトガル	50,919,801	0.07
	ケイマン	69,174,127	0.10
	キュラソー	73,020,288	0.11
	ジャージー	203,598,756	0.31

	小計	63,783,187,573	98.08
投資証券	アメリカ	1,302,636,588	2.00
	カナダ	11,503,430	0.01
	フランス	54,589,426	0.08
	オーストラリア	71,647,322	0.11
	イギリス	49,308,799	0.07
	香港	18,585,069	0.02
	シンガポール	15,693,145	0.02
	小計	1,523,963,779	2.34
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		△281,430,208	△0.43
合計（純資産総額）		65,025,721,144	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	地域	時価（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	995,708,961	1.53
	買建	ドイツ	201,772,331	0.31
	買建	イギリス	137,586,307	0.21

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

TMA外国株式マザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	36,513,473,185	71.69
	カナダ	1,311,479,522	2.57
	ドイツ	242,473,536	0.47
	イタリア	131,230,575	0.25
	フランス	239,744,014	0.47
	オーストラリア	580,421,851	1.13
	イギリス	3,893,971,258	7.64
	スイス	2,620,886,940	5.14
	オランダ	1,796,813,910	3.52
	スペイン	91,142,744	0.17
	ノルウェー	179,741,133	0.35
	デンマーク	1,080,355,621	2.12
	アイルランド	893,642,743	1.75
	中華人民共和国	643,863,269	1.26
	キュラソー	45,806,592	0.08
	小計	50,265,046,893	98.70
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		661,275,143	1.29
合計（純資産総額）		50,926,322,036	100.00

(2)【投資資産】

①【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日本債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	252,601,706	1.4112	356,496,167	1.4061	355,183,258	12.96
2	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	276,208,594	1.2903	356,418,949	1.2858	355,149,010	12.96
3	TMA外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	203,958,678	1.7216	351,135,506	1.7235	351,522,781	12.83
4	TMA外国債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	140,636,456	2.4949	350,874,093	2.4976	351,253,612	12.82
5	東京海上・ＪＰＸ日経400インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	175,027,582	1.9457	340,566,156	1.9446	340,358,635	12.42
6	TMA外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	84,981,081	3.8659	328,536,470	3.9235	333,423,271	12.17
7	TMA外国株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	75,784,307	4.2426	321,528,844	4.3072	326,418,167	11.91
8	TMA日本株アクティブマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	152,427,860	2.1430	326,662,952	2.1349	325,418,238	11.88

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	99.99
合　計	99.99

②【投資不動産物件】
該当事項はありません。

③【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）
①投資有価証券の主要銘柄
a.主要銘柄の明細
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３５９回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2030/06/20	284,000,000	101.03	286,926,240	100.16	284,471,440	1.29
2	第１３５回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2023/03/20	280,000,000	100.29	280,812,000	100.19	280,551,600	1.28
3	第１３９回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2024/03/20	272,000,000	100.51	273,396,880	100.34	272,927,520	1.24
4	第３４７回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2027/06/20	270,000,000	101.12	273,042,900	100.61	271,671,300	1.23
5	第１３８回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2023/12/20	258,000,000	100.46	259,197,120	100.31	258,799,800	1.18
6	第１４０回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2024/06/20	250,000,000	100.54	251,364,400	100.36	250,922,500	1.14
7	第３４９回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2027/12/20	243,000,000	101.22	245,984,040	100.61	244,499,310	1.11
8	第３５４回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2029/03/20	240,000,000	101.29	243,103,200	100.53	241,279,200	1.10
9	第１３６回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2023/06/20	240,000,000	100.34	240,828,000	100.23	240,561,600	1.09
10	第１４１回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2024/09/20	235,000,000	100.63	236,480,500	100.39	235,928,250	1.07
11	第３５３回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2028/12/20	232,000,000	101.32	235,062,400	100.54	233,273,680	1.06
12	第３５６回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2029/09/20	232,000,000	101.22	234,830,400	100.41	232,969,760	1.06
13	第３４８回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2027/09/20	230,000,000	101.17	232,691,000	100.61	231,423,700	1.05
14	第１４２回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2024/12/20	230,000,000	100.68	231,575,800	100.44	231,028,100	1.05
15	第３５２回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2028/09/20	220,000,000	101.27	222,807,200	100.56	221,238,600	1.00
16	第１４７回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.005	2026/03/20	220,000,000	100.47	221,034,500	100.18	220,409,200	1.00
17	第１４９回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.005	2026/09/20	220,000,000	100.45	220,994,400	100.13	220,305,800	1.00
18	第３５５回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2029/06/20	216,000,000	101.24	218,693,980	100.47	217,032,480	0.99
19	第３４４回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2026/09/20	215,000,000	101.00	217,150,000	100.57	216,244,850	0.98
20	第３６４回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2031/09/20	216,000,000	100.38	216,833,870	99.47	214,870,320	0.98
21	第１４６回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2025/12/20	206,000,000	100.82	207,697,560	100.56	207,159,780	0.94
22	第３５７回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2029/12/20	204,000,000	101.11	206,272,300	100.35	204,720,120	0.93
23	平成２７年度第３回福岡県公募公債	日本	地方債証券	0.529	2025/08/25	200,000,000	101.98	203,972,000	101.84	203,698,000	0.92
24	第３５０回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2028/03/20	200,000,000	101.24	202,492,000	100.61	201,224,000	0.91
25	第３４２回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2026/03/20	200,000,000	100.89	201,780,000	100.57	201,156,000	0.91
26	第１４５回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2025/09/20	200,000,000	100.78	201,576,400	100.54	201,090,000	0.91
27	第１４３回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2025/03/20	199,000,000	100.73	200,462,900	100.48	199,965,150	0.91
28	第３４３回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2026/06/20	195,000,000	100.94	196,848,600	100.59	196,154,400	0.89
29	第３４６回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2027/03/20	194,000,000	101.04	196,035,540	100.59	195,144,600	0.89
30	第３６０回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2030/09/20	195,000,000	100.93	196,813,500	100.04	195,081,900	0.89

TMA日本債券マザーファンド

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１５０回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.005	2026/12/20	9,892,000,000	100.22	9,914,574,600	100.12	9,904,068,240	10.68
2	第３６５回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2031/12/20	6,570,000,000	99.88	6,562,476,050	99.31	6,525,258,300	7.03
3	第１４回利付国債（４０年）	日本	国債証券	0.700	2061/03/20	2,346,000,000	99.08	2,324,464,100	96.44	2,262,599,700	2.44

4	第３６４回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2031/09/20	1,873,000,000	100.28	1,878,336,880	99.47	1,863,204,210	2.00
5	第１６２回利付国債（２０年）	日本	国債証券	0.600	2037/09/20	1,750,000,000	104.89	1,835,667,820	102.71	1,797,512,500	1.93
6	第１７９回利付国債（２０年）	日本	国債証券	0.500	2041/12/20	1,736,000,000	99.46	1,726,686,300	98.92	1,717,355,360	1.85
7	第１６０回利付国債（２０年）	日本	国債証券	0.700	2037/03/20	1,575,000,000	105.45	1,660,957,450	104.42	1,644,741,000	1.77
8	第６５回利付国債（３０年）	日本	国債証券	0.400	2049/12/20	1,424,000,000	93.47	1,331,085,600	90.98	1,295,612,160	1.39
9	第３６３回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2031/06/20	1,200,000,000	99.76	1,197,122,000	99.62	1,195,548,000	1.28
10	第１５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	日本	社債券	0.890	2030/07/24	1,000,000,000	102.79	1,027,996,000	102.22	1,022,280,000	1.10
11	第１６回武田薬品工業株式会社無担保社債	日本	社債券	0.400	2031/10/14	1,000,000,000	100.00	1,000,000,000	99.31	993,100,000	1.07
12	第１７７回利付国債（２０年）	日本	国債証券	0.400	2041/06/20	910,000,000	99.77	907,954,800	97.20	884,538,200	0.95
13	第３８回利付国債（３０年）	日本	国債証券	1.800	2043/03/20	710,000,000	126.88	900,904,800	123.89	879,654,500	0.94
14	第５６回利付国債（３０年）	日本	国債証券	0.800	2047/09/20	835,000,000	105.34	879,615,600	102.39	854,998,250	0.92
15	第４３１回利付国債（２年）	日本	国債証券	0.005	2023/12/01	851,000,000	100.19	852,651,900	100.11	852,012,690	0.91
16	第３３回利付国債（３０年）	日本	国債証券	2.000	2040/09/20	674,000,000	128.70	867,438,000	126.10	849,940,960	0.91
17	第５２回利付国債（３０年）	日本	国債証券	0.500	2046/09/20	790,000,000	98.44	777,676,000	96.20	759,995,800	0.81
18	第４８回利付国債（３０年）	日本	国債証券	1.400	2045/09/20	644,000,000	119.73	771,091,020	116.43	749,854,280	0.80
19	第４０回利付国債（３０年）	日本	国債証券	1.800	2043/09/20	561,000,000	127.31	714,209,100	124.16	696,565,650	0.75
20	第１０９回住友不動産株式会社無担保社債	日本	社債券	0.310	2031/05/09	700,000,000	100.10	700,711,000	99.02	693,182,000	0.74
21	第１６８回利付国債（２０年）	日本	国債証券	0.400	2039/03/20	670,000,000	100.49	673,311,600	98.73	661,511,100	0.71
22	第６３回利付国債（３０年）	日本	国債証券	0.400	2049/06/20	710,000,000	93.60	664,567,100	91.42	649,124,600	0.70
23	第６４回利付国債（３０年）	日本	国債証券	0.400	2049/09/20	700,000,000	92.99	650,993,000	91.25	638,799,000	0.68
24	第１０回みずほフィナンシャルグループ（劣後）	日本	社債券	1.232	2025/12/15	600,000,000	101.52	609,126,000	101.45	608,736,000	0.65
25	第１回三菱ＨＣキャピタル株式会社無担保社債（劣後）	日本	社債券	0.630	2081/09/27	600,000,000	100.00	600,000,000	100.39	602,346,000	0.64
26	第１回パナソニック株式会社無担保社債（劣後）	日本	社債券	0.740	2081/10/14	600,000,000	100.00	600,000,000	100.19	601,152,000	0.64
27	第１４９回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.005	2026/09/20	600,000,000	100.23	601,412,000	100.13	600,834,000	0.64
28	第３４７回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2027/06/20	590,000,000	101.08	596,372,000	100.61	593,652,100	0.64
29	第１７０回利付国債（２０年）	日本	国債証券	0.300	2039/09/20	577,000,000	98.53	568,518,100	96.68	557,843,600	0.60
30	第４４回利付国債（３０年）	日本	国債証券	1.700	2044/09/20	450,000,000	125.75	565,915,500	122.65	551,934,000	0.59

東京海上・ＪＰＸ日経400インデックスマザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	東京エレクトロン	日本	電気機器	株式	1,300	49,175.99	63,928,795	54,730.00	71,149,000	1.74
2	ソニーグループ	日本	電気機器	株式	5,500	11,572.68	63,649,740	12,720.00	69,960,000	1.71
3	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	株式	30,800	2,031.12	62,558,680	2,245.50	69,161,400	1.69

4	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	11,800	5,747.97	67,826,123	5,595.00	66,021,000	1.61
5	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	91,800	607.31	55,751,860	691.10	63,442,980	1.55
6	ダイキン工業	日本	機械	株式	2,600	24,820.61	64,533,590	23,825.00	61,945,000	1.51
7	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	18,500	2,899.35	53,638,031	3,267.00	60,439,500	1.48
8	三菱商事	日本	卸売業	株式	15,300	3,429.19	52,466,625	3,877.00	59,318,100	1.45
9	ＨＯＹＡ	日本	精密機器	株式	4,000	16,194.57	64,778,304	14,755.00	59,020,000	1.44
10	キーエンス	日本	電気機器	株式	1,000	61,230.09	61,230,096	58,230.00	58,230,000	1.42
11	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	14,100	3,844.01	54,200,669	4,113.00	57,993,300	1.42
12	信越化学工業	日本	化学	株式	3,000	18,144.17	54,432,514	19,040.00	57,120,000	1.39
13	日立製作所	日本	電気機器	株式	9,400	6,066.86	57,028,520	5,939.00	55,826,600	1.36
14	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	16,300	3,552.65	57,908,223	3,354.00	54,670,200	1.33
15	ＫＤＤＩ	日本	情報・通信業	株式	14,800	3,389.70	50,167,702	3,645.00	53,946,000	1.32
16	伊藤忠商事	日本	卸売業	株式	14,300	3,436.93	49,148,132	3,667.00	52,438,100	1.28
17	村田製作所	日本	電気機器	株式	6,100	8,967.77	54,703,432	8,539.00	52,087,900	1.27
18	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	15,200	3,566.78	54,215,096	3,328.00	50,585,600	1.23
19	任天堂	日本	その他製品	株式	900	53,241.04	47,916,944	56,160.00	50,544,000	1.23
20	日本電産	日本	電気機器	株式	5,000	12,049.49	60,247,476	10,090.00	50,450,000	1.23
21	東京海上ホールディングス	日本	保険業	株式	6,700	5,704.33	38,219,035	6,830.00	45,761,000	1.12
22	オリエンタルランド	日本	サービス業	株式	2,300	16,219.58	37,305,051	19,880.00	45,724,000	1.12
23	三井物産	日本	卸売業	株式	15,800	2,669.95	42,185,268	2,853.50	45,085,300	1.10
24	セブン＆アイ・ホールディングス	日本	小売業	株式	7,800	4,954.51	38,645,179	5,593.00	43,625,400	1.06
25	第一三共	日本	医薬品	株式	16,200	2,141.11	34,686,132	2,565.00	41,553,000	1.01
26	ファナック	日本	電気機器	株式	1,800	24,389.92	43,901,860	22,460.00	40,428,000	0.99
27	みずほフィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	26,000	1,568.33	40,776,652	1,550.00	40,300,000	0.98
28	デンソー	日本	輸送用機器	株式	4,500	7,910.62	35,597,830	8,494.00	38,223,000	0.93
29	ＳＭＣ	日本	機械	株式	600	67,447.29	40,468,374	63,390.00	38,034,000	0.93
30	アステラス製薬	日本	医薬品	株式	17,900	1,811.91	32,433,190	1,850.50	33,123,950	0.81

ＴＭＡ日本株アクティブマザーファンド

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	ソニーグループ	日本	電気機器	株式	332,200	11,479.85	3,813,606,170	12,720.00	4,225,584,000	5.50
2	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	株式	1,737,900	1,683.01	2,924,903,079	2,245.50	3,902,454,450	5.08
3	信越化学工業	日本	化学	株式	144,700	18,301.35	2,648,205,345	19,040.00	2,755,088,000	3.59
4	アステラス製薬	日本	医薬品	株式	1,299,800	1,785.11	2,320,285,978	1,850.50	2,405,279,900	3.13
5	ルネサスエレクトロニクス	日本	電気機器	株式	1,764,000	1,173.09	2,069,330,760	1,298.00	2,289,672,000	2.98
6	第一三共	日本	医薬品	株式	878,100	3,065.71	2,691,999,951	2,565.00	2,252,326,500	2.93
7	東京エレクトロン	日本	電気機器	株式	38,800	41,944.96	1,627,464,448	54,730.00	2,123,524,000	2.76
8	三井物産	日本	卸売業	株式	665,900	2,468.94	1,644,067,146	2,853.50	1,900,145,650	2.47
9	村田製作所	日本	電気機器	株式	206,400	9,028.09	1,863,397,776	8,539.00	1,762,449,600	2.29
10	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	2,477,000	649.70	1,609,306,900	691.10	1,711,854,700	2.23
11	セブン＆アイ・ホールディングス	日本	小売業	株式	268,500	5,000.89	1,342,738,965	5,593.00	1,501,720,500	1.95
12	野村総合研究所	日本	情報・通信業	株式	357,800	3,427.32	1,226,295,096	3,960.00	1,416,888,000	1.84

13	バンダイナムコホールディングス	日本	その他製品	株式	170,900	7,953.62	1,359,273,658	8,007.00	1,368,396,300	1.78
14	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	243,800	5,342.16	1,302,419,719	5,595.00	1,364,061,000	1.77
15	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	410,600	2,947.81	1,210,370,786	3,267.00	1,341,430,200	1.74
16	富士通	日本	電気機器	株式	89,200	16,338.17	1,457,364,764	15,020.00	1,339,784,000	1.74
17	新光電気工業	日本	電気機器	株式	256,900	3,312.68	851,027,492	5,200.00	1,335,880,000	1.74
18	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	261,600	9,748.89	2,550,309,624	5,011.00	1,310,877,600	1.70
19	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	308,500	4,281.32	1,320,787,220	4,113.00	1,268,860,500	1.65
20	日立製作所	日本	電気機器	株式	208,400	6,242.41	1,300,918,244	5,939.00	1,237,687,600	1.61
21	デンソー	日本	輸送用機器	株式	144,400	7,649.57	1,104,597,908	8,494.00	1,226,533,600	1.59
22	ダイキン工業	日本	機械	株式	50,500	22,773.79	1,150,076,395	23,825.00	1,203,162,500	1.56
23	オリエンタルランド	日本	サービス業	株式	57,600	17,625.89	1,015,251,264	19,880.00	1,145,088,000	1.49
24	クボタ	日本	機械	株式	445,100	2,468.16	1,098,578,016	2,444.00	1,087,824,400	1.41
25	ＳＭＣ	日本	機械	株式	17,000	63,299.50	1,076,091,500	63,390.00	1,077,630,000	1.40
26	第一生命ホールディングス	日本	保険業	株式	408,300	2,000.40	816,763,320	2,571.50	1,049,943,450	1.36
27	GMOペイメントゲートウェイ	日本	情報・通信業	株式	96,800	14,298.00	1,384,046,400	9,850.00	953,480,000	1.24
28	ＪＣＲファーマ	日本	医薬品	株式	457,400	3,337.54	1,526,590,796	2,011.00	919,831,400	1.19
29	ミスミグループ本社	日本	卸売業	株式	227,000	3,329.77	755,857,790	3,700.00	839,900,000	1.09
30	レーザーテック	日本	電気機器	株式	33,200	23,990.82	796,495,224	25,075.00	832,490,000	1.08

TMA外国債券インデックスマザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	額面	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
							単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	T 2 1/4 11/15/24	アメリカ	国債証券	2.250	2024/11/15	800,000	12,077.00	96,616,065	11,828.09	94,624,725	0.92
2	T 2 08/15/25	アメリカ	国債証券	2.000	2025/08/15	800,000	12,019.73	96,157,912	11,743.31	93,946,515	0.91
3	T 0 1/8 10/15/23	アメリカ	国債証券	0.125	2023/10/15	700,000	11,479.96	80,359,768	11,356.41	79,494,870	0.77
4	T 0 1/8 12/15/23	アメリカ	国債証券	0.125	2023/12/15	700,000	11,459.22	80,214,565	11,328.45	79,299,163	0.77
5	T 2 3/4 02/15/28	アメリカ	国債証券	2.750	2028/02/15	600,000	12,600.09	75,600,573	12,233.93	73,403,605	0.71
6	T 2 3/4 11/15/23	アメリカ	国債証券	2.750	2023/11/15	600,000	12,076.10	72,456,637	11,875.89	71,255,340	0.69
7	T 1 3/4 12/31/24	アメリカ	国債証券	1.750	2024/12/31	600,000	11,910.61	71,463,672	11,666.65	69,999,930	0.68
8	T 1 5/8 02/15/26	アメリカ	国債証券	1.625	2026/02/15	600,000	11,848.38	71,090,296	11,571.95	69,431,748	0.67
9	T 2 1/2 05/15/24	アメリカ	国債証券	2.500	2024/05/15	500,000	12,094.14	60,470,718	11,871.38	59,356,903	0.57
10	T 1 3/4 05/15/23	アメリカ	国債証券	1.750	2023/05/15	500,000	11,794.27	58,971,351	11,668.45	58,342,293	0.56
11	T 1 5/8 05/15/31	アメリカ	国債証券	1.625	2031/05/15	500,000	11,715.80	58,579,030	11,403.30	57,016,537	0.55
12	T 0 1/8 09/15/23	アメリカ	国債証券	0.125	2023/09/15	500,000	11,487.18	57,435,909	11,373.54	56,867,728	0.55
13	T 1 1/2 02/15/30	アメリカ	国債証券	1.500	2030/02/15	500,000	11,679.28	58,396,405	11,330.25	56,651,278	0.55
14	T 2 02/15/50	アメリカ	国債証券	2.000	2050/02/15	500,000	11,985.46	59,927,338	11,313.12	56,565,600	0.55
15	T 0 3/8 01/31/26	アメリカ	国債証券	0.375	2026/01/31	500,000	11,252.69	56,263,471	11,014.59	55,072,996	0.53
16	T 1 1/4 08/15/31	アメリカ	国債証券	1.250	2031/08/15	500,000	11,313.57	56,567,853	11,013.69	55,068,487	0.53
17	T 3 02/15/49	アメリカ	国債証券	3.000	2049/02/15	400,000	14,494.48	57,977,935	13,691.36	54,765,457	0.53
18	BTPS 0.3 08/15/23	イタリア	国債証券	0.300	2023/08/15	400,000	13,052.55	52,210,228	12,988.22	51,952,908	0.50
19	T 2 1/4 11/15/27	アメリカ	国債証券	2.250	2027/11/15	400,000	12,242.50	48,970,008	11,893.92	47,575,710	0.46
20	T 2 11/30/22	アメリカ	国債証券	2.000	2022/11/30	400,000	11,766.31	47,065,248	11,669.36	46,677,442	0.45

21	T 1 1/8 10/31/26	アメリカ	国債証券	1.125	2026/10/31	400,000	11,496.65	45,986,606	11,282.45	45,129,825	0.44
22	T 0 3/8 08/15/24	アメリカ	国債証券	0.375	2024/08/15	400,000	11,457.42	45,829,680	11,277.94	45,111,786	0.44
23	T 0 1/4 10/31/25	アメリカ	国債証券	0.250	2025/10/31	400,000	11,231.95	44,927,805	11,011.89	44,047,575	0.42
24	T 1 1/8 02/15/31	アメリカ	国債証券	1.125	2031/02/15	400,000	11,265.77	45,063,085	10,930.72	43,722,900	0.42
25	T 0 5/8 11/30/27	アメリカ	国債証券	0.625	2027/11/30	400,000	11,140.41	44,561,642	10,853.16	43,412,655	0.42
26	T 0 3/8 09/30/27	アメリカ	国債証券	0.375	2027/09/30	400,000	11,005.12	44,020,518	10,731.41	42,925,642	0.41
27	T 0 5/8 05/15/30	アメリカ	国債証券	0.625	2030/05/15	400,000	10,845.04	43,380,187	10,540.21	42,160,852	0.41
28	DBR 4 01/04/37	ドイツ	国債証券	4.000	2037/01/04	200,000	21,290.39	42,580,798	20,639.50	41,279,017	0.40
29	FRTR 1 05/25/27	フランス	国債証券	1.000	2027/05/25	300,000	13,875.33	41,626,013	13,643.74	40,931,249	0.39
30	T 3 02/15/48	アメリカ	国債証券	3.000	2048/02/15	300,000	14,399.78	43,199,361	13,591.25	40,773,768	0.39

ＴＭＡ外国債券マザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	額面	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
							単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	T 0 1/8 02/28/23	アメリカ	国債証券	0.125	2023/02/28	10,900,000	11,533.78	1,257,183,087	11,460.12	1,249,153,698	4.64
2	T 3 1/8 11/15/28	アメリカ	国債証券	3.125	2028/11/15	8,200,000	12,936.46	1,060,790,336	12,566.72	1,030,471,552	3.83
3	T 1 1/2 01/15/23	アメリカ	国債証券	1.500	2023/01/15	5,200,000	11,726.39	609,772,550	11,625.16	604,508,775	2.24
4	T 2 5/8 02/15/29	アメリカ	国債証券	2.625	2029/02/15	4,700,000	12,514.66	588,189,275	12,217.70	574,231,931	2.13
5	T 3 5/8 02/15/44	アメリカ	国債証券	3.625	2044/02/15	3,900,000	14,209.46	554,169,269	14,521.99	566,357,657	2.10
6	T 1 07/31/28	アメリカ	国債証券	1.000	2028/07/31	5,000,000	11,044.70	552,235,198	11,017.30	550,865,250	2.05
7	T 0 1/2 10/31/27	アメリカ	国債証券	0.500	2027/10/31	5,100,000	10,948.26	558,361,637	10,788.22	550,199,665	2.04
8	T 2 1/2 02/15/45	アメリカ	国債証券	2.500	2045/02/15	4,200,000	11,890.98	499,421,399	12,237.54	513,976,758	1.91
9	T 2 3/8 04/30/26	アメリカ	国債証券	2.375	2026/04/30	4,300,000	12,388.15	532,690,665	11,920.08	512,563,522	1.90
10	T 0 5/8 11/30/27	アメリカ	国債証券	0.625	2027/11/30	4,600,000	11,057.13	508,628,189	10,853.16	499,245,531	1.85
11	FRTR 0 03/25/25	フランス	国債証券	－	2025/03/25	3,800,000	13,120.37	498,574,225	13,007.52	494,285,988	1.83
12	T 1 1/2 11/30/28	アメリカ	国債証券	1.500	2028/11/30	3,400,000	11,498.90	390,962,812	11,357.31	386,148,605	1.43
13	T 0 5/8 12/31/27	アメリカ	国債証券	0.625	2027/12/31	3,500,000	11,073.31	387,565,899	10,845.94	379,608,204	1.41
14	FRTR 0 02/25/26	フランス	国債証券	－	2026/02/25	2,900,000	13,150.57	381,366,638	12,991.44	376,751,861	1.40
15	T 2 1/4 05/15/41	アメリカ	国債証券	2.250	2041/05/15	2,900,000	12,414.41	360,018,110	11,726.17	340,059,183	1.26
16	BTPS 0 04/15/24	イタリア	国債証券	－	2024/04/15	2,600,000	12,934.20	336,289,449	12,809.38	333,044,129	1.23
17	T 1 1/8 08/31/28	アメリカ	国債証券	1.125	2028/08/31	3,000,000	11,127.03	333,810,994	11,097.57	332,927,155	1.23
18	OBL 0 10/09/26	ドイツ	国債証券	－	2026/10/09	2,500,000	13,193.08	329,827,114	13,082.02	327,050,503	1.21
19	FRTR4.5 04/25/41	フランス	国債証券	4.500	2041/04/25	1,400,000	22,751.93	318,527,035	21,677.92	303,490,927	1.12
20	T 1 5/8 11/30/26	アメリカ	国債証券	1.625	2026/11/30	2,600,000	11,896.09	309,298,392	11,555.72	300,448,834	1.11
21	T 1 1/4 03/31/28	アメリカ	国債証券	1.250	2028/03/31	2,600,000	11,533.69	299,876,143	11,225.63	291,866,591	1.08
22	T 3 5/8 08/15/43	アメリカ	国債証券	3.625	2043/08/15	1,900,000	14,069.43	267,319,356	14,469.68	274,923,967	1.02
23	DBR 0 08/15/31	ドイツ	国債証券	－	2031/08/15	2,000,000	13,126.29	262,525,969	12,964.42	259,288,498	0.96
24	T 2 3/4 08/15/42	アメリカ	国債証券	2.750	2042/08/15	2,000,000	12,332.30	246,646,127	12,705.61	254,112,300	0.94
25	FRTR 0 11/25/31	フランス	国債証券	－	2031/11/25	2,000,000	12,729.63	254,592,793	12,480.02	249,600,400	0.92
26	DBR 2 1/2 08/15/46	ドイツ	国債証券	2.500	2046/08/15	1,200,000	20,225.31	242,703,838	20,332.26	243,987,221	0.90
27	T 3 3/4 11/15/43	アメリカ	国債証券	3.750	2043/11/15	1,600,000	14,346.88	229,550,131	14,751.96	236,031,510	0.87
28	FRTR 1 1/2 05/25/31	フランス	国債証券	1.500	2031/05/25	1,600,000	14,871.80	237,948,950	14,362.31	229,797,052	0.85
29	UKT 0 1/8 01/31/24	イギリス	国債証券	0.125	2024/01/31	1,500,000	15,296.38	229,445,737	15,215.16	228,227,472	0.84
30	MBONO 5 1/2 03/04/27	メキシコ	国債証券	5.500	2027/03/04	45,000,000	511.70	230,267,221	506.42	227,892,233	0.84

ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	株式	172,218	17,663.75	3,042,016,431	19,662.89	3,386,304,485	5.20
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	74,313	38,538.99	2,863,948,469	35,585.53	2,644,467,817	4.06
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	株式	4,757	407,703.44	1,939,445,290	332,416.40	1,581,304,845	2.43
4	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	3,122	340,998.21	1,064,596,437	307,880.78	961,203,822	1.47
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	株式	2,985	341,985.39	1,020,826,415	307,738.79	918,600,310	1.41
6	META PLATFORMS INC-A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	24,769	38,463.01	952,690,391	34,829.40	862,689,468	1.32
7	TESLA INC	アメリカ	自動車・自動車部品	株式	8,821	118,085.79	1,041,634,815	97,702.64	861,835,022	1.32
8	NVIDIA CORP	アメリカ	半導体・半導体製造装置	株式	26,341	34,892.90	919,114,100	26,366.49	694,519,871	1.06
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	26,935	18,834.29	507,301,616	19,831.43	534,159,771	0.82
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	株式	31,062	19,217.55	596,935,847	16,924.65	525,713,739	0.80
11	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	ヘルスケア機器・サービス	株式	9,687	53,693.28	520,126,841	53,801.96	521,179,648	0.80
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	各種金融	株式	13,540	33,277.26	450,574,175	36,121.17	489,080,723	0.75
13	HOME DEPOT INC	アメリカ	小売	株式	10,986	43,074.91	473,221,045	42,313.37	464,854,766	0.71
14	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	家庭用品・パーソナル用品	株式	25,029	16,980.05	424,993,838	18,528.11	463,740,315	0.71
15	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	17,545	24,650.34	432,490,295	26,320.31	461,790,014	0.71
16	NESTLE SA-REGISTERED	スイス	食品・飲料・タバコ	株式	28,680	15,238.73	437,046,954	14,639.43	419,859,139	0.64
17	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	銀行	株式	79,231	5,403.48	428,123,506	5,295.23	419,546,589	0.64
18	MASTERCARD INC-CLASS A	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	9,185	39,958.11	367,015,245	44,156.95	405,581,626	0.62
19	EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	エネルギー	株式	44,534	7,669.59	341,557,765	8,690.32	387,014,853	0.59
20	PFIZER INC	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	59,092	5,564.10	328,794,022	6,271.85	370,616,467	0.56
21	ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	スイス	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	7,532	45,489.20	342,624,728	44,075.79	331,978,925	0.51
22	ASML HOLDING NV	オランダ	半導体・半導体製造装置	株式	4,373	92,918.53	406,332,761	72,834.42	318,504,944	0.48
23	THE WALT DISNEY CO	アメリカ	メディア・娯楽	株式	19,231	19,859.34	381,914,987	16,003.44	307,762,293	0.47
24	CHEVRONTEXACO CORP	アメリカ	エネルギー	株式	19,986	13,516.71	270,145,015	15,077.61	301,341,281	0.46
25	ADOBE INC	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	5,027	75,819.57	381,144,987	59,816.39	300,696,994	0.46
26	COCA-COLA COMPANY	アメリカ	食品・飲料・タバコ	株式	42,122	6,559.89	276,316,086	7,023.36	295,838,374	0.45

27	ABBVIE INC	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	18,505	13,538.41	250,528,363	15,921.48	294,627,076	0.45
28	BROADCOM INC	アメリカ	半導体・半導体製造装置	株式	4,296	65,141.09	279,846,131	64,657.94	277,770,527	0.42
29	PEPSICO INC	アメリカ	食品・飲料・タバコ	株式	13,913	18,963.50	263,839,284	19,933.02	277,328,174	0.42
30	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	株式	42,964	6,636.24	285,119,627	6,419.61	275,812,484	0.42

ＴＭＡ外国株式マザーファンド

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	AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	株式	7,800	361,718.20	2,821,402,022	332,416.40	2,592,847,969	5.09
2	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	ヘルスケア機器・サービス	株式	40,300	42,458.83	1,711,090,929	53,801.96	2,168,219,245	4.25
3	NVIDIA CORP	アメリカ	半導体・半導体製造装置	株式	70,500	14,828.26	1,045,392,894	26,366.49	1,858,837,968	3.65
4	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	アメリカ	家庭用品・パーソナル用品	株式	49,600	33,031.26	1,638,350,540	35,069.51	1,739,448,072	3.41
5	TJX COMPANIES INC	アメリカ	小売	株式	210,800	7,709.66	1,625,196,655	8,240.10	1,737,014,597	3.41
6	MASTERCARD INC-CLASS A	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	39,000	41,101.89	1,602,973,934	44,156.95	1,722,121,221	3.38
7	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	63,500	24,797.45	1,574,638,481	25,642.68	1,628,310,637	3.19
8	META PLATFORMS INC-A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	46,100	33,490.29	1,543,902,756	34,829.40	1,605,635,450	3.15
9	S&P GLOBAL INC	アメリカ	各種金融	株式	33,000	40,184.66	1,326,093,912	46,940.21	1,549,027,022	3.04
10	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	株式	5,000	235,867.00	1,179,335,040	307,738.79	1,538,693,988	3.02
11	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	4,800	233,992.26	1,123,162,859	307,880.78	1,477,827,786	2.90
12	MSCI INC	アメリカ	各種金融	株式	24,900	48,262.94	1,201,747,423	58,658.52	1,460,597,327	2.86
13	ADOBE INC	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	20,700	52,232.87	1,081,220,467	59,816.39	1,238,199,281	2.43
14	ASTRAZENECA PLC	イギリス	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	90,000	11,644.63	1,048,017,212	13,564.30	1,220,787,216	2.39
15	AIRBUS SE	オランダ	資本財	株式	81,400	12,890.80	1,049,311,717	14,330.15	1,166,474,275	2.29
16	DOLLARAMA INC	カナダ	小売	株式	197,100	4,688.71	924,146,512	5,822.78	1,147,671,455	2.25
17	ASHTEAD GROUP PLC	イギリス	資本財	株式	140,500	6,631.29	931,697,537	8,113.51	1,139,949,110	2.23
18	FIRST REPUBLIC BANK/CA	アメリカ	銀行	株式	57,000	19,501.27	1,111,572,914	19,510.51	1,112,099,320	2.18
19	ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	スイス	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	24,900	38,738.45	964,587,652	44,075.80	1,097,487,420	2.15
20	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	97,800	7,619.70	745,206,953	11,046.58	1,080,355,621	2.12
21	BOEING CO	アメリカ	資本財	株式	48,900	29,026.98	1,419,419,562	21,999.40	1,075,770,699	2.11

22	NESTLE SA-REGISTERED	スイス	食品・飲料・タバコ	株式	63,000	15,742.06	991,749,796	14,639.44	922,284,720	1.81
23	PAYPAL HOLDINGS INC	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	48,700	27,248.80	1,327,016,883	18,876.74	919,297,666	1.80
24	HDFC Bank Ltd	アメリカ	銀行	株式	116,100	8,872.05	1,030,045,505	7,556.70	877,333,148	1.72
25	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	30,800	23,884.53	735,643,708	26,320.32	810,665,856	1.59
26	NIKE INC -CL B	アメリカ	耐久消費財・アパレル	株式	47,300	16,141.61	763,498,409	16,843.85	796,714,123	1.56
27	BRIGHT HORIZONS FAMILY SOLUTIONS INC	アメリカ	消費者サービス	株式	56,206	18,492.44	1,039,386,274	14,158.71	795,804,791	1.56
28	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	アメリカ	食品・飲料・タバコ	株式	89,600	6,707.06	600,952,934	7,667.52	687,010,222	1.34
29	Ping An Insurance Group Co	中華人民共和国	保険	株式	718,000	1,404.72	1,008,595,063	896.74	643,863,269	1.26
30	DIAGEO PLC	イギリス	食品・飲料・タバコ	株式	111,800	5,750.82	642,942,643	5,720.77	639,582,309	1.25

b.投資有価証券の種類

ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	88.06
地方債証券	5.23
特殊債券	1.38
社債券	5.42
合　計	100.09

ＴＭＡ日本債券マザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	51.71
社債券	47.56
合　計	99.27

東京海上・ＪＰＸ日経400インデックスマザーファンド

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.04
		鉱業	0.31
		建設業	2.42
		食料品	3.66
		繊維製品	0.38
		パルプ・紙	0.21
		化学	7.24
		医薬品	5.84
		石油・石炭製品	0.55
		ゴム製品	0.88
		ガラス・土石製品	0.73
		非鉄金属	0.73

		金属製品	0.34
		機械	5.75
		電気機器	17.18
		輸送用機器	6.41
		精密機器	3.14
		その他製品	1.86
		電気・ガス業	1.16
		陸運業	1.58
		海運業	0.56
		倉庫・運輸関連業	0.04
		情報・通信業	6.91
		卸売業	6.15
		小売業	3.71
		銀行業	5.20
		証券、商品先物取引業	0.87
		保険業	2.83
		その他金融業	1.42
		不動産業	2.18
		サービス業	4.84
合　計			95.26

ＴＭＡ日本株アクティブマザーファンド

種類	国内／国外	業種	投資比率(％)
株式	国内	水産・農林業	0.35
		建設業	0.61
		食料品	2.06
		繊維製品	0.17
		化学	7.63
		医薬品	8.29
		鉄鋼	0.73
		非鉄金属	0.70
		機械	5.12
		電気機器	23.10
		輸送用機器	8.81
		精密機器	0.97
		その他製品	2.72
		陸運業	1.67
		海運業	0.92
		情報・通信業	11.57
		卸売業	4.74
		小売業	3.83
		銀行業	3.88
		証券、商品先物取引業	0.71
		保険業	1.36
		その他金融業	0.40
		不動産業	1.92
		サービス業	6.86
合　計			99.21

ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド

種類	投資比率(％)
国債証券	98.93
合　計	98.93

ＴＭＡ外国債券マザーファンド

種類	投資比率(％)
国債証券	99.18
合　計	99.18

ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド

種類	国内／国外	業種	投資比率(％)
株式	国外	エネルギー	4.10
		素材	4.18
		資本財	6.11
		商業・専門サービス	1.17
		運輸	1.96
		自動車・自動車部品	2.28
		耐久消費財・アパレル	1.85
		消費者サービス	1.85
		メディア・娯楽	6.71
		小売	5.25
		食品・生活必需品小売り	1.46
		食品・飲料・タバコ	3.97
		家庭用品・パーソナル用品	1.75
		ヘルスケア機器・サービス	4.67
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.06
		銀行	6.44
		各種金融	4.88
		保険	3.07
		不動産	0.37
		ソフトウェア・サービス	11.79
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.78
		電気通信サービス	1.56
		公益事業	2.91
		半導体・半導体製造装置	4.81
投資証券		―	2.34
合　計			100.43

ＴＭＡ外国株式マザーファンド

種類	国内／国外	業種	投資比率(％)
株式	国外	エネルギー	3.35
		素材	2.51
		資本財	6.83
		耐久消費財・アパレル	1.56
		消費者サービス	1.56
		メディア・娯楽	10.11
		小売	10.75
		食品・飲料・タバコ	4.86
		家庭用品・パーソナル用品	3.41
		ヘルスケア機器・サービス	5.63
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	11.04
		銀行	4.78

		各種金融	7.12
		保険	1.40
		ソフトウェア・サービス	13.94
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.18
		公益事業	1.94
		半導体・半導体製造装置	6.63
合　計			98.70

②投資不動産物件
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。

ＴＭＡ日本債券マザーファンド
該当事項はありません。

東京海上・ＪＰＸ日経400インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

ＴＭＡ日本株アクティブマザーファンド
該当事項はありません。

ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

ＴＭＡ外国債券マザーファンド
該当事項はありません。

ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

ＴＭＡ外国株式マザーファンド
該当事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの
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。

ＴＭＡ日本債券マザーファンド
該当事項はありません。

東京海上・ＪＰＸ日経400インデックスマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/売建	数量(枚)	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	10	184,261,000.00	189,850,000	4.65

(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日本株アクティブマザーファンド

該当事項はありません。

ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

ＴＭＡ外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/売建	数量(枚)	通貨	帳簿価額	評価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	Chicago Mercantile Exchange	S&P 500 EMIN	買建	39	米ドル	9,022,387.50	8,625,337.50	995,708,961	1.53
	ドイツ	Eurex	DJ EU STX 50	買建	38	ユーロ	1,612,460.00	1,568,260.00	201,772,331	0.31
	イギリス	ICE Futures Europe Financials	FTSE 100 IDX	買建	12	英ポンド	889,910.00	889,260.00	137,586,307	0.21

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

ＴＭＡ外国株式マザーファンド

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【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	（2016年 1月25日）	1,526	1,526	0.9182	0.9182
第2計算期間末	（2017年 1月25日）	623	623	0.9639	0.9639
第3計算期間末	（2018年 1月25日）	574	574	1.0813	1.0813
第4計算期間末	（2019年 1月25日）	820	820	1.0090	1.0090
第5計算期間末	（2020年 1月27日）	1,269	1,269	1.1163	1.1163
第6計算期間末	（2021年 1月25日）	1,706	1,706	1.2067	1.2067
第7計算期間末	（2022年 1月25日）	2,715	2,715	1.2656	1.2656
2021年 1月末日		1,691	—	1.1934	—
2月末日		1,704	—	1.2050	—
3月末日		1,800	—	1.2443	—
4月末日		1,826	—	1.2532	—
5月末日		1,908	—	1.2629	—
6月末日		2,005	—	1.2782	—
7月末日		2,070	—	1.2765	—

8月末日	2,162	―	1.2952	―
9月末日	2,321	―	1.2955	―
10月末日	2,379	―	1.3215	―
11月末日	2,466	―	1.3070	―
12月末日	2,740	―	1.3275	―
2022年 1月末日	2,738	―	1.2681	―

②【分配の推移】

該当事項はありません。

③【収益率の推移】

期	計算期間	収益率（%）（分配付）
第1計算期間	2015年 7月17日～2016年 1月25日	△8.2
第2計算期間	2016年 1月26日～2017年 1月25日	5.0
第3計算期間	2017年 1月26日～2018年 1月25日	12.2
第4計算期間	2018年 1月26日～2019年 1月25日	△6.7
第5計算期間	2019年 1月26日～2020年 1月27日	10.6
第6計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	8.1
第7計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	4.9

(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	2015年 7月17日～2016年 1月25日	1,666,568,807	4,270,612	1,662,298,195
第2計算期間	2016年 1月26日～2017年 1月25日	70,889,246	1,086,318,747	646,868,694
第3計算期間	2017年 1月26日～2018年 1月25日	279,752,757	394,962,087	531,659,364
第4計算期間	2018年 1月26日～2019年 1月25日	379,742,942	98,391,843	813,010,463
第5計算期間	2019年 1月26日～2020年 1月27日	547,511,806	223,323,526	1,137,198,743
第6計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	600,338,294	323,095,042	1,414,441,995
第7計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	1,022,817,811	291,792,723	2,145,467,083

＜参考情報＞

基準日：2022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2015年7月17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3期	2018/01/25	0円
第4期	2019/01/25	0円
第5期	2020/01/27	0円
第6期	2021/01/25	0円
第7期	2022/01/25	0円
設定来累計		分配実績なし

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

主要な資産の状況

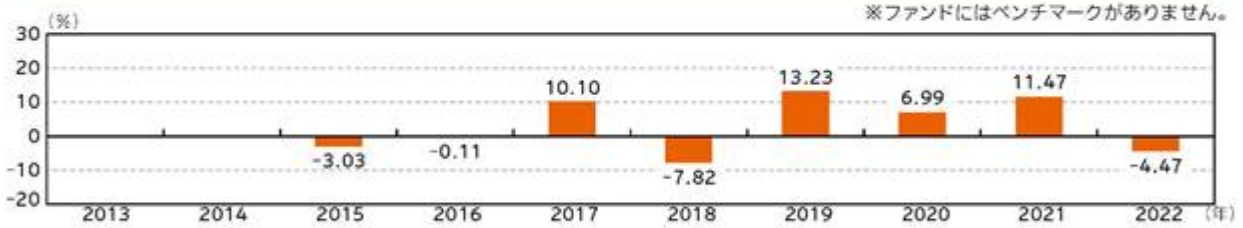
資産構成

マザーファンド	組入比率	基本資産配分	差
ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド	13.0%	12.5%	+0.5%
ＴＭＡ日本債券マザーファンド	13.0%	12.5%	+0.5%
東京海上・ＪＰＸ日経400インデックスマザーファンド	12.4%	12.5%	−0.1%
ＴＭＡ日本株アクティブマザーファンド	11.9%	12.5%	−0.6%
ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド	12.8%	12.5%	+0.3%
ＴＭＡ外国債券マザーファンド	12.8%	12.5%	+0.3%
ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド	12.2%	12.5%	−0.3%
ＴＭＡ外国株式マザーファンド	11.9%	12.5%	−0.6%
短期金融資産等	0.0%	−	+0.0%

※比率は純資産総額に占める割合です。
※短期金融資産等には未払金等が含まれるため、組入比率がマイナスとなる場合があります。

年間収益率の推移

※ファンドにはベンチマークがありません。



※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。ただし、お申込み日が以下の日のいずれかに該当する場合には、取得のお申込みの受付を行いません。
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ロンドン証券取引所の休業日

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

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

c.販売会社やお申込みのコース等によって申込単位は異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。なお、分配金再投資コースにおける収益分配金の再投資に際しては、１口単位で取得することができます。

d.取得申込の受付は、原則として午後３時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みについては翌営業日受付の取扱いとなります。

e.受益権の取得申込価額は以下の通りです。
取得申込受付日の翌営業日の基準価額
基準価額は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。
●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.申込手数料は、発行価格に2.2%（税抜２%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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ます。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。ただし、解約請求日が以下の日のいずれかに該当する場合には、お申込みの受付を行いません。
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ロンドン証券取引所の休業日
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扱いします。
f.解約時の価額（解約価額）は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
※信託財産留保額はありません。
※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.基準価額とは、受益権１口当たりの純資産価額（純資産総額を計算日における受益権総口数で除した金額）をいいます。ただし、便宜上１万口当たりに換算した価額で表示されることがあります。

b.純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、外国為替予約に基づく予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

＜主要投資対象資産の評価方法＞

対象	評価方法
マザーファンド受益証券	原則として、当ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。
株式	原則として、上場されている取引所における計算日（外国株式の場合は、計算時に知り得る直近の日）の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、以下のいずれかの価額で評価します。 a.日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値） b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く） c.価格情報会社の提供する価額
先物取引	国内取引所に上場されているものは、当該取引所が発表する計算日の清算値段または証拠金算定基準値段で評価します。 海外取引所に上場されているものは、当該海外取引所が発表する計算日に知りうる直近の日の清算価格または最終相場で評価するものとします。

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

原則として、2015年７月17日から無期限とします。ただし、後記「(5)その他 ①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】

① 信託の終了（繰上償還）

a.委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより受益権の総口数が10億口を下ることとなったとき、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

b.委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

c.上記b.の書面決議において、受益者（委託会社および信託の信託財産に信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下c.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

d.上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。
e.上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
f.委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。
g.上記f.の規定にかかわらず、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、信託は、「②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。受託会社が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、「②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。

② 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「②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します。
c.上記b.の書面決議において、受益者（委託会社および信託の信託財産に信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下c.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
d.上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。
e.書面決議の効力は、信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
f.上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
g.上記a.からf.までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

① 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。

② 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。

③ 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。

④ 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7期計算期間(2021年1月26日から2022年1月25日まで)の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】
【東京海上・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 [2021年 1月25日現在]	第7期 [2022年 1月25日現在]
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,706,339,584	2,714,398,819
未収入金	19,140,863	22,642,571
流動資産合計	1,725,480,447	2,737,041,390
資産合計	1,725,480,447	2,737,041,390
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,229,498	5,110,797
未払受託者報酬	372,648	598,528
未払委託者報酬	9,937,238	15,960,791
その他未払費用	82,715	132,909
流動負債合計	18,622,099	21,803,025
負債合計	18,622,099	21,803,025
純資産の部		
元本等		
元本	※1 1,414,441,995	※1 2,145,467,083
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	292,416,353	569,771,282
（分配準備積立金）	184,791,189	199,210,390
元本等合計	1,706,858,348	2,715,238,365
純資産合計	1,706,858,348	2,715,238,365
負債純資産合計	1,725,480,447	2,737,041,390

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	第7期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	144,797,820	88,144,094
営業収益合計	144,797,820	88,144,094
営業費用		
支払利息	1	1
受託者報酬	690,706	1,052,637
委託者報酬	18,418,723	28,070,341
その他費用	153,308	233,730
営業費用合計	19,262,738	29,356,709
営業利益又は営業損失（△）	125,535,082	58,787,385
経常利益又は経常損失（△）	125,535,082	58,787,385
当期純利益又は当期純損失（△）	125,535,082	58,787,385
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（△）	4,913,780	14,303,441
期首剰余金又は期首欠損金（△）	132,242,643	292,416,353
剰余金増加額又は欠損金減少額	75,665,597	297,302,051
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	75,665,597	297,302,051
剰余金減少額又は欠損金増加額	36,113,189	64,431,066
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	36,113,189	64,431,066
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（△）	292,416,353	569,771,282

(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7期 自 2021年 1月26日 至 2022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7期 自 2021年 1月26日 至 2022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。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第6期 [2021年 1月25日現在]	第7期 [2022年 1月25日現在]
1.※1　期首元本額	1,137,198,743円	1,414,441,995円
期中追加設定元本額	600,338,294円	1,022,817,811円
期中一部解約元本額	323,095,042円	291,792,723円
2.※1　計算期間末日における受益権の総数	1,414,441,995口	2,145,467,083口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第6期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	第7期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日
※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（17,846,084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（102,775,218円）、投資信託約款に規定される収益調整金（128,400,821円）及び分配準備積立金（64,169,887円）より、分配対象額は313,192,010円（１万口当たり2,214.23円）でありますが、分配を行っておりません。	※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（17,009,680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（27,474,264円）、投資信託約款に規定される収益調整金（370,560,892円）及び分配準備積立金（154,726,446円）より、分配対象額は569,771,282円（１万口当たり2,655.66円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	第6期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	第7期 自 2021年 1月26日 至 2022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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	第6期 [2021年 1月25日現在]	第7期 [2022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った場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

第6期（自 2020年1月28日　至 2021年1月25日）

売買目的有価証券

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	138,257,747円
合計	138,257,747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7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	59,333,670円
合計	59,333,670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6期 [2021年 1月25日現在]	第7期 [2022年 1月25日現在]
1口当たり純資産額　1.2067円 （1万口当たり純資産額　12,067円）	1口当たり純資産額　1.2656円 （1万口当たり純資産額　12,656円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
親投資信託受益証券	TMA日本株アクティブマザーファンド	151,357,748	324,420,197	
	TMA日本債券マザーファンド	250,992,114	354,275,368	
	TMA外国株式マザーファンド	75,249,226	319,289,990	
	TMA外国債券マザーファンド	139,726,491	348,645,540	
	TMA外国債券インデックスマザーファンド	202,640,188	348,926,139	
	TMA外国株式インデックスマザーファンド	84,394,364	326,302,368	
	TMA日本債券インデックスマザーファンド	274,448,183	354,202,824	
	東京海上・ＪＰＸ日経400インデックスマザーファンド	173,853,550	338,336,393	
親投資信託受益証券　合計		1,352,661,864	2,714,398,819	
合計		1,352,661,864	2,714,398,819	

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日本債券インデックスマザーファンド」、「TMA日本債券マザーファンド」、「東京海上・ＪＰＸ日経400インデックスマザーファンド」、「TMA日本株アクティブマザーファンド」、「TMA外国債券インデックスマザーファンド」、「TMA外国債券マザーファンド」、「TMA外国株式インデックスマザーファンド」、「TMA外国株式マザーファンド」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日本債券インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区　　分	注記番号	[2021年 1月25日現在] 金額（円）	[2022年 1月25日現在] 金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		98,460,233	71,130,638
国債証券		16,876,678,160	19,275,688,910
地方債証券		940,470,500	1,147,601,300
特殊債券		404,464,000	302,629,000
社債券		948,955,624	1,190,312,197
未収入金		2,037,820	—
未収利息		27,074,201	30,402,940
前払費用		1,443,290	1,082,882

流動資産合計		19,299,583,828	22,018,847,867
資産合計		19,299,583,828	22,018,847,867
負債の部			
流動負債			
未払金		64,371,630	―
未払解約金		20,828,837	19,281,361
未払利息		54	75
流動負債合計		85,200,521	19,281,436
負債合計		85,200,521	19,281,436
純資産の部			
元本等			
元本	※1	14,840,406,534	17,045,546,776
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		4,373,976,773	4,954,019,655
元本等合計		19,214,383,307	21,999,566,431
純資産合計		19,214,383,307	21,999,566,431
負債純資産合計		19,299,583,828	22,018,847,867

(2) 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自 2021年 1月26日 至 2022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
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分		[2021年 1月25日現在]	[2022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	13,281,789,429円	14,840,406,534円
	同期中における追加設定元本額	3,906,123,892円	4,350,928,344円
	同期中における一部解約元本額	2,347,506,787円	2,145,788,102円
	同期末における元本額	14,840,406,534円	17,045,546,776円
	元本の内訳＊		
	円資産バランスファンド2018－09 ＜適格機関投資家限定＞	776,121,843円	742,152,891円

	円資産バランスファンド2019－05 ＜適格機関投資家限定＞	2,692,333,657円	2,710,606,047円
	円資産バランスファンド2019－09 ＜適格機関投資家限定＞	2,205,925,610円	2,001,529,487円
	円資産バランスファンド2019－12 ＜適格機関投資家限定＞	2,933,938,740円	2,750,256,361円
	ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）	51,823,711円	－円
	ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）	39,550,574円	－円
	ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）	65,100,188円	－円
	ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）	47,355,744円	－円
	ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）	27,881,702円	－円
	東京海上セレクション・日本債券インデックス	2,967,931,914円	3,499,610,089円
	東京海上・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）	162,175,743円	274,448,183円
	東京海上・円資産インデックスバランスファンド	41,050,741円	74,378,615円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	32,515,238円	166,165,124円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	10,213,294円	77,029,594円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	7,381,685円	45,230,199円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	12,035,007円	75,172,530円
	ＴＭＡ日本債券インデックスＶＡ ＜適格機関投資家限定＞	147,197,126円	88,262,058円
	東京海上・世界インデックス・バランス40 ＜適格機関投資家限定＞	298,498,751円	528,985,806円
	東京海上・世界インデックス・バランス60 ＜適格機関投資家限定＞	999,061,353円	1,753,322,194円
	円資産バランスオープン ＜適格機関投資家限定＞	1,322,313,913円	1,696,618,095円
	円資産インデックスバランス＜円奏会ベーシック＞（適格機関投資家専用）	－円	561,779,503円
	計	14,840,406,534円	17,045,546,776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	14,840,406,534口	17,045,546,776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）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	自 2021年 1月26日 至 2022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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	[2021年 1月25日現在]	[2022年 1月25日現在]
1．　貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．　時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）
（自 2020年1月28日　至 2021年1月25日）
売買目的有価証券

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

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年11月11日から2021年1月25日まで)を指しております。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

[2021年 1月25日現在]		[2022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	1.2947円 12,947円）	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額	1.2906円 12,906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４１８回利付国債（２年）	28,000,000	28,041,720	
	第４２１回利付国債（２年）	85,000,000	85,164,050	
	第４２２回利付国債（２年）	74,000,000	74,149,480	
	第４２３回利付国債（２年）	50,000,000	50,053,000	
	第４２４回利付国債（２年）	120,000,000	120,135,600	
	第４２５回利付国債（２年）	100,000,000	100,121,000	
	第４２６回利付国債（２年）	100,000,000	100,121,000	
	第４２７回利付国債（２年）	70,000,000	70,089,600	
	第４２８回利付国債（２年）	41,000,000	41,055,350	
	第４２９回利付国債（２年）	90,000,000	90,127,800	
	第４３０回利付国債（２年）	60,000,000	60,084,600	
	第４３１回利付国債（２年）	80,000,000	80,110,400	
	第１３５回利付国債（５年）	280,000,000	280,593,600	
	第１３６回利付国債（５年）	240,000,000	240,602,400	
	第１３７回利付国債（５年）	130,000,000	130,386,100	
	第１３８回利付国債（５年）	258,000,000	258,856,560	
	第１３９回利付国債（５年）	272,000,000	273,022,720	
	第１４０回利付国債（５年）	250,000,000	251,020,000	
	第１４１回利付国債（５年）	235,000,000	236,059,850	
	第１４２回利付国債（５年）	230,000,000	231,133,900	
	第１４３回利付国債（５年）	199,000,000	200,064,650	
	第１４４回利付国債（５年）	190,000,000	191,098,200	
	第１４５回利付国債（５年）	200,000,000	201,206,000	
	第１４６回利付国債（５年）	206,000,000	207,287,500	
	第１４７回利付国債（５年）	220,000,000	220,547,800	
	第１４８回利付国債（５年）	183,000,000	183,442,860	
	第１４９回利付国債（５年）	220,000,000	220,459,800	
	第５回利付国債（４０年）	35,000,000	47,087,950	
	第６回利付国債（４０年）	34,000,000	45,124,800	
	第７回利付国債（４０年）	40,000,000	51,099,600	
	第８回利付国債（４０年）	48,000,000	57,425,280	
	第９回利付国債（４０年）	79,000,000	71,096,840	
	第１０回利付国債（４０年）	59,000,000	62,065,640	
	第１１回利付国債（４０年）	70,000,000	71,400,700	
	第１２回利付国債（４０年）	68,000,000	62,787,120	
	第１３回利付国債（４０年）	96,000,000	88,357,440	
	第１４回利付国債（４０年）	61,000,000	59,805,010	
	第３２５回利付国債（１０年）	8,000,000	8,046,240	
	第３２６回利付国債（１０年）	10,000,000	10,071,000	
	第３２７回利付国債（１０年）	50,000,000	50,400,000	
	第３２８回利付国債（１０年）	23,000,000	23,180,550	
	第３２９回利付国債（１０年）	45,000,000	45,550,350	

第３３０回利付国債（１０年）	103,000,000	104,487,320	
第３３１回利付国債（１０年）	55,000,000	55,612,700	
第３３２回利付国債（１０年）	30,000,000	30,381,900	
第３３３回利付国債（１０年）	63,000,000	63,906,570	
第３３４回利付国債（１０年）	30,000,000	30,482,400	
第３３５回利付国債（１０年）	180,000,000	182,721,600	
第３３６回利付国債（１０年）	68,000,000	69,125,400	
第３３７回利付国債（１０年）	10,000,000	10,107,400	
第３３８回利付国債（１０年）	40,000,000	40,592,400	
第３３９回利付国債（１０年）	180,000,000	182,880,000	
第３４０回利付国債（１０年）	70,000,000	71,190,000	
第３４１回利付国債（１０年）	90,000,000	91,283,400	
第３４２回利付国債（１０年）	200,000,000	201,286,000	
第３４３回利付国債（１０年）	195,000,000	196,288,950	
第３４４回利付国債（１０年）	215,000,000	216,401,800	
第３４５回利付国債（１０年）	160,000,000	161,059,200	
第３４６回利付国債（１０年）	194,000,000	195,348,300	
第３４７回利付国債（１０年）	270,000,000	271,895,400	
第３４８回利付国債（１０年）	230,000,000	231,690,500	
第３４９回利付国債（１０年）	243,000,000	244,793,340	
第３５０回利付国債（１０年）	200,000,000	201,476,000	
第３５１回利付国債（１０年）	135,000,000	135,993,600	
第３５２回利付国債（１０年）	220,000,000	221,608,200	
第３５３回利付国債（１０年）	232,000,000	233,679,680	
第３５４回利付国債（１０年）	240,000,000	241,713,600	
第３５５回利付国債（１０年）	208,000,000	209,383,200	
第３５６回利付国債（１０年）	242,000,000	243,478,620	
第３５７回利付国債（１０年）	204,000,000	205,124,040	
第３５８回利付国債（１０年）	115,000,000	115,560,050	
第３５９回利付国債（１０年）	284,000,000	285,067,840	
第３６０回利付国債（１０年）	195,000,000	195,586,950	
第３６１回利付国債（１０年）	81,000,000	81,178,200	
第３６２回利付国債（１０年）	177,000,000	177,159,300	
第３６３回利付国債（１０年）	177,000,000	176,916,810	
第３６４回利付国債（１０年）	216,000,000	215,587,440	
第１回利付国債（３０年）	5,000,000	6,059,300	
第２回利付国債（３０年）	24,000,000	28,566,720	
第３回利付国債（３０年）	20,000,000	23,734,800	
第５回利付国債（３０年）	40,000,000	47,794,000	
第１８回利付国債（３０年）	4,000,000	5,050,000	
第２２回利付国債（３０年）	5,000,000	6,519,150	
第２６回利付国債（３０年）	11,000,000	14,325,630	
第２７回利付国債（３０年）	8,000,000	10,591,120	
第２８回利付国債（３０年）	20,000,000	26,611,600	
第２９回利付国債（３０年）	50,000,000	66,021,500	

第３１回利付国債（３０年）	44,000,000	57,056,120	
第３２回利付国債（３０年）	10,000,000	13,180,800	
第３３回利付国債（３０年）	38,000,000	48,258,480	
第３４回利付国債（３０年）	53,000,000	69,409,330	
第３５回利付国債（３０年）	40,000,000	51,054,400	
第３６回利付国債（３０年）	50,000,000	64,019,000	
第３７回利付国債（３０年）	46,000,000	58,216,680	
第３８回利付国債（３０年）	46,000,000	57,435,600	
第３９回利付国債（３０年）	73,000,000	92,754,530	
第４０回利付国債（３０年）	47,000,000	58,877,840	
第４１回利付国債（３０年）	73,000,000	90,111,930	
第４２回利付国債（３０年）	73,000,000	90,195,150	
第４３回利付国債（３０年）	24,000,000	29,681,040	
第４４回利付国債（３０年）	29,000,000	35,897,360	
第４５回利付国債（３０年）	31,000,000	37,102,350	
第４６回利付国債（３０年）	68,000,000	81,430,000	
第４７回利付国債（３０年）	51,000,000	62,229,690	
第４８回利付国債（３０年）	69,000,000	81,188,850	
第４９回利付国債（３０年）	64,000,000	75,331,200	
第５０回利付国債（３０年）	57,000,000	59,466,390	
第５１回利付国債（３０年）	76,000,000	70,621,480	
第５２回利付国債（３０年）	50,000,000	48,665,000	
第５３回利付国債（３０年）	68,000,000	67,633,480	
第５４回利付国債（３０年）	58,000,000	60,336,240	
第５５回利付国債（３０年）	54,000,000	56,132,460	
第５６回利付国債（３０年）	51,000,000	52,972,680	
第５７回利付国債（３０年）	52,000,000	53,968,200	
第５８回利付国債（３０年）	72,000,000	74,579,760	
第５９回利付国債（３０年）	69,000,000	69,698,280	
第６０回利付国債（３０年）	45,000,000	47,501,100	
第６１回利付国債（３０年）	67,000,000	67,381,230	
第６２回利付国債（３０年）	94,000,000	89,710,780	
第６３回利付国債（３０年）	50,000,000	46,391,500	
第６４回利付国債（３０年）	87,000,000	80,580,270	
第６５回利付国債（３０年）	79,000,000	73,041,820	
第６６回利付国債（３０年）	90,000,000	83,259,900	
第６７回利付国債（３０年）	48,000,000	46,696,800	
第６８回利付国債（３０年）	60,000,000	58,428,600	
第６９回利付国債（３０年）	43,000,000	42,947,970	
第７０回利付国債（３０年）	56,000,000	55,797,280	
第７１回利付国債（３０年）	88,000,000	87,678,800	
第７２回利付国債（３０年）	50,000,000	49,755,500	
第６０回利付国債（２０年）	8,000,000	8,107,200	
第６２回利付国債（２０年）	21,000,000	21,256,830	
第６３回利付国債（２０年）	6,000,000	6,157,320	

第６６回利付国債（２０年）	60,000,000	62,133,000	
第６７回利付国債（２０年）	30,000,000	31,266,300	
第７０回利付国債（２０年）	40,000,000	42,367,200	
第７１回利付国債（２０年）	45,000,000	47,447,100	
第７４回利付国債（２０年）	20,000,000	21,257,400	
第７５回利付国債（２０年）	30,000,000	32,046,900	
第７６回利付国債（２０年）	10,000,000	10,619,200	
第７８回利付国債（２０年）	10,000,000	10,669,000	
第７９回利付国債（２０年）	10,000,000	10,703,000	
第８０回利付国債（２０年）	40,000,000	42,948,400	
第８１回利付国債（２０年）	28,000,000	30,109,520	
第８２回利付国債（２０年）	40,000,000	43,159,600	
第８３回利付国債（２０年）	15,000,000	16,262,850	
第８４回利付国債（２０年）	60,000,000	64,816,800	
第８５回利付国債（２０年）	20,000,000	21,786,000	
第８６回利付国債（２０年）	10,000,000	10,976,100	
第８７回利付国債（２０年）	15,000,000	16,401,900	
第８８回利付国債（２０年）	20,000,000	22,066,400	
第８９回利付国債（２０年）	20,000,000	21,978,200	
第９０回利付国債（２０年）	65,000,000	71,781,450	
第９３回利付国債（２０年）	8,000,000	8,839,120	
第９４回利付国債（２０年）	8,000,000	8,880,320	
第９５回利付国債（２０年）	6,000,000	6,755,760	
第９９回利付国債（２０年）	15,000,000	16,882,950	
第１００回利付国債（２０年）	20,000,000	22,731,800	
第１０５回利付国債（２０年）	20,000,000	22,807,800	
第１０６回利付国債（２０年）	20,000,000	22,940,800	
第１０８回利付国債（２０年）	25,000,000	28,286,500	
第１１１回利付国債（２０年）	7,000,000	8,133,160	
第１１２回利付国債（２０年）	10,000,000	11,544,800	
第１１３回利付国債（２０年）	5,000,000	5,796,500	
第１１６回利付国債（２０年）	40,000,000	47,033,600	
第１１７回利付国債（２０年）	60,000,000	70,063,200	
第１２１回利付国債（２０年）	30,000,000	34,749,600	
第１２２回利付国債（２０年）	25,000,000	28,743,000	
第１２３回利付国債（２０年）	88,000,000	103,797,760	
第１２４回利付国債（２０年）	40,000,000	46,827,200	
第１２５回利付国債（２０年）	45,000,000	53,636,400	
第１２６回利付国債（２０年）	31,000,000	36,386,870	
第１２７回利付国債（２０年）	25,000,000	29,117,500	
第１２９回利付国債（２０年）	18,000,000	20,858,400	
第１３０回利付国債（２０年）	54,000,000	62,713,440	
第１３１回利付国債（２０年）	45,000,000	51,831,450	
第１３２回利付国債（２０年）	52,000,000	60,007,480	
第１３３回利付国債（２０年）	71,000,000	82,627,670	

	第１３４回利付国債（２０年）	46,000,000	53,638,300	
	第１３５回利付国債（２０年）	25,000,000	28,901,000	
	第１３６回利付国債（２０年）	40,000,000	45,841,600	
	第１３７回利付国債（２０年）	73,000,000	84,583,640	
	第１３８回利付国債（２０年）	40,000,000	45,528,000	
	第１３９回利付国債（２０年）	52,000,000	59,718,880	
	第１４０回利付国債（２０年）	60,000,000	69,675,000	
	第１４１回利付国債（２０年）	50,000,000	58,185,500	
	第１４２回利付国債（２０年）	45,000,000	52,848,450	
	第１４３回利付国債（２０年）	98,000,000	113,203,720	
	第１４４回利付国債（２０年）	76,000,000	86,960,720	
	第１４５回利付国債（２０年）	119,000,000	139,122,900	
	第１４６回利付国債（２０年）	84,000,000	98,399,280	
	第１４７回利付国債（２０年）	80,000,000	92,962,400	
	第１４８回利付国債（２０年）	105,000,000	120,969,450	
	第１４９回利付国債（２０年）	44,000,000	50,765,880	
	第１５０回利付国債（２０年）	103,000,000	117,740,330	
	第１５１回利付国債（２０年）	113,000,000	126,492,200	
	第１５２回利付国債（２０年）	125,000,000	140,023,750	
	第１５３回利付国債（２０年）	131,000,000	148,540,900	
	第１５４回利付国債（２０年）	110,000,000	123,384,800	
	第１５５回利付国債（２０年）	112,000,000	122,704,960	
	第１５６回利付国債（２０年）	120,000,000	121,545,600	
	第１５７回利付国債（２０年）	126,000,000	123,918,480	
	第１５８回利付国債（２０年）	114,000,000	116,789,580	
	第１５９回利付国債（２０年）	106,000,000	110,064,040	
	第１６０回利付国債（２０年）	103,000,000	108,340,550	
	第１６１回利付国債（２０年）	109,000,000	112,897,840	
	第１６２回利付国債（２０年）	95,000,000	98,304,100	
	第１６３回利付国債（２０年）	77,000,000	79,598,750	
	第１６４回利付国債（２０年）	103,000,000	104,800,440	
	第１６５回利付国債（２０年）	102,000,000	103,648,320	
	第１６６回利付国債（２０年）	82,000,000	85,839,240	
	第１６７回利付国債（２０年）	79,000,000	80,060,180	
	第１６８回利付国債（２０年）	94,000,000	93,548,800	
	第１６９回利付国債（２０年）	98,000,000	95,704,840	
	第１７０回利付国債（２０年）	80,000,000	77,973,600	
	第１７１回利付国債（２０年）	88,000,000	85,600,240	
	第１７２回利付国債（２０年）	89,000,000	87,957,810	
	第１７３回利付国債（２０年）	122,000,000	120,349,340	
	第１７４回利付国債（２０年）	116,000,000	114,215,920	
	第１７５回利付国債（２０年）	105,000,000	105,090,300	
	第１７６回利付国債（２０年）	97,000,000	96,914,640	
	第１７７回利付国債（２０年）	99,000,000	96,906,150	
	第１７８回利付国債（２０年）	116,000,000	115,585,880	

国債証券　合計		18,511,000,000	19,275,688,910	
地方債証券	第７８１回東京都公募公債	100,000,000	100,477,000	
	平成３０年度第１１回北海道公募公債（５年）	100,000,000	100,032,000	
	第２６回神奈川県公募公債（２０年）	20,000,000	22,827,800	
	第６回大阪府公募公債（２０年）	50,000,000	57,724,000	
	平成２８年度第２回京都府公募公債（１５年）	50,000,000	50,144,500	
	第４回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	111,519,000	
	平成３１年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	99,856,000	
	平成２９年度第７回広島県公募公債	100,000,000	100,740,000	
	平成２５年度第８回埼玉県公募公債	100,000,000	101,335,000	
	平成２７年度第３回福岡県公募公債	200,000,000	203,752,000	
	平成２９年度第１回広島市公募公債（５年）	100,000,000	100,001,000	
	令和元年度第３回岡山県公募公債（１０年）	100,000,000	99,193,000	
地方債証券　合計		1,120,000,000	1,147,601,300	
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	100,570,000	
	第４２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,662,000	
	第５８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,397,000	
特殊債券　合計		300,000,000	302,629,000	
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	99,999,000	
	第３３回道路債券	100,000,000	130,890,000	
	第２３回国際協力銀行債券	100,000,000	108,064,000	
	第１０１回都市再生債券	100,000,000	105,998,000	
	第５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,740,000	30,166,078	
	第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,265,000	33,867,602	
	第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,402,000	32,943,524	
	第５９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,997,000	36,826,993	
	第１６回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	101,473,000	
	第８３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,150,000	
	第５０３回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,381,000	
	第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,257,000	
	第１０回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,294,000	
	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	101,002,000	
社債券　合計		1,127,404,000	1,190,312,197	

合計	21,058,404,000	21,916,231,407	

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。

「TMA日本債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区　　分	注記番号	[2021年 1月25日現在] 金額（円）	[2022年 1月25日現在] 金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		4,950,000	11,304,500
コール・ローン		489,527,519	869,071,016
国債証券		61,428,173,690	47,539,925,270
地方債証券		1,200,932,000	―
特殊債券		700,966,000	―
社債券		26,803,468,942	44,856,954,319
未収入金		3,982,165,250	1,040,049,058
未収利息		86,105,154	90,720,483
前払費用		19,329,353	8,408,052
流動資産合計		94,715,617,908	94,416,432,698
資産合計		94,715,617,908	94,416,432,698
負債の部			
流動負債			
未払金		3,972,926,000	1,337,075,700
未払解約金		92,958,464	71,140,440
未払利息		269	919
流動負債合計		4,065,884,733	1,408,217,059
負債合計		4,065,884,733	1,408,217,059
純資産の部			
元本等			
元本	※1	64,220,170,509	65,890,862,584
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		26,429,562,666	27,117,353,055
元本等合計		90,649,733,175	93,008,215,639
純資産合計		90,649,733,175	93,008,215,639
負債純資産合計		94,715,617,908	94,416,432,698

(2) 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自 2021年 1月26日 至 2022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
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分		[2021年 1月25日現在]	[2022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	65,498,782,795円	64,220,170,509円
	同期中における追加設定元本額	15,379,414,940円	19,639,346,253円
	同期中における一部解約元本額	16,658,027,226円	17,968,654,178円
	同期末における元本額	64,220,170,509円	65,890,862,584円
	元本の内訳＊		
	東京海上セレクション・バランス30	4,178,697,120円	4,630,321,079円
	東京海上セレクション・バランス50	5,447,469,228円	6,213,633,874円
	東京海上セレクション・バランス70	1,391,025,872円	1,671,534,831円
	東京海上セレクション・日本債券	12,446,097,419円	12,093,352,737円
	東京海上・日本債券オープン（野村ＳＭＡ向け）	6,095,659,026円	5,859,062,017円
	東京海上・日本債券オープン（野村SMA・EW向け）	24,833,132,336円	30,814,526,621円
	東京海上・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）	148,786,045円	250,992,114円
	ＴＭＡバランス25ＶＡ〈適格機関投資家限定〉	165,838,498円	124,416,695円
	ＴＭＡバランス50ＶＡ〈適格機関投資家限定〉	72,318,610円	74,923,589円
	ＴＭＡバランス75ＶＡ〈適格機関投資家限定〉	8,011,006円	7,611,219円
	東京海上・日本債券オープンF（適格機関投資家専用）	9,433,135,349円	4,150,487,808円
	計	64,220,170,509円	65,890,862,584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	64,220,170,509口	65,890,862,584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）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	自 2021年 1月26日 至 2022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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	[2021年 1月25日現在]	[2022年 1月25日現在]
1．貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
（自 2020年1月28日　至 2021年1月25日）
売買目的有価証券

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△468,687,520円
地方債証券	△2,282,000円
特殊債券	△75,000円
社債券	73,281,091円
合計	△397,763,429円

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年3月24日から2021年1月25日まで)を指しております。

（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	△306,483,890円
社債券	△40,731,286円
合計	△347,215,176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。

（1口当たり情報に関する注記）

[2021年 1月25日現在]	[2022年 1月25日現在]
1口当たり純資産額　1.4115円 （1万口当たり純資産額　14,115円）	1口当たり純資産額　1.4115円 （1万口当たり純資産額　14,115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４３１回利付国債（２年）	1,541,000,000	1,543,126,580	
	第４３２回利付国債（２年）	356,000,000	356,516,200	
	第１４８回利付国債（５年）	95,000,000	95,229,900	
	第１４９回利付国債（５年）	700,000,000	701,463,000	
	第１５０回利付国債（５年）	9,892,000,000	9,908,915,320	
	第７回利付国債（４０年）	10,000,000	12,774,900	
	第１０回利付国債（４０年）	444,000,000	467,070,240	
	第１１回利付国債（４０年）	27,000,000	27,540,270	
	第１４回利付国債（４０年）	2,346,000,000	2,300,041,860	
	第３４７回利付国債（１０年）	590,000,000	594,141,800	
	第３４９回利付国債（１０年）	300,000,000	302,214,000	
	第３５４回利付国債（１０年）	295,000,000	297,106,300	
	第３６１回利付国債（１０年）	100,000,000	100,220,000	
	第３６２回利付国債（１０年）	200,000,000	200,180,000	
	第３６３回利付国債（１０年）	500,000,000	499,765,000	
	第３６４回利付国債（１０年）	1,873,000,000	1,869,422,570	
	第３６５回利付国債（１０年）	6,570,000,000	6,547,530,600	
	第１５回利付国債（３０年）	1,000,000	1,275,920	
	第２３回利付国債（３０年）	248,000,000	324,193,040	
	第２６回利付国債（３０年）	75,000,000	97,674,750	
	第２７回利付国債（３０年）	40,000,000	52,955,600	
	第２８回利付国債（３０年）	50,000,000	66,529,000	
	第３３回利付国債（３０年）	674,000,000	855,953,040	
	第３４回利付国債（３０年）	150,000,000	196,441,500	
	第３８回利付国債（３０年）	710,000,000	886,506,000	
	第４０回利付国債（３０年）	561,000,000	702,775,920	
	第４１回利付国債（３０年）	147,000,000	181,458,270	
	第４４回利付国債（３０年）	450,000,000	557,028,000	
	第４５回利付国債（３０年）	30,000,000	35,905,500	
	第４７回利付国債（３０年）	140,000,000	170,826,600	
	第４８回利付国債（３０年）	644,000,000	757,762,600	

	第５１回利付国債（３０年）	600,000,000	557,538,000	
	第５２回利付国債（３０年）	790,000,000	768,907,000	
	第５４回利付国債（３０年）	5,000,000	5,201,400	
	第５６回利付国債（３０年）	835,000,000	867,297,800	
	第５７回利付国債（３０年）	536,000,000	556,287,600	
	第５８回利付国債（３０年）	466,000,000	482,696,780	
	第５９回利付国債（３０年）	250,000,000	252,530,000	
	第６０回利付国債（３０年）	70,000,000	73,890,600	
	第６３回利付国債（３０年）	710,000,000	658,759,300	
	第６４回利付国債（３０年）	700,000,000	648,347,000	
	第６５回利付国債（３０年）	1,424,000,000	1,316,601,920	
	第６７回利付国債（３０年）	112,000,000	108,959,200	
	第６８回利付国債（３０年）	100,000,000	97,381,000	
	第６９回利付国債（３０年）	1,000,000	998,790	
	第７１回利付国債（３０年）	101,000,000	100,631,350	
	第７２回利付国債（３０年）	329,000,000	327,391,190	
	第７３回利付国債（３０年）	1,220,000,000	1,213,985,400	
	第１４４回利付国債（２０年）	2,000,000	2,288,440	
	第１４５回利付国債（２０年）	80,000,000	93,528,000	
	第１４６回利付国債（２０年）	42,000,000	49,199,640	
	第１４７回利付国債（２０年）	30,000,000	34,860,900	
	第１５０回利付国債（２０年）	103,000,000	117,740,330	
	第１５１回利付国債（２０年）	22,000,000	24,626,800	
	第１５２回利付国債（２０年）	103,000,000	115,379,570	
	第１５５回利付国債（２０年）	62,000,000	67,925,960	
	第１５６回利付国債（２０年）	400,000,000	405,152,000	
	第１５７回利付国債（２０年）	100,000,000	98,348,000	
	第１５８回利付国債（２０年）	215,000,000	220,261,050	
	第１６０回利付国債（２０年）	265,000,000	278,740,250	
	第１６１回利付国債（２０年）	450,000,000	466,092,000	
	第１６２回利付国債（２０年）	1,750,000,000	1,810,865,000	
	第１６４回利付国債（２０年）	314,000,000	319,488,720	
	第１６５回利付国債（２０年）	110,000,000	111,777,600	
	第１６８回利付国債（２０年）	670,000,000	666,784,000	
	第１６９回利付国債（２０年）	227,000,000	221,683,660	
	第１７０回利付国債（２０年）	577,000,000	562,384,590	
	第１７６回利付国債（２０年）	200,000,000	199,824,000	
	第１７７回利付国債（２０年）	910,000,000	890,753,500	
	第１７８回利付国債（２０年）	207,000,000	206,261,010	
	第１７９回利付国債（２０年）	1,736,000,000	1,728,170,640	
	第１９回インドネシア共和国円貨債券（２０２１）	100,000,000	99,841,000	
国債証券　合計		46,683,000,000	47,539,925,270	
社債券	第１回ＢＰＣＥ円貨社債（５年）	100,000,000	99,997,000	
	第９回ＢＰＣＥ円貨社債（劣後）	200,000,000	199,464,000	

第１回クレディ・アグリコル円貨社債（劣後）	100,000,000	103,567,000	
第９回クレディ・アグリコル円貨社債	200,000,000	199,502,000	
第４回ロイズ・バンキング・グループ円貨社債	200,000,000	200,192,000	
第１回バンコ・サンタンデール無担保社債	100,000,000	100,181,000	
第２回ヤンマーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,332,000	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,233,000	11,447,774	
第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	24,164,000	24,728,712	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,360,000	38,055,830	
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	48,421,000	48,303,821	
第９回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	84,608,000	84,424,400	
第１７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,077,000	98,920,458	
第１７４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,414,000	99,698,324	
第１７７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,410,000	
第２回株式会社商工組合中央金庫無担保社債（劣後）	300,000,000	300,996,000	
ゴールドマン・サックスＥＭＴＮ２０１８	400,000,000	398,912,000	
第２３回ルノー円貨社債（２０２１）	100,000,000	100,053,000	
第２４回ルノー円貨社債（２０２１）	100,000,000	100,678,000	
第３回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債（２０１８）	100,000,000	99,950,000	
ソシエテ・ジェネラルＥＭＴＮ２０２１	300,000,000	298,800,000	
第８１回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,836,000	
第８５回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	197,874,000	
第１４５回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,821,000	
第１回国際石油開発帝石株式会社無担保社債	100,000,000	99,875,000	
第２回国際石油開発帝石株式会社無担保社債	100,000,000	100,224,000	
第２回株式会社高松コンストラクショングループ無担保社債	200,000,000	199,866,000	
第３０回清水建設株式会社無担保社債	200,000,000	200,922,000	
第１２回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	199,128,000	
第１４回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	100,000,000	100,163,000	
第８回戸田建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,740,000	

第７回五洋建設株式会社無担保社債	500,000,000	498,835,000	
第２５回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,548,000	
第３回協和エクシオ株式会社無担保社債	100,000,000	99,991,000	
第４回高砂熱学工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,790,000	
ＢＮＰパリバＥＭＴＮ２０２１	200,000,000	199,060,000	
バークレイズＥＭＴＮ２０２１	300,000,000	300,597,000	
バークシャー・ハサウェイＥＭＴＮ２０２１	500,000,000	495,320,000	
アフラックＥＭＴＮ２０２１	200,000,000	198,420,000	
第２回パーソルホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,890,000	
第１４回日本ハム株式会社無担保社債	300,000,000	298,422,000	
第１回アサヒグループホールディングス無担保社債（劣後）	200,000,000	203,474,000	
第１６回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,671,000	
第１８回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,827,000	
第１９回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,262,000	
第２０回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,000,000	
第３５回双日株式会社無担保社債	100,000,000	101,223,000	
第２回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,940,000	
第６回日本アコモデーションファンド投資法人無担保投資法人債	200,000,000	198,250,000	
第１５回野村不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,826,000	
第１回株式会社オープンハウス無担保社債	100,000,000	99,819,000	
第１回帝人株式会社無担保社債（劣後）	100,000,000	100,349,000	
第１回三井不動産ロジスティクスパーク投資法人債	100,000,000	99,828,000	
第１回日本土地建物株式会社無担保社債	100,000,000	99,824,000	
第３回日本土地建物株式会社無担保社債	100,000,000	99,516,000	
第５回日本土地建物株式会社無担保社債	100,000,000	98,991,000	
第２８回北越コーポレーション株式会社無担保社債	300,000,000	299,361,000	
第２１回大王製紙株式会社無担保社債	200,000,000	201,326,000	
第２回住友化学株式会社無担保社債（劣後）	100,000,000	100,621,000	
第１回日本酸素ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,718,000	
第５２回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,942,000	
第４０回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,696,000	

第４１回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	300,000,000	299,193,000	
第１６回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,549,000	
第１７回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	400,000,000	403,952,000	
第１６回武田薬品工業株式会社無担保社債	1,000,000,000	996,300,000	
第４８回ＤＩＣ株式会社無担保社債	200,000,000	198,632,000	
第４９回ＤＩＣ株式会社無担保社債	300,000,000	296,667,000	
第１９回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,645,000	
第１６回楽天株式会社無担保社債	200,000,000	199,528,000	
第１２回株式会社資生堂無担保社債	400,000,000	399,144,000	
第１２回出光興産株式会社無担保社債	100,000,000	99,959,000	
第１４回出光興産株式会社無担保社債	300,000,000	297,549,000	
第１回ＥＮＥＯＳホールディングス株式会社無担保社債（劣後）	200,000,000	200,494,000	
第２回ＥＮＥＯＳホールディングス株式会社無担保社債（劣後）	400,000,000	404,528,000	
第４７回古河電気工業株式会社無担保社債	200,000,000	201,012,000	
第９回日本発条株式会社無担保社債	200,000,000	199,536,000	
第２回テクノプロ・ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,811,000	
第１回株式会社リクルートホールディングス無担保社債	200,000,000	199,998,000	
第２０回日立建機株式会社無担保社債	100,000,000	99,430,000	
第１回栗田工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,614,000	
第１５回ＴＨＫ株式会社無担保社債	100,000,000	99,480,000	
第１回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,849,000	
第１回株式会社明電舎無担保社債	100,000,000	100,024,000	
第１９回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,039,000	
第２２回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,145,000	
第１回パナソニック株式会社無担保社債（劣後）	600,000,000	603,126,000	
第２回パナソニック株式会社無担保社債（劣後）	500,000,000	502,095,000	
第３回パナソニック株式会社無担保社債（劣後）	300,000,000	303,657,000	
第９回ＴＤＫ株式会社無担保社債	300,000,000	298,692,000	
第２７回日立造船株式会社無担保社債	100,000,000	99,304,000	
第４６回株式会社ＩＨＩ無担保社債	200,000,000	199,858,000	
第５回Ａ号富国生命保険相互会社無担保社債（劣後）	100,000,000	100,089,000	
第２０回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,130,000	

第２１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,974,000	
第３回昭和リース株式会社無担保社債	300,000,000	299,346,000	
第２回株式会社かんぽ生命保険無担保社債（劣後）	500,000,000	509,980,000	
第１回大樹生命保険株式会社無担保社債（劣後）	100,000,000	100,338,000	
第１回明治安田生命２０１７基金特定目的会社特定社債	200,000,000	200,114,000	
第３回明治安田生命保険無担保社債（劣後特約付）	400,000,000	403,540,000	
第９回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス無担保社債	100,000,000	99,981,000	
第３１回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,059,000	
第２６回トヨタ自動車株式会社無担保社債	300,000,000	299,553,000	
第２７回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	199,980,000	
第１回愛三工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,861,000	
第１回日本生命第１回劣後ローン流動化株式会社無担保社債（劣後）	200,000,000	203,542,000	
第１回日本生命第２回劣後ローン流動化株式会社無担保社債（劣後）	300,000,000	304,854,000	
第１回明治安田生命２０１８基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,108,000	
第１回住友生命第１回劣後ローン流動化株式会社無担保（劣後）	100,000,000	99,881,000	
第５回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	99,629,000	
第１回オリックス銀行株式会社無担保社債	300,000,000	300,366,000	
第１回明治安田生命株式会社無担保社債（劣後）	100,000,000	100,405,000	
第２３回株式会社ニコン無担保社債	200,000,000	199,070,000	
第３回兼松株式会社無担保社債	100,000,000	100,066,000	
第７回三菱商事株式会社無担保社債（劣後）	500,000,000	498,990,000	
第６回株式会社新生銀行無担保社債	200,000,000	200,076,000	
第２８回株式会社あおぞら銀行無担保社債	200,000,000	200,042,000	
第１１回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	100,201,000	
第１回株式会社千葉銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,000,000	
第３回株式会社群馬銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	199,896,000	
第２回株式会社北國銀行無担保社債（劣後）	200,000,000	199,974,000	
第１８回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	300,000,000	300,294,000	

第１９回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	200,000,000	199,998,000	
第１０回みずほフィナンシャルグループ（劣後）	600,000,000	608,892,000	
第２８回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,642,000	
第３０回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,146,000	
第３１回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,425,000	
第７回みずほリース株式会社無担保社債	300,000,000	299,910,000	
第９回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,130,000	
第１０回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,807,000	
第１７回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	201,108,000	
第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	500,000,000	503,800,000	
第２０回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	299,307,000	
第２１回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,812,000	
第２２回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	299,166,000	
第６９回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,342,000	
第７０回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,818,000	
第７１回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,260,000	
第７２回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	400,000,000	399,308,000	
第２５回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,767,000	
第２６回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,631,000	
第２８回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,390,000	
第１６回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,814,000	
第１回イオンプロダクトファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	300,888,000	
第７７回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,150,000	
第８０回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,080,000	
第８１回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,521,000	
第３０回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,058,000	
第３２回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,783,000	
第３３回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,658,000	
第３５回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,735,000	

第１８回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	200,000,000	203,386,000	
第３０回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	100,000,000	99,282,000	
第３２回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	100,000,000	99,957,000	
第８７回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,804,000	
第２０１回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,495,000	
第２０４回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,586,000	
第２０５回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,405,000	
第１回三菱ＨＣキャピタル株式会社無担保社債（劣後）	600,000,000	602,502,000	
第３６回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,784,000	
第３７回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,783,000	
第５１回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,101,000	
第１回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,016,000	
第３回野村ホールディングス株式会社無担保社債（劣後）	300,000,000	306,018,000	
第１回アニコム　ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,910,000	
第１回第一生命ホールディングス無担保社債（劣後）	100,000,000	102,346,000	
第３回第一生命ホールディングス無担保社債（劣後）	300,000,000	304,659,000	
第４回第一生命ホールディングス無担保社債（劣後）	100,000,000	100,241,000	
第７回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	199,998,000	
第３回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	100,385,000	
第５回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債（劣後）	100,000,000	101,654,000	
第１回あいおいニッセイ同和損害保険株式会社無担保社債（劣後）	200,000,000	200,804,000	
第２０回ＮＥＣキャピタルソリューション株式会社無担保社債	300,000,000	296,631,000	
第１回株式会社Ｔ＆Ｄホールディングス無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	203,696,000	
第２回株式会社Ｔ＆Ｄホールディングス無担保社債（劣後）	100,000,000	100,027,000	
第３回株式会社Ｔ＆Ｄホールディングス無担保社債（劣後）	100,000,000	100,516,000	

第５回三菱地所株式会社無担保社債（劣後）	100,000,000	100,041,000	
第１３５回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	198,638,000	
第１０９回住友不動産株式会社無担保社債	700,000,000	695,303,000	
第１１０回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,127,000	
第１０回ＮＴＴ都市開発リート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	99,256,000	
第１回森トラスト・ホールディングス無担保社債	500,000,000	496,640,000	
第５回東急株式会社無担保社債	500,000,000	499,415,000	
第５８回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,667,000	
第１６３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	199,154,000	
第１６４回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	500,000,000	499,385,000	
第７３回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,576,000	
第７回株式会社鴻池運輸無担保社債	200,000,000	199,846,000	
第５８回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,755,000	
第５９回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,472,000	
第６２回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,302,000	
第６４回名古屋鉄道株式会社無担保社債	400,000,000	398,344,000	
第８回ニッコンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,869,000	
第４３回日本郵船株式会社無担保社債	100,000,000	99,622,000	
第２回飯野海運株式会社無担保社債	100,000,000	99,905,000	
第７回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,586,000	
第８回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	198,928,000	
第４回株式会社ヤマタネ無担保社債	200,000,000	200,036,000	
第４回株式会社近鉄エクスプレス無担保社債	100,000,000	99,377,000	
第１１回ソフトバンク無担保社債	100,000,000	99,784,000	
第１２回ソフトバンク無担保社債	100,000,000	99,661,000	
第１３回ソフトバンク無担保社債	200,000,000	198,586,000	
第１８回ソフトバンク無担保社債	100,000,000	99,957,000	
第１回ＧＭＯインターネット株式会社無担保社債	100,000,000	99,846,000	
第２回ＧＭＯインターネット株式会社無担保社債	100,000,000	99,765,000	
第５４６回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,251,000	
第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,257,000	
第５３８回関西電力株式会社社債	600,000,000	599,736,000	
第５４１回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,768,000	

	第４１６回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,215,000	
	第３１６回北陸電力株式会社社債	400,000,000	402,536,000	
	第３４２回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,391,000	
	第３４３回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,310,000	
	第３４５回北陸電力株式会社社債	200,000,000	198,046,000	
	第５２７回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,560,000	
	第５２９回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,429,000	
	第５３０回東北電力株式会社社債	200,000,000	199,230,000	
	第５３１回東北電力株式会社社債	300,000,000	298,338,000	
	第５３５回東北電力株式会社社債	200,000,000	198,530,000	
	第１回九州電力株式会社無担保社債（劣後）	100,000,000	101,488,000	
	第３回九州電力株式会社無担保社債（劣後）	100,000,000	103,958,000	
	第４９１回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,052,000	
	第４９３回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,526,000	
	第４９４回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,267,000	
	第３７０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,357,000	
	第７２回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	199,568,000	
	第７３回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	198,654,000	
	第１５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1,000,000,000	1,023,030,000	
	第３５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	209,670,000	
	第３９回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	103,870,000	
	第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,076,000	
	第４５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,441,000	
	第４７回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,048,000	
	第２回株式会社ＪＥＲＡ無担保社債	400,000,000	399,832,000	
	第１回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	200,000,000	199,844,000	
	第２回大阪瓦斯株式会社無担保社債（劣後）	100,000,000	99,696,000	
	第６回株式会社イチネンホールディングス無担保社債	100,000,000	99,818,000	
	第７回株式会社イチネンホールディングス無担保社債	100,000,000	99,796,000	
	第８回ＳＣＳＫ株式会社無担保社債	100,000,000	99,588,000	
	第１４回コナミホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,716,000	
	第４回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	102,339,000	
社債券　合計		44,803,277,000	44,856,954,319	
合計		91,486,277,000	92,396,879,589	

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・ＪＰＸ日経400インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区　　分	注記番号	[2021年 1月25日現在] 金額（円）	[2022年 1月25日現在] 金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		175,552,157	190,268,935
株式	※2	3,767,417,090	3,030,369,060
派生商品評価勘定		5,638,400	―
未収配当金		5,108,200	4,443,500
前払金		―	3,782,000
流動資産合計		3,953,715,847	3,228,863,495
資産合計		3,953,715,847	3,228,863,495
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		―	7,031,900
前受金		5,495,000	―
未払解約金		64,700,709	2,830,320
未払利息		96	201
流動負債合計		70,195,805	9,862,421
負債合計		70,195,805	9,862,421
純資産の部			
元本等			
元本	※1	2,063,135,641	1,654,043,540
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		1,820,384,401	1,564,957,534
元本等合計		3,883,520,042	3,219,001,074
純資産合計		3,883,520,042	3,219,001,074
負債純資産合計		3,953,715,847	3,228,863,495

(2) 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自 2021年 1月26日 至 2022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
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	[2021年 1月25日現在]	[2022年 1月25日現在]
1.※1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	2,995,224,189円	2,063,135,641円
同期中における追加設定元本額	1,231,886,848円	365,657,200円
同期中における一部解約元本額	2,163,975,396円	774,749,301円
同期末における元本額	2,063,135,641円	1,654,043,540円
元本の内訳＊		
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）	115,626,975円	173,853,550円
東京海上・ＪＰＸ日経400インデックスファンド＜適格機関投資家限定＞	1,947,508,666円	1,480,189,990円
計	2,063,135,641円	1,654,043,540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	2,063,135,641口	1,654,043,540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 161,265,000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 77,587,000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）
Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	自 2021年 1月26日 至 2022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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	[2021年 1月25日現在]	[2022年 1月25日現在]
1．貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）
（自 2020年1月28日　至 2021年1月25日）
売買目的有価証券

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	629,132,626円
合計	629,132,626円

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年8月7日から2021年1月25日まで)を指しております。

（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	△49,600,860円

合計	△49,600,860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8月7日から2022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
（2021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	105,835,000	—	111,480,000	5,645,000
	東証株価指数先物	105,835,000	—	111,480,000	5,645,000
合　計		105,835,000	—	111,480,000	5,645,000

（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	177,302,000	—	170,280,000	△7,022,000
	東証株価指数先物	177,302,000	—	170,280,000	△7,022,000
合　計		177,302,000	—	170,280,000	△7,022,000

(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）

[2021年 1月25日現在]		[2022年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額	1.8823円	1口当たり純資産額	1.9461円
（1万口当たり純資産額	18,823円）	（1万口当たり純資産額	19,461円）

(3) 附属明細表
第1　有価証券明細表
(1)株式

（単位：円）

銘　柄	株式数	評価額		備　考
		単価	金額	

日本水産	2,300	542.00	1,246,600	
ＩＮＰＥＸ	8,700	1,097.00	9,543,900	
ミライト・ホールディングス	800	1,863.00	1,490,400	
安藤・間	1,300	864.00	1,123,200	
東急建設	700	696.00	487,200	
コムシスホールディングス	800	2,736.00	2,188,800	
東建コーポレーション	100	9,380.00	938,000	
大成建設	1,500	3,735.00	5,602,500	
大林組	5,100	927.00	4,727,700	
清水建設	4,800	770.00	3,696,000	
長谷工コーポレーション	1,600	1,443.00	2,308,800	
鹿島建設	3,800	1,369.00	5,202,200	
西松建設	400	3,775.00	1,510,000	
三井住友建設	1,200	427.00	512,400	
戸田建設	2,100	740.00	1,554,000	
熊谷組	300	2,898.00	869,400	
大東建託	500	13,330.00	6,665,000	
ＮＩＰＰＯ	500	3,995.00	1,997,500	
五洋建設	2,100	638.00	1,339,800	
住友林業	1,200	2,031.00	2,437,200	
大和ハウス工業	4,600	3,388.00	15,584,800	
積水ハウス	5,400	2,345.00	12,663,000	
関電工	800	871.00	696,800	
エクシオグループ	800	2,381.00	1,904,800	
九電工	400	3,350.00	1,340,000	
インフロニア・ホールディングス	2,200	1,068.00	2,349,600	
森永製菓	400	3,685.00	1,474,000	
カルビー	800	2,712.00	2,169,600	
森永乳業	400	5,630.00	2,252,000	
ヤクルト本社	1,100	5,980.00	6,578,000	
明治ホールディングス	1,100	7,310.00	8,041,000	
プリマハム	200	2,538.00	507,600	
日本ハム	700	4,490.00	3,143,000	
アサヒグループホールディングス	3,800	4,825.00	18,335,000	
キリンホールディングス	5,900	1,879.00	11,086,100	
サントリー食品インターナショナル	1,100	4,395.00	4,834,500	
伊藤園	500	6,380.00	3,190,000	
キッコーマン	1,100	8,430.00	9,273,000	
味の素	3,500	3,180.00	11,130,000	
キユーピー	900	2,352.00	2,116,800	
カゴメ	700	3,070.00	2,149,000	
アリアケジャパン	200	6,200.00	1,240,000	
ニチレイ	800	2,628.00	2,102,400	
東洋水産	800	4,715.00	3,772,000	
日清食品ホールディングス	700	8,130.00	5,691,000	

日本たばこ産業	8,600	2,351.50	20,222,900	
帝人	1,600	1,456.00	2,329,600	
東レ	11,300	730.80	8,258,040	
ゴールドウイン	300	6,060.00	1,818,000	
王子ホールディングス	6,600	602.00	3,973,200	
大王製紙	800	1,848.00	1,478,400	
レンゴー	1,600	859.00	1,374,400	
クラレ	2,300	1,027.00	2,362,100	
旭化成	10,400	1,129.50	11,746,800	
昭和電工	1,300	2,318.00	3,013,400	
住友化学	11,700	572.00	6,692,400	
日産化学	800	6,040.00	4,832,000	
東ソー	2,300	1,765.00	4,059,500	
トクヤマ	600	1,843.00	1,105,800	
デンカ	600	3,940.00	2,364,000	
信越化学工業	2,300	18,135.00	41,710,500	
エア・ウォーター	1,500	1,734.00	2,601,000	
日本酸素ホールディングス	1,600	2,347.00	3,755,200	
三菱瓦斯化学	1,500	2,106.00	3,159,000	
三井化学	1,500	3,140.00	4,710,000	
三菱ケミカルホールディングス	10,500	882.30	9,264,150	
ダイセル	2,300	806.00	1,853,800	
積水化学工業	3,300	1,928.00	6,362,400	
日本ゼオン	1,400	1,300.00	1,820,000	
アイカ工業	500	3,270.00	1,635,000	
宇部興産	800	2,050.00	1,640,000	
日油	600	5,250.00	3,150,000	
花王	3,500	5,955.00	20,842,500	
日本ペイントホールディングス	5,900	908.00	5,357,200	
関西ペイント	1,700	2,442.00	4,151,400	
ＤＩＣ	700	2,944.00	2,060,800	
富士フイルムホールディングス	2,800	7,648.00	21,414,400	
資生堂	2,900	5,875.00	17,037,500	
ライオン	2,000	1,555.00	3,110,000	
ファンケル	700	2,900.00	2,030,000	
コーセー	300	10,850.00	3,255,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	700	1,773.00	1,241,100	
小林製薬	500	8,800.00	4,400,000	
日東電工	900	8,810.00	7,929,000	
エフピコ	300	3,680.00	1,104,000	
ニフコ	500	3,755.00	1,877,500	
ユニ・チャーム	3,000	4,836.00	14,508,000	
協和キリン	1,800	2,910.00	5,238,000	
武田薬品工業	11,800	3,282.00	38,727,600	5,500株
アステラス製薬	13,900	1,939.50	26,959,050	

大日本住友製薬	1,100	1,349.00	1,483,900	
塩野義製薬	2,000	6,789.00	13,578,000	
日本新薬	400	7,600.00	3,040,000	
中外製薬	5,000	3,698.00	18,490,000	
科研製薬	300	4,225.00	1,267,500	
エーザイ	1,900	5,893.00	11,196,700	
ロート製薬	900	3,195.00	2,875,500	
小野薬品工業	3,600	2,680.00	9,648,000	
参天製薬	2,900	1,334.00	3,868,600	
ＪＣＲファーマ	500	2,048.00	1,024,000	
東和薬品	300	2,757.00	827,100	
第一三共	12,600	2,606.00	32,835,600	
大塚ホールディングス	3,300	4,203.00	13,869,900	
ペプチドリーム	800	2,084.00	1,667,200	
サワイグループホールディングス	400	4,410.00	1,764,000	
出光興産	1,800	3,250.00	5,850,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	24,300	452.10	10,986,030	
コスモエネルギーホールディングス	500	2,302.00	1,151,000	
横浜ゴム	1,000	1,706.00	1,706,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	900	1,634.00	1,470,600	
ブリヂストン	4,600	5,063.00	23,289,800	
住友ゴム工業	1,500	1,197.00	1,795,500	
ＡＧＣ	1,400	5,110.00	7,154,000	
太平洋セメント	1,000	2,298.00	2,298,000	
東海カーボン	1,400	1,200.00	1,680,000	
ＴＯＴＯ	1,100	4,900.00	5,390,000	
日本碍子	1,800	1,893.00	3,407,400	
日本特殊陶業	1,300	1,954.00	2,540,200	
ニチアス	400	2,602.00	1,040,800	
三井金属鉱業	500	3,135.00	1,567,500	
住友金属鉱山	2,000	5,088.00	10,176,000	
住友電気工業	6,000	1,543.50	9,261,000	
アサヒホールディングス	700	2,068.00	1,447,600	
ＳＵＭＣＯ	2,500	2,183.00	5,457,500	
三和ホールディングス	1,500	1,247.00	1,870,500	
リンナイ	300	10,490.00	3,147,000	
日本製鋼所	500	3,680.00	1,840,000	
三浦工業	700	3,395.00	2,376,500	
アマダ	2,500	1,118.00	2,795,000	
ＦＵＪＩ	800	2,504.00	2,003,200	
オーエスジー	800	1,995.00	1,596,000	
ＤＭＧ森精機	1,000	1,781.00	1,781,000	
ディスコ	300	31,250.00	9,375,000	
オプトラン	300	2,303.00	690,900	
ナブテスコ	900	3,425.00	3,082,500	

ＳＭＣ	500	63,690.00	31,845,000	
小松製作所	7,200	2,800.00	20,160,000	
住友重機械工業	1,000	2,965.00	2,965,000	
日立建機	700	2,954.00	2,067,800	
クボタ	7,800	2,418.00	18,860,400	
荏原製作所	700	5,580.00	3,906,000	
ダイキン工業	2,000	24,295.00	48,590,000	
ダイフク	800	7,940.00	6,352,000	
竹内製作所	300	2,818.00	845,400	
ホシザキ	500	8,350.00	4,175,000	
日本精工	3,000	772.00	2,316,000	
マキタ	1,900	4,531.00	8,608,900	
三菱重工業	2,600	3,022.00	7,857,200	
ＩＨＩ	1,100	2,224.00	2,446,400	
ブラザー工業	2,000	2,194.00	4,388,000	
ミネベアミツミ	2,700	2,656.00	7,171,200	
日立製作所	7,300	6,171.00	45,048,300	
三菱電機	16,000	1,457.00	23,312,000	
富士電機	1,000	5,460.00	5,460,000	
安川電機	1,800	4,815.00	8,667,000	
日本電産	3,800	10,545.00	40,071,000	
オムロン	1,300	9,199.00	11,958,700	
ＭＣＪ	600	973.00	583,800	
日本電気	2,000	4,920.00	9,840,000	
富士通	1,400	17,655.00	24,717,000	
ルネサスエレクトロニクス	8,800	1,250.00	11,000,000	
セイコーエプソン	2,000	1,987.00	3,974,000	
ワコム	1,300	834.00	1,084,200	
アルバック	300	5,900.00	1,770,000	
エレコム	400	1,394.00	557,600	
パナソニック	17,100	1,269.00	21,699,900	
アンリツ	1,100	1,574.00	1,731,400	
ソニーグループ	4,300	12,480.00	53,664,000	
ＴＤＫ	2,300	4,000.00	9,200,000	
横河電機	1,600	1,915.00	3,064,000	
アズビル	1,000	4,480.00	4,480,000	
日本光電工業	700	3,075.00	2,152,500	
堀場製作所	300	6,070.00	1,821,000	
アドバンテスト	1,200	9,450.00	11,340,000	
キーエンス	800	58,780.00	47,024,000	
シスメックス	1,300	10,660.00	13,858,000	
レーザーテック	700	26,035.00	18,224,500	
スタンレー電気	1,200	2,727.00	3,272,400	
カシオ計算機	1,200	1,457.00	1,748,400	
ファナック	1,400	22,920.00	32,088,000	

浜松ホトニクス	1,100	5,830.00	6,413,000	
京セラ	2,200	6,899.00	15,177,800	
太陽誘電	700	5,530.00	3,871,000	
村田製作所	4,700	8,553.00	40,199,100	
小糸製作所	900	6,050.00	5,445,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	300	11,220.00	3,366,000	
東京エレクトロン	1,000	56,870.00	56,870,000	
トヨタ紡織	700	2,094.00	1,465,800	
豊田自動織機	1,200	8,950.00	10,740,000	
デンソー	3,500	8,688.00	30,408,000	
いすゞ自動車	5,000	1,386.00	6,930,000	
トヨタ自動車	23,900	2,236.50	53,452,350	
日野自動車	2,100	962.00	2,020,200	
アイシン	1,100	4,310.00	4,741,000	
本田技研工業	12,600	3,399.00	42,827,400	
スズキ	3,600	4,609.00	16,592,400	
ＳＵＢＡＲＵ	4,600	2,069.00	9,517,400	
ヤマハ発動機	2,100	2,736.00	5,745,600	
豊田合成	600	2,398.00	1,438,800	
シマノ	600	26,840.00	16,104,000	
テイ・エス　テック	700	1,447.00	1,012,900	
テルモ	4,500	4,161.00	18,724,500	
島津製作所	2,000	4,055.00	8,110,000	
ブイ・テクノロジー	100	3,390.00	339,000	
東京精密	300	4,810.00	1,443,000	
オリンパス	8,400	2,443.00	20,521,200	
ＨＯＹＡ	3,100	14,240.00	44,144,000	
朝日インテック	1,700	2,013.00	3,422,100	
バンダイナムコホールディングス	1,400	7,875.00	11,025,000	
パイロットコーポレーション	300	4,090.00	1,227,000	
ヤマハ	900	5,160.00	4,644,000	
ピジョン	900	2,399.00	2,159,100	
任天堂	700	53,950.00	37,765,000	
中部電力	5,000	1,252.00	6,260,000	
関西電力	6,200	1,104.00	6,844,800	
中国電力	2,500	949.00	2,372,500	
東北電力	3,900	829.00	3,233,100	
九州電力	3,400	869.00	2,954,600	
北海道電力	1,400	504.00	705,600	
電源開発	1,400	1,501.00	2,101,400	
イーレックス	300	1,512.00	453,600	
レノバ	300	1,712.00	513,600	
東京瓦斯	3,000	2,224.00	6,672,000	
大阪瓦斯	3,000	1,950.00	5,850,000	
東海旅客鉄道	1,300	14,920.00	19,396,000	

阪急阪神ホールディングス	1,900	3,345.00	6,355,500	
ヤマトホールディングス	2,100	2,417.00	5,075,700	
山九	500	4,590.00	2,295,000	
センコーグループホールディングス	800	918.00	734,400	
日立物流	300	5,270.00	1,581,000	
丸和運輸機関	400	1,358.00	543,200	
九州旅客鉄道	1,300	2,371.00	3,082,300	
ＳＧホールディングス	2,800	2,383.00	6,672,400	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディン	600	6,710.00	4,026,000	
日本郵船	1,200	8,150.00	9,780,000	
商船三井	800	8,040.00	6,432,000	
近鉄エクスプレス	300	2,777.00	833,100	
ＮＥＣネッツエスアイ	600	1,735.00	1,041,000	
システナ	2,400	349.00	837,600	
日鉄ソリューションズ	300	3,325.00	997,500	
ＴＩＳ	1,500	3,050.00	4,575,000	
コーエーテクモホールディングス	600	3,940.00	2,364,000	
ネクソン	3,500	2,050.00	7,175,000	
ティーガイア	200	1,666.00	333,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	500	2,385.00	1,192,500	
GMOペイメントゲートウェイ	300	10,110.00	3,033,000	
ラクス	700	2,405.00	1,683,500	
アカツキ	100	2,647.00	264,700	
野村総合研究所	3,000	4,145.00	12,435,000	
インフォコム	200	1,858.00	371,600	
オービック	500	18,200.00	9,100,000	
ジャストシステム	300	4,825.00	1,447,500	
Ｚホールディングス	22,900	561.20	12,851,480	
トレンドマイクロ	900	5,910.00	5,319,000	
日本オラクル	300	8,720.00	2,616,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	800	3,250.00	2,600,000	
大塚商会	800	4,680.00	3,744,000	
電通国際情報サービス	300	3,445.00	1,033,500	
東映アニメーション	100	8,020.00	802,000	
デジタルガレージ	300	4,305.00	1,291,500	
日本ユニシス	500	3,045.00	1,522,500	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	200	2,424.00	484,800	
日本電信電話	14,700	3,284.00	48,274,800	
ＫＤＤＩ	11,500	3,653.00	42,009,500	8,000株
光通信	100	14,270.00	1,427,000	
東宝	900	4,480.00	4,032,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	4,100	2,176.00	8,921,600	

スクウェア・エニックス・ホールディングス	700	5,550.00	3,885,000	
カプコン	1,500	2,592.00	3,888,000	
ＳＣＳＫ	1,100	1,954.00	2,149,400	
コナミホールディングス	600	5,910.00	3,546,000	
ソフトバンクグループ	4,500	5,069.00	22,810,500	
双日	1,800	1,768.00	3,182,400	
アルフレッサ　ホールディングス	1,800	1,595.00	2,871,000	
神戸物産	1,200	3,600.00	4,320,000	
ダイワボウホールディングス	800	1,654.00	1,323,200	
ＴＯＫＡＩホールディングス	800	863.00	690,400	
シップヘルスケアホールディングス	500	2,581.00	1,290,500	
コメダホールディングス	400	2,020.00	808,000	
メディパルホールディングス	1,800	2,070.00	3,726,000	
日本ライフライン	400	1,066.00	426,400	
伊藤忠商事	11,000	3,675.00	40,425,000	
丸紅	15,600	1,130.00	17,628,000	
豊田通商	1,500	4,655.00	6,982,500	
兼松	600	1,241.00	744,600	
三井物産	12,300	2,799.00	34,427,700	
住友商事	10,000	1,733.00	17,330,000	
三菱商事	11,800	3,812.00	44,981,600	
岩谷産業	400	5,650.00	2,260,000	
ＰＡＬＴＡＣ	300	4,180.00	1,254,000	
日鉄物産	200	5,050.00	1,010,000	
ミスミグループ本社	1,900	3,675.00	6,982,500	
ローソン	400	4,985.00	1,994,000	
エービーシー・マート	300	5,430.00	1,629,000	
日本マクドナルドホールディングス	800	5,020.00	4,016,000	
セリア	400	2,951.00	1,180,400	
ビックカメラ	1,000	1,005.00	1,005,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	2,000	1,845.00	3,690,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	700	3,890.00	2,723,000	
ＺＯＺＯ	1,000	2,796.00	2,796,000	
ウエルシアホールディングス	900	3,190.00	2,871,000	
クリエイトＳＤホールディングス	300	3,090.00	927,000	
コスモス薬品	200	14,670.00	2,934,000	
セブン＆アイ・ホールディングス	6,100	5,283.00	32,226,300	
ツルハホールディングス	300	9,570.00	2,871,000	
クスリのアオキホールディングス	200	6,880.00	1,376,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥ	900	3,370.00	3,033,000	
ノジマ	300	2,300.00	690,000	
良品計画	1,800	1,580.00	2,844,000	
コーナン商事	300	3,385.00	1,015,500	

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	3,100	1,537.00	4,764,700	
ゼンショーホールディングス	900	2,732.00	2,458,800	
ワークマン	300	5,130.00	1,539,000	
スギホールディングス	400	6,960.00	2,784,000	
ライフコーポレーション	200	3,055.00	611,000	
丸井グループ	1,400	2,129.00	2,980,600	
イズミ	300	3,200.00	960,000	
ヤオコー	200	6,590.00	1,318,000	
ケーズホールディングス	1,600	1,109.00	1,774,400	
アインホールディングス	300	5,800.00	1,740,000	
ニトリホールディングス	600	16,835.00	10,101,000	
ファーストリテイリング	200	68,000.00	13,600,000	
サンドラッグ	600	2,923.00	1,753,800	
めぶきフィナンシャルグループ	8,300	255.00	2,116,500	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	9,000	469.00	4,221,000	
新生銀行	1,000	2,093.00	2,093,000	
あおぞら銀行	1,000	2,559.00	2,559,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	72,800	673.60	49,038,080	45,000株
りそなホールディングス	18,200	483.40	8,797,880	
三井住友トラスト・ホールディングス	3,000	4,012.00	12,036,000	
三井住友フィナンシャルグループ	10,900	4,099.00	44,679,100	
千葉銀行	5,300	728.00	3,858,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	1,400	2,205.00	3,087,000	
セブン銀行	4,900	244.00	1,195,600	
みずほフィナンシャルグループ	20,200	1,545.50	31,219,100	
ＦＰＧ	600	653.00	391,800	
GMOフィナンシャルホールディングス	400	831.00	332,400	
ＳＢＩホールディングス	1,900	2,914.00	5,536,600	
ジャフコ　グループ	300	5,800.00	1,740,000	
大和証券グループ本社	11,900	689.40	8,203,860	
野村ホールディングス	24,300	504.80	12,266,640	
ＳＯＭＰＯホールディングス	2,700	5,234.00	14,131,800	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	3,600	3,921.00	14,115,600	
第一生命ホールディングス	7,800	2,507.50	19,558,500	
東京海上ホールディングス	5,200	6,688.00	34,777,600	
Ｔ＆Ｄホールディングス	4,200	1,639.00	6,883,800	
全国保証	400	5,190.00	2,076,000	
芙蓉総合リース	200	7,600.00	1,520,000	
みずほリース	300	3,185.00	955,500	
東京センチュリー	400	5,590.00	2,236,000	
イオンフィナンシャルサービス	900	1,210.00	1,089,000	
アコム	3,200	322.00	1,030,400	
オリエントコーポレーション	4,500	126.00	567,000	

オリックス	9,600	2,370.00	22,752,000	
三菱ＨＣキャピタル	5,900	594.00	3,504,600	
日本取引所グループ	4,000	2,279.50	9,118,000	
いちご	1,800	294.00	529,200	
ヒューリック	3,800	1,043.00	3,963,400	
野村不動産ホールディングス	900	2,617.00	2,355,300	
サムティ	300	2,090.00	627,000	
プレサンスコーポレーション	300	2,099.00	629,700	
オープンハウスグループ	500	5,780.00	2,890,000	
東急不動産ホールディングス	4,800	652.00	3,129,600	
飯田グループホールディングス	1,400	2,364.00	3,309,600	
三井不動産	7,200	2,351.00	16,927,200	
三菱地所	10,400	1,647.00	17,128,800	
東京建物	1,600	1,682.00	2,691,200	
住友不動産	3,300	3,463.00	11,427,900	
スターツコーポレーション	300	2,480.00	744,000	
日本エスコン	300	761.00	228,300	
イオンモール	800	1,636.00	1,308,800	
カチタス	400	3,520.00	1,408,000	
ミクシィ	400	2,076.00	830,400	
日本Ｍ＆Ａセンターホールディングス	2,500	1,850.00	4,625,000	
ＵＴグループ	300	3,175.00	952,500	
エス・エム・エス	600	3,185.00	1,911,000	
パーソルホールディングス	1,500	2,867.00	4,300,500	
綜合警備保障	700	4,340.00	3,038,000	
カカクコム	1,100	2,427.00	2,669,700	
ディップ	300	3,470.00	1,041,000	
ベネフィット・ワン	600	3,630.00	2,178,000	
エムスリー	2,700	4,397.00	11,871,900	
アウトソーシング	1,000	1,332.00	1,332,000	
博報堂ＤＹホールディングス	2,200	1,804.00	3,968,800	
オリエンタルランド	1,800	18,455.00	33,219,000	
ユー・エス・エス	1,800	1,869.00	3,364,200	
フルキャストホールディングス	200	2,050.00	410,000	
エン・ジャパン	300	2,787.00	836,100	
テクノプロ・ホールディングス	900	2,976.00	2,678,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	100	5,120.00	512,000	
ジャパンマテリアル	600	1,624.00	974,400	
リクルートホールディングス	9,100	5,506.00	50,104,600	
ベルシステム２４ホールディングス	300	1,413.00	423,900	
ベイカレント・コンサルティング	100	40,150.00	4,015,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	500	1,585.00	792,500	
リログループ	900	2,042.00	1,837,800	
カナモト	300	2,253.00	675,900	

セコム	1,500	8,087.00	12,130,500	
メイテック	200	6,390.00	1,278,000	
イオンディライト	200	3,125.00	625,000	
合　計	1,086,400	－	3,030,369,060	

（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日本株アクティブマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区　　分	注記番号	[2021年 1月25日現在] 金額（円）	[2022年 1月25日現在] 金額（円）
資産の部			
流動資産			
金銭信託		481,944	916,096
コール・ローン		538,413,046	707,958,770
株式		57,113,966,370	76,438,413,390
未収入金		325,707,485	205,340,059
未収配当金		36,603,990	45,306,200
流動資産合計		58,015,172,835	77,397,934,515
資産合計		58,015,172,835	77,397,934,515
負債の部			
流動負債			
未払金		316,372,425	218,927,288
未払解約金		142,307,763	99,062,700
未払利息		296	748
流動負債合計		458,680,484	317,990,736
負債合計		458,680,484	317,990,736
純資産の部			
元本等			
元本	※1	27,016,239,628	35,961,310,316
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		30,540,252,723	41,118,633,463
元本等合計		57,556,492,351	77,079,943,779
純資産合計		57,556,492,351	77,079,943,779
負債純資産合計		58,015,172,835	77,397,934,515

(2) 注記表
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日
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。

（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
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分		[2021年 1月25日現在]	[2022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	28,466,111,162円	27,016,239,628円
	同期中における追加設定元本額	8,381,992,916円	15,956,553,639円
	同期中における一部解約元本額	9,831,864,450円	7,011,482,951円
	同期末における元本額	27,016,239,628円	35,961,310,316円
	元本の内訳＊		
	日本株アクティブファンド ＜適格機関投資家限定＞	142,791,412円	174,285,394円
	東京海上セレクション・日本株式	15,726,655,259円	15,958,788,222円
	東京海上セレクション・バランス30	1,237,277,477円	1,187,551,364円
	東京海上セレクション・バランス50	4,913,498,168円	4,854,846,456円
	東京海上セレクション・バランス70	4,839,261,654円	5,037,248,900円
	東京海上・年金運用型戦略ファンド （年１回決算型）	103,526,884円	151,357,748円
	ＴＭＡバランス25ＶＡ 〈適格機関投資家限定〉	19,232,473円	12,496,579円
	ＴＭＡバランス50ＶＡ 〈適格機関投資家限定〉	25,160,643円	22,575,990円
	ＴＭＡバランス75ＶＡ 〈適格機関投資家限定〉	8,361,432円	6,880,154円
	東京海上・日本株式ＧＡＲＰ ＜適格機関投資家限定＞	474,226円	8,555,279,509円
	計	27,016,239,628円	35,961,310,316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	27,016,239,628口	35,961,310,316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）
Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	自 2021年 1月26日 至 2022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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	[2021年 1月25日現在]	[2022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った場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
（自 2020年1月28日　至 2021年1月25日）
売買目的有価証券

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	19,037,479,200円
合計	19,037,479,200円

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年3月24日から2021年1月25日まで)を指しております。

（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	△1,929,848,537円
合計	△1,929,848,537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。

（1口当たり情報に関する注記）

[2021年 1月25日現在]	[2022年 1月25日現在]
1口当たり純資産額　2.1304円 （1万口当たり純資産額　21,304円）	1口当たり純資産額　2.1434円 （1万口当たり純資産額　21,434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	
サカタのタネ	81,000	3,305.00	267,705,000	
ショーボンドホールディングス	94,700	5,070.00	480,129,000	

ヤクルト本社	65,300	5,980.00	390,494,000	
アサヒグループホールディングス	152,700	4,825.00	736,777,500	
サントリー食品インターナショナル	110,900	4,395.00	487,405,500	
ゴールドウイン	22,000	6,060.00	133,320,000	
日産化学	63,100	6,040.00	381,124,000	
信越化学工業	144,700	18,135.00	2,624,134,500	
エア・ウォーター	237,300	1,734.00	411,478,200	
三井化学	176,300	3,140.00	553,582,000	
三菱ケミカルホールディングス	397,500	882.30	350,714,250	
富士フイルムホールディングス	96,500	7,648.00	738,032,000	
ファンケル	154,700	2,900.00	448,630,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	132,600	1,773.00	235,099,800	
アステラス製薬	1,299,800	1,939.50	2,520,962,100	
塩野義製薬	90,500	6,789.00	614,404,500	
日本新薬	28,000	7,600.00	212,800,000	
ＪＣＲファーマ	457,400	2,048.00	936,755,200	
第一三共	878,100	2,606.00	2,288,328,600	
日本製鉄	229,400	1,836.00	421,178,400	
東京製鐵	126,000	1,136.00	143,136,000	
住友電気工業	358,200	1,543.50	552,881,700	
ＤＭＧ森精機	313,400	1,781.00	558,165,400	
ＳＭＣ	17,000	63,690.00	1,082,730,000	
クボタ	445,100	2,418.00	1,076,251,800	
ダイキン工業	50,500	24,295.00	1,226,897,500	
日立製作所	208,400	6,171.00	1,286,036,400	
富士通	89,200	17,655.00	1,574,826,000	
ルネサスエレクトロニクス	1,764,000	1,250.00	2,205,000,000	
ソニーグループ	332,200	12,480.00	4,145,856,000	
アドバンテスト	41,800	9,450.00	395,010,000	
キーエンス	12,200	58,780.00	717,116,000	
フェローテックホールディングス	139,400	2,919.00	406,908,600	
レーザーテック	33,200	26,035.00	864,362,000	
カシオ計算機	247,600	1,457.00	360,753,200	
新光電気工業	256,900	4,675.00	1,201,007,500	
太陽誘電	132,600	5,530.00	733,278,000	
村田製作所	206,400	8,553.00	1,765,339,200	
東京エレクトロン	38,800	56,870.00	2,206,556,000	
デンソー	144,400	8,688.00	1,254,547,200	
日産自動車	1,175,500	605.40	711,647,700	
トヨタ自動車	1,737,900	2,236.50	3,886,813,350	
スズキ	119,000	4,609.00	548,471,000	
シマノ	13,200	26,840.00	354,288,000	
ＨＯＹＡ	50,500	14,240.00	719,120,000	
バンダイナムコホールディングス	170,900	7,875.00	1,345,837,500	
任天堂	12,800	53,950.00	690,560,000	

東急	208,800	1,519.00	317,167,200	
名古屋鉄道	206,400	1,839.00	379,569,600	
ヤマトホールディングス	244,000	2,417.00	589,748,000	
商船三井	80,300	8,040.00	645,612,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	169,200	1,735.00	293,562,000	
GMOペイメントゲートウェイ	96,800	10,110.00	978,648,000	
ビジョナル	58,000	7,770.00	450,660,000	
野村総合研究所	357,800	4,145.00	1,483,081,000	
セーフィー	78,800	1,069.00	84,237,200	
Ｓａｎｓａｎ	74,900	1,424.00	106,657,600	
ＪＭＤＣ	48,500	5,440.00	263,840,000	
ＪＴＯＷＥＲ	67,500	5,800.00	391,500,000	
Ｚホールディングス	1,386,200	561.20	777,935,440	
伊藤忠テクノソリューションズ	167,200	3,250.00	543,400,000	
日本電信電話	410,600	3,284.00	1,348,410,400	
東宝	99,700	4,480.00	446,656,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	95,500	5,550.00	530,025,000	
ソフトバンクグループ	261,600	5,069.00	1,326,050,400	
豊田通商	114,400	4,655.00	532,532,000	
三井物産	665,900	2,799.00	1,863,854,100	
トラスコ中山	150,400	2,528.00	380,211,200	
ミスミグループ本社	227,000	3,675.00	834,225,000	
エービーシー・マート	107,700	5,430.00	584,811,000	
コスモス薬品	24,200	14,670.00	355,014,000	
セブン&アイ・ホールディングス	268,500	5,283.00	1,418,485,500	
良品計画	186,200	1,580.00	294,196,000	
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	147,800	1,537.00	227,168,600	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	2,477,000	673.60	1,668,507,200	
三井住友フィナンシャルグループ	308,500	4,099.00	1,264,541,500	
ＳＢＩホールディングス	186,800	2,914.00	544,335,200	
第一生命ホールディングス	408,300	2,507.50	1,023,812,250	
アルヒ	269,600	1,131.00	304,917,600	
ＳＲＥホールディングス	38,100	4,640.00	176,784,000	
オープンハウスグループ	98,200	5,780.00	567,596,000	
東急不動産ホールディングス	1,168,300	652.00	761,731,600	
日本M&Aセンターホールディングス	251,200	1,850.00	464,720,000	
カカクコム	64,900	2,427.00	157,512,300	
ベネフィット・ワン	119,200	3,630.00	432,696,000	
エムスリー	102,800	4,397.00	452,011,600	
オリエンタルランド	57,600	18,455.00	1,063,008,000	
サイバーエージェント	606,500	1,683.00	1,020,739,500	
アイ・アールジャパンホールディングス	33,600	5,120.00	172,032,000	
リクルートホールディングス	231,800	5,506.00	1,276,290,800	
ベイカレント・コンサルティング	9,800	40,150.00	393,470,000	

合　計	25,585,700	―	76,438,413,390	

(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
該当事項はありません。

「TMA外国債券インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区　分	注記番号	[2021年 1月25日現在] 金額（円）	[2022年 1月25日現在] 金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		57,136,610	48,503,235
コール・ローン		23,741,347	38,215,569
国債証券		7,306,175,386	10,134,691,455
派生商品評価勘定		―	22,470
未収利息		44,612,459	53,640,156
前払費用		2,144,783	2,593,364
流動資産合計		7,433,810,585	10,277,666,249
資産合計		7,433,810,585	10,277,666,249
負債の部			
流動負債			
未払金		33,863,397	23,622,031
未払解約金		9,137,293	20,885,881
未払利息		13	40
流動負債合計		43,000,703	44,507,952
負債合計		43,000,703	44,507,952
純資産の部			
元本等			
元本	※1	4,412,965,149	5,942,840,376
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		2,977,844,733	4,290,317,921
元本等合計		7,390,809,882	10,233,158,297
純資産合計		7,390,809,882	10,233,158,297
負債純資産合計		7,433,810,585	10,277,666,249

(2) 注記表
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日

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

（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
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分		[2021年 1月25日現在]	[2022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	3,109,800,387円	4,412,965,149円
	同期中における追加設定元本額	2,186,532,672円	2,439,923,200円
	同期中における一部解約元本額	883,367,910円	910,047,973円
	同期末における元本額	4,412,965,149円	5,942,840,376円
	元本の内訳＊		
	ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）	6,827,561円	―円
	ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）	9,005,984円	―円
	ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）	27,649,249円	―円
	ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）	24,263,464円	―円
	ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）	14,661,934円	―円
	東京海上セレクション・外国債券インデックス	3,071,524,638円	3,876,368,304円
	東京海上・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）	124,630,973円	202,640,188円

	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	8,924,996円	43,813,070円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	3,019,097円	21,873,017円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	2,578,756円	13,913,587円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	4,624,808円	27,749,062円
	ＴＭＡ外国債券インデックスＶＡ＜適格機関投資家限定＞	112,726,445円	61,406,387円
	東京海上・世界インデックス・バランス40＜適格機関投資家限定＞	230,644,001円	392,878,044円
	東京海上・世界インデックス・バランス60＜適格機関投資家限定＞	771,883,243円	1,302,198,717円
	計	4,412,965,149円	5,942,840,376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	4,412,965,149口	5,942,840,376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）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	[2021年 1月25日現在]	[2022年 1月25日現在]
1．貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）
（自 2020年1月28日　至 2021年1月25日）
売買目的有価証券

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△32,223,397円
合計	△32,223,397円

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年11月11日から2021年1月25日まで)を指しております。

（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	△239,578,777円
合計	△239,578,777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。

（デリバティブ取引等に関する注記）
取引の時価等に関する事項
通貨関連
（2021年1月25日現在）
該当事項はありません。

（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

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	11,378,400	—	11,400,870	22,470
	米ドル	11,378,400	—	11,400,870	22,470
合　計		11,378,400	—	11,400,870	22,470

(注)1.時価の算定方法

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

①同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

(3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報に関する注記）

[2021年 1月25日現在]	[2022年 1月25日現在]
1口当たり純資産額　1.6748円 （1万口当たり純資産額　16,748円）	1口当たり純資産額　1.7219円 （1万口当たり純資産額　17,219円）

(3) 附属明細表

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
国債証券	米ドル			米ドル	
		T 0 1/2 02/28/26	100,000	96,250.00	
		T 0 1/2 03/15/23	100,000	99,804.68	
		T 0 1/2 04/30/27	100,000	94,703.12	
		T 0 1/2 05/31/27	200,000	189,171.87	
		T 0 1/2 06/30/27	100,000	94,500.00	
		T 0 1/2 08/31/27	200,000	188,406.25	
		T 0 1/2 10/31/27	100,000	93,898.43	
		T 0 1/2 11/30/23	300,000	297,609.37	
		T 0 1/4 03/15/24	200,000	196,687.50	
		T 0 1/4 04/15/23	100,000	99,484.37	
		T 0 1/4 05/15/24	100,000	98,109.37	
		T 0 1/4 05/31/25	200,000	193,000.00	
		T 0 1/4 06/15/23	300,000	297,890.62	
		T 0 1/4 06/15/24	200,000	196,015.62	

		T 0 1/4 06/30/25	300,000	289,195.31	
		T 0 1/4 07/31/25	100,000	96,250.00	
		T 0 1/4 08/31/25	300,000	288,304.68	
		T 0 1/4 09/30/23	200,000	197,968.75	
		T 0 1/4 09/30/25	200,000	192,015.62	
		T 0 1/4 10/31/25	400,000	383,375.00	
		T 0 1/8 02/15/24	300,000	294,820.31	
		T 0 1/8 04/30/23	200,000	198,468.75	
		T 0 1/8 05/15/23	200,000	198,484.37	
		T 0 1/8 05/31/23	100,000	99,156.25	
		T 0 1/8 06/30/23	200,000	198,109.37	
		T 0 1/8 07/15/23	200,000	197,984.37	
		T 0 1/8 07/31/23	200,000	197,875.00	
		T 0 1/8 08/15/23	100,000	98,882.81	
		T 0 1/8 08/31/23	300,000	296,559.12	
		T 0 1/8 09/15/23	500,000	493,984.37	
		T 0 1/8 09/30/22	100,000	99,789.06	
		T 0 1/8 10/15/23	700,000	690,867.19	
		T 0 1/8 12/15/23	700,000	689,445.31	
		T 0 1/8 12/31/22	100,000	99,570.31	
		T 0 3/4 03/31/26	300,000	291,445.31	
		T 0 3/4 04/30/26	200,000	194,125.00	
		T 0 3/4 05/31/26	100,000	96,976.56	
		T 0 3/4 08/31/26	300,000	290,109.37	
		T 0 3/4 11/15/24	200,000	197,468.74	
		T 0 3/8 01/31/26	500,000	479,453.12	
		T 0 3/8 04/15/24	100,000	98,546.87	
		T 0 3/8 04/30/25	100,000	97,031.25	
		T 0 3/8 07/15/24	300,000	294,585.93	
		T 0 3/8 07/31/27	200,000	187,484.37	
		T 0 3/8 08/15/24	400,000	392,312.48	
		T 0 3/8 09/15/24	100,000	97,945.31	
		T 0 3/8 09/30/27	400,000	373,281.25	
		T 0 3/8 10/31/23	200,000	198,125.00	
		T 0 3/8 11/30/25	100,000	96,156.25	
		T 0 3/8 12/31/25	300,000	288,093.75	
		T 0 5/8 05/15/30	400,000	366,968.75	
		T 0 5/8 07/31/26	300,000	288,679.68	
		T 0 5/8 08/15/30	300,000	274,429.68	
		T 0 5/8 10/15/24	300,000	295,476.55	
		T 0 5/8 11/30/27	400,000	377,937.50	
		T 0 5/8 12/31/27	100,000	94,382.81	
		T 0 7/8 06/30/26	200,000	194,781.25	

		T 0 7/8 09/30/26	100,000	97,164.06	
		T 0 7/8 11/15/30	300,000	279,702.84	
		T 1 07/31/28	300,000	287,671.87	
		T 1 1/2 01/31/27	200,000	199,812.50	
		T 1 1/2 02/15/30	500,000	493,281.25	
		T 1 1/2 02/28/23	100,000	100,914.06	
		T 1 1/2 03/31/23	100,000	100,945.31	
		T 1 1/2 09/30/24	100,000	100,843.75	
		T 1 1/2 10/31/24	300,000	302,460.93	
		T 1 1/2 11/30/24	200,000	201,546.87	
		T 1 1/2 11/30/28	200,000	197,687.50	
		T 1 1/4 04/30/28	300,000	292,898.43	
		T 1 1/4 05/15/50	200,000	163,578.12	
		T 1 1/4 05/31/28	300,000	292,640.62	
		T 1 1/4 06/30/28	200,000	194,984.37	
		T 1 1/4 07/31/23	100,000	100,640.62	
		T 1 1/4 08/15/31	500,000	479,062.50	
		T 1 1/4 08/31/24	300,000	300,726.56	
		T 1 1/4 09/30/28	300,000	291,914.05	
		T 1 1/4 11/30/26	200,000	197,539.06	
		T 1 1/8 02/15/31	400,000	380,593.75	
		T 1 1/8 02/28/25	300,000	298,617.18	
		T 1 1/8 02/29/28	300,000	291,468.75	
		T 1 1/8 05/15/40	200,000	169,531.25	
		T 1 1/8 08/15/40	100,000	84,445.31	
		T 1 1/8 08/31/28	300,000	289,757.80	
		T 1 1/8 10/31/26	400,000	392,937.50	
		T 1 12/15/24	300,000	298,007.81	
		T 1 3/4 01/31/23	300,000	303,468.75	
		T 1 3/4 05/15/23	500,000	506,328.12	
		T 1 3/4 07/31/24	300,000	304,640.62	
		T 1 3/4 08/15/41	200,000	187,210.92	
		T 1 3/4 11/15/29	300,000	301,828.12	
		T 1 3/4 12/31/24	600,000	608,906.25	
		T 1 3/4 12/31/26	300,000	303,492.18	
		T 1 3/8 01/31/25	200,000	200,671.87	
		T 1 3/8 02/15/23	200,000	201,609.37	
		T 1 3/8 08/15/50	200,000	168,703.12	
		T 1 3/8 10/15/22	100,000	100,656.25	
		T 1 3/8 10/31/28	300,000	294,187.50	
		T 1 3/8 11/15/31	200,000	193,468.74	
		T 1 3/8 11/15/40	100,000	88,054.68	
		T 1 5/8 02/15/26	600,000	604,640.62	

		T 1 5/8 05/15/26	200,000	201,328.12	
		T 1 5/8 05/15/31	500,000	496,328.12	
		T 1 5/8 08/15/29	300,000	298,968.75	
		T 1 5/8 09/30/26	200,000	201,187.50	
		T 1 5/8 11/15/22	100,000	100,890.62	
		T 1 5/8 11/15/50	100,000	89,765.62	
		T 1 5/8 11/30/26	300,000	301,875.00	
		T 1 5/8 12/15/22	100,000	100,960.93	
		T 1 7/8 02/15/41	300,000	287,203.12	
		T 1 7/8 07/31/26	100,000	101,710.93	
		T 1 7/8 11/15/51	300,000	286,042.95	
		T 2 02/15/23	300,000	304,359.37	
		T 2 02/15/25	200,000	204,484.37	
		T 2 02/15/50	500,000	489,921.87	
		T 2 06/30/24	100,000	102,140.62	
		T 2 08/15/25	800,000	817,750.00	
		T 2 08/15/51	200,000	196,218.74	
		T 2 1/2 01/31/24	200,000	206,109.37	
		T 2 1/2 02/15/46	100,000	106,601.56	
		T 2 1/2 05/15/24	500,000	516,132.81	
		T 2 1/2 05/15/46	100,000	106,648.43	
		T 2 1/2 08/15/23	300,000	307,734.37	
		T 2 1/4 05/15/41	300,000	305,015.62	
		T 2 1/4 08/15/27	100,000	103,625.00	
		T 2 1/4 08/15/46	200,000	203,968.75	
		T 2 1/4 08/15/49	200,000	206,390.62	
		T 2 1/4 11/15/24	800,000	823,250.00	
		T 2 1/4 11/15/27	400,000	414,062.50	
		T 2 1/8 05/15/25	300,000	308,085.93	
		T 2 11/15/26	100,000	102,304.68	
		T 2 11/15/41	300,000	292,839.84	
		T 2 11/30/22	400,000	404,968.75	
		T 2 3/4 02/15/28	600,000	639,093.75	
		T 2 3/4 07/31/23	100,000	102,906.25	
		T 2 3/4 08/15/42	100,000	110,101.56	
		T 2 3/4 08/15/47	100,000	112,359.37	
		T 2 3/4 11/15/23	600,000	619,781.25	
		T 2 3/4 11/15/42	200,000	220,265.62	
		T 2 3/8 05/15/27	100,000	104,257.81	
		T 2 3/8 05/15/29	100,000	104,789.06	
		T 2 3/8 05/15/51	300,000	319,335.93	
		T 2 3/8 08/15/24	200,000	206,296.87	
		T 2 3/8 11/15/49	100,000	106,031.25	

		T 2 5/8 01/31/26	100,000	104,671.87	
		T 2 5/8 02/15/29	100,000	106,343.75	
		T 2 5/8 03/31/25	100,000	104,203.12	
		T 2 7/8 05/15/28	100,000	107,421.87	
		T 2 7/8 05/15/43	100,000	112,343.75	
		T 2 7/8 05/31/25	200,000	210,218.75	
		T 2 7/8 07/31/25	100,000	105,296.87	
		T 2 7/8 08/15/28	100,000	107,546.87	
		T 2 7/8 08/15/45	100,000	113,476.56	
		T 3 02/15/47	300,000	350,648.43	
		T 3 02/15/48	300,000	353,578.12	
		T 3 02/15/49	400,000	474,625.00	
		T 3 05/15/47	100,000	117,179.68	
		T 3 08/15/48	100,000	118,140.62	
		T 3 1/8 02/15/43	100,000	116,531.25	
		T 3 1/8 05/15/48	100,000	120,726.56	
		T 3 1/8 08/15/44	300,000	352,406.25	
		T 3 1/8 11/15/28	200,000	218,890.62	
		T 3 1/8 11/15/41	100,000	116,218.75	
		T 3 11/15/45	300,000	348,187.50	
		T 3 3/4 11/15/43	100,000	128,070.31	
		T 3 3/8 11/15/48	200,000	252,734.37	
		T 3 5/8 02/15/44	100,000	126,039.06	
		T 3 5/8 08/15/43	100,000	125,562.50	
		T 3 7/8 08/15/40	200,000	255,375.00	
		T 4 1/4 11/15/40	100,000	133,882.81	
		T 4 3/4 02/15/41	100,000	142,320.31	
		T 4 3/8 02/15/38	100,000	133,828.12	
		T 4 3/8 05/15/40	100,000	135,734.37	
		T 4 3/8 11/15/39	200,000	270,390.62	
		T 5 05/15/37	50,000	70,765.62	
		T 5 3/8 02/15/31	100,000	131,265.62	
		US TREASURY N/B	300,000	284,953.12	
		US TREASURY N/B	300,000	285,726.56	
	米ドル小計		41,750,000	42,221,073.82 (4,813,624,626)	
		銘柄数	177		
		比　率	47.0%	47.5%	
	加ドル			**加ドル**	
		CAN 0 1/2 09/01/25	100,000	96,425.00	
		CAN 0 1/2 11/01/23	100,000	98,746.00	
		CAN 0 1/2 12/01/30	100,000	89,800.00	
		CAN 0 1/4 03/01/26	100,000	94,875.00	
		CAN 0 1/4 04/01/24	100,000	97,755.00	

	CAN 0 1/4 05/01/23	100,000	98,945.00	
	CAN 0 1/4 08/01/23	100,000	98,609.00	
	CAN 1 06/01/27	100,000	96,870.00	
	CAN 1 1/2 06/01/23	100,000	100,515.00	
	CAN 1 1/2 06/01/26	100,000	99,835.00	
	CAN 1 1/2 06/01/31	100,000	97,910.00	
	CAN 1 1/2 12/01/31	100,000	96,970.00	
	CAN 1 1/4 03/01/25	100,000	99,383.00	
	CAN 1 1/4 06/01/30	100,000	96,245.00	
	CAN 2 06/01/28	100,000	102,097.00	
	CAN 2 09/01/23	100,000	101,290.00	
	CAN 2 1/2 06/01/24	100,000	102,668.00	
	CAN 2 1/4 06/01/29	100,000	103,895.00	
	CAN 2 12/01/51	200,000	198,216.00	
	CAN 2 3/4 12/01/48	100,000	114,621.00	
	CAN 3 1/2 12/01/45	100,000	127,462.00	
加ドル小計		2,200,000	2,213,132.00 (199,690,900)	
	銘柄数	21		
	比　率	2.0%	2.0%	
メキシコペソ			**メキシコペソ**	
	MBONO 10 11/20/36	300,000	358,926.30	
	MBONO 10 12/05/24	600,000	639,502.20	
	MBONO 5 3/4 03/05/26	1,600,000	1,503,688.00	
	MBONO 6 3/4 03/09/23	100,000	99,780.80	
	MBONO 7 1/2 06/03/27	1,700,000	1,699,486.60	
	MBONO 7 3/4 05/29/31	1,000,000	1,007,449.00	
	MBONO 7 3/4 11/13/42	800,000	775,385.60	
	MBONO 7 3/4 11/23/34	300,000	300,396.00	
	MBONO 8 09/05/24	1,300,000	1,317,287.40	
	MBONO 8 1/2 05/31/29	1,500,000	1,580,551.50	
	MBONO 8 1/2 11/18/38	900,000	945,312.30	
	MBONO 8 11/07/47	900,000	893,566.80	
	MBONO 8 12/07/23	1,700,000	1,720,301.40	
メキシコペソ小計		12,700,000	12,841,633.90 (71,057,897)	
	銘柄数	13		
	比　率	0.7%	0.7%	
ユーロ			**ユーロ**	
	BGB 0 1/2 10/22/24	100,000	102,930.00	
	BGB 0.2 10/22/23	100,000	101,467.00	
	BGB 0.8 06/22/25	100,000	104,180.00	
	BGB 0.8 06/22/27	100,000	105,640.00	
	BGB 0.9 06/22/29	100,000	106,970.00	

		BGB 1 06/22/26	100,000	105,870.00	
		BGB 1 06/22/31	100,000	107,670.00	
		BGB 1 1/4 04/22/33	100,000	111,320.00	
		BGB 1.6 06/22/47	100,000	116,790.00	
		BGB 1.7 06/22/50	100,000	118,510.00	
		BGB 1.9 06/22/38	100,000	120,840.00	
		BGB 3 3/4 06/22/45	100,000	163,300.00	
		BGB 4 1/4 03/28/41	100,000	164,180.00	
		BGB 5 03/28/35	100,000	159,390.00	
		BGB 5 1/2 03/28/28	100,000	135,705.00	
		BKO 0 03/10/23	300,000	302,355.00	
		BKO 0 06/16/23	200,000	201,966.00	
		BTPS 0 01/15/24	100,000	100,300.00	
		BTPS 0 01/30/24	100,000	100,110.00	
		BTPS 0 04/01/26	100,000	98,440.00	
		BTPS 0 04/15/24	100,000	99,770.00	
		BTPS 0 08/01/26	100,000	97,960.00	
		BTPS 0 1/2 02/01/26	100,000	100,680.00	
		BTPS 0 1/2 07/15/28	100,000	98,170.00	
		BTPS 0 1/4 03/15/28	100,000	97,030.00	
		BTPS 0.3 08/15/23	400,000	403,512.00	
		BTPS 0.35 02/01/25	200,000	201,440.00	
		BTPS 0.45 02/15/29	100,000	96,970.00	
		BTPS 0.6 08/01/31	100,000	94,460.00	
		BTPS 0.85 01/15/27	300,000	304,770.00	
		BTPS 0.95 03/01/23	100,000	101,445.00	
		BTPS 0.95 03/01/37	100,000	90,860.00	
		BTPS 0.95 08/01/30	100,000	98,870.00	
		BTPS 0.95 12/01/31	200,000	194,080.00	
		BTPS 1 1/2 04/30/45	100,000	92,160.00	
		BTPS 1 1/2 06/01/25	100,000	104,450.00	
		BTPS 1 3/4 07/01/24	100,000	104,270.00	
		BTPS 1.45 11/15/24	100,000	103,830.00	
		BTPS 1.6 06/01/26	200,000	210,480.00	
		BTPS 1.65 03/01/32	100,000	103,580.00	
		BTPS 1.65 12/01/30	200,000	208,600.00	
		BTPS 1.8 03/01/41	100,000	99,350.00	
		BTPS 1.85 07/01/25	200,000	211,300.00	
		BTPS 2 02/01/28	100,000	107,750.00	
		BTPS 2 1/4 09/01/36	100,000	108,500.00	
		BTPS 2 12/01/25	100,000	106,690.00	
		BTPS 2.45 09/01/33	100,000	111,420.00	
		BTPS 2.45 09/01/50	100,000	107,930.00	

		BTPS 2.7 03/01/47	100,000	114,180.00	
		BTPS 2.95 09/01/38	100,000	118,070.00	
		BTPS 3 08/01/29	200,000	230,480.00	
		BTPS 3 1/2 03/01/30	100,000	119,900.00	
		BTPS 3 1/4 09/01/46	100,000	124,790.00	
		BTPS 3 3/4 09/01/24	100,000	109,710.00	
		BTPS 3.35 03/01/35	100,000	121,610.00	
		BTPS 3.45 03/01/48	100,000	129,230.00	
		BTPS 4 02/01/37	100,000	131,670.00	
		BTPS 4 1/2 03/01/24	100,000	109,710.00	
		BTPS 4 1/2 05/01/23	100,000	106,233.00	
		BTPS 4 3/4 08/01/23	100,000	107,775.00	
		BTPS 4 3/4 09/01/28	100,000	125,620.00	
		BTPS 4 3/4 09/01/44	100,000	152,330.00	
		BTPS 5 08/01/34	100,000	140,800.00	
		BTPS 5 08/01/39	100,000	149,570.00	
		BTPS 5 09/01/40	100,000	151,260.00	
		BTPS 5 3/4 02/01/33	100,000	145,540.00	
		BTPS 6 05/01/31	100,000	142,950.00	
		BTPS 6 1/2 11/01/27	100,000	133,380.00	
		BTPS 7 1/4 11/01/26	100,000	132,340.00	
		DBR 0 02/15/30	100,000	101,991.00	
		DBR 0 02/15/31	100,000	101,585.00	
		DBR 0 05/15/35	100,000	99,832.00	
		DBR 0 05/15/36	100,000	99,298.00	
		DBR 0 08/15/26	100,000	102,089.00	
		DBR 0 08/15/29	100,000	102,082.00	
		DBR 0 08/15/30	300,000	305,583.00	
		DBR 0 08/15/31	200,000	202,642.00	
		DBR 0 08/15/50	100,000	95,099.00	
		DBR 0 1/2 02/15/25	100,000	103,403.00	
		DBR 0 1/2 02/15/26	100,000	104,016.00	
		DBR 0 1/4 02/15/27	100,000	103,362.00	
		DBR 0 1/4 02/15/29	100,000	103,964.00	
		DBR 0 1/4 08/15/28	200,000	207,702.00	
		DBR 0 11/15/27	200,000	204,284.00	
		DBR 0 11/15/28	300,000	306,300.00	
		DBR 1 08/15/25	100,000	105,510.00	
		DBR 1 1/2 02/15/23	100,000	102,392.00	
		DBR 1 1/4 08/15/48	100,000	128,906.00	
		DBR 2 1/2 07/04/44	100,000	155,365.00	
		DBR 2 1/2 08/15/46	100,000	159,134.00	
		DBR 3 1/4 07/04/42	100,000	166,456.00	

		DBR 4 01/04/37	200,000	323,114.00	
		DBR 4 3/4 07/04/34	100,000	161,824.00	
		DBR 4 3/4 07/04/40	100,000	188,693.00	
		DBR 4.25 07/04/39	100,000	175,353.00	
		DBR 5.5 01/04/31	100,000	152,531.00	
		DBR 6.5 07/04/27	100,000	138,221.00	
		FRTR 0 02/25/23	300,000	302,082.00	
		FRTR 0 02/25/24	200,000	202,420.00	
		FRTR 0 02/25/26	300,000	303,900.00	
		FRTR 0 02/25/27	200,000	202,000.00	
		FRTR 0 03/25/23	100,000	100,750.00	
		FRTR 0 03/25/24	200,000	202,540.00	
		FRTR 0 03/25/25	300,000	304,050.00	
		FRTR 0 1/2 05/25/25	100,000	103,100.00	
		FRTR 0 1/2 05/25/26	100,000	103,485.00	
		FRTR 0 1/2 05/25/29	100,000	103,690.00	
		FRTR 0 1/2 05/25/40	200,000	194,000.00	
		FRTR 0 1/2 06/25/44	100,000	95,140.00	
		FRTR 0 1/4 11/25/26	100,000	102,430.00	
		FRTR 0 11/25/29	200,000	199,120.00	
		FRTR 0 11/25/30	200,000	197,180.00	
		FRTR 0 11/25/31	200,000	195,000.00	
		FRTR 0 3/4 05/25/28	100,000	104,980.00	
		FRTR 0 3/4 05/25/52	100,000	95,460.00	
		FRTR 0 3/4 11/25/28	300,000	316,605.00	
		FRTR 1 05/25/27	300,000	319,440.00	
		FRTR 1 1/2 05/25/31	200,000	224,400.00	
		FRTR 1 1/2 05/25/50	100,000	115,730.00	
		FRTR 1 1/4 05/25/34	200,000	219,900.00	
		FRTR 1 1/4 05/25/36	200,000	220,420.00	
		FRTR 1 11/25/25	200,000	210,460.00	
		FRTR 1 3/4 05/25/23	100,000	103,214.00	
		FRTR 1 3/4 05/25/66	100,000	125,720.00	
		FRTR 1 3/4 06/25/39	100,000	120,150.00	
		FRTR 1 3/4 11/25/24	200,000	212,820.00	
		FRTR 2 05/25/48	100,000	128,470.00	
		FRTR 2 1/2 05/25/30	200,000	240,580.00	
		FRTR 3 1/2 04/25/26	200,000	232,740.00	
		FRTR 3 1/4 05/25/45	100,000	153,360.00	
		FRTR 4 04/25/55	100,000	188,310.00	
		FRTR 4 04/25/60	100,000	197,560.00	
		FRTR 4 10/25/38	100,000	155,620.00	
		FRTR 4 3/4 04/25/35	100,000	156,220.00	

		FRTR 4.25 10/23	100,000	108,630.00	
		FRTR 5 1/2 04/25/29	200,000	280,920.00	
		FRTR 5 3/4 10/25/32	200,000	317,200.00	
		FRTR 6 10/25/25	100,000	124,340.00	
		FRTR4.5 04/25/41	100,000	170,040.00	
		IRISH 0.2 10/18/30	100,000	100,120.00	
		IRISH 1 05/15/26	100,000	105,230.00	
		IRISH 1.3 05/15/33	100,000	109,870.00	
		IRISH 1.35 03/18/31	100,000	110,750.00	
		IRISH 1.7 05/15/37	100,000	116,440.00	
		IRISH 5.4 03/13/25	100,000	118,485.00	
		NETHER 0 01/15/27	100,000	101,535.00	
		NETHER 0 07/15/30	100,000	100,440.00	
		NETHER 0 07/15/31	100,000	99,780.00	
		NETHER 0 1/2 07/15/26	100,000	104,040.00	
		NETHER 0 1/4 07/15/25	100,000	102,535.00	
		NETHER 2 07/15/24	100,000	106,460.00	
		NETHER 2 1/2 01/15/33	100,000	126,480.00	
		NETHER 2 3/4 01/15/47	100,000	161,360.00	
		NETHER 3 3/4 01/15/42	100,000	169,220.00	
		NETHER 4 01/15/37	100,000	156,900.00	
		NETHER 5 1/2 01/15/28	100,000	134,810.00	
		NETHER 7 1/2 01/15/23	100,000	107,970.00	
		OBL 0 04/05/24	300,000	304,434.00	
		OBL 0 04/10/26	100,000	102,003.00	
		OBL 0 04/11/25	200,000	203,698.00	
		OBL 0 10/09/26	100,000	102,007.00	
		OBL 0 10/18/24	200,000	203,434.00	
		RAGB 0 07/15/24	100,000	101,350.00	
		RAGB 0 1/2 02/20/29	100,000	103,920.00	
		RAGB 0 1/2 04/20/27	100,000	103,960.00	
		RAGB 0 10/20/40	100,000	90,440.00	
		RAGB 0 3/4 10/20/26	100,000	104,995.00	
		RAGB 1 1/2 02/20/47	100,000	121,410.00	
		RAGB 1 3/4 10/20/23	100,000	104,200.00	
		RAGB 3.15 06/20/44	100,000	156,360.00	
		RAGB 4.15 03/37	100,000	156,570.00	
		RFGB 0 1/2 09/15/28	100,000	104,105.00	
		RFGB 0 3/4 04/15/31	100,000	106,160.00	
		RFGB 1 1/8 04/15/34	100,000	110,470.00	
		RFGB 4 07/04/25	100,000	115,725.00	
		SPGB 0 01/31/25	300,000	302,640.00	
		SPGB 0 01/31/26	200,000	200,800.00	

		SPGB 0 01/31/28	100,000	98,910.00	
		SPGB 0 04/30/23	100,000	100,680.00	
		SPGB 0 05/31/24	200,000	201,200.00	
		SPGB 0.1 04/30/31	100,000	95,650.00	
		SPGB 0.35 07/30/23	100,000	101,358.00	
		SPGB 0.6 10/31/29	100,000	101,800.00	
		SPGB 0.8 07/30/27	200,000	207,720.00	
		SPGB 1 1/4 10/31/30	100,000	106,640.00	
		SPGB 1 10/31/50	100,000	90,300.00	
		SPGB 1.2 10/31/40	100,000	100,850.00	
		SPGB 1.3 10/31/26	100,000	106,300.00	
		SPGB 1.4 07/30/28	100,000	107,860.00	
		SPGB 1.45 10/31/27	100,000	107,750.00	
		SPGB 1.85 07/30/35	100,000	111,800.00	
		SPGB 1.95 04/30/26	100,000	108,805.00	
		SPGB 1.95 07/30/30	200,000	225,580.00	
		SPGB 2 3/4 10/31/24	100,000	108,690.00	
		SPGB 2.15 10/31/25	100,000	108,590.00	
		SPGB 2.35 07/30/33	200,000	234,900.00	
		SPGB 2.7 10/31/48	100,000	130,820.00	
		SPGB 2.9 10/31/46	100,000	134,320.00	
		SPGB 3.45 07/30/66	100,000	150,460.00	
		SPGB 4.2 01/31/37	100,000	146,040.00	
		SPGB 4.4 10/31/23	200,000	217,400.00	
		SPGB 4.7 07/30/41	100,000	163,070.00	
		SPGB 4.8 01/31/24	100,000	110,550.00	
		SPGB 4.9 07/30/40	100,000	164,700.00	
		SPGB 5 3/4 07/30/32	100,000	152,330.00	
		SPGB 5.15 10/31/28	100,000	133,190.00	
		SPGB 6 01/31/29	100,000	140,440.00	
	ユーロ小計		26,700,000	30,440,124.00 (3,928,602,403)	
		銘柄数	207		
		比　率	38.4%	38.8%	
	英ポンド			**英ポンド**	
		UKT 0 1/4 07/31/31	100,000	92,055.00	
		UKT 0 1/8 01/30/26	100,000	96,975.00	
		UKT 0 1/8 01/31/23	200,000	198,760.00	
		UKT 0 1/8 01/31/24	100,000	98,525.00	
		UKT 0 5/8 06/07/25	100,000	99,225.00	
		UKT 0 5/8 07/31/35	100,000	91,890.00	
		UKT 0 5/8 10/22/50	100,000	84,970.00	
		UKT 1 04/22/24	100,000	100,305.00	
		UKT 1 1/2 07/22/47	100,000	104,335.00	

	UKT 1 1/4 07/22/27	100,000	101,670.00	
	UKT 1 1/4 10/22/41	100,000	98,645.00	
	UKT 1 1/8 01/31/39	100,000	97,080.00	
	UKT 1 3/4 09/07/37	100,000	106,540.00	
	UKT 1 5/8 10/22/28	100,000	104,210.00	
	UKT 2 09/07/25	100,000	103,945.00	
	UKT 2 1/2 07/22/65	100,000	149,145.00	
	UKT 2 1/4 09/07/23	100,000	102,290.00	
	UKT 3 1/2 01/22/45	100,000	143,135.00	
	UKT 3 1/2 07/22/68	100,000	188,340.00	
	UKT 3 1/4 01/22/44	100,000	136,630.00	
	UKT 3 3/4 07/22/52	100,000	162,855.00	
	UKT 4 1/2 12/07/42	100,000	158,325.00	
	UKT 4 1/4 03/07/36	100,000	139,010.00	
	UKT 4 1/4 12/07/27	30,000	35,595.00	
	UKT 4 1/4 12/07/40	100,000	149,240.00	
	UKT 4 1/4 12/07/46	100,000	162,160.00	
	UKT 4 1/4 12/07/49	100,000	169,540.00	
	UKT 4 1/4 12/07/55	100,000	184,075.00	
	UKT 4 3/4 12/07/30	100,000	131,120.00	
	UKT 4 3/4 12/07/38	100,000	153,010.00	
	UKT 4.25 06/07/32	100,000	130,125.00	
	UKT 6 12/07/28	10,000	13,317.00	
英ポンド小計		3,140,000	3,887,042.00 (597,438,355)	
	銘柄数	32		
	比　率	5.8%	5.9%	
スウェーデンクローネ			**スウェーデンクローネ**	
	SGB 0 1/8 05/12/31	200,000	197,032.00	
	SGB 0 3/4 05/12/28 #1060	300,000	310,041.00	
	SGB 0 3/4 11/12/29 #1061	300,000	311,706.00	
	SGB 1 1/2 11/13/23	300,000	308,916.00	
	SGB 1 11/12/26 #1059	300,000	312,246.00	
	SGB 2 1/2 05/12/25 #1058	400,000	432,444.00	
	SGB 2 1/4 06/01/32 #1056	100,000	119,310.00	
	SGB 3 1/2 03/30/39	200,000	297,694.00	
スウェーデンクローネ小計		2,100,000	2,289,389.00 (28,159,484)	
	銘柄数	8		
	比　率	0.3%	0.3%	

ノルウェークローネ			ノルウェークローネ	
	NGB 1 1/2 02/19/26	200,000	198,580.00	
	NGB 1 1/4 09/17/31	200,000	189,520.00	
	NGB 1 3/4 02/17/27	200,000	199,930.00	
	NGB 1 3/4 03/13/25	200,000	200,610.00	
	NGB 1 3/4 09/06/29	200,000	199,240.00	
	NGB 1 3/8 08/19/30	200,000	192,600.00	
	NGB 2 04/26/28	100,000	101,160.00	
	NGB 2 05/24/23	300,000	302,700.00	
	NGB 3 03/14/24	300,000	309,000.00	
ノルウェークローネ小計		1,900,000	1,893,340.00 (24,026,484)	
	銘柄数	9		
	比　率	0.2%	0.2%	
デンマーククローネ			デンマーククローネ	
	DGB 0 1/2 11/15/27	300,000	312,225.00	
	DGB 0 1/2 11/15/29	400,000	417,880.00	
	DGB 0 1/4 11/15/52	200,000	197,200.00	
	DGB 0 11/15/24	100,000	101,170.00	
	DGB 0 11/15/31	200,000	198,360.00	
	DGB 1 1/2 11/15/23	200,000	207,708.00	
	DGB 1 3/4 11/15/25	200,000	216,080.00	
	DGB 4 1/2 11/15/39	500,000	881,450.00	
デンマーククローネ小計		2,100,000	2,532,073.00 (43,880,825)	
	銘柄数	8		
	比　率	0.4%	0.4%	
ポーランドズロチ			ポーランドズロチ	
	POLGB 0 04/25/23	100,000	96,240.00	
	POLGB 0 1/4 10/25/26	100,000	84,300.00	
	POLGB 0 3/4 04/25/25	200,000	183,460.00	
	POLGB 1 1/4 10/25/30	100,000	80,930.00	
	POLGB 2 1/2 01/25/23	200,000	198,860.00	
	POLGB 2 1/2 04/25/24	100,000	99,000.00	
	POLGB 2 1/2 07/25/26	200,000	189,120.00	
	POLGB 2 1/2 07/25/27	100,000	92,840.00	
	POLGB 2 1/4 10/25/24	200,000	194,320.00	
	POLGB 2 3/4 04/25/28	200,000	186,000.00	
	POLGB 2 3/4 10/25/29	300,000	274,830.00	
	POLGB 3 1/4 07/25/25	100,000	98,900.00	
ポーランドズロチ小計		1,900,000	1,778,800.00 (50,282,406)	
	銘柄数	12		

	比　率	0.5%	0.5%	
豪ドル			豪ドル	
	ACGB 0 1/2 09/21/26	100,000	95,106.70	
	ACGB 0 1/4 11/21/25	100,000	95,454.40	
	ACGB 1 1/2 06/21/31	200,000	193,580.00	
	ACGB 1 1/4 05/21/32	100,000	93,610.10	
	ACGB 1 12/21/30	100,000	92,749.60	
	ACGB 1 3/4 06/21/51	100,000	83,703.20	
	ACGB 2 1/2 05/21/30	100,000	105,200.00	
	ACGB 2 1/4 05/21/28	100,000	103,265.00	
	ACGB 2 3/4 04/21/24	200,000	208,314.20	
	ACGB 2 3/4 11/21/27	200,000	211,890.00	
	ACGB 2 3/4 11/21/29	100,000	106,930.00	
	ACGB 3 03/21/47	100,000	108,680.00	
	ACGB 3 1/4 04/21/25	100,000	106,030.00	
	ACGB 3 1/4 04/21/29	100,000	109,967.50	
	ACGB 4 1/2 04/21/33	100,000	125,910.00	
	ACGB 4 1/4 04/21/26	100,000	111,210.00	
	ACGB 5 1/2 04/21/23	100,000	105,984.00	
豪ドル小計		2,000,000	2,057,584.70 (168,001,790)	
	銘柄数	17		
	比　率	1.6%	1.7%	
シンガポールドル			シンガポールドル	
	SIGB 2 1/4 08/01/36	100,000	102,890.00	
	SIGB 2 1/8 06/01/26	100,000	102,550.00	
	SIGB 3 1/2 03/01/27	200,000	217,980.00	
	SIGB 3 3/8 09/01/33	100,000	114,920.00	
シンガポールドル小計		500,000	538,340.00 (45,683,532)	
	銘柄数	4		
	比　率	0.4%	0.5%	

マレーシア リンギット			マレーシア リンギット	
	MGS 2.632 04/15/31	100,000	91,213.10	
	MGS 3.48 03/15/23	200,000	203,139.60	
	MGS 3.502 05/31/27	100,000	100,865.60	
	MGS 3.733 06/15/28	100,000	101,403.00	
	MGS 3.757 05/22/40	100,000	93,521.50	
	MGS 3.828 07/05/34	100,000	97,514.50	
	MGS 3.844 04/15/33	100,000	99,499.80	
	MGS 3.885 08/15/29	100,000	101,655.30	
	MGS 3.955 09/15/25	100,000	102,942.80	
	MGS 4.065 06/15/50	100,000	95,429.20	
	MGS 4.181 07/15/24	100,000	103,026.90	
	MGS 4.254 05/31/35	100,000	102,312.80	
	MGS 4.392 04/15/26	200,000	209,040.00	
	MGS 4.498 04/15/30	100,000	105,627.10	
	MGS 4.736 03/15/46	100,000	104,251.00	
	MGS 4.762 04/07/37	100,000	107,751.20	
	MGS 5.248 09/28	100,000	109,937.60	
マレーシアリンギット小計		1,900,000	1,929,131.00 (52,514,996)	
	銘柄数	17		
	比　率	0.5%	0.5%	
イスラエル シュケル			イスラエル シュケル	
	ILGOV 1 03/31/30	100,000	98,270.00	
	ILGOV 1 1/2 11/30/23	100,000	102,520.00	
	ILGOV 1 3/4 08/31/25	100,000	104,460.00	
	ILGOV 2 03/31/27	200,000	214,260.00	
	ILGOV 2 1/4 09/28/28	100,000	108,250.00	
	ILGOV 3 3/4 03/31/24	100,000	110,430.00	
	ILGOV 3 3/4 03/31/47	100,000	126,780.00	
	ILGOV 4 1/4 03/31/23	100,000	108,350.00	
	ILGOV 5 1/2 01/31/42	100,000	153,000.00	
	ILGOV 6 1/4 10/30/26	100,000	126,740.00	
イスラエルシュケル小計		1,100,000	1,253,060.00 (45,190,606)	
	銘柄数	10		
	比　率	0.4%	0.4%	

	オフショア人民元	CGB 1.99 04/09/25	200,000	オフショア人民元 197,919.00	
		CGB 2.56 10/21/23	300,000	302,391.00	
		CGB 2.57 05/20/23	200,000	201,247.00	
		CGB 2.69 08/12/26	100,000	101,402.40	
		CGB 2.84 04/08/24	200,000	202,860.40	
		CGB 2.85 06/04/27	300,000	305,894.10	
		CGB 2.88 11/05/23	200,000	202,649.80	
		CGB 3.01 05/13/28	300,000	307,384.80	
		CGB 3.02 05/27/31	100,000	102,436.00	
		CGB 3.02 10/22/25	300,000	307,528.20	
		CGB 3.03 03/11/26	300,000	307,917.00	
		CGB 3.19 04/11/24	200,000	204,471.40	
		CGB 3.27 11/19/30	200,000	208,168.60	
		CGB 3.29 05/23/29	200,000	208,535.20	
		CGB 3.39 03/16/50	100,000	100,813.50	
		CGB 3.72 04/12/51	200,000	215,173.00	
		CGB 3.81 09/14/50	100,000	108,715.10	
		CGB 3.86 07/22/49	100,000	109,400.80	
	オフショア人民元小計		3,600,000	3,694,907.30 (66,537,151)	
		銘柄数	18		
		比　率	0.7%	0.7%	
国債証券合計				円 10,134,691,455 (10,134,691,455)	
合　計				円 10,134,691,455 (10,134,691,455)	

（注1）通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
（注2）合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
（注3）比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

「TMA外国債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区　分	注記番号	[2021年 1月25日現在] 金額（円）	[2022年 1月25日現在] 金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		22,442,844	58,445,799

コール・ローン		73,886,093	66,956,916
国債証券		24,326,998,481	26,631,113,653
派生商品評価勘定		32,000	—
未収入金		70,827,730	47,977,238
未収利息		136,081,878	121,447,079
前払費用		25,640,181	16,332,818
流動資産合計		24,655,909,207	26,942,273,503
資産合計		24,655,909,207	26,942,273,503
負債の部			
流動負債			
未払金		75,223,385	63,299,652
未払解約金		28,275,479	40,784,597
未払利息		40	70
流動負債合計		103,498,904	104,084,319
負債合計		103,498,904	104,084,319
純資産の部			
元本等			
元本	※1	10,036,411,823	10,755,895,489
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		14,515,998,480	16,082,293,695
元本等合計		24,552,410,303	26,838,189,184
純資産合計		24,552,410,303	26,838,189,184
負債純資産合計		24,655,909,207	26,942,273,503

(2) 注記表
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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）、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
2.　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

3．その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（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
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	[2021年 1月25日現在]	[2022年 1月25日現在]
1.※1　本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	9,563,088,320円	10,036,411,823円
同期中における追加設定元本額	2,512,589,821円	2,240,455,655円
同期中における一部解約元本額	2,039,266,318円	1,520,971,989円
同期末における元本額	10,036,411,823円	10,755,895,489円
元本の内訳＊		
東京海上セレクション・外国債券	5,262,239,977円	5,375,521,879円
東京海上セレクション・バランス30	1,019,479,173円	1,096,790,801円
東京海上セレクション・バランス50	2,313,538,702円	2,562,099,360円
東京海上セレクション・バランス70	1,355,852,323円	1,581,756,958円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）	85,301,648円	139,726,491円
計	10,036,411,823円	10,755,895,489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	10,036,411,823口	10,755,895,489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）
Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左

2．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	[2021年 1月25日現在]	[2022年 1月25日現在]
1．　貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．　時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）
（自 2020年1月28日　至 2021年1月25日）
売買目的有価証券

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	151,439,953円
合計	151,439,953円

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年3月24日から2021年1月25日まで)を指しております。

（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	△418,005,431円
合計	△418,005,431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。

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

（単位：円）

区　分	種　類	契約額等	うち1年超	時　価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	12,605,000	—	12,637,000	32,000
	ユーロ	12,605,000	—	12,637,000	32,000
合　計		12,605,000	—	12,637,000	32,000

(注)1.時価の算定方法

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

①同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

(3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（2022年1月25日現在）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

[2021年 1月25日現在]	[2022年 1月25日現在]
1口当たり純資産額 2.4463円 （1万口当たり純資産額 24,463円）	1口当たり純資産額 2.4952円 （1万口当たり純資産額 24,952円）

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
国債証券	米ドル			米ドル	
		T 0 1/2 03/15/23	100,000	99,804.68	
		T 0 1/2 05/31/27	2,000,000	1,891,718.76	
		T 0 1/2 08/31/27	800,000	753,625.00	
		T 0 1/2 10/31/27	5,100,000	4,788,820.33	
		T 0 1/4 08/31/25	500,000	480,507.81	
		T 0 1/4 10/31/25	400,000	383,375.00	
		T 0 1/8 02/28/23	10,900,000	10,836,984.37	
		T 0 1/8 03/31/23	500,000	496,640.62	
		T 0 1/8 05/31/23	100,000	99,156.25	
		T 0 3/4 04/30/26	600,000	582,375.00	
		T 0 3/8 01/31/26	1,700,000	1,630,140.61	
		T 0 3/8 09/30/27	1,100,000	1,026,523.44	
		T 0 3/8 11/30/25	600,000	576,937.50	
		T 0 3/8 12/31/25	200,000	192,062.50	
		T 0 5/8 07/31/26	100,000	96,226.56	
		T 0 5/8 11/30/27	4,600,000	4,346,281.24	
		T 0 5/8 12/31/27	3,500,000	3,303,398.44	

	T 0 7/8 06/30/26	100,000	97,390.62	
	T 0 7/8 09/30/26	100,000	97,164.06	
	T 1 07/31/28	5,000,000	4,794,531.23	
	T 1 1/2 01/15/23	8,500,000	8,573,710.98	
	T 1 1/2 11/30/28	3,400,000	3,360,687.50	
	T 1 1/4 03/31/28	2,600,000	2,539,265.63	
	T 1 1/4 04/30/28	1,500,000	1,464,492.19	
	T 1 1/4 06/30/28	1,300,000	1,267,398.43	
	T 1 1/4 09/30/28	800,000	778,437.50	
	T 1 1/8 02/29/28	500,000	485,781.25	
	T 1 1/8 08/31/28	700,000	676,101.56	
	T 1 3/4 08/15/41	100,000	93,605.46	
	T 1 3/4 11/15/29	400,000	402,437.49	
	T 1 3/8 10/31/28	100,000	98,062.50	
	T 1 5/8 08/15/29	200,000	199,312.50	
	T 1 5/8 09/30/26	1,000,000	1,005,937.50	
	T 1 5/8 11/30/26	2,900,000	2,918,125.00	
	T 1 7/8 02/15/41	400,000	382,937.49	
	T 1 7/8 06/30/26	700,000	712,304.69	
	T 2 08/15/25	1,700,000	1,737,718.75	
	T 2 1/2 02/15/45	4,200,000	4,460,203.12	
	T 2 1/2 02/15/46	1,500,000	1,599,023.43	
	T 2 1/2 05/15/46	900,000	959,835.94	
	T 2 1/4 05/15/41	3,000,000	3,050,156.25	
	T 2 11/15/26	500,000	511,523.44	
	T 2 3/4 08/15/42	2,000,000	2,202,031.25	
	T 2 3/4 11/15/42	700,000	770,929.69	
	T 2 3/8 04/30/26	4,300,000	4,461,921.87	
	T 2 5/8 02/15/29	4,700,000	4,998,156.25	
	T 2 7/8 05/15/28	200,000	214,843.75	
	T 2 7/8 05/15/43	1,200,000	1,348,125.00	
	T 2 7/8 08/15/28	200,000	215,093.75	
	T 3 05/15/45	900,000	1,039,781.25	
	T 3 1/8 02/15/43	500,000	582,656.25	
	T 3 1/8 08/15/44	400,000	469,875.00	
	T 3 1/8 11/15/28	8,200,000	8,974,515.66	
	T 3 11/15/44	400,000	461,093.75	
	T 3 3/4 11/15/43	1,700,000	2,177,195.32	
	T 3 3/8 05/15/44	500,000	609,023.44	
	T 3 5/8 02/15/44	3,900,000	4,915,523.44	
	T 3 5/8 08/15/43	1,900,000	2,385,687.50	
	US TREASURY N/B	1,700,000	1,614,734.37	

米ドル小計		108,300,000	111,291,910.16 (12,688,390,677)	
	銘柄数	59		
	比　率	47.3%	47.6%	
加ドル			加ドル	
	CAN 0 1/2 09/01/25	2,200,000	2,121,350.00	
	CAN 0 1/4 03/01/26	1,200,000	1,138,500.00	
	CAN 1 09/01/26	800,000	777,808.00	
	CAN 1 1/2 06/01/31	400,000	391,640.00	
	CAN 1 1/2 12/01/31	100,000	96,970.00	
	CAN 1 1/4 03/01/25	100,000	99,383.00	
	CAN 1 1/4 03/01/27	400,000	391,840.00	
	CAN 2 3/4 12/01/48	300,000	343,863.00	
	CAN 3 1/2 12/01/45	600,000	764,772.00	
	CAN 4 06/01/41	500,000	661,800.00	
	CAN 5 06/01/37	400,000	557,056.00	
	CAN 5 3/4 06/01/33	700,000	973,910.00	
加ドル小計		7,700,000	8,318,892.00 (750,613,625)	
	銘柄数	12		
	比　率	2.8%	2.8%	
メキシコペソ			メキシコペソ	
	MBONO 5 1/2 03/04/27	44,000,000	40,279,492.00	
	MBONO 7 1/2 06/03/27	1,000,000	999,698.00	
	MBONO 7 3/4 05/29/31	1,000,000	1,007,449.00	
	MBONO 8 1/2 05/31/29	35,000,000	36,879,535.00	
	MBONO 8 1/2 11/18/38	28,000,000	29,409,716.00	
	MBONO 8 11/07/47	5,000,000	4,964,260.00	
	MBONO 8 12/07/23	12,000,000	12,143,304.00	
メキシコペソ小計		126,000,000	125,683,454.00 (695,456,824)	
	銘柄数	7		
	比　率	2.6%	2.6%	
ユーロ			ユーロ	
	BGB 0 10/22/31	300,000	293,190.00	
	BGB 0.2 10/22/23	400,000	405,868.00	
	BGB 0.8 06/22/25	500,000	520,900.00	
	BGB 0.9 06/22/29	100,000	106,970.00	
	BGB 1 06/22/26	400,000	423,480.00	
	BGB 2.15 06/22/66	100,000	139,790.00	
	BGB 3 3/4 06/22/45	300,000	489,900.00	
	BGB 4 1/4 03/28/41	500,000	820,900.00	
	BGB 5 03/28/35	200,000	318,780.00	
	BKO 0 06/16/23	300,000	302,949.00	

		BTPS 0 04/01/26	300,000	295,320.00	
		BTPS 0 04/15/24	2,500,000	2,494,250.00	
		BTPS 0 08/15/24	1,400,000	1,398,880.00	
		BTPS 0 1/2 07/15/28	1,200,000	1,178,040.00	
		BTPS 0 12/15/24	200,000	199,220.00	
		BTPS 0.95 03/01/37	200,000	181,720.00	
		BTPS 0.95 06/01/32	200,000	192,460.00	
		BTPS 0.95 09/15/27	800,000	814,160.00	
		BTPS 1.85 07/01/25	1,400,000	1,479,100.00	
		BTPS 2 02/01/28	200,000	215,500.00	
		BTPS 2.1 07/15/26	200,000	215,160.00	
		BTPS 2.45 09/01/33	100,000	111,420.00	
		BTPS 2.8 03/01/67	400,000	437,920.00	
		BTPS 2.8 12/01/28	100,000	113,340.00	
		BTPS 3.1 03/01/40	300,000	361,020.00	
		BTPS 3.35 03/01/35	600,000	729,660.00	
		BTPS 4 02/01/37	900,000	1,185,030.00	
		BTPS 4 1/2 03/01/26	100,000	117,100.00	
		BTPS 4 3/4 09/01/44	700,000	1,066,310.00	
		BTPS 5 08/01/34	1,000,000	1,408,000.00	
		BTPS 5 08/01/39	900,000	1,346,130.00	
		BTPS 5 09/01/40	800,000	1,210,080.00	
		BTPS 5 3/4 02/01/33	700,000	1,018,780.00	
		BTPS 6 05/01/31	900,000	1,286,550.00	
		BTPS 6 1/2 11/01/27	200,000	266,760.00	
		DBR 0 05/15/35	700,000	698,824.00	
		DBR 0 05/15/36	600,000	595,788.00	
		DBR 0 08/15/29	800,000	816,656.00	
		DBR 0 08/15/30	900,000	916,749.00	
		DBR 0 08/15/31	1,600,000	1,621,136.00	
		DBR 0 1/4 02/15/27	400,000	413,448.00	
		DBR 0 11/15/27	600,000	612,852.00	
		DBR 1 08/15/25	100,000	105,510.00	
		DBR 1 1/4 08/15/48	600,000	773,436.00	
		DBR 2 1/2 08/15/46	1,000,000	1,591,340.00	
		FRTR 0 02/25/24	1,100,000	1,113,310.00	
		FRTR 0 02/25/26	2,900,000	2,937,700.00	
		FRTR 0 02/25/27	700,000	707,000.00	
		FRTR 0 03/25/25	3,800,000	3,851,300.00	
		FRTR 0 1/2 05/25/25	200,000	206,200.00	
		FRTR 0 11/25/30	1,800,000	1,774,620.00	
		FRTR 0 11/25/31	2,000,000	1,950,000.00	
		FRTR 1 1/2 05/25/31	1,600,000	1,795,200.00	

		FRTR 1 1/4 05/25/34	1,400,000	1,539,300.00	
		FRTR 1 3/4 05/25/23	1,300,000	1,341,782.00	
		FRTR 3 1/2 04/25/26	300,000	349,110.00	
		FRTR 4 04/25/55	800,000	1,506,480.00	
		FRTR 4 04/25/60	600,000	1,185,360.00	
		FRTR4.5 04/25/41	1,400,000	2,380,560.00	
		NETHER 0 01/15/24	600,000	607,842.00	
		NETHER 0 01/15/26	100,000	101,500.00	
		NETHER 0 01/15/27	400,000	406,140.00	
		NETHER 0 01/15/38	200,000	191,900.00	
		NETHER 0 01/15/52	200,000	181,000.00	
		NETHER 0 07/15/31	300,000	299,340.00	
		NETHER 0 1/4 07/15/25	100,000	102,535.00	
		NETHER 0 3/4 07/15/28	300,000	319,290.00	
		NETHER 4 01/15/37	400,000	627,600.00	
		OBL 0 04/10/26	100,000	102,003.00	
		OBL 0 04/11/25	1,400,000	1,425,886.00	
		OBL 0 10/09/26	2,100,000	2,142,147.00	
		OBL 0 10/18/24	600,000	610,302.00	
		RAGB 0 02/20/30	300,000	298,680.00	
		RAGB 0 02/20/31	300,000	296,190.00	
		RAGB 0 04/20/25	200,000	202,740.00	
		RAGB 0 07/15/24	500,000	506,750.00	
		RAGB 0 1/2 02/20/29	300,000	311,760.00	
		RAGB 0 3/4 03/20/51	200,000	204,780.00	
		RAGB 2.1 09/20/17	200,000	305,020.00	
		RAGB 2.4 05/23/34	200,000	252,220.00	
		RAGB 3.8 01/26/62	100,000	205,370.00	
		SPGB 0 01/31/25	100,000	100,880.00	
		SPGB 0 01/31/26	1,300,000	1,305,200.00	
		SPGB 0 01/31/27	200,000	199,500.00	
		SPGB 0 01/31/28	500,000	494,550.00	
		SPGB 0 05/31/24	1,000,000	1,006,000.00	
		SPGB 0 1/2 10/31/31	600,000	593,460.00	
		SPGB 0.8 07/30/27	1,300,000	1,350,180.00	
		SPGB 0.85 07/30/37	100,000	97,070.00	
		SPGB 2.15 10/31/25	600,000	651,540.00	
		SPGB 2.9 10/31/46	500,000	671,600.00	
		SPGB 3.45 07/30/66	400,000	601,840.00	
		SPGB 4.7 07/30/41	700,000	1,141,490.00	
		SPGB 5 3/4 07/30/32	700,000	1,066,310.00	
		SPGB 5.15 10/31/44	500,000	894,800.00	

ユーロ小計		64,200,000	73,803,713.00 (9,525,107,199)	
	銘柄数	95		
	比　率	35.5%	35.8%	
英ポンド			英ポンド	
	UKT 0 1/2 01/31/29	200,000	192,720.00	
	UKT 0 1/2 10/22/61	400,000	323,320.00	
	UKT 0 1/4 01/31/25	1,000,000	980,500.00	
	UKT 0 1/4 07/31/31	300,000	276,165.00	
	UKT 0 1/8 01/31/23	500,000	496,900.00	
	UKT 0 1/8 01/31/24	1,500,000	1,477,875.00	
	UKT 0 1/8 01/31/28	700,000	665,175.00	
	UKT 0 3/8 10/22/26	600,000	583,530.00	
	UKT 0 3/8 10/22/30	100,000	94,135.00	
	UKT 0 5/8 07/31/35	700,000	643,230.00	
	UKT 1 1/4 07/31/51	200,000	198,620.00	
	UKT 1 1/8 01/31/39	100,000	97,080.00	
	UKT 1 3/4 07/22/57	600,000	698,460.00	
	UKT 1 5/8 10/22/54	500,000	552,700.00	
	UKT 2 1/2 07/22/65	200,000	298,290.00	
	UKT 3 1/2 01/22/45	800,000	1,145,080.00	
	UKT 3 1/4 01/22/44	800,000	1,093,040.00	
	UKT 4 1/4 12/07/46	600,000	972,960.00	
	UKT 4 1/4 12/07/49	100,000	169,540.00	
	UKT 4.25 06/07/32	900,000	1,171,125.00	
	UKT 5 03/07/25	100,000	112,560.00	
英ポンド小計		10,900,000	12,243,005.00 (1,881,749,868)	
	銘柄数	21		
	比　率	7.0%	7.1%	
スウェーデン クローネ			スウェーデン クローネ	
	SGB 1 1/2 11/13/23	5,000,000	5,148,600.00	
スウェーデンクローネ小計		5,000,000	5,148,600.00 (63,327,780)	
	銘柄数	1		
	比　率	0.2%	0.2%	
ポーランド ズロチ			ポーランドズロチ	
	POLGB 3 1/4 07/25/25	2,300,000	2,274,700.00	
ポーランドズロチ小計		2,300,000	2,274,700.00 (64,300,309)	
	銘柄数	1		
	比　率	0.2%	0.2%	
豪ドル			豪ドル	
	ACGB 0 1/4 11/21/24	500,000	487,486.50	

		ACGB 2 1/2 05/21/30	1,700,000	1,788,400.00	
		ACGB 2 3/4 05/21/41	600,000	628,982.40	
		ACGB 2 3/4 06/21/35	400,000	431,440.00	
		ACGB 2 3/4 11/21/27	800,000	847,560.00	
		ACGB 2 3/4 11/21/28	200,000	212,960.00	
		ACGB 2 3/4 11/21/29	100,000	106,930.00	
		ACGB 3 1/4 04/21/25	1,600,000	1,696,480.00	
		ACGB 3 1/4 04/21/29	600,000	659,805.00	
		ACGB 3 1/4 06/21/39	600,000	679,080.00	
		ACGB 3 3/4 04/21/37	600,000	720,240.00	
		ACGB 4 1/4 04/21/26	600,000	667,260.00	
		ACGB 4 3/4 04/21/27	1,000,000	1,156,492.00	
		ACGB 5 1/2 04/21/23	1,400,000	1,483,776.00	
	豪ドル小計		10,700,000	11,566,891.90 (944,436,723)	
		銘柄数	14		
		比　率	3.5%	3.5%	
	シンガポールドル			シンガポールドル	
		SIGB 3 09/01/24	200,000	208,940.00	
	シンガポールドル小計		200,000	208,940.00 (17,730,648)	
		銘柄数	1		
		比　率	0.1%	0.1%	
国債証券合計				円 26,631,113,653 (26,631,113,653)	
合　計				円 26,631,113,653 (26,631,113,653)	

（注1）通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
（注2）合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
（注3）比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「TMA外国株式インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区　分	注記番号	[2021年 1月25日現在] 金額（円）	[2022年 1月25日現在] 金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		379,927,458	1,115,412,134
コール・ローン		65,990,146	211,684,278

株式		30,913,475,854	60,486,527,162
投資証券		679,011,304	1,457,586,964
派生商品評価勘定		18,462,409	—
未収入金		—	264,465
未収配当金		19,814,716	41,082,618
差入委託証拠金		470,990,626	768,578,266
流動資産合計		32,547,672,513	64,081,135,887
資産合計		32,547,672,513	64,081,135,887
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		221,707	123,255,404
未払解約金		27,432,107	81,348,204
未払利息		36	223
流動負債合計		27,653,850	204,603,831
負債合計		27,653,850	204,603,831
純資産の部			
元本等			
元本	※1	10,389,370,150	16,521,030,366
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		22,130,648,513	47,355,501,690
元本等合計		32,520,018,663	63,876,532,056
純資産合計		32,520,018,663	63,876,532,056
負債純資産合計		32,547,672,513	64,081,135,887

(2) 注記表
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

3．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（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
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分		[2021年 1月25日現在]	[2022年 1月25日現在]
1.※1	本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	5,970,420,435円	10,389,370,150円
	同期中における追加設定元本額	6,045,309,007円	13,610,105,585円
	同期中における一部解約元本額	1,626,359,292円	7,478,445,369円
	同期末における元本額	10,389,370,150円	16,521,030,366円
	元本の内訳＊		
	ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）	2,214,429円	―円
	ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）	3,755,213円	―円
	ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）	11,713,332円	―円
	ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）	16,489,454円	―円
	ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）	16,932,119円	―円
	東京海上セレクション・外国株式インデックス	9,195,684,892円	6,841,355,312円
	東京海上・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）	69,303,074円	84,394,364円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	15,384,415円	56,536,549円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	5,372,042円	29,134,748円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	4,875,425円	19,112,042円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	9,000,136円	40,426,906円
	ＴＭＡ外国株式インデックスＶＡ＜適格機関投資家限定＞	62,744,659円	27,456,584円
	東京海上・世界インデックス・バランス40＜適格機関投資家限定＞	108,063,480円	140,692,293円

東京海上・世界インデックス・バランス60＜適格機関投資家限定＞	867,837,480円	1,119,280,508円
先進国株式インデックス（適格機関投資家専用）	―円	377,271,069円
東京海上セレクション・外国株式インデックス２＜適格機関投資家限定＞	―円	7,785,369,991円
計	10,389,370,150円	16,521,030,366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	10,389,370,150口	16,521,030,366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）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2．金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、先物取引及び為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3．金融商品に係るリスク管理体制	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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	[2021年 1月25日現在]	[2022年 1月25日現在]
1．貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）
（自 2020年1月28日　至 2021年1月25日）
売買目的有価証券

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,413,958,612円
投資証券	13,288,035円
合計	2,427,246,647円

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年11月11日から2021年1月25日まで)を指しております。

（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	△4,086,076,551円
投資証券	△38,445,184円
合計	△4,124,521,735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。

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

（単位：円）

区　分	種　類	契約額等	うち1年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	897,504,005	—	915,704,407	18,200,402
	S&P 500 EMIN	640,187,878	—	656,936,492	16,748,614
	DJ EU STX 50	135,483,804	—	136,024,667	540,863
	FTSE 100 IDX	121,832,323	—	122,743,248	910,925
合　計		897,504,005	—	915,704,407	18,200,402

（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	2,006,338,340	—	1,883,082,936	△123,255,404
	S&P 500 EMIN	1,510,413,028	—	1,405,800,302	△104,612,726
	DJ EU STX 50	302,841,224	—	287,978,029	△14,863,195
	FTSE 100 IDX	193,084,088	—	189,304,605	△3,779,483
合　計		2,006,338,340	—	1,883,082,936	△123,255,404

(注)1.時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
また契約額等及び時価の邦貨換算は本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(2) 通貨関連

（2021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
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	13,457,600	—	13,497,900	40,300
	米ドル	13,457,600	—	13,497,900	40,300
合　計		13,457,600	—	13,497,900	40,300

(注)1.時価の算定方法

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

①同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

(3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（2022年1月25日現在）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

[2021年 1月25日現在]		[2022年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額	3.1301円	1口当たり純資産額	3.8664円
（1万口当たり純資産額	31,301円）	（1万口当たり純資産額	38,664円）

(3) 附属明細表

第1　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数	評価額		備　考
		単価	金額	
米ドル	株	米ドル	米ドル	
BAKER HUGHES COMPANY	11,105	27.07	300,612.35	
CABOT OIL & GAS CORP	8,816	19.53	172,176.48	
CHEVRONTEXACO CORP	18,868	127.18	2,399,632.24	
CONOCOPHILLIPS	14,202	83.02	1,179,050.04	
DEVON ENERGY CORPORATION	7,911	48.33	382,338.63	
EOG RESOURCES INC	6,490	102.31	663,991.90	
EXXON MOBIL CORPORATION	42,883	72.79	3,121,453.57	
HALLIBURTON CO	9,687	28.59	276,951.33	

HESS CORP	3,661	88.74	324,877.14	
KINDER MORGAN INC	16,827	17.32	291,443.64	
MARATHON PETROLEUM CORP	6,966	70.39	490,336.74	
ONEOK INC	5,262	58.63	308,511.06	
PHILLIPS 66	4,924	82.83	407,854.92	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,629	206.00	541,574.00	
SCHLUMBERGER LTD	15,941	36.60	583,440.60	
VALERO ENERGY CORP	4,660	78.59	366,229.40	
WILLIAMS COS INC	11,428	28.27	323,069.56	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,114	282.81	597,860.34	
ALBEMARLE CORP	1,419	211.92	300,714.48	
AMCOR PLC	14,897	11.92	177,572.24	
AVERY DENNISON CORP	800	200.37	160,296.00	
BALL CORP	3,233	87.23	282,014.59	
CELANESE CORP-SERIES A	1,049	160.80	168,679.20	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,718	68.36	185,802.48	
CORTEVA INC	6,886	46.07	317,238.02	
CROWN HOLDINGS INC	1,306	108.19	141,296.14	
DOW INC	7,043	56.62	398,774.66	
DUPONT DE NEMOURS INC	5,745	77.15	443,226.75	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	1,418	119.24	169,082.32	
ECOLAB INC	2,322	192.61	447,240.42	
FMC CORP	1,300	107.40	139,620.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	16,113	39.96	643,875.48	
INTERNATIONAL PAPER CO	3,270	48.23	157,712.10	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,722	136.62	371,879.64	
LINDE PLC	5,214	316.16	1,648,458.24	
LyondellBasell Industries NV	2,673	93.39	249,631.47	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	713	383.71	273,585.23	
MOSAIC CO/THE	4,823	39.11	188,627.53	
NEWMONT CORPORATION	7,609	63.08	479,975.72	
NUCOR CORP	3,411	95.31	325,102.41	
PACKAGING CORP OF AMERICA	794	136.57	108,436.58	
PPG INDUSTRIES INC	2,156	155.03	334,244.68	
RPM INTERNATIONAL INC	1,044	89.26	93,187.44	
SEALED AIR CORP	1,568	66.30	103,958.40	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,453	298.52	732,269.56	
STEEL DYNAMICS INC	2,563	54.70	140,196.10	
VULCAN MATERIALS CO	1,505	188.79	284,128.95	
WESTROCK CO	3,263	44.99	146,802.37	
3M CO	5,462	172.80	943,833.60	
ALLEGION PLC	800	123.55	98,840.00	
AMETEK INC	1,906	136.33	259,844.98	

BOEING CO	5,857	204.20	1,195,999.40	
CARRIER GLOBAL CORP	9,042	47.66	430,941.72	
CATERPILLAR INC	5,565	214.33	1,192,746.45	
CUMMINS INC	1,187	224.00	265,888.00	
DEERE & CO	3,035	364.03	1,104,831.05	
DOVER CORP	1,237	173.69	214,854.53	
EATON CORP PLC	3,896	160.72	626,165.12	
EMERSON ELECTRIC CO	5,449	93.04	506,974.96	
FASTENAL CO	4,806	57.47	276,200.82	
FORTIVE CORP	2,892	71.96	208,108.32	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,602	97.87	156,787.74	
GENERAC HOLDINGS INC	801	286.19	229,238.19	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,188	207.08	453,091.04	
GENERAL ELECTRIC CO	11,599	96.91	1,124,059.09	
HEICO CORP	1,200	120.95	145,140.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	6,627	204.45	1,354,890.15	
HOWMET AEROSPACE INC	5,682	32.82	186,483.24	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	350	195.65	68,477.50	
IDEX CORP	770	220.60	169,862.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	2,912	237.91	692,793.92	
INGERSOLL-RAND INC	5,146	57.16	294,145.36	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	3,000	59.30	177,900.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	5,983	73.79	441,485.57	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,086	225.05	469,454.30	
LENNOX INTERNATIONAL INC	301	288.60	86,868.60	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,329	373.33	869,485.57	
MASCO CORP	2,057	65.00	133,705.00	
NORDSON CORP	560	234.63	131,392.80	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,395	403.06	562,268.70	
OTIS WORLDWIDE CORP	3,871	83.23	322,183.33	
PACCAR INC	3,207	91.15	292,318.05	
PARKER HANNIFIN CORP	1,349	314.17	423,815.33	
PENTAIR PLC	1,696	65.27	110,697.92	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	15,752	88.12	1,388,066.24	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,335	311.78	416,226.30	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,092	434.45	474,419.40	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	2,093	58.97	123,424.21	
SMITH (A.O.) CORP	1,580	78.78	124,472.40	
SNAP-ON INC	582	210.78	122,673.96	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,787	178.63	319,211.81	
TEXTRON INC	2,711	71.89	194,893.79	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	2,371	176.25	417,888.75	
TRANSDIGM GROUP INC	616	621.27	382,702.32	

UNITED RENTALS INC	911	312.19	284,405.09	
WABTEC CORP/DE	2,555	90.51	231,253.05	
WW GRAINGER INC	328	494.05	162,048.40	
XYLEM INC	1,963	107.59	211,199.17	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,800	86.69	156,042.00	
CINTAS CORP	812	386.32	313,691.84	
COPART INC	2,391	129.42	309,443.22	
COSTAR GROUP INC	4,542	69.65	316,350.30	
EQUIFAX INC	1,412	234.19	330,676.28	
IHS MARKIT LTD	4,196	117.85	494,498.60	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,549	132.13	204,669.37	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,513	93.04	140,769.52	
REPUBLIC SERVICES INC	1,797	127.60	229,297.20	
ROBERT HALF INTL INC	1,311	109.88	144,052.68	
ROLLINS INC	3,299	31.90	105,238.10	
TRANSUNION	2,049	102.68	210,391.32	
VERISK ANALYTICS INC	1,367	197.38	269,818.46	
WASTE CONNECTIONS INC	2,170	123.30	267,561.00	
WASTE MANAGEMENT INC	3,855	149.79	577,440.45	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,155	107.58	124,254.90	
CSX CORP	21,778	34.36	748,292.08	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,562	118.27	184,737.74	
FEDEX CORP	2,578	245.72	633,466.16	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	978	202.67	198,211.26	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,280	57.16	130,324.80	
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,471	276.31	682,762.01	
OLD DOMINION FREIGHT LINE INC	982	309.05	303,487.10	
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,096	43.87	135,821.52	
UBER TECHNOLOGIES INC	13,646	36.28	495,076.88	
UNION PACIFIC CORP	6,401	245.10	1,568,885.10	
UNITED PARCEL SERVICE CL B	7,293	204.13	1,488,720.09	
APTIV PLC	3,062	139.89	428,343.18	
BORGWARNER INC	3,220	44.17	142,227.40	
FORD MOTOR CO	41,981	20.39	855,992.59	
GENERAL MOTORS CO	13,831	52.64	728,063.84	
LEAR CORP	898	173.67	155,955.66	
TESLA INC	8,473	930.00	7,879,890.00	
DR HORTON INC	3,396	91.09	309,341.64	
GARMIN LTD	1,409	123.41	173,884.69	
HASBRO INC	1,532	97.41	149,232.12	
LENNAR CORP-CL A	3,031	100.01	303,130.31	
LULULEMON ATHLETICA INC	1,310	321.62	421,322.20	
MOHAWK INDUSTRIES INC	718	158.83	114,039.94	

NEWELL BRANDS INC	4,487	23.41	105,040.67	
NIKE INC -CL B	12,619	146.00	1,842,374.00	
NVR INC	37	5,287.17	195,625.29	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	4,479	29.71	133,071.09	
PULTE HOMES INC	2,909	54.00	157,086.00	
VF CORP	3,644	68.00	247,792.00	
WHIRLPOOL CORP	630	207.20	130,536.00	
AIRBNB INC-CLASS A	2,699	147.90	399,182.10	
ARAMARK	4,431	34.38	152,337.78	
BOOKING HOLDINGS INC	435	2,349.62	1,022,084.70	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A	316	1,416.57	447,636.12	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,785	136.59	243,813.15	
DOMINO'S PIZZA INC	429	456.24	195,726.96	
EXPEDIA GROUP INC	1,850	171.35	316,997.50	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,211	140.48	451,081.28	
LAS VEGAS SANDS CORP	5,379	44.89	241,463.31	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	3,146	155.74	489,958.04	
MCDONALD'S CORP	7,257	253.61	1,840,447.77	
STARBUCKS CORP	11,733	98.10	1,151,007.30	
VAIL RESORTS INC	610	283.75	173,087.50	
YUM! BRANDS INC	2,831	126.34	357,668.54	
ACTIVISION BLIZZARD INC	8,691	79.97	695,019.27	
ALPHABET INC-CL A	3,018	2,616.08	7,895,329.44	
ALPHABET INC-CL C	2,893	2,607.44	7,543,323.92	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,317	577.13	760,080.21	
COMCAST CORP-CL A	45,440	50.07	2,275,180.80	
DISCOVERY INC-A	4,828	26.88	129,776.64	
DISCOVERY INC-C	3,470	26.25	91,087.50	
DISH NETWORK CORPORATION	3,928	30.83	121,100.24	
ELECTRONIC ARTS INC	3,058	135.20	413,441.60	
FOX CORP-CLASS A	3,264	39.09	127,589.76	
FOX CORP-CLASS B	3,665	35.86	131,426.90	
IAC/INTERACTIVECORP	1,316	128.52	169,132.32	
INTERPUBLIC GROUP COS INC	5,684	35.61	202,407.24	
LIBERTY BROADBAND-C	1,814	143.05	259,492.70	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	2,834	45.99	130,335.66	
MATCH GROUP INC	3,083	117.25	361,481.75	
META PLATFORMS INC-A	24,038	308.71	7,420,770.98	
NETFLIX INC	4,494	387.15	1,739,852.10	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	6,190	22.00	136,180.00	
OMNICOM GROUP	2,148	75.61	162,410.28	
PINTEREST INC- CLASS A	7,161	31.11	222,778.71	
ROKU INC	1,439	157.32	226,383.48	

SEA LTD-ADR	1,100	149.32	164,252.00	
SNAP INC - A	11,880	31.80	377,784.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	1,562	164.99	257,714.38	
THE WALT DISNEY CO	18,566	137.46	2,552,082.36	
TWITTER INC	9,311	35.06	326,443.66	
VIACOMCBS INC-CLASS B	8,194	32.55	266,714.70	
ADVANCE AUTO PARTS	840	232.81	195,560.40	
AMAZON.COM INC	4,580	2,890.88	13,240,230.40	
AUTOZONE INC	223	1,972.13	439,784.99	
BEST BUY COMPANY INC	2,561	101.38	259,634.18	
BURLINGTON STORES INC	891	229.60	204,573.60	
CARMAX INC	2,094	111.92	234,360.48	
Dollar General Corp	2,234	216.58	483,839.72	
DOLLAR TREE INC	2,664	132.15	352,047.60	
EBAY INC	6,396	59.66	381,585.36	
ETSY INC	1,547	154.06	238,330.82	
GENUINE PARTS CO	1,541	134.98	208,004.18	
HOME DEPOT INC	10,495	363.81	3,818,185.95	
LKQ CORP	3,758	55.29	207,779.82	
LOWE'S COMPANIES	6,971	232.35	1,619,711.85	
MERCADOLIBRE INC	492	1,026.63	505,101.96	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	643	657.77	422,946.11	
POOL CORP	469	477.62	224,003.78	
ROSS STORES INC	4,047	98.25	397,617.75	
TARGET CORP	4,887	220.58	1,077,974.46	
TJX COMPANIES INC	12,372	69.06	854,410.32	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,320	217.17	286,664.40	
ULTA BEAUTY INC	655	364.84	238,970.20	
WAYFAIR INC- CLASS A	1,036	152.78	158,280.08	
COSTCO WHOLESALE CORP	4,450	488.90	2,175,605.00	
KROGER CO	7,873	47.72	375,699.56	
SYSCO CORP	5,428	77.17	418,878.76	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	7,506	52.38	393,164.28	
WALMART INC	15,022	140.20	2,106,084.40	
ALTRIA GROUP INC	18,401	49.95	919,129.95	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	5,459	68.59	374,432.81	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,697	66.17	178,460.49	
BUNGE LIMITED	1,682	93.69	157,586.58	
CAMPBELL SOUP CO	2,147	45.32	97,302.04	
COCA-COLA COMPANY	40,094	59.96	2,404,036.24	
COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC	3,097	56.86	176,095.42	
CONAGRA BRANDS INC	5,359	35.31	189,226.29	

CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,631	240.06	391,537.86	
GENERAL MILS INC	5,682	68.55	389,501.10	
HERSHEY CO/THE	1,152	199.92	230,307.84	
HORMEL FOODS CORP	3,351	49.01	164,232.51	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	1,272	142.02	180,649.44	
KELLOGG CO	2,606	66.20	172,517.20	
KEURIG DR PEPPER INC	8,959	38.17	341,965.03	
KRAFT HEINZ CO/THE	7,018	36.39	255,385.02	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,639	94.17	248,514.63	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	3,087	49.86	153,917.82	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	13,103	67.61	885,893.83	
MONSTER BEVERAGE CORP	3,362	88.14	296,326.68	
PEPSICO INC	13,497	173.33	2,339,435.01	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	14,989	100.58	1,507,593.62	
TYSON FOODS INC-CL A	3,028	90.65	274,488.20	
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,851	102.42	291,999.42	
CLOROX COMPANY	1,578	176.95	279,227.10	
COLGATE-PALMOLIVE CO	7,327	83.67	613,050.09	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,473	301.79	746,326.67	
KIMBERLY-CLARK CORP	2,959	141.80	419,586.20	
PROCTER & GAMBLE CO	23,949	161.30	3,862,973.70	
ABBOTT LABORATORIES	17,705	123.82	2,192,233.10	
ABIOMED INC	650	311.94	202,761.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	840	474.43	398,521.20	
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,832	131.55	240,999.60	
ANTHEM INC	2,371	449.50	1,065,764.50	
BAXTER INTL INC	4,546	85.96	390,774.16	
BECTON DICKINSON & CO	2,753	259.96	715,669.88	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	14,073	42.66	600,354.18	
CARDINAL HEALTH INC	3,346	50.81	170,010.26	
CENTENE CORP	6,433	77.53	498,750.49	
CERNER CORP	2,666	91.71	244,498.86	
CIGNA CORP	3,177	236.42	751,106.34	
COOPER COS INC/THE	417	393.31	164,010.27	
CVS HEALTH CORPORATION	12,990	103.51	1,344,594.90	
DAVITA INC	917	110.73	101,539.41	
DENTSPLY SIRONA INC	2,559	53.88	137,878.92	
DEXCOM INC	1,081	426.83	461,403.23	
Edwards Lifesciences Corp	6,532	110.60	722,439.20	
HCA HEALTHCARE INC	2,470	243.60	601,692.00	
HENRY SCHEIN INC	2,500	74.38	185,950.00	
HUMANA INC	1,160	379.10	439,756.00	
IDEXX LABORATORIES INC	884	511.65	452,298.60	

INTUITIVE SURGICAL INC	3,737	271.98	1,016,389.26	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	972	272.15	264,529.80	
MASIMO CORP	768	223.51	171,655.68	
MCKESSON CORP	1,523	248.35	378,237.05	
MEDTRONIC PLC	13,295	104.21	1,385,471.95	
MOLINA HEALTHCARE INC	703	279.77	196,678.31	
QUEST DIAGNOSTICS	1,189	138.30	164,438.70	
RESMED INC	1,585	238.52	378,054.20	
STERIS PLC	1,150	224.29	257,933.50	
STRYKER CORP	3,311	251.92	834,107.12	
TELADOC HEALTH INC	2,106	75.16	158,286.96	
TELEFLEX INC	644	317.29	204,334.76	
UNITEDHEALTH GROUP INC	9,323	462.27	4,309,743.21	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	649	130.74	84,850.26	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,612	227.36	366,504.32	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,350	123.65	290,577.50	
ABBVIE INC	17,997	132.16	2,378,483.52	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	2,890	138.12	399,166.80	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,540	136.53	210,256.20	
AMGEN INC	5,549	226.08	1,254,517.92	
AVANTOR INC	6,908	36.57	252,625.56	
BIOGEN INC	1,662	224.69	373,434.78	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,615	86.22	225,465.30	
BIO-RAD LABORATORIES-A	283	583.96	165,260.68	
BIO-TECHNE CORP	531	381.89	202,783.59	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	22,920	62.61	1,435,021.20	
CATALENT INC	2,206	103.74	228,850.44	
CHARLES RIVER LABORATORIES	685	330.09	226,111.65	
DANAHER CORP	6,618	276.86	1,832,259.48	
ELI LILLY & CO	8,256	240.42	1,984,907.52	
GILEAD SCIENCES INC	12,110	68.57	830,382.70	
ILLUMINA INC	1,602	364.96	584,665.92	
INCYTE CORP	2,895	75.34	218,109.30	
IQVIA HOLDINGS INC	2,050	243.70	499,585.00	
JOHNSON & JOHNSON	26,011	162.97	4,239,012.67	
MERCK & CO. INC.	25,415	78.83	2,003,464.45	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	216	1,462.64	315,930.24	
MODERNA INC	3,685	157.30	579,650.50	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,568	75.86	118,948.48	
PERKINELMER INC	1,449	174.11	252,285.39	
PFIZER INC	57,166	51.54	2,946,335.64	
Regeneron Pharmaceuticals Inc	1,135	621.48	705,379.80	
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	4,500	39.47	177,615.00	

SEAGEN INC	1,769	129.55	229,173.95	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	3,992	575.80	2,298,593.60	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,834	229.68	650,913.12	
VIATRIS INC	14,537	14.36	208,751.32	
WATERS CORP	567	322.88	183,072.96	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	874	383.52	335,196.48	
ZOETIS INC	4,744	200.07	949,132.08	
BANK OF AMERICA CORP	76,453	44.55	3,405,981.15	
CITIGROUP INC	19,731	62.70	1,237,133.70	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,175	51.10	264,442.50	
FIFTH THIRD BANCORP	8,251	45.48	375,255.48	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,781	174.86	311,425.66	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	18,501	15.64	289,355.64	
JPMORGAN CHASE & CO	29,571	144.95	4,286,316.45	
KEYCORP	10,250	24.99	256,147.50	
M & T BANK CORP	1,284	166.63	213,952.92	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,180	204.11	853,179.80	
REGIONS FINANCIAL CORP	10,668	22.97	245,043.96	
SVB FINANCIAL GROUP	673	570.01	383,616.73	
TRUIST FINANCIAL CORP	14,336	62.30	893,132.80	
US BANCORP	15,126	56.81	859,308.06	
WELLS FARGO & COMPANY	42,048	53.32	2,241,999.36	
ALLY FINANCIAL INC	4,196	46.68	195,869.28	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	7,003	158.93	1,112,986.79	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,004	300.96	302,163.84	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	5,003	65.35	326,946.05	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	8,172	58.90	481,330.80	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	13,073	303.73	3,970,662.29	
BLACKROCK INC	1,459	786.82	1,147,970.38	
BLACKSTONE INC	7,331	109.39	801,938.09	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	4,786	148.30	709,763.80	
CARLYLE GROUP INC/THE	2,889	48.04	138,787.56	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,356	118.10	160,143.60	
CME GROUP INC	3,594	224.25	805,954.50	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,479	115.34	401,267.86	
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,490	32.93	180,785.70	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	312	420.98	131,345.76	
FRANKLIN RESOURCES INC	4,123	31.69	130,657.87	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,276	343.39	1,124,945.64	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	5,199	125.32	651,538.68	
INVESCO LTD	6,105	21.57	131,684.85	
KKR & CO INC	6,052	65.41	395,861.32	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	503	365.22	183,705.66	

MOODY'S CORP	1,601	344.08	550,872.08	
MORGAN STANLEY	13,832	98.08	1,356,642.56	
MSCI INC	920	507.07	466,504.40	
NASDAQ INC	1,071	176.33	188,849.43	
NORTHERN TRUST CORP	2,221	116.32	258,346.72	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,047	97.64	199,869.08	
S&P GLOBAL INC	2,293	417.95	958,359.35	
SCHWAB (CHARLES) CORP	15,171	88.71	1,345,819.41	
SEI INVESTMENTS COMPANY	754	58.48	44,093.92	
STATE STREET CORP	3,785	93.80	355,033.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	6,245	44.93	280,587.85	
T ROWE PRICE GROUP INC	1,970	159.32	313,860.40	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,663	89.58	148,971.54	
AFLAC INC	5,371	61.48	330,209.08	
ALLEGHANY CORP	125	657.00	82,125.00	
ALLSTATE CORP	2,463	121.92	300,288.96	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,182	129.00	152,478.00	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	9,585	57.46	550,754.10	
AON PLC	2,255	273.65	617,080.75	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,400	45.70	155,380.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,054	156.29	321,019.66	
ASSURANT INC	654	149.60	97,838.40	
BROWN & BROWN INC	3,500	64.61	226,135.00	
CHUBB LTD	4,107	195.90	804,561.30	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,726	117.17	202,235.42	
EVEREST RE GROUP LTD	399	284.11	113,359.89	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	2,821	50.31	141,924.51	
GLOBE LIFE INC	826	102.06	84,301.56	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	3,227	70.58	227,761.66	
LINCOLN NATIONAL CORP	2,830	66.56	188,364.80	
LOEWS CORP	2,786	58.96	164,262.56	
MARKEL CORP	110	1,229.41	135,235.10	
MARSH & MCLENNAN COS	4,992	157.96	788,536.32	
METLIFE INC	6,362	65.41	416,138.42	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,650	72.16	263,384.00	
PROGRESSIVE CORP	5,346	109.88	587,418.48	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,290	109.44	469,497.60	
TRAVELERS COS INC/THE	2,120	168.83	357,919.60	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,197	230.84	276,315.48	
WR BERKLEY CORP	1,233	83.36	102,782.88	
CBRE GROUP INC - A	3,902	100.75	393,126.50	
ACCENTURE PLC-CL A	6,340	339.00	2,149,260.00	
ADOBE INC	4,873	519.66	2,532,303.18	

AKAMAI TECHNOLOGIES	1,871	114.19	213,649.49	
ANSYS INC	1,023	334.77	342,469.71	
AUTODESK INC	2,410	245.35	591,293.50	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	4,144	218.24	904,386.56	
BLACK KNIGHT INC	2,294	74.12	170,031.28	
BLOCK INC-A	4,337	117.30	508,730.10	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	1,115	157.92	176,080.80	
CADENCE DESIGN SYS INC	3,092	151.66	468,932.72	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,568	124.24	194,808.32	
CITRIX SYSTEMS INC	1,765	106.34	187,690.10	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	2,839	93.28	264,821.92	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	4,808	85.10	409,160.80	
COUPA SOFTWARE INC	1,081	132.35	143,070.35	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC-A	2,191	167.27	366,488.57	
DOCUSIGN INC	2,325	121.83	283,254.75	
DYNATRACE INC	2,952	50.19	148,160.88	
EPAM SYSTEMS INC	663	468.41	310,555.83	
FAIR ISAAC CORP	412	439.45	181,053.40	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	6,700	111.79	748,993.00	
FISERV INC	6,512	102.74	669,042.88	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	918	225.45	206,963.10	
FORTINET INC	1,566	290.37	454,719.42	
GARTNER INC	1,020	287.03	292,770.60	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,429	140.81	482,837.49	
GODADDY INC - CLASS A	2,579	73.39	189,272.81	
HUBSPOT INC	544	465.07	252,998.08	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	8,641	128.82	1,113,133.62	
INTUIT INC	2,829	534.68	1,512,609.72	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	673	163.22	109,847.06	
MASTERCARD INC-CLASS A	8,924	349.42	3,118,224.08	
MICROSOFT CORP	71,594	296.37	21,218,313.78	
NORTONLIFELOCK INC	6,076	26.13	158,765.88	
OKTA INC	1,540	190.90	293,986.00	
ORACLE CORPORATION	17,200	82.42	1,417,624.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	1,083	504.21	546,059.43	
PAYCHEX INC	2,805	120.09	336,852.45	
PAYCOM SOFTWARE INC	658	326.29	214,698.82	
PAYPAL HOLDINGS INC	11,476	162.17	1,861,062.92	
PTC INC	1,746	117.60	205,329.60	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	1,084	173.54	188,117.36	
SALESFORCE.COM INC	10,031	223.03	2,237,213.93	
SERVICENOW INC	2,076	525.84	1,091,643.84	

SNOWFLAKE INC-CLASS A	2,286	277.50	634,365.00	
SPLUNK INC	2,181	121.29	264,533.49	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,734	78.91	215,739.94	
SYNOPSYS INC	1,689	308.34	520,786.26	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	4,998	65.33	326,519.34	
TWILIO INC - A	1,895	197.50	374,262.50	
TYLER TECHNOLOGIES INC	534	466.82	249,281.88	
VERISIGN INC	1,126	220.10	247,832.60	
VISA INC-CLASS A SHARES	17,001	201.85	3,431,651.85	
VMWARE INC-CLASS A	2,407	125.19	301,332.33	
WESTERN UNION CO	6,080	17.86	108,588.80	
WORKDAY INC-CLASS A	2,135	247.63	528,690.05	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	2,488	152.95	380,539.60	
AMPHENOL CORP-CL A	5,309	77.35	410,651.15	
APPLE INC	165,462	161.62	26,741,968.44	
ARISTA NETWORKS INC	2,797	121.52	339,891.44	
CDW CORP/DE	1,350	185.15	249,952.50	
CISCO SYSTEMS INC	41,258	56.90	2,347,580.20	
COGNEX CORP	2,356	67.71	159,524.76	
CORNING INC	7,761	35.33	274,196.13	
DELL TECHNOLOGIES -C	3,336	55.42	184,881.12	
F5 INC	615	226.67	139,402.05	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	15,204	16.10	244,784.40	
HP INC	12,069	35.62	429,897.78	
JUNIPER NETWORKS INC	2,949	32.29	95,223.21	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	1,919	175.36	336,515.84	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,580	239.51	378,425.80	
NETAPP INC	2,269	86.52	196,313.88	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	2,231	97.16	216,763.96	
TE CONNECTIVITY LTD	2,972	152.51	453,259.72	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	501	417.01	208,922.01	
TRIMBLE INC	3,178	72.52	230,468.56	
WESTERN DIGITAL CORP	3,828	57.02	218,272.56	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	576	490.56	282,562.56	
AT&T INC	73,212	26.34	1,928,404.08	
T-MOBILE US INC	6,760	106.65	720,954.00	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	40,326	52.96	2,135,664.96	
AES CORPORATION	8,526	22.59	192,602.34	
ALLIANT ENERGY CORP	2,398	58.75	140,882.50	
AMEREN CORPORATION	2,188	86.40	189,043.20	
AMERICAN ELECTRIC POWER	4,345	89.12	387,226.40	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,973	159.79	315,265.67	
ATMOS ENERGY CORP	1,464	102.32	149,796.48	

CENTERPOINT ENERGY INC	7,511	27.16	203,998.76	
CMS ENERGY CORP	2,454	62.60	153,620.40	
CONSOLIDATED EDISON INC	3,117	81.99	255,562.83	
DOMINION ENERGY INC	8,024	78.48	629,723.52	
DTE ENERGY COMPANY	1,745	116.88	203,955.60	
DUKE ENERGY CORP	7,168	102.58	735,293.44	
EDISON INTERNATIONAL	4,175	62.27	259,977.25	
ENTERGY CORP	2,181	108.19	235,962.39	
ESSENTIAL UTILITIES INC	3,443	47.83	164,678.69	
EVERGY INC	2,778	63.58	176,625.24	
EVERSOURCE ENERGY	3,434	86.15	295,839.10	
EXELON CORP	8,857	56.10	496,877.70	
FIRSTENERGY CORP	5,684	41.31	234,806.04	
NEXTERA ENERGY INC	19,981	81.92	1,636,843.52	
NISOURCE INC	4,550	27.04	123,032.00	
NRG ENERGY INC	2,912	39.82	115,955.84	
PPL CORPORATION	7,708	29.56	227,848.48	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	4,363	64.35	280,759.05	
SEMPRA ENERGY	3,170	131.65	417,330.50	
SOUTHERN CO	9,738	67.37	656,049.06	
UGI CORP	2,093	44.41	92,950.13	
WEC ENERGY GROUP INC	3,126	95.13	297,376.38	
XCEL ENERGY INC	4,845	67.43	326,698.35	
ADVANCED MICRO DEVICES	12,534	116.53	1,460,587.02	
ANALOG DEVICES	5,379	161.44	868,385.76	
APPLIED MATERIALS INC	9,203	139.29	1,281,885.87	
BROADCOM INC	4,099	541.58	2,219,936.42	
ENPHASE ENERGY INC	1,599	128.10	204,831.90	
INTEL CORP	39,620	51.94	2,057,862.80	
KLA CORPORATION	1,608	391.10	628,888.80	
LAM RESEARCH CORP	1,429	621.82	888,580.78	
MARVELL TECHNOLOGY INC	8,903	72.09	641,817.27	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,077	74.85	454,863.45	
MICRON TECHNOLOGY INC	11,773	82.95	976,570.35	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	551	402.02	221,513.02	
NVIDIA CORP	25,223	233.72	5,895,119.56	
NXP SEMICONDUCTORS NV	2,822	203.07	573,063.54	
QORVO INC	1,143	137.65	157,333.95	
QUALCOMM INC	11,282	170.07	1,918,729.74	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,560	143.84	224,390.40	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	731	225.87	165,110.97	
TERADYNE INC	1,756	147.44	258,904.64	
TEXAS INSTRUMENTS	8,934	178.34	1,593,289.56	

XILINX INC	2,743	185.51	508,853.93	
米ドル小計	3,078,032		386,793,389.02 (44,098,314,282)	
	銘柄数	523		
	比　率	69.0%	72.9%	
加ドル	株	加ドル	加ドル	
CAMECO CORP	7,015	25.33	177,689.95	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	13,266	62.30	826,471.80	
CENOVUS ENERGY INC	18,634	17.61	328,144.74	
ENBRIDGE INC	19,354	50.87	984,537.98	
IMPERIAL OIL LTD	4,688	50.58	237,119.04	
KEYERA CORP	5,528	27.76	153,457.28	
PEMBINA PIPELINE CORP	7,553	38.50	290,790.50	
SUNCOR ENERGY INC	17,237	33.20	572,268.40	
TC ENERGY CORP	8,946	62.37	557,962.02	
AGNICO EAGLE MINES LTD	3,007	63.56	191,124.92	
BARRICK GOLD CORP	16,979	24.45	415,136.55	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,620	64.84	169,880.80	
FRANCO-NEVADA CORP	1,972	163.52	322,461.44	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	3,596	50.24	180,663.04	
NUTRIEN LTD	6,503	88.01	572,329.03	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	5,672	50.83	288,307.76	
CAE INC	5,699	30.95	176,384.05	
WSP GLOBAL INC	1,607	166.17	267,035.19	
THOMSON REUTERS CORP	1,895	134.40	254,688.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	7,570	153.59	1,162,676.30	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,060	93.20	937,592.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,593	99.12	356,138.16	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,387	49.27	166,877.49	
RESTAURANT BRANDS INTERN	4,069	70.41	286,498.29	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	5,851	37.86	221,518.86	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	883	176.98	156,273.34	
DOLLARAMA INC	3,211	61.83	198,536.13	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	8,633	49.75	429,491.75	
LOBLAW COMPANIES LTD	1,598	93.30	149,093.40	
METRO INC	2,287	64.45	147,397.15	
WESTON (GEORGE) LTD	1,159	132.82	153,938.38	
SAPUTO INC	5,761	27.45	158,139.45	
BANK OF MONTREAL	6,735	142.10	957,043.50	
BANK OF NOVA SCOTIA	11,579	88.99	1,030,415.21	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	4,329	158.26	685,107.54	
NATIONAL BANK OF CANADA	3,983	97.25	387,346.75	
ROYAL BANK OF CANADA	13,708	143.34	1,964,904.72	

TORONTO-DOMINION BANK	17,911	99.21	1,776,950.31	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	15,111	67.75	1,023,770.25	
IGM FINANCIAL INC	2,482	45.03	111,764.46	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	305	600.95	183,289.75	
GREAT-WEST LIFECO INC	4,487	38.19	171,358.53	
INTACT FINANCIAL CORP	1,923	166.70	320,564.10	
MANULIFE FINANCIAL CORP	19,816	25.04	496,192.64	
POWER CORP OF CANADA	7,328	40.19	294,512.32	
SUN LIFE FINANCIAL INC	4,797	69.74	334,542.78	
CGI INC	1,843	105.45	194,344.35	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	234	2,080.97	486,946.98	
OPEN TEXT CORP	3,570	59.08	210,915.60	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,177	1,188.46	1,398,817.42	
BCE INC	1,927	64.96	125,177.92	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	4,794	60.73	291,139.62	
TELUS CORP	1,600	29.25	46,800.00	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	11,958	17.45	208,667.10	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,493	35.75	124,874.75	
EMERA INC	2,741	59.58	163,308.78	
FORTIS INC	4,285	58.68	251,443.80	
HYDRO ONE LTD	4,027	32.06	129,105.62	
加ドル小計	365,976		24,859,927.99 (2,243,111,302)	
	銘柄数	58		
	比　率	3.5%	3.7%	
ユーロ	株	ユーロ	ユーロ	
ENI SPA	21,788	12.68	276,402.56	
Galp Energia SGPS SA	8,917	9.26	82,607.08	
NESTE OYJ	4,108	39.27	161,321.16	
OMV AG	2,820	51.66	145,681.20	
REPSOL SA	12,827	10.42	133,708.64	
TENARIS SA	9,588	9.85	94,441.80	
TOTALENERGIES SE	23,955	47.91	1,147,803.82	
AIR LIQUIDE	4,406	150.72	664,072.32	
AKZO NOBEL	1,324	90.08	119,265.92	
ARCELORMITTAL	6,792	26.98	183,282.12	
BASF SE	8,363	64.26	537,406.38	
COVESTRO AG	1,594	51.26	81,708.44	
CRH PLC(DUBLIN)	6,680	43.14	288,175.20	
EVONIK INDUSTRIES AG	4,282	28.50	122,037.00	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	1,001	37.54	37,577.54	
HEIDELBERGCEMENT AG	1,313	60.08	78,885.04	
KONINKLIJKE DSM NV	1,487	167.95	249,741.65	

LANXESS	1,978	52.50	103,845.00	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,500	45.05	112,625.00	
SOLVAY SA	898	105.55	94,783.90	
STORA ENSO OYJ-R SHS	4,601	16.14	74,260.14	
SYMRISE AG	1,067	108.55	115,822.85	
UMICORE	3,433	32.61	111,950.13	
UPM-KYMMENE OYJ	4,070	34.01	138,420.70	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,456	22.48	100,170.88	
AIRBUS SE	6,304	107.34	676,671.36	
ALSTOM	5,137	30.79	158,168.23	
BOUYGUES	2,236	31.05	69,427.80	
BRENNTAG SE	1,423	74.72	106,326.56	
CNH INDUSTRIAL NV	14,292	13.12	187,582.50	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	4,732	57.96	274,266.72	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	4,085	31.67	129,371.95	
Eiffage SA	853	91.00	77,623.00	
FERROVIAL SA	6,093	24.71	150,558.03	
GEA GROUP AG	2,647	41.37	109,506.39	
KINGSPAN GROUP PLC	1,573	79.22	124,613.06	
KONE OYJ-B	3,002	56.10	168,412.20	
Legrand SA	2,174	89.18	193,877.32	
MTU AERO ENGINES AG	806	185.10	149,190.60	
Prysmian SpA	3,223	29.52	95,142.96	
SAFRAN SA	3,840	104.02	399,436.80	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	5,292	149.94	793,482.48	
SIEMENS AG	7,821	137.44	1,074,918.24	
SIEMENS ENERGY AG	6,551	18.04	118,180.04	
THALES SA	980	80.42	78,811.60	
VINCI S.A.	5,374	95.28	512,034.72	
WARTSILA	8,864	11.74	104,063.36	
Bureau Veritas SA	2,338	24.67	57,678.46	
RANDSTAD NV	1,334	56.94	75,957.96	
TELEPERFORMANCE	605	331.20	200,376.00	
WOLTERS KLUWER	2,170	86.94	188,659.80	
AENA SME SA	860	142.85	122,851.00	
Aeroports de Paris	928	120.95	112,241.60	
DEUTSCHE POST AG	9,699	50.49	489,702.51	
GETLINK SE	7,931	13.86	109,963.31	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,194	91.48	292,187.12	
CONTINENTAL AG	1,106	84.84	93,833.04	
DAIMLER AG	8,358	68.30	570,851.40	
FERRARI NV	1,355	197.95	268,222.25	
MICHELIN (CGDE)-B	1,341	145.15	194,646.15	

PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	1,789	81.36	145,553.04	
STELLANTIS NV	21,796	16.78	365,911.24	
VALEO SA	4,228	24.17	102,190.76	
VOLKSWAGEN AG	521	244.40	127,332.40	
VOLKSWAGEN AG PFD	1,709	176.52	301,672.68	
ADIDAS AG	1,851	240.75	445,628.25	
ESSILORLUXOTTICA	3,103	167.22	518,883.66	
HERMES INTERNATIONAL	326	1,308.50	426,571.00	
KERING	767	648.90	497,706.30	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	2,745	662.80	1,819,386.00	
MONCLER SPA	2,486	55.58	138,171.88	
PUMA AG	989	91.36	90,355.04	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,144	125.15	268,321.60	
SODEXO	1,741	81.72	142,274.52	
PUBLICIS GROUPE	2,064	57.04	117,730.56	
SCOUT24 SE	1,969	54.20	106,719.80	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,351	49.82	117,126.82	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	9,124	20.96	191,239.04	
VIVENDI SA	5,268	11.17	58,869.90	
DELIVERY HERO SE	2,148	68.58	147,309.84	
INDITEX	11,141	27.15	302,478.15	
PROSUS NV	10,044	72.48	727,989.12	
ZALANDO SE	2,948	64.58	190,381.84	
CARREFOUR SA	5,235	17.39	91,062.82	
COLRUYT SA	1,052	35.44	37,282.88	
HELLOFRESH SE	2,500	53.00	132,500.00	
JERONIMO MARTINS	6,160	20.79	128,066.40	
KESKO OYJ-B SHS	4,988	26.18	130,585.84	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	8,764	28.46	249,467.26	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	8,614	56.49	486,604.86	
DANONE	5,649	56.06	316,682.94	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	10,149	11.13	113,009.11	
HEINEKEN HOLDING NV	1,077	79.80	85,944.60	
HEINEKEN NV	2,778	97.66	271,299.48	
KERRY GROUP PLC-A	1,259	111.20	140,000.80	
PERNOD-RICARD	1,850	193.00	357,050.00	
BEIERSDORF AG	812	89.80	72,917.60	
HENKEL AG & CO KGAA	1,044	72.80	76,003.20	
HENKEL AG AND CO KGAA VORZUG	1,040	76.24	79,289.60	
L'OREAL	2,390	366.35	875,576.50	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	1,721	56.00	96,376.00	
Fresenius SE & CO KG	3,712	35.47	131,664.64	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	9,790	28.03	274,462.65	

ORPEA	1,290	69.28	89,371.20	
SARTORIUS AG-VORZUG	359	440.00	157,960.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,718	58.48	217,428.64	
BAYER AG	9,473	50.00	473,650.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,862	87.98	163,818.76	
GRIFOLS SA	6,001	15.36	92,205.36	
MERCK KGAA	1,475	190.00	280,250.00	
ORION OYJ	1,972	34.15	67,343.80	
QIAGEN N V	2,511	42.30	106,215.30	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	2,105	50.52	106,344.60	
SANOFI	10,801	88.52	956,104.52	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	391	368.80	144,200.80	
UCB SA	1,499	86.40	129,513.60	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	67,838	5.43	368,428.17	
BANCO SANTANDER S.A	163,923	2.94	482,425.38	
BNP PARIBAS	10,954	60.10	658,335.40	
CaixaBank SA	38,505	2.68	103,501.44	
COMMERZBANK AG	18,174	7.11	129,380.70	
CREDIT AGRICOLE SA	12,430	12.86	159,874.66	
ERSTE GROUP BANK AG	5,002	40.48	202,480.96	
FINECOBANK SPA	7,620	14.90	113,576.10	
ING GROEP NV-CVA	43,260	12.45	538,846.56	
INTESA SANPAOLO	160,185	2.46	395,096.30	
KBC GROEP NV	3,204	75.50	241,902.00	
MEDIOBANCA SPA	9,518	9.79	93,181.22	
SOCIETE GENERALE-A	9,099	31.11	283,115.38	
UNICREDIT SPA	25,121	12.84	322,754.60	
DEUTSCHE BANK AG -REG	24,410	10.76	262,651.60	
DEUTSCHE BOERSE AG	1,549	160.15	248,072.35	
EXOR NV	1,000	71.74	71,740.00	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	899	92.74	83,373.26	
Wendel	562	94.55	53,137.10	
AEGON NV	26,621	4.82	128,339.84	
AGEAS	2,118	41.58	88,066.44	
ALLIANZ SE	3,879	216.60	840,191.40	
ASSICURAZIONI GENERALI	8,315	17.80	148,007.00	
AXA SA	17,413	26.76	466,058.94	
CNP ASSURANCES	4,719	21.76	102,685.44	
HANNOVER RUECK SE	457	163.90	74,902.30	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,206	260.65	314,343.90	
NN GROUP NV	2,638	47.91	126,386.58	
POSTE ITALIANE SPA	9,547	11.02	105,255.67	
SAMPO OYJ-A SHS	4,520	41.19	186,178.80	

AROUNDTOWN SA	22,069	5.34	117,936.73	
LEG IMMOBILIEN SE	618	113.15	69,926.70	
VONOVIA SE	7,355	47.15	346,788.25	
ADYEN NV /WI	220	1,678.20	369,204.00	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	5,104	59.80	305,219.20	
CAPGEMINI	1,821	190.70	347,264.70	
DASSAULT SYSTEMES SE	7,679	42.67	327,701.32	
EDENRED	2,816	38.21	107,599.36	
SAP SE	10,035	116.00	1,164,060.00	
WORLDLINE SA	3,706	42.00	155,652.00	
NOKIA OYJ	58,213	4.79	279,218.65	
CELLNEX TELECOM SAU	6,126	41.05	251,472.30	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	31,104	15.72	488,954.88	
ELISA OYJ	1,201	51.38	61,707.38	
KONIKLIJKE KPN NV	35,965	2.80	100,845.86	
ORANGE	14,450	9.98	144,297.70	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	31,464	2.56	80,799.55	
TELEFONICA SA	48,194	4.02	193,836.26	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,463	33.07	81,451.41	
E.ON SE	24,096	11.92	287,224.32	
ELECTRICITE DE FRANCE	9,085	8.14	73,951.90	
ENAGAS SA	4,803	19.59	94,114.78	
ENDESA SA	3,722	19.43	72,337.07	
ENEL SPA	79,378	6.66	529,054.37	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	30,731	4.43	136,169.06	
ENGIE	16,362	13.17	215,520.26	
FORTUM OYJ	6,356	23.46	149,111.76	
IBERDROLA SA	52,999	9.97	528,400.03	
NATURGY ENERGY GROUP SA	4,010	28.25	113,282.50	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	2,522	17.79	44,866.38	
RWE AG	7,639	35.12	268,281.68	
SNAM SPA	25,000	4.94	123,625.00	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	15,194	6.83	103,835.79	
UNIPER SE	2,215	38.83	86,008.45	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	7,594	30.76	233,591.44	
ASM INTERNATIONAL NV	612	303.30	185,619.60	
ASML HOLDING NV	4,212	585.00	2,464,020.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	13,834	34.28	474,298.69	
STMICROELECTRONICS NV	6,942	38.69	268,585.98	
ユーロ小計	1,792,657		47,103,014.99 (6,079,115,114)	
	銘柄数	185		
	比　率	9.5%	10.1%	

英ポンド	株	英ポンド	英ポンド	
BP PLC	201,625	3.64	734,116.62	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	38,363	17.47	670,278.33	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	38,140	17.47	666,610.92	
ANGLO AMERICAN PLC	14,386	32.21	463,373.06	
BHP GROUP PLC	19,629	23.33	458,042.71	
CRODA INTERNATIONAL PLC	1,641	77.42	127,046.22	
GLENCORE PLC	111,620	3.88	433,364.65	
JOHNSON MATTHEY PLC	4,544	18.71	85,040.96	
MONDI PLC	3,676	17.65	64,881.40	
RIO TINTO PLC	10,972	52.64	577,566.08	
ASHTEAD GROUP PLC	5,215	49.50	258,142.50	
BAE SYSTEMS PLC	24,248	5.98	145,003.04	
BUNZL PLC	2,914	26.99	78,648.86	
DCC PLC	1,700	61.24	104,108.00	
FERGUSON PLC	2,065	113.55	234,480.75	
MELROSE INDUSTRIES PLC	70,864	1.49	105,799.95	
SMITHS GROUP PLC	5,259	15.17	79,805.32	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	985	126.90	124,996.50	
EXPERIAN PLC	8,891	29.49	262,195.59	
INTERTEK GROUP PLC	1,447	52.84	76,459.48	
RELX PLC	17,540	22.28	390,791.20	
RENTOKIL INITIAL PLC	26,096	5.21	136,064.54	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	9,000	6.14	55,296.00	
BURBERRY GROUP PLC	3,881	18.86	73,195.66	
PERSIMMON PLC	2,958	23.90	70,696.20	
COMPASS GROUP PLC	20,876	16.18	337,773.68	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,018	46.66	140,819.88	
Whitbread PLC	3,944	29.42	116,032.48	
AUTO TRADER GROUP PLC	9,710	6.59	64,008.32	
INFORMA PLC	26,443	5.27	139,354.61	
WPP PLC	14,124	11.44	161,578.56	
KINGFISHER PLC	24,547	3.16	77,691.25	
NEXT PLC	1,495	72.62	108,566.90	
OCADO GROUP PLC	7,803	13.58	106,003.75	
TESCO PLC	62,329	2.88	179,632.17	
Associated British Foods PLC	5,480	19.86	108,860.20	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	20,232	31.84	644,288.04	
DIAGEO PLC	22,282	36.72	818,195.04	
IMPERIAL BRANDS PLC	7,753	17.36	134,592.08	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	7,715	64.26	495,765.90	
UNILEVER PLC	24,872	39.43	980,827.32	
SMITH & NEPHEW PLC	8,001	12.13	97,052.13	

ASTRAZENECA PLC	15,615	83.16	1,298,543.40	
GLAXOSMITHKLINE PLC	47,652	16.14	769,389.19	
BARCLAYS PLC	156,175	1.90	297,294.73	
HSBC HOLDINGS PLC	202,173	4.92	994,994.41	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	716,729	0.49	353,132.37	
NATWEST GROUP PLC	69,786	2.29	160,438.01	
STANDARD CHARTERED PLC	26,802	4.87	130,766.95	
3I GROUP PLC	9,645	12.98	125,240.32	
ABRDN PLC	19,207	2.29	44,022.44	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	7,376	12.96	95,629.84	
London Stock Exchange Group PLC	3,691	73.62	271,731.42	
M&G PLC	47,167	2.06	97,447.02	
SCHRODERS PLC	2,831	32.81	92,885.11	
ST JAMES'S PLACE PLC	6,958	15.08	104,926.64	
ADMIRAL GROUP PLC	2,865	31.25	89,531.25	
AVIVA PLC	32,473	4.24	137,717.99	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	68,288	2.81	192,162.43	
PRUDENTIAL PLC	28,218	12.33	347,927.94	
SAGE GROUP PLC/THE	8,686	7.67	66,638.99	
HALMA PLC	3,510	24.43	85,749.30	
BT GROUP PLC	111,533	1.86	207,562.91	
VODAFONE GROUP PLC	285,525	1.22	350,796.01	
NATIONAL GRID PLC	34,797	10.79	375,459.63	
SEVERN TRENT PLC	2,425	28.85	69,961.25	
SSE PLC	10,023	15.37	154,103.62	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	6,612	10.59	70,021.08	
英ポンド小計	2,825,045		18,171,121.10 (2,792,901,313)	
	銘柄数	68		
	比　率	4.4%	4.6%	
スイスフラン	株	スイスフラン	スイスフラン	
CLARIANT AG-REG	3,816	19.02	72,599.40	
GIVAUDAN-REG	85	4,015.00	341,275.00	
HOLCIM LTD	4,094	48.34	197,903.96	
SIKA AG-REG	1,561	308.80	482,036.80	
ABB LTD	16,813	32.01	538,184.13	
GEBERIT AG-REG	287	618.80	177,595.60	
Schindler Holding AG	495	214.40	106,128.00	
Schindler Holding AG	210	216.80	45,528.00	
ADECCO GROUP AG(REG)	2,699	45.36	122,426.64	
SGS SA	43	2,574.00	110,682.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	747	249.90	186,675.30	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	5,618	127.85	718,261.30	

THE SWATCH GROUP AG-B	428	289.70	123,991.60	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	40	2,168.00	86,720.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	101,400.00	101,400.00	
Lindt & Spruengli AG	16	9,955.00	159,280.00	
NESTLE SA-REGISTERED	27,763	118.00	3,276,034.00	
ALCON INC	5,297	67.78	359,030.66	
SONOVA HOLDING AG	709	304.80	216,103.20	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	134	1,463.50	196,109.00	
LONZA GROUP AG-REG	818	612.40	500,943.20	
NOVARTIS AG-REG SHS	21,262	76.75	1,631,858.50	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	7,176	344.75	2,473,926.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG	30,314	8.27	250,878.66	
JULIUS BAER GROUP LTD	3,062	58.94	180,474.28	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	252	1,242.50	313,110.00	
UBS GROUP AG	32,443	16.67	540,824.81	
Baloise Holding AG	406	154.00	62,524.00	
SWISS LIFE HOLDING AG	351	562.40	197,402.40	
SWISS RE AG	2,599	96.62	251,115.38	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,373	423.10	580,916.30	
SWISS PRIME SITE	654	87.05	56,930.70	
TEMENOS GROUP AG-REG	1,113	104.00	115,752.00	
Logitech International SA	2,360	66.38	156,656.80	
SWISSCOM AG-REG	207	515.60	106,729.20	
スイスフラン小計	175,246		15,038,006.82 (1,874,938,690)	
	銘柄数	35		
	比　率	2.9%	3.1%	
スウェーデンクローネ	株	スウェーデン クローネ	スウェーデン クローネ	
LUNDIN ENERGY AB	3,700	350.70	1,297,590.00	
BOLIDEN AB	4,029	372.10	1,499,190.90	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	7,142	152.65	1,090,226.30	
ALFA LAVAL AB	4,545	307.50	1,397,587.50	
ASSA ABLOY AB-B	9,247	246.70	2,281,234.90	
ATLAS COPCO AB-A SHS	5,878	543.80	3,196,456.40	
ATLAS COPCO AB-B SHS	4,926	470.20	2,316,205.20	
EPIROC AB-A	8,105	208.00	1,685,840.00	
EPIROC AB-B	3,996	174.70	698,101.20	
Husqvarna AB	9,322	122.00	1,137,284.00	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	18,863	85.76	1,617,690.88	
SANDVIK AB	10,919	236.30	2,580,159.70	
SKANSKA AB-B SHS	3,246	224.20	727,753.20	
SKF AB-B SHARES	5,207	204.60	1,065,352.20	
VOLVO AB-B SHS	14,638	206.70	3,025,674.60	

SECURITAS AB-B SHS	6,237	110.20	687,317.40	
EVOLUTION AB	2,355	1,137.80	2,679,519.00	
HENNES & MAURITZ AB-B	10,512	167.92	1,765,175.04	
SWEDISH MATCH AB	16,938	71.76	1,215,470.88	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	5,962	268.70	1,601,989.40	
NORDEA BANK ABP	30,256	103.46	3,130,285.76	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	18,276	116.30	2,125,498.80	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	13,691	99.12	1,357,051.92	
Swedbank AB	7,406	177.74	1,316,342.44	
EQT AB	4,093	359.60	1,471,842.80	
Industrivarden AB	210	280.00	58,800.00	
Industrivarden AB	2,933	274.90	806,281.70	
INVESTOR AB-B SHS	16,047	194.28	3,117,611.16	
KINNEVIK AB-B	3,394	262.15	889,737.10	
ERICSSON LM-B SHS	28,662	100.36	2,876,518.32	
HEXAGON AB-B SHS	23,233	118.80	2,760,080.40	
TELE2 AB-B SHS	9,158	130.10	1,191,455.80	
TELIA COMPANY AB	25,901	35.43	917,672.43	
スウェーデンクローネ小計	339,027		55,584,997.33 (683,695,467)	
	銘柄数	33		
	比　率	1.1%	1.1%	
ノルウェークローネ	株	ノルウェークローネ	ノルウェークローネ	
EQUINOR ASA	10,978	247.00	2,711,566.00	
NORSK HYDRO ASA	24,398	68.24	1,664,919.52	
YARA INTERNATIONAL ASA	961	439.10	421,975.10	
SCHIBSTED ASA-B SHS	2,691	238.00	640,458.00	
MOWI ASA	7,028	201.20	1,414,033.60	
ORKLA ASA	6,571	84.62	556,038.02	
DNB BANK ASA	7,833	202.80	1,588,532.40	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	3,437	214.10	735,861.70	
TELENOR ASA	5,179	141.10	730,756.90	
ノルウェークローネ小計	69,076		10,464,141.24 (132,789,952)	
	銘柄数	9		
	比　率	0.2%	0.2%	
デンマーククローネ	株	デンマーククローネ	デンマーククローネ	
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	1,603	527.00	844,781.00	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,833	458.00	839,514.00	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	12,061	174.00	2,098,614.00	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	32	20,480.00	655,360.00	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	67	22,000.00	1,474,000.00	

DSV A/S	2,291	1,268.00	2,904,988.00	
PANDORA A/S	987	716.00	706,692.00	
CARLSBERG AS-B	920	1,064.50	979,340.00	
COLOPLAST-B	1,066	939.40	1,001,400.40	
DEMANT A/S	2,606	279.60	728,637.60	
GENMAB A/S	821	2,146.00	1,761,866.00	
NOVO NORDISK A/S-B	17,029	608.90	10,368,958.10	
DANSKE BANK A/S	5,704	123.80	706,155.20	
TRYG A/S	3,600	157.35	566,460.00	
ORSTED A/S	2,346	707.60	1,660,029.60	
デンマーククローネ小計	52,966		27,296,795.90 (473,053,472)	
	銘柄数	15		
	比　率	0.7%	0.8%	
豪ドル	株	豪ドル	豪ドル	
AMPOL LTD	5,592	29.80	166,641.60	
SANTOS LTD	37,639	7.06	265,731.34	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	9,808	25.13	246,475.04	
BHP GROUP LIMITED	28,730	45.60	1,310,088.00	
BLUESCOPE STEEL LTD	5,300	18.48	97,944.00	
EVOLUTION MINING LTD	37,649	4.02	151,348.98	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	18,587	20.52	381,405.24	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	4,508	48.97	220,756.76	
NEWCREST MINING LIMITED	7,328	25.18	184,519.04	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	19,509	9.65	188,261.85	
ORICA LTD	10,052	14.11	141,833.72	
RIO TINTO LIMITED	3,360	107.96	362,745.60	
SOUTH32 LTD	59,750	3.94	235,415.00	
BRAMBLES LTD	10,710	10.04	107,528.40	
TRANSURBAN GROUP	34,475	12.84	442,659.00	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	7,588	41.05	311,487.40	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	42,374	5.05	213,988.70	
SEEK LTD	6,046	29.23	176,724.58	
WESFARMERS LIMITED	9,972	53.00	528,516.00	
COLES GROUP LTD	11,118	16.33	181,556.94	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	23,757	6.35	150,856.95	
WOOLWORTHS GROUP LTD	10,828	35.02	379,196.56	
TREASURY WINE ESTATES LTD	15,604	11.03	172,112.12	
COCHLEAR LIMITED	804	193.10	155,252.40	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,800	63.50	177,800.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	4,676	38.94	182,083.44	
CSL LIMITED	4,928	262.57	1,293,944.96	
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	25,528	27.77	708,912.56	

COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	17,447	97.44	1,700,035.68	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	30,132	28.17	848,818.44	
WESTPAC BANKING CORPORATION	32,897	20.80	684,257.60	
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	2,025	83.77	169,634.25	
MACQUARIE GROUP LTD	3,548	189.98	674,049.04	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	37,902	4.38	166,010.76	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	15,191	11.55	175,456.05	
SUNCORP GROUP LTD	10,983	11.23	123,339.09	
LENDLEASE GROUP	16,447	10.37	170,555.39	
BLOCK INC-CDI	1,186	166.25	197,172.50	
COMPUTERSHARE LIMITED	10,046	19.72	198,107.12	
XERO LTD	2,003	116.25	232,848.75	
TELSTRA CORP LTD	35,627	4.05	144,289.35	
APA GROUP	19,050	9.57	182,308.50	
ORIGIN ENERGY LIMITED	38,779	5.60	217,162.40	
豪ドル小計	732,283		15,019,831.10 (1,226,369,209)	
	銘柄数	43		
	比　率	1.9%	2.0%	
ニュージーランドドル	株	ニュージーランドドル	ニュージーランドドル	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	22,976	7.20	165,427.20	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	6,452	30.36	195,882.72	
RYMAN HEALTHCARE LTD	6,744	10.80	72,835.20	
SPARK NEW ZEALAND LTD	34,616	4.43	153,521.96	
MERIDIAN ENERGY LTD	30,701	4.53	139,075.53	
ニュージーランドドル小計	101,489		726,742.61 (55,486,798)	
	銘柄数	5		
	比　率	0.1%	0.1%	
香港ドル	株	香港ドル	香港ドル	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	22,828	56.45	1,288,640.60	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	16,500	133.00	2,194,500.00	
MTR CORPORATION	16,000	42.65	682,400.00	
Galaxy Entertainment Group Limited	34,000	45.95	1,562,300.00	
Sands China Ltd	57,600	21.45	1,235,520.00	
WH Group Limited	199,000	5.23	1,040,770.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	32,000	30.00	960,000.00	
HANG SENG BANK	5,600	156.20	874,720.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	13,100	473.40	6,201,540.00	
AIA GROUP LTD	124,200	88.05	10,935,810.00	
CK ASSET HOLDINGS LIMITED	19,828	53.70	1,064,763.60	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	32,403	35.05	1,135,725.15	

SINO LAND CO	75,800	9.97	755,726.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	12,000	97.05	1,164,600.00	
SWIRE PACIFIC LTD A	15,000	46.30	694,500.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	34,400	20.50	705,200.00	
HKT Trust / HKT Ltd	78,000	10.58	825,240.00	
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)	15,500	49.45	766,475.00	
CLP HOLDINGS LIMITED	10,500	78.40	823,200.00	
HONG KONG & CHINA GAS	98,589	12.18	1,200,814.02	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	10,500	48.55	509,775.00	
香港ドル小計	923,348		36,622,219.37 (536,149,291)	
	銘柄数	21		
	比　率	0.8%	0.9%	
シンガポールドル	株	シンガポールドル	シンガポールドル	
KEPPEL CORP LTD	34,000	5.40	183,600.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	39,900	3.72	148,428.00	
GENTING SINGAPORE LTD	190,900	0.76	145,084.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	20,700	35.66	738,162.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	32,700	12.30	402,210.00	
UNITED OVERSEAS BANK	13,400	30.01	402,134.00	
CITY DEVELOPMENTS	18,500	7.12	131,720.00	
UNITED OVERSEAS LAND LTD	13,100	7.27	95,237.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	122,200	2.49	304,278.00	
シンガポールドル小計	485,400		2,550,853.00 (216,465,385)	
	銘柄数	9		
	比　率	0.3%	0.4%	
イスラエルシュケル	株	イスラエル シュケル	イスラエル シュケル	
ICL GROUP LTD	13,968	30.23	422,252.64	
BANK HAPOALIM BM	11,726	32.20	377,577.20	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	10,216	32.36	330,589.76	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,004	118.60	356,274.40	
NICE LTD	738	771.00	568,998.00	
イスラエルシュケル小計	39,652		2,055,692.00 (74,136,887)	
	銘柄数	5		
	比　率	0.1%	0.1%	
合　計	株 10,980,197		円 60,486,527,162 (60,486,527,162)	

（注1）通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
（注2）合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
（注3）比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
投資証券	米ドル			米ドル	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	1,276	249,151.76	
		AMERICAN TOWER CORP	4,550	1,130,220.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,177	282,939.03	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,601	184,163.03	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	956	151,038.44	
		CROWN CASTLE INTL CORP	4,344	797,601.84	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	2,981	458,805.71	
		DUKE REALTY CORP	3,392	193,445.76	
		EQUINIX INC	942	688,451.28	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	1,368	104,487.84	
		EQUITY RESIDENTIAL	3,168	279,861.12	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	590	196,411.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,437	280,215.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	5,268	183,642.48	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	11,573	196,741.00	
		INVITATION HOMES INC	5,865	244,511.85	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,221	189,000.79	
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	969	196,513.20	
		PROLOGIS INC	7,438	1,140,319.78	
		PUBLIC STORAGE	1,432	504,250.16	
		REALTY INCOME CORP	4,691	320,911.31	
		REGENCY CENTERS CORP	2,094	148,443.66	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1,095	357,561.30	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	3,636	531,219.60	
		SUN COMMUNITIES INC	1,301	243,000.78	
		UDR INC	3,207	180,201.33	
		VENTAS INC	4,925	254,721.00	
		VICI PROPERTIES INC	8,054	221,485.00	
		VORNADO REALTY TRUST	3,147	130,348.74	
		WELLTOWER INC	4,917	422,960.34	
		WEYERHAEUSER CO	6,927	269,113.95	
		WP CAREY INC	1,872	142,066.08	
	米ドル小計		114,414	10,873,804.16 (1,239,722,412)	
		銘柄数	32		
		比　率	1.9%	85.1%	

加ドル			加ドル	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,828	104,864.16	
加ドル小計		4,828	104,864.16 (9,461,893)	
	銘柄数	1		
	比　率	0.0%	0.6%	
ユーロ			ユーロ	
	COVIVIO	894	65,601.72	
	GECINA SA	995	115,668.75	
	KLEPIERRE	3,922	90,245.22	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,917	118,068.03	
ユーロ小計		7,728	389,583.72 (50,279,674)	
	銘柄数	4		
	比　率	0.1%	3.4%	
英ポンド			英ポンド	
	BRITISH LAND CO PLC	19,511	103,135.14	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	10,751	83,255.74	
	SEGRO PLC	9,986	127,870.73	
英ポンド小計		40,248	314,261.61 (48,302,009)	
	銘柄数	3		
	比　率	0.1%	3.3%	
豪ドル			豪ドル	
	DEXUS/AU	7,207	77,619.39	
	GOODMAN GROUP	15,621	366,000.03	
	GPT GROUP	17,951	93,165.69	
	MIRVAC GROUP	44,464	122,720.64	
	SCENTRE GROUP	52,670	156,429.90	
	STOCKLAND	24,415	98,880.75	
豪ドル小計		162,328	914,816.40 (74,694,759)	
	銘柄数	6		
	比　率	0.1%	5.1%	
香港ドル			香港ドル	
	LINK REIT	18,800	1,292,500.00	
香港ドル小計		18,800	1,292,500.00 (18,922,200)	
	銘柄数	1		
	比　率	0.0%	1.3%	

	シンガポールドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	95,000	シンガポールドル 190,950.00	
	シンガポールドル小計		95,000	190,950.00 (16,204,017)	
		銘柄数	1		
		比　率	0.0%	1.1%	
投資証券合計				円 1,457,586,964 (1,457,586,964)	
合　計				円 1,457,586,964 (1,457,586,964)	

（注1）通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
（注2）合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
（注3）比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「TMA外国株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区　分	注記番号	[2021年 1月25日現在] 金額（円）	[2022年 1月25日現在] 金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		79,782,289	66,540,512
コール・ローン		772,694,601	744,000,257
株式		41,034,061,670	49,510,264,514
未収配当金		8,643,532	10,794,107
流動資産合計		41,895,182,092	50,331,599,390
資産合計		41,895,182,092	50,331,599,390
負債の部			
流動負債			
未払解約金		30,563,489	82,123,452
未払利息		424	787
流動負債合計		30,563,913	82,124,239
負債合計		30,563,913	82,124,239
純資産の部			
元本等			
元本	※1	11,737,336,215	11,842,545,070
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		30,127,281,964	38,406,930,081
元本等合計		41,864,618,179	50,249,475,151

純資産合計	41,864,618,179	50,249,475,151
負債純資産合計	41,895,182,092	50,331,599,390

(2) 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自 2021年 1月26日 至 2022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	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（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
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分		[2021年 1月25日現在]	[2022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	11,529,690,523円	11,737,336,215円
	同期中における追加設定元本額	3,774,023,029円	2,808,560,992円
	同期中における一部解約元本額	3,566,377,337円	2,703,352,137円
	同期末における元本額	11,737,336,215円	11,842,545,070円
	元本の内訳＊		
	東京海上セレクション・外国株式	8,948,310,687円	9,415,232,079円
	東京海上セレクション・バランス30	358,232,340円	295,174,460円

東京海上セレクション・バランス50	1,219,368,427円	1,034,357,849円
東京海上セレクション・バランス70	1,120,927,524円	1,001,674,930円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）	59,950,066円	75,249,226円
ＴＭＡバランス25ＶＡ〈適格機関投資家限定〉	11,136,436円	6,212,594円
ＴＭＡバランス50ＶＡ〈適格機関投資家限定〉	14,569,104円	11,223,508円
ＴＭＡバランス75ＶＡ〈適格機関投資家限定〉	4,841,631円	3,420,424円
計	11,737,336,215円	11,842,545,070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	11,737,336,215口	11,842,545,070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）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	[2021年 1月25日現在]	[2022年 1月25日現在]
1．貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）
（自 2020年1月28日　至 2021年1月25日）
売買目的有価証券

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	14,381,714,599円
合計	14,381,714,599円

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年3月24日から2021年1月25日まで)を指しております。

（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	2,820,583,323円
合計	2,820,583,323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。

（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
（2021年1月25日現在）
該当事項はありません。

（2022年1月25日現在）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

[2021年 1月25日現在]		[2022年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額	3.5668円	1口当たり純資産額	4.2431円
（1万口当たり純資産額	35,668円）	（1万口当たり純資産額	42,431円）

(3) 附属明細表
第1　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数	評価額		備　考
		単価	金額	
米ドル	株	米ドル	米ドル	
CHEVRONTEXACO CORP	15,600	127.18	1,984,008.00	
CONOCOPHILLIPS	14,100	83.02	1,170,582.00	
EOG RESOURCES INC	12,200	102.31	1,248,182.00	
EXXON MOBIL CORPORATION	33,100	72.79	2,409,349.00	
HALLIBURTON CO	12,000	28.59	343,080.00	
KINDER MORGAN INC	12,000	17.32	207,840.00	
PHILLIPS 66	4,700	82.83	389,301.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,000	206.00	618,000.00	
SCHLUMBERGER LTD	10,000	36.60	366,000.00	
BALL CORP	10,000	87.23	872,300.00	
CORTEVA INC	5,791	46.07	266,791.37	
DOW INC	5,791	56.62	327,886.42	
DUPONT DE NEMOURS INC	5,791	77.15	446,775.65	
ECOLAB INC	1,500	192.61	288,915.00	
INTERNATIONAL PAPER CO	5,000	48.23	241,150.00	
LINDE PLC	3,300	316.16	1,043,328.00	
PPG INDUSTRIES INC	2,200	155.03	341,066.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,800	298.52	537,336.00	
BOEING CO	48,900	204.20	9,985,380.00	
SUNRUN INC	36,800	27.04	995,072.00	
NIKE INC -CL B	47,300	146.00	6,905,800.00	
BRIGHT HORIZONS FAMILY SOLUTIONS INC	56,206	128.45	7,219,660.70	
ALPHABET INC-CL A	4,800	2,616.08	12,557,184.00	
ALPHABET INC-CL C	5,000	2,607.44	13,037,200.00	
META PLATFORMS INC-A	46,100	308.71	14,231,531.00	
THE WALT DISNEY CO	32,900	137.46	4,522,434.00	
AMAZON.COM INC	7,800	2,890.88	22,548,864.00	
TJX COMPANIES INC	210,800	69.06	14,557,848.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	89,600	67.61	6,057,856.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	49,600	301.79	14,968,784.00	
MEDTRONIC PLC	45,800	104.21	4,772,818.00	
TELADOC HEALTH INC	19,300	75.16	1,450,588.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	40,300	462.27	18,629,481.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,300	86.22	1,060,506.00	
MERCK & CO. INC.	68,400	78.83	5,391,972.00	
SEAGEN INC	6,800	129.55	880,940.00	
ZOETIS INC	25,200	200.07	5,041,764.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	57,000	174.86	9,967,020.00	
HDFC Bank Ltd	116,100	67.46	7,832,106.00	

SIGNATURE BANK/NEW YORK NY	12,900	314.17	4,052,793.00	
MSCI INC	24,900	507.07	12,626,043.00	
S&P GLOBAL INC	33,000	417.95	13,792,350.00	
ADOBE INC	20,700	519.66	10,756,962.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	39,000	349.42	13,627,380.00	
MICROSOFT CORP	11,900	296.37	3,526,803.00	
OKTA INC	13,000	190.90	2,481,700.00	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	55,700	13.40	746,380.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	48,700	162.17	7,897,679.00	
SALESFORCE.COM INC	63,500	223.03	14,162,405.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	30,800	201.85	6,216,980.00	
APPLE INC	30,800	161.62	4,977,896.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	4,900	89.12	436,688.00	
DOMINION ENERGY INC	4,000	78.48	313,920.00	
DUKE ENERGY CORP	10,300	102.58	1,056,574.00	
EXELON CORP	8,500	56.10	476,850.00	
NEXTERA ENERGY INC	20,400	81.92	1,671,168.00	
PPL CORPORATION	30,600	29.56	904,536.00	
SOUTHERN CO	12,200	67.37	821,914.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	33,100	116.53	3,857,143.00	
NVIDIA CORP	70,500	233.72	16,477,260.00	
Taiwan Semiconductor Manufacturing	46,500	125.96	5,857,140.00	
米ドル小計	1,810,779		322,455,263.14 (36,763,124,550)	
	銘柄数	61		
	比　率	73.2%	74.3%	
加ドル	株	加ドル	加ドル	
ENBRIDGE INC	13,000	50.87	661,310.00	
SUNCOR ENERGY INC	12,900	33.20	428,280.00	
TC ENERGY CORP	10,000	62.37	623,700.00	
DOLLARAMA INC	197,100	61.83	12,186,693.00	
加ドル小計	233,000		13,899,983.00 (1,254,195,466)	
	銘柄数	4		
	比　率	2.5%	2.5%	
ユーロ	株	ユーロ	ユーロ	
ENI SPA	25,400	12.68	322,224.40	
TOTALENERGIES SE	17,400	47.91	833,721.00	
AIR LIQUIDE	5,710	150.72	860,611.20	
AKZO NOBEL	5,333	90.08	480,396.64	
BASF SE	13,200	64.26	848,232.00	
KONINKLIJKE DSM NV	3,800	167.95	638,210.00	
SYMRISE AG	3,500	108.55	379,925.00	

AIRBUS SE	81,400	107.34	8,737,476.00	
KERRY GROUP PLC-A	15,900	111.20	1,768,080.00	
E.ON SE	50,000	11.92	596,000.00	
ENEL SPA	100,000	6.66	666,500.00	
ENGIE	8,000	13.17	105,376.00	
IBERDROLA SA	70,000	9.97	697,900.00	
ASML HOLDING NV	6,700	585.00	3,919,500.00	
ユーロ小計	406,343		20,854,152.24 (2,691,436,888)	
	銘柄数	14		
	比　率	5.4%	5.4%	
英ポンド	株	英ポンド	英ポンド	
BP PLC	140,000	3.64	509,740.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	34,500	17.47	602,784.00	
JOHNSON MATTHEY PLC	9,722	18.71	181,947.23	
ASHTEAD GROUP PLC	140,500	49.50	6,954,750.00	
DIAGEO PLC	111,800	36.72	4,105,296.00	
ASTRAZENECA PLC	90,000	83.16	7,484,400.00	
ST JAMES'S PLACE PLC	230,300	15.08	3,472,924.00	
BEAZLEY PLC	97,100	4.85	471,032.10	
NATIONAL GRID PLC	47,941	10.79	517,283.39	
英ポンド小計	901,863		24,300,156.72 (3,734,934,087)	
	銘柄数	9		
	比　率	7.4%	7.5%	
スイスフラン	株	スイスフラン	スイスフラン	
GIVAUDAN-REG	100	4,015.00	401,500.00	
NESTLE SA-REGISTERED	63,000	118.00	7,434,000.00	
LONZA GROUP AG-REG	7,100	612.40	4,348,040.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	24,900	344.75	8,584,275.00	
スイスフラン小計	95,100		20,767,815.00 (2,589,331,174)	
	銘柄数	4		
	比　率	5.2%	5.2%	
ノルウェークローネ	株	ノルウェークローネ	ノルウェークローネ	
EQUINOR ASA	45,000	247.00	11,115,000.00	
YARA INTERNATIONAL ASA	6,000	439.10	2,634,600.00	
ノルウェークローネ小計	51,000		13,749,600.00 (174,482,424)	
	銘柄数	2		
	比　率	0.3%	0.4%	
デンマーククローネ	株	デンマーククローネ	デンマーククローネ	
NOVO NORDISK A/S-B	97,800	608.90	59,550,420.00	

デンマーククローネ小計	97,800		59,550,420.00 (1,032,008,778)	
	銘柄数	1		
	比　率	2.1%	2.1%	
豪ドル	株	豪ドル	豪ドル	
BHP GROUP LIMITED	40,000	45.60	1,824,000.00	
RIO TINTO LIMITED	10,000	107.96	1,079,600.00	
CSL LIMITED	11,700	262.57	3,072,069.00	
HUB24 LTD	42,478	27.35	1,161,773.30	
豪ドル小計	104,178		7,137,442.30 (582,772,163)	
	銘柄数	4		
	比　率	1.2%	1.2%	
香港ドル	株	香港ドル	香港ドル	
Ping An Insurance Group Co	718,000	65.45	46,993,100.00	
香港ドル小計	718,000		46,993,100.00 (687,978,984)	
	銘柄数	1		
	比　率	1.4%	1.4%	
合　計	株 4,418,063		円 49,510,264,514 (49,510,264,514)	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2) 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
(注3) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2)株式以外の有価証券
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
該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2022年1月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	2,740,293,892 円
Ⅱ　負債総額	1,343,243 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,738,950,649 円
Ⅳ　発行済数量	2,159,848,495 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2681 円

（ご参考：親投資信託の現況）

ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド

2022年1月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	22,128,361,051 円
Ⅱ　負債総額	216,192,468 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	21,912,168,583 円
Ⅳ　発行済数量	17,042,255,389 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2858 円

ＴＭＡ日本債券マザーファンド

2022年1月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	93,645,304,417 円
Ⅱ　負債総額	943,245,055 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	92,702,059,362 円
Ⅳ　発行済数量	65,930,101,264 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4061 円

東京海上・ＪＰＸ日経400インデックスマザーファンド

2022年1月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	4,937,233,605 円
Ⅱ　負債総額	855,098,214 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,082,135,391 円
Ⅳ　発行済数量	2,099,220,477 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9446 円

ＴＭＡ日本株アクティブマザーファンド

2022年1月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	76,994,188,378 円
Ⅱ　負債総額	265,622,894 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	76,728,565,484 円
Ⅳ　発行済数量	35,939,692,498 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1349 円

ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド

2022年1月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	10,283,792,523 円
Ⅱ　負債総額	31,416,749 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,252,375,774 円
Ⅳ　発行済数量	5,948,591,423 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7235 円

ＴＭＡ外国債券マザーファンド

2022年1月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	27,537,199,018 円
Ⅱ　負債総額	667,813,586 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	26,869,385,432 円
Ⅳ　発行済数量	10,757,898,440 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4976 円

ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド

2022年1月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	67,635,453,766 円
Ⅱ　負債総額	2,609,732,622 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	65,025,721,144 円
Ⅳ　発行済数量	16,573,461,620 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.9235 円

ＴＭＡ外国株式マザーファンド

2022年1月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	51,058,326,527 円
Ⅱ　負債総額	132,004,491 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	50,926,322,036 円
Ⅳ　発行済数量	11,823,531,007 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.3072 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
① 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。
② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。
③ 上記①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た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】

2022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。

①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。
②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。
③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。
④売買の執行はトレーディング部が行います。
⑤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。
⑥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。

2022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	172	2,826,801
単位型公社債投資信託	2	5,091
単位型株式投資信託	11	39,129
合計	185	2,871,022

3【委託会社等の経理状況】

１．当社の財務諸表は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第２条により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第36期事業年度（2020年４月１日から2021年３月31日まで）の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人により監査を受けております。
また、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、当中間会計期間（2021年４月１日から2021年９月30日まで）の中間財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

（単位：千円）

	第35期 （2020年３月31日現在）		第36期 （2021年３月31日現在）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		19,928,671		22,550,090
前払費用		207,883		235,902
未収委託者報酬		2,864,007		2,973,733
未収収益		2,126,212		2,375,688
未収入金		101,676		3,865
その他の流動資産		22,090		21,479
流動資産計		25,250,541		28,160,759
固定資産				
有形固定資産	＊1	576,200	＊1	530,601
建物		388,342		354,556
器具備品		187,858		176,045
無形固定資産		5,385		137,430
電話加入権		3,795		3,795
ソフトウエア		-		89,839
ソフトウエア仮勘定		1,590		43,795
投資その他の資産		2,987,389		3,057,965
投資有価証券		65,610		49,477
関係会社株式		1,673,049		1,673,049
その他の関係会社有価証券		31,200		71,200
長期前払費用		32,906		45,424
敷金		450,632		474,324
その他長期差入保証金		10,030		10,030
繰延税金資産		723,961		734,459
固定資産計		3,568,975		3,725,997
資産合計		28,819,517		31,886,757
負債の部				
流動負債				
未払金		2,555,940		2,979,963
未払手数料		1,315,027		1,349,326
その他未払金		1,240,912		1,630,636
未払費用		544,639		429,654
未払消費税等		367,506		468,610
未払法人税等		1,347,000		1,378,000
預り金		43,576		45,524
前受収益		3,128		2,329
賞与引当金		244,679		273,836
その他の流動負債		-		946
流動負債計		5,106,470		5,578,864
固定負債				
退職給付引当金		750,413		802,176
固定負債計		750,413		802,176
負債合計		5,856,883		6,381,041
純資産の部				
株主資本		22,965,811		25,499,322
資本金		2,000,000		2,000,000
資本剰余金		400,000		400,000
その他資本剰余金		400,000		400,000
利益剰余金		20,565,811		23,099,322
利益準備金		500,000		500,000
その他利益剰余金		20,065,811		22,599,322
特別償却準備金		0		0
繰越利益剰余金		20,065,811		22,599,322

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

(2)【損益計算書】

（単位：千円）

	第35期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）		第36期 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	
営業収益				
委託者報酬		16,536,369		17,997,091
運用受託報酬		9,077,029		9,745,973
投資助言報酬		60,786		59,827
その他営業収益		412,354		453,173
営業収益計		26,086,540		28,256,066
営業費用				
支払手数料		7,818,291		8,444,858
広告宣伝費		254,153		233,667
調査費		5,425,141		6,150,198
調査費		2,525,312		2,540,308
委託調査費		2,899,828		3,609,889
委託計算費		122,584		118,443
営業雑経費		285,550		278,728
通信費		35,052		44,106
印刷費		205,117		189,670
協会費		24,696		26,080
諸会費		12,157		10,102
図書費		8,525		8,768
営業費用計		13,905,720		15,225,895
一般管理費				
給料		3,509,999		3,799,821
役員報酬		112,566		129,108
給料・手当		2,541,727		2,761,131
賞与		855,706		909,581
交際費		17,797		4,415
寄付金		5,833		3,449
旅費交通費		174,094		13,735
租税公課		164,117		170,294
不動産賃借料		375,694		375,691
退職給付費用		466,387		156,614
賞与引当金繰入		244,679		273,836
固定資産減価償却費		118,517		139,782
法定福利費		580,893		596,481
福利厚生費		9,971		10,114
諸経費		482,967		394,336
一般管理費計		6,150,953		5,938,574
営業利益		6,029,866		7,091,595
営業外収益				
受取利息		434		455
受取配当金	＊１	4,704	＊１	7,512
匿名組合投資利益	＊１	39,334	＊１	60,878
雑益		10,094		9,958
営業外収益計		54,568		78,804
営業外費用				
為替差損		15,577		44,450
雑損		5,174		5,811
営業外費用計		20,752		50,261
経常利益		6,063,682		7,120,138

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

(3)【株主資本等変動計算書】

第35期（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

（単位：千円）

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

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

第36期（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		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	
					特別償却準備金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	0	20,065,811
当期変動額						
剰余金の配当						△ 2,403,708
特別償却準備金の取崩					△ 0	0
当期純利益						4,937,219
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	△ 0	2,533,511
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	0	22,599,322

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
	利益剰余金合計				
当期首残高	20,565,811	22,965,811	△ 3,177	△ 3,177	22,962,634
当期変動額					
剰余金の配当	△ 2,403,708	△ 2,403,708			△ 2,403,708
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	4,937,219	4,937,219			4,937,219
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			9,570	9,570	9,570
当期変動額合計	2,533,511	2,533,511	9,570	9,570	2,543,081
当期末残高	23,099,322	25,499,322	6,393	6,393	25,505,715

注記事項

（重要な会計方針）

第36期
自　2020年４月１日
至　2021年３月31日

１．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券

移動平均法による原価法

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法
（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価を把握することが極めて困難と認められるもの

移動平均法による原価法

２．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、2016年４月１日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。また、取得価額が10万円以上20万円未満の少額減価償却資産については、一括償却資産として３年間で均等償却する方法を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウエアについては、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。

① 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。

② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

４．消費税等の会計処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

（重要な会計上の見積り）

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

（未適用の会計基準等）

第36期 自　2020年４月１日 至　2021年３月31日
・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号　平成30年３月30日） ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号　平成30年３月30日） (1) 概要 収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の５つのステップを適用し認識されます。 ステップ1 ： 顧客との契約を識別する。 ステップ2 ： 契約における履行義務を識別する。 ステップ3 ： 取引価格を算定する。 ステップ4 ： 契約における履行義務に取引価格を配分する。 ステップ5 ： 履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。 (2) 適用予定日 2022年３月期の期首より適用予定であります。 (3) 当該会計基準等の適用による影響 影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（貸借対照表関係）

第35期 2020年３月31日現在	第36期 2021年３月31日現在
＊１．有形固定資産の減価償却累計額は次のとおりであります。 建物　114,303千円 器具備品　364,003千円	＊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 器具備品　458,314千円

（損益計算書関係）

第35期 自　2019年４月１日 至　2020年３月31日	第36期 自　2020年４月１日 至　2021年３月31日
＊１．関係会社との主な取引高は次のとおりであります。 関係会社からの受取配当金　2,400千円 関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配　39,334千円	＊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 関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配　60,878千円

（株主資本等変動計算書関係）

第35期（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

１．発行済株式に関する事項

（単位：株）

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

２．配当に関する事項

(1)　配当金支払額

2019年６月28日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

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

(2)　基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2020年６月26日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

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

第36期（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

１．発行済株式に関する事項

（単位：株）

株式の種類	2020年４月１日現在	増加	減少	2021年３月31日現在
普通株式	38,300	-	-	38,300

２．配当に関する事項

(1) 配当金支払額

2020年６月26日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	**2,403,708千円**
(ロ) １株当たり配当額	**62,760円**
(ハ) 基準日	**2020年３月31日**
(ニ) 効力発生日	**2020年６月26日**

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2021年６月30日の定時株主総会において、次のとおり配当を提案する予定であります。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	**4,937,214千円**
(ロ) 配当の原資	**繰越利益剰余金**
(ハ) １株当たり配当額	**128,909円**
(ニ) 基準日	**2021年３月31日**
(ホ) 効力発生日	**2021年６月30日**

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

第35期 **自　2019年４月１日** **至　2020年３月31日**	**第36期** **自　2020年４月１日** **至　2021年３月31日**
(1) 金融商品に対する取組方針 **当社の資本は本来の事業目的のために使用することを基本とし、資産の運用に際しては、資産運用リスクを極力最小限に留めることを基本方針としております。**	**(1) 金融商品に対する取組方針** **同左**
(2) 金融商品の内容及びそのリスク **営業債権である未収収益は顧客の信用リスクに晒されており、未収委託者報酬は市場リスクに晒されております。投資有価証券は、主にファンドの自己設定に関連する投資信託であり、基準価額の変動リスクに晒されております。** **営業債務である未払金は、ほとんど１年以内の支払期日であり、流動性リスクに晒されております。**	**(2) 金融商品の内容及びそのリスク** **同左**
(3) 金融商品に係るリスク管理体制 **① 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** **① 信用リスク** **同左**
② 市場リスク **未収委託者報酬には、運用資産の悪化から回収できず当社が損失を被るリスクが存在しますが、過去の回収実績からリスクは僅少であると判断しております。** **投資有価証券については、管理部門において定期的に時価を把握する体制としております。**	**② 市場リスク** **同左**
③ 流動性リスク **当社は、日々資金残高管理を行っており流動性リスクを管理しております。**	**③ 流動性リスク** **同左**

２．金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：千円）

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

(＊)負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

（単位：千円）

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

(＊)負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

第35期 2020年３月31日現在	第36期 2021年３月31日現在

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

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

（注3）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

（注4）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

第35期（2020年３月31日現在）

（単位：千円）

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

第36期（2021年３月31日現在）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

第35期 2020年３月31日現在	第36期 2021年３月31日現在

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

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額　子会社株式1,640,302千円、関連会社株式32,747千円）並びにその他の関係会社有価証券（貸借対照表計上額　31,200千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

２．その他有価証券

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
①貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 証券投資信託	32,071	27,816	4,254
②貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 証券投資信託	33,538	42,372	△8,834
合計	65,610	70,189	△4,579

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。

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

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。

２．その他有価証券

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
①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
②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

３．当事業年度中に売却したその他有価証券

同左

（退職給付関係）

第35期
自　2019年４月１日
至　2020年３月31日

１．採用している退職給付制度の概要

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。

当社は当事業年度より退職給付債務の計算方法を簡便法から原則法に変更しております。

２．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

割引率	0.4%

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、66,184千円であります。

第36期
自　2020年４月１日
至　2021年３月31日

１．採用している退職給付制度の概要

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

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

２．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

割引率	0.4%

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、73,196千円であります。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第35期 （2020年３月31日現在）	第36期 （2021年３月31日現在）
繰延税金資産		
退職給付引当金	229,776千円	245,626千円
未払金	3,802千円	3,859千円
賞与引当金	74,920千円	83,848千円
未払法定福利費	9,935千円	10,817千円
未払事業所税	3,672千円	3,840千円
未払事業税	70,737千円	81,915千円
未払調査費	82,822千円	79,792千円
減価償却超過額	124,870千円	86,208千円
繰延資産超過額	3,293千円	6,297千円
未払確定拠出年金	1,666千円	1,901千円

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

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

第35期 （2020年３月31日現在）	第36期 （2021年３月31日現在）
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。	同左

（セグメント情報等）

第35期 自　2019年４月１日 至　2020年３月31日	第36期 自　2020年４月１日 至　2021年３月31日
[セグメント情報] 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。	[セグメント情報] 同左

[関連情報] 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。 ２．地域ごとの情報 (1) 営業収益 （単位：千円） 日本 | その他 | 合計 23,387,535 | 2,699,004 | 26,086,540 (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 (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） (2) 委託者報酬 5,339,902千円 (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	[関連情報] １．製品及びサービスごとの情報 同左 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。 (2) 有形固定資産 同左 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） (2) 委託者報酬 5,399,003千円 (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

(関連当事者情報)

第35期（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

１．関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

重要な取引はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要な取引はありません。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

重要な取引はありません。

(4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

重要な取引はありません。

２．親会社又は重要な関連会社に関する情報

(1) 親会社情報

東京海上ホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

重要な関連会社はありません。

第36期（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

１．関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

重要な取引はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
重要な取引はありません。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等
重要な取引はありません。

(4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
重要な取引はありません。

２．親会社又は重要な関連会社に関する情報

(1) 親会社情報
東京海上ホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報
重要な関連会社はありません。

（１株当たり情報）

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

	第36期 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
１株当たり純資産額	665,945円58銭
１株当たり当期純利益金額	128,909円11銭

なお、潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注）１株当たり純資産額の算定上の基礎

貸借対照表の純資産の部の合計額	25,505,715千円
純資産の部の合計額から控除する金額	－
普通株式に係る当期末の純資産額	25,505,715千円
１株当たり純資産額の算定に用いられた当期末の普通株式の数	38,300株

１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎

損益計算書上の当期純利益金額	4,937,219千円
普通株主に帰属しない金額	－
普通株式に係る当期純利益金額	4,937,219千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

中間財務諸表
中間貸借対照表

（単位：千円）

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

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

中間損益計算書

（単位：千円）

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

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

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30日）

（単位：千円）

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

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
	利益剰余金合計				
当期首残高	23,099,322	25,499,322	6,393	6,393	25,505,715
当中間期変動額					
剰余金の配当	△ 4,937,214	△ 4,937,214			△ 4,937,214
特別償却準備金の取崩	-	-			-
中間純利益	2,255,055	2,255,055			2,255,055
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）			△ 338	△ 338	△ 338

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

注記事項

（重要な会計方針）

当中間会計期間
自　2021年４月１日
至　2021年９月30日

１．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券

移動平均法による原価法

(2) その他有価証券

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

２．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、2016年４月１日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。また、取得価額が10万円以上20万円未満の少額減価償却資産については、一括償却資産として３年間で均等償却する方法を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウエアについては、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、支給見込額の当中間会計期間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。

① 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。

② 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。

（会計方針の変更）

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

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間
自　2021年４月１日
至　2021年９月30日

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首（株）	当中間会計期間増加（株）	当中間会計期間減少（株）	当中間会計期間末（株）
普通株式	38,300	-	-	38,300

２．配当に関する事項

配当金支払額
2021年６月30日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。
・普通株式の配当に関する事項
（イ） 配当金の総額・・・・・・・・・・4,937,214千円
（ロ） １株当たり配当額・・・・・・・・128,909円
（ハ） 基準日・・・・・・・・・・・・・2021年３月31日
（ニ） 効力発生日・・・・・・・・・・・2021年６月30日

（金融商品関係）
当中間会計期間（2021年９月30日現在）
１．金融商品の時価等に関する事項
2021年９月30日現在における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

（単位：千円）

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

（＊１）以下の金融商品については、現金であること、及び短期で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。
現金・預金
未収委託者報酬
未収収益
未収入金
預り金
未払金
未払費用

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

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

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

２．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項
金融商品の時価を時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の３つのレベルに分類しております。

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

(1)時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

（単位：千円）

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

資産計	-	46,790	-	46,790

(2)時価で中間貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

（単位：千円）

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

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

投資有価証券

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

敷金

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

（有価証券関係）

当中間会計期間（2021年９月30日現在）

その他有価証券

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

(収益認識関係)

１．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30日）

（単位：千円）

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

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

顧客との契約から生じた債権等

（単位：千円）

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

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30日）

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

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

[関連情報]

当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30日）

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

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

(注)　営業収益は顧客の所在地を基準とし、国ごとに分類しております。

(2) 有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

（１株当たり情報）

当中間会計期間 自　2021年４月１日 至　2021年９月30日	
１株当たり純資産額	595,906円49銭
１株当たり中間純利益金額	58,878円73銭

なお、潜在株式調整後１株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（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	22,823,218千円
純資産の部の合計額から控除する金額	－
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額	22,823,218千円
１株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数	38,300株

１株当たり中間純利益金額の算定上の基礎

中間損益計算書上の中間純利益金額	2,255,055千円
普通株主に帰属しない金額	－
普通株式に係る中間純利益金額	2,255,055千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

4【利害関係人との取引制限】

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

①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。)。

②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。)。

③通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤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。

④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。

⑤上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

・名称　　三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社
（再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）

・資本金の額　324,279百万円（2021年９月末日現在）

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

<参考情報：再信託受託会社の概要>

・名称　　日本マスタートラスト信託銀行株式会社

・資本金の額　10,000百万円（2021年９月末日現在）

・事業の内容　銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額（※）	事業の内容
株式会社ＳＢＩ証券	48,323百万円	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。
松井証券株式会社	11,945百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社池田泉州銀行	61,385百万円	
株式会社西日本シティ銀行	85,745百万円	
株式会社山形銀行	12,008百万円	
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

（※）2021年９月末日現在。

２【関係業務の概要】

受託会社は、信託財産の保管・管理等を行います。また、当ファンドにかかる信託事務の一部につき日本マスタートラスト信託銀行株式会社に委託することがあります。
販売会社は、募集・販売の取扱い、一部解約事務および収益分配金・解約金・償還金の支払い等を行います。

３【資本関係】

資本関係はありません。

第３【その他】

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

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年６月３日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　奈良昌彦　㊞

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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント株式会社の2020年４月１日から2021年３月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント株式会社の2021年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
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．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2022年３月９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・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）の2021年１月26日から2022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・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）の2022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。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2021年12月３日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　奈　良　昌　彦

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　久　保　直　毅

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント株式会社の2021年４月１日から2022年３月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2021年４月１日から2021年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以　上

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

２．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。