

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2023年10月25日
【発行者名】	東京海上アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 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】	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	上限 各1兆円
【縦覧に供する場所】	該当なし

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

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

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

当初の1口当たり元本は1円です。

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

各1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

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

委託会社のお問い合わせ先（以下「委託会社サービスデスク」といいます。）

東京海上アセットマネジメント サービスデスク

0120-712-016（土日祝日・年末年始を除く9時～17時）

(5)【申込手数料】

申込時の手数料はありません。

(6)【申込単位】

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

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

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

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

(7)【申込期間】

2023年10月26日から2024年4月25日まで

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

(8)【申込取扱場所】

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

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

申込金は、お申込みの販売会社にお支払いください。

(11)【振替機関に関する事項】

当ファンドの受益権の振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

該当ありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

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

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

基本的性格

当ファンドは、追加型投信／内外／資産複合に属します。

当ファンドの商品分類表および属性区分表は、以下の通りです。

商品分類表

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

属性区分表

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

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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

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

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

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

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

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

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

信託金の限度額

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

ファンドの特色

1

主として、以下のマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内外の株式および債券に分散投資を行います。

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

- 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

2

当初設定時は以下の資産配分比率を参考にポートフォリオを構築します。

<当初設定時>

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

次ページへ続く

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

3

資産配分比率は、原則として以下の方針で1年ごとに変更します。

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

<2023年4月時点>

ファンド	資産配分比率			
	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	30%	30%	30%	10%
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	32%	26%	32%	10%
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	33%	24%	33%	10%
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	35%	20%	35%	10%

<ターゲットイヤーの10年前>

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

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

次ページへ続く

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

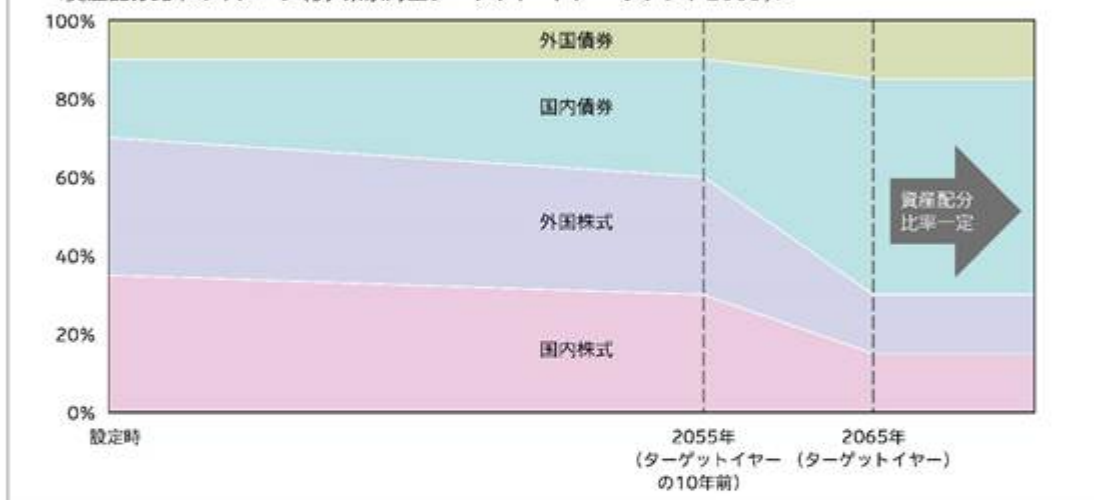
4

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

<ターゲットイヤーの資産配分比率見直し実施日以降>

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

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



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

<各マザーファンドが対象とする指数について>

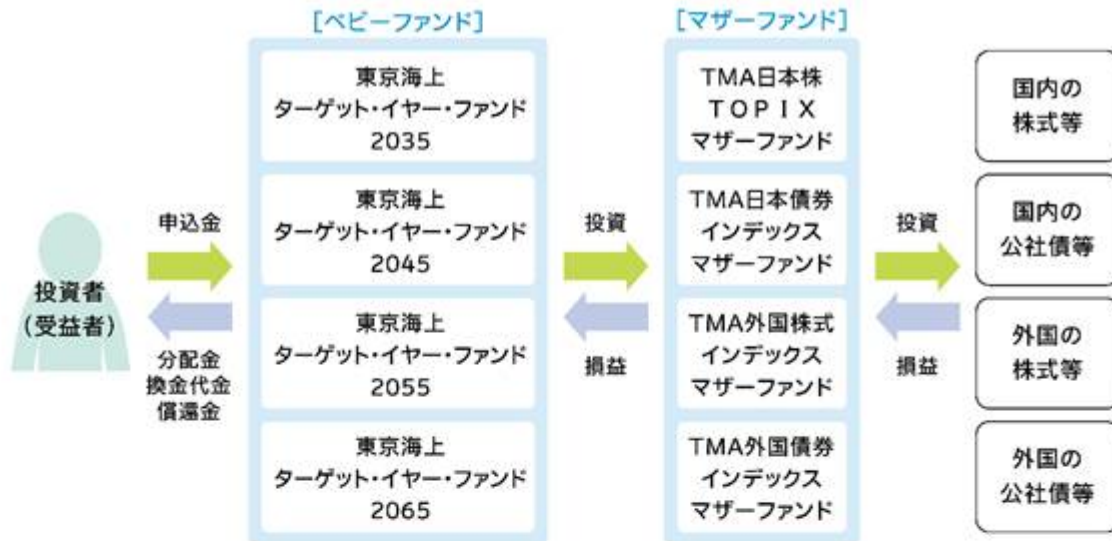
- 配当込みTOPIX(以下「TOPIX(配当込み)」といいます)は、株式会社J P X総研が算出する株価指数であり、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。TOPIX(配当込み)の指数値およびTOPIX(配当込み)にかかる標準または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIX(配当込み)に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX(配当込み)にかかる標準または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、TOPIX(配当込み)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。
- NOMURA-BPI(総合)とは、野村フィューチャー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下、NFRCといいます)が公表する日本の公算債券流通市場全体の動向を的確に表す代表的な指標です。NOMURA-BPIは、NFRCの知的財産です。NFRCは、ファンドの運用成績等に関し、一切責任ありません。
- 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。
- FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

次ページへ続く

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

ファンドの仕組み

- ファミリーファンド方式により運用を行います。



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

主な投資制限

株 式	株式への実質投資割合には制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
デリバティブ等	デリバティブ取引等は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

次ページへ続く


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

分配方針

◎年1回決算を行います。

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

《イメージ図》

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

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

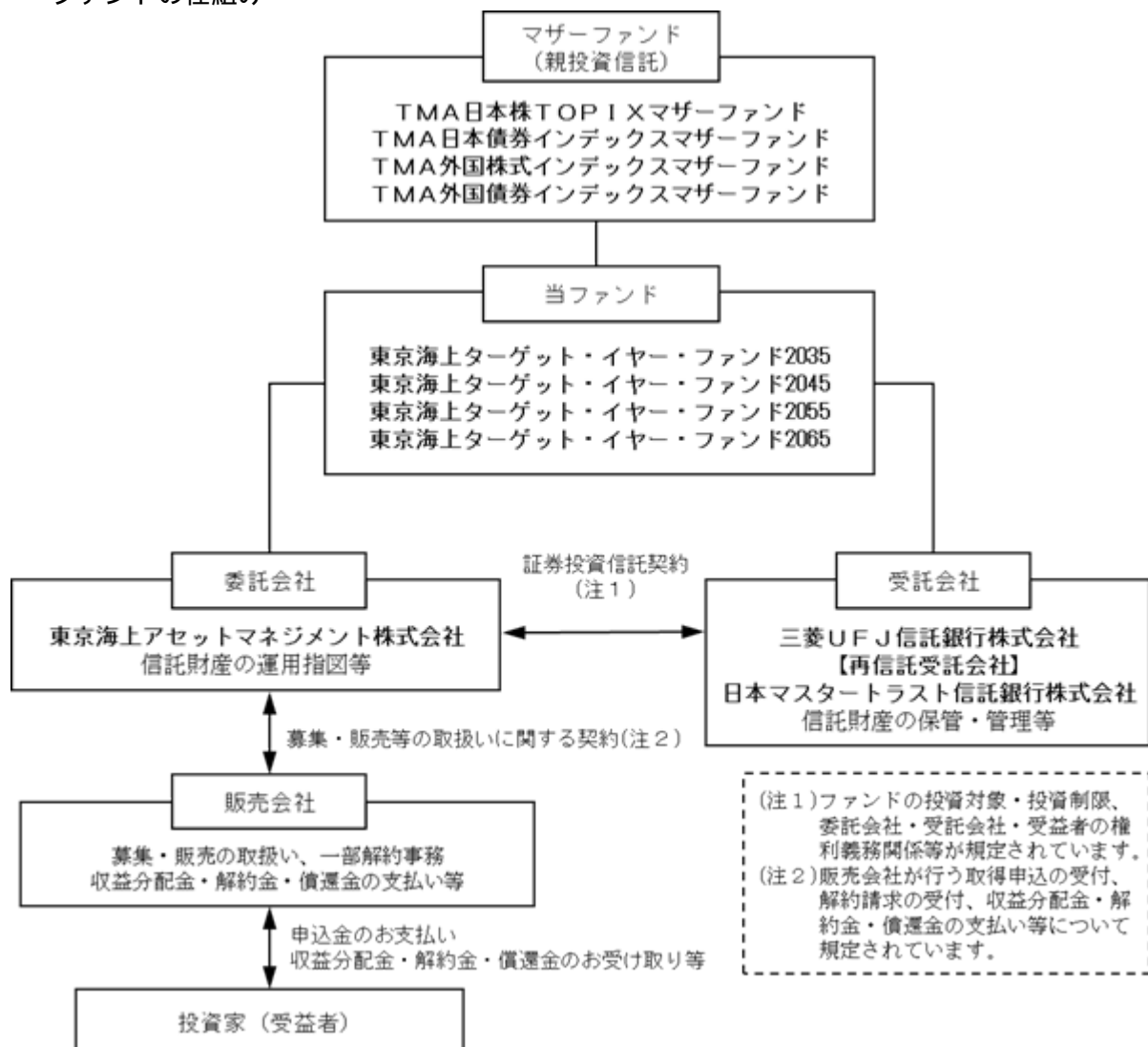
資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2019年9月20日 ファンドの設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



委託会社の概況

- ・名称 東京海上アセットマネジメント株式会社
- ・資本金の額 20億円（2023年7月末日現在）
- ・会社の沿革
 - 1985年12月 東京海上グループ（現：東京海上日動グループ）等の出資により、資産運用ビジネスの戦略的位置付けで、東京海上エム・シー投資顧問株式会社の社名にて資本金2億円で設立
 - 1987年2月 投資顧問業者として登録
 - 同年6月 投資一任業務認可取得
 - 1991年4月 国内および海外年金の運用受託を開始
 - 1998年5月 東京海上アセットマネジメント投信株式会社に社名変更し、投資信託法上の委託会社としての免許取得
 - 2007年9月 金融商品取引業者として登録
 - 2014年4月 東京海上アセットマネジメント株式会社に社名変更
 - 2016年10月 東京海上不動産投資顧問株式会社と合併

・大株主の状況（2023年7月末日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

1．基本方針

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

2．運用方法

(1) 主要投資対象

主として以下のマザーファンド受益証券に投資します。なお、有価証券等の資産に直接投資することがあります。

TMA日本株TOPIXマザーファンド
 TMA日本債券インデックスマザーファンド
 TMA外国株式インデックスマザーファンド
 TMA外国債券インデックスマザーファンド

(2) 投資態度

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

主として、以下の各指数に連動する投資成果をめざして運用を行う各マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式および債券に分散投資を行います。

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

当初設定時は以下の資産配分比率を参考にポートフォリオを構築します。

国内株式：31%

国内債券：28%

海外株式：31%

海外債券：10%

資産配分比率は、原則として以下の方針で1年ごとに変更します。

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

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

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

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

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

主として、以下の各指数に連動する投資成果をめざして運用を行う各マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式および債券に分散投資を行います。

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

当初設定時は以下の資産配分比率を参考にポートフォリオを構築します。

国内株式：32%

国内債券：26%

海外株式：32%

海外債券：10%

資産配分比率は、原則として以下の方針で1年ごとに変更します。

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

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

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

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

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

主として、以下の各指数に連動する投資成果をめざして運用を行う各マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式および債券に分散投資を行います。

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

当初設定時は以下の資産配分比率を参考にポートフォリオを構築します。

国内株式：34%

国内債券：22%

海外株式：34%

海外債券：10%

資産配分比率は、原則として以下の方針で1年ごとに変更します。

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

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

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

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

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

主として、以下の各指数に連動する投資成果をめざして運用を行う各マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式および債券に分散投資を行います。

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

当初設定時は以下の資産配分比率を参考にポートフォリオを構築します。

国内株式：35%

国内債券：20%

海外株式：35%

海外債券：10%

資産配分比率は、原則として以下の方針で1年ごとに変更します。

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

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

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

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

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

<参考情報> マザーファンドの運用の基本方針、主な投資対象と投資制限（要約）**TMA日本株TOPIXマザーファンド****1. 基本方針**

TOPIX（配当込み）に連動する投資成果の達成を目標とします。

2. 運用方法**(1) 投資対象**

TOPIXに採用されている銘柄を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

TOPIXに採用されている銘柄を中心に、TOPIX（配当込み）との連動性を考慮し組入を行います。流動性、機動性、コストなどの観点から、株価指数先物取引を行うことがあります。

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

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

3. 運用制限

(1) 株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

TMA日本債券インデックスマザーファンド**1．基本方針**

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

2．運用方法**(1) 投資対象**

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

3．運用制限

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

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

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

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

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

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

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

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

TMA外国株式インデックスマザーファンド**1．基本方針**

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

2．運用方法**(1) 投資対象**

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行いません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利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。

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

3．運用制限

(1) 株式への投資割合には、制限を設けません。

(2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

TMA外国債券インデックスマザーファンド**1. 基本方針**

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

2. 運用方法**(1) 投資対象**

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

3. 運用制限

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

(2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

「TMA日本債券インデックスマザーファンド」の運用にあたっては、層化抽出法を用いて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。

「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（配当込み、円ヘッジなし・円ベース）に連動するようポートフォリオを構築します。

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

(2)【投資対象】

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

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

有価証券

デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限り、）

金銭債権（ に掲げるものに該当するものを除きます。 ）

約束手形（金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。 ）

(2) 次に掲げる特定資産以外の資産

為替手形

2. 委託会社は、信託金を、主として東京海上アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社として締結された「TMA日本株TOPIXマザーファンド」、「TMA日本債券インデックスマザーファンド」、「TMA外国株式インデックスマザーファンド」、「TMA外国債券インデックスマザーファンド」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。

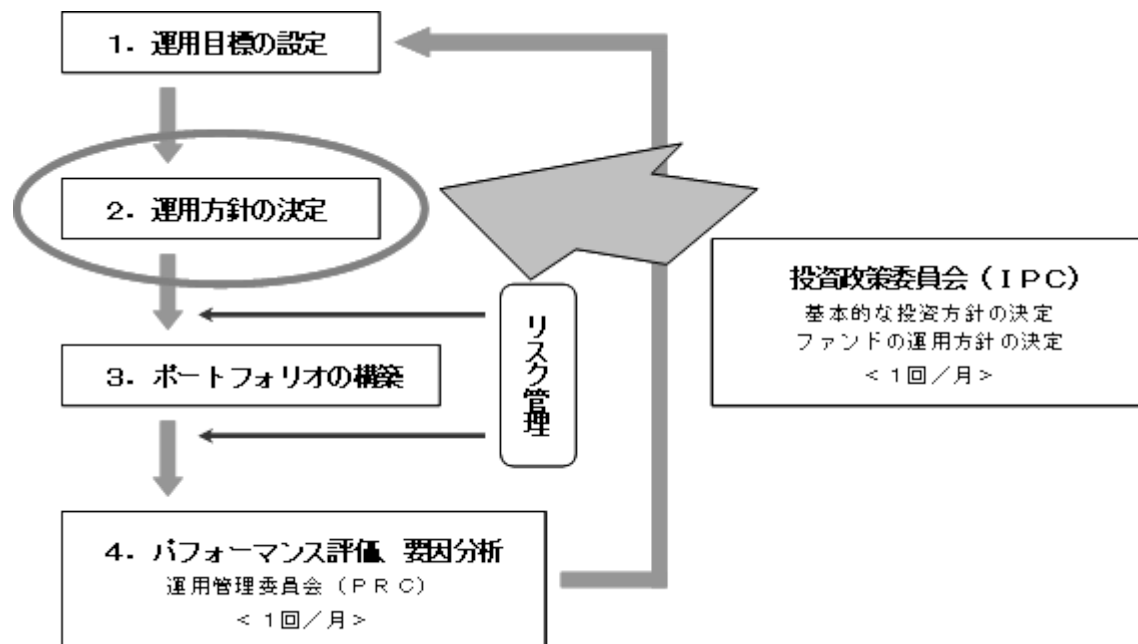
3. 委託会社は、信託金を、上記2.に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

- (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、2023年7月末日現在）

(4) 【配分方針】

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

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

信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- 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。

計算期末において信託財産に損失が生じた場合は、次期に繰越します。

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

に、お支払いします。なお、「分配金再投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5)【投資制限】

運用の基本方針に基づく制限(約款別紙「運用の基本方針」)

- a. 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る株式等が転換等により投資信託証券に該当することとなった投資信託証券を除きます。)の時価総額とマザーファンドに属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
 - e. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
 - f. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
 - g. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
 - h. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
 - i. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
- 投資する株式等の範囲(約款)
- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 - b. 上記a.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- 信用取引(約款)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡または買戻により行うことの指図をすることができるものとします。
 - b. 上記a.の信用取引の指図は、当該売付にかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付にかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の売付にかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。
- 先物取引等(約款)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、日本国内の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所にお

けるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

- b. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、日本国内の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- c. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、日本国内の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引(約款)

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

金利先渡取引および為替先渡取引(約款)

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

デリバティブ取引等に係る投資制限(約款)

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

有価証券の貸付(約款)

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

有価証券の空売(約款)

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

有価証券の借入(約款)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入の指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入を行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. 上記a.の借入の指図は、当該借入にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うことができるものとします。

- c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の借入にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- d. 上記a.の借入にかかる品借料は信託財産中から支弁します。
- 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款)
外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 外国為替予約取引(約款)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. 上記a.の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により上記b.の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内にその超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- 信用リスク集中回避のための投資制限(約款)
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 資金の借入(約款)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

3【投資リスク】

1. 投資リスク

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

(1) 価格変動リスク

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

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

投資信託は預貯金や保険と異なります。

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

株価変動リスク

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

金利変動リスク

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

信用リスク

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

為替変動リスク

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

カントリーリスク

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

流動性リスク

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

(2) デリバティブ取引のリスク

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

2. その他の留意事項

(1) 一般的な留意事項

投資信託は、その商品性格から次の特徴をご理解のうえご購入ください。

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

(2) 法令・税制・会計等の変更可能性

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

(3) その他の留意点

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

一部解約金、収益分配金および償還金の支払は全て販売会社を通じて行われます。

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

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

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

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

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

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

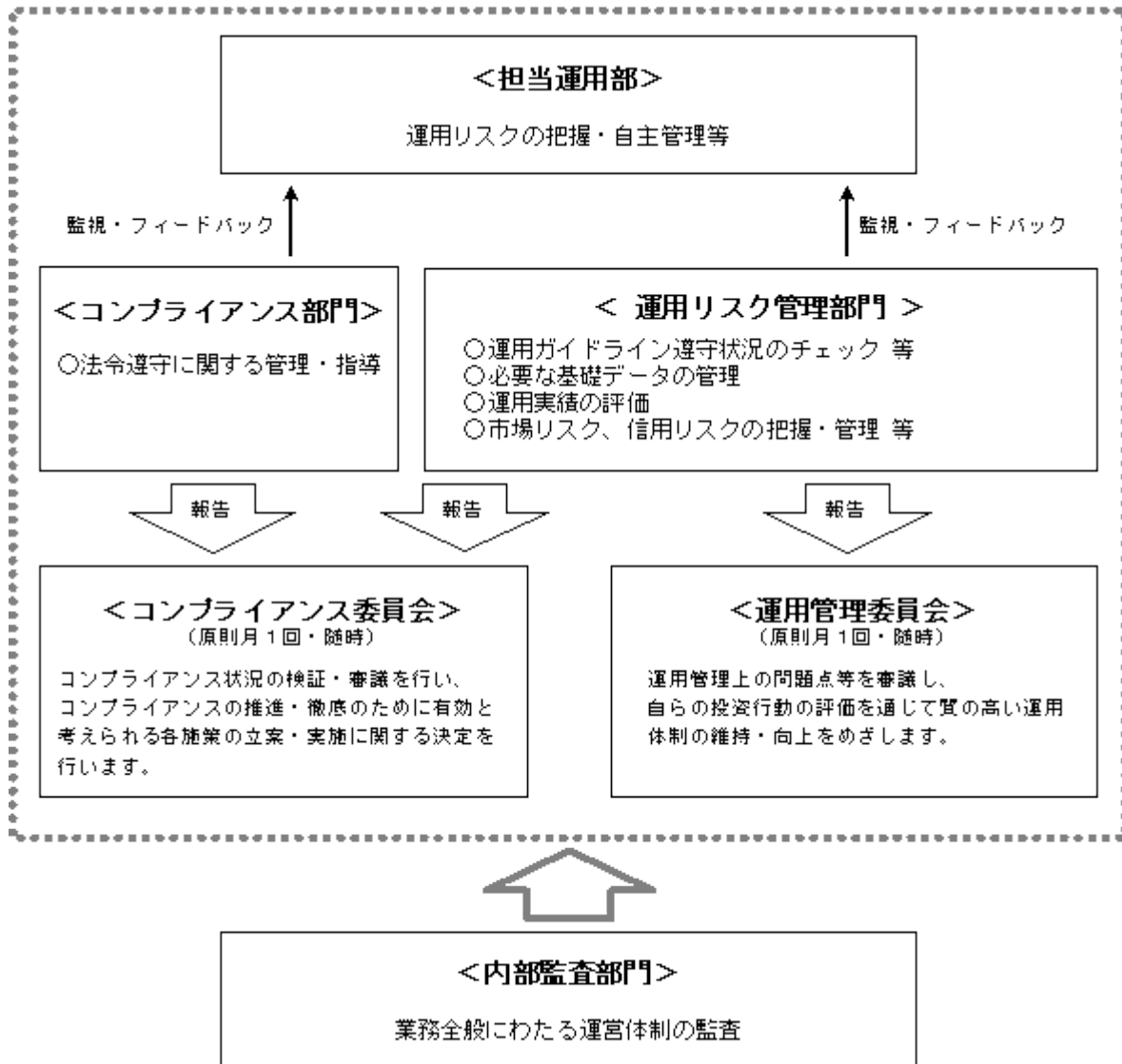
3. 管理体制

<リスク管理体制>

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

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

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



<流動性リスク管理>

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

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

参考情報

2018年8月～2023年7月

ファンドの年間騰落率および
分配金再投資基準価額の推移

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

ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較

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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035



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

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

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

※ファンドは2020年9月以降の年間騰落率を用いています。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045



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

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

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

※ファンドは2020年9月以降の年間騰落率を用いています。

次ページへ続く

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055



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

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

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

※ファンドは2020年9月以降の年間騰落率を用いています。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065



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

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

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

※ファンドは2020年9月以降の年間騰落率を用いています。

次ページへ続く

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

代表的な資産クラスと指数名

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

指数について

●TOPIXの指数値およびTOPIXにかかる標準または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下、J P Xといいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXにかかる標準または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。 ●MSCIコクサイ指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。 ●MSCIエマージング・マーケット・インデックスの著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。 ●NOMURA-BPI (国債) に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。 ●FTSE世界国債インデックスは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 ●JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

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

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込時の手数料はありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金時（解約時）の手数料はありません。

(3)【信託報酬等】

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

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

信託報酬率およびその配分（税抜）については以下の通りとします。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

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

*1 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価

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

*3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

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

*1 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価

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

*3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

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

* 1 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価

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

* 3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

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

* 1 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価

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

* 3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

(5)【課税上の取扱い】

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

< 個人の受益者に対する課税 >

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

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

解約時および償還時の差益（解約時および償還時の価額から取得費（申込手数料（税込）を含む）を控除した差額）は、その全額が譲渡所得等の金額とみなされ課税対象となります。譲渡所得等については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）での取扱いも可能です。）。

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

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」および非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「つみたてNISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託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が、2024年1月1日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。

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。

また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。

当ファンドは、2024年1月1日以降の「NISA」の「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象となる予定ですが、販売会社により取扱い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。

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

< 法人の受益者に対する課税 >

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

< 確定拠出年金に対する課税 >

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

（ 1 ）「元本払戻金（特別分配金）」とは、収益分配金落ち後の基準価額が各受益者の個別元本を下回る場合、収益分配金のうち当該下回る部分に相当する額をさし、元本の一部払戻しに相当するものです。この場合、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

（ 2 ）「各受益者の個別元本」とは、原則として各受益者の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、元本払戻金（特別分配金）が支払われた際に調整されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数の支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

* 上記は、2023年7月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容等が変更される場合があります。

5【運用状況】

以下は2023年7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】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	2,821,819,644	99.99
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		26,334	0.00
合計（純資産総額）		2,821,845,978	100.00

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	1,508,268,550	99.99
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		13,259	0.00
合計（純資産総額）		1,508,281,809	100.00

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	921,134,385	99.99
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		8,419	0.00
合計（純資産総額）		921,142,804	100.00

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	1,482,938,638	99.99
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		14,906	0.00
合計（純資産総額）		1,482,953,544	100.00

（ご参考：親投資信託の投資状況）

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

TMA日本株TOPIXマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	49,325,012,110	90.58
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		5,129,144,890	9.41
合計（純資産総額）		54,454,157,000	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	4,979,780,000	9.14

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

TMA外国債券インデックスマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	7,570,135,580	47.74
	カナダ	319,572,765	2.01
	ドイツ	1,027,280,614	6.47
	イタリア	1,215,820,054	7.66
	フランス	1,302,509,083	8.21
	オーストラリア	235,869,498	1.48
	イギリス	771,596,893	4.86
	シンガポール	73,538,019	0.46
	マレーシア	85,914,341	0.54
	ニュージーランド	37,192,876	0.23
	オランダ	249,583,445	1.57
	スペイン	792,705,221	4.99
	ベルギー	293,312,606	1.84
	スウェーデン	31,573,548	0.19
	ノルウェー	27,481,523	0.17
	オーストリア	195,569,959	1.23
	フィンランド	82,523,473	0.52
	デンマーク	47,517,567	0.29
	メキシコ	156,506,398	0.98
	アイルランド	96,494,099	0.60
イスラエル	46,538,972	0.29	
ポーランド	78,976,073	0.49	
中華人民共和国	941,105,422	5.93	
小計		15,679,318,029	98.88
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		176,187,042	1.11
合計（純資産総額）		15,855,505,071	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	108,371,536,732	70.32
	カナダ	5,271,023,889	3.42
	ドイツ	3,859,917,663	2.50
	イタリア	822,355,311	0.53
	フランス	5,046,035,459	3.27
	オーストラリア	3,127,464,433	2.02
	イギリス	6,355,515,303	4.12
	スイス	4,951,948,479	3.21
	バミューダ	283,441,084	0.18
	香港	937,912,139	0.60
	シンガポール	570,191,559	0.37
	ニュージーランド	148,465,038	0.09
	オランダ	2,998,892,938	1.94
	スペイン	1,193,116,651	0.77
	ベルギー	330,129,868	0.21
	スウェーデン	1,357,863,109	0.88
	ノルウェー	352,990,208	0.22
	オーストリア	86,931,219	0.05
	ルクセンブルク	65,172,551	0.04
	フィンランド	484,499,850	0.31
	デンマーク	1,372,596,057	0.89
	アイルランド	2,677,905,003	1.73
	イスラエル	255,842,651	0.16
	ポルトガル	100,174,826	0.06
	ケイマン	122,557,243	0.07
	キュラソー	243,239,900	0.15
	ジャージー	455,562,755	0.29
マン島	46,789,029	0.03	
小計	151,890,070,947	98.56	
投資証券	アメリカ	2,661,562,357	1.72
	カナダ	24,449,611	0.01
	フランス	92,874,071	0.06
	オーストラリア	169,750,988	0.11
	イギリス	109,529,790	0.07
	香港	39,228,537	0.02
	シンガポール	41,812,497	0.02
	小計	3,139,207,851	2.03
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		933,628,349	0.60
合計(純資産総額)		154,095,650,449	100.00

その他の資産の投資状況

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

株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,526,039,016	0.99
	買建	ドイツ	293,285,265	0.19
	買建	イギリス	181,016,082	0.11

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

TMA日本債券インデックスマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	25,756,903,810	90.31
地方債証券	日本	1,369,683,568	4.80
特殊債券	日本	199,822,000	0.70
社債券	日本	1,231,459,332	4.31
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		39,302,079	0.13
合計(純資産総額)		28,518,566,631	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a. 主要銘柄の明細

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	TMA日本株TOPIXマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	405,466,717	1.8183	737,297,263	2.1153	857,683,746	30.39
2	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	170,522,030	4.2587	726,202,381	5.0279	857,367,714	30.38
3	TMA日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	670,192,391	1.2362	828,510,766	1.2405	831,373,661	29.46
4	TMA外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	151,348,936	1.7173	259,922,687	1.8196	275,394,523	9.75

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	TMA日本株TOPIXマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	230,884,094	1.8207	420,371,745	2.1153	488,389,124	32.38
2	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	97,099,786	4.2628	413,923,402	5.0279	488,208,014	32.36
3	TMA日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	310,076,461	1.2368	383,504,059	1.2405	384,649,849	25.50
4	TMA外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	80,798,837	1.7186	138,863,346	1.8196	147,021,563	9.74

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	

1	TMA日本株TOPIXマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	145,323,330	1.8207	264,597,238	2.1153	307,402,439	33.37
2	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	61,115,808	4.2617	260,459,283	5.0279	307,284,171	33.35
3	TMA日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	174,697,442	1.2374	216,172,512	1.2405	216,712,176	23.52
4	TMA外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	49,316,113	1.7195	84,802,586	1.8196	89,735,599	9.74

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	TMA日本株TOPIXマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	247,828,490	1.8258	452,495,621	2.1153	524,231,604	35.35
2	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	104,224,583	4.2778	445,853,322	5.0279	524,030,780	35.33
3	TMA日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	234,086,169	1.2370	289,567,201	1.2405	290,383,892	19.58
4	TMA外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	79,298,946	1.7219	136,550,307	1.8196	144,292,362	9.73

b. 投資有価証券の種類

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

【投資不動産物件】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065
該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065
該当事項はありません。

(ご参考:親投資信託の投資資産)

投資有価証券の主要銘柄

a. 主要銘柄の明細

TMA日本株TOPIXマザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	株式	814,200	1,791.97	1,459,024,964	2,386.00	1,942,681,200	3.56
2	ソニーグループ	日本	電気機器	株式	105,100	11,623.56	1,221,636,994	13,315.00	1,399,406,500	2.56
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	919,700	833.82	766,872,488	1,146.00	1,053,976,200	1.93
4	キーエンス	日本	電気機器	株式	14,800	60,562.01	896,317,846	63,760.00	943,648,000	1.73
5	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	4,777,500	160.28	765,744,224	162.90	778,254,750	1.42
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	107,400	5,209.33	559,482,266	6,694.00	718,935,600	1.32
7	三菱商事	日本	卸売業	株式	97,800	4,670.13	456,738,853	7,265.00	710,517,000	1.30
8	日立製作所	日本	電気機器	株式	72,700	6,868.76	499,358,944	9,298.00	675,964,600	1.24
9	東京エレクトロン	日本	電気機器	株式	31,400	15,900.23	499,267,474	21,245.00	667,093,000	1.22
10	三井物産	日本	卸売業	株式	112,200	3,731.89	418,718,396	5,541.00	621,700,200	1.14
11	任天堂	日本	その他製品	株式	93,400	5,099.59	476,302,524	6,450.00	602,430,000	1.10
12	信越化学工業	日本	化学	株式	123,700	4,008.44	495,844,640	4,679.00	578,792,300	1.06
13	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	131,800	4,300.09	566,752,704	4,341.00	572,143,800	1.05
14	第一三共	日本	医薬品	株式	130,100	4,492.38	584,459,300	4,347.00	565,544,700	1.03
15	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	113,200	3,490.84	395,163,952	4,933.00	558,415,600	1.02
16	伊藤忠商事	日本	卸売業	株式	96,700	4,153.20	401,615,110	5,750.00	556,025,000	1.02
17	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	119,300	3,367.03	401,686,904	4,513.00	538,400,900	0.98
18	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	74,100	4,869.39	360,822,052	7,242.00	536,632,200	0.98
19	HOYA	日本	精密機器	株式	31,700	14,179.03	449,475,370	16,530.00	524,001,000	0.96
20	ダイキン工業	日本	機械	株式	17,800	22,448.12	399,576,544	28,690.00	510,682,000	0.93
21	みずほフィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	211,100	1,842.27	388,903,650	2,404.00	507,484,400	0.93
22	KDDI	日本	情報・通信業	株式	115,000	4,085.47	469,829,995	4,187.00	481,505,000	0.88
23	東京海上ホールディングス	日本	保険業	株式	145,700	2,569.91	374,436,389	3,259.00	474,836,300	0.87
24	オリエンタルランド	日本	サービス業	株式	81,200	4,392.59	356,678,728	5,450.00	442,540,000	0.81
25	ソフトバンク	日本	情報・通信業	株式	239,800	1,536.77	368,519,567	1,578.00	378,404,400	0.69
26	村田製作所	日本	電気機器	株式	44,200	7,686.65	339,750,185	8,325.00	367,965,000	0.67
27	SMC	日本	機械	株式	4,800	68,322.67	327,948,860	74,150.00	355,920,000	0.65
28	セブン&アイ・ホールディングス	日本	小売業	株式	53,800	5,785.82	311,277,340	5,893.00	317,043,400	0.58
29	ファナック	日本	電気機器	株式	72,400	4,568.42	330,754,024	4,348.00	314,795,200	0.57
30	三菱電機	日本	電気機器	株式	153,000	1,519.01	232,409,430	2,051.00	313,803,000	0.57

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	13,449.41	107,595,352	13,566.15	108,529,278	0.68
2	T 2 08/15/25	アメリカ	国債証券	2.000	2025/08/15	800,000	13,165.27	105,322,211	13,313.95	106,511,645	0.67
3	T 4 1/8 11/15/32	アメリカ	国債証券	4.125	2032/11/15	700,000	14,747.46	103,232,232	14,245.67	99,719,754	0.62
4	T 4 1/2 11/30/24	アメリカ	国債証券	4.500	2024/11/30	700,000	14,141.92	98,993,443	13,951.62	97,661,372	0.61
5	T 3 7/8 12/31/27	アメリカ	国債証券	3.875	2027/12/31	600,000	14,030.64	84,183,852	13,872.32	83,233,974	0.52
6	T 3 5/8 05/31/28	アメリカ	国債証券	3.625	2028/05/31	600,000	13,981.54	83,889,263	13,742.61	82,455,718	0.52
7	T 1 3/8 11/15/31	アメリカ	国債証券	1.375	2031/11/15	700,000	11,331.50	79,320,564	11,522.09	80,654,663	0.50
8	T 1 3/4 12/31/24	アメリカ	国債証券	1.750	2024/12/31	600,000	13,284.21	79,705,319	13,431.79	80,590,786	0.50
9	T 2 3/4 02/15/28	アメリカ	国債証券	2.750	2028/02/15	600,000	13,057.34	78,344,077	13,230.25	79,381,527	0.50
10	T 1 5/8 02/15/26	アメリカ	国債証券	1.625	2026/02/15	600,000	12,864.61	77,187,682	13,080.47	78,482,844	0.49
11	T 2 7/8 05/15/32	アメリカ	国債証券	2.875	2032/05/15	600,000	12,688.40	76,130,405	12,938.40	77,630,416	0.48
12	T 1 1/4 12/31/26	アメリカ	国債証券	1.250	2026/12/31	600,000	12,537.57	75,225,434	12,696.11	76,176,663	0.48
13	T 1 3/8 12/31/28	アメリカ	国債証券	1.375	2028/12/31	600,000	12,087.90	72,527,411	12,204.91	73,229,509	0.46
14	FRTR 0 3/4 02/25/28	フランス	国債証券	0.750	2028/02/25	500,000	14,208.24	71,041,241	14,127.52	70,637,645	0.44
15	T 4 1/8 06/15/26	アメリカ	国債証券	4.125	2026/06/15	500,000	13,932.35	69,661,757	13,940.61	69,703,056	0.43
16	T 3 7/8 12/31/29	アメリカ	国債証券	3.875	2029/12/31	500,000	14,255.59	71,277,999	13,891.05	69,455,257	0.43
17	T 3 06/30/24	アメリカ	国債証券	3.000	2024/06/30	500,000	13,701.62	68,508,115	13,796.33	68,981,687	0.43
18	T 3 1/2 02/15/33	アメリカ	国債証券	3.500	2033/02/15	500,000	13,895.08	69,475,415	13,573.86	67,869,343	0.42
19	T 1 1/4 11/30/26	アメリカ	国債証券	1.250	2026/11/30	500,000	12,528.70	62,643,542	12,714.83	63,574,165	0.40
20	T 0 3/8 01/31/26	アメリカ	国債証券	0.375	2026/01/31	500,000	12,366.81	61,834,067	12,681.79	63,408,967	0.39
21	T 1 1/2 02/15/30	アメリカ	国債証券	1.500	2030/02/15	500,000	11,768.79	58,843,961	12,023.19	60,115,995	0.37
22	T 1 7/8 02/15/32	アメリカ	国債証券	1.875	2032/02/15	500,000	11,647.64	58,238,231	11,960.42	59,802,117	0.37
23	T 1 5/8 05/15/31	アメリカ	国債証券	1.625	2031/05/15	500,000	11,581.56	57,907,832	11,891.03	59,455,198	0.37
24	T 1 1/8 02/15/31	アメリカ	国債証券	1.125	2031/02/15	500,000	11,206.01	56,030,067	11,522.09	57,610,473	0.36
25	T 1 1/4 08/15/31	アメリカ	国債証券	1.250	2031/08/15	500,000	11,133.32	55,666,629	11,471.43	57,357,168	0.36
26	T 0 7/8 11/15/30	アメリカ	国債証券	0.875	2030/11/15	500,000	11,083.41	55,417,074	11,339.95	56,699,769	0.35
27	FRTR 0 02/25/27	フランス	国債証券	-	2027/02/25	400,000	14,057.62	56,230,486	14,006.35	56,025,424	0.35
28	T 4 3/8 10/31/24	アメリカ	国債証券	4.375	2024/10/31	400,000	14,084.19	56,336,787	13,938.40	55,753,635	0.35
29	T 3 7/8 11/30/27	アメリカ	国債証券	3.875	2027/11/30	400,000	14,161.57	56,646,289	13,872.32	55,489,316	0.34
30	T 3 5/8 05/15/26	アメリカ	国債証券	3.625	2026/05/15	400,000	13,923.54	55,694,163	13,745.67	54,982,705	0.34

T M A 外国株式インデックスマザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	株式	316,987	19,778.41	6,269,499,275	27,606.15	8,750,792,286	5.67
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	142,061	33,565.58	4,768,360,122	47,700.01	6,776,312,384	4.39
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	一般消費財・サービス流通・小売り	株式	185,703	12,830.41	2,382,646,120	18,637.64	3,461,066,348	2.24
4	NVIDIA CORP	アメリカ	半導体・半導体製造装置	株式	49,782	23,822.80	1,185,946,775	65,903.47	3,280,806,792	2.12
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	118,923	12,860.90	1,529,456,949	18,689.80	2,222,647,394	1.44
6	TESLA INC	アメリカ	自動車・自動車部品	株式	57,652	25,916.64	1,494,146,639	37,560.04	2,165,411,818	1.40
7	META PLATFORMS INC-A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	44,786	17,288.69	774,291,638	45,882.91	2,054,912,258	1.33
8	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	株式	108,640	12,831.50	1,394,014,698	18,750.41	2,037,045,596	1.32
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	ヘルスケア機器・サービス	株式	18,480	74,667.32	1,379,852,121	70,895.22	1,310,143,715	0.85
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	株式	58,646	18,590.01	1,090,230,179	22,119.60	1,297,226,219	0.84
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	金融サービス	株式	25,651	41,702.70	1,069,716,167	49,312.71	1,264,920,470	0.82
12	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	51,050	24,133.42	1,232,011,389	24,596.44	1,255,648,547	0.81
13	EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	エネルギー	株式	82,590	15,367.78	1,269,225,644	14,683.43	1,212,704,913	0.78
14	BROADCOM INC	アメリカ	半導体・半導体製造装置	株式	8,443	73,790.79	623,015,705	126,843.39	1,070,938,794	0.69
15	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	金融サービス	株式	32,200	28,275.17	910,460,672	33,233.67	1,070,124,415	0.69
16	ELI LILLY AND COMPANY	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	16,407	51,917.23	851,806,037	64,631.92	1,060,416,003	0.68
17	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	家庭用品・パーソナル用品	株式	46,574	19,647.05	915,041,969	22,049.11	1,026,915,607	0.66
18	HOME DEPOT INC	アメリカ	一般消費財・サービス流通・小売り	株式	20,126	41,151.92	828,223,610	46,713.22	940,150,444	0.61
19	MASTERCARD INC - A	アメリカ	金融サービス	株式	16,913	46,113.53	779,918,156	55,395.57	936,905,295	0.60
20	NESTLE SA-REGISTERED	スイス	食品・飲料・タバコ	株式	53,664	17,711.32	950,460,569	17,392.31	933,341,460	0.60
21	CHEVRONTEXACO CORP	アメリカ	エネルギー	株式	36,881	24,755.06	912,991,725	22,395.90	825,983,331	0.53
22	ASML HOLDING NV	オランダ	半導体・半導体製造装置	株式	8,089	80,670.02	652,539,822	101,443.54	820,576,875	0.53
23	MERCK & CO. 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	50,814	14,592.21	741,488,833	14,990.74	761,739,960	0.49

24	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	35,469	20,996.89	744,739,007	21,265.32	754,259,794	0.48
25	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	33,220	18,539.85	615,893,901	22,034.27	731,978,781	0.47
26	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	フランス	耐久消費財・アパレル	株式	5,528	107,441.37	593,935,936	130,680.41	722,401,361	0.46
27	PEPSICO INC	アメリカ	食品・飲料・タバコ	株式	26,683	25,284.03	674,654,027	26,828.00	715,851,542	0.46
28	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	生活必需品流通・小売り	株式	8,880	69,448.68	616,704,341	79,411.22	705,171,637	0.45
29	ADOBE INC	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	9,424	45,001.22	424,091,538	74,554.80	702,604,471	0.45
30	COCA-COLA COMPANY	アメリカ	食品・飲料・タバコ	株式	79,572	8,389.65	667,581,455	8,807.80	700,854,707	0.45

T M A 日本債券インデックスマザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	額面	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
							単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	第352回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2028/09/20	397,000,000	100.02	397,089,870	99.49	394,979,270	1.38
2	第148回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.005	2026/06/20	391,000,000	100.14	391,569,260	99.98	390,941,350	1.37
3	第146回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2025/12/20	365,000,000	100.48	366,752,000	100.26	365,956,300	1.28
4	第144回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2025/06/20	330,000,000	100.40	331,333,200	100.23	330,775,500	1.15
5	第143回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2025/03/20	319,000,000	100.35	320,124,550	100.21	319,676,280	1.12
6	第147回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.005	2026/03/20	319,000,000	100.15	319,478,670	100.01	319,041,470	1.11
7	第356回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2029/09/20	321,000,000	99.63	319,842,800	98.85	317,321,340	1.11
8	第142回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2024/12/20	309,000,000	100.31	309,978,450	100.22	309,682,890	1.08
9	第360回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2030/09/20	311,000,000	98.90	307,589,760	97.98	304,736,460	1.06
10	第355回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2029/06/20	303,000,000	99.51	301,528,820	99.01	300,015,450	1.05
11	第357回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2029/12/20	299,000,000	99.37	297,128,780	98.68	295,065,160	1.03
12	第354回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2029/03/20	297,000,000	99.65	295,960,500	99.19	294,606,180	1.03
13	第358回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2030/03/20	295,000,000	99.26	292,823,250	98.50	290,595,650	1.01
14	第348回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2027/09/20	290,000,000	100.16	290,490,100	100.08	290,237,800	1.01
15	第359回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2030/06/20	287,000,000	99.09	284,393,460	98.28	282,080,820	0.98

16	第363回利付 国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2031/06/20	287,000,000	98.36	282,295,470	97.29	279,242,390	0.97
17	第150回利付 国債（5年）	日本	国債証券	0.005	2026/12/20	279,000,000	99.90	278,727,020	99.91	278,762,850	0.97
18	第364回利付 国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2031/09/20	284,000,000	98.29	279,147,210	97.06	275,656,080	0.96
19	第365回利付 国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2031/12/20	284,000,000	98.15	278,760,610	96.85	275,076,720	0.96
20	第145回利付 国債（5年）	日本	国債証券	0.100	2025/09/20	272,000,000	100.40	273,089,870	100.24	272,666,400	0.95
21	第361回利付 国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2030/12/20	276,000,000	98.81	272,722,720	97.77	269,864,520	0.94
22	第366回利付 国債（10年）	日本	国債証券	0.200	2032/03/20	274,000,000	99.27	272,006,320	97.47	267,084,240	0.93
23	第149回利付 国債（5年）	日本	国債証券	0.005	2026/09/20	265,000,000	100.08	265,222,500	99.95	264,872,800	0.92
24	第353回利付 国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2028/12/20	266,000,000	99.65	265,071,810	99.36	264,300,260	0.92
25	第349回利付 国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2027/12/20	264,000,000	100.12	264,327,180	99.95	263,883,840	0.92
26	第351回利付 国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2028/06/20	264,000,000	100.02	264,064,920	99.66	263,102,400	0.92
27	第151回利付 国債（5年）	日本	国債証券	0.005	2027/03/20	259,000,000	99.66	258,119,400	99.85	258,621,860	0.90
28	第350回利付 国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2028/03/20	252,000,000	100.07	252,176,400	99.81	251,533,800	0.88
29	第141回利付 国債（5年）	日本	国債証券	0.100	2024/09/20	250,000,000	100.28	250,706,400	100.21	250,540,000	0.87
30	第370回利付 国債（10年）	日本	国債証券	0.500	2033/03/20	252,000,000	100.89	254,247,920	99.27	250,160,400	0.87

b. 投資有価証券の種類

TMA日本株TOPIXマザーファンド

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.06
		鉱業	0.30
		建設業	1.80
		食料品	2.99
		繊維製品	0.40
		パルプ・紙	0.15
		化学	5.38
		医薬品	4.52
		石油・石炭製品	0.38
		ゴム製品	0.67
		ガラス・土石製品	0.60
		鉄鋼	0.88
		非鉄金属	0.60
		金属製品	0.49
		機械	4.92

	電気機器	16.27
	輸送用機器	7.34
	精密機器	2.31
	その他製品	2.09
	電気・ガス業	1.18
	陸運業	2.56
	海運業	0.56
	空運業	0.47
	倉庫・運輸関連業	0.15
	情報・通信業	7.38
	卸売業	6.25
	小売業	3.96
	銀行業	5.96
	証券、商品先物取引業	0.68
	保険業	2.06
	その他金融業	1.06
	不動産業	1.64
	サービス業	4.35
合 計		90.58

T M A 外国債券インデックスマザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	98.88
合 計	98.88

T M A 外国株式インデックスマザーファンド

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	4.94
		素材	4.16
		資本財	6.61
		商業・専門サービス	1.57
		運輸	1.88
		自動車・自動車部品	2.31
		耐久消費財・アパレル	1.72
		消費者サービス	2.18
		メディア・娯楽	6.03
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.47
		生活必需品流通・小売り	1.72
		食品・飲料・タバコ	3.92
		家庭用品・パーソナル用品	1.68
		ヘルスケア機器・サービス	4.60
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.30
		銀行	5.45

	金融サービス	6.70
	保険	3.00
	ソフトウェア・サービス	9.50
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.04
	電気通信サービス	1.16
	公益事業	2.84
	半導体・半導体製造装置	6.31
	不動産管理・開発	0.38
投資証券	-	2.03
合計		100.60

TMA日本債券インデックスマザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	90.31
地方債証券	4.80
特殊債券	0.70
社債券	4.31
合計	100.13

投資不動産物件

TMA日本株TOPIXマザーファンド
該当事項はありません。

TMA外国債券インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

TMA外国株式インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

TMA日本債券インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

TMA日本株TOPIXマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/ 売建	数量 (枚)	帳簿価額	評価額(円)	投資 比率(%)
株価指数先物取引	日本	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	214	4,854,385,400.00	4,979,780,000	9.14

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

TMA外国債券インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

TMA外国株式インデックスマザーファンド

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

株価指数 先物取引	アメリカ	Chicago Mercantile Exchange	S&P 500 EMIN	買建	47	米ドル	10,572,337.50	10,825,275.00	1,526,039,016	0.99
	ドイツ	Eurex	DJ EU STX 50	買建	42	ユーロ	1,832,890.00	1,887,900.00	293,285,265	0.19
	イギリス	ICE Futures Europe Financials	FTSE 100 IDX	買建	13	英ポンド	970,695.00	998,985.00	181,016,082	0.11

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

TMA日本債券インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1計算期間末	(2020年 1月27日)	4	4	1.0509	1.0509
第2計算期間末	(2021年 1月25日)	153	153	1.1305	1.1305
第3計算期間末	(2022年 1月25日)	735	735	1.2250	1.2250
第4計算期間末	(2023年 1月25日)	1,888	1,888	1.2592	1.2592
2022年 7月末日		1,319		1.2677	
8月末日		1,408		1.2722	
9月末日		1,486		1.2272	
10月末日		1,629		1.2834	
11月末日		1,771		1.2776	
12月末日		1,785		1.2251	
2023年 1月末日		1,897		1.2553	
2月末日		1,991		1.2776	
3月末日		2,105		1.2885	
4月末日		2,207		1.3115	
5月末日		2,343		1.3464	
6月末日		2,665		1.4148	
7月末日		2,821		1.4176	

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1計算期間末	(2020年 1月27日)	2	2	1.0527	1.0527
第2計算期間末	(2021年 1月25日)	51	51	1.1351	1.1351
第3計算期間末	(2022年 1月25日)	366	366	1.2333	1.2333
第4計算期間末	(2023年 1月25日)	964	964	1.2715	1.2715
2022年 7月末日		696		1.2780	
8月末日		726		1.2830	
9月末日		736		1.2356	

10月末日	809		1.2959	
11月末日	906		1.2902	
12月末日	917		1.2352	
2023年 1月末日	972		1.2678	
2月末日	1,030		1.2909	
3月末日	1,110		1.3015	
4月末日	1,165		1.3260	
5月末日	1,248		1.3635	
6月末日	1,438		1.4368	
7月末日	1,508		1.4414	

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1計算期間末	(2020年 1月27日)	1	1	1.0565	1.0565
第2計算期間末	(2021年 1月25日)	44	44	1.1445	1.1445
第3計算期間末	(2022年 1月25日)	233	233	1.2487	1.2487
第4計算期間末	(2023年 1月25日)	593	593	1.2904	1.2904
2022年 7月末日		413		1.2960	
8月末日		441		1.3014	
9月末日		453		1.2522	
10月末日		502		1.3152	
11月末日		551		1.3096	
12月末日		557		1.2527	
2023年 1月末日		593		1.2868	
2月末日		630		1.3106	
3月末日		684		1.3211	
4月末日		730		1.3466	
5月末日		785		1.3858	
6月末日		884		1.4624	
7月末日		921		1.4680	

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1計算期間末	(2020年 1月27日)	1	1	1.0584	1.0584
第2計算期間末	(2021年 1月25日)	79	79	1.1490	1.1490
第3計算期間末	(2022年 1月25日)	463	463	1.2579	1.2579
第4計算期間末	(2023年 1月25日)	978	978	1.3059	1.3059
2022年 7月末日		720		1.3095	
8月末日		754		1.3156	
9月末日		766		1.2637	
10月末日		834		1.3311	
11月末日		888		1.3256	

12月末日	915		1.2659	
2023年 1月末日	984		1.3026	
2月末日	1,050		1.3272	
3月末日	1,136		1.3375	
4月末日	1,182		1.3647	
5月末日	1,250		1.4066	
6月末日	1,432		1.4885	
7月末日	1,482		1.4961	

【分配の推移】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065
該当事項はありません。

【収益率の推移】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第1計算期間	2019年 9月20日 ~ 2020年 1月27日	5.1
第2計算期間	2020年 1月28日 ~ 2021年 1月25日	7.6
第3計算期間	2021年 1月26日 ~ 2022年 1月25日	8.4
第4計算期間	2022年 1月26日 ~ 2023年 1月25日	2.8
第5中間計算期間	2023年 1月26日 ~ 2023年 7月25日	12.5

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第1計算期間	2019年 9月20日 ~ 2020年 1月27日	5.3
第2計算期間	2020年 1月28日 ~ 2021年 1月25日	7.8
第3計算期間	2021年 1月26日 ~ 2022年 1月25日	8.7
第4計算期間	2022年 1月26日 ~ 2023年 1月25日	3.1
第5中間計算期間	2023年 1月26日 ~ 2023年 7月25日	13.1

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第1計算期間	2019年 9月20日 ~ 2020年 1月27日	5.7
第2計算期間	2020年 1月28日 ~ 2021年 1月25日	8.3
第3計算期間	2021年 1月26日 ~ 2022年 1月25日	9.1
第4計算期間	2022年 1月26日 ~ 2023年 1月25日	3.3
第5中間計算期間	2023年 1月26日 ~ 2023年 7月25日	13.5

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

期	計算期間	収益率（％）（分配付）
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	5.8
第2計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	8.6
第3計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	9.5
第4計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	3.8
第5中間計算期間	2023年 1月26日～2023年 7月25日	14.2

(4)【設定及び解約の実績】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	4,514,529		4,514,529
第2計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	147,556,612	16,408,441	135,662,700
第3計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	541,037,240	76,037,177	600,662,763
第4計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	1,013,766,234	114,944,473	1,499,484,524
第5中間計算期間	2023年 1月26日～2023年 7月25日	509,450,681	64,436,341	1,944,498,864

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	2,051,072		2,051,072
第2計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	47,146,627	3,465,092	45,732,607
第3計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	271,763,387	20,016,066	297,479,928
第4計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	527,211,069	65,733,276	758,957,721
第5中間計算期間	2023年 1月26日～2023年 7月25日	306,268,440	44,618,156	1,020,608,005

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	1,075,709		1,075,709
第2計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	42,994,246	5,274,240	38,795,715
第3計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	173,994,786	26,139,658	186,650,843
第4計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	329,859,329	56,692,136	459,818,036
第5中間計算期間	2023年 1月26日～2023年 7月25日	208,263,400	45,775,500	622,305,936

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	1,503,582		1,503,582
第2計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	88,824,986	20,986,846	69,341,722
第3計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	434,498,332	135,257,180	368,582,874
第4計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	524,519,145	144,133,313	748,968,706
第5中間計算期間	2023年 1月26日～2023年 7月25日	372,099,574	140,414,153	980,654,127

< 参考情報 >

基準日: 2023年7月31日

基準価額・純資産の推移

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035



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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第1期	2020/01/27	0円
第2期	2021/01/25	0円
第3期	2022/01/25	0円
第4期	2023/01/25	0円
第5期	2024/01/25	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。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045



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

(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第1期	2020/01/27	0円
第2期	2021/01/25	0円
第3期	2022/01/25	0円
第4期	2023/01/25	0円
第5期	2024/01/25	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。

次ページへ続く

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

基準日：2023年7月31日

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055



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

(1万口当たり、税引前)

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

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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065



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

(1万口当たり、税引前)

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

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

次ページへ続く

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

基準日：2023年7月31日

主要な資産の状況

資産構成

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

ファンド名	組入比率	基本資産配分	差
TMA日本株TOPIXマザーファンド	30.4%	30.0%	+0.4%
TMA日本債券インデックスマザーファンド	29.5%	30.0%	-0.5%
TMA外国株式インデックスマザーファンド	30.4%	30.0%	+0.4%
TMA外国債券インデックスマザーファンド	9.8%	10.0%	-0.2%
短期金融資産等	0.0%	-	+0.0%

※比率は純資産総額に占める割合です。

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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

ファンド名	組入比率	基本資産配分	差
TMA日本株TOPIXマザーファンド	32.4%	32.0%	+0.4%
TMA日本債券インデックスマザーファンド	25.5%	26.0%	-0.5%
TMA外国株式インデックスマザーファンド	32.4%	32.0%	+0.4%
TMA外国債券インデックスマザーファンド	9.7%	10.0%	-0.3%
短期金融資産等	0.0%	-	+0.0%

※比率は純資産総額に占める割合です。

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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

ファンド名	組入比率	基本資産配分	差
TMA日本株TOPIXマザーファンド	33.4%	33.0%	+0.4%
TMA日本債券インデックスマザーファンド	23.5%	24.0%	-0.5%
TMA外国株式インデックスマザーファンド	33.4%	33.0%	+0.4%
TMA外国債券インデックスマザーファンド	9.7%	10.0%	-0.3%
短期金融資産等	0.0%	-	+0.0%

※比率は純資産総額に占める割合です。

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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

ファンド名	組入比率	基本資産配分	差
TMA日本株TOPIXマザーファンド	35.4%	35.0%	+0.4%
TMA日本債券インデックスマザーファンド	19.6%	20.0%	-0.4%
TMA外国株式インデックスマザーファンド	35.3%	35.0%	+0.3%
TMA外国債券インデックスマザーファンド	9.7%	10.0%	-0.3%
短期金融資産等	0.0%	-	+0.0%

※比率は純資産総額に占める割合です。

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

次ページへ続く

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

基準日:2023年7月31日

年間収益率の推移

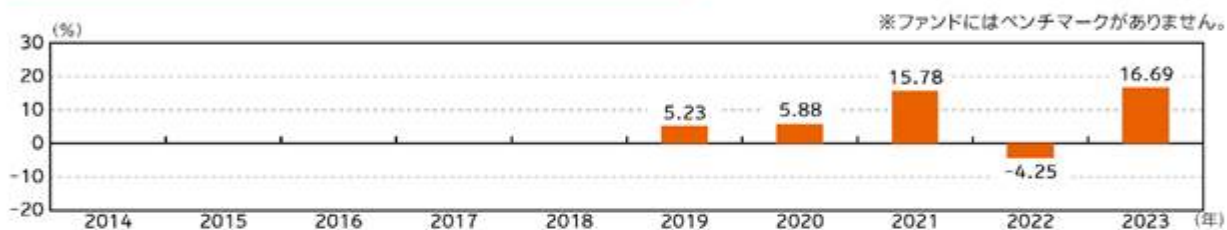
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035



※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資した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。

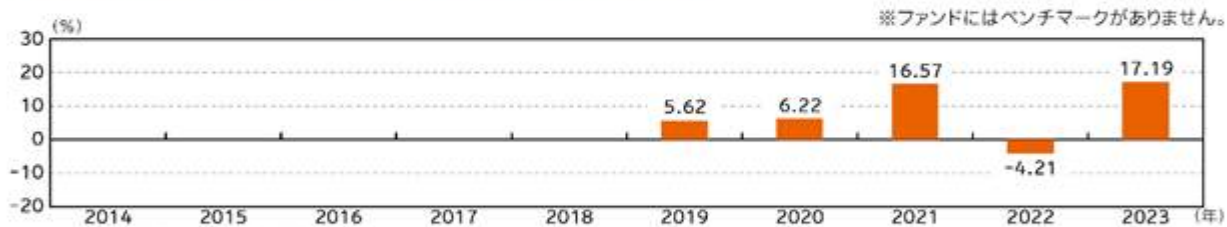
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045



※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資した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。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055



※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資した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。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065



※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資した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
- ・フランクフルト証券取引所の休業日

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

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

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

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

e. 受益権の取得申込価額は以下の通りです。

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

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

委託会社のお問い合わせ先（委託会社サービスデスク）

東京海上アセットマネジメント サービスデスク

0120-712-016（土日祝日・年末年始を除く9時～17時）

f. 取得申込にかかる手数料はありません。

g. 上記にかかわらず、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます（本書において、同じ。）。）における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置を取った場合には、販売会社は、受益権の取得申込の受付を中止すること、および既に受け付けた取得申込の受付を取り消すことができます。

h. 取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関等への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関等への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関等の定める方法により、振替機関等へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

i. 定時定額購入サービスを選択した取得申込者は、販売会社との間で定時定額購入サービスに関する取り決めを行います。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

- a. 受益者は、自己に帰属する受益権につき、一部解約の実行請求（解約請求）の方法によりご換金の請求を行うことができます。
- b. ご換金のお申込みは販売会社で受け付けます。なお、販売会社の買取りによるご換金の請求については、販売会社にお問い合わせください。
- c. 解約請求による換金のお申込みは、毎営業日に行うことができます。ただし、解約請求日が以下の日のいずれかに該当する場合には、お申込みの受付を行いません。
 - ・ニューヨーク証券取引所の休業日
 - ・ロンドン証券取引所の休業日
 - ・フランクフルト証券取引所の休業日
- d. 解約単位は、販売会社やお申込みのコース等によって異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- e. 解約請求のお申込みの受付は、原則として午後3時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みは翌営業日受付としてお取り扱いします。
- f. 解約時の価額（解約価額）は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
 - 信託財産留保額はありませぬ。
 - 確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、収益分配金および解約時・償還時の個別元本超過額に対する所得税、地方税はかかりませぬ。
- g. 解約価額は、原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクにお問い合わせることにより知ることができます。
- h. 解約にかかる手数料はありませぬ。
- i. 解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から、お支払いします。
- j. 委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよび既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日を解約請求受付日とする解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にその請求を受け付けたものとして取扱います。
- k. 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口解約には制限を設ける場合があります。ただし、確定拠出年金制度に基づく受益者である場合には制限はありませぬ。
- l. 受益者が解約の請求をするときは、振替受益権をもって行うものとし、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請が行われ、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

- a. 基準価額は、受益権1口当たりの純資産価額（純資産総額を計算日における受益権総口数で除した金額）をいいます。ただし、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示されることがあります。
- b. 純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、外国為替予約に基づく予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

< 主要投資対象資産の評価方法 >

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

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

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

信託約款の変更

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

関係会社との契約の更改等

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

運用報告書

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

公告

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

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

4【受益者の権利等】

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

収益分配金の請求権

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

償還金の請求権

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

換金（解約）請求権

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

買取請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、第4期計算期間(2022年1月26日から2023年1月25日まで)の財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 [2022年 1月25日現在]	第4期 [2023年 1月25日現在]
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	735,770,006	1,888,079,937
未収入金	1,075,468	3,700,657
流動資産合計	736,845,474	1,891,780,594
資産合計	736,845,474	1,891,780,594
負債の部		
流動負債		
未払解約金	65,819	1,007,806
未払受託者報酬	66,341	177,088
未払委託者報酬	862,367	2,302,038
その他未払費用	33,076	88,462
流動負債合計	1,027,603	3,575,394
負債合計	1,027,603	3,575,394
純資産の部		
元本等		
元本	1,600,662,763	1,499,484,524
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	135,155,108	388,720,676
（分配準備積立金）	17,826,532	39,154,953
元本等合計	735,817,871	1,888,205,200
純資産合計	735,817,871	1,888,205,200
負債純資産合計	736,845,474	1,891,780,594

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	15,159,190	29,082,125
営業収益合計	15,159,190	29,082,125
営業費用		
受託者報酬	97,094	280,502
委託者報酬	1,262,052	3,646,359
その他費用	48,360	140,080
営業費用合計	1,407,506	4,066,941
営業利益又は営業損失（ ）	13,751,684	25,015,184
経常利益又は経常損失（ ）	13,751,684	25,015,184
当期純利益又は当期純損失（ ）	13,751,684	25,015,184
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（ ）	4,341,096	1,562,544
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	17,699,017	135,155,108
剰余金増加額又は欠損金減少額	121,597,317	256,991,239
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	121,597,317	256,991,239
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,551,814	26,878,311
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,551,814	26,878,311
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（ ）	135,155,108	388,720,676

(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4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第3期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第3期 [2022年 1月25日現在]	第4期 [2023年 1月25日現在]
1. 1 期首元本額	135,662,700円	600,662,763円
期中追加設定元本額	541,037,240円	1,013,766,234円
期中一部解約元本額	76,037,177円	114,944,473円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	600,662,763口	1,499,484,524口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
<p>1 分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,445,064円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（3,965,524円）、投資信託約款に規定される収益調整金（117,328,576円）及び分配準備積立金（8,415,944円）より、分配対象額は135,155,108円（1万口当たり2,250.07円）ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>1 分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（17,980,966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（5,471,674円）、投資信託約款に規定される収益調整金（349,565,723円）及び分配準備積立金（15,702,313円）より、分配対象額は388,720,676円（1万口当たり2,592.34円）ですが、分配を行っておりません。</p>

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期 [2022年 1月25日現在]	第4期 [2023年 1月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左

	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

第3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	8,858,929円
合計	8,858,929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4期（自 2022年1月26日 至 2023年1月25日）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	30,963,711円
合計	30,963,711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3期 [2022年 1月25日現在]		第4期 [2023年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2250円 12,250円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2592円 12,592円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
-----	-----	------	-----	-----

親投資信託 受益証券	T M A日本株 T O P I Xマザーファンド	324,325,891	576,781,164	
	T M A外国債券インデックスマザーファンド	110,052,574	187,089,375	
	T M A外国株式インデックスマザーファンド	137,808,850	571,093,655	
	T M A日本債券インデックスマザーファンド	448,775,451	553,115,743	
親投資信託受益証券 合計		1,020,962,766	1,888,079,937	
合計		1,020,962,766	1,888,079,937	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 [2022年 1月25日現在]	第4期 [2023年 1月25日現在]
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	366,844,977	964,916,821
未収入金	1,442,020	1,711,552
流動資産合計	368,286,997	966,628,373
資産合計	368,286,997	966,628,373
負債の部		
流動負債		
未払解約金	961,244	343,039
未払受託者報酬	31,599	89,989
未払委託者報酬	410,682	1,169,782
その他未払費用	15,698	44,895
流動負債合計	1,419,223	1,647,705
負債合計	1,419,223	1,647,705
純資産の部		
元本等		
元本	1,297,479,928	1,758,957,721
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	69,387,846	206,022,947
（分配準備積立金）	6,535,571	18,740,074
元本等合計	366,867,774	964,980,668
純資産合計	366,867,774	964,980,668
負債純資産合計	368,286,997	966,628,373

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	5,184,965	16,133,435
営業収益合計	5,184,965	16,133,435
営業費用		
受託者報酬	44,680	144,467
委託者報酬	580,715	1,877,960
その他費用	22,157	72,041
営業費用合計	647,552	2,094,468
営業利益又は営業損失（ ）	4,537,413	14,038,967
経常利益又は経常損失（ ）	4,537,413	14,038,967
当期純利益又は当期純損失（ ）	4,537,413	14,038,967
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（ ）	933,065	1,051,269
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,180,404	69,387,846
剰余金増加額又は欠損金減少額	63,323,028	139,746,400
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	63,323,028	139,746,400
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,719,934	16,098,997
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,719,934	16,098,997
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（ ）	69,387,846	206,022,947

(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4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第3期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第3期 [2022年 1月25日現在]	第4期 [2023年 1月25日現在]
1. 1 期首元本額	45,732,607円	297,479,928円
期中追加設定元本額	271,763,387円	527,211,069円
期中一部解約元本額	20,016,066円	65,733,276円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	297,479,928口	758,957,721口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
<p>1 分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,440,342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（1,164,006円）、投資信託約款に規定される収益調整金（62,852,275円）及び分配準備積立金（2,931,223円）より、分配対象額は69,387,846円（1万口当たり2,332.49円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>1 分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（9,602,509円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（3,385,189円）、投資信託約款に規定される収益調整金（187,282,873円）及び分配準備積立金（5,752,376円）より、分配対象額は206,022,947円（1万口当たり2,714.52円）であります。分配を行っておりません。</p>

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期 [2022年 1月25日現在]	第4期 [2023年 1月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左

	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

第3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	3,433,951円
合計	3,433,951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4期（自 2022年1月26日 至 2023年1月25日）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	16,875,262円
合計	16,875,262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3期 [2022年 1月25日現在]		第4期 [2023年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2333円 12,333円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2715円 12,715円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
-----	-----	------	-----	-----

親投資信託 受益証券	T M A日本株T O P I Xマザーファンド	176,536,831	313,953,100	
	T M A外国債券インデックスマザーファンド	56,161,429	95,474,429	
	T M A外国株式インデックスマザーファンド	75,014,168	310,866,213	
	T M A日本債券インデックスマザーファンド	198,477,144	244,623,079	
親投資信託受益証券 合計		506,189,572	964,916,821	
合計		506,189,572	964,916,821	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 [2022年 1月25日現在]	第4期 [2023年 1月25日現在]
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	233,059,604	593,301,979
未収入金	1,567,337	856,206
流動資産合計	234,626,941	594,158,185
資産合計	234,626,941	594,158,185
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,255,090	23,859
未払受託者報酬	20,524	54,758
未払委託者報酬	266,785	711,814
その他未払費用	10,167	27,280
流動負債合計	1,552,566	817,711
負債合計	1,552,566	817,711
純資産の部		
元本等		
元本	186,650,843	459,818,036
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	46,423,532	133,522,438
（分配準備積立金）	4,698,504	13,102,298
元本等合計	233,074,375	593,340,474
純資産合計	233,074,375	593,340,474
負債純資産合計	234,626,941	594,158,185

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	4,063,668	11,482,548
営業収益合計	4,063,668	11,482,548
営業費用		
受託者報酬	29,235	88,695
委託者報酬	380,025	1,152,978
その他費用	14,432	44,151
営業費用合計	423,692	1,285,824
営業利益又は営業損失（ ）	3,639,976	10,196,724
経常利益又は経常損失（ ）	3,639,976	10,196,724
当期純利益又は当期純損失（ ）	3,639,976	10,196,724
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（ ）	1,559,629	977,744
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,604,405	46,423,532
剰余金増加額又は欠損金減少額	44,036,130	92,577,140
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	44,036,130	92,577,140
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,297,350	14,697,214
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,297,350	14,697,214
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（ ）	46,423,532	133,522,438

(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4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第3期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第3期 [2022年 1月25日現在]	第4期 [2023年 1月25日現在]
1. 1 期首元本額	38,795,715円	186,650,843円
期中追加設定元本額	173,994,786円	329,859,329円
期中一部解約元本額	26,139,658円	56,692,136円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	186,650,843口	459,818,036口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
<p>1 分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,611,242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（469,105円）、投資信託約款に規定される収益調整金（41,725,028円）及び分配準備積立金（2,618,157円）より、分配対象額は46,423,532円（1万口当たり2,487.16円）ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>1 分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（6,186,168円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（3,032,812円）、投資信託約款に規定される収益調整金（120,420,140円）及び分配準備積立金（3,883,318円）より、分配対象額は133,522,438円（1万口当たり2,903.77円）ですが、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期 [2022年 1月25日現在]	第4期 [2023年 1月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左

	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

第3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	1,815,577円
合計	1,815,577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4期（自 2022年1月26日 至 2023年1月25日）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	11,609,304円
合計	11,609,304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3期 [2022年 1月25日現在]		第4期 [2023年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2487円 12,487円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2904円 12,904円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
親投資信託 受益証券	T M A日本株T O P I Xマザーファンド	111,856,787	198,926,110	
	T M A外国債券インデックスマザーファンド	34,507,253	58,662,330	
	T M A外国株式インデックスマザーファンド	47,531,242	196,974,219	
	T M A日本債券インデックスマザーファンド	112,567,400	138,739,320	
親投資信託受益証券 合計		306,462,682	593,301,979	
合計		306,462,682	593,301,979	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 [2022年 1月25日現在]	第4期 [2023年 1月25日現在]
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	463,624,016	978,021,736
未収入金	4,318,123	2,024,175
流動資産合計	467,942,139	980,045,911
資産合計	467,942,139	980,045,911
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,651,878	635,301
未払受託者報酬	43,758	91,339
未払委託者報酬	568,739	1,187,337
その他未払費用	21,781	45,571
流動負債合計	4,286,156	1,959,548
負債合計	4,286,156	1,959,548
純資産の部		
元本等		
元本	1,368,582,874	1,748,968,706
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	95,073,109	229,117,657
（分配準備積立金）	5,987,447	23,609,226
元本等合計	463,655,983	978,086,363
純資産合計	463,655,983	978,086,363
負債純資産合計	467,942,139	980,045,911

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	10,793,928	25,459,223
営業収益合計	10,793,928	25,459,223
営業費用		
受託者報酬	62,439	154,126
委託者報酬	811,492	2,003,578
その他費用	31,025	76,878
営業費用合計	904,956	2,234,582
営業利益又は営業損失（ ）	9,888,972	23,224,641
経常利益又は経常損失（ ）	9,888,972	23,224,641
当期純利益又は当期純損失（ ）	9,888,972	23,224,641
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（ ）	7,281,337	3,572,724
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	10,333,524	95,073,109
剰余金増加額又は欠損金減少額	110,827,627	152,839,227
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	110,827,627	152,839,227
剰余金減少額又は欠損金増加額	28,695,677	38,446,596
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	28,695,677	38,446,596
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（ ）	95,073,109	229,117,657

(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4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第3期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第3期 [2022年 1月25日現在]	第4期 [2023年 1月25日現在]
1. 1 期首元本額	69,341,722円	368,582,874円
期中追加設定元本額	434,498,332円	524,519,145円
期中一部解約元本額	135,257,180円	144,133,313円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	368,582,874口	748,968,706口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
<p>1 分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,331,756円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（89,085,662円）及び分配準備積立金（2,655,691円）より、分配対象額は95,073,109円（1万口当たり2,579.40円）ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>1 分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（11,421,806円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（7,685,676円）、投資信託約款に規定される収益調整金（205,508,431円）及び分配準備積立金（4,501,744円）より、分配対象額は229,117,657円（1万口当たり3,059.09円）ですが、分配を行っておりません。</p>

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期 [2022年 1月25日現在]	第4期 [2023年 1月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左

	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

第3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	2,583,349円
合計	2,583,349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4期（自 2022年1月26日 至 2023年1月25日）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	23,440,334円
合計	23,440,334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3期 [2022年 1月25日現在]		第4期 [2023年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2579円 12,579円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3059円 13,059円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
親投資信託 受益証券	T M A日本株T O P I Xマザーファンド	195,274,138	347,275,527	
	T M A外国債券インデックスマザーファンド	56,800,810	96,561,377	
	T M A外国株式インデックスマザーファンド	82,980,639	343,880,066	
	T M A日本債券インデックスマザーファンド	154,405,490	190,304,766	
親投資信託受益証券 合計		489,461,077	978,021,736	
合計		489,461,077	978,021,736	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（ご参考）

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

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[2022年 1月25日現在]	[2023年 1月25日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	23,205,064,108円	23,726,938,838円
同期中における追加設定元本額	10,647,555,407円	5,866,161,102円
同期中における一部解約元本額	10,125,680,677円	5,740,639,025円
同期末における元本額	23,726,938,838円	23,852,460,915円
元本の内訳*		
円資産バランスファンド2018 - 09 < 適格機関投資家限定 >	97,698,496円	36,060,550円
円資産バランスファンド2019 - 05 < 適格機関投資家限定 >	356,829,745円	131,700,571円
円資産バランスファンド2019 - 09 < 適格機関投資家限定 >	263,486,331円	97,231,433円
円資産バランスファンド2019 - 12 < 適格機関投資家限定 >	362,049,570円	133,598,486円
東京海上セレクション・日本株TOPIX	15,780,191,330円	16,706,542,164円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	10,832,087円	7,844,364円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	137,306,023円	324,325,891円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	70,755,058円	176,536,831円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	46,416,303円	111,856,787円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	98,180,784円	195,274,138円
TMA日本株式インデックスVA<適格機関投資家限定>	609,512,309円	777,803,719円
東京海上・世界インデックス・バランス40 <適格機関投資家限定>	199,901,079円	269,737,004円
東京海上・世界インデックス・バランス60 <適格機関投資家限定>	1,325,201,502円	1,771,350,438円
東京海上・TOPIXインデックスファンド<適格機関投資家限定>	4,071,292,052円	2,895,680,866円
円資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	223,319,366円	82,378,826円
円資産インデックスバランス<円奏会ベーシック>（適格機関投資家専用）	73,966,803円	134,538,847円
計	23,726,938,838円	23,852,460,915円
2. 1 本書における開示対象ファンドの計算期間 末日における当該親投資信託の受益権の総 数	23,726,938,838口	23,852,460,915口
3. 2 担保資産	代用有価証券として、 担保に供している資産 は次のとおりでありま す。 株式 873,030,000円	代用有価証券として、 担保に供している資産 は次のとおりでありま す。 株式 860,160,000円

（注1）*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（注2）3.については、決算日現在の代用有価証券の時価額を記載

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

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

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

・ 金融商品の時価等に関する事項

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

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

(有価証券に関する注記)

(自 2021年1月26日 至 2022年1月25日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,620,082,033円
合計	1,620,082,033円

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2021年3月23日から2022年1月25日まで)を指しております。

(自 2022年1月26日 至 2023年1月25日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,108,736,452円
合計	1,108,736,452円

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2022年3月23日から2023年1月25日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

(2022年1月25日現在)

(単位：円)

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

(2023年1月25日現在)

(単位：円)

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

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

[2022年 1月25日現在]		[2023年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6553円 16,553円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7784円 17,784円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘 柄	株式数	評価額		備 考
		単価	金額	
ニッセイ	20,500	531.00	10,885,500	
マルハニチロ	3,300	2,432.00	8,025,600	
サカタのタネ	2,600	4,055.00	10,543,000	
ホクト	2,600	1,881.00	4,890,600	
I N P E X	73,900	1,472.00	108,780,800	
石油資源開発	2,900	4,275.00	12,397,500	
K & O エナジーグループ	3,000	2,010.00	6,030,000	
ショーボンドホールディングス	2,600	5,360.00	13,936,000	
ミライト・ワン	5,900	1,579.00	9,316,100	
ベステラ	4,900	981.00	4,806,900	
安藤・間	12,900	860.00	11,094,000	
東急建設	10,700	658.00	7,040,600	
コムシスホールディングス	7,100	2,411.00	17,118,100	
東建コーポレーション	800	7,840.00	6,272,000	
ヤマウラ	4,800	1,055.00	5,064,000	
オリエンタル白石	21,700	308.00	6,683,600	
大成建設	13,700	4,470.00	61,239,000	

大林組	47,500	992.00	47,120,000
清水建設	44,500	717.00	31,906,500
長谷工コーポレーション	14,300	1,486.00	21,249,800
鹿島建設	33,900	1,566.00	53,087,400
西松建設	3,300	4,045.00	13,348,500
三井住友建設	13,600	418.00	5,684,800
奥村組	2,700	3,015.00	8,140,500
東鉄工業	2,900	2,669.00	7,740,100
戸田建設	19,900	706.00	14,049,400
熊谷組	2,700	2,650.00	7,155,000
東亜建設工業	2,800	2,474.00	6,927,200
五洋建設	20,900	644.00	13,459,600
住友林業	11,400	2,400.00	27,360,000
日本基礎技術	5,800	530.00	3,074,000
大和ハウス工業	39,400	3,117.00	122,809,800
積水ハウス	46,300	2,499.50	115,726,850
北陸電気工事	4,800	689.00	3,307,200
中電工	2,400	2,109.00	5,061,600
関電工	7,000	859.00	6,013,000
きんでん	7,900	1,420.00	11,218,000
日本電設工業	4,400	1,609.00	7,079,600
エクシオグループ	6,700	2,319.00	15,537,300
新日本空調	2,800	1,918.00	5,370,400
九電工	2,800	3,350.00	9,380,000
三機工業	4,200	1,533.00	6,438,600
日揮ホールディングス	15,800	1,714.00	27,081,200
中外炉工業	2,200	1,711.00	3,764,200
ヤマト	6,500	729.00	4,738,500
高砂熱学工業	4,900	1,820.00	8,918,000
三晃金属工業	1,400	3,490.00	4,886,000
大気社	2,400	3,505.00	8,412,000
日比谷総合設備	3,600	1,981.00	7,131,600
インフロニア・ホールディングス	16,200	1,035.00	16,767,000
レイズネクスト	5,700	1,315.00	7,495,500
ニッポン	4,000	1,607.00	6,428,000
日清製粉グループ本社	16,000	1,620.00	25,920,000
鳥越製粉	6,000	588.00	3,528,000
日本甜菜製糖	1,500	1,653.00	2,479,500
DM三井製糖ホールディングス	3,700	2,001.00	7,403,700
森永製菓	3,400	3,790.00	12,886,000
江崎グリコ	4,100	3,545.00	14,534,500
山崎製パン	11,500	1,508.00	17,342,000
亀田製菓	1,900	4,290.00	8,151,000
寿スピリッツ	1,700	8,480.00	14,416,000
カルビー	7,600	2,929.00	22,260,400

森永乳業	2,800	4,745.00	13,286,000
ヤクルト本社	10,300	9,310.00	95,893,000
明治ホールディングス	8,800	6,700.00	58,960,000
雪印メグミルク	2,900	1,783.00	5,170,700
プリマハム	2,400	2,148.00	5,155,200
日本ハム	4,800	3,780.00	18,144,000
丸大食品	3,000	1,461.00	4,383,000
S Foods	2,400	2,861.00	6,866,400
伊藤ハム米久ホールディングス	10,600	705.00	7,473,000
サッポロホールディングス	5,200	3,070.00	15,964,000
アサヒグループホールディングス	32,200	4,296.00	138,331,200
キリンホールディングス	62,800	1,994.50	125,254,600
宝ホールディングス	11,600	1,051.00	12,191,600
オエノンホールディングス	11,800	255.00	3,009,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	9,500	1,348.00	12,806,000
サントリー食品インターナショナル	9,400	4,360.00	40,984,000
ダイドーグループホールディングス	1,200	4,760.00	5,712,000
伊藤園	4,900	4,155.00	20,359,500
キーコーヒー	3,700	2,099.00	7,766,300
ユニカフェ	3,600	896.00	3,225,600
ジャパンフーズ	3,800	1,077.00	4,092,600
日清オイリオグループ	2,000	3,140.00	6,280,000
不二製油グループ本社	3,100	2,019.00	6,258,900
J - オイルミルズ	4,400	1,557.00	6,850,800
キッコーマン	9,800	6,840.00	67,032,000
味の素	34,100	4,262.00	145,334,200
キューピー	8,300	2,213.00	18,367,900
ハウス食品グループ本社	5,000	2,737.00	13,685,000
カゴメ	5,600	3,075.00	17,220,000
アリアケジャパン	1,800	4,240.00	7,632,000
ニチレイ	6,500	2,685.00	17,452,500
東洋水産	7,500	5,150.00	38,625,000
日清食品ホールディングス	5,200	10,090.00	52,468,000
フジッコ	3,600	1,893.00	6,814,800
ロック・フィールド	3,300	1,569.00	5,177,700
日本たばこ産業	92,700	2,675.50	248,018,850
ユーグレナ	13,600	999.00	13,586,400
片倉工業	2,400	1,756.00	4,214,400
ゲンゼ	1,300	4,175.00	5,427,500
東洋紡	5,900	1,014.00	5,982,600
倉敷紡績	3,000	2,205.00	6,615,000
日本毛織	6,400	959.00	6,137,600
帝国繊維	2,300	1,534.00	3,528,200
帝人	13,800	1,300.00	17,940,000

東レ	93,900	783.90	73,608,210
日本フェルト	8,000	410.00	3,280,000
セーレン	3,700	2,308.00	8,539,600
小松マテーレ	6,100	764.00	4,660,400
ワコールホールディングス	3,500	2,397.00	8,389,500
ホギメディカル	2,300	3,570.00	8,211,000
T S Iホールディングス	11,000	492.00	5,412,000
ゴールドウイン	2,400	9,670.00	23,208,000
デザート	3,400	3,195.00	10,863,000
特種東海製紙	1,600	2,870.00	4,592,000
王子ホールディングス	54,400	529.00	28,777,600
日本製紙	6,500	935.00	6,077,500
三菱製紙	1,800	281.00	505,800
北越コーポレーション	13,500	830.00	11,205,000
大王製紙	6,900	985.00	6,796,500
レンゴー	9,700	910.00	8,827,000
ザ・パック	1,900	2,530.00	4,807,000
クラレ	21,100	1,051.00	22,176,100
旭化成	92,700	952.70	88,315,290
共和レザー	5,800	517.00	2,998,600
レゾナック・ホールディングス	12,600	2,225.00	28,035,000
住友化学	108,100	491.00	53,077,100
日産化学	7,000	6,000.00	42,000,000
クレハ	1,000	8,510.00	8,510,000
石原産業	5,000	1,097.00	5,485,000
片倉コープアグリ	3,300	1,732.00	5,715,600
日本曹達	1,900	4,085.00	7,761,500
東ソー	19,300	1,622.00	31,304,600
トクヤマ	3,000	1,837.00	5,511,000
セントラル硝子	2,900	2,798.00	8,114,200
東亜合成	8,600	1,175.00	10,105,000
大阪ソーダ	1,900	4,180.00	7,942,000
デンカ	5,100	2,652.00	13,525,200
信越化学工業	24,900	17,475.00	435,127,500
堺化学工業	2,400	1,813.00	4,351,200
エア・ウォーター	13,600	1,557.00	21,175,200
日本酸素ホールディングス	13,200	2,096.00	27,667,200
日本パーカライジング	7,500	951.00	7,132,500
ステラ ケミファ	2,000	2,567.00	5,134,000
日本触媒	1,700	5,390.00	9,163,000
カネカ	3,300	3,340.00	11,022,000
三菱瓦斯化学	12,000	1,851.00	22,212,000
三井化学	12,200	3,055.00	37,271,000
J S R	14,800	2,946.00	43,600,800
東京応化工業	2,300	6,480.00	14,904,000

三菱ケミカルグループ	96,500	731.50	70,589,750
KHネオケム	3,700	2,770.00	10,249,000
ダイセル	20,700	947.00	19,602,900
住友ベークライト	1,900	4,245.00	8,065,500
積水化学工業	29,500	1,919.00	56,610,500
日本ゼオン	11,900	1,320.00	15,708,000
アイカ工業	3,900	3,065.00	11,953,500
UBE	6,000	1,988.00	11,928,000
旭有機材	2,700	2,918.00	7,878,600
タイガースポリマー	7,200	405.00	2,916,000
ミライアル	3,000	1,543.00	4,629,000
日本化薬	9,000	1,181.00	10,629,000
ADEKA	6,600	2,136.00	14,097,600
日油	4,200	5,440.00	22,848,000
ハリマ化成グループ	4,700	837.00	3,933,900
花王	34,800	5,230.00	182,004,000
ニイタカ	2,300	1,966.00	4,521,800
三洋化成工業	1,100	4,180.00	4,598,000
日本ペイントホールディングス	62,600	1,194.00	74,744,400
関西ペイント	14,600	1,709.00	24,951,400
中国塗料	6,900	1,006.00	6,941,400
太陽ホールディングス	3,100	2,356.00	7,303,600
DIC	4,500	2,375.00	10,687,500
サカタインクス	6,600	1,071.00	7,068,600
東洋インキSCホールディングス	3,300	1,828.00	6,032,400
富士フイルムホールディングス	27,700	6,920.00	191,684,000
資生堂	29,800	6,484.00	193,223,200
ライオン	16,400	1,422.00	23,320,800
高砂香料工業	2,100	2,545.00	5,344,500
マンダム	4,100	1,420.00	5,822,000
ミルボン	1,700	5,590.00	9,503,000
ファンケル	6,600	2,656.00	17,529,600
コーセー	2,900	14,130.00	40,977,000
コタ	3,700	1,702.00	6,297,400
ポーラ・オルビスホールディングス	6,100	1,789.00	10,912,900
ノエビアホールディングス	1,000	5,610.00	5,610,000
エステー	3,300	1,582.00	5,220,600
長谷川香料	2,900	3,080.00	8,932,000
小林製薬	4,200	9,170.00	38,514,000
荒川化学工業	4,500	995.00	4,477,500
メック	2,700	2,475.00	6,682,500
タカラバイオ	4,900	1,745.00	8,550,500
JCU	2,700	3,185.00	8,599,500
デクセリアルズ	5,200	2,769.00	14,398,800
アース製薬	1,200	5,000.00	6,000,000

大成ラミック	1,700	3,000.00	5,100,000
クミアイ化学工業	8,600	860.00	7,396,000
日本農薬	8,800	697.00	6,133,600
日東電工	10,200	8,110.00	82,722,000
レック	6,400	998.00	6,387,200
前澤化成工業	4,200	1,372.00	5,762,400
エフピコ	2,600	3,445.00	8,957,000
天馬	2,500	2,201.00	5,502,500
信越ポリマー	5,000	1,235.00	6,175,000
ニフコ	5,300	3,315.00	17,569,500
バルカー	1,800	2,775.00	4,995,000
ユニ・チャーム	29,600	4,930.00	145,928,000
協和キリン	16,500	2,930.00	48,345,000
武田薬品工業	127,700	4,220.00	538,894,000
アステラス製薬	138,000	1,977.50	272,895,000
住友ファーマ	11,100	897.00	9,956,700
塩野義製薬	19,200	6,296.00	120,883,200
日本新薬	3,700	6,760.00	25,012,000
中外製薬	44,500	3,463.00	154,103,500
科研製薬	1,900	3,815.00	7,248,500
エーザイ	18,000	8,316.00	149,688,000
ロート製薬	16,200	2,332.00	37,778,400
小野薬品工業	29,200	2,921.50	85,307,800
久光製薬	4,100	3,965.00	16,256,500
持田製薬	1,900	3,450.00	6,555,000
参天製薬	26,800	1,022.00	27,389,600
ツムラ	4,300	2,753.00	11,837,900
キッセイ薬品工業	1,900	2,553.00	4,850,700
生化学工業	6,900	842.00	5,809,800
栄研化学	3,700	1,658.00	6,134,600
鳥居薬品	2,100	3,080.00	6,468,000
JCRファーマ	5,000	1,687.00	8,435,000
東和薬品	2,700	2,044.00	5,518,800
ゼリア新薬工業	4,000	2,180.00	8,720,000
第一三共	125,800	4,390.00	552,262,000
キョーリン製薬ホールディングス	4,000	1,716.00	6,864,000
大幸薬品	9,700	388.00	3,763,600
大塚ホールディングス	32,500	4,226.00	137,345,000
大正製薬ホールディングス	2,900	5,480.00	15,892,000
ペプチドリーム	8,000	2,069.00	16,552,000
あすか製薬ホールディングス	4,600	1,281.00	5,892,600
サワイグループホールディングス	2,700	3,935.00	10,624,500
ニチレキ	4,700	1,347.00	6,330,900
出光興産	16,200	3,375.00	54,675,000
ENEOSホールディングス	255,500	477.20	121,924,600

コスモエネルギーホールディングス	6,600	3,765.00	24,849,000	
横浜ゴム	8,600	2,112.00	18,163,200	
TOYO TIRE	7,900	1,524.00	12,039,600	
ブリヂストン	45,800	4,876.00	223,320,800	
住友ゴム工業	13,600	1,149.00	15,626,400	
オカモト	1,300	3,835.00	4,985,500	
ニッタ	2,000	2,833.00	5,666,000	
住友理工	2,800	651.00	1,822,800	
バンドー化学	6,800	1,019.00	6,929,200	
日東紡績	2,700	2,020.00	5,454,000	
A G C	14,100	4,735.00	66,763,500	
日本山村硝子	4,800	538.00	2,582,400	
日本電気硝子	5,200	2,418.00	12,573,600	
住友大阪セメント	2,700	3,240.00	8,748,000	
太平洋セメント	8,800	2,116.00	18,620,800	
日本ヒューム	6,900	669.00	4,616,100	
東海カーボン	12,800	1,121.00	14,348,800	
東洋炭素	2,000	4,060.00	8,120,000	
TOTO	9,600	5,040.00	48,384,000	
日本碍子	16,800	1,764.00	29,635,200	
日本特殊陶業	11,800	2,560.00	30,208,000	
MARUWA	700	17,630.00	12,341,000	
フジミインコーポレーテッド	1,700	6,810.00	11,577,000	
ニチアス	3,600	2,437.00	8,773,200	
ニチハ	1,900	2,735.00	5,196,500	
日本製鉄	67,600	2,731.50	184,649,400	
神戸製鋼所	26,500	692.00	18,338,000	
J F Eホールディングス	37,800	1,713.00	64,751,400	
東京製鐵	7,100	1,373.00	9,748,300	
共英製鋼	3,500	1,400.00	4,900,000	
大和工業	2,400	5,180.00	12,432,000	
大阪製鐵	2,100	1,275.00	2,677,500	
淀川製鋼所	2,200	2,732.00	6,010,400	
丸一鋼管	4,900	2,827.00	13,852,300	
大同特殊鋼	2,100	4,735.00	9,943,500	
山陽特殊製鋼	3,000	2,436.00	7,308,000	
愛知製鋼	1,100	2,304.00	2,534,400	
大平洋金属	3,300	2,037.00	6,722,100	
新日本電工	19,800	389.00	7,702,200	
三菱製鋼	4,000	1,133.00	4,532,000	
シンニッタン	12,500	235.00	2,937,500	
日本軽金属ホールディングス	4,100	1,605.00	6,580,500	
三井金属鉱業	4,100	3,395.00	13,919,500	
東邦亜鉛	2,500	2,194.00	5,485,000	
三菱マテリアル	9,500	2,235.00	21,232,500	

住友金属鉱山	18,100	5,333.00	96,527,300
DOWAホールディングス	4,100	4,460.00	18,286,000
古河機械金属	4,200	1,319.00	5,539,800
UACJ	3,500	2,520.00	8,820,000
古河電気工業	3,900	2,473.00	9,644,700
住友電気工業	54,200	1,537.00	83,305,400
フジクラ	20,000	989.00	19,780,000
タツタ電線	2,700	713.00	1,925,100
リョービ	4,500	1,206.00	5,427,000
アサヒホールディングス	7,600	2,053.00	15,602,800
トーカロ	4,800	1,241.00	5,956,800
SUMCO	26,900	1,982.00	53,315,800
東洋製罐グループホールディングス	8,200	1,658.00	13,595,600
横河ブリッジホールディングス	4,000	1,900.00	7,600,000
駒井ハルテック	1,600	1,557.00	2,491,200
三和ホールディングス	13,200	1,265.00	16,698,000
文化シャッター	6,400	1,148.00	7,347,200
三協立山	5,300	651.00	3,450,300
LIXIL	23,500	2,162.00	50,807,000
ノーリツ	4,800	1,467.00	7,041,600
長府製作所	2,300	2,064.00	4,747,200
リンナイ	2,700	9,970.00	26,919,000
日東精工	9,600	509.00	4,886,400
東プレ	4,900	1,230.00	6,027,000
高周波熱錬	7,000	683.00	4,781,000
パイオラックス	4,600	1,763.00	8,109,800
日本発條	15,600	878.00	13,696,800
三益半導体工業	2,500	2,596.00	6,490,000
日本製鋼所	5,200	2,684.00	13,956,800
三浦工業	6,200	3,255.00	20,181,000
タクマ	6,100	1,269.00	7,740,900
オークマ	1,500	5,080.00	7,620,000
芝浦機械	2,700	2,827.00	7,632,900
アマダ	22,600	1,143.00	25,831,800
アイダエンジニアリング	6,000	799.00	4,794,000
FUJ I	5,400	2,127.00	11,485,800
牧野フライス製作所	1,900	4,515.00	8,578,500
オーエスジー	7,100	1,983.00	14,079,300
旭ダイヤモンド工業	10,700	729.00	7,800,300
DMG森精機	9,200	1,969.00	18,114,800
ディスコ	2,400	39,000.00	93,600,000
日東工器	3,000	1,546.00	4,638,000
島精機製作所	3,100	1,963.00	6,085,300
日阪製作所	5,200	847.00	4,404,400
ナブテスコ	8,700	3,700.00	32,190,000

S M C	4,700	65,000.00	305,500,000	
ユニオンツール	1,200	3,370.00	4,044,000	
オイレス工業	4,300	1,518.00	6,527,400	
サトーホールディングス	4,000	2,070.00	8,280,000	
小松製作所	69,900	3,125.00	218,437,500	
住友重機械工業	7,600	2,790.00	21,204,000	
日立建機	6,400	3,075.00	19,680,000	
巴工業	2,400	2,416.00	5,798,400	
井関農機	3,800	1,217.00	4,624,600	
ローツェ	1,200	10,140.00	12,168,000	
タカキタ	10,000	436.00	4,360,000	
クボタ	75,800	1,918.50	145,422,300	
月島機械	4,800	1,032.00	4,953,600	
帝国電機製作所	2,900	2,411.00	6,991,900	
新東工業	3,700	714.00	2,641,800	
小森コーポレーション	6,700	885.00	5,929,500	
鶴見製作所	3,300	2,013.00	6,642,900	
荏原製作所	5,400	5,520.00	29,808,000	
西島製作所	4,500	1,506.00	6,777,000	
ダイキン工業	17,600	22,955.00	404,008,000	
栗田工業	7,900	5,930.00	46,847,000	
椿本チエイン	2,100	3,070.00	6,447,000	
ダイフク	7,800	7,160.00	55,848,000	
タダノ	8,100	943.00	7,638,300	
フジテック	5,600	3,225.00	18,060,000	
C K D	3,900	2,007.00	7,827,300	
平和	3,900	2,338.00	9,118,200	
S A N K Y O	3,200	5,180.00	16,576,000	
日本金銭機械	7,100	1,166.00	8,278,600	
フクシマガリレイ	1,400	4,370.00	6,118,000	
竹内製作所	4,100	2,811.00	11,525,100	
アマノ	3,700	2,409.00	8,913,300	
グローリー	4,200	2,231.00	9,370,200	
大和冷機工業	5,900	1,214.00	7,162,600	
セガサミーホールディングス	13,500	2,029.00	27,391,500	
リケン	600	2,338.00	1,402,800	
ホシザキ	8,800	4,630.00	40,744,000	
大豊工業	6,400	650.00	4,160,000	
日本精工	30,800	725.00	22,330,000	
N T N	40,100	270.00	10,827,000	
ジェイテクト	14,900	935.00	13,931,500	
不二越	1,700	3,755.00	6,383,500	
日本トムソン	6,400	594.00	3,801,600	
T H K	8,900	2,724.00	24,243,600	
ユーシン精機	6,100	686.00	4,184,600	

キッツ	7,400	810.00	5,994,000
マキタ	18,000	3,485.00	62,730,000
日立造船	16,800	836.00	14,044,800
三菱重工業	25,000	5,059.00	126,475,000
I H I	10,500	3,895.00	40,897,500
スター精密	3,700	1,664.00	6,156,800
日清紡ホールディングス	9,000	962.00	8,658,000
イビデン	8,800	5,280.00	46,464,000
コニカミノルタ	32,800	552.00	18,105,600
ブラザー工業	18,100	1,994.00	36,091,400
ミネベアミツミ	25,200	2,189.00	55,162,800
日立製作所	74,000	6,917.00	511,858,000
東芝	28,800	4,539.00	130,723,200
三菱電機	148,800	1,405.00	209,064,000
富士電機	8,900	5,330.00	47,437,000
安川電機	16,700	4,890.00	81,663,000
明電舎	3,900	1,917.00	7,476,300
東芝テック	1,600	3,690.00	5,904,000
マブチモーター	3,800	3,680.00	13,984,000
日本電産	36,000	7,145.00	257,220,000
東光高岳	3,300	2,205.00	7,276,500
ダイヘン	2,200	4,165.00	9,163,000
日新電機	4,400	1,332.00	5,860,800
オムロン	13,200	7,153.00	94,419,600
日東工業	3,500	2,426.00	8,491,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,200	2,262.00	11,762,400
メルコホールディングス	1,700	3,420.00	5,814,000
テクノメディカ	1,800	1,821.00	3,277,800
日本電気	20,000	4,610.00	92,200,000
富士通	14,800	18,850.00	278,980,000
沖電気工業	4,700	730.00	3,431,000
サンケン電気	1,700	7,220.00	12,274,000
アイホン	2,700	1,914.00	5,167,800
ルネサスエレクトロニクス	93,100	1,352.50	125,917,750
セイコーエプソン	18,000	1,991.00	35,838,000
ワコム	14,000	633.00	8,862,000
アルバック	3,300	6,070.00	20,031,000
E I Z O	1,500	3,615.00	5,422,500
日本信号	5,200	1,055.00	5,486,000
能美防災	2,600	1,692.00	4,399,200
ホーチキ	3,900	1,437.00	5,604,300
エレコム	6,100	1,340.00	8,174,000
パナソニック ホールディングス	170,100	1,171.50	199,272,150
シャープ	17,800	1,071.00	19,063,800
アンリツ	9,700	1,280.00	12,416,000

富士通ゼネラル	4,400	3,705.00	16,302,000
ソニーグループ	102,700	11,665.00	1,197,995,500
T D K	23,900	4,610.00	110,179,000
アルプスアルパイン	12,500	1,291.00	16,137,500
日本トリム	1,300	2,985.00	3,880,500
フォスター電機	4,900	938.00	4,596,200
ヨコオ	2,500	2,236.00	5,590,000
ホシデン	5,900	1,560.00	9,204,000
ヒロセ電機	2,300	16,850.00	38,755,000
日本航空電子工業	3,800	2,246.00	8,534,800
アイコム	2,200	2,574.00	5,662,800
横河電機	14,700	2,246.00	33,016,200
アズビル	9,400	3,660.00	34,404,000
日本光電工業	6,200	3,325.00	20,615,000
堀場製作所	2,800	5,970.00	16,716,000
アドバンテスト	11,800	9,840.00	116,112,000
キーエンス	14,500	59,940.00	869,130,000
日置電機	1,000	6,590.00	6,590,000
シスメックス	12,200	8,643.00	105,444,600
O B A R A G R O U P	1,800	3,695.00	6,651,000
コーセル	7,100	1,109.00	7,873,900
イリソ電子工業	1,900	4,350.00	8,265,000
オブテックスグループ	4,300	2,060.00	8,858,000
千代田インテグレ	2,400	2,293.00	5,503,200
レーザーテック	7,300	26,380.00	192,574,000
スタンレー電気	10,700	2,688.00	28,761,600
ウシオ電機	8,700	1,726.00	15,016,200
日本セラミック	1,900	2,370.00	4,503,000
図研	2,500	3,035.00	7,587,500
日本電子	3,400	3,845.00	13,073,000
カシオ計算機	12,200	1,356.00	16,543,200
ファナック	14,200	22,270.00	316,234,000
ローム	6,600	10,340.00	68,244,000
浜松ホトニクス	11,200	7,060.00	79,072,000
三井ハイテック	1,800	6,900.00	12,420,000
新光電気工業	5,800	3,830.00	22,214,000
京セラ	22,100	6,682.00	147,672,200
太陽誘電	7,900	4,505.00	35,589,500
村田製作所	44,200	7,578.00	334,947,600
双葉電子工業	7,700	560.00	4,312,000
ニチコン	6,100	1,279.00	7,801,900
日本ケミコン	3,800	1,653.00	6,281,400
K O A	4,200	1,958.00	8,223,600
小糸製作所	16,000	2,118.00	33,888,000
ミツバ	7,500	481.00	3,607,500

S C R E E Nホールディングス	2,900	9,690.00	28,101,000	
キヤノン電子	3,500	1,560.00	5,460,000	
キヤノン	78,400	2,939.00	230,417,600	
リコー	38,100	1,010.00	38,481,000	
象印マホービン	4,100	1,618.00	6,633,800	
東京エレクトロン	10,300	46,380.00	477,714,000	
イノテック	2,800	1,351.00	3,782,800	
トヨタ紡織	5,800	1,885.00	10,933,000	
ユニプレス	7,300	771.00	5,628,300	
豊田自動織機	11,100	7,930.00	88,023,000	
モリタホールディングス	6,100	1,172.00	7,149,200	
デンソー	30,300	6,923.00	209,766,900	
東海理化電機製作所	3,600	1,461.00	5,259,600	
川崎重工業	11,800	2,926.00	34,526,800	
日産自動車	199,100	444.40	88,480,040	
いすゞ自動車	44,700	1,605.00	71,743,500	
トヨタ自動車	793,400	1,905.00	1,511,427,000	300,000株
日野自動車	21,000	530.00	11,130,000	
三菱自動車工業	64,300	497.00	31,957,100	
武蔵精密工業	5,300	1,719.00	9,110,700	
日産車体	4,800	863.00	4,142,400	
新明和工業	5,400	1,047.00	5,653,800	
極東開発工業	4,200	1,465.00	6,153,000	
トピー工業	3,300	1,647.00	5,435,100	
ティラド	1,600	2,722.00	4,355,200	
N O K	7,600	1,207.00	9,173,200	
フタバ産業	5,900	373.00	2,200,700	
K Y B	2,700	3,615.00	9,760,500	
プレス工業	17,300	438.00	7,577,400	
アイシン	10,400	3,710.00	38,584,000	
マツダ	48,800	1,007.00	49,141,600	
今仙電機製作所	5,900	700.00	4,130,000	
本田技研工業	116,800	3,147.00	367,569,600	
スズキ	27,400	4,720.00	129,328,000	
S U B A R U	44,400	2,082.00	92,440,800	
ヤマハ発動機	21,800	3,175.00	69,215,000	
エクセディ	3,700	1,650.00	6,105,000	
豊田合成	4,500	2,095.00	9,427,500	
愛三工業	7,300	725.00	5,292,500	
ヨロズ	4,300	722.00	3,104,600	
エフ・シー・シー	3,300	1,398.00	4,613,400	
シマノ	5,800	23,245.00	134,821,000	
テイ・エス テック	6,500	1,584.00	10,296,000	
テルモ	46,000	3,817.00	175,582,000	
クリエートメディック	4,000	882.00	3,528,000	

島津製作所	18,700	3,970.00	74,239,000
ブイ・テクノロジー	2,200	2,732.00	6,010,400
東京精密	2,600	4,605.00	11,973,000
マニー	5,700	1,915.00	10,915,500
ニコン	23,000	1,261.00	29,003,000
トプコン	9,000	1,626.00	14,634,000
オリンパス	90,200	2,418.00	218,103,600
理研計器	1,500	4,630.00	6,945,000
タムロン	2,500	3,095.00	7,737,500
HOYA	31,300	14,350.00	449,155,000
朝日インテック	18,800	2,287.00	42,995,600
シチズン時計	20,800	598.00	12,438,400
メニコン	5,600	2,845.00	15,932,000
セイコーグループ	3,600	2,877.00	10,357,200
ニプロ	10,600	1,038.00	11,002,800
パラマウントベッドホールディングス	3,900	2,523.00	9,839,700
バンダイナムコホールディングス	13,400	8,615.00	115,441,000
アイフィスジャパン	4,400	603.00	2,653,200
パイロットコーポレーション	2,000	4,540.00	9,080,000
フジシールインターナショナル	3,400	1,645.00	5,593,000
タカラトミー	6,700	1,266.00	8,482,200
タカノ	4,100	675.00	2,767,500
大建工業	3,000	2,188.00	6,564,000
凸版印刷	20,700	2,058.00	42,600,600
大日本印刷	17,100	3,000.00	51,300,000
NISSHA	4,200	1,903.00	7,992,600
アシックス	13,600	2,954.00	40,174,400
小松ウオール工業	2,200	1,859.00	4,089,800
ヤマハ	8,800	4,990.00	43,912,000
クリナップ	8,700	647.00	5,628,900
ビジョン	9,500	2,057.00	19,541,500
キングジム	6,300	902.00	5,682,600
リンテック	2,800	2,186.00	6,120,800
イトーキ	9,700	693.00	6,722,100
任天堂	92,100	5,574.00	513,365,400
三菱鉛筆	5,000	1,426.00	7,130,000
タカラスタANDARD	3,700	1,391.00	5,146,700
コクヨ	6,800	1,824.00	12,403,200
オカムラ	6,500	1,421.00	9,236,500
美津濃	2,400	2,810.00	6,744,000
東京電力ホールディングス	126,500	466.00	58,949,000
中部電力	50,700	1,281.00	64,946,700
関西電力	55,200	1,238.00	68,337,600
中国電力	22,100	669.00	14,784,900
北陸電力	14,700	508.00	7,467,600

東北電力	35,500	662.00	23,501,000	
四国電力	14,000	724.00	10,136,000	
九州電力	33,100	718.00	23,765,800	
北海道電力	16,600	453.00	7,519,800	
沖縄電力	5,100	1,030.00	5,253,000	
電源開発	12,300	2,066.00	25,411,800	
レノバ	4,500	2,290.00	10,305,000	
東京瓦斯	29,300	2,530.00	74,129,000	
大阪瓦斯	27,700	2,042.00	56,563,400	
東邦瓦斯	7,100	2,374.00	16,855,400	
北海道瓦斯	3,600	1,676.00	6,033,600	
西部ガスホールディングス	2,200	1,732.00	3,810,400	
静岡ガス	5,700	1,066.00	6,076,200	
東武鉄道	14,900	3,055.00	45,519,500	
相鉄ホールディングス	4,900	2,207.00	10,814,300	
東急	38,600	1,657.00	63,960,200	
京浜急行電鉄	19,700	1,348.00	26,555,600	
小田急電鉄	20,100	1,674.00	33,647,400	
京王電鉄	7,400	4,635.00	34,299,000	
京成電鉄	9,800	3,770.00	36,946,000	
富士急行	2,600	4,640.00	12,064,000	
東日本旅客鉄道	25,000	7,392.00	184,800,000	
西日本旅客鉄道	17,900	5,588.00	100,025,200	
東海旅客鉄道	11,400	16,130.00	183,882,000	
西武ホールディングス	21,000	1,476.00	30,996,000	
西日本鉄道	3,600	2,397.00	8,629,200	
近鉄グループホールディングス	14,800	4,220.00	62,456,000	
阪急阪神ホールディングス	18,500	3,895.00	72,057,500	
南海電気鉄道	6,700	2,843.00	19,048,100	
京阪ホールディングス	6,400	3,545.00	22,688,000	
名古屋鉄道	14,600	2,152.00	31,419,200	
ヤマトホールディングス	20,200	2,100.00	42,420,000	
山九	3,600	4,810.00	17,316,000	
センコーグループホールディングス	8,600	975.00	8,385,000	
トナミホールディングス	600	3,620.00	2,172,000	
ニッコンホールディングス	3,400	2,424.00	8,241,600	
福山通運	2,400	3,075.00	7,380,000	
セイノーホールディングス	6,400	1,188.00	7,603,200	
日立物流	800	8,900.00	7,120,000	
C & F ロジホールディングス	3,500	1,228.00	4,298,000	
九州旅客鉄道	10,300	2,943.00	30,312,900	
S Gホールディングス	26,200	1,867.00	48,915,400	
NIPPON EXPRESSホールディングス	5,000	7,350.00	36,750,000	
日本郵船	40,200	3,242.00	130,328,400	

商船三井	25,700	3,395.00	87,251,500
川崎汽船	14,000	2,872.00	40,208,000
飯野海運	10,700	911.00	9,747,700
日本航空	34,300	2,747.00	94,222,100
A N Aホールディングス	38,200	2,885.00	110,207,000
三菱倉庫	3,900	2,958.00	11,536,200
三井倉庫ホールディングス	2,300	3,690.00	8,487,000
住友倉庫	5,000	1,971.00	9,855,000
東陽倉庫	13,900	268.00	3,725,200
安田倉庫	5,300	940.00	4,982,000
上組	7,600	2,641.00	20,071,600
キムラユニティー	6,500	797.00	5,180,500
キューソー流通システム	3,600	916.00	3,297,600
エーアイティー	3,900	1,462.00	5,701,800
N E C ネットエスアイ	5,200	1,759.00	9,146,800
システナ	23,200	409.00	9,488,800
デジタルアーツ	1,600	5,700.00	9,120,000
日鉄ソリューションズ	2,200	3,340.00	7,348,000
T I S	15,600	3,720.00	58,032,000
J N Sホールディングス	12,500	317.00	3,962,500
グリー	13,100	702.00	9,196,200
コーエーテクモホールディングス	10,300	2,444.00	25,173,200
ブレインパッド	6,000	747.00	4,482,000
K L a b	11,500	425.00	4,887,500
ネクソン	36,400	3,135.00	114,114,000
エイチーム	6,600	784.00	5,174,400
コロプラ	9,800	663.00	6,497,400
サイバーリンクス	4,500	999.00	4,495,500
C A R T A H O L D I N G S	2,800	1,681.00	4,706,800
S H I F T	1,200	25,250.00	30,300,000
ティーガイア	3,100	1,648.00	5,108,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,000	2,176.00	8,704,000
G M O ペイメントゲートウェイ	3,400	12,220.00	41,548,000
ザッパラス	10,800	353.00	3,812,400
インターネットイニシアティブ	10,000	2,366.00	23,660,000
ラクス	9,000	1,826.00	16,434,000
チェンジ	5,600	2,355.00	13,188,000
マネーフォワード	4,300	4,995.00	21,478,500
電算システムホールディングス	2,500	2,181.00	5,452,500
フェイス	4,000	499.00	1,996,000
野村総合研究所	29,300	3,260.00	95,518,000
C E ホールディングス	10,000	504.00	5,040,000
インテージホールディングス	4,700	1,563.00	7,346,100
ラクスル	3,400	2,910.00	9,894,000

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,400	1,670.00	4,008,000	
Sansan	7,900	1,680.00	13,272,000	
フジ・メディア・ホールディングス	10,800	1,082.00	11,685,600	
オービック	5,000	20,960.00	104,800,000	
ジャストシステム	3,400	3,165.00	10,761,000	
Zホールディングス	218,800	378.80	82,881,440	
トレンドマイクロ	8,500	6,300.00	53,550,000	
日本オラクル	2,600	8,880.00	23,088,000	
フューチャー	5,500	1,665.00	9,157,500	
CAC Holdings	3,900	1,456.00	5,678,400	
S Bテクノロジー	2,800	1,931.00	5,406,800	
オービックビジネスコンサルタント	2,300	4,990.00	11,477,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	7,500	3,125.00	23,437,500	
大塚商会	8,500	4,230.00	35,955,000	
サイボウズ	3,800	2,609.00	9,914,200	
電通国際情報サービス	2,500	4,170.00	10,425,000	
デジタルガレージ	2,500	4,580.00	11,450,000	
ウェザーニューズ	1,000	7,090.00	7,090,000	
日本エンタープライズ	33,500	129.00	4,321,500	
ネットワンシステムズ	6,600	3,540.00	23,364,000	
アルゴグラフィックス	2,500	3,760.00	9,400,000	
エイベックス	5,300	1,730.00	9,169,000	
BIPROGY	5,200	3,385.00	17,602,000	
兼松エレクトロニクス	1,700	4,605.00	7,828,500	
TBSホールディングス	5,400	1,516.00	8,186,400	
日本テレビホールディングス	9,800	1,046.00	10,250,800	
テレビ朝日ホールディングス	3,700	1,325.00	4,902,500	
スカパーJSATホールディングス	15,500	498.00	7,719,000	
テレビ東京ホールディングス	2,200	1,942.00	4,272,400	
日本電信電話	185,700	3,899.00	724,044,300	
KDDI	113,000	4,096.00	462,848,000	
ソフトバンク	236,300	1,489.50	351,968,850	
光通信	1,800	19,030.00	34,254,000	
GMOインターネットグループ	6,900	2,579.00	17,795,100	
KADOKAWA	9,400	2,464.00	23,161,600	
ゼンリン	6,500	810.00	5,265,000	
松竹	1,000	10,810.00	10,810,000	
東宝	9,200	4,785.00	44,022,000	
東映	400	17,260.00	6,904,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	44,000	2,003.00	88,132,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,900	2,013.00	5,837,700	
DTS	3,100	3,025.00	9,377,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,800	6,220.00	48,516,000	

カプコン	15,300	4,225.00	64,642,500
S C S K	10,600	2,077.00	22,016,200
アイネス	3,900	1,361.00	5,307,900
T K C	2,000	3,605.00	7,210,000
富士ソフト	1,600	7,660.00	12,256,000
N S D	4,800	2,313.00	11,102,400
コナミグループ	6,000	6,400.00	38,400,000
ソフトバンクグループ	84,600	6,183.00	523,081,800
伊藤忠食品	800	4,930.00	3,944,000
エレマテック	4,300	1,697.00	7,297,100
双日	17,700	2,559.00	45,294,300
アルフレッサ ホールディングス	13,500	1,621.00	21,883,500
横浜冷凍	6,500	1,086.00	7,059,000
神戸物産	11,900	3,855.00	45,874,500
あい ホールディングス	3,200	2,149.00	6,876,800
ダイワボウホールディングス	5,800	1,942.00	11,263,600
マクニカホールディングス	3,600	3,395.00	12,222,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,400	839.00	2,852,600
レスターホールディングス	3,000	2,192.00	6,576,000
O C H Iホールディングス	3,000	1,311.00	3,933,000
T O K A Iホールディングス	7,800	853.00	6,653,400
シップヘルスケアホールディングス	5,000	2,530.00	12,650,000
明治電機工業	2,800	1,125.00	3,150,000
コメダホールディングス	3,100	2,398.00	7,433,800
エコートレーディング	6,000	720.00	4,320,000
ナガイレーベン	3,000	1,930.00	5,790,000
三菱食品	1,900	3,075.00	5,842,500
松田産業	2,300	2,367.00	5,444,100
第一興商	2,400	4,000.00	9,600,000
メディカルホールディングス	14,600	1,724.00	25,170,400
アズワン	2,400	5,770.00	13,848,000
尾家産業	3,200	918.00	2,937,600
ドウシシャ	3,000	1,635.00	4,905,000
丸文	6,300	1,050.00	6,615,000
橋本総業ホールディングス	4,300	1,077.00	4,631,100
日本ライフライン	6,400	951.00	6,086,400
進和	2,800	2,124.00	5,947,200
オーハシテクニカ	3,900	1,503.00	5,861,700
白銅	2,000	2,672.00	5,344,000
伊藤忠商事	95,400	4,161.00	396,959,400
丸紅	122,300	1,592.50	194,762,750
長瀬産業	7,200	2,049.00	14,752,800
豊田通商	13,900	5,360.00	74,504,000
兼松	4,000	1,515.00	6,060,000
三井物産	113,200	3,910.00	442,612,000

日本紙パルプ商事	1,100	4,935.00	5,428,500
山善	6,300	1,040.00	6,552,000
住友商事	93,400	2,329.00	217,528,600
内田洋行	1,100	4,680.00	5,148,000
三菱商事	96,700	4,445.00	429,831,500
キヤノンマーケティングジャパン	3,300	3,055.00	10,081,500
西華産業	3,500	1,647.00	5,764,500
菱洋エレクトロ	2,700	2,399.00	6,477,300
東京産業	4,700	768.00	3,609,600
阪和興業	3,000	4,005.00	12,015,000
岩谷産業	3,800	5,570.00	21,166,000
アステナホールディングス	12,200	416.00	5,075,200
三愛オブリ	5,600	1,310.00	7,336,000
稲畑産業	3,900	2,479.00	9,668,100
ワキタ	6,400	1,194.00	7,641,600
東邦ホールディングス	4,000	2,082.00	8,328,000
サンゲツ	3,800	2,269.00	8,622,200
シナネンホールディングス	1,600	3,935.00	6,296,000
伊藤忠エネクス	5,800	1,098.00	6,368,400
サンリオ	5,200	4,675.00	24,310,000
リョーサン	2,900	3,070.00	8,903,000
三信電気	2,600	2,509.00	6,523,400
モスフードサービス	2,200	3,060.00	6,732,000
加賀電子	2,300	4,255.00	9,786,500
立花エレテック	2,500	1,821.00	4,552,500
フォーバル	4,600	1,060.00	4,876,000
PALTA C	2,100	4,705.00	9,880,500
日鉄物産	1,300	9,240.00	12,012,000
トラスコ中山	4,300	2,081.00	8,948,300
オートバックスセブン	5,200	1,417.00	7,368,400
加藤産業	2,000	3,565.00	7,130,000
杉本商事	2,400	2,025.00	4,860,000
因幡電機産業	3,700	2,783.00	10,297,100
ミスミグループ本社	22,200	3,245.00	72,039,000
スズケン	5,800	3,390.00	19,662,000
ジェコス	5,200	889.00	4,622,800
ローソン	3,200	5,120.00	16,384,000
サンエー	1,700	4,055.00	6,893,500
エービーシー・マート	2,000	6,900.00	13,800,000
ハードオフコーポレーション	4,300	1,242.00	5,340,600
アスクル	5,300	1,726.00	9,147,800
ゲオホールディングス	4,300	1,844.00	7,929,200
アダストリア	2,700	2,141.00	5,780,700
ジーフット	8,900	295.00	2,625,500
エディオン	5,900	1,296.00	7,646,400

あみやき亭	1,900	2,919.00	5,546,100	
ハニーズホールディングス	3,700	1,425.00	5,272,500	
ジinzホールディングス	1,900	4,000.00	7,600,000	
ビックカメラ	8,600	1,207.00	10,380,200	
D C Mホールディングス	8,200	1,184.00	9,708,800	
M o n o t a R O	21,900	1,991.00	43,602,900	
J . フロント リテイリング	18,000	1,212.00	21,816,000	
ドトール・日レスホールディングス	5,300	1,768.00	9,370,400	
マツキヨココカラ&カンパニー	9,600	6,570.00	63,072,000	
Z O Z O	11,500	3,245.00	37,317,500	
トレジャー・ファクトリー	2,600	2,130.00	5,538,000	
三越伊勢丹ホールディングス	24,100	1,418.00	34,173,800	
ウエルシアホールディングス	9,000	2,913.00	26,217,000	
クリエイトSDホールディングス	2,100	3,450.00	7,245,000	
シュッピン	4,300	1,112.00	4,781,600	
オイシックス・ラ・大地	4,300	2,156.00	9,270,800	
ジョイフル本田	4,500	1,935.00	8,707,500	
すかいらくホールディングス	18,900	1,528.00	28,879,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	6,000	1,117.00	6,702,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,600	1,477.00	5,317,200	
あさひ	3,400	1,394.00	4,739,600	
コスモス薬品	1,600	12,780.00	20,448,000	
トーエル	3,900	740.00	2,886,000	
セブン&アイ・ホールディングス	53,600	6,129.00	328,514,400	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	11,600	965.00	11,194,000	
ツルハホールディングス	3,600	9,610.00	34,596,000	
サンマルクホールディングス	2,800	1,737.00	4,863,600	
トリドールホールディングス	5,200	2,784.00	14,476,800	
クスリのアオキホールディングス	1,500	7,440.00	11,160,000	
FOOD & LIFE COMPANIES	10,000	3,080.00	30,800,000	
ノジマ	4,800	1,377.00	6,609,600	
カップ・クリエイト	5,700	1,428.00	8,139,600	
ライトオン	5,200	566.00	2,943,200	
良品計画	18,000	1,435.00	25,830,000	
パリミキホールディングス	5,500	269.00	1,479,500	
アドヴァングループ	5,200	892.00	4,638,400	
G - 7ホールディングス	4,300	1,578.00	6,785,400	
コーナン商事	2,500	3,280.00	8,200,000	
エコス	2,900	1,877.00	5,443,300	
マルシェ	11,800	393.00	4,637,400	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	33,400	2,408.00	80,427,200	
西松屋チェーン	5,600	1,497.00	8,383,200	

ゼンショーホールディングス	7,500	3,285.00	24,637,500
サイゼリヤ	2,900	3,150.00	9,135,000
魚力	2,400	2,166.00	5,198,400
ユナイテッドアローズ	3,100	1,722.00	5,338,200
ハイデイ日高	2,800	2,032.00	5,689,600
YU-WA Creation Holdings	12,300	200.00	2,460,000
コロワイド	6,800	1,803.00	12,260,400
吉番屋	1,000	4,700.00	4,700,000
スギホールディングス	3,200	5,750.00	18,400,000
薬王堂ホールディングス	2,600	2,669.00	6,939,400
スクロール	4,900	724.00	3,547,600
木曽路	2,400	2,119.00	5,085,600
千趣会	14,000	396.00	5,544,000
ケーヨー	7,500	897.00	6,727,500
上新電機	2,300	1,968.00	4,526,400
日本瓦斯	8,000	2,052.00	16,416,000
ロイヤルホールディングス	4,900	2,434.00	11,926,600
いなげや	3,600	1,308.00	4,708,800
チヨダ	2,800	791.00	2,214,800
ライフコーポレーション	2,100	2,778.00	5,833,800
AOKIホールディングス	8,500	683.00	5,805,500
コメリ	1,700	2,657.00	4,516,900
青山商事	6,000	875.00	5,250,000
しまむら	1,800	12,230.00	22,014,000
高島屋	11,600	1,801.00	20,891,600
松屋	6,200	1,183.00	7,334,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,700	1,272.00	11,066,400
丸井グループ	12,000	2,172.00	26,064,000
アクシアル リテイリング	2,000	3,490.00	6,980,000
イオン	52,900	2,611.00	138,121,900
イズミ	2,400	2,886.00	6,926,400
平和堂	3,100	2,109.00	6,537,900
フジ	3,200	1,841.00	5,891,200
ヤオコー	1,400	6,750.00	9,450,000
ゼビオホールディングス	3,500	920.00	3,220,000
ケーズホールディングス	13,100	1,157.00	15,156,700
Genky DrugStores	1,300	3,715.00	4,829,500
ブックオフグループホールディングス	4,400	1,238.00	5,447,200
アインホールディングス	2,200	5,640.00	12,408,000
ヤマダホールディングス	55,700	471.00	26,234,700
ニトリホールディングス	6,300	17,060.00	107,478,000
吉野家ホールディングス	5,400	2,339.00	12,630,600
王将フードサービス	700	5,950.00	4,165,000
ブレナス	3,000	2,634.00	7,902,000

ミニストップ	3,200	1,411.00	4,515,200	
アークス	3,000	2,155.00	6,465,000	
バローホールディングス	3,900	1,831.00	7,140,900	
ファーストリテイリング	2,300	77,440.00	178,112,000	
サンドラッグ	5,000	3,650.00	18,250,000	
ヤマザワ	2,300	1,315.00	3,024,500	
ペルーナ	10,200	684.00	6,976,800	
いよぎんホールディングス	11,900	716.00	8,520,400	
しずおかフィナンシャルグループ	34,300	1,076.00	36,906,800	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	8,400	944.00	7,929,600	
めぶきフィナンシャルグループ	59,500	326.00	19,397,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,900	2,821.00	11,001,900	
九州フィナンシャルグループ	16,400	465.00	7,626,000	
ゆうちょ銀行	37,400	1,143.00	42,748,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	71,300	568.00	40,498,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,400	1,054.00	9,907,600	
三十三フィナンシャルグループ	100	1,638.00	163,800	
第四北越フィナンシャルグループ	2,800	2,898.00	8,114,400	
ひろぎんホールディングス	13,200	660.00	8,712,000	
おきなわフィナンシャルグループ	2,000	2,344.00	4,688,000	
十六フィナンシャルグループ	2,500	3,030.00	7,575,000	
北國フィナンシャルホールディングス	2,100	4,180.00	8,778,000	
プロクレアホールディングス	2,600	2,259.00	5,873,400	
あいちフィナンシャルグループ	4,200	2,318.00	9,735,600	
SBI新生銀行	6,200	2,350.00	14,570,000	
あおぞら銀行	7,700	2,622.00	20,189,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	906,100	962.20	871,849,420	300,000株
りそなホールディングス	177,300	729.90	129,411,270	
三井住友トラスト・ホールディングス	25,800	4,741.00	122,317,800	
三井住友フィナンシャルグループ	103,600	5,660.00	586,376,000	
千葉銀行	45,500	970.00	44,135,000	
群馬銀行	19,900	492.00	9,790,800	
武蔵野銀行	1,300	2,198.00	2,857,400	
七十七銀行	4,800	2,170.00	10,416,000	
秋田銀行	2,800	1,833.00	5,132,400	
山形銀行	3,200	1,271.00	4,067,200	
岩手銀行	2,900	2,049.00	5,942,100	
東邦銀行	8,100	236.00	1,911,600	
東北銀行	2,800	1,023.00	2,864,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	10,700	3,015.00	32,260,500	
スルガ銀行	13,200	418.00	5,517,600	
八十二銀行	22,400	552.00	12,364,800	
山梨中央銀行	4,300	1,181.00	5,078,300	
大垣共立銀行	3,100	1,900.00	5,890,000	
福井銀行	1,500	1,619.00	2,428,500	

滋賀銀行	3,100	2,749.00	8,521,900
南都銀行	3,100	2,625.00	8,137,500
百五銀行	12,300	403.00	4,956,900
京都銀行	4,500	5,940.00	26,730,000
紀陽銀行	4,700	1,591.00	7,477,700
ほくほくフィナンシャルグループ	9,200	1,001.00	9,209,200
山陰合同銀行	10,500	783.00	8,221,500
鳥取銀行	3,000	1,170.00	3,510,000
百十四銀行	4,000	2,009.00	8,036,000
阿波銀行	3,000	2,128.00	6,384,000
大分銀行	1,900	2,149.00	4,083,100
宮崎銀行	1,700	2,609.00	4,435,300
佐賀銀行	2,500	1,791.00	4,477,500
琉球銀行	8,400	932.00	7,828,800
セブン銀行	38,200	264.00	10,084,800
みずほフィナンシャルグループ	204,200	2,027.50	414,015,500
山口フィナンシャルグループ	11,500	876.00	10,074,000
長野銀行	3,900	1,399.00	5,456,100
名古屋銀行	1,600	3,480.00	5,568,000
北洋銀行	20,400	271.00	5,528,400
愛媛銀行	3,900	916.00	3,572,400
トマト銀行	3,100	1,051.00	3,258,100
京葉銀行	11,400	597.00	6,805,800
栃木銀行	18,500	302.00	5,587,000
トモニホールディングス	13,900	385.00	5,351,500
フィデアホールディングス	2,600	1,455.00	3,783,000
池田泉州ホールディングス	35,200	250.00	8,800,000
F P G	9,700	1,067.00	10,349,900
S B Iホールディングス	20,800	2,752.00	57,241,600
ジャフコグループ	6,700	2,365.00	15,845,500
大和証券グループ本社	100,700	606.00	61,024,200
野村ホールディングス	256,000	517.00	132,352,000
岡三証券グループ	13,900	427.00	5,935,300
丸三証券	12,700	428.00	5,435,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	20,100	382.00	7,678,200
水戸証券	13,600	299.00	4,066,400
いちよし証券	7,100	634.00	4,501,400
松井証券	9,000	778.00	7,002,000
マネックスグループ	19,600	490.00	9,604,000
極東証券	6,100	609.00	3,714,900
アイザワ証券グループ	7,400	729.00	5,394,600
かんぽ生命保険	15,800	2,329.00	36,798,200
S O M P Oホールディングス	24,000	5,767.00	138,408,000

M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	31,800	4,245.00	134,991,000
第一生命ホールディングス	74,500	3,061.00	228,044,500
東京海上ホールディングス	142,400	2,774.00	395,017,600
T & Dホールディングス	36,500	2,032.00	74,168,000
全国保証	3,900	4,860.00	18,954,000
クレディセゾン	11,100	1,692.00	18,781,200
芙蓉総合リース	1,600	8,770.00	14,032,000
みずほリース	2,100	3,425.00	7,192,500
東京センチュリー	3,000	4,530.00	13,590,000
日本証券金融	8,900	1,166.00	10,377,400
アイフル	35,000	381.00	13,335,000
リコーリース	1,600	3,785.00	6,056,000
イオンフィナンシャルサービス	9,500	1,310.00	12,445,000
アコム	31,600	313.00	9,890,800
オリエントコーポレーション	7,500	1,155.00	8,662,500
オリックス	95,200	2,270.50	216,151,600
三菱H Cキャピタル	52,300	664.00	34,727,200
日本取引所グループ	38,500	1,903.00	73,265,500
アサックス	5,500	595.00	3,272,500
N E Cキャピタルソリューション	2,300	2,265.00	5,209,500
大東建託	5,300	14,130.00	74,889,000
いちご	22,600	298.00	6,734,800
ヒューリック	34,100	1,049.00	35,770,900
野村不動産ホールディングス	9,000	2,836.00	25,524,000
オープンハウスグループ	5,500	4,965.00	27,307,500
東急不動産ホールディングス	46,700	638.00	29,794,600
飯田グループホールディングス	12,400	2,142.00	26,560,800
パーク24	12,700	2,214.00	28,117,800
三井不動産	63,600	2,407.00	153,085,200
三菱地所	92,700	1,675.00	155,272,500
平和不動産	3,300	3,665.00	12,094,500
東京建物	14,800	1,584.00	23,443,200
京阪神ビルディング	4,100	1,356.00	5,559,600
住友不動産	26,900	3,158.00	84,950,200
テーオーシー	7,300	669.00	4,883,700
スターツコーポレーション	3,400	2,533.00	8,612,200
空港施設	7,500	520.00	3,900,000
ゴールドクレスト	3,500	1,704.00	5,964,000
エスリード	2,500	1,955.00	4,887,500
A V A N T I A	6,500	794.00	5,161,000
イオンモール	7,700	1,820.00	14,014,000
カチタス	5,000	3,055.00	15,275,000
日本空港ビルデング	5,600	6,830.00	38,248,000
M I X I	3,400	2,518.00	8,561,200

日本M&Aセンターホールディングス	27,600	1,743.00	48,106,800
UTグループ	3,800	2,608.00	9,910,400
パソナグループ	2,900	2,111.00	6,121,900
エス・エム・エス	6,300	3,430.00	21,609,000
パーソルホールディングス	15,500	2,838.00	43,989,000
クックパッド	18,600	223.00	4,147,800
学情	3,700	1,420.00	5,254,000
スタジオアリス	2,200	2,161.00	4,754,200
シミックホールディングス	3,500	1,780.00	6,230,000
NJS	2,500	2,144.00	5,360,000
総合警備保障	5,400	3,530.00	19,062,000
カカクコム	12,800	2,160.00	27,648,000
アイロムグループ	2,500	2,391.00	5,977,500
ディップ	3,300	3,925.00	12,952,500
キャリアデザインセンター	3,300	1,472.00	4,857,600
ベネフィット・ワン	6,900	2,126.00	14,669,400
エムスリー	29,500	3,632.00	107,144,000
アウトソーシング	10,100	991.00	10,009,100
ディー・エヌ・エー	6,900	1,785.00	12,316,500
博報堂DYホールディングス	20,000	1,389.00	27,780,000
ぐるなび	13,100	399.00	5,226,900
ファンコミュニケーションズ	11,300	419.00	4,734,700
WDBホールディングス	1,400	2,126.00	2,976,400
インフォマート	25,000	414.00	10,350,000
クイック	3,400	2,060.00	7,004,000
電通グループ	14,900	4,300.00	64,070,000
H.U.グループホールディングス	3,900	2,807.00	10,947,300
日本空調サービス	7,200	709.00	5,104,800
オリエンタルランド	15,900	21,115.00	335,728,500
ダスキン	3,300	3,040.00	10,032,000
ラウンドワン	18,900	460.00	8,694,000
リゾートトラスト	6,900	2,356.00	16,256,400
ビー・エム・エル	2,800	3,325.00	9,310,000
りらいあコミュニケーションズ	4,700	1,457.00	6,847,900
リソー教育	20,800	364.00	7,571,200
早稲田アカデミー	4,800	1,155.00	5,544,000
ユー・エス・エス	17,400	2,098.00	36,505,200
サイバーエージェント	36,700	1,243.00	45,618,100
楽天グループ	68,400	658.00	45,007,200
テー・オー・ダブリュー	19,000	291.00	5,529,000
エン・ジャパン	4,600	2,493.00	11,467,800
テクノプロ・ホールディングス	9,700	3,980.00	38,606,000
インターワークス	8,700	367.00	3,192,900
アイ・オールジャパンホールディングス	3,200	1,881.00	6,019,200
ジャパンマテリアル	4,900	2,420.00	11,858,000

キャリアリンク	2,000	2,720.00	5,440,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	1,112.00	4,336,800	
リクルートホールディングス	111,000	4,266.00	473,526,000	
エラン	6,300	997.00	6,281,100	
日本郵政	191,900	1,114.00	213,776,600	
ベイカレント・コンサルティング	12,600	5,530.00	69,678,000	
MS - J a p a n	4,400	1,066.00	4,690,400	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,300	1,819.00	11,459,700	
リログループ	9,500	2,215.00	21,042,500	
共立メンテナンス	3,300	5,830.00	19,239,000	
建設技術研究所	1,900	3,350.00	6,365,000	
東京都競馬	2,300	3,930.00	9,039,000	
カナモト	3,600	2,255.00	8,118,000	
トランス・コスモス	2,700	3,370.00	9,099,000	
乃村工藝社	7,700	921.00	7,091,700	
日本管財	3,200	2,549.00	8,156,800	
白洋舎	2,700	1,814.00	4,897,800	
セコム	15,000	7,758.00	116,370,000	
セントラル警備保障	2,100	2,565.00	5,386,500	
メイテック	4,700	2,507.00	11,782,900	
応用地質	3,300	2,134.00	7,042,200	
船井総研ホールディングス	3,400	2,794.00	9,499,600	
ベネッセホールディングス	5,900	1,982.00	11,693,800	
イオンディライト	2,000	3,065.00	6,130,000	
ダイセキ	3,400	4,455.00	15,147,000	
ステップ	3,000	1,790.00	5,370,000	
合 計	16,811,700	-	41,363,773,320	

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

「TMA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	[2022年 1月25日現在]	[2023年 1月25日現在]
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		48,503,235	41,652,155
コール・ローン		38,215,569	27,761,637
国債証券		10,134,691,455	13,014,141,470
派生商品評価勘定		22,470	
未収利息		53,640,156	81,921,771
前払費用		2,593,364	7,283,851
流動資産合計		10,277,666,249	13,172,760,884
資産合計		10,277,666,249	13,172,760,884
負債の部			
流動負債			
未払金		23,622,031	
未払解約金		20,885,881	18,357,395
未払利息		40	13
流動負債合計		44,507,952	18,357,408
負債合計		44,507,952	18,357,408
純資産の部			
元本等			
元本	1	5,942,840,376	7,737,975,705
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		4,290,317,921	5,416,427,771
元本等合計		10,233,158,297	13,154,403,476
純資産合計		10,233,158,297	13,154,403,476
負債純資産合計		10,277,666,249	13,172,760,884

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
<p>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。</p>	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[2022年 1月25日現在]	[2023年 1月25日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,412,965,149円	5,942,840,376円
同期中における追加設定元本額	2,439,923,200円	2,793,945,488円
同期中における一部解約元本額	910,047,973円	998,810,159円
同期末における元本額	5,942,840,376円	7,737,975,705円
元本の内訳*		
東京海上セレクション・外国債券インデックス	3,876,368,304円	4,838,451,794円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型）	202,640,188円	247,034,039円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035	43,813,070円	110,052,574円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	21,873,017円	56,161,429円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	13,913,587円	34,507,253円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	27,749,062円	56,800,810円
TMA外国債券インデックスV A <適格機 関投資家限定>	61,406,387円	37,476,579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>	392,878,044円	550,363,074円
東京海上・世界インデックス・バランス60 <適格機関投資家限定>	1,302,198,717円	1,807,128,153円
計	5,942,840,376円	7,737,975,705円
2. 1 本書における開示対象ファンドの計算期間 末日における当該親投資信託の受益権の総 数	5,942,840,376口	7,737,975,705口

(注) *は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

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

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

・金融商品の時価等に関する事項

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

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

(有価証券に関する注記)

(自 2021年1月26日 至 2022年1月25日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
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。

(自 2022年1月26日 至 2023年1月25日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	342,354,032円
合計	342,354,032円

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2022年11月11日から2023年1月25日まで)を指しております。

(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

(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 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。
同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
- ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- (2)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
- (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られ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。

(2023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)

[2022年 1月25日現在]		[2023年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7219円 17,219円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7000円 17,000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	90,328.12	
		T 0 1/2 04/30/27	100,000	87,679.68	
		T 0 1/2 05/31/27	200,000	174,968.75	
		T 0 1/2 06/30/27	100,000	87,335.93	
		T 0 1/2 08/31/27	300,000	260,859.37	
		T 0 1/2 10/31/27	200,000	173,078.12	
		T 0 1/4 03/15/24	200,000	190,234.37	
		T 0 1/4 05/15/24	100,000	94,531.25	
		T 0 1/4 05/31/25	200,000	183,187.50	
		T 0 1/4 06/15/24	200,000	188,500.00	
		T 0 1/4 06/30/25	300,000	274,523.43	
		T 0 1/4 07/31/25	100,000	91,171.87	
		T 0 1/4 08/31/25	300,000	272,789.06	
		T 0 1/4 09/30/25	200,000	181,546.87	
		T 0 1/4 10/31/25	400,000	361,843.75	
		T 0 1/8 02/15/24	300,000	285,960.93	
T 0 1/8 12/15/23	700,000	672,164.06			

T 0 3/4 01/31/28	300,000	261,304.68	
T 0 3/4 03/31/26	300,000	272,835.93	
T 0 3/4 04/30/26	200,000	181,406.25	
T 0 3/4 05/31/26	100,000	90,554.68	
T 0 3/4 08/31/26	300,000	270,140.62	
T 0 3/4 11/15/24	300,000	281,695.31	
T 0 3/8 01/31/26	500,000	450,820.31	
T 0 3/8 04/15/24	100,000	94,960.93	
T 0 3/8 04/30/25	100,000	92,078.12	
T 0 3/8 07/15/24	300,000	282,562.50	
T 0 3/8 07/31/27	200,000	173,187.50	
T 0 3/8 08/15/24	400,000	375,656.25	
T 0 3/8 09/15/24	100,000	93,726.56	
T 0 3/8 09/30/27	400,000	345,062.50	
T 0 3/8 11/30/25	100,000	90,578.12	
T 0 3/8 12/31/25	300,000	271,664.06	
T 0 5/8 05/15/30	400,000	328,125.00	
T 0 5/8 07/31/26	300,000	269,296.87	
T 0 5/8 08/15/30	400,000	326,531.24	
T 0 5/8 10/15/24	300,000	281,718.75	
T 0 5/8 11/30/27	400,000	347,562.50	
T 0 5/8 12/31/27	300,000	260,156.25	
T 0 7/8 01/31/24	300,000	288,536.31	
T 0 7/8 06/30/26	200,000	181,562.50	
T 0 7/8 09/30/26	400,000	360,875.00	
T 0 7/8 11/15/30	400,000	331,371.12	
T 1 07/31/28	300,000	261,632.81	
T 1 1/2 01/31/27	200,000	183,812.50	
T 1 1/2 02/15/25	300,000	284,390.62	
T 1 1/2 02/15/30	500,000	439,921.87	
T 1 1/2 02/29/24	300,000	289,804.68	
T 1 1/2 09/30/24	100,000	95,421.87	
T 1 1/2 10/31/24	300,000	285,703.12	
T 1 1/2 11/30/24	200,000	190,296.87	
T 1 1/2 11/30/28	400,000	356,843.75	
T 1 1/4 04/30/28	300,000	266,437.50	
T 1 1/4 05/15/50	200,000	117,562.50	
T 1 1/4 05/31/28	300,000	266,109.37	
T 1 1/4 06/30/28	200,000	177,218.75	
T 1 1/4 08/15/31	500,000	421,015.62	
T 1 1/4 08/31/24	300,000	285,445.31	
T 1 1/4 09/30/28	400,000	352,656.24	
T 1 1/4 11/30/26	500,000	456,171.87	

T 1 1/4 12/31/26	600,000	546,656.24	
T 1 1/8 01/15/25	300,000	282,750.00	
T 1 1/8 02/15/31	500,000	422,343.75	
T 1 1/8 02/28/25	300,000	282,093.75	
T 1 1/8 02/29/28	300,000	265,898.43	
T 1 1/8 05/15/40	200,000	133,843.75	
T 1 1/8 08/15/40	100,000	66,609.37	
T 1 1/8 08/31/28	300,000	263,039.06	
T 1 1/8 10/31/26	400,000	363,625.00	
T 1 12/15/24	300,000	282,539.06	
T 1 3/4 01/31/29	200,000	180,562.50	
T 1 3/4 03/15/25	200,000	190,359.37	
T 1 3/4 07/31/24	300,000	288,117.18	
T 1 3/4 08/15/41	300,000	219,703.12	
T 1 3/4 11/15/29	300,000	269,601.56	
T 1 3/4 12/31/24	600,000	573,093.75	
T 1 3/4 12/31/26	300,000	279,210.93	
T 1 3/8 01/31/25	200,000	189,281.25	
T 1 3/8 08/15/50	200,000	121,343.75	
T 1 3/8 10/31/28	400,000	354,625.00	
T 1 3/8 11/15/31	500,000	422,929.69	
T 1 3/8 11/15/40	200,000	139,015.62	
T 1 3/8 12/31/28	500,000	442,421.87	
T 1 5/8 02/15/26	600,000	561,703.12	
T 1 5/8 05/15/26	200,000	186,765.62	
T 1 5/8 05/15/31	500,000	436,289.06	
T 1 5/8 08/15/29	300,000	267,632.81	
T 1 5/8 09/30/26	200,000	185,609.37	
T 1 5/8 11/15/50	300,000	194,343.75	
T 1 5/8 11/30/26	300,000	277,945.31	
T 1 7/8 02/15/32	500,000	439,960.94	
T 1 7/8 02/15/41	300,000	226,406.25	
T 1 7/8 02/15/51	300,000	206,929.68	
T 1 7/8 02/28/27	300,000	279,609.37	
T 1 7/8 02/28/29	200,000	181,687.50	
T 1 7/8 07/31/26	100,000	93,906.25	
T 1 7/8 11/15/51	400,000	274,843.75	
T 2 02/15/25	200,000	191,421.87	
T 2 02/15/50	500,000	357,617.19	
T 2 06/30/24	100,000	96,476.56	
T 2 08/15/25	800,000	761,000.00	
T 2 08/15/51	400,000	283,875.00	
T 2 1/2 01/31/24	200,000	195,625.00	

T 2 1/2 02/15/46	100,000	80,531.25	
T 2 1/2 03/31/27	200,000	190,984.37	
T 2 1/2 04/30/24	100,000	97,382.81	
T 2 1/2 05/15/24	500,000	486,679.69	
T 2 1/2 05/15/46	100,000	80,437.50	
T 2 1/2 05/31/24	600,000	583,734.37	
T 2 1/4 02/15/52	300,000	225,656.25	
T 2 1/4 05/15/41	300,000	240,375.00	
T 2 1/4 08/15/27	100,000	94,289.06	
T 2 1/4 08/15/46	200,000	152,906.25	
T 2 1/4 08/15/49	200,000	151,656.25	
T 2 1/4 11/15/24	800,000	772,250.00	
T 2 1/4 11/15/27	400,000	376,250.00	
T 2 1/8 05/15/25	300,000	287,179.68	
T 2 11/15/26	100,000	93,921.87	
T 2 11/15/41	400,000	305,406.24	
T 2 3/4 02/15/28	600,000	576,562.50	
T 2 3/4 04/30/27	200,000	192,843.75	
T 2 3/4 05/15/25	300,000	291,375.00	
T 2 3/4 05/31/29	200,000	190,968.75	
T 2 3/4 07/31/27	300,000	289,125.00	
T 2 3/4 08/15/32	300,000	283,101.54	
T 2 3/4 08/15/42	100,000	86,007.81	
T 2 3/4 08/15/47	100,000	84,132.81	
T 2 3/4 11/15/42	200,000	171,687.50	
T 2 3/8 02/15/42	300,000	243,796.87	
T 2 3/8 03/31/29	300,000	280,359.37	
T 2 3/8 05/15/27	100,000	94,976.56	
T 2 3/8 05/15/29	100,000	93,406.25	
T 2 3/8 05/15/51	300,000	232,593.75	
T 2 3/8 08/15/24	200,000	193,765.62	
T 2 3/8 11/15/49	300,000	233,578.12	
T 2 5/8 01/31/26	100,000	96,523.43	
T 2 5/8 02/15/29	100,000	94,898.43	
T 2 5/8 03/31/25	100,000	96,929.68	
T 2 5/8 04/15/25	200,000	193,890.62	
T 2 5/8 05/31/27	200,000	191,843.75	
T 2 5/8 07/31/29	200,000	189,437.50	
T 2 7/8 04/30/29	200,000	192,375.00	
T 2 7/8 05/15/28	100,000	96,515.62	
T 2 7/8 05/15/32	600,000	573,140.62	
T 2 7/8 05/15/43	100,000	87,382.81	
T 2 7/8 05/15/52	300,000	258,843.75	

T 2 7/8 05/31/25	200,000	194,812.50	
T 2 7/8 06/15/25	300,000	292,265.62	
T 2 7/8 07/31/25	100,000	97,414.06	
T 2 7/8 08/15/28	100,000	96,445.31	
T 2 7/8 08/15/45	100,000	86,390.62	
T 2 7/8 11/15/46	100,000	86,179.68	
T 3 02/15/47	300,000	264,257.81	
T 3 02/15/48	300,000	264,445.31	
T 3 02/15/49	400,000	353,687.50	
T 3 05/15/47	100,000	88,117.18	
T 3 06/30/24	500,000	489,335.94	
T 3 07/15/25	300,000	292,968.75	
T 3 07/31/24	100,000	97,875.00	
T 3 08/15/48	200,000	176,406.24	
T 3 08/15/52	300,000	265,804.68	
T 3 1/2 09/15/25	200,000	197,765.62	
T 3 1/4 05/15/42	100,000	93,187.50	
T 3 1/4 06/30/27	300,000	295,242.18	
T 3 1/4 06/30/29	200,000	196,593.75	
T 3 1/4 08/31/24	300,000	294,656.25	
T 3 1/8 02/15/43	100,000	91,132.81	
T 3 1/8 05/15/48	100,000	90,242.18	
T 3 1/8 08/15/25	300,000	293,789.05	
T 3 1/8 08/15/44	300,000	271,640.62	
T 3 1/8 08/31/27	300,000	293,813.43	
T 3 1/8 08/31/29	100,000	97,562.50	
T 3 1/8 11/15/28	200,000	195,343.75	
T 3 1/8 11/15/41	100,000	92,007.81	
T 3 11/15/44	100,000	88,585.93	
T 3 11/15/45	300,000	264,515.62	
T 3 3/4 11/15/43	100,000	99,859.37	
T 3 3/8 08/15/42	200,000	189,859.36	
T 3 3/8 11/15/48	200,000	189,093.75	
T 3 5/8 02/15/44	100,000	97,968.75	
T 3 5/8 08/15/43	100,000	98,195.31	
T 3 7/8 08/15/40	200,000	207,109.37	
T 3 7/8 09/30/29	300,000	305,929.68	
T 3 7/8 11/30/27	400,000	405,234.37	
T 3 7/8 11/30/29	100,000	102,070.31	
T 4 1/2 11/15/25	300,000	304,546.87	
T 4 1/2 11/30/24	700,000	702,625.00	
T 4 1/4 09/30/24	200,000	199,625.00	
T 4 1/4 10/15/25	300,000	302,320.31	

T 4 1/4 11/15/40	100,000	108,359.37	
T 4 1/8 09/30/27	200,000	204,359.37	
T 4 1/8 10/31/27	300,000	306,703.12	
T 4 1/8 11/15/32	400,000	421,843.72	
T 4 10/31/29	300,000	308,273.43	
T 4 11/15/42	200,000	207,421.86	
T 4 11/15/52	200,000	213,937.50	
T 4 12/15/25	300,000	300,972.65	
T 4 3/4 02/15/41	100,000	115,320.31	
T 4 3/8 02/15/38	100,000	110,195.31	
T 4 3/8 05/15/40	100,000	110,101.56	
T 4 3/8 10/31/24	400,000	400,343.72	
T 4 3/8 11/15/39	200,000	220,578.12	
T 5 05/15/37	50,000	58,488.28	
T 5 3/8 02/15/31	100,000	113,335.93	
米ドル小計	54,350,000	49,521,290.47 (6,457,576,277)	
	銘柄数	204	
	比率	49.1%	49.6%
加ドル			加ドル
CAN 0 1/2 09/01/25	100,000	92,848.00	
CAN 0 1/2 12/01/30	200,000	167,698.00	
CAN 0 1/4 03/01/26	100,000	91,215.00	
CAN 0 1/4 04/01/24	100,000	95,536.00	
CAN 1 06/01/27	100,000	92,384.70	
CAN 1 1/2 06/01/26	100,000	94,990.00	
CAN 1 1/2 06/01/31	200,000	180,220.00	
CAN 1 1/2 12/01/31	100,000	89,633.00	
CAN 1 1/4 03/01/25	100,000	95,372.00	
CAN 1 1/4 06/01/30	100,000	89,799.00	
CAN 1 3/4 12/01/53	200,000	150,280.00	
CAN 2 06/01/28	100,000	96,019.00	
CAN 2 06/01/32	100,000	93,040.00	
CAN 2 1/2 06/01/24	100,000	98,013.00	
CAN 2 1/2 12/01/32	100,000	96,930.00	
CAN 2 1/4 06/01/29	100,000	96,883.00	
CAN 2 12/01/51	200,000	162,042.00	
CAN 2 3/4 08/01/24	200,000	196,478.00	
CAN 2 3/4 09/01/27	100,000	99,160.00	
CAN 2 3/4 12/01/48	100,000	95,714.00	
CAN 3 1/2 12/01/45	100,000	108,039.00	
CAN 3 10/01/25	100,000	98,982.50	
CAN 3 11/01/24	200,000	197,372.00	
CAN 5 3/4 06/01/33	100,000	125,198.00	

加ドル小計		3,000,000	2,803,846.20 (273,318,927)	
	銘柄数	24		
	比率	2.1%	2.1%	
メキシコペソ			メキシコペソ	
	MBONO 10 11/20/36	400,000	446,631.20	
	MBONO 10 12/05/24	1,400,000	1,412,947.20	
	MBONO 5 03/06/25	600,000	545,850.60	
	MBONO 5 1/2 03/04/27	600,000	529,709.40	
	MBONO 5 3/4 03/05/26	2,000,000	1,834,054.00	
	MBONO 7 1/2 05/26/33	300,000	277,094.10	
	MBONO 7 1/2 06/03/27	1,700,000	1,628,458.90	
	MBONO 7 3/4 05/29/31	2,000,000	1,904,298.00	
	MBONO 7 3/4 11/13/42	1,200,000	1,089,840.00	
	MBONO 7 3/4 11/23/34	400,000	375,842.80	
	MBONO 8 07/31/53	400,000	368,049.20	
	MBONO 8 09/05/24	1,300,000	1,257,792.90	
	MBONO 8 1/2 05/31/29	1,500,000	1,495,827.00	
	MBONO 8 1/2 11/18/38	1,100,000	1,084,825.50	
	MBONO 8 11/07/47	1,200,000	1,109,253.60	
メキシコペソ小計		16,100,000	15,360,474.40 (106,461,912)	
	銘柄数	15		
	比率	0.8%	0.8%	
ユーロ			ユーロ	
	BGB 0 1/2 10/22/24	100,000	96,490.00	
	BGB 0.1 06/22/30	100,000	83,680.00	
	BGB 0.35 06/22/32	100,000	80,350.00	
	BGB 0.8 06/22/25	100,000	95,220.00	
	BGB 0.8 06/22/27	100,000	92,945.00	
	BGB 0.8 06/22/28	100,000	91,180.00	
	BGB 0.9 06/22/29	100,000	90,580.00	
	BGB 1 06/22/26	100,000	95,300.00	
	BGB 1 06/22/31	100,000	88,120.00	
	BGB 1 1/4 04/22/33	100,000	87,060.00	
	BGB 1.6 06/22/47	100,000	74,690.00	
	BGB 1.7 06/22/50	100,000	74,800.00	
	BGB 1.9 06/22/38	100,000	86,280.00	
	BGB 3 06/22/34	100,000	101,150.00	
	BGB 3 3/4 06/22/45	100,000	111,600.00	
	BGB 4 1/4 03/28/41	100,000	117,010.00	
	BGB 5 03/28/35	100,000	121,740.00	
	BGB 5 1/2 03/28/28	100,000	114,390.00	
	BKO 0 03/15/24	200,000	194,376.00	

BKO 0.2 06/14/24	100,000	96,813.00	
BKO 2.2 12/12/24	100,000	99,402.00	
BTPS 0 01/15/24	100,000	97,170.00	
BTPS 0 01/30/24	200,000	194,194.00	
BTPS 0 04/01/26	200,000	181,240.00	
BTPS 0 04/15/24	100,000	96,544.00	
BTPS 0 08/01/26	200,000	179,320.00	
BTPS 0 1/2 02/01/26	100,000	92,580.00	
BTPS 0 1/2 07/15/28	100,000	85,650.00	
BTPS 0 1/4 03/15/28	100,000	85,380.00	
BTPS 0.35 02/01/25	200,000	189,700.00	
BTPS 0.45 02/15/29	100,000	83,450.00	
BTPS 0.6 08/01/31	100,000	77,330.00	
BTPS 0.85 01/15/27	300,000	274,260.00	
BTPS 0.9 04/01/31	100,000	80,360.00	
BTPS 0.95 03/01/37	100,000	67,570.00	
BTPS 0.95 06/01/32	100,000	77,850.00	
BTPS 0.95 08/01/30	200,000	164,520.00	
BTPS 0.95 12/01/31	200,000	157,980.00	
BTPS 1 1/2 04/30/45	100,000	62,940.00	
BTPS 1 1/2 06/01/25	100,000	96,800.00	
BTPS 1 3/4 05/30/24	200,000	196,500.00	
BTPS 1 3/4 07/01/24	100,000	98,325.00	
BTPS 1.1 04/01/27	100,000	91,850.00	
BTPS 1.2 08/15/25	200,000	191,020.00	
BTPS 1.45 03/01/36	100,000	74,150.00	
BTPS 1.45 11/15/24	100,000	97,378.00	
BTPS 1.6 06/01/26	200,000	190,300.00	
BTPS 1.65 03/01/32	100,000	83,850.00	
BTPS 1.65 12/01/30	200,000	172,360.00	
BTPS 1.7 09/01/51	100,000	61,890.00	
BTPS 1.8 03/01/41	100,000	71,020.00	
BTPS 1.85 07/01/25	200,000	194,560.00	
BTPS 2 02/01/28	100,000	93,990.00	
BTPS 2 1/2 12/01/32	100,000	88,760.00	
BTPS 2 1/4 09/01/36	100,000	81,450.00	
BTPS 2 12/01/25	100,000	97,160.00	
BTPS 2.45 09/01/33	100,000	86,800.00	
BTPS 2.45 09/01/50	100,000	74,050.00	
BTPS 2.65 12/01/27	200,000	195,160.00	
BTPS 2.7 03/01/47	100,000	79,760.00	
BTPS 2.8 06/15/29	100,000	95,710.00	
BTPS 2.8 12/01/28	100,000	96,910.00	

BTPS 2.95 09/01/38	100,000	86,980.00	
BTPS 3 08/01/29	200,000	194,440.00	
BTPS 3 1/2 03/01/30	100,000	99,680.00	
BTPS 3 1/4 09/01/46	100,000	87,620.00	
BTPS 3 3/4 09/01/24	100,000	101,080.00	
BTPS 3.1 03/01/40	100,000	87,280.00	
BTPS 3.35 03/01/35	100,000	92,850.00	
BTPS 3.4 04/01/28	100,000	99,840.00	
BTPS 3.45 03/01/48	100,000	90,570.00	
BTPS 3.85 09/01/49	100,000	95,880.00	
BTPS 3.85 12/15/29	100,000	101,290.00	
BTPS 4 02/01/37	100,000	99,570.00	
BTPS 4 1/2 03/01/24	100,000	101,629.00	
BTPS 4 3/4 09/01/28	100,000	106,890.00	
BTPS 4 3/4 09/01/44	100,000	108,350.00	
BTPS 5 08/01/34	100,000	108,540.00	
BTPS 5 08/01/39	100,000	110,070.00	
BTPS 5 09/01/40	100,000	110,690.00	
BTPS 5 3/4 02/01/33	100,000	114,500.00	
BTPS 6 05/01/31	100,000	116,730.00	
BTPS 6 1/2 11/01/27	100,000	114,200.00	
BTPS 7 1/4 11/01/26	100,000	114,810.00	
DBR 0 02/15/30	100,000	86,442.00	
DBR 0 02/15/31	200,000	169,416.00	
DBR 0 02/15/32	200,000	165,552.00	
DBR 0 05/15/35	100,000	76,215.00	
DBR 0 05/15/36	100,000	74,484.00	
DBR 0 08/15/26	100,000	92,444.00	
DBR 0 08/15/29	200,000	174,448.00	
DBR 0 08/15/30	300,000	256,761.00	
DBR 0 08/15/31	200,000	167,574.00	
DBR 0 08/15/50	200,000	114,442.00	
DBR 0 08/15/52	100,000	55,101.00	
DBR 0 1/2 02/15/25	100,000	96,129.00	
DBR 0 1/2 02/15/26	100,000	94,744.00	
DBR 0 1/4 02/15/27	100,000	92,519.00	
DBR 0 1/4 02/15/29	100,000	89,524.00	
DBR 0 1/4 08/15/28	300,000	270,693.00	
DBR 0 11/15/27	200,000	180,376.00	
DBR 0 11/15/28	300,000	265,500.00	
DBR 1 05/15/38	100,000	83,904.00	
DBR 1 08/15/25	100,000	96,549.00	
DBR 1 1/4 08/15/48	200,000	166,978.00	

DBR 1.7 08/15/32	100,000	96,337.00	
DBR 2 1/2 07/04/44	100,000	105,576.00	
DBR 2 1/2 08/15/46	200,000	213,626.00	
DBR 3 1/4 07/04/42	100,000	116,170.00	
DBR 4 01/04/37	200,000	242,106.00	
DBR 4 3/4 07/04/34	100,000	125,937.00	
DBR 4 3/4 07/04/40	100,000	135,735.00	
DBR 4.25 07/04/39	100,000	127,598.00	
DBR 5.5 01/04/31	100,000	124,237.00	
DBR 6.5 07/04/27	100,000	117,899.00	
FRTR 0 02/25/24	200,000	194,340.00	
FRTR 0 02/25/25	200,000	189,300.00	
FRTR 0 02/25/26	300,000	277,875.00	
FRTR 0 02/25/27	400,000	362,160.00	
FRTR 0 03/25/24	300,000	290,814.00	
FRTR 0 03/25/25	300,000	283,470.00	
FRTR 0 05/25/32	100,000	78,480.00	
FRTR 0 1/2 05/25/25	100,000	95,375.00	
FRTR 0 1/2 05/25/26	100,000	93,665.00	
FRTR 0 1/2 05/25/29	200,000	177,380.00	
FRTR 0 1/2 05/25/40	200,000	134,920.00	
FRTR 0 1/2 06/25/44	100,000	61,990.00	
FRTR 0 1/4 11/25/26	300,000	276,135.00	
FRTR 0 11/25/29	300,000	254,385.00	
FRTR 0 11/25/30	300,000	248,010.00	
FRTR 0 11/25/31	300,000	240,930.00	
FRTR 0 3/4 02/25/28	300,000	275,505.00	
FRTR 0 3/4 05/25/28	100,000	91,100.00	
FRTR 0 3/4 05/25/52	200,000	117,400.00	
FRTR 0 3/4 05/25/53	100,000	56,220.00	
FRTR 0 3/4 11/25/28	300,000	272,685.00	
FRTR 1 05/25/27	300,000	282,255.00	
FRTR 1 1/2 05/25/31	200,000	185,920.00	
FRTR 1 1/2 05/25/50	200,000	147,760.00	
FRTR 1 1/4 05/25/34	200,000	171,260.00	
FRTR 1 1/4 05/25/36	200,000	164,420.00	
FRTR 1 1/4 05/25/38	100,000	78,990.00	
FRTR 1 11/25/25	200,000	191,860.00	
FRTR 1 3/4 05/25/66	100,000	72,630.00	
FRTR 1 3/4 06/25/39	100,000	85,170.00	
FRTR 1 3/4 11/25/24	200,000	196,912.00	
FRTR 2 05/25/48	100,000	82,740.00	
FRTR 2 1/2 05/25/30	200,000	200,680.00	

FRTR 2 11/25/32	200,000	188,760.00	
FRTR 3 1/2 04/25/26	200,000	206,040.00	
FRTR 3 1/4 05/25/45	100,000	105,190.00	
FRTR 4 04/25/55	100,000	120,950.00	
FRTR 4 04/25/60	100,000	123,540.00	
FRTR 4 10/25/38	100,000	113,510.00	
FRTR 4 3/4 04/25/35	200,000	239,600.00	
FRTR 5 1/2 04/25/29	200,000	234,700.00	
FRTR 5 3/4 10/25/32	200,000	254,180.00	
FRTR 6 10/25/25	100,000	109,130.00	
FRTR4.5 04/25/41	200,000	244,120.00	
IRISH 0.2 10/18/30	100,000	83,340.00	
IRISH 1 05/15/26	100,000	95,270.00	
IRISH 1.3 05/15/33	100,000	87,390.00	
IRISH 1.35 03/18/31	100,000	91,800.00	
IRISH 1.7 05/15/37	100,000	85,850.00	
IRISH 2 02/18/45	100,000	84,630.00	
IRISH 5.4 03/13/25	100,000	105,890.00	
NETHER 0 01/15/27	100,000	91,170.00	
NETHER 0 01/15/29	100,000	86,990.00	
NETHER 0 01/15/52	100,000	52,800.00	
NETHER 0 07/15/30	100,000	84,150.00	
NETHER 0 07/15/31	100,000	82,060.00	
NETHER 0 1/2 01/15/40	100,000	71,800.00	
NETHER 0 1/2 07/15/26	100,000	93,715.00	
NETHER 0 1/2 07/15/32	100,000	83,600.00	
NETHER 0 1/4 07/15/25	100,000	94,750.00	
NETHER 0 3/4 07/15/27	100,000	93,440.00	
NETHER 2 07/15/24	100,000	99,190.00	
NETHER 2 1/2 01/15/33	100,000	100,220.00	
NETHER 2 3/4 01/15/47	100,000	107,260.00	
NETHER 3 3/4 01/15/42	100,000	118,180.00	
NETHER 4 01/15/37	100,000	117,610.00	
NETHER 5 1/2 01/15/28	100,000	114,570.00	
OBL 0 04/05/24	300,000	291,093.00	
OBL 0 04/10/26	200,000	186,034.00	
OBL 0 04/11/25	200,000	189,614.00	
OBL 0 04/16/27	100,000	91,105.00	
OBL 0 10/09/26	200,000	184,074.00	
OBL 0 10/10/25	200,000	187,732.00	
OBL 0 10/18/24	200,000	191,524.00	
OBL 1.3 10/15/27	200,000	192,022.00	
RAGB 0 02/20/30	100,000	83,050.00	

RAGB 0 02/20/31	100,000	80,800.00	
RAGB 0 07/15/24	100,000	96,341.00	
RAGB 0 1/2 02/20/29	100,000	88,210.00	
RAGB 0 1/2 04/20/27	100,000	92,075.00	
RAGB 0 1/4 10/20/36	100,000	71,080.00	
RAGB 0 10/20/28	100,000	86,280.00	
RAGB 0 10/20/40	100,000	60,860.00	
RAGB 0 3/4 10/20/26	100,000	93,755.00	
RAGB 0.9 02/20/32	100,000	85,620.00	
RAGB 1 1/2 02/20/47	100,000	77,500.00	
RAGB 3.15 06/20/44	100,000	104,550.00	
RAGB 4.15 03/37	100,000	115,050.00	
RFGB 0 09/15/30	100,000	81,930.00	
RFGB 0 1/2 09/15/28	100,000	88,960.00	
RFGB 0 3/4 04/15/31	100,000	85,950.00	
RFGB 1 1/8 04/15/34	100,000	84,000.00	
RFGB 4 07/04/25	100,000	103,751.00	
SPGB 0 01/31/25	300,000	284,250.00	
SPGB 0 01/31/26	200,000	184,240.00	
SPGB 0 01/31/27	100,000	89,590.00	
SPGB 0 01/31/28	200,000	174,040.00	
SPGB 0 05/31/24	300,000	288,600.00	
SPGB 0 05/31/25	100,000	93,770.00	
SPGB 0 1/2 10/31/31	100,000	80,480.00	
SPGB 0.1 04/30/31	100,000	79,150.00	
SPGB 0.6 10/31/29	100,000	86,250.00	
SPGB 0.8 07/30/27	200,000	183,070.00	
SPGB 0.8 07/30/29	100,000	87,540.00	
SPGB 0.85 07/30/37	100,000	70,150.00	
SPGB 1 1/4 10/31/30	200,000	176,820.00	
SPGB 1 10/31/50	100,000	56,670.00	
SPGB 1.2 10/31/40	100,000	69,590.00	
SPGB 1.3 10/31/26	200,000	190,000.00	
SPGB 1.4 07/30/28	100,000	93,170.00	
SPGB 1.45 04/30/29	100,000	92,465.00	
SPGB 1.45 10/31/27	100,000	94,375.00	
SPGB 1.85 07/30/35	100,000	85,350.00	
SPGB 1.95 04/30/26	100,000	97,800.00	
SPGB 1.95 07/30/30	200,000	187,100.00	
SPGB 2 3/4 10/31/24	100,000	100,000.00	
SPGB 2.15 10/31/25	100,000	98,120.00	
SPGB 2.35 07/30/33	200,000	185,500.00	
SPGB 2.55 10/31/32	200,000	190,340.00	

SPGB 2.7 10/31/48	100,000	86,340.00	
SPGB 2.9 10/31/46	100,000	91,420.00	
SPGB 3.45 07/30/66	100,000	95,420.00	
SPGB 4.2 01/31/37	100,000	109,710.00	
SPGB 4.7 07/30/41	100,000	117,666.00	
SPGB 4.8 01/31/24	100,000	102,000.00	
SPGB 4.9 07/30/40	100,000	119,450.00	
SPGB 5 3/4 07/30/32	100,000	123,000.00	
SPGB 5.15 10/31/28	100,000	111,975.00	
SPGB 5.15 10/31/44	100,000	125,950.00	
SPGB 6 01/31/29	100,000	117,920.00	
ユーロ小計	33,700,000	31,279,844.00 (4,439,861,057)	
	銘柄数	245	
	比率	33.8%	34.1%
英ポンド			英ポンド
UKT 0 1/2 01/31/29	100,000	84,870.00	
UKT 0 1/2 10/22/61	100,000	38,680.00	
UKT 0 1/4 07/31/31	100,000	77,585.00	
UKT 0 1/8 01/30/26	100,000	91,510.00	
UKT 0 1/8 01/31/24	100,000	96,690.00	
UKT 0 1/8 01/31/28	100,000	85,820.00	
UKT 0 3/8 10/22/26	100,000	90,010.00	
UKT 0 3/8 10/22/30	100,000	80,540.00	
UKT 0 5/8 06/07/25	200,000	188,560.00	
UKT 0 5/8 07/31/35	100,000	70,880.00	
UKT 0 5/8 10/22/50	100,000	48,120.00	
UKT 0 7/8 01/31/46	100,000	56,550.00	
UKT 0 7/8 07/31/33	100,000	77,710.00	
UKT 0 7/8 10/22/29	100,000	86,030.00	
UKT 1 01/31/32	100,000	81,955.00	
UKT 1 04/22/24	100,000	97,210.00	
UKT 1 1/2 07/22/26	100,000	94,470.00	
UKT 1 1/2 07/22/47	100,000	64,940.00	
UKT 1 1/4 07/22/27	100,000	92,035.00	
UKT 1 1/4 07/31/51	100,000	58,020.00	
UKT 1 1/4 10/22/41	100,000	67,190.00	
UKT 1 1/8 01/31/39	100,000	69,460.00	
UKT 1 3/4 07/22/57	100,000	64,775.00	
UKT 1 3/4 09/07/37	100,000	78,840.00	
UKT 1 5/8 10/22/28	100,000	91,970.00	
UKT 1 5/8 10/22/54	100,000	62,985.00	
UKT 2 09/07/25	200,000	194,120.00	
UKT 2 1/2 07/22/65	100,000	78,930.00	

UKT 2 3/4 09/07/24	100,000	99,040.00	
UKT 3 1/2 01/22/45	100,000	96,695.00	
UKT 3 1/2 07/22/68	100,000	100,820.00	
UKT 3 1/4 01/22/44	100,000	93,150.00	
UKT 3 3/4 07/22/52	100,000	101,870.00	
UKT 4 1/2 12/07/42	100,000	111,080.00	
UKT 4 1/4 03/07/36	100,000	107,375.00	
UKT 4 1/4 12/07/27	30,000	31,395.00	
UKT 4 1/4 12/07/40	100,000	107,160.00	
UKT 4 1/4 12/07/46	100,000	108,190.00	
UKT 4 1/4 12/07/49	100,000	109,300.00	
UKT 4 1/4 12/07/55	100,000	112,190.00	
UKT 4 3/4 12/07/30	100,000	110,580.00	
UKT 4 3/4 12/07/38	100,000	113,250.00	
UKT 4.25 06/07/32	100,000	107,785.00	
UKT 4.5 09/07/34	100,000	110,035.00	
UKT 6 12/07/28	10,000	11,434.00	
英ポンド小計	4,540,000	4,001,804.00 (642,849,794)	
	銘柄数	45	
	比率	4.9%	4.9%
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	300,000	256,068.00	
SGB 0 3/4 05/12/28 #1060	300,000	278,223.00	
SGB 0 3/4 11/12/29 #1061	400,000	365,632.00	
SGB 1 11/12/26 #1059	500,000	476,160.00	
SGB 2 1/2 05/12/25 #1058	500,000	499,085.00	
SGB 2 1/4 06/01/32 #1056	300,000	305,730.00	
SGB 3 1/2 03/30/39	200,000	243,268.00	
スウェーデンクローネ小計	2,500,000	2,424,166.00 (30,980,841)	
	銘柄数	7	
	比率	0.2%	0.2%

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	192,310.00	
	NGB 1 1/4 09/17/31	200,000	174,780.00	
	NGB 1 3/4 02/17/27	200,000	192,120.00	
	NGB 1 3/4 03/13/25	300,000	292,095.00	
	NGB 1 3/4 09/06/29	200,000	187,270.00	
	NGB 1 3/8 08/19/30	300,000	270,030.00	
	NGB 2 04/26/28	200,000	190,820.00	
	NGB 2 1/8 05/18/32	200,000	187,620.00	
NGB 3 03/14/24	300,000	299,130.00		
ノルウェークローネ小計		2,100,000	1,986,175.00 (26,237,371)	
	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	273,750.00	
	DGB 0 1/2 11/15/29	400,000	352,340.00	
	DGB 0 1/4 11/15/52	300,000	172,350.00	
	DGB 0 11/15/24	300,000	285,150.00	
	DGB 0 11/15/31	400,000	323,960.00	
	DGB 1 3/4 11/15/25	300,000	293,160.00	
DGB 4 1/2 11/15/39	500,000	634,000.00		
デンマーククローネ小計		2,500,000	2,334,710.00 (44,546,266)	
	銘柄数	7		
	比率	0.3%	0.3%	

ポーランド ズロチ	POLGB 0 07/25/24	100,000	ポーランドズロチ	91,450.00
	POLGB 0 1/4 10/25/26	200,000		162,680.00
	POLGB 0 3/4 04/25/25	200,000		177,360.00
	POLGB 1 1/4 10/25/30	200,000		143,240.00
	POLGB 1 3/4 04/25/32	100,000		70,550.00
	POLGB 2 1/2 04/25/24	100,000		96,300.00
	POLGB 2 1/2 07/25/26	200,000		178,380.00
	POLGB 2 1/2 07/25/27	100,000		86,890.00
	POLGB 2 1/4 10/25/24	200,000		187,200.00
	POLGB 2 3/4 04/25/28	200,000		170,400.00
	POLGB 2 3/4 10/25/29	300,000		248,700.00
	POLGB 3 1/4 07/25/25	100,000		92,575.00
	POLGB 3 3/4 05/25/27	200,000		182,980.00
ポーランドズロチ小計		2,200,000		1,888,705.00 (56,874,573)
	銘柄数	13		
	比率	0.4%		0.4%
豪ドル	ACGB 0 1/2 09/21/26	100,000	豪ドル	91,146.00
	ACGB 0 1/4 11/21/25	100,000		92,553.50
	ACGB 1 1/2 06/21/31	200,000		173,080.00
	ACGB 1 1/4 05/21/32	100,000		82,615.60
	ACGB 1 11/21/31	100,000		81,589.60
	ACGB 1 12/21/30	100,000		83,606.80
	ACGB 1 3/4 06/21/51	100,000		63,561.30
	ACGB 1 3/4 11/21/32	200,000		171,698.60
	ACGB 2 1/2 05/21/30	100,000		95,040.00
	ACGB 2 1/4 05/21/28	100,000		95,780.00
	ACGB 2 3/4 04/21/24	200,000		199,231.60
	ACGB 2 3/4 05/21/41	100,000		85,240.60
	ACGB 2 3/4 11/21/27	200,000		196,780.00
	ACGB 2 3/4 11/21/29	100,000		97,085.00
	ACGB 3 03/21/47	100,000		86,380.00
	ACGB 3 1/4 04/21/25	100,000		100,670.00
	ACGB 3 1/4 04/21/29	100,000		100,077.50
	ACGB 3 11/21/33	100,000		95,559.30
	ACGB 3 3/4 04/21/37	100,000		100,160.00
	ACGB 4 1/2 04/21/33	100,000		109,390.00
ACGB 4 1/4 04/21/26	100,000		103,820.00	
豪ドル小計		2,500,000		2,305,065.40 (212,388,725)
	銘柄数	21		
	比率	1.6%		1.6%

ニュージーランドドル			ニュージーランドドル	
	NZGB 0 1/2 05/15/24	100,000	94,522.00	
	NZGB 2 05/15/32	100,000	84,060.00	
	NZGB 2 3/4 04/15/37	100,000	83,470.00	
	NZGB 3 04/20/29	100,000	94,200.00	
ニュージーランドドル小計		400,000	356,252.00 (30,078,356)	
	銘柄数	4		
	比率	0.2%	0.2%	
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	93,420.00	
	SIGB 2 1/8 06/01/26	100,000	97,610.00	
	SIGB 2 7/8 09/01/30	100,000	100,090.00	
	SIGB 3 1/2 03/01/27	200,000	205,300.00	
	SIGB 3 3/8 09/01/33	100,000	104,800.00	
シンガポールドル小計		600,000	601,220.00 (59,394,523)	
	銘柄数	5		
	比率	0.5%	0.5%	
マレーシアリングgit			マレーシアリングgit	
	MGS 2.632 04/15/31	100,000	91,576.90	
	MGS 3.478 06/14/24	100,000	100,305.80	
	MGS 3.502 05/31/27	100,000	99,351.90	
	MGS 3.582 07/15/32	100,000	98,938.20	
	MGS 3.733 06/15/28	100,000	100,029.30	
	MGS 3.757 05/22/40	100,000	94,974.90	
	MGS 3.828 07/05/34	100,000	98,609.80	
	MGS 3.844 04/15/33	100,000	99,459.30	
	MGS 3.885 08/15/29	100,000	100,063.70	
	MGS 3.899 11/16/27	100,000	101,732.90	
	MGS 3.955 09/15/25	200,000	202,666.00	
	MGS 4.065 06/15/50	100,000	96,484.50	
	MGS 4.181 07/15/24	100,000	101,291.00	
	MGS 4.232 06/30/31	100,000	102,267.80	
	MGS 4.254 05/31/35	100,000	102,120.00	
	MGS 4.392 04/15/26	200,000	205,351.40	
	MGS 4.498 04/15/30	100,000	104,037.90	
	MGS 4.736 03/15/46	100,000	105,778.30	
	MGS 4.762 04/07/37	100,000	107,602.70	
MGS 4.893 06/08/38	100,000	109,941.40		
MGS 4.921 07/06/48	100,000	106,565.40		
MGS 5.248 09/28	100,000	107,305.50		

マレーシアリングット小計		2,400,000	2,436,454.60 (74,230,487)	
	銘柄数	22		
	比率	0.6%	0.6%	
イスラエル シュケル			イスラエル シュケル	
	ILGOV 0 1/2 02/27/26	100,000	91,900.00	
	ILGOV 0.4 10/31/24	100,000	94,640.00	
	ILGOV 1 03/31/30	100,000	86,360.00	
	ILGOV 1 1/2 05/31/37	100,000	79,890.00	
	ILGOV 1 3/4 08/31/25	100,000	96,400.00	
	ILGOV 2 03/31/27	200,000	192,720.00	
	ILGOV 2 1/4 09/28/28	100,000	95,180.00	
	ILGOV 3 3/4 03/31/24	100,000	103,130.00	
	ILGOV 3 3/4 03/31/47	100,000	107,350.00	
	ILGOV 5 1/2 01/31/42	100,000	128,700.00	
	ILGOV 6 1/4 10/30/26	100,000	111,310.00	
イスラエルシュケル小計		1,200,000	1,187,580.00 (46,067,178)	
	銘柄数	11		
	比率	0.4%	0.4%	
オフショア人 民元			オフショア人民元	
	CGB 1.99 04/09/25	500,000	495,254.00	
	CGB 1.99 09/15/24	900,000	894,717.90	
	CGB 2 1/2 07/25/27	700,000	693,496.30	
	CGB 2 3/4 02/17/32	300,000	295,134.00	
	CGB 2 3/4 06/15/29	500,000	497,223.00	
	CGB 2.18 06/25/24	700,000	698,380.20	
	CGB 2.18 08/25/25	700,000	694,190.70	
	CGB 2.24 05/25/25	800,000	795,471.20	
	CGB 2.26 02/24/25	700,000	697,526.90	
	CGB 2.28 03/17/24	500,000	500,343.50	
	CGB 2.28 11/25/25	700,000	695,415.00	
	CGB 2.37 01/20/27	600,000	593,272.80	
	CGB 2.44 10/15/27	800,000	789,988.00	
	CGB 2.47 09/02/24	600,000	600,994.20	
	CGB 2.48 04/15/27	500,000	495,576.50	
	CGB 2.6 09/01/32	500,000	485,355.00	
	CGB 2.62 09/25/29	500,000	491,928.50	
	CGB 2.68 05/21/30	700,000	690,739.70	
	CGB 2.69 08/12/26	700,000	701,617.00	
	CGB 2.69 08/15/32	300,000	293,853.90	
	CGB 2.76 05/15/32	300,000	295,619.70	
	CGB 2.79 12/15/29	200,000	198,983.80	

CGB 2.8 03/24/29	600,000	599,295.60	
CGB 2.8 11/15/32	600,000	593,692.20	
CGB 2.84 04/08/24	400,000	403,016.80	
CGB 2.85 06/04/27	500,000	502,992.00	
CGB 2.89 11/18/31	500,000	499,652.00	
CGB 2.91 10/14/28	800,000	806,192.00	
CGB 2.94 10/17/24	500,000	505,629.00	
CGB 3 1/4 06/06/26	500,000	511,785.50	
CGB 3 1/4 11/22/28	500,000	515,127.50	
CGB 3.01 05/13/28	700,000	709,747.50	
CGB 3.02 05/27/31	500,000	505,504.50	
CGB 3.02 10/22/25	500,000	507,226.50	
CGB 3.03 03/11/26	700,000	710,703.70	
CGB 3.12 10/25/52	100,000	97,065.70	
CGB 3.12 12/05/26	800,000	815,109.60	
CGB 3.13 11/21/29	400,000	409,492.00	
CGB 3.19 04/11/24	400,000	405,174.00	
CGB 3.22 12/06/25	400,000	408,910.80	
CGB 3.27 11/19/30	700,000	725,895.80	
CGB 3.28 12/03/27	400,000	412,329.20	
CGB 3.29 05/23/29	300,000	310,952.40	
CGB 3.32 04/15/52	400,000	403,279.60	
CGB 3.39 03/16/50	500,000	505,765.00	
CGB 3.53 10/18/51	400,000	416,024.00	
CGB 3.54 08/16/28	100,000	104,810.50	
CGB 3.72 04/12/51	300,000	322,359.90	
CGB 3.81 09/14/50	700,000	763,466.90	
CGB 3.86 07/22/49	600,000	658,449.00	
オフショア人民元小計	26,500,000	26,724,731.00 (513,275,183)	
	銘柄数	50	
	比率	3.9%	3.9%
国債証券合計		円 13,014,141,470 (13,014,141,470)	
合計		円 13,014,141,470 (13,014,141,470)	

(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	[2022年 1月25日現在]	[2023年 1月25日現在]
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		1,115,412,134	1,042,322,595
コール・ローン		211,684,278	273,949,540
株式		60,486,527,162	106,523,621,280
投資証券		1,457,586,964	2,511,220,942
派生商品評価勘定			71,883,902
未収入金		264,465	
未収配当金		41,082,618	80,912,443
差入委託証拠金		768,578,266	894,288,095
流動資産合計		64,081,135,887	111,398,198,797
資産合計		64,081,135,887	111,398,198,797
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		123,255,404	566,713
未払解約金		81,348,204	31,497,411
未払利息		223	132
流動負債合計		204,603,831	32,064,256
負債合計		204,603,831	32,064,256
純資産の部			
元本等			
元本	1	16,521,030,366	26,873,327,459
剰余金			
剰余金又は欠損金()		47,355,501,690	84,492,807,082
元本等合計		63,876,532,056	111,366,134,541
純資産合計		63,876,532,056	111,366,134,541
負債純資産合計		64,081,135,887	111,398,198,797

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券 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	自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。	同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	[2022年 1月25日現在]	[2023年 1月25日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	10,389,370,150円	16,521,030,366円
同期中における追加設定元本額	13,610,105,585円	12,349,504,370円
同期中における一部解約元本額	7,478,445,369円	1,997,207,277円
同期末における元本額	16,521,030,366円	26,873,327,459円
元本の内訳*		
東京海上セレクション・外国株式インデックス	6,841,355,312円	9,199,572,062円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型）	84,394,364円	103,112,339円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	56,536,549円	137,808,850円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	29,134,748円	75,014,168円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	19,112,042円	47,531,242円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	40,426,906円	82,980,639円
TMA外国株式インデックスVA＜適格機関投資家限定＞	27,456,584円	15,177,952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＞	140,692,293円	192,040,331円
東京海上・世界インデックス・バランス60＜適格機関投資家限定＞	1,119,280,508円	1,513,308,733円
先進国株式インデックス（適格機関投資家専用）	377,271,069円	2,531,615,905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＞	7,785,369,991円	12,975,165,238円
計	16,521,030,366円	26,873,327,459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	16,521,030,366口	26,873,327,459口

（注）*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左

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

・金融商品の時価等に関する事項

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

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

(有価証券に関する注記)

(自 2021年1月26日 至 2022年1月25日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	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。

(自 2022年1月26日 至 2023年1月25日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	7,080,492,632円
投資証券	226,637,472円
合計	7,307,130,104円

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2022年11月11日から2023年1月25日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

(2022年1月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち	時価	評価損益
			1年超		
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

(2023年1月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち	時価	評価損益
			1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,286,505,074		2,357,822,263	71,317,189
	S&P 500 EMIN	1,685,594,410		1,735,372,980	49,778,570
	DJ EU STX 50	331,960,754		348,628,767	16,668,013
	FTSE 100 IDX	268,949,910		273,820,516	4,870,606
合計		2,286,505,074		2,357,822,263	71,317,189

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

[2022年 1月25日現在]		[2023年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額	3.8664円	1口当たり純資産額	4.1441円
(1万口当たり純資産額)	38,664円)	(1万口当たり純資産額)	41,441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	20,001	30.15	603,030.15	
CHENIERE ENERGY INC	4,428	151.02	668,716.56	
CHEVRONTEXACO CORP	31,931	180.83	5,774,082.73	
CONOCOPHILLIPS	22,444	118.81	2,666,571.64	
COTERRA ENERGY INC	17,293	25.20	435,783.60	
DEVON ENERGY CORPORATION	12,279	63.97	785,487.63	
EOG RESOURCES INC	10,628	132.76	1,410,973.28	
EXXON MOBIL CORPORATION	71,239	113.81	8,107,710.59	
HALLIBURTON CO	17,724	39.84	706,124.16	
HESS CORP	5,535	153.88	851,725.80	
KINDER MORGAN INC	36,252	18.57	673,199.64	
MARATHON PETROLEUM CORP	9,235	130.21	1,202,489.35	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	17,235	64.43	1,110,451.05	
ONEOK INC	8,855	69.51	615,511.05	
PHILLIPS 66	8,678	107.01	928,632.78	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,244	237.74	1,008,968.56	
SCHLUMBERGER LTD	25,658	55.47	1,423,249.26	
VALERO ENERGY CORP	7,400	145.03	1,073,222.00	
WILLIAMS COS INC	22,876	31.44	719,221.44	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,794	313.34	1,188,811.96	
ALBEMARLE CORP	2,278	264.59	602,736.02	
AMCOR PLC	23,932	11.74	280,961.68	
AVERY DENNISON CORP	1,406	189.90	266,999.40	
BALL CORP	5,706	57.05	325,527.30	
CELANESE CORP-SERIES A	2,255	122.33	275,854.15	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,092	84.94	347,574.48	
CORTEVA INC	11,962	62.51	747,744.62	
CROWN HOLDINGS INC	2,840	87.26	247,818.40	
DOW INC	11,386	58.20	662,665.20	
DUPONT DE NEMOURS INC	8,252	74.94	618,404.88	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	2,127	90.61	192,727.47	
ECOLAB INC	4,290	153.67	659,244.30	
FMC CORP	1,918	129.22	247,843.96	
FREEMPORT-MCMORAN INC	27,582	44.59	1,229,881.38	
INTERNATIONAL PAPER CO	5,576	36.75	204,918.00	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,788	110.84	530,701.92	
LINDE PLC	8,426	328.63	2,769,036.38	
LyondellBasell Industries NV	4,267	92.74	395,721.58	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,216	346.42	421,246.72	
MOSAIC CO/THE	7,991	48.46	387,243.86	
NEWMONT CORPORATION	13,306	53.39	710,407.34	
NUCOR CORP	4,911	154.03	756,441.33	

PACKAGING CORP OF AMERICA	1,630	130.03	211,948.90
PPG INDUSTRIES INC	3,941	130.97	516,152.77
RPM INTERNATIONAL INC	2,685	87.74	235,581.90
SEALED AIR CORP	2,839	52.40	148,763.60
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,263	249.36	1,063,021.68
STEEL DYNAMICS INC	3,860	108.03	416,995.80
VULCAN MATERIALS CO	2,566	178.30	457,517.80
WESTROCK CO	5,456	36.51	199,198.56
3M CO	8,753	115.00	1,006,595.00
ALLEGION PLC	1,779	113.39	201,720.81
AMETEK INC	3,327	144.08	479,354.16
BOEING CO	9,927	211.98	2,104,325.46
CARRIER GLOBAL CORP	14,493	43.70	633,344.10
CATERPILLAR INC	9,017	257.61	2,322,869.37
CUMMINS INC	2,255	247.86	558,924.30
DEERE & CO	4,989	416.67	2,078,766.63
DOVER CORP	1,994	143.21	285,560.74
EATON CORP PLC	6,351	161.69	1,026,893.19
EMERSON ELECTRIC CO	9,163	89.48	819,905.24
FASTENAL CO	8,394	49.58	416,174.52
FERGUSON PLC	2,971	138.53	411,572.63
FORTIVE CORP	5,649	67.24	379,838.76
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	2,999	62.85	188,487.15
GENERAC HOLDINGS INC	1,634	114.39	186,913.26
GENERAL DYNAMICS CORP	3,784	235.45	890,942.80
GENERAL ELECTRIC CO	19,167	80.70	1,546,776.90
HEICO CORP	2,029	131.54	266,894.66
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	11,020	206.93	2,280,368.60
HOWMET AEROSPACE INC	8,552	39.41	337,034.32
HUBBELL INC	863	229.44	198,006.72
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	982	220.15	216,187.30
IDEX CORP	1,173	232.35	272,546.55
ILLINOIS TOOL WORKS INC	4,752	229.35	1,089,871.20
INGERSOLL-RAND INC	8,623	56.38	486,164.74
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	3,300	52.40	172,920.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	11,913	68.06	810,798.78
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	3,309	194.72	644,328.48
LENNOX INTERNATIONAL INC	670	249.50	167,165.00
LOCKHEED MARTIN CORP	3,991	449.23	1,792,876.93
MASCO CORP	4,074	51.12	208,262.88
NORDSON CORP	889	242.45	215,538.05
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,539	459.31	1,166,188.09
OTIS WORLDWIDE CORP	6,452	82.11	529,773.72

PACCAR INC	5,459	111.08	606,385.72
PARKER HANNIFIN CORP	2,069	312.69	646,955.61
PENTAIR PLC	3,113	50.38	156,832.94
QUANTA SERVICES INC	2,941	151.51	445,590.91
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	25,164	99.47	2,503,063.08
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,130	277.98	592,097.40
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,460	46.58	207,746.80
SMITH (A.O.) CORP	2,519	60.67	152,827.73
SNAP-ON INC	908	240.96	218,791.68
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,130	87.63	274,281.90
TEXTRON INC	4,092	69.60	284,803.20
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3,870	174.76	676,321.20
TRANSDIGM GROUP INC	914	694.25	634,544.50
UNITED RENTALS INC	1,343	393.80	528,873.40
WABTEC CORP/DE	3,554	104.99	373,134.46
WW GRAINGER INC	750	570.83	428,122.50
XYLEM INC	3,752	103.57	388,594.64
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	2,969	96.20	285,617.80
CINTAS CORP	1,412	440.24	621,618.88
COPART INC	7,374	65.10	480,047.40
COSTAR GROUP INC	7,315	78.63	575,178.45
EQUIFAX INC	2,434	221.98	540,299.32
JACOBS SOLUTIONS INC	2,196	121.35	266,484.60
LEIDOS HOLDINGS INC	2,496	97.30	242,860.80
REPUBLIC SERVICES INC	3,281	123.21	404,252.01
ROBERT HALF INTL INC	1,990	79.10	157,409.00
ROLLINS INC	5,923	36.32	215,123.36
TRANSUNION	4,465	69.66	311,031.90
VERISK ANALYTICS INC	2,577	183.35	472,492.95
WASTE CONNECTIONS INC	4,142	129.69	537,175.98
WASTE MANAGEMENT INC	6,534	152.27	994,932.18
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,231	99.09	221,069.79
CSX CORP	34,770	31.86	1,107,772.20
EXPEDITORS INTL WASH INC	2,620	108.35	283,877.00
FEDEX CORP	4,226	189.25	799,770.50
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,549	191.88	297,222.12
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,502	57.30	200,664.60
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,901	255.88	998,187.88
OLD DOMINION FREIGHT LINE INC	1,688	320.90	541,679.20
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,036	36.68	221,400.48
UBER TECHNOLOGIES INC	28,257	29.93	845,732.01
UNION PACIFIC CORP	10,343	203.18	2,101,490.74
UNITED PARCEL SERVICE CL B	12,185	179.99	2,193,178.15

APTIV PLC	5,354	106.02	567,631.08
BORGWARNER INC	6,055	44.52	269,568.60
FORD MOTOR CO	70,862	12.74	902,781.88
GENERAL MOTORS CO	24,343	36.20	881,216.60
LEAR CORP	1,616	134.94	218,063.04
TESLA INC	45,633	143.89	6,566,132.37
DR HORTON INC	5,534	97.00	536,798.00
GARMIN LTD	2,278	98.16	223,608.48
HASBRO INC	2,168	63.82	138,361.76
LENNAR CORP-CL A	4,596	99.09	455,417.64
LULULEMON ATHLETICA INC	2,060	311.21	641,092.60
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,495	116.60	174,317.00
NEWELL BRANDS INC	9,632	15.75	151,704.00
NIKE INC -CL B	21,459	126.83	2,721,644.97
NVR INC	54	5,039.19	272,116.26
PULTE HOMES INC	4,135	51.62	213,448.70
VF CORP	6,863	30.26	207,674.38
WHIRLPOOL CORP	1,057	152.73	161,435.61
AIRBNB INC-CLASS A	7,299	104.13	760,044.87
ARAMARK	6,210	44.76	277,959.60
BOOKING HOLDINGS INC	694	2,402.34	1,667,223.96
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A	506	1,595.09	807,115.54
DARDEN RESTAURANTS INC	2,610	145.98	381,007.80
DOMINO'S PIZZA INC	662	339.34	224,643.08
EXPEDIA GROUP INC	3,140	115.17	361,633.80
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	5,382	140.24	754,771.68
LAS VEGAS SANDS CORP	7,480	55.47	414,915.60
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	5,084	169.63	862,398.92
MCDONALD'S CORP	12,237	269.56	3,298,605.72
STARBUCKS CORP	19,814	106.64	2,112,964.96
VAIL RESORTS INC	1,018	254.26	258,836.68
YUM! BRANDS INC	4,041	128.51	519,308.91
ACTIVISION BLIZZARD INC	12,587	75.11	945,409.57
ALPHABET INC-CL A	100,763	97.70	9,844,545.10
ALPHABET INC-CL C	94,736	99.21	9,398,758.56
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,915	392.03	750,737.45
COMCAST CORP-CL A	72,049	39.75	2,863,947.75
DISH NETWORK CORPORATION	9,162	14.28	130,833.36
ELECTRONIC ARTS INC	4,488	127.49	572,175.12
FOX CORP-CLASS A	3,264	32.67	106,634.88
FOX CORP-CLASS B	6,426	30.63	196,828.38
INTERPUBLIC GROUP COS INC	7,849	36.48	286,331.52
LIBERTY BROADBAND-C	2,724	90.72	247,121.28

LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	3,916	69.80	273,336.80
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,312	39.96	172,307.52
META PLATFORMS INC-A	39,052	143.14	5,589,903.28
NETFLIX INC	7,701	363.83	2,801,854.83
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	8,586	19.53	167,684.58
OMNICOM GROUP	3,365	86.14	289,861.10
PARAMOUNT GLOBAL CLASS-B	11,692	20.83	243,544.36
PINTEREST INC- CLASS A	12,259	25.83	316,649.97
ROKU INC	3,821	52.61	201,022.81
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3,121	111.27	347,273.67
THE WALT DISNEY CO	31,099	106.00	3,296,494.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	8,830	47.62	420,484.60
WARNER BROS DISCOVERY INC	45,183	13.38	604,548.54
ADVANCE AUTO PARTS	1,326	147.27	195,280.02
AMAZON.COM INC	155,410	96.32	14,969,091.20
AUTOZONE INC	344	2,341.56	805,496.64
BEST BUY COMPANY INC	3,556	83.63	297,388.28
BURLINGTON STORES INC	1,368	224.58	307,225.44
CARMAX INC	3,735	66.72	249,199.20
Dollar General Corp	3,803	234.12	890,358.36
DOLLAR TREE INC	3,841	146.52	562,783.32
EBAY INC	9,601	46.69	448,270.69
ETSY INC	2,750	136.68	375,870.00
GENUINE PARTS CO	2,733	165.44	452,147.52
HOME DEPOT INC	17,231	317.69	5,474,116.39
LKQ CORP	5,108	57.41	293,250.28
LOWE'S COMPANIES	10,471	206.41	2,161,319.11
MERCADOLIBRE INC	875	1,109.91	971,171.25
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,107	799.09	884,592.63
POOL CORP	833	364.26	303,428.58
ROSS STORES INC	6,282	117.72	739,517.04
TARGET CORP	7,970	163.55	1,303,493.50
TJX COMPANIES INC	19,776	81.30	1,607,788.80
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,982	214.86	425,852.52
ULTA BEAUTY INC	891	501.53	446,863.23
COSTCO WHOLESALE CORP	7,515	492.11	3,698,206.65
KROGER CO	11,670	44.26	516,514.20
SYSCO CORP	8,185	78.11	639,330.35
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	12,389	35.90	444,765.10
WALMART INC	25,268	143.02	3,613,829.36
ALTRIA GROUP INC	29,798	44.78	1,334,354.44
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	10,031	85.77	860,358.87
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,118	67.16	343,724.88

BUNGE LIMITED	2,847	96.57	274,934.79
CAMPBELL SOUP CO	5,164	51.40	265,429.60
COCA-COLA COMPANY	67,841	60.55	4,107,772.55
COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC	4,363	55.25	241,055.75
CONAGRA BRANDS INC	9,256	37.26	344,878.56
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,623	227.50	596,732.50
GENERAL MILS INC	10,142	77.01	781,035.42
HERSHEY CO/THE	2,435	220.29	536,406.15
HORMEL FOODS CORP	5,933	44.60	264,611.80
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	1,950	149.60	291,720.00
KELLOGG CO	4,336	67.67	293,417.12
KEURIG DR PEPPER INC	14,499	34.98	507,175.02
KRAFT HEINZ CO/THE	12,650	39.82	503,723.00
LAMB WESTON HOLDING INC	2,312	96.98	224,217.76
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,409	78.60	346,547.40
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	4,270	51.47	219,776.90
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	21,840	64.84	1,416,105.60
MONSTER BEVERAGE CORP	6,704	103.02	690,646.08
PEPSICO INC	22,632	170.69	3,863,056.08
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	25,851	101.30	2,618,706.30
TYSON FOODS INC-CL A	4,055	65.24	264,548.20
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,266	82.72	352,883.52
CLOROX COMPANY	2,394	140.98	337,506.12
COLGATE-PALMOLIVE CO	11,778	75.94	894,421.32
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,220	277.16	1,169,615.20
KIMBERLY-CLARK CORP	5,357	134.63	721,212.91
PROCTER & GAMBLE CO	39,812	141.82	5,646,137.84
ABBOTT LABORATORIES	29,331	112.53	3,300,617.43
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,538	252.63	388,544.94
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,676	161.43	431,986.68
BAXTER INTL INC	8,946	44.91	401,764.86
BECTON DICKINSON & CO	4,730	245.75	1,162,397.50
BOSTON SCIENTIFIC CORP	24,027	45.84	1,101,397.68
CARDINAL HEALTH INC	5,581	74.85	417,737.85
CENTENE CORP	9,567	75.76	724,795.92
CIGNA CORP	5,108	308.99	1,578,320.92
COOPER COS INC/THE	952	343.15	326,678.80
CVS HEALTH CORPORATION	21,938	86.02	1,887,106.76
DAVITA INC	2,172	77.31	167,917.32
DENTSPLY SIRONA INC	5,559	35.89	199,512.51
DEXCOM INC	7,405	106.03	785,152.15
Edwards Lifesciences Corp	11,145	77.11	859,390.95

ELEVANCE HEALTH INC	3,945	478.52	1,887,761.40
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	6,141	69.60	427,413.60
HCA HEALTHCARE INC	3,902	252.68	985,957.36
HENRY SCHEIN INC	2,500	80.75	201,875.00
HOLOGIC INC	4,273	81.59	348,634.07
HUMANA INC	2,042	500.35	1,021,714.70
IDEXX LABORATORIES INC	1,526	486.70	742,704.20
INTUITIVE SURGICAL INC	6,346	257.98	1,637,141.08
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,438	253.99	365,237.62
MASIMO CORP	1,302	167.58	218,189.16
MCKESSON CORP	2,555	376.50	961,957.50
MEDTRONIC PLC	21,522	80.80	1,738,977.60
MOLINA HEALTHCARE INC	1,057	296.21	313,093.97
QUEST DIAGNOSTICS	1,798	143.90	258,732.20
RESMED INC	2,500	233.62	584,050.00
STERIS PLC	2,054	204.82	420,700.28
STRYKER CORP	5,857	255.75	1,497,927.75
TELEFLEX INC	963	235.62	226,902.06
UNITEDHEALTH GROUP INC	15,558	491.60	7,648,312.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	1,297	146.15	189,556.55
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2,626	168.09	441,404.34
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	3,502	125.48	439,430.96
ABBVIE INC	30,149	147.69	4,452,705.81
AGILENT TECHNOLOGIES INC	5,084	155.69	791,527.96
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,426	228.11	553,394.86
AMGEN INC	9,020	259.70	2,342,494.00
AVANTOR INC	13,036	23.04	300,349.44
BIOGEN INC	2,611	291.88	762,098.68
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,903	113.82	444,239.46
BIO-RAD LABORATORIES-A	537	457.00	245,409.00
BIO-TECHNE CORP	3,473	80.15	278,360.95
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	35,841	72.34	2,592,737.94
CATALENT INC	4,045	49.57	200,510.65
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,185	246.26	291,818.10
DANAHER CORP	11,808	271.58	3,206,816.64
ELI LILLY & CO	13,769	346.39	4,769,443.91
GILEAD SCIENCES INC	21,657	84.02	1,819,621.14
ILLUMINA INC	2,945	215.15	633,616.75
INCYTE CORP	3,721	83.64	311,224.44
IQVIA HOLDINGS INC	3,411	225.78	770,135.58
JOHNSON & JOHNSON	43,684	168.31	7,352,454.04
MERCK & CO. INC.	42,747	108.52	4,638,904.44
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	395	1,534.75	606,226.25

MODERNA INC	6,071	196.76	1,194,529.96
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,290	108.66	248,831.40
PERKINELMER INC	2,443	134.87	329,487.41
PFIZER INC	94,651	44.71	4,231,846.21
Regeneron Pharmaceuticals Inc	1,861	727.47	1,353,821.67
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	5,158	38.26	197,345.08
SEAGEN INC	2,893	136.85	395,907.05
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	6,681	580.72	3,879,790.32
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	4,546	313.57	1,425,489.22
VIATRIS INC	23,496	11.60	272,553.60
WATERS CORP	1,025	334.03	342,380.75
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	1,469	258.33	379,486.77
ZOETIS INC	8,006	165.89	1,328,115.34
BANK OF AMERICA CORP	122,171	34.57	4,223,451.47
CITIGROUP INC	32,410	51.42	1,666,522.20
CITIZENS FINANCIAL GROUP	9,844	41.82	411,676.08
FIFTH THIRD BANCORP	12,615	35.15	443,417.25
FIRST HORIZON NATIONAL CORP	8,624	24.59	212,064.16
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,739	136.21	509,289.19
HUNTINGTON BANCSHARES INC	29,401	14.68	431,606.68
JPMORGAN CHASE & CO	49,500	138.45	6,853,275.00
KEYCORP	17,273	17.93	309,704.89
M & T BANK CORP	3,105	154.94	481,088.70
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	6,812	158.42	1,079,157.04
REGIONS FINANCIAL CORP	19,166	22.83	437,559.78
SVB FINANCIAL GROUP	1,264	288.35	364,474.40
TRUIST FINANCIAL CORP	23,404	48.34	1,131,349.36
US BANCORP	23,534	46.67	1,098,331.78
WELLS FARGO & COMPANY	64,130	44.45	2,850,578.50
ALLY FINANCIAL INC	6,803	31.36	213,342.08
AMERICAN EXPRESS COMPANY	10,671	155.33	1,657,526.43
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,938	341.00	660,858.00
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	7,970	67.70	539,569.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	12,236	49.46	605,192.56
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	21,563	311.30	6,712,561.90
BLACKROCK INC	2,552	752.07	1,919,282.64
BLACKSTONE INC	12,491	88.22	1,101,956.02
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	6,624	106.51	705,522.24
CARLYLE GROUP INC/THE	6,081	34.44	209,429.64
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,126	121.57	258,457.82
CME GROUP INC	5,727	173.13	991,515.51
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	4,507	111.49	502,485.43
EQUITABLE HOLDINGS INC	8,694	30.59	265,949.46

FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	693	419.64	290,810.52
FRANKLIN RESOURCES INC	7,144	29.93	213,819.92
GOLDMAN SACHS GROUP INC	5,617	348.33	1,956,569.61
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	9,097	106.25	966,556.25
INVESCO LTD	10,219	18.52	189,255.88
KKR & CO INC	11,119	53.37	593,421.03
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	1,466	230.91	338,514.06
MARKETAXESS HOLDINGS INC	743	329.52	244,833.36
MOODY'S CORP	2,774	315.36	874,808.64
MORGAN STANLEY	21,675	95.51	2,070,179.25
MSCI INC	1,417	519.84	736,613.28
NASDAQ INC	6,966	61.92	431,334.72
NORTHERN TRUST CORP	3,594	94.77	340,603.38
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,946	117.00	461,682.00
S&P GLOBAL INC	5,696	367.72	2,094,533.12
SCHWAB (CHARLES) CORP	25,117	79.25	1,990,522.25
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,374	62.57	85,971.18
STATE STREET CORP	6,348	87.03	552,466.44
SYNCHRONY FINANCIAL	8,973	35.37	317,375.01
T ROWE PRICE GROUP INC	3,809	117.48	447,481.32
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	2,464	71.60	176,422.40
AFLAC INC	8,914	72.80	648,939.20
ALLSTATE CORP	4,462	127.26	567,834.12
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,652	138.21	228,322.92
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	12,652	63.16	799,100.32
AON PLC	3,492	324.34	1,132,595.28
ARCH CAPITAL GROUP LTD	7,441	64.04	476,521.64
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,775	197.01	743,712.75
ASSURANT INC	1,238	128.84	159,503.92
BROWN & BROWN INC	5,060	58.71	297,072.60
CHUBB LTD	6,756	228.35	1,542,732.60
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,621	105.50	276,515.50
EVEREST RE GROUP LTD	874	343.50	300,219.00
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	5,489	42.87	235,313.43
GLOBE LIFE INC	2,007	119.43	239,696.01
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	4,312	76.39	329,393.68
LINCOLN NATIONAL CORP	5,302	32.53	172,474.06
LOEWS CORP	4,215	60.23	253,869.45
MARKEL CORP	224	1,389.55	311,259.20
MARSH & MCLENNAN COS	8,201	173.49	1,422,791.49
METLIFE INC	10,028	70.97	711,687.16
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	5,080	89.77	456,031.60
PROGRESSIVE CORP	9,811	129.19	1,267,483.09

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5,906	100.88	595,797.28
TRAVELERS COS INC/THE	3,419	193.25	660,721.75
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,579	252.74	399,076.46
WR BERKLEY CORP	4,183	70.78	296,072.74
CBRE GROUP INC - A	5,121	83.20	426,067.20
ACCENTURE PLC-CL A	10,723	274.87	2,947,431.01
ADOBE INC	8,061	361.32	2,912,600.52
AKAMAI TECHNOLOGIES	2,800	87.75	245,700.00
ANSYS INC	1,772	257.60	456,467.20
AUTODESK INC	4,027	206.43	831,293.61
AUTOMATIC DATA PROCESSING	7,083	239.15	1,693,899.45
BLACK KNIGHT INC	2,918	60.53	176,626.54
BLOCK INC-A	10,451	80.79	844,336.29
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	1,992	150.26	299,317.92
CADENCE DESIGN SYS INC	4,861	182.38	886,549.18
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,004	128.10	256,712.40
CLOUDFLARE INC - CLASS A	6,398	46.67	298,594.66
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	7,979	63.92	510,017.68
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC-A	4,324	104.60	452,290.40
CYBERARK SOFTWARE LTD	1,419	136.13	193,168.47
DATADOG INC - CLASS A	5,464	73.69	402,642.16
DOCUSIGN INC	5,237	57.95	303,484.15
DYNATRACE INC	5,871	36.98	217,109.58
EPAM SYSTEMS INC	1,203	331.95	399,335.85
FAIR ISAAC CORP	511	640.22	327,152.42
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	11,349	74.41	844,479.09
FISERV INC	10,583	103.71	1,097,562.93
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,213	199.57	242,078.41
FORTINET INC	12,935	51.09	660,849.15
GARTNER INC	1,471	332.93	489,740.03
GEN DIGITAL INC	10,589	22.66	239,946.74
GLOBAL PAYMENTS INC	4,993	112.29	560,663.97
GODADDY INC - CLASS A	3,338	80.96	270,244.48
HUBSPOT INC	1,049	346.92	363,919.08
INTL BUSINESS MACHINES CORP	15,213	141.49	2,152,487.37
INTUIT INC	4,769	401.55	1,914,991.95
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,368	178.43	244,092.24
MASTERCARD INC-CLASS A	14,566	380.01	5,535,225.66
MICROSOFT CORP	119,743	242.04	28,982,595.72
MONGODB INC	1,719	199.88	343,593.72
ORACLE CORPORATION	27,006	89.70	2,422,438.20
PALO ALTO NETWORKS INC	5,519	151.14	834,141.66

PAYCHEX INC	5,007	118.62	593,930.34
PAYCOM SOFTWARE INC	1,144	319.92	365,988.48
PAYPAL HOLDINGS INC	19,375	79.58	1,541,862.50
PTC INC	2,242	133.62	299,576.04
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,699	446.18	758,059.82
SALESFORCE INC	17,497	154.86	2,709,585.42
SERVICENOW INC	3,655	443.41	1,620,663.55
SNOWFLAKE INC-CLASS A	4,421	145.79	644,537.59
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,476	57.58	257,728.08
SYNOPSYS INC	2,718	349.28	949,343.04
TWILIO INC - A	4,863	56.41	274,321.83
TYLER TECHNOLOGIES INC	904	319.00	288,376.00
VERISIGN INC	1,684	215.51	362,918.84
VISA INC-CLASS A SHARES	27,509	223.89	6,158,990.01
VMWARE INC-CLASS A	3,449	125.74	433,677.26
WESTERN UNION CO	6,501	14.14	91,924.14
WORKDAY INC-CLASS A	3,961	172.53	683,391.33
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	4,835	69.43	335,694.05
AMPHENOL CORP-CL A	8,998	79.44	714,801.12
APPLE INC	271,346	142.53	38,674,945.38
ARISTA NETWORKS INC	4,492	121.77	546,990.84
CDW CORP/DE	2,207	197.14	435,087.98
CISCO SYSTEMS INC	68,069	47.81	3,254,378.89
COGNEX CORP	3,648	52.84	192,760.32
CORNING INC	13,026	35.81	466,461.06
DELL TECHNOLOGIES -C	5,359	40.59	217,521.81
F5 INC	1,081	146.47	158,334.07
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	24,782	16.17	400,724.94
HP INC	17,159	28.40	487,315.60
JUNIPER NETWORKS INC	6,450	32.01	206,464.50
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	3,051	180.21	549,820.71
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,838	256.23	727,180.74
NETAPP INC	3,747	66.86	250,524.42
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	3,695	62.23	229,939.85
TE CONNECTIVITY LTD	4,783	124.65	596,200.95
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	959	410.32	393,496.88
TRIMBLE INC	5,151	56.28	289,898.28
WESTERN DIGITAL CORP	6,537	41.10	268,670.70
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	982	310.08	304,498.56
AT&T INC	119,091	19.16	2,281,783.56
T-MOBILE US INC	11,194	145.81	1,632,197.14
VERIZON COMMUNICATIONS INC	69,455	40.42	2,807,371.10
AES CORPORATION	14,059	26.99	379,452.41

ALLIANT ENERGY CORP	5,098	54.33	276,974.34	
AMEREN CORPORATION	4,502	86.47	389,287.94	
AMERICAN ELECTRIC POWER	7,852	92.70	727,880.40	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,857	154.54	441,520.78	
ATMOS ENERGY CORP	2,619	114.85	300,792.15	
CENTERPOINT ENERGY INC	13,208	30.19	398,749.52	
CMS ENERGY CORP	5,020	61.79	310,185.80	
CONSOLIDATED EDISON INC	5,560	94.05	522,918.00	
CONSTELLATION ENERGY	6,508	83.91	546,086.28	
DOMINION ENERGY INC	13,675	62.48	854,414.00	
DTE ENERGY COMPANY	3,400	113.43	385,662.00	
DUKE ENERGY CORP	12,095	101.37	1,226,070.15	
EDISON INTERNATIONAL	6,921	67.82	469,382.22	
ENTERGY CORP	3,808	107.27	408,484.16	
ESSENTIAL UTILITIES INC	5,987	46.86	280,550.82	
EVERGY INC	4,925	61.35	302,148.75	
EVERSOURCE ENERGY	5,258	80.25	421,954.50	
EXELON CORP	16,435	41.51	682,216.85	
FIRSTENERGY CORP	10,471	41.18	431,195.78	
NEXTERA ENERGY INC	33,640	83.90	2,822,396.00	
NISOURCE INC	9,948	27.32	271,779.36	
NRG ENERGY INC	4,979	32.90	163,809.10	
PPL CORPORATION	12,337	29.49	363,818.13	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	7,941	60.95	484,003.95	
SEMPRA ENERGY	5,348	159.12	850,973.76	
SOUTHERN CO	17,631	66.70	1,175,987.70	
UGI CORP	4,377	39.48	172,803.96	
WEC ENERGY GROUP INC	4,785	92.88	444,430.80	
XCEL ENERGY INC	8,494	68.34	580,479.96	
ADVANCED MICRO DEVICES	28,470	74.70	2,126,709.00	
ANALOG DEVICES	8,673	168.86	1,464,522.78	
APPLIED MATERIALS INC	14,693	112.99	1,660,162.07	
BROADCOM INC	6,788	585.03	3,971,183.64	
ENPHASE ENERGY INC	2,625	219.47	576,108.75	
FIRST SOLAR INC	1,542	171.48	264,429.87	
INTEL CORP	67,615	29.92	2,023,040.80	
KLA CORPORATION	2,426	423.14	1,026,537.64	
LAM RESEARCH CORP	2,356	487.50	1,148,550.00	
MARVELL TECHNOLOGY INC	16,957	42.51	720,842.07	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	9,698	75.72	734,332.56	
MICRON TECHNOLOGY INC	18,782	61.26	1,150,585.32	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	886	419.13	371,349.18	
NVIDIA CORP	42,644	192.65	8,215,366.60	

NXP SEMICONDUCTORS NV	4,430	173.17	767,143.10	
ON SEMICONDUCTOR CORP	8,344	70.08	584,747.52	
QORVO INC	2,089	108.11	225,841.79	
QUALCOMM INC	18,793	130.70	2,456,245.10	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,433	107.31	261,085.23	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	1,140	308.37	351,541.80	
TERADYNE INC	2,963	103.02	305,248.26	
TEXAS INSTRUMENTS	14,739	177.04	2,609,392.56	
米ドル小計	5,556,855		585,796,404.47 (76,387,851,142)	
	銘柄数	521		
	比率	68.6%	71.7%	
加ドル	株	加ドル	加ドル	
CAMECO CORP	10,519	36.04	379,104.76	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	21,345	80.92	1,727,237.40	
CENOVUS ENERGY INC	28,313	25.51	722,264.63	
ENBRIDGE INC	35,136	55.55	1,951,804.80	
IMPERIAL OIL LTD	6,138	69.49	426,529.62	
KEYERA CORP	8,073	30.94	249,778.62	
PEMBINA PIPELINE CORP	12,166	47.57	578,736.62	
SUNCOR ENERGY INC	24,493	44.78	1,096,796.54	
TC ENERGY CORP	17,981	57.43	1,032,648.83	
AGNICO EAGLE MINES LTD	8,867	76.66	679,744.22	
BARRICK GOLD CORP	30,068	25.95	780,264.60	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,988	61.40	244,863.20	
FRANCO-NEVADA CORP	3,301	198.23	654,357.23	
NUTRIEN LTD	10,267	105.27	1,080,807.09	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	9,825	61.13	600,602.25	
CAE INC	9,721	29.08	282,686.68	
WSP GLOBAL INC	2,801	174.69	489,306.69	
THOMSON REUTERS CORP	3,480	158.03	549,944.40	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	10,000	165.91	1,659,100.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	16,644	106.94	1,779,909.36	
MAGNA INTERNATIONAL INC	5,815	81.25	472,468.75	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,253	40.71	254,559.63	
RESTAURANT BRANDS INTERN	6,372	90.56	577,048.32	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,979	39.50	354,670.50	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	1,268	158.79	201,345.72	
DOLLARAMA INC	5,809	85.18	494,810.62	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	14,435	62.36	900,166.60	
LOBLAW COMPANIES LTD	3,704	119.39	442,220.56	
METRO INC	5,518	75.58	417,050.44	
WESTON (GEORGE) LTD	1,926	175.13	337,300.38	

SAPUTO INC	7,809	35.12	274,252.08	
BANK OF MONTREAL	11,144	133.26	1,485,049.44	
BANK OF NOVA SCOTIA	18,625	69.42	1,292,947.50	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	15,441	58.37	901,291.17	
NATIONAL BANK OF CANADA	6,310	99.20	625,952.00	
ROYAL BANK OF CANADA	22,396	135.12	3,026,147.52	
TORONTO-DOMINION BANK	29,807	89.87	2,678,755.09	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	5,899	43.01	253,715.99	
BROOKFIELD CORP	23,894	49.10	1,173,195.40	
IGM FINANCIAL INC	4,870	41.16	200,449.20	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	534	841.03	449,110.02	
GREAT-WEST LIFECO INC	8,175	34.31	280,484.25	
INTACT FINANCIAL CORP	3,369	198.40	668,409.60	
MANULIFE FINANCIAL CORP	27,726	25.74	713,667.24	
POWER CORP OF CANADA	10,434	35.56	371,033.04	
SUN LIFE FINANCIAL INC	7,679	65.59	503,665.61	
CGI INC	3,388	117.39	397,717.32	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	378	2,336.99	883,382.22	
OPEN TEXT CORP	6,947	44.45	308,794.15	
SHOPIFY INC - CLASS A	22,768	57.09	1,299,825.12	
BCE INC	3,187	61.91	197,307.17	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	6,893	66.49	458,315.57	
TELUS CORP	1,600	28.52	45,632.00	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	26,008	9.80	254,878.40	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	5,091	37.78	192,337.98	
EMERA INC	6,146	54.38	334,219.48	
FORTIS INC	7,776	55.69	433,045.44	
HYDRO ONE LTD	8,735	37.44	327,038.40	
加ドル小計	636,234		41,448,747.46 (4,040,423,902)	
	銘柄数	58		
	比率	3.6%	3.8%	
ユーロ	株	ユーロ	ユーロ	
ENI SPA	48,903	14.18	693,444.54	
Galp Energia SGPS SA	15,765	12.80	201,792.00	
NESTE OYJ	7,586	45.38	344,252.68	
OMV AG	4,333	44.74	193,858.42	
REPSOL SA	29,281	15.29	447,706.49	
TENARIS SA	13,137	16.04	210,717.48	
TOTALENERGIES SE	43,532	58.69	2,554,893.08	
AIR LIQUIDE	8,140	144.68	1,177,695.20	
AKZO NOBEL	2,677	68.80	184,177.60	
ARCELORMITTAL	10,164	28.52	289,928.10	

BASF SE	13,231	53.04	701,772.24
COVESTRO AG	3,476	42.64	148,216.64
CRH PLC(DUBLIN)	10,346	41.44	428,789.97
EVONIK INDUSTRIES AG	6,597	20.20	133,259.40
HEIDELBERGCEMENT AG	1,652	58.20	96,146.40
KONINKLIJKE DSM NV	2,869	121.00	347,149.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	4,945	39.50	195,327.50
SOLVAY SA	1,770	104.20	184,434.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	8,070	14.01	113,101.05
SYMRISE AG	2,449	98.36	240,883.64
UMICORE	5,656	34.69	196,206.64
UPM-KYMMENE OYJ	8,541	33.98	290,223.18
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,456	26.98	120,222.88
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCC	4,456	0.46	2,062.23
AIRBUS SE	9,943	120.78	1,200,915.54
ALSTOM	7,788	26.71	208,017.48
BOUYGUES	2,236	30.13	67,370.68
BRENNTAG SE	2,663	68.06	181,243.78
CNH INDUSTRIAL NV	19,210	15.78	303,229.85
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	8,025	53.34	428,053.50
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	8,161	30.49	248,869.69
Eiffage SA	1,285	98.62	126,726.70
FERROVIAL SA	8,010	27.26	218,352.60
GEA GROUP AG	3,477	40.66	141,374.82
IMCD NV	1,242	147.30	182,946.60
KINGSPAN GROUP PLC	3,628	58.46	212,092.88
KONE OYJ-B	5,060	51.56	260,893.60
Legrand SA	4,082	82.34	336,111.88
MTU AERO ENGINES AG	967	227.30	219,799.10
Prysmian SpA	5,223	37.64	196,593.72
SAFRAN SA	5,919	131.28	777,046.32
SCHNEIDER ELECTRIC SE	8,986	146.08	1,312,674.88
SIEMENS AG	12,994	143.30	1,862,040.20
SIEMENS ENERGY AG	10,631	18.94	201,351.14
THALES SA	2,166	122.90	266,201.40
VINCI S.A.	8,232	104.54	860,573.28
WARTSILA	15,462	8.72	134,890.48
Bureau Veritas SA	5,163	26.39	136,251.57
RANDSTAD NV	2,025	59.22	119,920.50
TELEPERFORMANCE	1,382	251.60	347,711.20
WOLTERS KLUWER	3,907	100.10	391,090.70
AENA SME SA	1,427	137.40	196,069.80
Aéroports de Paris	1,165	144.95	168,866.75

DEUTSCHE POST AG	15,531	39.96	620,696.41
GETLINK SE	10,838	15.72	170,373.36
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	5,280	91.79	484,651.20
CONTINENTAL AG	2,681	63.26	169,600.06
DR ING HC F PORSCHE AG	1,830	102.80	188,124.00
FERRARI NV	2,090	223.40	466,906.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	12,986	67.75	879,801.50
MICHELIN (CGDE)	10,691	28.85	308,488.80
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	2,526	54.86	138,576.36
STELLANTIS NV	34,389	14.02	482,133.78
VALEO SA	8,084	18.84	152,342.98
VOLKSWAGEN AG	720	159.00	114,480.00
VOLKSWAGEN AG PFD	2,738	123.80	338,964.40
ADIDAS AG	2,950	148.72	438,724.00
HERMES INTERNATIONAL	552	1,650.50	911,076.00
KERING	1,224	538.80	659,491.20
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	4,645	794.80	3,691,846.00
MONCLER SPA	4,192	56.52	236,931.84
PUMA AG	2,408	62.28	149,970.24
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	3,479	146.75	510,543.25
SODEXO	2,417	91.82	221,928.94
PUBLICIS GROUPE	4,448	64.08	285,027.84
SCOUT24 SE	2,884	51.28	147,891.52
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,201	19.60	62,755.60
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	12,863	23.44	301,508.72
VIVENDI SA	7,736	9.57	74,079.93
INDITEX	17,437	27.50	479,517.50
PROSUS NV	14,896	76.47	1,139,097.12
ZALANDO SE	5,924	41.99	248,748.76
CARREFOUR SA	11,041	17.20	189,960.40
HELLOFRESH SE	5,610	22.90	128,469.00
JERONIMO MARTINS	6,540	19.94	130,407.60
KESKO OYJ-B SHS	4,988	21.56	107,541.28
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	14,276	27.11	387,022.36
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	14,974	54.76	819,976.24
DANONE	8,666	50.15	434,599.90
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	15,438	9.94	153,515.47
HEINEKEN HOLDING NV	1,563	74.35	116,209.05
HEINEKEN NV	4,134	91.04	376,359.36
KERRY GROUP PLC-A	2,364	87.72	207,370.08
PERNOD-RICARD	3,123	193.75	605,081.25
BEIERSDORF AG	2,227	111.20	247,642.40
HENKEL AG & CO KGAA	1,673	60.85	101,802.05

HENKEL AG AND CO KGAA VORZUG	2,380	64.98	154,652.40
L'OREAL	3,992	379.50	1,514,964.00
ESSILORLUXOTTICA	5,096	170.95	871,161.20
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	3,573	33.35	119,159.55
Fresenius SE & CO KG	6,702	27.71	185,712.42
KONINKLIJKE PHILIPS NV	15,055	15.65	235,701.08
SIEMENS HEALTHINEERS AG	5,766	49.31	284,321.46
BAYER AG	16,076	55.52	892,539.52
EUROFINS SCIENTIFIC	2,919	64.28	187,633.32
MERCK KGAA	2,219	189.60	420,722.40
ORION OYJ	3,032	49.00	148,568.00
QIAGEN N V	4,595	46.21	212,334.95
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,752	41.31	154,995.12
SANOFI	18,674	89.38	1,669,082.12
SARTORIUS AG-VORZUG	639	403.00	257,517.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	731	306.00	223,686.00
UCB SA	2,385	76.52	182,500.20
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	99,772	6.43	641,633.73
BANCO SANTANDER S.A	272,453	3.10	845,694.11
BNP PARIBAS	18,814	60.75	1,142,950.50
CaixaBank SA	95,341	3.97	378,980.47
COMMERZBANK AG	28,567	9.67	276,471.42
CREDIT AGRICOLE SA	20,289	10.65	216,159.00
ERSTE GROUP BANK AG	8,454	33.53	283,462.62
FINECOBANK SPA	15,029	16.01	240,689.43
ING GROEP NV-CVA	64,667	12.80	827,737.60
INTESA SANPAOLO	286,831	2.28	655,552.25
KBC GROEP NV	5,179	67.54	349,789.66
MEDIOBANCA SPA	13,643	9.68	132,118.81
SOCIETE GENERALE-A	15,487	25.09	388,646.26
UNICREDIT SPA	36,911	15.25	563,114.21
DEUTSCHE BANK AG -REG	38,349	11.97	459,267.62
DEUTSCHE BOERSE AG	2,898	162.25	470,200.50
EXOR NV	1,661	72.00	119,592.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,850	78.94	146,039.00
Wendel	1,651	97.55	161,055.05
AEGON NV	40,693	5.03	204,685.79
AGEAS	3,549	44.50	157,930.50
ALLIANZ SE	6,308	220.70	1,392,175.60
ASSICURAZIONI GENERALI	12,690	17.91	227,341.35
AXA SA	27,860	28.27	787,602.20
HANNOVER RUECK SE	1,066	188.00	200,408.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2,218	331.70	735,710.60

NN GROUP NV	4,265	39.15	166,974.75	
POSTE ITALIANE SPA	18,062	9.64	174,226.05	
SAMPO OYJ-A SHS	7,007	48.93	342,852.51	
AROUNDTOWN SA	48,533	2.74	133,223.08	
LEG IMMOBILIEN SE	1,858	73.10	135,819.80	
VONOVIA SE	12,756	26.67	340,202.52	
ADYEN NV /WI	427	1,353.00	577,731.00	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	7,836	57.14	447,749.04	
CAPGEMINI	2,710	173.15	469,236.50	
DASSAULT SYSTEMES SE	12,037	34.72	417,984.82	
EDENRED	5,123	49.91	255,688.93	
SAP SE	17,026	106.62	1,815,312.12	
WORLDLINE SA	5,214	40.22	209,707.08	
NOKIA OYJ	81,626	4.23	345,767.73	
CELLNEX TELECOM SAU	11,325	36.56	414,042.00	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	52,352	20.12	1,053,584.00	
ELISA OYJ	1,201	51.88	62,307.88	
KONIKLIJKE KPN NV	54,449	3.05	166,396.14	
ORANGE	23,631	9.62	227,542.89	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	53,421	2.57	137,772.75	
TELEFONICA SA	91,190	3.54	322,994.98	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,808	21.66	125,801.28	
E.ON SE	38,841	10.10	392,488.30	
ELECTRICITE DE FRANCE	16,107	12.00	193,284.00	
ENAGAS SA	7,420	16.87	125,212.50	
ENDESA SA	7,302	18.39	134,283.78	
ENEL SPA	116,358	5.49	639,503.56	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,123	4.79	259,411.53	
ENGIE	31,149	12.96	403,753.33	
FORTUM OYJ	12,921	14.41	186,191.61	
IBERDROLA SA	95,101	10.84	1,031,370.34	
NATURGY ENERGY GROUP SA	5,791	26.00	150,566.00	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	6,067	16.54	100,378.51	
RWE AG	11,678	42.15	492,227.70	
SNAM SPA	26,717	4.73	126,451.56	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	28,282	7.36	208,268.64	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	11,988	27.26	326,792.88	
ASM INTERNATIONAL NV	937	311.65	292,016.05	
ASML HOLDING NV	6,901	615.70	4,248,945.70	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	22,258	31.69	705,467.31	
STMICROELECTRONICS NV	10,943	39.09	427,816.58	
一口小計	2,979,305		77,391,381.50 (10,984,932,690)	

	銘柄数	180		
	比率	9.9%	10.3%	
英ポンド	株	英ポンド	英ポンド	
BP PLC	303,480	4.75	1,442,288.70	
SHELL PLC-NEW	118,157	23.47	2,773,735.57	
ANGLO AMERICAN PLC	23,893	35.80	855,369.40	
CRODA INTERNATIONAL PLC	2,914	70.18	204,504.52	
GLENCORE PLC	179,244	5.65	1,013,804.06	
JOHNSON MATTHEY PLC	5,873	21.38	125,564.74	
MONDI PLC	8,456	15.12	127,897.00	
RIO TINTO PLC	20,348	62.80	1,277,854.40	
ASHTREAD GROUP PLC	8,223	50.54	415,590.42	
BAE SYSTEMS PLC	53,900	8.59	463,001.00	
BUNZL PLC	6,030	29.35	176,980.50	
DCC PLC	2,505	45.05	112,850.25	
MELROSE INDUSTRIES PLC	108,972	1.44	157,682.48	
SMITHS GROUP PLC	5,259	17.29	90,928.11	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	1,614	115.70	186,739.80	
EXPERIAN PLC	14,876	29.62	440,627.12	
INTERTEK GROUP PLC	2,217	42.83	94,954.11	
RELX PLC	27,988	23.77	665,274.76	
RENTOKIL INITIAL PLC	42,739	5.11	218,738.20	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	28,742	4.55	131,034.77	
BURBERRY GROUP PLC	7,695	23.81	183,217.95	
PERSIMMON PLC	6,329	14.07	89,049.03	
COMPASS GROUP PLC	29,675	19.22	570,501.87	
ENTAIN PLC	14,072	15.59	219,452.84	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,592	57.00	261,744.00	
Whitbread PLC	6,005	30.89	185,494.45	
AUTO TRADER GROUP PLC	18,454	5.93	109,542.94	
INFORMA PLC	31,969	6.59	210,803.58	
WPP PLC	18,933	9.37	177,515.80	
KINGFISHER PLC	39,800	2.63	104,713.80	
NEXT PLC	2,193	65.06	142,676.58	
TESCO PLC	114,236	2.43	278,621.60	
Associated British Foods PLC	6,549	18.32	119,977.68	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	34,932	30.93	1,080,621.42	
DIAGEO PLC	36,804	36.88	1,357,331.52	
IMPERIAL BRANDS PLC	15,561	20.55	319,778.55	
HALEON PLC	94,466	3.13	295,914.74	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	11,546	56.96	657,660.16	
UNILEVER PLC	41,391	40.99	1,696,824.04	
SMITH & NEPHEW PLC	13,900	11.43	158,946.50	

ASTRAZENECA PLC	26,229	107.10	2,809,125.90	
GSK PLC	65,227	13.87	904,698.49	
BARCLAYS PLC	258,194	1.79	464,129.53	
HSBC HOLDINGS PLC	335,456	5.94	1,995,292.28	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,104,268	0.50	553,569.54	
NATWEST GROUP PLC	98,005	2.98	292,740.93	
STANDARD CHARTERED PLC	46,639	7.12	332,256.23	
3I GROUP PLC	11,587	14.68	170,155.09	
ABRDN PLC	72,862	2.08	152,062.99	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	15,515	8.65	134,204.75	
London Stock Exchange Group PLC	5,567	72.64	404,386.88	
M&G PLC	70,605	2.06	146,011.14	
SCHRODERS PLC	22,394	4.76	106,774.59	
ST JAMES'S PLACE PLC	15,039	12.00	180,468.00	
ADMIRAL GROUP PLC	5,844	21.34	124,710.96	
AVIVA PLC	51,825	4.41	228,703.72	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	95,447	2.59	247,780.41	
PRUDENTIAL PLC	48,374	13.12	634,908.75	
SAGE GROUP PLC/THE	19,098	7.63	145,755.93	
HALMA PLC	8,694	21.28	185,008.32	
BT GROUP PLC	117,225	1.31	153,623.36	
VODAFONE GROUP PLC	430,804	0.92	396,942.80	
NATIONAL GRID PLC	55,239	10.31	569,514.09	
SEVERN TRENT PLC	6,252	27.85	174,118.20	
SSE PLC	19,222	17.31	332,828.93	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	16,404	10.58	173,636.34	
英ポンド小計	4,536,547		31,209,217.11 (5,013,448,636)	
	銘柄数	66		
	比率	4.5%	4.7%	
スイスフラン	株	スイスフラン	スイスフラン	
CLARIANT AG-REG	8,395	15.51	130,206.45	
GIVAUDAN-REG	157	2,930.00	460,010.00	
HOLCIM LTD	8,692	52.90	459,806.80	
SIKA AG-REG	2,723	259.70	707,163.10	
ABB LTD	23,081	31.54	727,974.74	
GEBERIT AG-REG	493	504.80	248,866.40	
Schindler Holding AG	1,032	186.00	191,952.00	
Schindler Holding AG	381	197.10	75,095.10	
ADECCO GROUP AG(REG)	3,975	33.91	134,792.25	
SGS SA	78	2,331.00	181,818.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	997	220.70	220,037.90	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	9,251	139.35	1,289,126.85	

THE SWATCH GROUP AG-B	706	321.90	227,261.40	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	59	1,913.00	112,867.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	101,900.00	203,800.00	
Lindt & Spruengli AG	26	10,180.00	264,680.00	
NESTLE SA-REGISTERED	45,407	112.56	5,111,011.92	
ALCON INC	8,832	67.98	600,399.36	
SONOVA HOLDING AG	1,057	234.00	247,338.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	2,600	121.45	315,770.00	
LONZA GROUP AG-REG	1,354	485.80	657,773.20	
NOVARTIS AG-REG SHS	35,134	85.06	2,988,498.04	
ROCHE HOLDING AG-BR	556	348.40	193,710.40	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	11,702	295.40	3,456,770.80	
CREDIT SUISSE GROUP AG	81,990	3.18	261,056.16	
JULIUS BAER GROUP LTD	4,836	58.36	282,228.96	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	415	884.20	366,943.00	
UBS GROUP AG	56,865	19.63	1,116,544.27	
Baloise Holding AG	876	150.80	132,100.80	
SWISS LIFE HOLDING AG	537	548.20	294,383.40	
SWISS RE AG	4,932	95.78	472,386.96	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,317	454.70	1,053,539.90	
SWISS PRIME SITE	1,479	82.80	122,461.20	
TEMENOS GROUP AG-REG	2,012	62.70	126,152.40	
Logitech International SA	3,635	53.92	195,999.20	
SWISSCOM AG-REG	432	541.20	233,798.40	
スイスフラン小計	327,016		23,864,324.36 (3,373,460,891)	
	銘柄数	36		
	比率	3.0%	3.2%	
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	
BOLIDEN AB	7,316	464.55	3,398,647.80	
SVENSKA CELLULOOSA AB-B SHS	11,220	147.10	1,650,462.00	
ALFA LAVAL AB	6,227	326.20	2,031,247.40	
ASSA ABLOY AB-B	14,750	244.50	3,606,375.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	34,663	132.66	4,598,393.58	
ATLAS COPCO AB-B SHS	37,774	117.90	4,453,554.60	
EPIROC AB-A	9,935	213.20	2,118,142.00	
EPIROC AB-B	10,467	182.35	1,908,657.45	
Husqvarna AB	20,790	80.48	1,673,179.20	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	30,327	113.50	3,442,114.50	
SANDVIK AB	17,215	217.10	3,737,376.50	
SKANSKA AB-B SHS	7,875	184.80	1,455,300.00	
SKF AB-B SHARES	7,510	185.35	1,391,978.50	
VOLVO AB-B SHS	25,166	206.15	5,187,970.90	

SECURITAS AB-B SHS	15,856	98.10	1,555,473.60	
EVOLUTION AB	3,498	1,180.00	4,127,640.00	
HENNES & MAURITZ AB-B	14,067	128.66	1,809,860.22	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	9,723	280.30	2,725,356.90	
NORDEA BANK ABP	50,404	119.12	6,004,124.48	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	25,640	127.55	3,270,382.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	26,103	109.55	2,859,583.65	
Swedbank AB	14,439	193.70	2,796,834.30	
EQT AB	8,623	235.30	2,028,991.90	
Industrivarden AB	6,733	274.10	1,845,515.30	
Industrivarden AB	5,831	274.70	1,601,775.70	
INVESTOR AB-A SHS	8,042	207.20	1,666,302.40	
INVESTOR AB-B SHS	32,078	204.25	6,551,931.50	
KINNEVIK AB-B	10,438	162.50	1,696,175.00	
ERICSSON LM-B SHS	47,091	59.67	2,809,919.97	
HEXAGON AB-B SHS	33,511	116.90	3,917,435.90	
TELE2 AB-B SHS	19,455	93.36	1,816,318.80	
TELIA COMPANY AB	50,278	27.69	1,392,197.82	
スウェーデンクローネ小計	623,045		91,129,218.87 (1,164,631,417)	
	銘柄数	32		
	比率	1.0%	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	
AKER BP ASA	8,407	300.10	2,522,940.70	
EQUINOR ASA	18,741	300.90	5,639,166.90	
NORSK HYDRO ASA	35,446	80.20	2,842,769.20	
YARA INTERNATIONAL ASA	3,032	444.60	1,348,027.20	
MOWI ASA	9,270	179.85	1,667,209.50	
ORKLA ASA	13,238	73.66	975,111.08	
DNB BANK ASA	16,294	185.35	3,020,092.90	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,329	190.70	1,206,940.30	
TELENOR ASA	16,381	103.35	1,692,976.35	
ノルウェークローネ小計	127,138		20,915,234.13 (276,290,242)	
	銘柄数	9		
	比率	0.2%	0.3%	
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	2,202	500.00	1,101,000.00	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	3,585	351.60	1,260,486.00	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18,584	201.75	3,749,322.00	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	60	14,830.00	889,800.00	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	80	15,160.00	1,212,800.00	

DSV A/S	3,215	1,129.50	3,631,342.50	
PANDORA A/S	1,673	577.00	965,321.00	
CARLSBERG AS-B	1,703	983.00	1,674,049.00	
COLOPLAST-B	2,276	848.00	1,930,048.00	
DEMANT A/S	4,559	197.00	898,123.00	
GENMAB A/S	1,277	2,680.00	3,422,360.00	
NOVO NORDISK A/S-B	28,003	957.20	26,804,471.60	
DANSKE BANK A/S	14,546	141.30	2,055,349.80	
TRYG A/S	6,476	162.55	1,052,673.80	
ORSTED A/S	3,323	604.20	2,007,756.60	
デンマーククローネ小計	91,562		52,654,903.30 (1,004,655,554)	
	銘柄数	15		
	比率	0.9%	0.9%	
豪ドル	株	豪ドル	豪ドル	
AMPOL LTD	7,954	30.53	242,835.62	
SANTOS LTD	73,406	7.36	540,268.16	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	36,008	37.75	1,359,302.00	
BHP GROUP LIMITED	88,610	49.71	4,404,803.10	
BLUESCOPE STEEL LTD	11,052	19.01	210,098.52	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	33,191	22.51	747,129.41	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	9,008	30.64	276,005.12	
NEWCREST MINING LIMITED	19,462	23.39	455,216.18	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	31,148	12.80	398,694.40	
ORICA LTD	16,815	15.00	252,225.00	
RIO TINTO LIMITED	7,469	127.44	951,849.36	
SOUTH32 LTD	109,946	4.83	531,039.18	
BRAMBLES LTD	27,487	11.71	321,872.77	
TRANSURBAN GROUP	50,955	13.75	700,631.25	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	11,540	34.10	393,514.00	
LOTTERY CORP LTD/THE	52,067	4.74	246,797.58	
SEEK LTD	11,860	24.39	289,265.40	
WESFARMERS LIMITED	16,261	49.16	799,390.76	
COLES GROUP LTD	19,099	17.25	329,457.75	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	32,744	6.60	216,110.40	
WOOLWORTHS GROUP LTD	14,946	34.79	519,971.34	
TREASURY WINE ESTATES LTD	16,482	14.35	236,516.70	
COCHLEAR LIMITED	1,441	203.41	293,113.81	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	3,908	68.00	265,744.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	7,443	31.89	237,357.27	
CSL LIMITED	8,113	297.81	2,416,132.53	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	42,254	24.62	1,040,293.48	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	28,115	108.05	3,037,825.75	

NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	51,879	31.34	1,625,887.86	
WESTPAC BANKING CORPORATION	56,762	23.65	1,342,421.30	
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	3,284	69.05	226,760.20	
MACQUARIE GROUP LTD	5,910	184.43	1,089,981.30	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	43,747	5.06	221,359.82	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	27,312	13.60	371,443.20	
SUNCORP GROUP LTD	26,095	12.72	331,928.40	
LENDLEASE GROUP	23,884	8.38	200,147.92	
COMPUTERSHARE LIMITED	13,522	24.01	324,663.22	
XERO LTD	4,270	76.31	325,843.70	
TELSTRA GROUP LTD	63,795	4.09	260,921.55	
APA GROUP	28,479	10.66	303,586.14	
ORIGIN ENERGY LIMITED	48,915	7.30	357,079.50	
豪ドル小計	1,186,638		28,695,484.95 (2,644,001,983)	
	銘柄数	41		
	比率	2.4%	2.5%	
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	25,244	8.41	212,302.04	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	10,889	25.20	274,402.80	
SPARK NEW ZEALAND LTD	38,917	5.18	201,784.64	
MERIDIAN ENERGY LTD	52,034	5.27	274,219.18	
ニュージーランドドル小計	127,084		962,708.66 (81,281,492)	
	銘柄数	4		
	比率	0.1%	0.1%	
香港ドル	株	香港ドル	香港ドル	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	33,328	49.70	1,656,401.60	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	27,000	96.25	2,598,750.00	
MTR CORPORATION	18,500	42.45	785,325.00	
Galaxy Entertainment Group Limited	56,000	54.90	3,074,400.00	
Sands China Ltd	87,200	30.00	2,616,000.00	
WH Group Limited	241,500	4.76	1,149,540.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	67,000	27.20	1,822,400.00	
HANG SENG BANK	12,900	128.20	1,653,780.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	22,154	368.40	8,161,533.60	
AIA GROUP LTD	209,510	87.60	18,353,076.00	
CK ASSET HOLDINGS LIMITED	29,328	49.75	1,459,068.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	52,403	29.65	1,553,748.95	
SINO LAND CO	131,800	10.38	1,368,084.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	19,000	111.60	2,120,400.00	
SWIRE PACIFIC LTD A	20,500	72.20	1,480,100.00	

SWIRE PROPERTIES LTD	60,000	22.25	1,335,000.00	
HKT Trust / HKT Ltd	127,000	10.10	1,282,700.00	
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)	20,000	44.00	880,000.00	
CLP HOLDINGS LIMITED	22,000	58.00	1,276,000.00	
HONG KONG & CHINA GAS	181,589	7.68	1,394,603.52	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	12,500	43.95	549,375.00	
香港ドル小計	1,451,212		56,570,285.67 (941,895,256)	
	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	43,800	7.35	321,930.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	69,800	3.51	244,998.00	
GENTING SINGAPORE LTD	266,600	0.99	263,934.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	62,975	4.06	255,678.50	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	29,381	34.55	1,015,113.55	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	43,313	12.66	548,342.58	
UNITED OVERSEAS BANK	18,949	29.40	557,100.60	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	13,780	9.21	126,913.80	
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	71,600	3.91	279,956.00	
CITY DEVELOPMENTS	23,000	8.04	184,920.00	
UNITED OVERSEAS LAND LTD	26,800	6.80	182,240.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	153,300	2.45	375,585.00	
シンガポールドル小計	823,298		4,356,712.03 (430,399,581)	
	銘柄数	12		
	比率	0.4%	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	22,863	27.12	620,044.56	
ELBIT SYSTEMS LTD	450	576.80	259,560.00	
BANK HAPOLIM BM	31,102	32.35	1,006,149.70	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	20,216	30.42	614,970.72	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	20,800	18.26	379,808.00	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,541	117.70	652,175.70	
AZRIELI GROUP LTD	2,148	231.50	497,262.00	
NICE LTD	863	717.60	619,288.80	
イスラエルシュケル小計	103,983		4,649,259.48 (180,348,494)	
	銘柄数	8		
	比率	0.2%	0.2%	
合計	株		円	
	18,569,917		106,523,621,280	

(106,523,621,280)

(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	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	3,076	487,915.12	
		AMERICAN TOWER CORP	7,989	1,718,993.13	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,035	352,238.15	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,707	191,790.95	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,787	210,919.61	
		CROWN CASTLE INC	7,349	1,067,883.19	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	5,207	557,149.00	
		EQUINIX INC	1,607	1,156,429.34	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	3,744	255,677.76	
		EQUITY RESIDENTIAL	5,488	343,548.80	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,072	234,307.04	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,548	387,525.32	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9,991	271,755.20	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	16,030	290,623.90	
		INVITATION HOMES INC	11,651	371,783.41	
		KIMCO REALTY CORP	9,940	218,083.60	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	17,382	229,790.04	
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	1,942	313,128.08	
		PROLOGIS INC	15,971	2,018,734.40	
		PUBLIC STORAGE	2,564	753,328.84	
		REALTY INCOME CORP	9,295	623,694.50	
		REGENCY CENTERS CORP	3,776	248,762.88	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1,915	550,390.15	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	5,463	685,333.35	
		SUN COMMUNITIES INC	2,468	370,693.60	
		UDR INC	6,580	267,345.40	
		VENTAS INC	6,938	353,838.00	
		VICI PROPERTIES INC	16,562	562,445.52	
		WELLTOWER INC	8,122	608,175.36	
		WEYERHAEUSER CO	12,300	396,060.00	
		WP CAREY INC	2,931	248,431.56	
		米ドル小計		206,430	16,346,775.20 (2,131,619,486)
		銘柄数	31		
		比率	1.9%	84.9%	

加ドル	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,688	加ドル 199,389.60
加ドル小計		8,688	199,389.60 (19,436,498)
	銘柄数	1	
	比率	0.0%	0.8%
ユーロ	COVIVIO	2,463	ユーロ 153,568.05
	GECINA SA	1,730	189,089.00
	KLEPIERRE	7,668	179,354.52
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,137	184,424.23
ユーロ小計		14,998	706,435.80 (100,271,497)
	銘柄数	4	
	比率	0.1%	4.0%
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	32,265	英ポンド 140,643.13
	LAND SECURITIES GROUP PLC	24,397	170,535.03
	SEGRO PLC	20,049	162,998.37
英ポンド小計		76,711	474,176.53 (76,171,717)
	銘柄数	3	
	比率	0.1%	3.0%
豪ドル	DEXUS/AU	11,966	豪ドル 96,804.94
	GOODMAN GROUP	28,312	553,499.60
	GPT GROUP	28,809	132,521.40
	MIRVAC GROUP	58,377	134,850.87
	SCENTRE GROUP	89,899	279,585.89
	STOCKLAND	24,415	95,706.80
豪ドル小計		241,778	1,292,969.50 (119,134,209)
	銘柄数	6	
	比率	0.1%	4.7%
香港ドル	LINK REIT	31,400	香港ドル 1,995,470.00
香港ドル小計		31,400	1,995,470.00 (33,224,575)
	銘柄数	1	
	比率	0.0%	1.3%

シンガポールドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	151,900	シンガポールドル 317,471.00	
シンガポールドル小計		151,900	317,471.00 (31,362,960)	
	銘柄数	1		
	比率	0.0%	1.2%	
投資証券合計			円 2,511,220,942 (2,511,220,942)	
合 計			円 2,511,220,942 (2,511,220,942)	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

「TMA日本債券インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

自 2021年 1月26日 至 2022年 1月25日	自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財 務諸表の作成にあたって行った会計上の見積り が、本書における開示対象ファンドの翌計算期間 の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別し ていないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[2022年 1月25日現在]	[2023年 1月25日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首にお ける当該親投資信託の元本額	14,840,406,534円	17,045,546,776円
同期中における追加設定元本額	4,350,928,344円	6,239,322,394円
同期中における一部解約元本額	2,145,788,102円	1,910,047,296円
同期末における元本額	17,045,546,776円	21,374,821,874円
元本の内訳*		
円資産バランスファンド2018 - 09 < 適格機 関投資家限定 >	742,152,891円	740,017,614円
円資産バランスファンド2019 - 05 < 適格機 関投資家限定 >	2,710,606,047円	2,702,697,087円
円資産バランスファンド2019 - 09 < 適格機 関投資家限定 >	2,001,529,487円	1,995,337,655円
円資産バランスファンド2019 - 12 < 適格機 関投資家限定 >	2,750,256,361円	2,741,645,200円
東京海上セレクション・日本債券インデッ クス	3,499,610,089円	4,119,021,651円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年1 回決算型）	274,448,183円	335,799,208円
東京海上・円資産インデックスバランス ファンド	74,378,615円	123,940,209円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035	166,165,124円	448,775,451円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	77,029,594円	198,477,144円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	45,230,199円	112,567,400円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	75,172,530円	154,405,490円

TMA日本債券インデックスVA<適格機関投資家限定>	88,262,058円	51,539,061円
東京海上・世界インデックス・バランス40<適格機関投資家限定>	528,985,806円	746,831,532円
東京海上・世界インデックス・バランス60<適格機関投資家限定>	1,753,322,194円	2,452,205,866円
円資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	1,696,618,095円	1,690,539,491円
円資産インデックスバランス<円奏会ベーシック>（適格機関投資家専用）	561,779,503円	2,761,021,815円
計	17,045,546,776円	21,374,821,874円
2. 1 本書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	17,045,546,776口	21,374,821,874口

（注）*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

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

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

・金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

（自 2021年1月26日 至 2022年1月25日）

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	131,059,200円
地方債証券	3,957,300円
特殊債券	581,000円
社債券	5,225,981円
合計	140,823,481円

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2021年11月11日から2022年1月25日まで)を指しております。

(自 2022年1月26日 至 2023年1月25日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	285,222,370円
地方債証券	9,216,300円
特殊債券	806,000円
社債券	9,455,887円
合計	304,700,557円

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2022年11月11日から2023年1月25日まで)を指しております。

(1口当たり情報に関する注記)

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

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

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

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

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

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

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

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

地方債証券	第781回東京都公募公債	100,000,000	99,018,000	
	平成30年度第11回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,989,000	
	第26回神奈川県公募公債(20年)	20,000,000	21,369,200	
	第6回大阪府公募公債(20年)	50,000,000	55,145,000	
	平成28年度第2回京都府公募公債(15年)	50,000,000	48,335,000	
	第2回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	105,099,000	
	第4回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,503,000	
	平成31年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	97,888,000	
	平成29年度第7回広島県公募公債	100,000,000	99,340,000	
	平成25年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	100,597,000	
	平成27年度第3回福岡県公募公債	200,000,000	202,104,000	
	令和4年度第1回長野県公募公債(10年)	100,000,000	97,068,000	
	令和元年度第3回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	96,948,000	
	地方債証券 合計		1,220,000,000	1,231,403,200
特殊債券	第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,184,000	
	第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,691,000	
特殊債券 合計		200,000,000	199,875,000	
社債券	第106回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,839,000	
	第33回道路債券	100,000,000	120,923,000	
	第23回国際協力銀行債券	100,000,000	105,553,000	
	第101回都市再生債券	100,000,000	102,507,000	
	第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,247,000	25,107,283	
	第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,069,000	28,010,459	
	第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,848,000	26,744,667	
	第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,786,000	28,817,138	
	第16回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	100,673,000	
	第118回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,526,000	
	第83回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,743,000	
	第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,599,000	
	第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	94,841,000	
	第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,401,000	
社債券 合計		1,104,950,000	1,137,284,547	
合計		26,677,950,000	26,276,137,227	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

【中間財務諸表】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、当中間計算期間(2023年1月26日から2023年7月25日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

中間財務諸表

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2023年 1月25日現在	当中間計算期間末 2023年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,888,079,937	2,753,278,133
未収入金	3,700,657	6,173,277
流動資産合計	1,891,780,594	2,759,451,410
資産合計	1,891,780,594	2,759,451,410
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,007,806	2,452,656
未払受託者報酬	177,088	244,687
未払委託者報酬	2,302,038	3,180,940
その他未払費用	88,462	122,257
流動負債合計	3,575,394	6,000,540
負債合計	3,575,394	6,000,540
純資産の部		
元本等		
元本	1,499,484,524	1,944,498,864
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	388,720,676	808,952,006
（分配準備積立金）	39,154,953	37,691,693
元本等合計	1,888,205,200	2,753,450,870
純資産合計	1,888,205,200	2,753,450,870
負債純資産合計	1,891,780,594	2,759,451,410

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前中間計算期間 自 2022年 1月26日 至 2022年 7月25日	当中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	34,472,247	274,705,911
営業収益合計	34,472,247	274,705,911
営業費用		
受託者報酬	103,414	244,687
委託者報酬	1,344,321	3,180,940
その他費用	51,618	122,257
営業費用合計	1,499,353	3,547,884
営業利益又は営業損失()	32,972,894	271,158,027
経常利益又は経常損失()	32,972,894	271,158,027
中間純利益又は中間純損失()	32,972,894	271,158,027
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	811,672	4,005,485
期首剰余金又は期首欠損金()	135,155,108	388,720,676
剰余金増加額又は欠損金減少額	118,095,935	170,097,097
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	118,095,935	170,097,097
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,685,917	17,018,309
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,685,917	17,018,309
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	272,726,348	808,952,006

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前期 2023年 1月25日現在	当中間計算期間末 2023年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	600,662,763円	1,499,484,524円
期中追加設定元本額	1,013,766,234円	509,450,681円
期中一部解約元本額	114,944,473円	64,436,341円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数	1,499,484,524口	1,944,498,864口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 2022年 1月26日 至 2022年 7月25日	当中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日
該当事項はありません。	同 左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 2023年 1月25日現在	当中間計算期間末 2023年 7月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	--	----

(1口当たり情報に関する注記)

前期 2023年 1月25日現在		当中間計算期間末 2023年 7月25日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2592円 12,592円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4160円 14,160円)

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2023年 1月25日現在	当中間計算期間末 2023年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	964,916,821	1,468,179,454
未収入金	1,711,552	2,740,618
流動資産合計	966,628,373	1,470,920,072
資産合計	966,628,373	1,470,920,072
負債の部		
流動負債		
未払解約金	343,039	775,203
未払受託者報酬	89,989	129,252
未払委託者報酬	1,169,782	1,680,154
その他未払費用	44,895	64,531
流動負債合計	1,647,705	2,649,140
負債合計	1,647,705	2,649,140
純資産の部		
元本等		
元本	1,758,957,721	1,102,608,005
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	206,022,947	447,662,927
（分配準備積立金）	18,740,074	17,825,771
元本等合計	964,980,668	1,468,270,932
純資産合計	964,980,668	1,468,270,932
負債純資産合計	966,628,373	1,470,920,072

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2022年 1月26日 至 2022年 7月25日	当中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	18,213,793	153,566,478
営業収益合計	18,213,793	153,566,478
営業費用		
受託者報酬	54,478	129,252
委託者報酬	708,178	1,680,154
その他費用	27,146	64,531
営業費用合計	789,802	1,873,937
営業利益又は営業損失()	17,423,991	151,692,541
経常利益又は経常損失()	17,423,991	151,692,541
中間純利益又は中間純損失()	17,423,991	151,692,541
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	340,128	3,126,795
期首剰余金又は期首欠損金()	69,387,846	206,022,947
剰余金増加額又は欠損金減少額	67,938,108	105,483,762
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	67,938,108	105,483,762
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,569,713	12,409,528
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,569,713	12,409,528
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	148,840,104	447,662,927

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前期 2023年 1月25日現在	当中間計算期間末 2023年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	297,479,928円	758,957,721円
期中追加設定元本額	527,211,069円	306,268,440円
期中一部解約元本額	65,733,276円	44,618,156円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数	758,957,721口	1,020,608,005口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 2022年 1月26日 至 2022年 7月25日	当中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日
該当事項はありません。	同 左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 2023年 1月25日現在	当中間計算期間末 2023年 7月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	--	----

(1口当たり情報に関する注記)

前期 2023年 1月25日現在		当中間計算期間末 2023年 7月25日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2715円 12,715円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4386円 14,386円)

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2023年 1月25日現在	当中間計算期間末 2023年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	593,301,979	911,339,882
未収入金	856,206	1,542,256
流動資産合計	594,158,185	912,882,138
資産合計	594,158,185	912,882,138
負債の部		
流動負債		
未払解約金	23,859	326,248
未払受託者報酬	54,758	79,999
未払委託者報酬	711,814	1,039,861
その他未払費用	27,280	39,906
流動負債合計	817,711	1,486,014
負債合計	817,711	1,486,014
純資産の部		
元本等		
元本	1,459,818,036	1,622,305,936
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	133,522,438	289,090,188
（分配準備積立金）	13,102,298	12,058,918
元本等合計	593,340,474	911,396,124
純資産合計	593,340,474	911,396,124
負債純資産合計	594,158,185	912,882,138

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2022年 1月26日 至 2022年 7月25日	当中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	11,544,363	98,093,734
営業収益合計	11,544,363	98,093,734
営業費用		
受託者報酬	33,937	79,999
委託者報酬	441,164	1,039,861
その他費用	16,871	39,906
営業費用合計	491,972	1,159,766
営業利益又は営業損失（ ）	11,052,391	96,933,968
経常利益又は経常損失（ ）	11,052,391	96,933,968
中間純利益又は中間純損失（ ）	11,052,391	96,933,968
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	197,910	3,848,808
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	46,423,532	133,522,438
剰余金増加額又は欠損金減少額	42,352,945	76,155,370
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	42,352,945	76,155,370
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,811,383	13,672,780
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,811,383	13,672,780
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	92,819,575	289,090,188

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前期 2023年 1月25日現在	当中間計算期間末 2023年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	186,650,843円	459,818,036円
期中追加設定元本額	329,859,329円	208,263,400円
期中一部解約元本額	56,692,136円	45,775,500円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数	459,818,036口	622,305,936口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 2022年 1月26日 至 2022年 7月25日	当中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日
該当事項はありません。	同 左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 2023年 1月25日現在	当中間計算期間末 2023年 7月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	--	----

(1口当たり情報に関する注記)

前期 2023年 1月25日現在		当中間計算期間末 2023年 7月25日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2904円 12,904円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4645円 14,645円)

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2023年 1月25日現在	当中間計算期間末 2023年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	978,021,736	1,462,384,061
未収入金	2,024,175	3,863,331
流動資産合計	980,045,911	1,466,247,392
資産合計	980,045,911	1,466,247,392
負債の部		
流動負債		
未払解約金	635,301	1,881,612
未払受託者報酬	91,339	130,350
未払委託者報酬	1,187,337	1,694,493
その他未払費用	45,571	65,086
流動負債合計	1,959,548	3,771,541
負債合計	1,959,548	3,771,541
純資産の部		
元本等		
元本	1,748,968,706	1,980,654,127
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	229,117,657	481,821,724
（分配準備積立金）	23,609,226	20,103,417
元本等合計	978,086,363	1,462,475,851
純資産合計	978,086,363	1,462,475,851
負債純資産合計	980,045,911	1,466,247,392

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前中間計算期間 自 2022年 1月26日 至 2022年 7月25日	当中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	23,524,402	166,047,555
営業収益合計	23,524,402	166,047,555
営業費用		
受託者報酬	62,787	130,350
委託者報酬	816,241	1,694,493
その他費用	31,307	65,086
営業費用合計	910,335	1,889,929
営業利益又は営業損失()	22,614,067	164,157,626
経常利益又は経常損失()	22,614,067	164,157,626
中間純利益又は中間純損失()	22,614,067	164,157,626
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	843,231	10,650,495
期首剰余金又は期首欠損金()	95,073,109	229,117,657
剰余金増加額又は欠損金減少額	70,373,284	143,374,669
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	70,373,284	143,374,669
剰余金減少額又は欠損金増加額	18,038,613	44,177,733
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	18,038,613	44,177,733
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	169,178,616	481,821,724

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前期 2023年 1月25日現在	当中間計算期間末 2023年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	368,582,874円	748,968,706円
期中追加設定元本額	524,519,145円	372,099,574円
期中一部解約元本額	144,133,313円	140,414,153円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数	748,968,706口	980,654,127口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 2022年 1月26日 至 2022年 7月25日	当中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日
該当事項はありません。	同 左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 2023年 1月25日現在	当中間計算期間末 2023年 7月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	--	----

(1口当たり情報に関する注記)

前期 2023年 1月25日現在		当中間計算期間末 2023年 7月25日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3059円 13,059円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4913円 14,913円)

(ご参考)

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

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	2023年 1月25日現在	2023年 7月25日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,078,615,211	4,997,867,917
株式	2	41,363,773,320	48,537,619,860
派生商品評価勘定		33,155,700	44,080,500
未収配当金		67,065,375	63,603,128
流動資産合計		42,542,609,606	53,643,171,405
資産合計		42,542,609,606	53,643,171,405
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定			10,500,400
前受金		29,504,000	20,225,000
未払解約金		92,999,979	216,067,435
未払利息		523	12,000
流動負債合計		122,504,502	246,804,835
負債合計		122,504,502	246,804,835
純資産の部			
元本等			
元本	1	23,852,460,915	25,659,081,012
剰余金			
剰余金又は欠損金()		18,567,644,189	27,737,285,558
元本等合計		42,420,105,104	53,396,366,570
純資産合計		42,420,105,104	53,396,366,570
負債純資産合計		42,542,609,606	53,643,171,405

(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 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2023年 1月25日現在	2023年 7月25日現在
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	23,726,938,838円	23,852,460,915円
同期中における追加設定元本額	5,866,161,102円	5,518,586,382円
同期中における一部解約元本額	5,740,639,025円	3,711,966,285円
同中間期末における元本額	23,852,460,915円	25,659,081,012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 >	36,060,550円	74,035,118円
円資産バランスファンド2019 - 05 < 適格機関投資家限定 >	131,700,571円	326,683,426円
円資産バランスファンド2019 - 09 < 適格機関投資家限定 >	97,231,433円	243,183,437円
円資産バランスファンド2019 - 12 < 適格機関投資家限定 >	133,598,486円	339,256,110円
東京海上セレクション・日本株 T O P I X	16,706,542,164円	17,053,918,298円
東京海上・円資産インデックスバランス ファンド	7,844,364円	13,641,785円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035	324,325,891円	396,087,061円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	176,536,831円	225,198,953円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	111,856,787円	144,125,646円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	195,274,138円	245,185,459円
T M A 日本株式インデックス V A < 適格機関投資家限定 >	777,803,719円	903,636,766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 >	269,737,004円	282,603,226円
東京海上・世界インデックス・バランス60 < 適格機関投資家限定 >	1,771,350,438円	1,910,578,488円

東京海上・TOPIXインデックスファンド<適格機関投資家限定>	2,895,680,866円	2,855,778,425円
円資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	82,378,826円	184,784,939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）	134,538,847円	460,383,875円
計	23,852,460,915円	25,659,081,012円
2. 1 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	23,852,460,915口	25,659,081,012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 860,160,000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 1,024,650,000円

（注1）*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（注2）3.については、決算日現在の代用有価証券の時価額を記載

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2023年 1月25日現在	2023年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

（2023年1月25日現在）

（単位：円）

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

（2023年7月25日現在）

（単位：円）

区 分	種 類	契約額等	うち	時 価	評価損益
			1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,739,750,000		4,773,560,000	33,810,000
	東証株価指数先物	4,739,750,000		4,773,560,000	33,810,000
	合 計	4,739,750,000		4,773,560,000	33,810,000

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（1口当たり情報に関する注記）

2023年 1月25日現在		2023年 7月25日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7784円 17,784円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0810円 20,810円)

「TMA外国債券インデックスマザーファンド」の状況

（1）貸借対照表

区 分	注記 番号	2023年 1月25日現在	2023年 7月25日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		41,652,155	40,683,269
コール・ローン		27,761,637	16,104,470

国債証券		13,014,141,470	15,786,198,895
未収利息		81,921,771	105,874,502
前払費用		7,283,851	10,849,748
流動資産合計		13,172,760,884	15,959,710,884
資産合計		13,172,760,884	15,959,710,884
負債の部			
流動負債			
未払解約金		18,357,395	17,998,122
未払利息		13	38
流動負債合計		18,357,408	17,998,160
負債合計		18,357,408	17,998,160
純資産の部			
元本等			
元本	1	7,737,975,705	8,678,993,756
剰余金			
剰余金又は欠損金()		5,416,427,771	7,262,718,968
元本等合計		13,154,403,476	15,941,712,724
純資産合計		13,154,403,476	15,941,712,724
負債純資産合計		13,172,760,884	15,959,710,884

(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 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2023年 1月25日現在	2023年 7月25日現在
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	5,942,840,376円	7,737,975,705円
同期中における追加設定元本額	2,793,945,488円	1,494,503,248円
同期中における一部解約元本額	998,810,159円	553,485,197円
同中間期末における元本額	7,737,975,705円	8,678,993,756円
元本の内訳*		
東京海上セレクション・外国債券インデックス	4,838,451,794円	5,275,590,516円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型）	247,034,039円	256,685,118円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035	110,052,574円	147,844,993円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	56,161,429円	78,807,787円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	34,507,253円	48,909,350円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	56,800,810円	78,452,624円
TMA外国債券インデックスVA<適格機関投資家限定>	37,476,579円	27,864,843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>	550,363,074円	631,211,013円
東京海上・世界インデックス・バランス60 <適格機関投資家限定>	1,807,128,153円	2,133,627,512円
計	7,737,975,705円	8,678,993,756円
2. 1 本書における開示対象ファンドの中間計算 期間末日における当該親投資信託の受益権 の総数	7,737,975,705口	8,678,993,756口

(注) *は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2023年 1月25日現在	2023年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び これらの差額	時価で計上しているため、その 差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証 券及びデリバティブ取引に関 する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項 に関する注記)に記載して おります。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関す る注記)に記載して おります。 (3)有価証券及びデリバティブ取 引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取 引以外の金融商品について は、短期間で決済され、時価 は帳簿価額と近似しているた め、当該帳簿価額を時価とし ております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取 引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事 項についての補足説明	金融商品の時価の算定におい ては一定の前提条件等を採用 しているため、異なる前提条 件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。ま た、デリバティブ取引に関す る契約額等は、あくまでも デリバティブ取引における名 目的な契約額又は計算上の 想定元本であり、当該金額 自体がデリバティブ取引の リスクの大きさを示すもの ではありません。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(2023年1月25日現在)

該当事項はありません。

(2023年7月25日現在)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2023年 1月25日現在		2023年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.7000円	1口当たり純資産額	1.8368円
(1万口当たり純資産額	17,000円)	(1万口当たり純資産額	18,368円)

「TMA外国株式インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	2023年 1月25日現在	2023年 7月25日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		1,042,322,595	1,353,625,050
コール・ローン		273,949,540	361,042,079
株式		106,523,621,280	147,603,281,891
投資証券		2,511,220,942	3,107,605,926
派生商品評価勘定		71,883,902	66,994,036
未収配当金		80,912,443	108,875,000
差入委託証拠金		894,288,095	1,112,317,312
流動資産合計		111,398,198,797	153,713,741,294
資産合計		111,398,198,797	153,713,741,294
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		566,713	361,613
未払解約金		31,497,411	65,288,761
未払利息		132	866
流動負債合計		32,064,256	65,651,240
負債合計		32,064,256	65,651,240
純資産の部			
元本等			
元本	1	26,873,327,459	30,618,522,016
剰余金			
剰余金又は欠損金()		84,492,807,082	123,029,568,038
元本等合計		111,366,134,541	153,648,090,054
純資産合計		111,366,134,541	153,648,090,054
負債純資産合計		111,398,198,797	153,713,741,294

(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 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2023年 1月25日現在	2023年 7月25日現在
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,521,030,366円	26,873,327,459円
同期中における追加設定元本額	12,349,504,370円	6,067,958,693円
同期中における一部解約元本額	1,997,207,277円	2,322,764,136円
同中間期末における元本額	26,873,327,459円	30,618,522,016円
元本の内訳*		
東京海上セレクション・外国株式インデックス	9,199,572,062円	10,154,849,461円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型）	103,112,339円	96,388,513円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035	137,808,850円	166,576,502円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	75,014,168円	94,708,370円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	47,531,242円	60,612,098円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	82,980,639円	103,112,879円
TMA外国株式インデックスVA<適格機 関投資家限定>	15,177,952円	9,105,959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>	192,040,331円	198,478,197円
東京海上・世界インデックス・バランス60 <適格機関投資家限定>	1,513,308,733円	1,610,195,369円
先進国株式インデックス(適格機関投資家 専用)	2,531,615,905円	2,009,514,297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>	12,975,165,238円	16,114,980,371円
計	26,873,327,459円	30,618,522,016円
2. 1 本書における開示対象ファンドの中間計算 期間末日における当該親投資信託の受益権 の総数	26,873,327,459口	30,618,522,016口

(注)*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2023年 1月25日現在	2023年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び これらの差額	時価で計上しているため、その 差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証 券及びデリバティブ取引に関 する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項 に関する注記)に記載してあ 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)に記載してありま 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	金融商品の時価の算定におい ては一定の前提条件等を採用し ているため、異なる前提条件等 によった場合、当該価額が異な ることもあります。また、デリバ ティブ取引に関する契約額等 は、あくまでもデリバティブ取 引における名目的な契約額又は 計算上の想定元本であり、当該 金額自体がデリバティブ取引の リスクの大きさを示すものでは ありません。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(1) 株式関連

(2023年1月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち	時価	評価損益
			1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,286,505,074		2,357,822,263	71,317,189
	S&P 500 EMIN	1,685,594,410		1,735,372,980	49,778,570
	DJ EU STX 50	331,960,754		348,628,767	16,668,013
	FTSE 100 IDX	268,949,910		273,820,516	4,870,606
合計		2,286,505,074		2,357,822,263	71,317,189

(2023年7月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち	時価	評価損益
			1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,964,739,285		3,031,377,708	66,638,423
	S&P 500 EMIN	2,247,197,399		2,303,708,346	56,510,947
	DJ EU STX 50	431,091,885		435,063,447	3,971,562
	FTSE 100 IDX	286,450,001		292,605,915	6,155,914
合計		2,964,739,285		3,031,377,708	66,638,423

(注)1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(2) 通貨関連

(2023年1月25日現在)

該当事項はありません。

(2023年7月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち	時価	評価損益
			1年超		

為替予約取引				
市場取引 以外の取引	買建	221,426,416	221,420,416	6,000
	米ドル	191,079,000	191,073,735	5,265
	ユーロ	20,367,100	20,366,645	455
	英ポンド	9,980,316	9,980,036	280
合 計		221,426,416	221,420,416	6,000

(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中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
- 同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- 同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
- ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- (2)本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
- (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られ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)

2023年 1月25日現在		2023年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	4.1441円	1口当たり純資産額	5.0181円
(1万口当たり純資産額)	(41,441円)	(1万口当たり純資産額)	(50,181円)

「TMA日本債券インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	2023年 1月25日現在	2023年 7月25日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		172,460,380	761,256,985
国債証券		23,707,574,480	25,832,968,540
地方債証券		1,231,403,200	1,375,290,088
特殊債券		199,875,000	200,172,000
社債券		1,137,284,547	1,236,307,551
未収入金		161,149,650	181,479,500
未収利息		36,098,359	39,348,934
前払費用		1,590,628	1,607,936
流動資産合計		26,647,436,244	29,628,431,534
資産合計		26,647,436,244	29,628,431,534
負債の部			
流動負債			
未払金		283,486,860	228,171,340
未払解約金		20,329,955	694,093,065
未払利息		83	1,827
流動負債合計		303,816,898	922,266,232
負債合計		303,816,898	922,266,232
純資産の部			
元本等			
元本	1	21,374,821,874	22,874,618,860
剰余金			
剰余金又は欠損金()		4,968,797,472	5,831,546,442
元本等合計		26,343,619,346	28,706,165,302
純資産合計		26,343,619,346	28,706,165,302
負債純資産合計		26,647,436,244	29,628,431,534

(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 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時 価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示す る価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社 の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値 (平均値)等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2023年 1月25日現在	2023年 7月25日現在
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首にお ける当該親投資信託の元本額	17,045,546,776円	21,374,821,874円
同期中における追加設定元本額	6,239,322,394円	3,347,542,962円
同期中における一部解約元本額	1,910,047,296円	1,847,745,976円
同中間期末における元本額	21,374,821,874円	22,874,618,860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 >	740,017,614円	572,352,234円
円資産バランスファンド2019 - 05 < 適格機 関投資家限定 >	2,702,697,087円	2,525,531,061円
円資産バランスファンド2019 - 09 < 適格機 関投資家限定 >	1,995,337,655円	1,880,007,602円
円資産バランスファンド2019 - 12 < 適格機 関投資家限定 >	2,741,645,200円	2,622,728,234円
東京海上セレクション・日本債券インデッ クス	4,119,021,651円	4,333,557,906円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1 回決算型)	335,799,208円	378,781,068円
東京海上・円資産インデックスバランス ファンド	123,940,209円	132,694,132円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035	448,775,451円	654,683,029円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	198,477,144円	302,438,616円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	112,567,400円	173,256,954円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	154,405,490円	231,588,656円
TMA日本債券インデックスVA < 適格機 関投資家限定 >	51,539,061円	40,542,005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 >	746,831,532円	921,267,220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 >	2,452,205,866円	3,115,143,674円
円資産バランスオープン < 適格機関投資家 限定 >	1,690,539,491円	1,428,539,272円

円資産インデックスバランス<円委会ベ シック>（適格機関投資家専用）	2,761,021,815円	3,561,507,197円
計	21,374,821,874円	22,874,618,860円
2. 1 本書における開示対象ファンドの中間計算 期間末日における当該親投資信託の受益権 の総数	21,374,821,874口	22,874,618,860口

（注）*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2023年 1月25日現在	2023年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び これらの差額	時価で計上しているため、その 差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証 券及びデリバティブ取引に関 する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項 に関する注記）に記載してお ります。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取 引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取 引以外の金融商品について は、短期間で決済され、時価 は帳簿価額と近似しているた め、当該帳簿価額を時価とし ております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取 引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事 項についての補足説明	金融商品の時価の算定におい ては一定の前提条件等を採用し ているため、異なる前提条件等 によった場合、当該価額が異 なることもあります。	同左

（1口当たり情報に関する注記）

2023年 1月25日現在		2023年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.2325円	1口当たり純資産額	1.2549円
（1万口当たり純資産額	12,325円）	（1万口当たり純資産額	12,549円）

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

2023年7月31日 現在

種類	金額
資産総額	2,830,221,626 円
負債総額	8,375,648 円
純資産総額 (-)	2,821,845,978 円
発行済数量	1,990,556,103 口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.4176 円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

2023年7月31日 現在

種類	金額
資産総額	1,510,501,192 円
負債総額	2,219,383 円
純資産総額 (-)	1,508,281,809 円
発行済数量	1,046,378,292 口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.4414 円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

2023年7月31日 現在

種類	金額
資産総額	924,503,928 円
負債総額	3,361,124 円
純資産総額 (-)	921,142,804 円
発行済数量	627,478,285 口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.4680 円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

2023年7月31日 現在

種類	金額
資産総額	1,484,945,244 円
負債総額	1,991,700 円
純資産総額 (-)	1,482,953,544 円
発行済数量	991,227,110 口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.4961 円

(ご参考：親投資信託の現況)

TMA日本株TOPIXマザーファンド

2023年7月31日 現在

種類	金額
資産総額	54,516,120,078 円

負債総額	61,963,078 円
純資産総額(-)	54,454,157,000 円
発行済数量	25,742,911,468 口
1 単位当たり純資産額(/)	2.1153 円

T M A 外国債券インデックスマザーファンド

2023年7月31日 現在

種類	金額
資産総額	15,917,715,130 円
負債総額	62,210,059 円
純資産総額(-)	15,855,505,071 円
発行済数量	8,713,806,474 口
1 単位当たり純資産額(/)	1.8196 円

T M A 外国株式インデックスマザーファンド

2023年7月31日 現在

種類	金額
資産総額	158,254,622,862 円
負債総額	4,158,972,413 円
純資産総額(-)	154,095,650,449 円
発行済数量	30,648,243,233 口
1 単位当たり純資産額(/)	5.0279 円

T M A 日本債券インデックスマザーファンド

2023年7月31日 現在

種類	金額
資産総額	29,158,770,396 円
負債総額	640,203,765 円
純資産総額(-)	28,518,566,631 円
発行済数量	22,988,879,981 口
1 単位当たり純資産額(/)	1.2405 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

1. 名義書換

該当事項はありません。

2. 受益者に対する特典

特典はありません。

3. 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

4. 受益権の譲渡

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

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

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

5. 受益権の譲渡の対抗要件

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

6. 受益権の再分割

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

7. 償還金

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

8. 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

2023年7月末日現在、資本金の額は20億円です。なお、会社の発行可能株式総数は160,000株であり、38,300株を発行済みです。

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

投資信託の投資運用の意思決定プロセスは以下の通りです。

運用本部で運用計画案、収益分配方針案等の運用の基本方針案を作成します。

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

決定された運用の基本方針に基づき、具体的運用計画を策定し、運用を行います。

売買の執行はトレーディング部が行います。

運用部門とは独立した運用リスク管理部門にて運用評価、ガイドライン遵守状況のチェックを行い、運用リスク管理部門担当役員を委員長としリスク管理部を事務局とする運用管理委員会に結果報告します。

運用管理委員会から投資政策委員会へ運用評価、ガイドライン遵守状況がフィードバックされ次の基本方針決定に生かされます。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

2023年7月末日現在、委託会社が運用を行っている証券投資信託（親投資信託を除きます。）は次の通りです。

	本数	純資産総額（百万円）
追加型公社債投資信託	0	0
追加型株式投資信託	171	4,033,991
単位型公社債投資信託	2	2,995
単位型株式投資信託	11	37,943
合計	184	4,074,930

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第38期事業年度(2022年4月1日から2023年3月31日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	21,389,756	20,784,858
前払費用	319,734	427,401
未収委託者報酬	2,902,834	3,200,726
未収収益	2,610,213	3,021,468
未収入金	1,692	4
その他の流動資産	22,412	18,592
流動資産計	27,246,644	27,453,052
固定資産		
有形固定資産	* 1 459,081	* 1 433,750
建物	342,403	307,934
器具備品	116,678	125,816
無形固定資産	228,727	348,422
電話加入権	3,795	3,795
ソフトウェア	188,720	314,954
ソフトウェア仮勘定	36,211	29,672
投資その他の資産	3,576,825	3,508,324
投資有価証券	42,253	48,291
関係会社株式	1,673,049	1,668,529
その他の関係会社有価証券	521,200	520,000
長期前払費用	40,588	30,700
敷金	474,324	474,324
その他長期差入保証金	21,230	21,230
繰延税金資産	804,178	954,048
投資損失引当金	-	208,800
固定資産計	4,264,634	4,290,497
資産合計	31,511,279	31,743,550
負債の部		
流動負債		
未払金	3,183,398	3,477,655
未払手数料	1,306,204	1,464,843
その他未払金	1,877,194	2,012,811
未払費用	398,447	335,471
未払消費税等	277,096	266,103
未払法人税等	1,152,000	1,210,000
預り金	46,775	60,297
前受収益	2,286	2,579
賞与引当金	287,955	288,706
その他の流動負債	7	8
流動負債計	5,347,968	5,640,822
固定負債		
退職給付引当金	845,039	886,720
固定負債計	845,039	886,720
負債合計	6,193,007	6,527,543
純資産の部		
株主資本	25,312,741	25,210,382
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	22,912,741	22,810,382
利益準備金	500,000	500,000
その他利益剰余金	22,412,741	22,310,382
繰越利益剰余金	22,412,741	22,310,382

評価・換算差額等	5,529	5,624
その他有価証券評価差額金	5,529	5,624
純資産合計	25,318,271	25,216,006
負債・純資産合計	31,511,279	31,743,550

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	18,065,913	16,696,838
運用受託報酬	10,405,866	11,663,951
投資助言報酬	66,255	92,682
その他営業収益	532,829	661,029
営業収益計	29,070,864	29,114,502
営業費用		
支払手数料	8,365,057	7,669,451
広告宣伝費	216,312	206,908
調査費	6,860,898	7,435,066
調査費	2,728,988	2,823,854
委託調査費	4,131,910	4,611,211
委託計算費	115,017	119,180
営業雑経費	259,680	265,287
通信費	38,574	60,267
印刷費	175,527	160,147
協会費	24,866	23,883
諸会費	11,208	12,732
図書費	9,504	8,256
営業費用計	15,816,967	15,695,895
一般管理費		
給料	3,925,627	3,883,418
役員報酬	128,277	83,430
給料・手当	2,779,798	2,848,648
賞与	1,017,551	951,339
交際費	4,546	13,259
寄付金	2,632	4,696
旅費交通費	17,590	140,480
租税公課	167,411	174,372
不動産賃借料	468,092	468,091
退職給付費用	161,994	163,194
賞与引当金繰入	287,955	288,706
固定資産減価償却費	165,703	165,502
法定福利費	630,892	629,504
福利厚生費	12,315	10,617
諸経費	487,975	503,320
一般管理費計	6,332,736	6,445,164
営業利益	6,921,159	6,973,442
営業外収益		
受取利息	206	189
受取配当金	* 1 5,672	* 1 4,304
雑益	13,622	13,722
営業外収益計	19,500	18,216
営業外費用		
為替差損	66,106	54,263
雑損	23,333	9,120
営業外費用計	89,440	63,383
経常利益	6,851,219	6,928,275
特別利益		

投資有価証券売却益	-	480
特別利益計	-	480
特別損失		
固定資産除却損	610	190
投資有価証券評価損	-	501
投資損失引当金繰入額	-	208,800
その他特別損失	-	392
特別損失計	610	209,884
税引前当期純利益	6,850,609	6,718,870
法人税、住民税及び事業税	2,169,313	2,220,524
法人税等調整額	69,337	149,911
法人税等合計	2,099,975	2,070,612
当期純利益	4,750,633	4,648,257

(3) 【株主資本等変動計算書】

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益 剰余金	
					特別償却 準備金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	0	22,599,322
当期変動額						
剰余金の配当						4,937,214
特別償却準備金の取崩					0	0
当期純利益						4,750,633
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	0	186,580
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	-	22,412,741

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等 合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	23,099,322	25,499,322	6,393	6,393	25,505,715
当期変動額					
剰余金の配当	4,937,214	4,937,214			4,937,214
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	4,750,633	4,750,633			4,750,633
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			863	863	863
当期変動額合計	186,580	186,580	863	863	187,444
当期末残高	22,912,741	25,312,741	5,529	5,529	25,318,271

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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
				繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	22,412,741
当期変動額					
剰余金の配当					4,750,617
当期純利益					4,648,257
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	-	102,359
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	22,310,382

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等 合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	22,912,741	25,312,741	5,529	5,529	25,318,271
当期変動額					
剰余金の配当	4,750,617	4,750,617			4,750,617
当期純利益	4,648,257	4,648,257			4,648,257
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			94	94	94
当期変動額合計	102,359	102,359	94	94	102,264
当期末残高	22,810,382	25,210,382	5,624	5,624	25,216,006

注記事項

（重要な会計方針）

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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

市場価格のない株式等以外のもの

当事業年度末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当期負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理しております。

投資損失引当金

関係会社等への投資に係る損失に備えるため、当該会社の財政状態等を勘案して必要と認められる額を計上しております。

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。

（重要な会計上の見積り）

第37期 2022年3月31日現在	第38期 2023年3月31日現在
当事業年度の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌事業年度の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。	同左

（貸借対照表関係）

第37期 2022年3月31日現在	第38期 2023年3月31日現在
* 1. 有形固定資産の減価償却累計額は次のとおりであります。	* 1. 有形固定資産の減価償却累計額は次のとおりであります
建物 182,121千円	建物 217,486千円
器具備品 501,021千円	器具備品 477,945千円

（損益計算書関係）

第37期 自 2021年4月1日 至 2022年3月31日	第38期 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日
<p>* 1 . 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。</p> <p style="text-align: center;">関係会社からの受取配当金 2,000千円</p> <p>上記のほか、関係会社に対する営業外収益のうち、雑益の合計額は営業外収益の総額の100分の10を超えており、その金額は8,520千円であります。</p>	<p>* 1 . 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。</p> <p style="text-align: center;">関係会社からの受取配当金 3,605千円</p> <p>上記のほか、関係会社に対する営業外収益のうち、雑益の合計額は営業外収益の総額の100分の10を超えており、その金額は9,067千円であります。</p>

(株主資本等変動計算書関係)

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1 . 発行済株式に関する事項

(単位：株)

株式の種類	2021年4月1日 現在	増加	減少	2022年3月31日 現在
普通株式	38,300	-	-	38,300

2 . 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

2021年6月30日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

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

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

2022年6月30日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	4,750,617千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	124,037円
(ニ) 基準日	2022年3月31日
(ホ) 効力発生日	2022年6月30日

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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	2022年4月1日 現在	増加	減少	2023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

2022年6月30日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	4,750,617千円
(ロ) 1株当たり配当額	124,037円
(ハ) 基準日	2022年3月31日
(ニ) 効力発生日	2022年6月30日

(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

2023年6月29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	4,648,241千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	121,364円
(ニ) 基準日	2023年3月31日
(ホ) 効力発生日	2023年6月29日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

第37期 自 2021年4月1日 至 2022年3月31日	第38期 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日
<p>(1) 金融商品に対する取組方針 当社の資本は本来の事業目的のために使用することを基本とし、資産の運用に際しては、資産運用リスクを極力最小限に留めることを基本方針としております。</p> <p>(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。</p> <p>営業債務である未払金は、ほとんど1年以内の支払期日であり、流動性リスクに晒されております。</p> <p>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 未収収益については、管理部門において取引先ごとに期日及び残高を把握することで、回収懸念の早期把握や軽減を図っております。</p> <p>市場リスク 未収委託者報酬には、運用資産の悪化から回収できず当社が損失を被るリスクが存在しますが、過去の回収実績からリスクは僅少であると判断しております。</p> <p>投資有価証券については、管理部門において定期的に時価を把握する体制としております。</p> <p>流動性リスク 当社は、日々資金残高管理を行っており流動性リスクを管理しております。</p>	<p>(1) 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク 同左</p> <p>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 同左</p> <p>市場リスク 同左</p> <p>流動性リスク 同左</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

第37期（2022年3月31日現在）

2022年3月31日現在における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
投資有価証券			
その他有価証券	42,253	42,253	-
敷金	474,324	474,362	37
資産計	516,578	516,616	37

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

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

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

(単位：千円)

	貸借対照表計上額
関係会社株式	
子会社株式	1,640,302
関連会社株式	32,747
その他の関係会社有価証券	520,000

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

(注4) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	-	21,628	538	-
合計	-	21,628	538	-

第38期(2023年3月31日現在)

2023年3月31日現在における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
投資有価証券 その他有価証券	48,291	48,291	-
敷金	474,324	475,064	739
資産計	522,615	523,355	739

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

現金・預金
未収委託者報酬
未収収益
未収入金
預り金
未払金
未払費用

(注2) 関係会社株式及びその他の関係会社有価証券については、市場価格のない株式等に該当することから、時価を注記しておりません。これらの貸借対照表計上額は、それぞれ以下のとおりです。

(単位：千円)

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	1,679	18,855	995	995
合計	1,679	18,855	995	995

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

第37期（2022年3月31日現在）

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

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

(1)時価で貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
投資有価証券 其他有価証券	-	42,253	-	42,253
資産計	-	42,253	-	42,253

(2)時価で貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

(単位：千円)

	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
敷金	-	474,362	-	474,362
資産計	-	474,362	-	474,362

(注)時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

投資有価証券

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

敷金

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

第38期（2023年3月31日現在）

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

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

(1)時価で貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
投資有価証券 其他有価証券	-	48,291	-	48,291
資産計	-	48,291	-	48,291

(2)時価で貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

(単位：千円)

	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
敷金	-	475,064	-	475,064

資産計	-	475,064	-	475,064
-----	---	---------	---	---------

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

投資有価証券

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

敷金

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

(有価証券関係)

第37期 2022年3月31日現在				第38期 2023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				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 521,200千円)は、市場価格のない株式等又は貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資に該当することから、記載しておりません。				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28,227千円)並びにその他の関係会社有価証券(貸借対照表計上額 520,000千円)は、市場価格のない株式等に該当することから、記載しておりません。			
2. その他有価証券 (単位:千円)				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	区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの証券投資信託	37,421	28,638	8,783	貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの証券投資信託	27,605	18,645	8,960
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの証券投資信託	4,832	5,645	813	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	20,685	21,539	853
合計	42,253	34,283	7,970	合計	48,291	40,184	8,106
3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 該当事項はありません。				3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 同左			
				4. 減損処理を行った有価証券 当事業年度において、有価証券について501千円(その他有価証券の証券投資信託501千円)減損処理を行っております。			

(収益認識関係)

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

(単位:千円)

	運用報酬	成功報酬	合計
--	------	------	----

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

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

顧客との契約から生じた債権等

顧客との契約から生じた債権（期首残高） 5,349,421千円

顧客との契約から生じた債権（期末残高） 5,513,048千円

（*）なお、当事業年度の期首及び期末において、顧客との契約から生じた契約資産及び契約負債はありません。

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

（単位：千円）

	運用報酬	成功報酬	合計
委託者報酬	16,696,838	-	16,696,838
運用受託報酬	11,529,748	134,202	11,663,951
投資助言報酬	92,682	-	92,682
その他営業収益	661,029	-	661,029
合計	28,980,299	134,202	29,114,502

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

顧客との契約から生じた債権等

顧客との契約から生じた債権（期首残高） 5,513,048千円

顧客との契約から生じた債権（期末残高） 6,222,195千円

（*）なお、当事業年度の期首及び期末において、顧客との契約から生じた契約資産及び契約負債はありません。

（退職給付関係）

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	800,611千円
勤務費用	69,820千円

利息費用	3,143千円
数理計算上の差異の発生額	9,121千円
退職給付の支払額	29,833千円
退職給付債務の期末残高	852,862千円

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

割引率 0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、79,167千円であります。

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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	852,862千円
勤務費用	70,929千円
利息費用	3,351千円
数理計算上の差異の発生額	24,231千円
退職給付の支払額	33,244千円

退職給付債務の期末残高	869,667千円
-------------	-----------

(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	869,667千円
未積立退職給付債務	869,667千円
未認識数理計算上の差異	17,052千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	886,720千円
退職給付引当金	886,720千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	886,720千円

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	70,929千円
利息費用	3,351千円
数理計算上の差異の費用処理額	644千円
その他	6,556千円
確定給付制度に係る退職給付費用	81,482千円

(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	0.8%
-----	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、81,712千円であります。

(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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
繰延税金資産		
退職給付引当金	258,750千円	271,513千円
未払金	3,366千円	2,092千円
賞与引当金	88,171千円	88,401千円
未払法定福利費	11,424千円	11,663千円
未払事業所税	3,958千円	3,929千円
未払事業税	61,773千円	64,984千円
未払調査費	90,375千円	102,531千円
減価償却超過額	53,430千円	24,211千円
繰延資産超過額	8,569千円	9,605千円
未払確定拠出年金	2,038千円	2,120千円
未収実績連動報酬	31,195千円	48,549千円
投資損失引当金	-	63,934千円
未払費用	195,620千円	267,102千円
繰延税金資産小計	808,674千円	960,642千円

評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	808,674千円	960,642千円
繰延税金負債		
前払費用	2,055千円	4,110千円
その他有価証券評価差額金	2,440千円	2,482千円
繰延税金負債合計	4,495千円	6,593千円
繰延税金資産の純額	804,178千円	954,048千円

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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023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

3. 法人税及び地方法人税に関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度からグループ通算制度を適用しているため、法人税及び地方法人税の会計処理またはこれらに関する税効果会計の会計処理および開示については、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月12日)を当事業年度の期首から適用しています。

(セグメント情報等)

第37期 自 2021年4月1日 至 2022年3月31日	第38期 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日
<p>[セグメント情報]</p> <p>当社は「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として運用(投資運用業)を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。</p> <p>当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。</p>	<p>[セグメント情報]</p> <p>同左</p>

[関連情報]

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
26,067,627	3,003,236	29,070,864

(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

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

4,883,617千円

(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

(単位：千円)

日本	その他	合計
25,542,522	3,571,980	29,114,502

(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

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

3,989,751千円

(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37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等重要な取引はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等重要な取引はありません。

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する情報

(1) 親会社情報

東京海上ホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

重要な関連会社はありません。

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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37期	
自 2021年 4月 1日	
至 2022年 3月 31日	
1 株当たり純資産額	661,051円47銭
1 株当たり当期純利益金額	124,037円43銭
なお、潜在株式調整後 1 株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
(注) 1 株当たり純資産額の算定上の基礎	
貸借対照表の純資産の部の合計額	25,318,271千円
純資産の部の合計額から控除する金額	-
普通株式に係る当期末の純資産額	25,318,271千円
1 株当たり純資産額の算定に用いられた当期末の普通株式の数	38,300株
1 株当たり当期純利益金額の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益金額	4,750,633千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る当期純利益金額	4,750,633千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

第38期	
自 2022年 4月 1日	
至 2023年 3月 31日	
1 株当たり純資産額	658,381円38銭
1 株当たり当期純利益金額	121,364円43銭
なお、潜在株式調整後 1 株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
(注) 1 株当たり純資産額の算定上の基礎	
貸借対照表の純資産の部の合計額	25,216,006千円
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	25,216,006千円
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	4,648,257千円
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	4,648,257千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

- ・ 名称 三菱UFJ信託銀行株式会社
(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)
- ・ 資本金の額 324,279百万円（2023年3月末日現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

<参考情報：再信託受託会社の概要>

- ・ 名称 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 10,000百万円（2023年3月末日現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額（ ）	事業の内容
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
SMB C日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社SBI証券	48,323百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	19,495百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社群馬銀行	48,652百万円	
株式会社八十二銀行	52,243百万円	
株式会社北洋銀行	121,101百万円	
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

() 2023年3月末日現在。

2【関係業務の概要】

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

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

3【資本関係】

資本関係はありません。

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

2023年6月5日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

PwC あらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 奈良 昌彦
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の財務諸表、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2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年4月5日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 久保 直毅

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035の2022年1月26日から2023年1月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035の2023年1月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年4月5日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 久保 直毅

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045の2022年1月26日から2023年1月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045の2023年1月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年4月5日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 久保 直毅

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055の2022年1月26日から2023年1月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055の2023年1月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年4月5日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 久保 直毅

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065の2022年1月26日から2023年1月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065の2023年1月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月8日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035の2023年1月26日から2023年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035の2023年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年1月26日から2023年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合

は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月8日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045の2023年1月26日から2023年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045の2023年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年1月26日から2023年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合

は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月8日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055の2023年1月26日から2023年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055の2023年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年1月26日から2023年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合

は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月8日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065の2023年1月26日から2023年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065の2023年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年1月26日から2023年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合

は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。