

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2024年4月25日
【計算期間】	第7期（自 2023年1月26日 至 2024年1月25日）
【ファンド名】	東京海上・円資産インデックスバランスファンド
【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
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】	03 - 3212 - 8421
【縦覧に供する場所】	該当なし

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

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

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

基本的性格

当ファンドは、追加型投信/国内/資産複合に属します。

当ファンドの商品分類表および属性区分表は、以下の通りです。

商品分類表

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

属性区分表

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

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

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

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

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

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

信託金の限度額

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

ファンドの特色

1

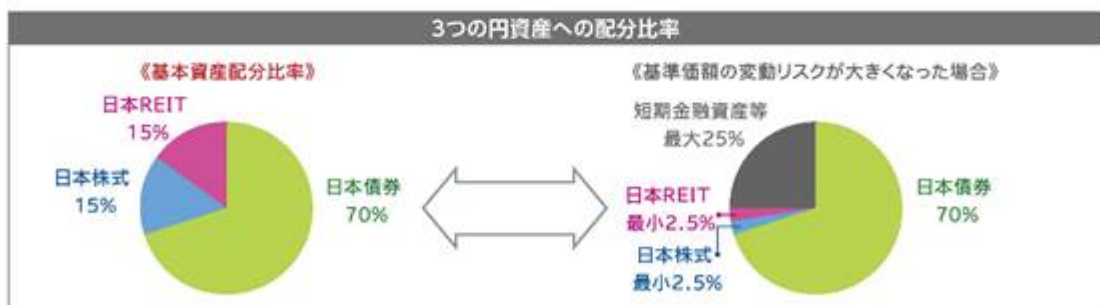
主として国内の債券や株式、不動産投資信託（REIT）を主要投資対象とするマザーファンドへの投資を通じて、国内の複数の資産（債券・株式・REIT）に分散投資します。

2

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

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

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



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

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

次ページへ続く

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

● 価格変動リスクとは

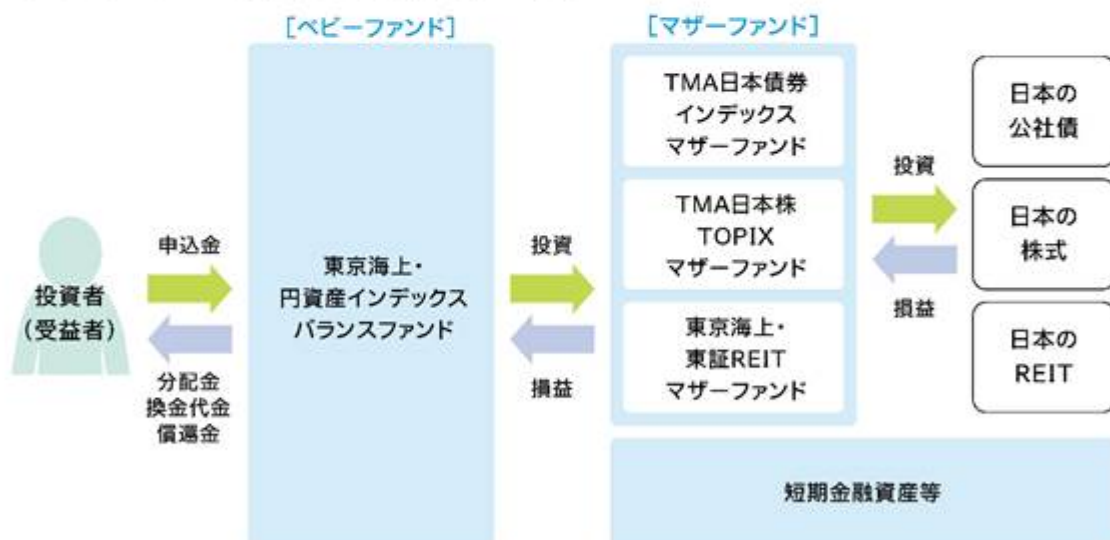
価格が下落した場合だけでなく、上昇した場合も含めた「値動きの振れ幅の程度」をいいます。リスクの大小を数値で表す場合、一般的には「標準偏差」を用います。標準偏差とは、価格の変化率（リターン）のばらつき度合いを示す指標です。標準偏差が小さいほど値動きが緩やかでリスクは小さく、標準偏差が大きいほど値動きは荒くリスクが大きいことを示します。

＜各マザーファンドが対象とする指数について＞

- NOMURA-BPI(総合)とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下、NFRCといたします。)が公表する日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表す代表的な指標です。NOMURA-BPIは、NFRCの知的財産です。NFRCは、ファンドの運用成績等に関し、一切責任ありません。
- 配当込みTOPIX(以下「TOPIX(配当込み)」)といえます。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に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。TOPIX(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。
- 配当込み東証REIT指数(以下「東証REIT指数(配当込み)」)といえます。は、株式会社J P X総研が算出する株価指数であり、東証市場に上場するREIT全銘柄を対象とした浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。東証REIT指数(配当込み)の指数値および東証REIT指数(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、利用等東証REIT指数(配当込み)に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数(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、東証REIT指数(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。

ファンドの仕組み

- ファミリーファンド方式により運用を行います。



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

次ページへ続く

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

主な投資制限

株 式	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
デリバティブ等	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、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

分配方針

◎年1回決算を行います。

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

《イメージ図》

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

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

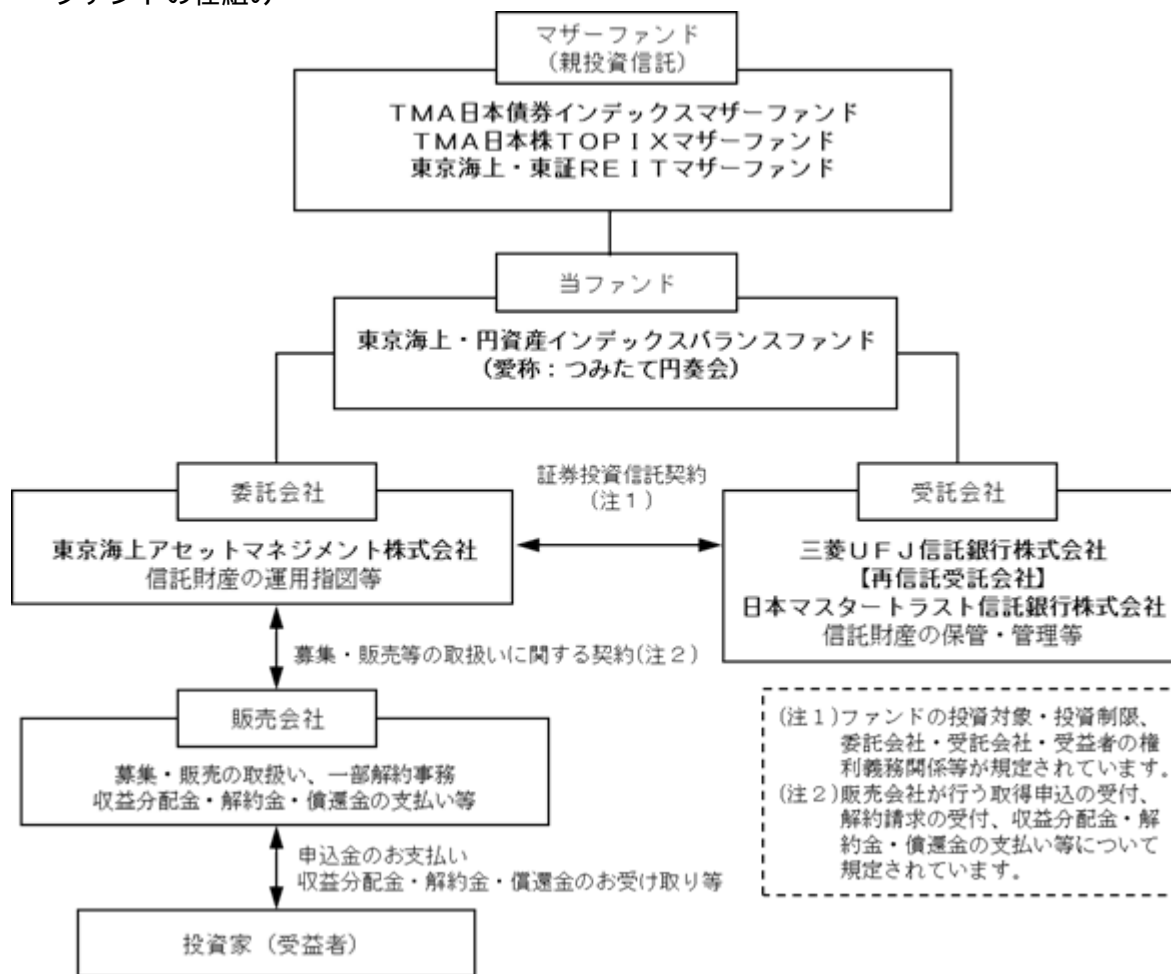
資金動向および市況動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2017年10月11日 ファンドの設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み

**委託会社の概況**

- ・名称 東京海上アセットマネジメント株式会社
- ・資本金の額 20億円（2024年1月末日現在）
- ・会社の沿革

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

・大株主の状況（2024年1月末日現在）

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

2 【投資方針】**(1) 【投資方針】**

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 主要投資対象

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

TMA日本債券インデックスマザーファンド受益証券

TMA日本株TOPIXマザーファンド受益証券

東京海上・東証REITマザーファンド受益証券

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

原則として月次でリバランスを実施します。

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

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

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

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

2. 運用方法**(1) 投資対象**

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

3. 運用制限

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

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

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

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

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

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

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

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

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

東京海上・東証REITマザーファンド**1. 基本方針**

東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果の達成を目標とします。

2. 運用方法**(1) 投資対象**

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

(2) 投資態度

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

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

原則として、REITへの組入比率を高位に維持します。

3. 運用制限

(1) 株式への直接投資は行いません。

(2) 外貨建資産への直接投資は行いません。

(3) 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

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

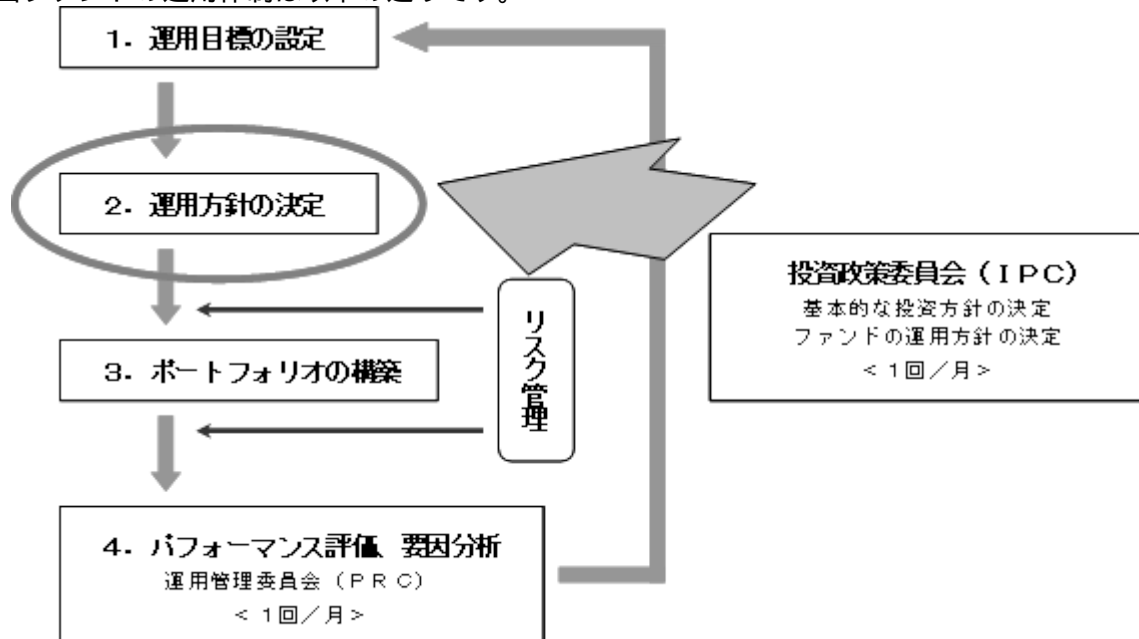
(2)【投資対象】

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

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

(3) 【運用体制】

当ファンドの運用体制は以下の通りです。



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

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

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

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

（上記の体制や人員等については、2024年1月末日現在）

(4)【配分方針】

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

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

信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

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

計算期末において信託財産に損失が生じた場合は、次期に繰越します。

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

(5)【投資制限】

運用の基本方針に基づく制限(約款別紙「運用の基本方針」)

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

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

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

投資する株式等の範囲(約款第19条)

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

信用取引(約款第21条)

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

先物取引等(約款第22条)

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

スワップ取引(約款第23条)

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

金利先渡取引および為替先渡取引(約款第24条)

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

デリバティブ取引等に係る投資制限(約款第24条の2)

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

有価証券の貸付（約款第25条）

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

有価証券の空売（約款第26条）

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

有価証券の借入（約款第27条）

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第28条）

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

外国為替予約取引（約款第29条）

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

信用リスク集中回避のための投資制限（約款第29条の2）

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

資金の借入（約款第35条）

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

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

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

3【投資リスク】

1．投資リスク

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

(1) 価格変動リスク

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

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

投資信託は預貯金や保険と異なります。

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

株価変動リスク

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

金利変動リスク

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

信用リスク

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

REITの価格変動リスク

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

流動性リスク

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

(2) デリバティブ取引のリスク

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

2．その他の留意事項

(1) 一般的な留意事項

投資信託は、その商品性格から次の特徴をご理解のうえご購入ください。

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

(2) 法令・税制・会計等の変更可能性

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

(3) その他の留意点

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

一部解約金、収益分配金および償還金の支払は全て販売会社を通じて行われます。

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

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

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

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

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

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

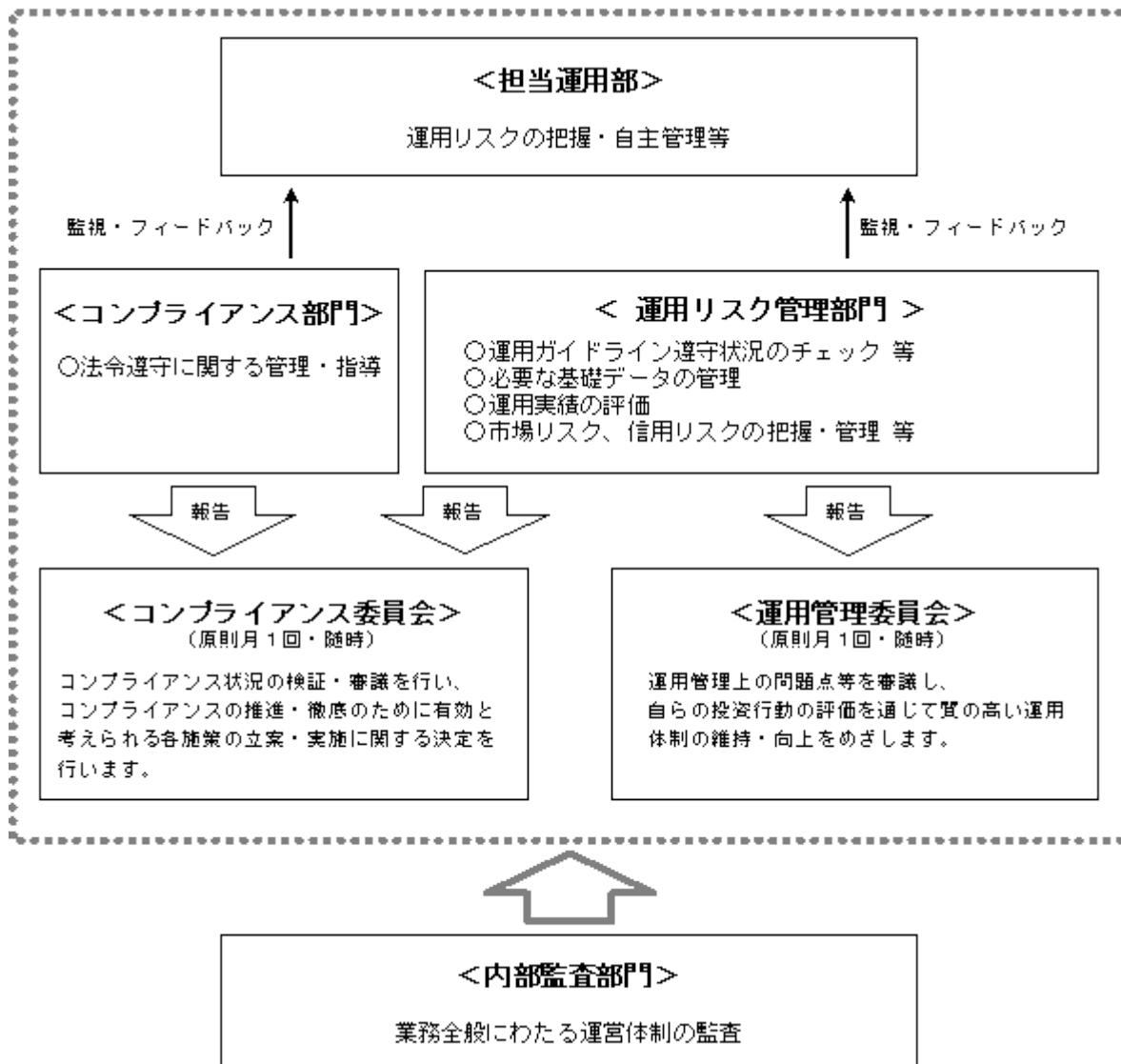
3. 管理体制

<リスク管理体制>

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

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

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



<流動性リスク管理>

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

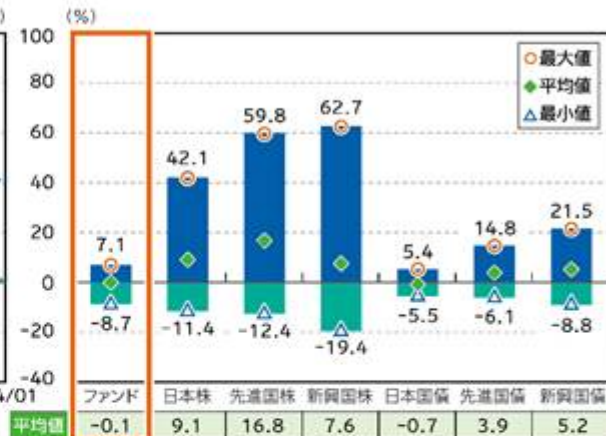
取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

参考情報

2019年2月～2024年1月

ファンドの年間騰落率および
分配金再投資基準価額の推移

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

※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものと
して計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場
合があります。※年間騰落率は、税引前分配金を再投資したものととして計算して
いるため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率と
は異なる場合があります。ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように
作成したものです。過去5年間の各月末における直近1年間
の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものです。

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

代表的な資産クラスと指数名

日本株	TOPIX (東証株価指数) (配当込み)
先進国株	MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ベース)
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)
日本国債	NOMURA-BPI (国債)
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド (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.とします。）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ューチャー・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、遅延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、年率0.418%（税抜0.38%）を乗じて得た金額とし、計算期間を通じて、毎日計上します。

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

信託報酬の配分（税抜）については以下の通りとします。

委託会社 ^{*1}	販売会社 ^{*2}	受託会社 ^{*3}
年率0.18%	年率0.18%	年率0.02%

*1 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価

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

*3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

(5)【課税上の取扱い】

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

< 個人の受益者に対する課税 >

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

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

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

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

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

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、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し、税法上の要件を満たした商品を購入する等、一定の条件に該当する方が対象となります。

当ファンドは、「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、2024年1月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容等が変更される場合があります。

（参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間（以下「当期間」といいます。）（2023年1月26日～2024年1月25日）におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
0.43%	0.42%	0.01%

（比率は年率、表示桁数未満を四捨五入）

※当期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。消費税等のかかるものは消費税等を含む。）を当期間の平均受益権口数に当期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した値です。

※入手し得る情報において計算に含まれていない費用はありません。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

※詳細につきましては、当期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

5【運用状況】

以下は2024年1月31日現在の運用状況です。

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

(1)【投資状況】

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	193,649,037	76.26
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		60,251,568	23.73
合計（純資産総額）		253,900,605	100.00

（ご参考：親投資信託の投資状況）

当ファンドが主要投資対象とする親投資信託の投資状況は以下の通りです。

TMA日本株TOPIXマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	57,589,801,160	93.10
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		4,267,771,513	6.89
合計（純資産総額）		61,857,572,673	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	3,983,460,000	6.43

（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	25,573,451,250	89.12
地方債証券	日本	1,469,377,796	5.12
特殊債券	日本	199,393,000	0.69
社債券	日本	1,426,065,377	4.96
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		26,306,870	0.09
合計（純資産総額）		28,694,594,293	100.00

東京海上・東証REITマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	12,823,103,700	97.18
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		372,085,759	2.81
合計（純資産総額）		13,195,189,459	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	317,908,000	2.40

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a. 主要銘柄の明細

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	TMA日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	144,330,771	1.2229	176,502,169	1.2248	176,776,328	69.62
2	TMA日本株TOPIXマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,731,271	2.3313	8,699,082	2.3499	8,768,113	3.45
3	東京海上・東証REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	5,751,612	1.4101	8,110,350	1.4091	8,104,596	3.19

b. 投資有価証券の種類

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	76.26
合計	76.26

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(ご参考:親投資信託の投資資産)

投資有価証券の主要銘柄

a. 主要銘柄の明細

TMA日本株TOPIXマザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	株式	872,600	1,857.12	1,620,525,195	3,000.00	2,617,800,000	4.23
2	ソニーグループ	日本	電気機器	株式	112,400	11,685.75	1,313,479,254	14,695.00	1,651,718,000	2.67
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	961,000	862.19	828,564,590	1,395.00	1,340,595,000	2.16
4	キーエンス	日本	電気機器	株式	15,900	60,424.89	960,755,844	66,580.00	1,058,622,000	1.71
5	東京エレクトロン	日本	電気機器	株式	33,500	16,202.79	542,793,768	27,865.00	933,477,500	1.50
6	日立製作所	日本	電気機器	株式	78,000	7,063.80	550,976,642	11,675.00	910,650,000	1.47
7	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	4,773,600	160.97	768,406,392	186.30	889,321,680	1.43
8	三菱商事	日本	卸売業	株式	334,200	1,652.08	552,127,710	2,565.00	857,223,000	1.38
9	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	110,700	5,332.60	590,319,653	7,700.00	852,390,000	1.37
10	信越化学工業	日本	化学	株式	143,800	4,085.69	587,523,304	5,875.00	844,825,000	1.36
11	任天堂	日本	その他製品	株式	99,500	5,170.11	514,426,653	8,310.00	826,845,000	1.33
12	三井物産	日本	卸売業	株式	127,200	3,940.73	501,261,183	6,031.00	767,143,200	1.24
13	伊藤忠商事	日本	卸売業	株式	113,400	4,352.82	493,610,604	6,752.00	765,676,800	1.23
14	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	120,900	3,576.65	432,417,465	5,927.00	716,574,300	1.15
15	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	384,200	1,161.04	446,074,100	1,675.50	643,727,100	1.04
16	第一三共	日本	医薬品	株式	139,200	4,457.70	620,513,050	4,423.00	615,681,600	0.99
17	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	140,500	4,307.33	605,180,074	4,362.00	612,861,000	0.99
18	東京海上ホールディングス	日本	保険業	株式	154,800	2,628.76	406,933,165	3,930.00	608,364,000	0.98
19	HOYA	日本	精密機器	株式	31,800	14,225.02	452,355,636	18,945.00	602,451,000	0.97
20	KDDI	日本	情報・通信業	株式	122,700	4,123.58	505,963,808	4,897.00	600,861,900	0.97
21	みずほフィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	210,500	1,867.81	393,174,005	2,702.00	568,771,000	0.91
22	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	78,900	4,954.85	390,937,700	6,460.00	509,694,000	0.82
23	ソフトバンク	日本	情報・通信業	株式	254,000	1,547.40	393,041,007	1,963.50	498,729,000	0.80
24	オリエンタルランド	日本	サービス業	株式	86,100	4,435.83	381,925,614	5,502.00	473,722,200	0.76
25	ダイキン工業	日本	機械	株式	19,200	22,550.25	432,964,914	23,885.00	458,592,000	0.74
26	村田製作所	日本	電気機器	株式	142,500	2,576.94	367,214,237	3,015.00	429,637,500	0.69
27	SMC	日本	機械	株式	4,800	68,304.48	327,861,504	82,910.00	397,968,000	0.64
28	三菱電機	日本	電気機器	株式	176,800	1,572.78	278,068,176	2,203.00	389,490,400	0.62
29	日本たばこ産業	日本	食料品	株式	94,300	2,772.33	261,431,651	3,895.00	367,298,500	0.59
30	丸紅	日本	卸売業	株式	140,000	1,801.25	252,176,075	2,541.50	355,810,000	0.57

TMA日本債券インデックスマザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	額面	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
							単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	第147回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.005	2026/03/20	482,000,000	99.74	480,756,440	99.88	481,436,060	1.67
2	第148回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.005	2026/06/20	422,000,000	99.65	420,523,000	99.85	421,396,540	1.46
3	第145回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2025/09/20	418,000,000	100.08	418,346,940	100.13	418,543,400	1.45
4	第146回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2025/12/20	392,000,000	100.03	392,121,520	100.09	392,368,480	1.36
5	第353回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2028/12/20	336,000,000	98.38	330,566,500	99.06	332,844,960	1.15
6	第354回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2029/03/20	336,000,000	98.17	329,857,920	98.96	332,519,040	1.15
7	第143回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2025/03/20	319,000,000	100.14	319,449,790	100.15	319,484,880	1.11
8	第355回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2029/06/20	313,000,000	97.98	306,680,530	98.88	309,519,440	1.07
9	第357回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2029/12/20	303,000,000	97.89	296,633,380	98.67	298,976,160	1.04
10	第356回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2029/09/20	300,000,000	97.78	293,340,000	98.78	296,346,000	1.03
11	第352回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2028/09/20	297,000,000	98.52	292,604,400	99.22	294,689,340	1.02
12	第366回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.200	2032/03/20	302,000,000	95.80	289,342,720	97.16	293,432,260	1.02
13	第362回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2031/03/20	298,000,000	96.10	286,404,820	97.58	290,794,360	1.01
14	第149回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.005	2026/09/20	281,000,000	99.54	279,721,450	99.82	280,519,490	0.97
15	第368回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.200	2032/09/20	285,000,000	95.04	270,864,000	96.59	275,301,450	0.95
16	第364回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2031/09/20	275,000,000	96.27	264,754,790	96.95	266,618,000	0.92
17	第367回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.200	2032/06/20	273,000,000	95.32	260,237,250	96.88	264,496,050	0.92
18	第365回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2031/12/20	270,000,000	95.37	257,522,320	96.67	261,017,100	0.90
19	第359回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2030/06/20	263,000,000	97.04	255,215,370	98.31	258,571,080	0.90
20	第351回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2028/06/20	258,000,000	98.75	254,790,480	99.39	256,433,940	0.89
21	第358回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2030/03/20	259,000,000	97.35	252,154,800	98.49	255,112,410	0.88
22	第350回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2028/03/20	252,000,000	98.95	249,354,000	99.54	250,863,480	0.87
23	第371回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.400	2033/06/20	256,000,000	96.04	245,882,880	97.53	249,676,800	0.87
24	第360回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2030/09/20	253,000,000	96.77	244,828,180	98.09	248,175,290	0.86

25	第363回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2031/06/20	255,000,000	95.97	244,738,560	97.25	248,002,800	0.86
26	第370回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.500	2033/03/20	240,000,000	97.13	233,128,800	98.66	236,793,600	0.82
27	第153回利付国債 (5年)	日本	国債証券	0.005	2027/06/20	235,000,000	99.51	233,851,350	99.57	234,010,650	0.81
28	第346回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.100	2027/03/20	234,000,000	99.60	233,066,340	99.98	233,962,560	0.81
29	第145回利付国債 (20年)	日本	国債証券	1.700	2033/06/20	211,000,000	108.02	227,928,530	109.33	230,690,520	0.80
30	第154回利付国債 (5年)	日本	国債証券	0.100	2027/09/20	226,000,000	99.31	224,440,600	99.78	225,509,580	0.78

東京海上・東証REITマザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	1,460	591,000.00	862,860,000	597,000.00	871,620,000	6.60
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	1,286	562,000.00	722,732,000	566,000.00	727,876,000	5.51
3	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	投資証券	4,047	160,000.00	647,520,000	161,400.00	653,185,800	4.95
4	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	5,999	99,900.00	599,300,100	100,200.00	601,099,800	4.55
5	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	3,602	163,700.00	589,647,400	160,200.00	577,040,400	4.37
6	日本プロロジスリート投資法人	日本	投資証券	2,180	272,200.00	593,396,000	262,600.00	572,468,000	4.33
7	GLP投資法人	日本	投資証券	4,227	133,600.00	564,727,200	131,700.00	556,695,900	4.21
8	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	1,886	253,700.00	478,478,200	260,700.00	491,680,200	3.72
9	オリックス不動産投資法人	日本	投資証券	2,494	169,000.00	421,486,000	170,600.00	425,476,400	3.22
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	2,799	150,100.00	420,129,900	149,400.00	418,170,600	3.16
11	アドバンス・レジデンス投資法人	日本	投資証券	1,228	328,500.00	403,398,000	325,000.00	399,100,000	3.02
12	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	6,059	61,100.00	370,204,900	60,700.00	367,781,300	2.78
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	4,189	75,300.00	315,431,700	75,900.00	317,945,100	2.40
14	日本プライムリアルティ投資法人	日本	投資証券	856	351,500.00	300,884,000	353,500.00	302,596,000	2.29
15	積水ハウス・リート投資法人	日本	投資証券	3,761	78,000.00	293,358,000	78,500.00	295,238,500	2.23
16	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	432	609,000.00	263,088,000	614,000.00	265,248,000	2.01
17	アクティブ・プロパティーズ投資法人	日本	投資証券	657	408,000.00	268,056,000	402,000.00	264,114,000	2.00
18	産業ファンド投資法人	日本	投資証券	1,910	138,800.00	265,108,000	133,600.00	255,176,000	1.93
19	ラサールロジポート投資法人	日本	投資証券	1,600	149,200.00	238,720,000	149,400.00	239,040,000	1.81
20	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	日本	投資証券	521	462,000.00	240,702,000	442,500.00	230,542,500	1.74
21	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	802	281,900.00	226,083,800	272,800.00	218,785,600	1.65
22	イオンリート投資法人	日本	投資証券	1,535	141,500.00	217,202,500	138,900.00	213,211,500	1.61
23	フロンティア不動産投資法人	日本	投資証券	464	439,000.00	203,696,000	436,000.00	202,304,000	1.53
24	森ヒルズリート投資法人	日本	投資証券	1,472	139,500.00	205,344,000	137,200.00	201,958,400	1.53
25	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	1,843	106,600.00	196,463,800	106,100.00	195,542,300	1.48
26	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	615	316,500.00	194,647,500	309,500.00	190,342,500	1.44

27	ヒューリックリート投資法人	日本	投資証券	1,171	156,600.00	183,378,600	155,300.00	181,856,300	1.37
28	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	2,412	74,000.00	178,488,000	74,900.00	180,658,800	1.36
29	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	259	618,000.00	160,062,000	629,000.00	162,911,000	1.23
30	三菱地所物流リート投資法人	日本	投資証券	432	376,000.00	162,432,000	369,500.00	159,624,000	1.20

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	0.31
		建設業	1.88
		食料品	3.05
		繊維製品	0.36
		パルプ・紙	0.15
		化学	5.48
		医薬品	4.26
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	0.67
		ガラス・土石製品	0.61
		鉄鋼	0.92
		非鉄金属	0.59
		金属製品	0.49
		機械	4.93
		電気機器	16.29
		輸送用機器	8.05
		精密機器	2.23
		その他製品	2.23
		電気・ガス業	1.27
		陸運業	2.50
		海運業	0.85
		空運業	0.40
		倉庫・運輸関連業	0.15
		情報・通信業	7.10
		卸売業	6.70
小売業	3.91		
銀行業	6.66		
証券、商品先物取引業	0.84		
保険業	2.30		
その他金融業	1.10		
不動産業	1.75		
サービス業	4.39		
合計			93.10

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	89.12
地方債証券	5.12
特殊債券	0.69
社債券	4.96
合計	99.90

東京海上・東証REITマザーファンド

種類	投資比率(%)
投資証券	97.18
合計	97.18

投資不動産物件

TMA日本株TOPIXマザーファンド

該当事項はありません。

TMA日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

東京海上・東証REITマザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

TMA日本株TOPIXマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/ 売建	数量 (枚)	帳簿価額	評価額(円)	投資 比率(%)
株価指数先物 取引	日本	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	156	3,708,687,700.00	3,983,460,000	6.43

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

TMA日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

東京海上・東証REITマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/ 売建	数量 (枚)	帳簿価額	評価額(円)	投資 比率(%)
株価指数先物 取引	日本	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	178	318,175,000.00	317,908,000	2.40

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1計算期間末	(2018年 1月25日)	1	1	1.0294	1.0294
第2計算期間末	(2019年 1月25日)	4	4	1.0243	1.0243
第3計算期間末	(2020年 1月27日)	44	44	1.0829	1.0829
第4計算期間末	(2021年 1月25日)	76	76	1.0180	1.0180
第5計算期間末	(2022年 1月25日)	134	134	1.0267	1.0267
第6計算期間末	(2023年 1月25日)	218	218	1.0010	1.0010
第7計算期間末	(2024年 1月25日)	252	252	1.0109	1.0109
	2023年 1月末日	218		0.9960	
	2月末日	222		1.0046	
	3月末日	231		1.0135	
	4月末日	235		1.0192	
	5月末日	241		1.0207	
	6月末日	237		1.0272	
	7月末日	237		1.0184	
	8月末日	237		1.0149	
	9月末日	237		1.0088	
	10月末日	236		0.9923	
	11月末日	247		1.0135	
	12月末日	252		1.0145	
	2024年 1月末日	253		1.0121	

【分配の推移】

該当事項はありません。

【収益率の推移】

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第1計算期間	2017年10月11日～2018年 1月25日	2.9
第2計算期間	2018年 1月26日～2019年 1月25日	0.5
第3計算期間	2019年 1月26日～2020年 1月27日	5.7
第4計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	6.0
第5計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	0.9
第6計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	2.5
第7計算期間	2023年 1月26日～2024年 1月25日	1.0

(4) 【設定及び解約の実績】

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2017年10月11日～2018年1月25日	1,081,855		1,081,855
第2計算期間	2018年1月26日～2019年1月25日	3,969,342	218,643	4,832,554
第3計算期間	2019年1月26日～2020年1月27日	48,695,808	12,789,758	40,738,604
第4計算期間	2020年1月28日～2021年1月25日	60,312,399	26,011,910	75,039,093
第5計算期間	2021年1月26日～2022年1月25日	106,661,951	50,413,953	131,287,091
第6計算期間	2022年1月26日～2023年1月25日	123,183,694	36,463,073	218,007,712
第7計算期間	2023年1月26日～2024年1月25日	120,508,317	88,999,190	249,516,839

< 参考情報 >

基準日: 2024年1月31日

基準価額・純資産の推移



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。

※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2017年10月11日です。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第3期	2020/01/27	0円
第4期	2021/01/25	0円
第5期	2022/01/25	0円
第6期	2023/01/25	0円
第7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。

主要な資産の状況

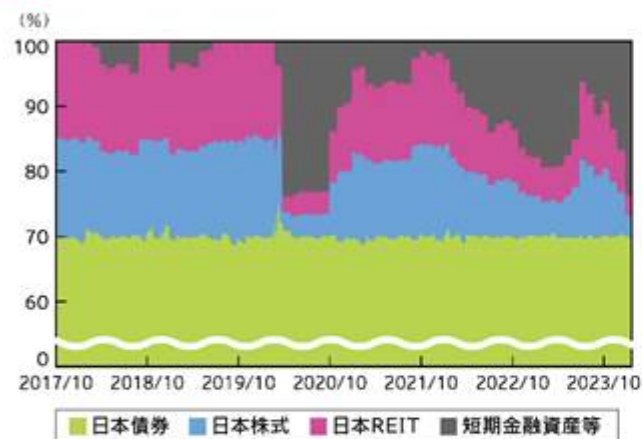
各マザーファンド組入比率、騰落率

マザーファンド	組入比率	基本資産 配分	差	騰落率				
				1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年
日本債券	69.6%	70.0%	-0.4%	-0.73%	+1.79%	-1.27%	+0.04%	-5.32%
日本株式	3.5%	15.0%	-11.5%	+7.78%	+13.40%	+11.09%	+32.49%	+52.54%
日本REIT	3.2%	15.0%	-11.8%	-0.09%	+0.19%	-1.98%	+2.83%	+9.53%
短期金融資産等	23.7%	-	+23.7%					

※比率は、純資産総額に占める割合です。

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

各マザーファンド組入比率の推移



※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

各マザーファンドの組入上位銘柄

TMA日本債券インデックスマザーファンド

	銘柄	クーポン	比率
1	第147回利付国債(5年)	0.005%	1.7%
2	第148回利付国債(5年)	0.005%	1.5%
3	第145回利付国債(5年)	0.100%	1.5%

TMA日本株TOPIXマザーファンド

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	4.2%
2	ソニーグループ	2.7%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.2%

東京海上・東証REITマザーファンド

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	6.6%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.5%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	5.0%

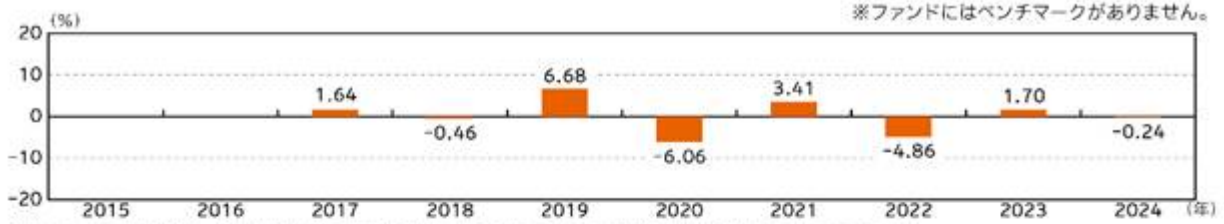
※比率は、各マザーファンドの純資産総額に占める割合です。

次ページへ続く

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

基準日:2024年1月31日

年間収益率の推移



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

※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

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

2【換金（解約）手続等】

- a. 受益者は、自己に帰属する受益権につき、一部解約の実行請求（解約請求）の方法によりご換金の請求を行うことができます。
- b. ご換金のお申込みは販売会社で受け付けます。なお、販売会社の買取りによるご換金の請求については、販売会社にお問い合わせください。
- c. 解約請求による換金のお申込みは、毎営業日に行うことができます。
- d. 解約単位は、販売会社やお申込みのコース等によって異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- e. 解約請求のお申込みの受付は、原則として午後3時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みは翌営業日受付としてお取り扱いします。
- f. 解約時の価額（解約価額）は、解約請求受付日の基準価額とします。
信託財産留保額はありませぬ。
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 1万口当たりには換算した価額で表示されることがあります。
- b. 純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、外国為替予約に基づく予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

< 主要投資対象資産の評価方法 >

対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	原則として、当ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。
株式	原則として、上場されている取引所における計算日（外国株式の場合は、計算時に知り得る直近の日）の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、以下のいずれかの価額で評価します。 a. 日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値） b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く） c. 価格情報会社の提供する価額

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

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

信託約款の変更

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

関係会社との契約の更改等

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

運用報告書

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

公告

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

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

4【受益者の権利等】

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

収益分配金の請求権

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

償還金の請求権

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

換金(解約)請求権

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

買取請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、第7期計算期間(2023年1月26日から2024年1月25日まで)の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【東京海上・円資産インデックスバランスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 [2023年 1月25日現在]	第7期 [2024年 1月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	38,666,783	60,357,684
親投資信託受益証券	179,647,928	192,289,919
未収入金	490,240	1,416,319
流動資産合計	218,804,951	254,063,922
資産合計		
	218,804,951	254,063,922
負債の部		
流動負債		
未払解約金	133,212	1,303,153
未払受託者報酬	22,615	26,932
未払委託者報酬	406,932	484,793
未払利息	18	27
その他未払費用	11,213	13,376
流動負債合計	573,990	1,828,281
負債合計		
	573,990	1,828,281
純資産の部		
元本等		
元本	1 218,007,712	1 249,516,839
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	223,249	2,718,802
（分配準備積立金）	1,993,620	2,614,313
元本等合計	218,230,961	252,235,641
純資産合計		
	218,230,961	252,235,641
負債純資産合計		
	218,804,951	254,063,922

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第7期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日
営業収益		
受取利息	114	191
有価証券売買等損益	4,304,949	3,289,308
営業収益合計	4,304,835	3,289,499
営業費用		
支払利息	10,157	12,471
受託者報酬	39,214	52,211
委託者報酬	705,646	939,710
その他費用	19,415	25,920
営業費用合計	774,432	1,030,312
営業利益又は営業損失()	5,079,267	2,259,187
経常利益又は経常損失()	5,079,267	2,259,187
当期純利益又は当期純損失()	5,079,267	2,259,187
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()	246,201	922,472
期首剰余金又は期首欠損金()	3,508,180	223,249
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,491,228	1,492,872
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,491,228	1,492,872
剰余金減少額又は欠損金増加額	943,093	334,034
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	943,093	334,034
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()	223,249	2,718,802

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第7期 自 2023年 1月26日 至 2024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6期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第7期 自 2023年 1月26日 至 2024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6期 [2023年 1月25日現在]	第7期 [2024年 1月25日現在]
1. 1 期首元本額	131,287,091円	218,007,712円
期中追加設定元本額	123,183,694円	120,508,317円
期中一部解約元本額	36,463,073円	88,999,190円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	218,007,712口	249,516,839口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第6期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第7期 自 2023年 1月26日 至 2024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（982,742円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（14,064,167円）及び分配準備積立金（1,010,878円）より、分配対象額は16,057,787円（1万口当たり736.55円）ですが、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（1,246,550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（17,087,441円）及び分配準備積立金（1,367,763円）より、分配対象額は19,701,754円（1万口当たり789.57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6期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第7期 自 2023年 1月26日 至 2024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6期 [2023年 1月25日現在]	第7期 [2024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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第6期(自 2022年1月26日 至 2023年1月25日)

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,996,244円
合計	2,996,244円

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

第7期(自 2023年1月26日 至 2024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	935,338円
合計	935,338円

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

(1口当たり情報に関する注記)

第6期 [2023年 1月25日現在]		第7期 [2024年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額	1.0010円	1口当たり純資産額	1.0109円
(1万口当たり純資産額)	(10,010円)	(1万口当たり純資産額)	(10,109円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
親投資信託 受益証券	TMA日本株TOPIXマザーファンド	3,711,227	8,654,210	
	TMA日本債券インデックスマザー ファンド	143,555,484	175,568,356	
	東京海上・東証REITマザーファンド	5,720,716	8,067,353	
親投資信託受益証券 合計		152,987,427	192,289,919	
合計		152,987,427	192,289,919	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（ご参考）

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

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	[2023年 1月25日現在]	[2024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		1,078,615,211	3,927,488,425
株式	2	41,363,773,320	57,153,417,110
派生商品評価勘定		33,155,700	238,725,500
未収配当金		67,065,375	76,149,950
流動資産合計		42,542,609,606	61,395,780,985
資産合計		42,542,609,606	61,395,780,985
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定			24,400
前受金		29,504,000	240,970,600
未払解約金		92,999,979	99,029,469
未払利息		523	1,762
流動負債合計		122,504,502	340,026,231
負債合計		122,504,502	340,026,231
純資産の部			
元本等			
元本	1	23,852,460,915	26,182,773,837
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		18,567,644,189	34,872,980,917
元本等合計		42,420,105,104	61,055,754,754
純資産合計		42,420,105,104	61,055,754,754
負債純資産合計		42,542,609,606	61,395,780,985

(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 2024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 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	自 2023年 1月26日 至 2024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	[2023年 1月25日現在]	[2024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	23,726,938,838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	9,252,139,772円
同期中における一部解約元本額	5,740,639,025円	6,921,826,850円
同期末における元本額	23,852,460,915円	26,182,773,837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	6,250,808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	42,546,714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	35,916,299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	46,008,342円
東京海上セレクション・日本株TOPIX	16,706,542,164円	17,768,224,715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	3,711,227円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	324,325,891円	481,270,679円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	176,536,831円	277,141,805円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	111,856,787円	181,498,545円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	195,274,138円	306,236,025円
TMA日本株式インデックスVA<適格機関投資家限定>	777,803,719円	1,063,320,955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	304,257,874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	2,132,302,054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	3,435,130,500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	29,762,003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	69,195,292円
計	23,852,460,915円	26,182,773,837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	23,852,460,915口	26,182,773,837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 1,304,250,000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 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び 投資法人に関する法律」(昭和 26年法律第198号)第2条第4項に 定める証券投資信託であり、有 価証券等の金融商品への投資を 信託約款に定める「運用の基本 方針」に基づき行なっておりま す。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリス ク	当ファンドが運用する主な金融 商品は「重要な会計方針に係る 事項に関する注記」の「有価証 券の評価基準及び評価方法」に 記載の有価証券及びデリバティ ブ取引であります。デリバティ ブ取引には、先物取引が含まれ ております。当該有価証券及び デリバティブ取引には、性質に 応じてそれぞれ価格変動リス ク、流動性リスク、信用リス ク等があります。	同左

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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2023年 1月25日現在]	[2024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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

(自 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。

(自 2023年1月26日 至 2024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	12,674,224,413円
合計	12,674,224,413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(2023年3月21日から2024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

(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

(2024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	3,506,389,400		3,745,140,000	238,750,600
	東証株価指数先物	3,506,389,400		3,745,140,000	238,750,600
	合 計	3,506,389,400		3,745,140,000	238,750,600

(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)

[2023年 1月25日現在]		[2024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)	1.7784円 17,784円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3319円 23,319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	
ニッスイ	20,900	792.30	16,559,070	
マルハニチロ	3,600	2,953.50	10,632,600	
サカタのタネ	2,700	3,715.00	10,030,500	
ホクト	2,700	1,778.00	4,800,600	
住石ホールディングス	2,500	1,828.00	4,570,000	
I N P E X	82,100	1,989.00	163,296,900	
石油資源開発	2,900	6,010.00	17,429,000	
K & O エナジーグループ	3,000	2,283.00	6,849,000	
ショーボンドホールディングス	3,300	6,664.00	21,991,200	
ミライト・ワン	6,000	1,921.00	11,526,000	
ベステラ	3,000	1,071.00	3,213,000	
安藤・間	13,000	1,172.00	15,236,000	
東急建設	10,700	826.00	8,838,200	
コムシスホールディングス	6,300	3,228.00	20,336,400	
東建コーポレーション	900	9,300.00	8,370,000	
ヤマウラ	5,200	1,662.00	8,642,400	
オリエンタル白石	22,900	366.00	8,381,400	
大成建設	14,500	5,387.00	78,111,500	
大林組	52,700	1,353.00	71,303,100	
清水建設	42,400	1,011.50	42,887,600	
長谷工コーポレーション	13,900	1,906.00	26,493,400	
鹿島建設	33,300	2,645.00	88,078,500	
西松建設	3,400	4,054.00	13,783,600	
三井住友建設	21,900	404.00	8,847,600	
奥村組	3,300	5,040.00	16,632,000	
東鉄工業	3,100	3,025.00	9,377,500	
戸田建設	16,900	936.20	15,821,780	
熊谷組	3,900	3,715.00	14,488,500	
東亜道路工業	700	7,000.00	4,900,000	

東亜建設工業	2,800	3,805.00	10,654,000
五洋建設	22,900	795.30	18,212,370
住友林業	13,500	4,424.00	59,724,000
日本基礎技術	3,200	498.00	1,593,600
大和ハウス工業	41,900	4,512.00	189,052,800
積水ハウス	46,400	3,385.00	157,064,000
北陸電気工事	4,900	1,176.00	5,762,400
中電工	2,400	2,684.00	6,441,600
関電工	9,400	1,433.00	13,470,200
きんでん	8,800	2,419.00	21,287,200
日本電設工業	3,300	2,031.00	6,702,300
エクシオグループ	6,800	3,247.00	22,079,600
新日本空調	2,900	2,487.00	7,212,300
九電工	3,300	5,041.00	16,635,300
三機工業	4,300	1,836.00	7,894,800
日揮ホールディングス	17,200	1,695.00	29,154,000
中外炉工業	2,800	2,648.00	7,414,400
ヤマト	3,900	981.00	3,825,900
高砂熱学工業	5,400	3,340.00	18,036,000
三晃金属工業	900	4,980.00	4,482,000
大気社	2,500	4,260.00	10,650,000
ダイダン	1,200	1,672.00	2,006,400
日比谷総合設備	3,600	2,587.00	9,313,200
インフロニア・ホールディングス	16,400	1,568.50	25,723,400
レイズネクスト	5,700	1,572.00	8,960,400
ニッポン	4,000	2,229.00	8,916,000
日清製粉グループ本社	14,000	2,063.00	28,882,000
鳥越製粉	3,700	692.00	2,560,400
フィード・ワン	2,400	830.00	1,992,000
日本甜菜製糖	1,500	2,164.00	3,246,000
DM三井製糖ホールディングス	3,700	3,200.00	11,840,000
森永製菓	6,800	2,757.00	18,747,600
江崎グリコ	3,600	4,266.00	15,357,600
井村屋グループ	2,700	2,427.00	6,552,900
山崎製パン	11,100	3,658.00	40,603,800
亀田製菓	1,900	4,150.00	7,885,000
寿スピリッツ	8,500	1,982.50	16,851,250
カルビー	7,800	3,022.00	23,571,600
森永乳業	5,800	2,994.50	17,368,100
ヤクルト本社	22,200	3,230.00	71,706,000
明治ホールディングス	18,200	3,536.00	64,355,200
雪印メグミルク	2,900	2,236.00	6,484,400
プリマハム	2,400	2,388.00	5,731,200
日本ハム	6,000	4,972.00	29,832,000
丸大食品	2,600	1,632.00	4,243,200

S Foods	2,400	3,315.00	7,956,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	2,100	4,105.00	8,620,500	
サッポロホールディングス	5,600	6,884.00	38,550,400	
アサヒグループホールディングス	36,200	5,474.00	198,158,800	
キリンホールディングス	65,500	2,088.50	136,796,750	
宝ホールディングス	7,800	1,224.50	9,551,100	
オエノンホールディングス	14,200	356.00	5,055,200	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	10,800	2,005.50	21,659,400	
サントリー食品インターナショナル	10,900	4,817.00	52,505,300	
ダイドーグループホールディングス	2,600	2,898.00	7,534,800	
伊藤園	5,600	4,304.00	24,102,400	
キーコーヒー	3,800	2,102.00	7,987,600	
ユニカフェ	3,400	907.00	3,083,800	
ジャパンフーズ	2,400	1,264.00	3,033,600	
日清オイリオグループ	2,000	4,420.00	8,840,000	
不二製油グループ本社	3,400	2,280.50	7,753,700	
J - オイルミルズ	4,400	2,029.00	8,927,600	
キッコーマン	10,400	9,115.00	94,796,000	
味の素	37,200	6,060.00	225,432,000	
キューピー	8,300	2,606.50	21,633,950	
ハウス食品グループ本社	4,300	3,218.00	13,837,400	
カゴメ	6,500	3,165.00	20,572,500	
アリアケジャパン	1,800	4,540.00	8,172,000	
ニチレイ	7,300	3,544.00	25,871,200	
東洋水産	7,900	7,863.00	62,117,700	
日清食品ホールディングス	16,200	4,907.00	79,493,400	
フジッコ	3,600	1,953.00	7,030,800	
ロック・フィールド	4,300	1,607.00	6,910,100	
日本たばこ産業	94,300	3,811.00	359,377,300	
なとり	1,400	2,136.00	2,990,400	
ユーグレナ	14,400	688.00	9,907,200	
片倉工業	2,500	1,704.00	4,260,000	
ゲンゼ	1,400	5,250.00	7,350,000	
東洋紡	6,000	1,106.00	6,636,000	
倉敷紡績	3,000	3,055.00	9,165,000	
シキボウ	1,200	1,204.00	1,444,800	
日本毛織	6,400	1,465.00	9,376,000	
帝国繊維	2,400	2,245.00	5,388,000	
帝人	13,700	1,348.50	18,474,450	
東レ	103,100	724.60	74,706,260	
日本フェルト	4,500	436.00	1,962,000	
セーレン	4,200	2,484.00	10,432,800	
小松マテーレ	2,200	809.00	1,779,800	
ワコールホールディングス	3,600	3,392.00	12,211,200	

ホギメディカル	2,700	3,470.00	9,369,000
T S I ホールディングス	11,000	687.00	7,557,000
三陽商会	600	2,636.00	1,581,600
ゴールドウイン	2,800	9,908.00	27,742,400
デサント	3,000	3,670.00	11,010,000
特種東海製紙	1,600	3,925.00	6,280,000
王子ホールディングス	57,900	577.10	33,414,090
日本製紙	8,800	1,381.00	12,152,800
三菱製紙	4,300	584.00	2,511,200
北越コーポレーション	13,500	1,386.00	18,711,000
大王製紙	7,000	1,129.00	7,903,000
レンゴー	10,100	954.40	9,639,440
ザ・パック	2,000	3,375.00	6,750,000
クラレ	23,000	1,537.00	35,351,000
旭化成	102,400	1,110.00	113,664,000
共和レザー	3,600	773.00	2,782,800
レゾナック・ホールディングス	14,800	3,017.00	44,651,600
住友化学	114,500	341.10	39,055,950
住友精化	400	5,310.00	2,124,000
日産化学	7,700	5,883.00	45,299,100
クレハ	3,900	2,895.00	11,290,500
石原産業	5,100	1,556.00	7,935,600
片倉コープアグリ	2,100	1,134.00	2,381,400
日本曹達	2,500	5,810.00	14,525,000
東ソー	20,900	1,875.00	39,187,500
トクヤマ	6,300	2,494.50	15,715,350
セントラル硝子	3,400	2,751.00	9,353,400
東亜合成	7,700	1,362.00	10,487,400
大阪ソーダ	1,900	9,860.00	18,734,000
デンカ	5,600	2,572.50	14,406,000
信越化学工業	143,800	5,867.00	843,674,600
日本カーバイド工業	1,800	1,525.00	2,745,000
堺化学工業	2,500	1,906.00	4,765,000
エア・ウォーター	15,100	1,958.50	29,573,350
日本酸素ホールディングス	15,500	3,739.00	57,954,500
日本パーカライジング	7,600	1,177.00	8,945,200
ステラ ケミファ	2,400	3,285.00	7,884,000
日本触媒	1,900	5,501.00	10,451,900
カネカ	3,500	3,623.00	12,680,500
三菱瓦斯化学	11,400	2,422.50	27,616,500
三井化学	12,600	4,398.00	55,414,800
J S R	17,600	4,056.00	71,385,600
東京応化工業	9,000	3,469.00	31,221,000
三菱ケミカルグループ	114,300	901.00	102,984,300
K H ネオケム	4,300	2,327.00	10,006,100

ダイセル	24,200	1,456.00	35,235,200
住友ベークライト	2,200	7,591.00	16,700,200
積水化学工業	30,800	2,140.50	65,927,400
日本ゼオン	10,000	1,312.50	13,125,000
アイカ工業	3,100	3,374.00	10,459,400
UBE	6,900	2,421.50	16,708,350
タキロンシーアイ	3,300	661.00	2,181,300
旭有機材	2,600	4,050.00	10,530,000
タイガースポリマー	4,400	920.00	4,048,000
ミライアル	1,900	1,575.00	2,992,500
日本化薬	8,600	1,325.00	11,395,000
ADEKA	5,200	2,936.00	15,267,200
日油	4,800	6,775.00	32,520,000
ハリマ化成グループ	4,800	872.00	4,185,600
花王	35,700	5,799.00	207,024,300
ニイタカ	1,500	1,884.00	2,826,000
三洋化成工業	1,200	4,290.00	5,148,000
日本ペイントホールディングス	85,000	1,182.50	100,512,500
関西ペイント	15,900	2,516.00	40,004,400
中国塗料	6,900	1,747.00	12,054,300
太陽ホールディングス	4,000	3,190.00	12,760,000
DIC	5,300	2,842.50	15,065,250
サカタインクス	6,700	1,423.00	9,534,100
artience	3,400	2,761.00	9,387,400
富士フイルムホールディングス	29,200	9,217.00	269,136,400
資生堂	33,300	4,009.00	133,499,700
ライオン	20,000	1,311.00	26,220,000
高砂香料工業	2,100	3,555.00	7,465,500
マンダム	4,100	1,281.00	5,252,100
ミルボン	2,600	3,506.00	9,115,600
ファンケル	7,100	2,312.00	16,415,200
コーセー	3,300	9,581.00	31,617,300
コタ	4,100	1,595.00	6,539,500
ポーラ・オルビスホールディングス	7,400	1,542.00	11,410,800
ノエビアホールディングス	1,100	5,220.00	5,742,000
エステー	3,400	1,537.00	5,225,800
長谷川香料	3,000	3,235.00	9,705,000
小林製薬	4,500	6,657.00	29,956,500
荒川化学工業	4,500	1,058.00	4,761,000
メック	2,700	4,435.00	11,974,500
タカラバイオ	6,100	1,242.00	7,576,200
JCU	2,800	3,885.00	10,878,000
デクセリアルズ	5,200	4,404.00	22,900,800
アース製薬	1,400	4,465.00	6,251,000
大成ラミック	1,800	3,005.00	5,409,000

クミアイ化学工業	8,800	855.00	7,524,000
日本農薬	8,900	684.00	6,087,600
日東電工	10,900	11,350.00	123,715,000
レック	6,400	1,054.00	6,745,600
前澤化成工業	4,200	1,577.00	6,623,400
エフピコ	2,600	2,875.50	7,476,300
天馬	2,400	2,259.00	5,421,600
信越ポリマー	5,100	1,757.00	8,960,700
ニフコ	5,300	3,851.00	20,410,300
バルカー	2,500	4,415.00	11,037,500
ユニ・チャーム	32,800	5,058.00	165,902,400
協和キリン	19,100	2,353.50	44,951,850
武田薬品工業	140,500	4,340.00	609,770,000
アステラス製薬	146,600	1,701.00	249,366,600
住友ファーマ	11,900	459.00	5,462,100
塩野義製薬	20,200	7,157.00	144,571,400
日本新薬	4,400	5,268.00	23,179,200
中外製薬	49,700	5,455.00	271,113,500
科研製薬	1,800	3,497.00	6,294,600
エーザイ	19,200	6,951.00	133,459,200
ロート製薬	15,700	2,983.50	46,840,950
小野薬品工業	34,100	2,620.00	89,342,000
久光製薬	3,700	4,198.00	15,532,600
持田製薬	2,000	3,310.00	6,620,000
参天製薬	27,400	1,473.00	40,360,200
ツムラ	3,900	2,683.50	10,465,650
キッセイ薬品工業	2,300	3,200.00	7,360,000
生化学工業	7,000	769.00	5,383,000
栄研化学	4,500	1,755.00	7,897,500
鳥居薬品	2,100	3,800.00	7,980,000
JCRファーマ	7,600	1,121.00	8,519,600
東和薬品	3,100	2,514.00	7,793,400
ゼリア新薬工業	4,000	2,033.00	8,132,000
第一三共	139,200	4,300.00	598,560,000
杏林製薬	4,100	1,799.00	7,375,900
大幸薬品	11,100	309.00	3,429,900
大塚ホールディングス	32,700	5,757.00	188,253,900
大正製薬ホールディングス	2,800	8,618.00	24,130,400
ペプチドリーム	8,800	1,347.00	11,853,600
あすか製薬ホールディングス	4,700	1,993.00	9,367,100
サワイグループホールディングス	3,500	5,644.00	19,754,000
ニチレキ	4,700	2,505.00	11,773,500
出光興産	82,000	819.50	67,199,000
E N E O Sホールディングス	255,300	598.20	152,720,460
コスモエネルギーホールディングス	6,600	6,140.00	40,524,000

横浜ゴム	8,900	3,444.00	30,651,600
TOYO TIRE	9,000	2,387.00	21,483,000
ブリヂストン	46,000	6,282.00	288,972,000
住友ゴム工業	13,600	1,647.50	22,406,000
藤倉コンポジット	1,000	1,505.00	1,505,000
オカモト	1,400	5,070.00	7,098,000
ニッタ	2,100	3,800.00	7,980,000
住友理工	2,900	1,170.00	3,393,000
三ツ星ベルト	2,100	4,825.00	10,132,500
バンドー化学	6,800	1,760.00	11,968,000
日東紡績	2,700	4,940.00	13,338,000
A G C	15,100	5,425.00	81,917,500
日本電気硝子	6,500	3,176.00	20,644,000
住友大阪セメント	2,900	3,672.00	10,648,800
太平洋セメント	9,600	2,973.50	28,545,600
日本ヒューム	7,000	909.00	6,363,000
東海カーボン	15,600	1,032.00	16,099,200
日本カーボン	700	4,465.00	3,125,500
東洋炭素	2,000	5,040.00	10,080,000
TOTO	11,000	3,970.00	43,670,000
日本碍子	17,600	1,809.00	31,838,400
日本特殊陶業	12,700	3,936.00	49,987,200
MARUWA	700	29,590.00	20,713,000
フジインコーポレーテッド	5,100	3,055.00	15,580,500
ニチアス	3,700	3,410.00	12,617,000
ニチハ	2,000	2,971.00	5,942,000
日本製鉄	74,000	3,479.00	257,446,000
神戸製鋼所	33,300	1,973.50	65,717,550
合同製鐵	800	4,940.00	3,952,000
J F Eホールディングス	46,000	2,295.00	105,570,000
東京製鐵	7,200	1,757.00	12,650,400
共英製鋼	3,500	2,097.00	7,339,500
大和工業	3,200	8,066.00	25,811,200
大阪製鐵	2,200	2,330.00	5,126,000
淀川製鋼所	2,300	3,920.00	9,016,000
丸一鋼管	4,600	3,804.00	17,498,400
モリ工業	500	4,700.00	2,350,000
大同特殊鋼	10,500	1,500.50	15,755,250
山陽特殊製鋼	3,100	2,525.00	7,827,500
愛知製鋼	1,200	3,420.00	4,104,000
大平洋金属	3,400	1,274.00	4,331,600
新日本電工	21,300	289.00	6,155,700
三菱製鋼	4,100	1,594.00	6,535,400
エンビプロ・ホールディングス	1,900	619.00	1,176,100
シンニタン	7,600	266.00	2,021,600

日本軽金属ホールディングス	4,100	1,846.00	7,568,600
三井金属鉱業	4,600	4,657.00	21,422,200
三菱マテリアル	11,500	2,712.50	31,193,750
住友金属鉱山	19,200	4,138.00	79,449,600
DOWAホールディングス	4,200	5,277.00	22,163,400
古河機械金属	4,300	1,895.00	8,148,500
UACJ	3,400	4,115.00	13,991,000
古河電気工業	4,000	2,616.50	10,466,000
住友電気工業	57,500	1,933.50	111,176,250
フジクラ	20,000	1,195.00	23,900,000
タツタ電線	9,800	695.00	6,811,000
リョービ	4,500	2,672.00	12,024,000
AREホールディングス	7,700	2,020.00	15,554,000
トーカロ	4,900	1,520.00	7,448,000
SUMCO	28,900	2,380.50	68,796,450
東洋製罐グループホールディングス	8,000	2,355.00	18,840,000
横河ブリッジホールディングス	4,000	2,782.00	11,128,000
駒井ハルテック	1,100	2,117.00	2,328,700
三和ホールディングス	15,900	2,309.50	36,721,050
文化シャッター	6,500	1,459.00	9,483,500
三協立山	5,400	887.00	4,789,800
LIXIL	25,200	1,967.00	49,568,400
ノーリツ	4,900	1,546.00	7,575,400
長府製作所	1,300	2,068.00	2,688,400
リンナイ	8,100	3,398.00	27,523,800
日東精工	9,700	544.00	5,276,800
東プレ	5,000	2,169.00	10,845,000
高周波熱錬	7,300	1,057.00	7,716,100
サンコール	2,600	475.00	1,235,000
バイオラックス	4,600	2,529.00	11,633,400
日本発條	13,000	1,218.00	15,834,000
三益半導体工業	2,600	3,435.00	8,931,000
日本製鋼所	4,500	2,431.50	10,941,750
三浦工業	6,000	2,770.00	16,620,000
タクマ	6,200	1,748.00	10,837,600
オークマ	1,600	6,568.00	10,508,800
芝浦機械	2,700	3,575.00	9,652,500
アマダ	22,200	1,591.50	35,331,300
アイダエンジニアリング	6,100	850.00	5,185,000
FUJII	5,500	2,521.00	13,865,500
牧野フライス製作所	2,100	6,050.00	12,705,000
オーエスジー	6,000	2,063.00	12,378,000
旭ダイヤモンド工業	10,000	882.00	8,820,000
DMG森精機	10,000	2,952.50	29,525,000
ディスコ	7,600	41,480.00	315,248,000

日東工器	3,100	1,928.00	5,976,800
富士ダイス	1,900	695.00	1,320,500
リケンNPR	1,400	2,709.00	3,792,600
島精機製作所	3,200	1,525.00	4,880,000
日阪製作所	5,300	974.00	5,162,200
ナプテスコ	9,100	2,860.50	26,030,550
SMC	4,800	83,310.00	399,888,000
ユニオンツール	1,300	3,425.00	4,452,500
オイレス工業	4,400	2,128.00	9,363,200
サトーホールディングス	4,100	2,215.00	9,081,500
小松製作所	75,500	3,914.00	295,507,000
住友重機械工業	8,700	3,793.00	32,999,100
日立建機	6,800	4,096.00	27,852,800
巴工業	2,400	3,705.00	8,892,000
井関農機	3,900	1,143.00	4,457,700
TOWA	1,700	8,110.00	13,787,000
ローツェ	1,200	16,710.00	20,052,000
タカキタ	8,100	486.00	3,936,600
クボタ	84,500	2,220.00	187,590,000
月島ホールディングス	4,900	1,364.00	6,683,600
帝国電機製作所	2,900	3,145.00	9,120,500
新東工業	3,800	1,116.00	4,240,800
小森コーポレーション	6,500	1,369.00	8,898,500
鶴見製作所	3,200	3,685.00	11,792,000
酒井重工業	300	6,970.00	2,091,000
荏原製作所	6,400	9,484.00	60,697,600
西島製作所	4,500	2,465.00	11,092,500
ダイキン工業	19,200	24,000.00	460,800,000
オルガノ	1,500	6,290.00	9,435,000
栗田工業	9,300	5,520.00	51,336,000
椿本チエイン	2,200	4,210.00	9,262,000
ダイフク	27,100	2,973.00	80,568,300
タダノ	10,200	1,175.50	11,990,100
フジテック	5,200	3,708.00	19,281,600
CKD	5,200	2,691.00	13,993,200
平和	3,900	2,193.00	8,552,700
SANKYO	3,700	9,280.00	34,336,000
日本金銭機械	5,900	1,588.00	9,369,200
フクシマガリレイ	1,800	5,190.00	9,342,000
竹内製作所	3,800	4,645.00	17,651,000
アマノ	3,800	3,420.00	12,996,000
グローリー	4,200	3,050.00	12,810,000
大和冷機工業	5,900	1,597.00	9,422,300
セガサミーホールディングス	13,600	2,160.00	29,376,000
ホシザキ	9,400	5,340.00	50,196,000

大豊工業	6,500	839.00	5,453,500
日本精工	23,800	796.60	18,959,080
NTN	40,100	268.00	10,746,800
ジェイテクト	11,100	1,310.50	14,546,550
不二越	1,800	3,475.00	6,255,000
日本トムソン	6,500	592.00	3,848,000
THK	8,900	2,888.50	25,707,650
ユーシン精機	5,600	672.00	3,763,200
キッツ	7,800	1,216.00	9,484,800
マキタ	19,100	3,982.00	76,056,200
日立造船	17,000	920.00	15,640,000
三菱重工業	28,100	9,618.00	270,265,800
IHI	12,500	2,803.00	35,037,500
スター精密	4,800	1,801.00	8,644,800
日清紡ホールディングス	9,100	1,209.50	11,006,450
イビデン	9,300	7,886.00	73,339,800
コニカミノルタ	32,800	411.50	13,497,200
ブラザー工業	20,500	2,513.50	51,526,750
ミネベアミツミ	26,700	3,050.00	81,435,000
日立製作所	78,000	11,385.00	888,030,000
三菱電機	176,800	2,153.00	380,650,400
富士電機	9,700	7,419.00	71,964,300
安川電機	18,600	5,797.00	107,824,200
明電舎	4,000	2,677.00	10,708,000
KOKUSAI ELECTRIC	3,500	3,915.00	13,702,500
ソシオネクスト	11,500	3,433.00	39,479,500
東芝テック	2,000	3,025.00	6,050,000
マブチモーター	6,600	2,507.50	16,549,500
ニデック	38,500	5,712.00	219,912,000
東光高岳	3,200	2,151.00	6,883,200
ダイヘン	2,200	6,990.00	15,378,000
JVCケンウッド	13,000	769.00	9,997,000
オムロン	13,900	6,798.00	94,492,200
日東工業	3,500	3,970.00	13,895,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,300	2,093.50	11,095,550
メルコホールディングス	1,500	3,335.00	5,002,500
テクノメディカ	3,000	1,991.00	5,973,000
日本電気	21,700	9,380.00	203,546,000
富士通	15,500	20,935.00	324,492,500
沖電気工業	5,400	1,029.00	5,556,600
サンケン電気	1,700	7,211.00	12,258,700
アイホン	2,800	2,951.00	8,262,800
ルネサスエレクトロニクス	105,000	2,689.50	282,397,500
セイコーエプソン	19,200	2,204.00	42,316,800
ワコム	15,200	676.00	10,275,200

アルバック	3,800	7,516.00	28,560,800
アクセル	700	2,261.00	1,582,700
E I Z O	2,000	5,170.00	10,340,000
日本信号	5,300	939.00	4,976,700
能美防災	2,700	2,260.00	6,102,000
ホーチキ	3,900	1,984.00	7,737,600
エレコム	6,200	1,768.00	10,961,600
パナソニック ホールディングス	188,500	1,373.50	258,904,750
シャープ	26,100	1,033.50	26,974,350
アンリツ	11,200	1,365.00	15,288,000
富士通ゼネラル	4,700	2,212.00	10,396,400
ソニーグループ	112,400	14,355.00	1,613,502,000
T D K	25,200	7,366.00	185,623,200
アルプスアルパイン	12,500	1,273.50	15,918,750
日本トリム	1,700	3,125.00	5,312,500
ローランド ディー . ジー .	500	3,830.00	1,915,000
フォスター電機	5,000	1,119.00	5,595,000
ヨコオ	2,800	1,484.00	4,155,200
ホシデン	5,900	1,773.00	10,460,700
ヒロセ電機	2,300	17,645.00	40,583,500
日本航空電子工業	3,900	3,110.00	12,129,000
アイコム	2,200	3,670.00	8,074,000
横河電機	17,300	2,963.50	51,268,550
アズビル	10,400	4,857.00	50,512,800
日本光電工業	6,900	4,534.00	31,284,600
堀場製作所	3,300	12,185.00	40,210,500
アドバンテスト	47,100	6,049.00	284,907,900
キーエンス	15,900	65,950.00	1,048,605,000
日置電機	1,200	6,350.00	7,620,000
シスメックス	13,800	7,966.00	109,930,800
日本マイクロニクス	2,900	4,370.00	12,673,000
O B A R A G R O U P	1,900	4,070.00	7,733,000
コーセル	6,600	1,499.00	9,893,400
イリソ電子工業	1,900	3,495.00	6,640,500
オプテックスグループ	4,500	1,806.00	8,127,000
千代田インテグレ	2,400	2,812.00	6,748,800
レーザーテック	7,300	41,530.00	303,169,000
スタンレー電気	10,600	2,815.50	29,844,300
ウシオ電機	7,800	2,130.00	16,614,000
日本セラミック	3,100	2,697.00	8,360,700
函研	2,500	4,065.00	10,162,500
日本電子	4,300	7,322.00	31,484,600
カシオ計算機	12,300	1,281.00	15,756,300
ファナック	76,600	4,316.00	330,605,600
ローム	28,200	2,678.50	75,533,700

浜松ホトニクス	12,000	6,017.00	72,204,000	
三井ハイテック	1,900	7,020.00	13,338,000	
新光電気工業	5,800	5,553.00	32,207,400	
京セラ	96,000	2,217.50	212,880,000	
太陽誘電	7,900	3,695.00	29,190,500	
村田製作所	142,500	3,061.00	436,192,500	
双葉電子工業	3,500	533.00	1,865,500	
ニチコン	6,300	1,298.00	8,177,400	
日本ケミコン	3,900	1,386.00	5,405,400	
K O A	4,700	1,578.00	7,416,600	
小糸製作所	17,900	2,282.50	40,856,750	
ミツバ	8,200	1,105.00	9,061,000	
S C R E E Nホールディングス	5,800	14,820.00	85,956,000	
キャノン電子	3,600	2,027.00	7,297,200	
キャノン	78,200	3,769.00	294,735,800	
リコー	37,400	1,174.00	43,907,600	
象印マホービン	4,700	1,483.00	6,970,100	
東京エレクトロン	33,500	28,655.00	959,942,500	
イノテック	2,900	1,860.00	5,394,000	
トヨタ紡織	5,900	2,447.50	14,440,250	
ユニプレス	7,300	1,030.00	7,519,000	
豊田自動織機	13,300	12,770.00	169,841,000	
モリタホールディングス	6,100	1,564.00	9,540,400	
デンソー	129,400	2,323.50	300,660,900	
東海理化電機製作所	4,800	2,306.00	11,068,800	
川崎重工業	12,900	3,263.00	42,092,700	
日産自動車	223,400	575.80	128,633,720	
いすゞ自動車	46,400	2,063.50	95,746,400	
トヨタ自動車	872,600	2,964.00	2,586,386,400	300,000株
日野自動車	24,200	499.60	12,090,320	
三菱自動車工業	65,400	461.20	30,162,480	
武蔵精密工業	6,100	1,689.00	10,302,900	
日産車体	4,900	993.00	4,865,700	
新明和工業	7,400	1,234.00	9,131,600	
極東開発工業	4,300	2,005.00	8,621,500	
トピー工業	3,300	2,858.00	9,431,400	
ティラド	2,000	3,635.00	7,270,000	
N O K	5,600	1,948.00	10,908,800	
フタバ産業	7,200	903.00	6,501,600	
カヤバ	2,600	5,130.00	13,338,000	
プレス工業	16,500	643.00	10,609,500	
アイシン	11,700	5,475.00	64,057,500	
マツダ	52,600	1,721.50	90,550,900	
今仙電機製作所	3,600	634.00	2,282,400	
本田技研工業	384,200	1,593.50	612,222,700	

スズキ	29,300	6,403.00	187,607,900
S U B A R U	50,100	2,910.50	145,816,050
ヤマハ発動機	70,800	1,421.50	100,642,200
エクセディ	3,800	2,815.00	10,697,000
豊田合成	4,600	2,840.00	13,064,000
愛三工業	7,300	1,375.00	10,037,500
ヨロズ	4,400	919.00	4,043,600
エフ・シー・シー	4,900	1,928.00	9,447,200
シマノ	6,400	21,695.00	138,848,000
テイ・エス テック	6,600	1,845.50	12,180,300
テルモ	47,600	4,998.00	237,904,800
クリエートメディック	2,500	899.00	2,247,500
島津製作所	20,200	4,128.00	83,385,600
ブイ・テクノロジー	2,700	2,866.00	7,738,200
東京計器	1,300	1,879.00	2,442,700
東京精密	3,600	10,150.00	36,540,000
マニー	6,000	2,082.50	12,495,000
ニコン	23,000	1,503.00	34,569,000
トプコン	9,100	1,625.50	14,792,050
オリンパス	99,100	2,196.50	217,673,150
理研計器	1,500	7,460.00	11,190,000
タムロン	2,500	5,640.00	14,100,000
HOYA	31,800	18,740.00	595,932,000
朝日インテック	17,300	2,942.00	50,896,600
シチズン時計	20,800	928.00	19,302,400
メニコン	6,100	2,260.50	13,789,050
セイコーグループ	3,700	2,628.00	9,723,600
ニプロ	12,200	1,198.00	14,615,600
パラマウントベッドホールディングス	4,000	2,706.00	10,824,000
バンダイナムコホールディングス	42,900	3,111.00	133,461,900
アイフィスジャパン	2,700	608.00	1,641,600
パイロットコーポレーション	2,200	4,137.00	9,101,400
フジシールインターナショナル	3,400	1,769.00	6,014,600
タカラトミー	7,500	2,508.50	18,813,750
広済堂ホールディングス	3,500	821.00	2,873,500
タカノ	2,500	1,033.00	2,582,500
T O P P A Nホールディングス	18,800	4,151.00	78,038,800
大日本印刷	17,100	4,243.00	72,555,300
N I S S H A	5,000	1,612.00	8,060,000
アシックス	14,300	4,494.00	64,264,200
小松ウオール工業	2,300	3,180.00	7,314,000
ヤマハ	10,100	3,300.00	33,330,000
クリナップ	8,700	736.00	6,403,200
ビジョン	10,400	1,621.00	16,858,400
キングジム	6,700	875.00	5,862,500

リンテック	2,900	2,813.00	8,157,700
イトーキ	9,700	1,506.00	14,608,200
任天堂	99,500	7,972.00	793,214,000
三菱鉛筆	4,200	2,065.00	8,673,000
タカラスタンダード	3,800	1,754.00	6,665,200
コクヨ	5,200	2,396.50	12,461,800
オカムラ	6,500	2,259.00	14,683,500
美津濃	2,500	4,380.00	10,950,000
東京電力ホールディングス	143,400	787.40	112,913,160
中部電力	56,400	1,882.50	106,173,000
関西電力	61,500	1,959.50	120,509,250
中国電力	27,300	1,035.50	28,269,150
北陸電力	15,800	721.80	11,404,440
東北電力	41,900	986.40	41,330,160
四国電力	14,000	1,064.50	14,903,000
九州電力	36,500	1,087.50	39,693,750
北海道電力	21,800	657.50	14,333,500
沖縄電力	7,000	1,161.00	8,127,000
電源開発	12,000	2,435.00	29,220,000
レノバ	5,700	1,192.00	6,794,400
東京瓦斯	33,300	3,297.00	109,790,100
大阪瓦斯	31,500	3,039.00	95,728,500
東邦瓦斯	6,500	2,991.00	19,441,500
北海道瓦斯	3,600	2,284.00	8,222,400
西部ガスホールディングス	2,300	1,935.00	4,450,500
静岡ガス	5,700	1,012.00	5,768,400
東武鉄道	16,900	3,950.00	66,755,000
相鉄ホールディングス	5,200	2,771.00	14,409,200
東急	43,100	1,734.50	74,756,950
京浜急行電鉄	21,500	1,293.50	27,810,250
小田急電鉄	26,300	2,273.50	59,793,050
京王電鉄	8,200	4,364.00	35,784,800
京成電鉄	10,200	6,778.00	69,135,600
富士急行	2,700	4,485.00	12,109,500
東日本旅客鉄道	29,200	8,426.00	246,039,200
西日本旅客鉄道	20,000	6,081.00	121,620,000
東海旅客鉄道	61,600	3,644.00	224,470,400
西武ホールディングス	20,700	2,075.00	42,952,500
西日本鉄道	3,700	2,480.50	9,177,850
ハマキョウレックス	1,400	4,150.00	5,810,000
近鉄グループホールディングス	15,900	4,594.00	73,044,600
阪急阪神ホールディングス	20,600	4,514.00	92,988,400
南海電気鉄道	7,200	2,848.00	20,505,600
京阪ホールディングス	8,800	3,635.00	31,988,000
名古屋鉄道	15,700	2,263.50	35,536,950

ヤマトホールディングス	20,500	2,589.00	53,074,500
山九	4,300	5,183.00	22,286,900
センコーグループホールディングス	10,000	1,146.00	11,460,000
トナミホールディングス	600	4,795.00	2,877,000
ニッコンホールディングス	4,700	3,118.00	14,654,600
福山通運	2,400	4,125.00	9,900,000
セイノーホールディングス	9,900	2,149.00	21,275,100
C & F ロジホールディングス	3,600	1,726.00	6,213,600
九州旅客鉄道	10,300	3,198.00	32,939,400
S Gホールディングス	29,000	1,985.50	57,579,500
NIPPON EXPRESSホールディングス	5,500	8,686.00	47,773,000
日本郵船	46,000	5,108.00	234,968,000
商船三井	35,200	5,232.00	184,166,400
川崎汽船	13,600	7,254.00	98,654,400
飯野海運	8,900	1,291.00	11,489,900
日本航空	38,500	2,838.50	109,282,250
A N Aホールディングス	43,400	3,191.00	138,489,400
三菱倉庫	3,500	4,534.00	15,869,000
三井倉庫ホールディングス	2,500	5,000.00	12,500,000
住友倉庫	5,100	2,642.00	13,474,200
東陽倉庫	1,600	1,546.00	2,473,600
安田倉庫	5,300	1,223.00	6,481,900
上組	7,600	3,427.00	26,045,200
キムラユニティー	3,500	1,476.00	5,166,000
キューソー流通システム	3,600	944.00	3,398,400
エーアイティー	3,900	1,801.00	7,023,900
N E C ネットエスアイ	6,600	2,263.00	14,935,800
システナ	33,700	306.00	10,312,200
デジタルアーツ	1,700	5,140.00	8,738,000
日鉄ソリューションズ	2,300	4,910.00	11,293,000
T I S	17,000	3,317.00	56,389,000
テクミラホールディングス	7,500	432.00	3,240,000
グリー	11,500	589.00	6,773,500
コーエーテクモホールディングス	10,300	1,809.50	18,637,850
三菱総合研究所	300	4,855.00	1,456,500
ブレインパッド	6,200	1,232.00	7,638,400
K L a b	11,700	286.00	3,346,200
ポルトゥウィンホールディングス	5,200	542.00	2,818,400
ネクソン	38,300	2,420.00	92,686,000
エイチーム	6,700	587.00	3,932,900
コロプラ	9,800	620.00	6,076,000
サイバーリンクス	3,500	810.00	2,835,000
C A R T A H O L D I N G S	2,900	1,510.00	4,379,000
S H I F T	1,200	26,740.00	32,088,000

ティーガイア	3,100	1,994.00	6,181,400
セック	300	5,350.00	1,605,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,400	2,472.50	10,879,000
GMOペイメントゲートウェイ	3,500	8,796.00	30,786,000
ザッパラス	6,600	444.00	2,930,400
インターネットイニシアティブ	9,900	3,058.00	30,274,200
ラクス	9,000	2,434.00	21,906,000
チェンジホールディングス	5,600	1,416.00	7,929,600
マネーフォワード	4,300	5,498.00	23,641,400
電算システムホールディングス	2,500	2,958.00	7,395,000
Appier Group	5,500	1,813.00	9,971,500
フェイス	2,500	481.00	1,202,500
野村総合研究所	34,900	4,359.00	152,129,100
CEホールディングス	6,000	638.00	3,828,000
日本システム技術	600	3,430.00	2,058,000
インテージホールディングス	4,700	1,701.00	7,994,700
東邦システムサイエンス	1,000	1,320.00	1,320,000
ラクスル	6,800	1,212.00	8,241,600
メルカリ	10,400	2,453.50	25,516,400
ウイングアーク1st	1,600	2,831.00	4,529,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,500	1,200.00	3,000,000
Sansan	7,600	1,385.00	10,526,000
JMDC	3,000	4,084.00	12,252,000
フジ・メディア・ホールディングス	12,200	1,750.50	21,356,100
オービック	5,100	23,180.00	118,218,000
ジャストシステム	3,400	3,260.00	11,084,000
LINEヤフー	224,500	472.20	106,008,900
トレンドマイクロ	7,600	8,250.00	62,700,000
日本オラクル	3,000	12,030.00	36,090,000
フューチャー	5,600	1,787.00	10,007,200
CAC Holdings	3,900	1,778.00	6,934,200
SBテクノロジー	2,800	2,491.00	6,974,800
オービックビジネスコンサルタント	3,200	6,933.00	22,185,600
大塚商会	8,600	6,161.00	52,984,600
サイボウズ	4,000	2,165.00	8,660,000
電通総研	2,600	5,810.00	15,106,000
デジタルガレージ	3,200	3,545.00	11,344,000
ウェザーニューズ	1,100	5,450.00	5,995,000
ビジネスエンジニアリング	300	4,655.00	1,396,500
日本エンタープライズ	22,700	126.00	2,860,200
ネットワンシステムズ	6,600	2,390.00	15,774,000
アルゴグラフィックス	2,600	3,900.00	10,140,000
エイベックス	5,300	1,410.00	7,473,000

B I P R O G Y	5,900	4,325.00	25,517,500
都築電気	800	2,206.00	1,764,800
T B S ホールディングス	7,000	3,584.00	25,088,000
日本テレビホールディングス	10,700	1,739.00	18,607,300
テレビ朝日ホールディングス	5,100	1,775.00	9,052,500
スカパー J S A T ホールディングス	17,600	767.00	13,499,200
テレビ東京ホールディングス	2,500	3,140.00	7,850,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	1,800	4,400.00	7,920,000
日本電信電話	4,773,600	186.30	889,321,680
K D D I	122,700	4,903.00	601,598,100
ソフトバンク	254,000	1,966.00	499,364,000
光通信	1,800	25,795.00	46,431,000
G M O インターネットグループ	7,000	2,678.50	18,749,500
K A D O K A W A	8,800	3,156.00	27,772,800
ゼンリン	6,600	877.00	5,788,200
松竹	1,100	9,616.00	10,577,600
東宝	9,500	4,782.00	45,429,000
東映	600	20,600.00	12,360,000
N T T データグループ	49,600	2,129.50	105,623,200
ビジネスブレイン太田昭和	2,900	2,237.00	6,487,300
D T S	3,200	3,620.00	11,584,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,900	5,807.00	45,875,300
カプコン	15,200	5,573.00	84,709,600
S C S K	12,300	2,895.00	35,608,500
N S W	700	2,910.00	2,037,000
アイネス	4,000	1,614.00	6,456,000
T K C	2,100	3,820.00	8,022,000
富士ソフト	3,800	6,450.00	24,510,000
N S D	5,500	2,778.00	15,279,000
コナミグループ	6,400	8,853.00	56,659,200
福井コンピュータホールディングス	700	2,629.00	1,840,300
J B C C ホールディングス	700	4,230.00	2,961,000
ソフトバンクグループ	78,900	6,667.00	526,026,300
高千穂交易	300	4,215.00	1,264,500
伊藤忠食品	800	7,500.00	6,000,000
エレマテック	4,300	1,879.00	8,079,700
東京エレクトロン デバイス	600	6,290.00	3,774,000
双日	19,800	3,469.00	68,686,200
アルフレッサ ホールディングス	14,800	2,416.00	35,756,800
横浜冷凍	7,900	1,101.00	8,697,900
ラサ商事	2,000	1,649.00	3,298,000
アルコニックス	2,900	1,395.00	4,045,500
神戸物産	12,700	3,860.00	49,022,000
あい ホールディングス	3,400	2,519.00	8,564,600

ダイワボウホールディングス	5,900	3,239.00	19,110,100
マクニカホールディングス	4,300	8,347.00	35,892,100
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,400	1,144.00	3,889,600
レスターホールディングス	3,100	3,105.00	9,625,500
O C H Iホールディングス	2,100	1,569.00	3,294,900
T O K A Iホールディングス	7,900	984.00	7,773,600
シップヘルスケアホールディングス	5,400	2,316.00	12,506,400
明治電機工業	2,900	1,448.00	4,199,200
コメダホールディングス	5,600	2,782.00	15,579,200
佐島電機	600	2,461.00	1,476,600
エコートレーディング	3,700	1,202.00	4,447,400
伯東	600	6,120.00	3,672,000
ナガイレーベン	2,600	2,396.00	6,229,600
三菱食品	1,900	5,030.00	9,557,000
松田産業	2,400	2,705.00	6,492,000
第一興商	6,600	2,068.00	13,648,800
メディパルホールディングス	15,300	2,295.00	35,113,500
アズワン	2,400	5,558.00	13,339,200
尾家産業	2,000	1,793.00	3,586,000
ドウシシャ	3,200	2,224.00	7,116,800
リックス	400	3,730.00	1,492,000
橋本総業ホールディングス	4,300	1,303.00	5,602,900
日本ライフライン	6,700	1,311.00	8,783,700
進和	2,900	2,434.00	7,058,600
オーハシテクニカ	3,900	1,765.00	6,883,500
白銅	2,400	2,480.00	5,952,000
伊藤忠商事	113,400	6,667.00	756,037,800
丸紅	140,000	2,491.50	348,810,000
長瀬産業	5,900	2,387.00	14,083,300
豊田通商	14,800	9,653.00	142,864,400
兼松	6,700	2,264.00	15,168,800
三井物産	127,200	5,928.00	754,041,600
日本紙パルプ商事	1,100	5,090.00	5,599,000
山善	6,400	1,289.00	8,249,600
住友商事	102,300	3,348.00	342,500,400
内田洋行	1,200	7,640.00	9,168,000
三菱商事	334,200	2,524.00	843,520,800
キヤノンマーケティングジャパン	3,400	4,386.00	14,912,400
西華産業	3,000	3,085.00	9,255,000
菱洋エレクトロ	2,700	3,995.00	10,786,500
東京産業	5,000	751.00	3,755,000
阪和興業	3,200	5,350.00	17,120,000
岩谷産業	3,900	6,596.00	25,724,400
アステナホールディングス	12,300	483.00	5,940,900
三愛オブリ	4,600	1,680.00	7,728,000

稲畑産業	3,900	3,160.00	12,324,000
ワキタ	6,500	1,560.00	10,140,000
東邦ホールディングス	3,500	3,210.00	11,235,000
サンゲツ	4,000	3,280.00	13,120,000
シナネンホールディングス	1,000	4,065.00	4,065,000
伊藤忠エネクス	5,800	1,583.00	9,181,400
サンリオ	5,000	6,178.00	30,890,000
リョーサン	2,900	5,190.00	15,051,000
三信電気	2,700	2,453.00	6,623,100
モスフードサービス	2,800	3,400.00	9,520,000
加賀電子	2,300	6,820.00	15,686,000
ソーダニッカ	1,900	1,233.00	2,342,700
立花エレテック	2,600	3,160.00	8,216,000
フォーバル	4,700	1,464.00	6,880,800
PALTA C	2,100	4,580.00	9,618,000
トラスコ中山	4,400	2,479.00	10,907,600
オートバックスセブン	5,000	1,591.00	7,955,000
加藤産業	2,000	4,745.00	9,490,000
杉本商事	2,500	2,263.00	5,657,500
因幡電機産業	3,000	3,535.00	10,605,000
ミスミグループ本社	24,800	2,466.50	61,169,200
スズケン	6,000	4,613.00	27,678,000
ジェコス	5,200	1,106.00	5,751,200
グローセル	2,800	674.00	1,887,200
ローソン	4,200	8,266.00	34,717,200
サンエー	1,600	4,570.00	7,312,000
エービーシー・マート	6,000	2,582.00	15,492,000
ハードオフコーポレーション	4,300	1,814.00	7,800,200
アスクル	4,200	2,109.00	8,857,800
ゲオホールディングス	4,300	2,297.00	9,877,100
アダストリア	2,900	3,265.00	9,468,500
ジーフット	8,100	295.00	2,389,500
エディオン	5,900	1,611.00	9,504,900
あみやき亭	1,800	4,160.00	7,488,000
ハニーズホールディングス	3,800	1,638.00	6,224,400
ジinzホールディングス	2,000	4,120.00	8,240,000
ビックカメラ	8,600	1,379.00	11,859,400
D C Mホールディングス	7,100	1,355.00	9,620,500
MonotaRO	24,300	1,444.00	35,089,200
J.フロント リテイリング	20,700	1,376.50	28,493,550
ドトール・日レスホールディングス	4,600	2,170.00	9,982,000
マツキヨココカラ &カンパニー	30,200	2,699.00	81,509,800
ブロンコビリー	600	3,435.00	2,061,000
ZOZO	10,900	3,300.00	35,970,000
トレジャー・ファクトリー	3,400	1,213.00	4,124,200

物語コーポレーション	2,700	5,140.00	13,878,000	
三越伊勢丹ホールディングス	28,100	1,713.00	48,135,300	
ウエルシアホールディングス	9,000	2,358.00	21,222,000	
クリエイイトSDホールディングス	2,500	3,165.00	7,912,500	
シュッピン	4,400	1,052.00	4,628,800	
オイシックス・ラ・大地	3,400	1,388.00	4,719,200	
ジョイフル本田	4,600	1,947.00	8,956,200	
すかいらーくホールディングス	20,800	2,380.00	49,504,000	
ヨシックスホールディングス	500	2,975.00	1,487,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,500	1,019.00	5,604,500	
あさひ	3,500	1,294.00	4,529,000	
コスモス薬品	1,700	15,490.00	26,333,000	
トーエル	2,400	804.00	1,929,600	
セブン&アイ・ホールディングス	57,900	5,785.00	334,951,500	
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	12,600	1,099.00	13,847,400	
ツルハホールディングス	3,600	12,635.00	45,486,000	
サンマルクホールディングス	2,900	2,217.00	6,429,300	
トリドールホールディングス	5,200	4,446.00	23,119,200	
クスリのアオキホールディングス	4,500	3,225.00	14,512,500	
力の源ホールディングス	800	1,428.00	1,142,400	
FOOD & LIFE COMPANIES	10,000	3,008.00	30,080,000	
ノジマ	5,000	1,902.00	9,510,000	
カッパ・クリエイイト	5,700	1,736.00	9,895,200	
ライトオン	3,200	415.00	1,328,000	
良品計画	18,100	2,328.00	42,136,800	
バリミキホールディングス	3,400	522.00	1,774,800	
アドヴァングループ	5,300	1,064.00	5,639,200	
G-7ホールディングス	4,300	1,254.00	5,392,200	
コーナン商事	2,500	3,900.00	9,750,000	
エコス	2,900	2,459.00	7,131,100	
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	34,300	3,230.00	110,789,000	
西松屋チェーン	5,700	2,130.00	12,141,000	
ゼンショーホールディングス	9,300	7,190.00	66,867,000	
サイゼリヤ	3,000	5,090.00	15,270,000	
魚力	2,500	2,317.00	5,792,500	
ユナイテッドアローズ	3,100	1,942.00	6,020,200	
ハイデイ日高	3,100	2,873.00	8,906,300	
コロナイド	7,000	2,309.50	16,166,500	
壱番屋	1,200	6,160.00	7,392,000	
スギホールディングス	3,200	6,757.00	21,622,400	
薬王堂ホールディングス	2,700	2,555.00	6,898,500	
スクロール	5,400	1,022.00	5,518,800	

木曽路	3,400	2,626.00	8,928,400
千趣会	14,100	315.00	4,441,500
上新電機	2,300	2,469.00	5,678,700
日本瓦斯	8,800	2,356.00	20,732,800
ロイヤルホールディングス	4,800	2,593.00	12,446,400
いなげや	3,800	1,281.00	4,867,800
チヨダ	2,800	895.00	2,506,000
ライフコーポレーション	2,100	3,760.00	7,896,000
AOKIホールディングス	8,500	1,186.00	10,081,000
コメリ	1,700	3,320.00	5,644,000
青山商事	6,000	1,743.00	10,458,000
しまむら	1,800	16,700.00	30,060,000
高島屋	12,400	2,035.00	25,234,000
松屋	6,300	948.00	5,972,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,700	1,620.00	14,094,000
丸井グループ	13,400	2,494.00	33,419,600
アクシアル リテイリング	2,000	4,080.00	8,160,000
イオン	56,800	3,457.00	196,357,600
イズミ	2,500	3,440.00	8,600,000
平和堂	3,100	2,183.00	6,767,300
フジ	2,400	1,964.00	4,713,600
ヤオコー	1,600	8,427.00	13,483,200
ゼビオホールディングス	3,500	976.00	3,416,000
ケーズホールディングス	9,800	1,342.00	13,151,600
Genky Drug Stores	1,300	6,290.00	8,177,000
ブックオフグループホールディングス	4,500	1,288.00	5,796,000
アインホールディングス	2,500	4,535.00	11,337,500
ヤマダホールディングス	57,700	455.00	26,253,500
アークランズ	3,200	1,693.00	5,417,600
ニトリホールディングス	6,600	19,465.00	128,469,000
吉野家ホールディングス	5,700	3,263.00	18,599,100
王将フードサービス	800	8,070.00	6,456,000
ミニストップ	3,200	1,535.00	4,912,000
アークス	3,000	2,903.00	8,709,000
バローホールディングス	2,800	2,493.00	6,980,400
大庄	2,200	1,317.00	2,897,400
ファーストリテイリング	7,500	38,960.00	292,200,000
サンドラッグ	5,600	4,484.00	25,110,400
ヤマザワ	1,400	1,272.00	1,780,800
ベルーナ	10,200	629.00	6,415,800
いよぎんホールディングス	17,400	999.30	17,387,820
しずおかフィナンシャルグループ	31,600	1,343.50	42,454,600
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12,300	1,039.50	12,785,850
楽天銀行	6,000	2,315.00	13,890,000
京都フィナンシャルグループ	17,600	2,397.50	42,196,000

めぶきフィナンシャルグループ	72,800	444.30	32,345,040	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,700	4,255.00	15,743,500	
九州フィナンシャルグループ	25,800	910.10	23,480,580	
ゆうちょ銀行	167,700	1,542.50	258,677,250	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	75,900	704.00	53,433,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	7,600	1,714.00	13,026,400	
三十三フィナンシャルグループ	300	1,909.00	572,700	
第四北越フィナンシャルグループ	2,800	4,055.00	11,354,000	
ひろぎんホールディングス	19,100	989.80	18,905,180	
おきなわフィナンシャルグループ	2,000	2,464.00	4,928,000	
十六フィナンシャルグループ	2,300	3,965.00	9,119,500	
北國フィナンシャルホールディングス	2,000	4,410.00	8,820,000	
プロクレアホールディングス	2,600	1,891.00	4,916,600	
あいちフィナンシャルグループ	4,200	2,585.00	10,857,000	
あおぞら銀行	9,300	3,247.00	30,197,100	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	961,000	1,383.50	1,329,543,500	300,000株
りそなホールディングス	189,200	810.60	153,365,520	
三井住友トラスト・ホールディングス	55,000	2,959.50	162,772,500	
三井住友フィナンシャルグループ	110,700	7,645.00	846,301,500	
千葉銀行	39,500	1,095.00	43,252,500	
群馬銀行	28,500	730.30	20,813,550	
武蔵野銀行	1,400	2,782.00	3,894,800	
千葉興業銀行	1,400	869.00	1,216,600	
七十七銀行	4,800	3,610.00	17,328,000	
秋田銀行	2,900	1,982.00	5,747,800	
山形銀行	3,300	1,111.00	3,666,300	
岩手銀行	2,900	2,550.00	7,395,000	
東邦銀行	8,200	305.00	2,501,000	
東北銀行	1,800	1,186.00	2,134,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,200	3,581.00	43,688,200	
スルガ銀行	16,200	852.00	13,802,400	
八十二銀行	31,700	807.00	25,581,900	
山梨中央銀行	4,400	1,747.00	7,686,800	
大垣共立銀行	3,100	1,958.00	6,069,800	
福井銀行	1,600	1,704.00	2,726,400	
滋賀銀行	3,100	3,450.00	10,695,000	
南都銀行	3,100	2,629.00	8,149,900	
百五銀行	12,400	575.00	7,130,000	
紀陽銀行	4,700	1,678.00	7,886,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,300	1,576.00	14,656,800	
山陰合同銀行	10,500	1,045.00	10,972,500	
鳥取銀行	1,800	1,434.00	2,581,200	
百十四銀行	4,000	2,444.00	9,776,000	
阿波銀行	1,800	2,443.00	4,397,400	
大分銀行	1,900	2,654.00	5,042,600	

宮崎銀行	1,800	2,712.00	4,881,600
佐賀銀行	2,600	1,942.00	5,049,200
琉球銀行	8,400	1,148.00	9,643,200
セブン銀行	52,600	305.00	16,043,000
みずほフィナンシャルグループ	210,500	2,671.50	562,350,750
山口フィナンシャルグループ	14,400	1,383.00	19,915,200
名古屋銀行	1,700	5,470.00	9,299,000
北洋銀行	20,500	368.00	7,544,000
愛媛銀行	3,900	1,054.00	4,110,600
トマト銀行	1,900	1,223.00	2,323,700
京葉銀行	11,400	716.00	8,162,400
栃木銀行	18,600	312.00	5,803,200
トモニホールディングス	14,000	406.00	5,684,000
フィデアホールディングス	3,800	1,595.00	6,061,000
池田泉州ホールディングス	35,300	334.00	11,790,200
F P G	9,700	1,693.00	16,422,100
S B Iホールディングス	21,300	3,629.00	77,297,700
ジャフコグループ	6,700	1,699.50	11,386,650
大和証券グループ本社	114,700	1,060.50	121,639,350
野村ホールディングス	266,800	757.60	202,127,680
岡三証券グループ	22,200	757.00	16,805,400
丸三証券	12,800	893.00	11,430,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	26,800	559.00	14,981,200
いちよし証券	7,200	778.00	5,601,600
松井証券	12,000	814.00	9,768,000
マネックスグループ	21,300	755.00	16,081,500
極東証券	6,200	1,051.00	6,516,200
アイザワ証券グループ	6,400	1,232.00	7,884,800
かんぽ生命保険	16,100	2,721.00	43,808,100
S O M P Oホールディングス	25,900	7,530.00	195,027,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	34,300	6,025.00	206,657,500
第一生命ホールディングス	76,900	3,181.00	244,618,900
東京海上ホールディングス	154,800	3,820.00	591,336,000
T & Dホールディングス	45,100	2,382.00	107,428,200
全国保証	4,000	5,504.00	22,016,000
ジェイリース	1,200	2,325.00	2,790,000
クレディセゾン	10,500	2,779.00	29,179,500
芙蓉総合リース	1,700	13,205.00	22,448,500
みずほリース	3,200	5,290.00	16,928,000
東京センチュリー	10,400	1,624.00	16,889,600
日本証券金融	8,800	1,565.00	13,772,000
アイフル	35,100	371.00	13,022,100
リコーリース	1,700	5,110.00	8,687,000

イオンフィナンシャルサービス	9,400	1,325.00	12,455,000
アコム	31,700	369.80	11,722,660
オリエントコーポレーション	7,600	1,114.00	8,466,400
オリックス	100,000	2,856.00	285,600,000
三菱HCキャピタル	63,500	1,026.00	65,151,000
日本取引所グループ	42,300	3,180.00	134,514,000
アサックス	4,000	731.00	2,924,000
NECキャピタルソリューション	2,300	3,730.00	8,579,000
大東建託	5,700	16,125.00	91,912,500
いちご	22,700	373.00	8,467,100
ヒューリック	35,200	1,555.50	54,753,600
野村不動産ホールディングス	10,300	3,973.00	40,921,900
プレサンスコーポレーション	2,500	1,667.00	4,167,500
オープンハウスグループ	6,300	4,535.00	28,570,500
東急不動産ホールディングス	47,000	994.50	46,741,500
飯田グループホールディングス	13,000	2,272.00	29,536,000
パーク24	13,000	1,867.00	24,271,000
三井不動産	71,700	3,665.00	262,780,500
三菱地所	102,500	2,029.00	207,972,500
平和不動産	3,400	3,900.00	13,260,000
東京建物	15,900	2,242.00	35,647,800
京阪神ビルディング	5,600	1,455.00	8,148,000
住友不動産	23,700	4,571.00	108,332,700
テーオーシー	7,400	693.00	5,128,200
スターツコーポレーション	3,500	3,055.00	10,692,500
空港施設	7,600	654.00	4,970,400
ゴールドクレスト	3,600	2,321.00	8,355,600
エスリード	2,500	3,645.00	9,112,500
AVANTIA	3,900	898.00	3,502,200
イオンモール	7,800	1,792.50	13,981,500
カチタス	5,300	1,914.00	10,144,200
グランディハウス	2,300	652.00	1,499,600
日本空港ビルデング	5,800	5,874.00	34,069,200
MIXI	3,500	2,534.00	8,869,000
日本M&Aセンターホールディングス	32,600	780.90	25,457,340
UTグループ	3,900	2,420.00	9,438,000
オープンアップグループ	4,400	2,224.00	9,785,600
コシダカホールディングス	6,300	995.00	6,268,500
パソナグループ	3,500	2,700.00	9,450,000
エス・エム・エス	6,800	2,620.00	17,816,000
パーソルホールディングス	167,000	233.90	39,061,300
クックパッド	25,000	116.00	2,900,000
学情	3,700	1,769.00	6,545,300
スタジオアリス	2,900	2,099.00	6,087,100
シミックホールディングス	3,400	2,643.00	8,986,200

N J S	2,500	2,811.00	7,027,500	
総合警備保障	27,000	798.10	21,548,700	
カカクコム	12,900	1,700.00	21,930,000	
アイロムグループ	2,600	2,062.00	5,361,200	
ディップ	3,300	2,539.00	8,378,700	
キャリアデザインセンター	1,800	2,104.00	3,787,200	
ベネフィット・ワン	7,700	2,133.50	16,427,950	
エムスリー	32,700	2,437.00	79,689,900	
アウトソーシング	11,200	1,743.00	19,521,600	
ディー・エヌ・エー	7,000	1,521.50	10,650,500	
博報堂D Yホールディングス	19,900	1,120.00	22,288,000	
ぐるなび	16,400	277.00	4,542,800	
ファンコミュニケーションズ	11,400	403.00	4,594,200	
W D Bホールディングス	1,500	2,307.00	3,460,500	
インフォマート	25,000	415.00	10,375,000	
プレステージ・インターナショナル	7,700	606.00	4,666,200	
クイック	3,400	2,532.00	8,608,800	
電通グループ	15,900	3,948.00	62,773,200	
H . U . グループホールディングス	4,700	2,720.50	12,786,350	
日本空調サービス	7,300	839.00	6,124,700	
オリエンタルランド	86,100	5,562.00	478,888,200	
ダスキン	2,600	3,392.00	8,819,200	
ラウンドワン	21,000	658.00	13,818,000	
リゾートトラスト	7,000	2,537.00	17,759,000	
ビー・エム・エル	2,900	2,850.00	8,265,000	
リソー教育	20,900	242.00	5,057,800	
早稲田アカデミー	4,600	1,682.00	7,737,200	
ユー・エス・エス	17,000	2,829.00	48,093,000	
サイバーエージェント	40,600	948.80	38,521,280	
楽天グループ	141,200	661.50	93,403,800	
テー・オー・ダブリュー	19,000	335.00	6,365,000	
エン・ジャパン	4,600	2,646.00	12,171,600	
テクノプロ・ホールディングス	9,700	3,514.00	34,085,800	
アイ・アールジャパンホールディングス	2,500	1,568.00	3,920,000	
ジャパンマテリアル	5,000	2,540.00	12,700,000	
キャリアリンク	2,100	2,578.00	5,413,800	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,000	1,032.00	4,128,000	
シグマクシス・ホールディングス	2,200	1,361.00	2,994,200	
リクルートホールディングス	120,900	5,914.00	715,002,600	
エラン	7,600	1,064.00	8,086,400	
日本郵政	187,500	1,420.50	266,343,750	
ソラスト	7,100	586.00	4,160,600	
ベイカレント・コンサルティング	13,000	3,490.00	45,370,000	
M S - J a p a n	4,500	1,232.00	5,544,000	

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,300	2,215.00	13,954,500	
アンビスホールディングス	1,800	2,719.00	4,894,200	
リログループ	11,200	1,603.00	17,953,600	
TREホールディングス	3,300	1,268.00	4,184,400	
大栄環境	2,900	2,564.00	7,435,600	
日本管財ホールディングス	3,300	2,626.00	8,665,800	
共立メンテナンス	3,600	5,958.00	21,448,800	
建設技術研究所	2,000	5,940.00	11,880,000	
スバル興業	100	15,580.00	1,558,000	
タナベコンサルティンググループ	1,100	1,055.00	1,160,500	
東京都競馬	2,400	4,595.00	11,028,000	
カナモト	4,300	2,904.00	12,487,200	
トランス・コスモス	3,200	3,130.00	10,016,000	
乃村工藝社	9,600	868.00	8,332,800	
白洋舎	1,700	2,792.00	4,746,400	
セコム	16,100	10,775.00	173,477,500	
セントラル警備保障	2,200	2,535.00	5,577,000	
メイテックグループホールディングス	4,900	2,905.00	14,234,500	
応用地質	3,400	2,235.00	7,599,000	
船井総研ホールディングス	4,200	2,629.00	11,041,800	
ベネッセホールディングス	5,900	2,620.00	15,458,000	
イオンディライト	2,100	3,750.00	7,875,000	
ダイセキ	3,400	4,275.00	14,535,000	
ステップ	3,100	1,956.00	6,063,600	
合計	24,373,700	-	57,153,417,110	

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

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「TMA日本債券インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	[2023年 1月25日現在]	[2024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		172,460,380	81,185,249
国債証券		23,707,574,480	25,142,469,150
地方債証券		1,231,403,200	1,468,338,556
特殊債券		199,875,000	199,346,000
社債券		1,137,284,547	1,425,686,907
未収入金		161,149,650	
未収利息		36,098,359	42,181,439
前払費用		1,590,628	1,424,753
流動資産合計		26,647,436,244	28,360,632,054
資産合計		26,647,436,244	28,360,632,054
負債の部			
流動負債			
未払金		283,486,860	33,857,110
未払解約金		20,329,955	38,497,088
未払利息		83	36
流動負債合計		303,816,898	72,354,234
負債合計		303,816,898	72,354,234
純資産の部			
元本等			
元本	1	21,374,821,874	23,129,731,957
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		4,968,797,472	5,158,545,863
元本等合計		26,343,619,346	28,288,277,820
純資産合計		26,343,619,346	28,288,277,820
負債純資産合計		26,647,436,244	28,360,632,054

(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 2024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 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	自 2023年 1月26日 至 2024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	[2023年 1月25日現在]	[2024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	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	6,357,708,643円
同期中における一部解約元本額	1,910,047,296円	4,602,798,560円
同期末における元本額	21,374,821,874円	23,129,731,957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	301,797,247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	2,215,804,553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	1,734,086,242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	2,221,343,394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	4,565,507,914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	622,696,317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	143,555,484円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035	448,775,451円	850,660,190円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	198,477,144円	398,009,076円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	112,567,400円	233,314,011円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	154,405,490円	309,307,029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	27,956,462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	1,049,847,957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	3,681,618,910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	1,436,948,709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)	2,761,021,815円	3,337,278,462円
計	21,374,821,874円	23,129,731,957円
2. 1 本書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	21,374,821,874口	23,129,731,957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 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	自 2023年 1月26日 至 2024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	[2023年 1月25日現在]	[2024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>同左</p>

（有価証券に関する注記）

（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
<p>国債証券</p>	<p>285,222,370円</p>
<p>地方債証券</p>	<p>9,216,300円</p>

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。

(自 2023年1月26日 至 2024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	119,140,650円
地方債証券	10,471,216円
特殊債券	573,000円
社債券	6,823,500円
合計	137,008,366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(2023年11月11日から2024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)

[2023年 1月25日現在]		[2024年 1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	1.2230円
(1万口当たり純資産額	12,325円)	(1万口当たり純資産額	12,230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445回利付国債(2年)	192,000,000	192,086,400	
	第446回利付国債(2年)	18,000,000	18,006,840	
	第447回利付国債(2年)	46,000,000	46,016,100	
	第448回利付国債(2年)	60,000,000	60,015,000	
	第449回利付国債(2年)	114,000,000	114,014,820	
	第450回利付国債(2年)	68,000,000	68,004,760	
	第451回利付国債(2年)	60,000,000	60,000,000	
	第452回利付国債(2年)	130,000,000	129,979,200	
	第453回利付国債(2年)	124,000,000	123,957,840	
	第454回利付国債(2年)	45,000,000	45,059,400	
	第143回利付国債(5年)	319,000,000	319,491,260	
	第144回利付国債(5年)	130,000,000	130,189,800	
	第145回利付国債(5年)	418,000,000	418,618,640	
	第146回利付国債(5年)	392,000,000	392,482,160	

第147回利付国債(5年)	482,000,000	481,532,460	
第148回利付国債(5年)	422,000,000	421,493,600	
第149回利付国債(5年)	281,000,000	280,589,740	
第150回利付国債(5年)	174,000,000	173,646,780	
第151回利付国債(5年)	205,000,000	204,389,100	
第152回利付国債(5年)	150,000,000	150,000,000	
第153回利付国債(5年)	153,000,000	152,378,820	
第154回利付国債(5年)	226,000,000	225,548,000	
第155回利付国債(5年)	210,000,000	210,934,500	
第156回利付国債(5年)	153,000,000	153,088,740	
第157回利付国債(5年)	119,000,000	118,901,230	
第158回利付国債(5年)	160,000,000	159,211,200	
第159回利付国債(5年)	102,000,000	101,311,500	
第160回利付国債(5年)	156,000,000	155,625,600	
第163回利付国債(5年)	160,000,000	160,769,600	
第5回利付国債(40年)	36,000,000	37,875,600	
第6回利付国債(40年)	76,000,000	78,124,200	
第7回利付国債(40年)	84,000,000	82,117,560	
第8回利付国債(40年)	85,000,000	76,834,050	
第9回利付国債(40年)	99,000,000	65,017,260	
第10回利付国債(40年)	100,000,000	77,151,000	
第11回利付国債(40年)	99,000,000	73,187,730	
第12回利付国債(40年)	104,000,000	68,080,480	
第13回利付国債(40年)	92,000,000	59,432,000	
第14回利付国債(40年)	88,000,000	60,584,480	
第15回利付国債(40年)	93,000,000	70,511,670	
第16回利付国債(40年)	76,000,000	63,072,400	
第338回利付国債(10年)	101,000,000	101,502,980	
第339回利付国債(10年)	160,000,000	160,904,000	
第340回利付国債(10年)	70,000,000	70,450,100	
第341回利付国債(10年)	90,000,000	90,451,800	
第342回利付国債(10年)	200,000,000	200,214,000	
第343回利付国債(10年)	195,000,000	195,208,650	
第344回利付国債(10年)	190,000,000	190,199,500	
第345回利付国債(10年)	170,000,000	170,122,400	
第346回利付国債(10年)	234,000,000	234,000,000	
第347回利付国債(10年)	145,000,000	144,876,750	
第348回利付国債(10年)	145,000,000	144,710,000	
第349回利付国債(10年)	174,000,000	173,425,800	
第350回利付国債(10年)	252,000,000	250,757,640	
第351回利付国債(10年)	258,000,000	256,258,500	
第352回利付国債(10年)	297,000,000	294,410,160	
第353回利付国債(10年)	336,000,000	332,512,320	
第354回利付国債(10年)	336,000,000	332,172,960	
第355回利付国債(10年)	313,000,000	309,181,400	

第356回利付国債(10年)	316,000,000	311,794,040	
第357回利付国債(10年)	303,000,000	298,621,650	
第358回利付国債(10年)	264,000,000	259,715,280	
第359回利付国債(10年)	263,000,000	258,237,070	
第360回利付国債(10年)	253,000,000	247,762,900	
第361回利付国債(10年)	187,000,000	182,620,460	
第362回利付国債(10年)	298,000,000	290,174,520	
第363回利付国債(10年)	255,000,000	247,546,350	
第364回利付国債(10年)	264,000,000	255,464,880	
第365回利付国債(10年)	270,000,000	260,406,900	
第366回利付国債(10年)	266,000,000	257,937,540	
第367回利付国債(10年)	273,000,000	263,952,780	
第368回利付国債(10年)	303,000,000	292,070,790	
第369回利付国債(10年)	144,000,000	142,122,240	
第370回利付国債(10年)	240,000,000	236,380,800	
第371回利付国債(10年)	256,000,000	249,226,240	
第372回利付国債(10年)	94,000,000	94,720,980	
第1回利付国債(30年)	5,000,000	5,688,050	
第2回利付国債(30年)	24,000,000	26,939,520	
第3回利付国債(30年)	20,000,000	22,394,600	
第5回利付国債(30年)	40,000,000	44,892,000	
第18回利付国債(30年)	4,000,000	4,611,600	
第21回利付国債(30年)	7,000,000	8,079,260	
第22回利付国債(30年)	8,000,000	9,416,800	
第25回利付国債(30年)	5,000,000	5,772,250	
第26回利付国債(30年)	11,000,000	12,826,330	
第27回利付国債(30年)	8,000,000	9,429,840	
第28回利付国債(30年)	20,000,000	23,557,000	
第29回利付国債(30年)	50,000,000	58,200,500	
第31回利付国債(30年)	44,000,000	49,862,560	
第32回利付国債(30年)	13,000,000	14,883,700	
第33回利付国債(30年)	45,000,000	49,446,450	
第34回利付国債(30年)	53,000,000	59,729,410	
第35回利付国債(30年)	40,000,000	43,736,800	
第36回利付国債(30年)	53,000,000	57,810,280	
第37回利付国債(30年)	64,000,000	68,579,840	
第38回利付国債(30年)	66,000,000	69,461,040	
第39回利付国債(30年)	73,000,000	77,913,630	
第40回利付国債(30年)	69,000,000	72,360,990	
第41回利付国債(30年)	71,000,000	73,063,970	
第42回利付国債(30年)	70,000,000	71,887,200	
第43回利付国債(30年)	71,000,000	72,819,730	
第44回利付国債(30年)	68,000,000	69,649,680	
第45回利付国債(30年)	73,000,000	72,082,390	
第46回利付国債(30年)	72,000,000	70,974,000	

第47回利付国債(30年)	67,000,000	67,106,530	
第48回利付国債(30年)	71,000,000	68,441,160	
第49回利付国債(30年)	71,000,000	68,309,100	
第50回利付国債(30年)	85,000,000	72,169,250	
第51回利付国債(30年)	72,000,000	54,155,520	
第52回利付国債(30年)	86,000,000	67,576,220	
第53回利付国債(30年)	84,000,000	67,326,840	
第54回利付国債(30年)	82,000,000	68,602,020	
第55回利付国債(30年)	83,000,000	69,163,900	
第56回利付国債(30年)	83,000,000	68,945,610	
第57回利付国債(30年)	79,000,000	65,415,950	
第58回利付国債(30年)	76,000,000	62,733,440	
第59回利付国債(30年)	77,000,000	61,854,100	
第60回利付国債(30年)	70,000,000	58,841,300	
第61回利付国債(30年)	70,000,000	55,848,800	
第62回利付国債(30年)	132,000,000	99,621,720	
第63回利付国債(30年)	87,000,000	63,608,310	
第64回利付国債(30年)	85,000,000	61,891,050	
第65回利付国債(30年)	95,000,000	68,890,200	
第66回利付国債(30年)	84,000,000	60,613,560	
第67回利付国債(30年)	82,000,000	62,382,320	
第68回利付国債(30年)	83,000,000	62,909,020	
第69回利付国債(30年)	82,000,000	63,689,400	
第70回利付国債(30年)	84,000,000	65,016,000	
第71回利付国債(30年)	82,000,000	63,244,140	
第72回利付国債(30年)	82,000,000	63,076,860	
第73回利付国債(30年)	84,000,000	64,444,800	
第74回利付国債(30年)	81,000,000	67,322,340	
第75回利付国債(30年)	76,000,000	68,090,680	
第76回利付国債(30年)	77,000,000	70,577,430	
第77回利付国債(30年)	73,000,000	70,090,950	
第78回利付国債(30年)	87,000,000	79,586,730	
第79回利付国債(30年)	73,000,000	63,361,080	
第80回利付国債(30年)	60,000,000	60,174,000	
第75回利付国債(20年)	30,000,000	30,733,500	
第76回利付国債(20年)	10,000,000	10,221,600	
第78回利付国債(20年)	10,000,000	10,266,100	
第79回利付国債(20年)	10,000,000	10,280,100	
第80回利付国債(20年)	20,000,000	20,588,200	
第81回利付国債(20年)	28,000,000	28,918,680	
第82回利付国債(20年)	40,000,000	41,378,400	
第83回利付国債(20年)	15,000,000	15,587,700	
第84回利付国債(20年)	60,000,000	62,236,800	
第85回利付国債(20年)	20,000,000	20,878,400	
第86回利付国債(20年)	20,000,000	20,964,200	

第87回利付国債(20年)	25,000,000	26,151,750	
第88回利付国債(20年)	20,000,000	21,074,800	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	21,027,000	
第90回利付国債(20年)	65,000,000	68,679,000	
第93回利付国債(20年)	8,000,000	8,476,560	
第94回利付国債(20年)	8,000,000	8,501,600	
第95回利付国債(20年)	16,000,000	17,180,000	
第99回利付国債(20年)	20,000,000	21,486,600	
第100回利付国債(20年)	20,000,000	21,635,400	
第105回利付国債(20年)	20,000,000	21,665,600	
第106回利付国債(20年)	20,000,000	21,757,400	
第107回利付国債(20年)	8,000,000	8,690,960	
第108回利付国債(20年)	25,000,000	26,918,000	
第111回利付国債(20年)	11,000,000	12,100,330	
第112回利付国債(20年)	10,000,000	10,947,300	
第113回利付国債(20年)	5,000,000	5,492,300	
第115回利付国債(20年)	10,000,000	11,078,700	
第116回利付国債(20年)	40,000,000	44,451,600	
第117回利付国債(20年)	60,000,000	66,316,200	
第120回利付国債(20年)	25,000,000	26,913,250	
第121回利付国債(20年)	30,000,000	32,914,500	
第122回利付国債(20年)	35,000,000	38,173,450	
第123回利付国債(20年)	58,000,000	64,511,080	
第124回利付国債(20年)	40,000,000	44,222,000	
第125回利付国債(20年)	45,000,000	50,451,300	
第126回利付国債(20年)	31,000,000	34,314,210	
第127回利付国債(20年)	25,000,000	27,499,750	
第128回利付国債(20年)	20,000,000	22,020,800	
第129回利付国債(20年)	28,000,000	30,629,200	
第130回利付国債(20年)	54,000,000	59,128,380	
第131回利付国債(20年)	45,000,000	48,942,000	
第132回利付国債(20年)	52,000,000	56,569,240	
第133回利付国債(20年)	71,000,000	77,776,950	
第134回利付国債(20年)	46,000,000	50,443,140	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	43,552,000	
第136回利付国債(20年)	60,000,000	64,860,600	
第137回利付国債(20年)	58,000,000	63,201,440	
第138回利付国債(20年)	47,000,000	50,441,810	
第139回利付国債(20年)	52,000,000	56,224,480	
第140回利付国債(20年)	78,000,000	85,020,000	
第141回利付国債(20年)	86,000,000	93,793,320	
第142回利付国債(20年)	72,000,000	79,131,600	
第143回利付国債(20年)	124,000,000	134,168,000	
第144回利付国債(20年)	92,000,000	98,750,040	
第145回利付国債(20年)	211,000,000	230,314,940	

第146回利付国債(20年)	131,000,000	142,969,470	
第147回利付国債(20年)	127,000,000	137,389,870	
第148回利付国債(20年)	126,000,000	135,035,460	
第149回利付国債(20年)	125,000,000	133,847,500	
第150回利付国債(20年)	161,000,000	170,645,510	
第151回利付国債(20年)	192,000,000	199,297,920	
第152回利付国債(20年)	166,000,000	172,002,560	
第153回利付国債(20年)	193,000,000	201,708,160	
第154回利付国債(20年)	164,000,000	169,366,080	
第155回利付国債(20年)	166,000,000	167,332,980	
第156回利付国債(20年)	163,000,000	152,739,150	
第157回利付国債(20年)	162,000,000	147,460,500	
第158回利付国債(20年)	155,000,000	145,887,550	
第159回利付国債(20年)	147,000,000	139,563,270	
第160回利付国債(20年)	123,000,000	117,822,930	
第161回利付国債(20年)	143,000,000	134,728,880	
第162回利付国債(20年)	133,000,000	124,811,190	
第163回利付国債(20年)	143,000,000	133,654,950	
第164回利付国債(20年)	144,000,000	132,130,080	
第165回利付国債(20年)	141,000,000	128,803,500	
第166回利付国債(20年)	126,000,000	117,929,700	
第167回利付国債(20年)	135,000,000	122,206,050	
第168回利付国債(20年)	133,000,000	118,001,590	
第169回利付国債(20年)	129,000,000	112,090,680	
第170回利付国債(20年)	131,000,000	113,228,540	
第171回利付国債(20年)	137,000,000	117,784,380	
第172回利付国債(20年)	126,000,000	109,550,700	
第173回利付国債(20年)	135,000,000	116,762,850	
第174回利付国債(20年)	134,000,000	115,361,940	
第175回利付国債(20年)	133,000,000	115,928,120	
第176回利付国債(20年)	142,000,000	123,221,920	
第177回利付国債(20年)	140,000,000	118,752,200	
第178回利付国債(20年)	139,000,000	119,519,150	
第179回利付国債(20年)	136,000,000	116,398,320	
第180回利付国債(20年)	133,000,000	119,634,830	
第181回利付国債(20年)	128,000,000	116,842,240	
第182回利付国債(20年)	134,000,000	126,187,800	
第183回利付国債(20年)	133,000,000	131,427,940	
第184回利付国債(20年)	102,000,000	95,504,640	
第185回利付国債(20年)	107,000,000	99,893,060	
第186回利付国債(20年)	89,000,000	88,797,080	
国債証券 合計	26,014,000,000	25,142,469,150	
地方債証券 第781回東京都公募公債	100,000,000	99,111,000	
第26回神奈川県公募公債(20年)	20,000,000	21,096,400	

	第6回大阪府公募公債(20年)	50,000,000	54,650,500	
	平成28年度第2回京都府公募公債(15年)	50,000,000	48,594,000	
	第2回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	103,806,000	
	第4回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	106,500,000	
	平成31年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	98,227,000	
	平成29年度第7回広島県公募公債	100,000,000	99,446,000	
	平成27年度第3回福岡県公募公債	200,000,000	201,304,000	
	令和4年度第1回長野県公募公債(10年)	100,000,000	96,724,000	
	第24回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	95,925,000	
	令和4年度第2回熊本県公募公債(5年)	140,400,000	139,717,656	
	平成24年度第2回福井県公募公債	100,000,000	107,977,000	
	令和元年度第2回徳島県公募公債	100,000,000	97,897,000	
	令和元年度第3回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	97,363,000	
	地方債証券 合計	1,460,400,000	1,468,338,556	
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	99,270,000	
	第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,076,000	
特殊債券	合計	200,000,000	199,346,000	
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	99,995,000	
	第33回道路債券	100,000,000	118,563,000	
	第23回国際協力銀行債券	100,000,000	103,604,000	
	第101回都市再生債券	100,000,000	102,289,000	
	第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,879,000	22,566,875	
	第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,602,000	25,349,654	
	第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,335,000	24,044,850	
	第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,922,000	25,711,528	
	第16回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	100,363,000	
	第15回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,513,000	
	第21回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,453,000	
	第80回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,086,000	

第118回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,720,000	
第83回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,766,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,439,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,974,000	
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	99,249,000	
社債券 合計	1,394,738,000	1,425,686,907	
合計	29,069,138,000	28,235,840,613	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「東京海上・東証REITマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	[2023年 1月25日現在]	[2024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		238,738,949	261,917,401
投資証券		11,860,332,800	12,878,239,550
未収入金		216,832,007	217,614,681
未収配当金		80,021,894	102,787,667
前払金		11,388,710	
差入委託証拠金		20,001,000	19,016,144
流動資産合計		12,427,315,360	13,479,575,443
資産合計		12,427,315,360	13,479,575,443
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		12,912,680	640,800
前受金			2,118,200
未払解約金		213,960,520	271,860,622
未払利息		115	117
流動負債合計		226,873,315	274,619,739
負債合計		226,873,315	274,619,739
純資産の部			
元本等			
元本	1	8,878,547,954	9,363,911,642
剰余金			
剰余金又は欠損金()		3,321,894,091	3,841,044,062
元本等合計		12,200,442,045	13,204,955,704
純資産合計		12,200,442,045	13,204,955,704
負債純資産合計		12,427,315,360	13,479,575,443

(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 2024年 1月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	自 2023年 1月26日 至 2024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	[2023年 1月25日現在]	[2024年 1月25日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	9,592,289,990円	8,878,547,954円
同期中における追加設定元本額	4,323,943,581円	4,777,616,857円
同期中における一部解約元本額	5,037,685,617円	4,292,253,169円
同期末における元本額	8,878,547,954円	9,363,911,642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 >	45,597,655円	9,663,771円
円資産バランスファンド2019 - 05 < 適格機関投資家限定 >	166,532,045円	65,776,411円
円資産バランスファンド2019 - 09 < 適格機関投資家限定 >	122,946,689円	55,526,729円
円資産バランスファンド2019 - 12 < 適格機関投資家限定 >	168,931,910円	71,129,064円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	9,417,950円	5,720,716円
東京海上・東証REITインデックスファンド < 適格機関投資家限定 >	8,090,839,031円	9,003,106,649円
円資産バランスオープン < 適格機関投資家限定 >	104,165,944円	46,012,164円
円資産インデックスバランス < 円奏会ベシック > (適格機関投資家専用)	170,116,730円	106,976,138円
計	8,878,547,954円	9,363,911,642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	8,878,547,954口	9,363,911,642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 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、先物取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2023年 1月25日現在]	[2024年 1月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左

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

(有価証券に関する注記)

(自 2022年1月26日 至 2023年1月25日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	418,141,376円
合計	418,141,376円

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

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2022年1月26日から2023年1月25日まで)を指しております。

(自 2023年1月26日 至 2024年1月25日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	232,299,817円
合計	232,299,817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(2023年1月26日から2024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

(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	334,944,710		322,051,500	12,893,210
	東証REIT指数先物	334,944,710		322,051,500	12,893,210
	合 計	334,944,710		322,051,500	12,893,210

(2024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	318,815,800		318,175,000	640,800
	東証REIT指数先物	318,815,800		318,175,000	640,800
	合 計	318,815,800		318,175,000	640,800

(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)

[2023年 1月25日現在]		[2024年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額	1.3741円	1口当たり純資産額	1.4102円
(1万口当たり純資産額)	13,741円)	(1万口当たり純資産額)	14,102円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	254	30,810,200	
	サンケイリアルエステート投資法人	401	36,611,300	
	S O S i L A 物流リート投資法人	624	74,443,200	
	東海道リート投資法人	186	23,808,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	432	263,088,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,472	205,344,000	
	産業ファンド投資法人	1,910	265,108,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,228	403,398,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	657	268,056,000	

G L P 投資法人	4,227	564,727,200	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	615	194,647,500	
日本プロロジスリート投資法人	2,180	593,396,000	
星野リゾート・リート投資法人	231	121,506,000	
O n e リート投資法人	218	59,012,600	
イオンリート投資法人	1,535	217,202,500	
ヒューリックリート投資法人	1,171	183,378,600	
日本リート投資法人	406	138,649,000	
積水ハウス・リート投資法人	3,761	293,358,000	
トーセイ・リート投資法人	264	36,960,000	
ヘルスケア & メディカル投資法人	309	42,147,600	
サムティ・レジデンシャル投資法人	341	37,782,800	
野村不動産マスターファンド投資法人	4,047	647,520,000	
いちごホテルリート投資法人	207	24,902,100	
ラサールロジポート投資法人	1,600	238,720,000	
スターアジア不動産投資法人	1,929	115,161,300	
マリモ地方創生リート投資法人	193	23,970,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	521	240,702,000	
大江戸温泉リート投資法人	191	14,153,100	
投資法人みらい	1,717	77,522,550	
三菱地所物流リート投資法人	432	162,432,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	539	82,413,100	
ザイマックス・リート投資法人	203	24,258,500	
タカラレーベン不動産投資法人	593	61,790,600	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	548	69,760,400	
日本ビルファンド投資法人	1,460	862,860,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,286	722,732,000	
日本都市ファンド投資法人	5,999	599,300,100	
オリックス不動産投資法人	2,494	421,486,000	
日本プライムリアルティ投資法人	856	300,884,000	
N T T 都市開発リート投資法人	1,269	160,020,900	
東急リアル・エステート投資法人	839	148,419,100	
グローバル・ワン不動産投資法人	924	101,270,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	2,799	420,129,900	
森トラストリート投資法人	2,412	178,488,000	
インヴィンシブル投資法人	6,059	370,204,900	
フロンティア不動産投資法人	464	203,696,000	
平和不動産リート投資法人	935	128,562,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	802	226,083,800	
福岡リート投資法人	647	111,348,700	
K D X 不動産投資法人	3,602	589,647,400	

いちごオフィスリート投資法人	1,025	84,152,500	
大和証券オフィス投資法人	259	160,062,000	
阪急阪神リート投資法人	597	85,729,200	
スターツプロシード投資法人	217	43,855,700	
大和ハウスリート投資法人	1,886	478,478,200	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,189	315,431,700	
大和証券リビング投資法人	1,843	196,463,800	
ジャパンエクセレント投資法人	1,088	132,192,000	
投資証券 合計	79,093	12,878,239,550	
合計	79,093	12,878,239,550	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	255,028,713 円
負債総額	1,128,108 円
純資産総額（ - ）	253,900,605 円
発行済数量	250,864,476 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.0121 円

（ご参考：親投資信託の現況）

TMA日本株TOPIXマザーファンド

2024年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	61,918,746,551 円
負債総額	61,173,878 円
純資産総額（ - ）	61,857,572,673 円
発行済数量	26,323,561,345 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.3499 円

TMA日本債券インデックスマザーファンド

2024年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	29,344,385,921 円
負債総額	649,791,628 円
純資産総額（ - ）	28,694,594,293 円
発行済数量	23,428,581,326 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.2248 円

東京海上・東証REITマザーファンド

2024年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	13,197,314,689 円
負債総額	2,125,230 円
純資産総額（ - ）	13,195,189,459 円
発行済数量	9,364,033,112 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.4091 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)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。

第二部【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】

2024年1月末日現在、資本金の額は20億円です。なお、会社の発行可能株式総数は160,000株であり、38,300株を発行済みです。

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

投資信託の投資運用の意思決定プロセスは以下の通りです。

運用本部で運用計画案、収益分配方針案等の運用の基本方針案を作成します。

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

決定された運用の基本方針に基づき、具体的運用計画を策定し、運用を行います。

売買の執行はトレーディング部が行います。

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年1月末日現在、委託会社が運用を行っている証券投資信託（親投資信託を除きます。）は次の通りです。

	本数	純資産総額（百万円）
追加型公社債投資信託	0	0
追加型株式投資信託	173	4,015,880
単位型公社債投資信託	2	3,071
単位型株式投資信託	13	53,889
合計	188	4,072,840

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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。
また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人による中間監査を受けております。

なお、従来、当社が監査証明を受けているPwCあらた有限責任監査法人は、2023年12月1日付でPwC京都監査法人と合併、名称を変更しPwC Japan有限責任監査法人となりました。

(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	* 1
建物	459,081	433,750
器具備品	342,403	307,934
無形固定資産	116,678	125,816
電話加入権	228,727	348,422
ソフトウェア	3,795	3,795
ソフトウェア仮勘定	188,720	314,954
投資その他の資産	36,211	29,672
投資有価証券	3,576,825	3,508,324
関係会社株式	42,253	48,291
その他の関係会社有価証券	1,673,049	1,668,529
長期前払費用	521,200	520,000
敷金	40,588	30,700
その他長期差入保証金	474,324	474,324
繰延税金資産	21,230	21,230
投資損失引当金	804,178	954,048
固定資産計	-	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。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

第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)			
	貸借対照表計上額	取得原価	差額		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

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間 (2023年9月30日現在)		
資産の部		
流動資産		
現金・預金		17,035,638
前払費用		389,252
未収委託者報酬		3,391,959
未収収益		4,101,522
未収入金		56,743
その他の流動資産		25,714
流動資産計		25,000,830
固定資産		
有形固定資産	* 1	686,176
建物		459,184
器具備品		226,992
無形固定資産		404,235
電話加入権		3,795
ソフトウェア		379,399
ソフトウェア仮勘定		21,041
投資その他の資産		3,812,118
投資有価証券		46,106
関係会社株式		1,668,529
その他の関係会社有価証券		530,000
長期前払費用		22,304
敷金		474,324
その他長期差入保証金		21,230
繰延税金資産		1,258,424
投資損失引当金		208,800
固定資産計		4,902,530
資産合計		29,903,361
負債の部		
流動負債		
未払金		3,694,268
未払手数料		1,546,039
その他未払金		2,148,229
未払費用		342,443
未払消費税等	* 2	233,391
未払法人税等		1,355,000
預り金		61,660
前受収益		13,302
賞与引当金		569,018
その他の流動負債		35

流動負債計	6,269,121
固定負債	
退職給付引当金	914,386
固定負債計	914,386
負債合計	7,183,508
純資産の部	
株主資本	22,712,318
資本金	2,000,000
資本剰余金	400,000
その他資本剰余金	400,000
利益剰余金	20,312,318
利益準備金	500,000
その他利益剰余金	19,812,318
繰越利益剰余金	19,812,318
評価・換算差額等	7,534
その他有価証券評価差額金	7,534
純資産合計	22,719,853
負債・純資産合計	29,903,361

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	8,494,444
運用受託報酬	6,212,505
投資助言報酬	50,944
その他営業収益	332,443
営業収益計	15,090,338
営業費用	
支払手数料	3,930,561
広告宣伝費	96,009
調査費	4,039,695
調査費	1,610,330
委託調査費	2,429,365
委託計算費	59,548
営業雑経費	133,241
通信費	29,396
印刷費	76,803
協会費	12,345
諸会費	9,611
図書費	5,084
営業費用計	8,259,058
一般管理費	
給料	1,675,634
役員報酬	41,325
給料・手当	1,488,342
賞与	145,966
交際費	10,489
寄付金	7,593
旅費交通費	78,583
租税公課	90,871

不動産賃借料		234,045
退職給付費用		88,001
賞与引当金繰入		569,018
固定資産減価償却費	* 1	107,128
法定福利費		343,406
福利厚生費		10,622
諸経費		403,938
一般管理費計		3,619,333
営業利益		3,211,946
営業外収益		
受取利息		68
受取配当金		955
雑益		7,395
営業外収益計		8,419
営業外費用		
為替差損		58,090
雑損		14,371
営業外費用計		72,462
経常利益		3,147,903
特別利益		
投資有価証券売却益		829
その他特別利益		402
特別利益計		1,232
特別損失		
固定資産除却損		30,348
特別損失計		30,348
税引前中間純利益		3,118,787
法人税、住民税及び事業税		1,273,828
法人税等調整額		305,218
法人税等合計		968,609
中間純利益		2,150,177

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益 剰余金
				繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	22,310,382
当中間期変動額					
剰余金の配当					4,648,241
中間純利益					2,150,177
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)					
当中間期変動額合計	-	-	-	-	2,498,063
当中間期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	19,812,318

	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	22,810,382	25,210,382	5,624	5,624	25,216,006
当中間期変動額					
剰余金の配当	4,648,241	4,648,241			4,648,241
中間純利益	2,150,177	2,150,177			2,150,177
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)			1,910	1,910	1,910
当中間期変動額合計	2,498,063	2,498,063	1,910	1,910	2,496,153
当中間期末残高	20,312,318	22,712,318	7,534	7,534	22,719,853

注記事項

(重要な会計方針)

当中間会計期間 自 2023年4月1日 至 2023年9月30日
<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p> <p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。また、取得価額が10万円以上20万円未満の少額減価償却資産については、一括償却資産として3年間で均等償却する方法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p> <p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 賞与引当金 従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当中間会計期間末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法</p>

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

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

(3) 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。

(中間貸借対照表関係)

	当中間会計期間 (2023年9月30日現在)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	建物	221,024千円
	器具備品	422,332千円

(中間損益計算書関係)

	当中間会計期間 自 2023年4月1日 至 2023年9月30日	
1 減価償却実施額	有形固定資産	56,407千円
	無形固定資産	50,721千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 自 2023年4月1日 至 2023年9月30日				
1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項				
株式の種類	当事業年度期首 (株)	当中間会計期間 増加 (株)	当中間会計期間 減少 (株)	当中間会計期間末 (株)
普通株式	38,300	-	-	38,300
2. 配当に関する事項				

配当金支払額

2023年6月29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・・・・・・・・・・4,648,241千円
- (ロ) 1株当たり配当額・・・・・・・・・・121,364円
- (ハ) 基準日・・・・・・・・・・2023年3月31日
- (ニ) 効力発生日・・・・・・・・・・2023年6月29日

(金融商品関係)

当中間会計期間（2023年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

2023年9月30日現在における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
投資有価証券			
その他有価証券	46,106	46,106	-
敷金	474,324	473,425	899
資産計	520,430	519,531	899

(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。これらの中間貸借対照表計上額は、それぞれ以下のとおりです。

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額
関係会社株式	
子会社株式	1,640,302
関連会社株式	28,227
その他の関係会社有価証券	530,000

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

(1)時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
投資有価証券				
その他有価証券	-	46,106	-	46,106
資産計	-	46,106	-	46,106

(2)時価で中間貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

(単位：千円)

	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
敷金	-	473,425	-	473,425
資産計	-	473,425	-	473,425

(注)時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

投資有価証券

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

敷金

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

(有価証券関係)

当中間会計期間(2023年9月30日現在)

その他有価証券

(単位：千円)

	種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	証券投資信託	34,038	21,163	12,875
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	証券投資信託	12,067	14,082	2,015
合計		46,106	35,245	10,860

(収益認識関係)

当中間会計期間(自2023年4月1日至2023年9月30日)

1.顧客との契約から生じる収益を分解した情報

(単位：千円)

	運用報酬	成功報酬	合計
委託者報酬	8,494,444	-	8,494,444
運用受託報酬	6,151,982	60,523	6,212,505
投資助言報酬	50,944	-	50,944
その他営業収益	332,443	-	332,443
合計	15,029,814	60,523	15,090,338

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

顧客との契約から生じた債権等

顧客との契約から生じた債権(期首残高) 6,222,195千円

顧客との契約から生じた債権(期末残高) 7,493,481千円

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自2023年4月1日至2023年9月30日)

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

[関連情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

(単位:千円)

日本	その他	合計
13,272,571	1,817,766	15,090,338

(注)営業収益は顧客の所在地を基準とし、国ごとに分類しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の名称	委託者報酬	関連するセグメント名
東京海上・円資産バランスファンド (毎月決算型)	1,662,509千円	投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメント

(1 株当たり情報)

当中間会計期間 自 2023年4月1日 至 2023年9月30日	
1株当たり純資産額	593,207円66銭
1株当たり中間純利益金額	56,140円40銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	22,719,853千円
純資産の部の合計額から控除する金額	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額	22,719,853千円
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数	38,300株
1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益金額	2,150,177千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	2,150,177千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常の利用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	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
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	
株式会社愛媛銀行	21,367百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

() 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【参考情報】

当計算期間において、当ファンドに係る以下の書類を関東財務局長宛に提出しております。

書類名	提出年月日
有価証券届出書	2023年4月25日
	2023年10月25日
有価証券報告書	2023年4月25日
半期報告書	2023年10月25日

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

2024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 Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 久保 直毅

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上・円資産インデックスバランスファンドの2023年1月26日から2024年1月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上・円資産インデックスバランスファンドの2024年1月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月5日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

PwC Japan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
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 石井章悟
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記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。