

【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9期（自 2023年1月26日 至 2024年1月25日）
【ファンド名】	東京海上・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型）
【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日本債券マザーファンド受益証券」、「東京海上・JPX日経400インデックスマザーファンド受益証券」、「TMA日本株アクティブマザーファンド受益証券」、「TMA外国債券インデックスマザーファンド受益証券」、「TMA外国債券マザーファンド受益証券」、「TMA外国株式インデックスマザーファンド受益証券」、「TMA外国株式マザーファンド受益証券」（それぞれをまたは総称して、以下「マザーファンド」ということがあります。）を主要投資対象として運用を行います。

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

基本的性格

当ファンドは、追加型投信 / 内外 / 資産複合に属します。

当ファンドの商品分類表および属性区分表は、以下の通りです。

商品分類表

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

属性区分表

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

(注) 当ファンドは、組入比率を変更することがありますが、機動的に変更を行うものではないため、「資産配分固定型」としていません。

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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

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

商品分類の定義

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

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

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

属性区分の定義

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

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

為替 ヘッジ	あり	目論見書または投資信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象イン デックス	日経225	目論見書または投資信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	TOPIX	目論見書または投資信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記指数にあてはまらない全てのものをいいます。
特殊型	プル・ペア型	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

公的年金の基本ポートフォリオ*を参照し、国内外の複数の資産に分散投資することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

*公的年金のうち「国民年金」と「厚生年金保険」の積立金を管理・運用する年金積立金管理運用独立行政法人（以下、GPIF）の基本ポートフォリオです。

ファンドは、東京海上アセットマネジメントが公的年金の基本ポートフォリオを参照して、独自に基本資産配分比率を決定するものであり、公的年金やGPIFと何ら関係を有するものではありません。

ファンドの運用は、GPIFの投資成果に連動することをめざすものではありません。また、生命保険会社等が提供する年金商品とは異なります。

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

次ページへ続く

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

● 各マザーファンドへの投資割合は、以下の基本投資比率とします。

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

上記は、2024年1月末現在のもので、公的年金の基本ポートフォリオが変更された場合には、委託会社の判断により「基本資産配分比率」、「基本投資比率」および「投資対象資産」を変更することがあります。

<各マザーファンドが対象とする指数について>

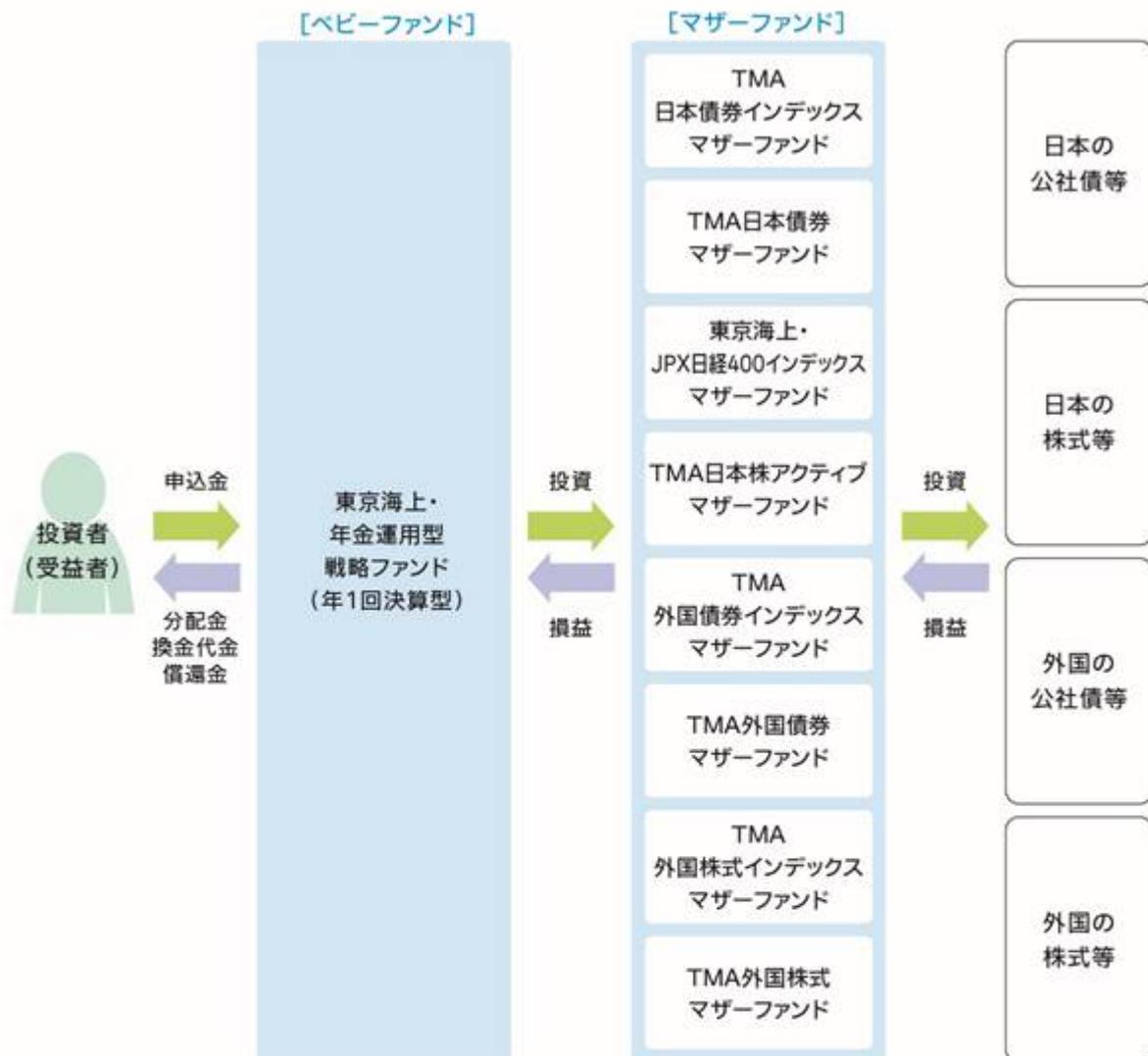
- NOMURA-BPI(総合)とは、野村フィデューシャリー・リサーチ & コンサルティング株式会社(以下、NFRCといいます。)が公表する日本の公債券流通市場全体の動向を的確に表す代表的な指標です。NOMURA-BPIは、NFRCの知的財産です。NFRCは、ファンドの運用成績等に関し、一切責任ありません。
- JPX日経インデックス400は、東京証券取引所のプライム市場、スタンダード市場、グロース市場を主市場とする普通株式等のうち、時価総額、売買代金、ROE等を基に、株式会社JPX総研(以下「JPX総研」といいます。)および株式会社日本経済新聞社(以下、日経といいます。)が選定した、原則400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

次ページへ続く

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

ファンドの仕組み

- ファミリーファンド方式により運用を行います。



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

次ページへ続く

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

主な投資制限

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

分配方針

◎年1回決算を行います。

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

《イメージ図》

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

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

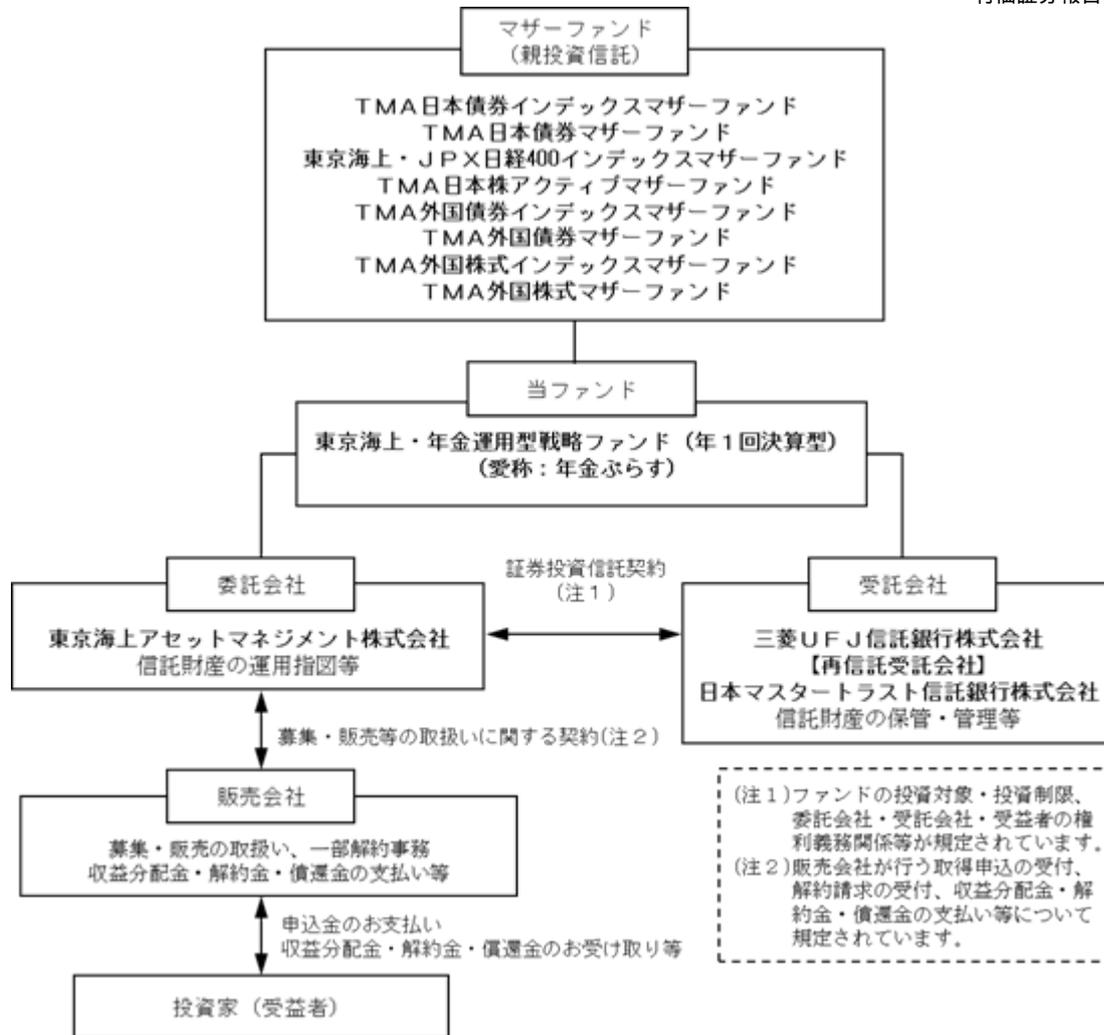
資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

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

2016年10月 東京海上不動産投資顧問株式会社と合併

- ・大株主の状況 (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。)受益証券に投資します。なお、有価証券等の資産に直接投資することがあります。

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

(2) 投資態度

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の複数の資産(日本債券、日本株式、外国債券、外国株式)に分散投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

公的年金の基本ポートフォリオを参照し、各投資対象資産の配分比率(「基本資産配分比率」)を決定します。

各投資対象資産内におけるマザーファンド受益証券の投資比率(「基本投資比率」)は、各投資対象資産の「基本資産配分比率」のそれぞれ50%とします。

資産配分は、「基本資産配分比率」を基準に、原則として各投資対象資産毎に一定の範囲内(±5%)に収まるように調整します。

実質組入外貨建資産は、原則として為替ヘッジを行いません。

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

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出来ない場合があります。

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

TMA日本債券インデックスマザーファンド**1. 基本方針**

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

2. 運用方法**(1) 投資対象**

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

3. 運用制限

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

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

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

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

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

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

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

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

TMA日本債券マザーファンド**1. 基本方針**

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

2. 運用方法**(1) 投資対象**

日本の債券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

イールド選択（金利選択）

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

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

スプレッド選択

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

銘柄選択

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

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

3. 運用制限

- (1) 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。（ただし、転換社債の転換、新株引受権の行使および新株予約権の行使により取得する場合には限りません。）
- (2) 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- (3) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- (4) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (5) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (6) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (7) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (8) デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

東京海上・J P X日経400インデックスマザーファンド**1．基本方針**

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

(2) 投資態度

J P X日経インデックス400（J P X日経400）に採用されている銘柄を主要投資対象とし、当該指数に連動する投資成果の達成を目標とします。

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

原則として、株式への組入比率を高位に維持します。

3．運用制限

(1) 株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

TMA日本株アクティブマザーファンド**1. 基本方針**

信託財産の中長期的な成長を目標とし、日本法人の株式に投資します。

TOPIX（配当込み）をベンチマークとし、これを上回る投資成果を目標とします。

2. 運用方法**(1) 投資対象**

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

(2) 投資態度

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

セクター判断は、以下要領で行います。

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

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

- ・業種共通のマクロ指標と各業種ごとのセミマクロ指標によるファンダメンタルズ分析
- ・業種別PER、PBR等によるバリュエーション分析
- ・計量的アプローチを用いたテクニカル分析

構造的（長期的）要因と循環的（短期的）要因を考慮します。

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

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

- ・成長性 ROE、経常増益率、利益予想変化 など
 - ・割安度 株価純資産倍率、株価収益率、キャッシュフロー倍率 など
- アナリスト、ファンド・マネージャーによる企業訪問など調査・分析

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

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

3. 運用制限

(1) 株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

(5) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

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

TMA外国債券インデックスマザーファンド**1. 基本方針**

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

信託財産の効率的な運用に資するため、債券先物取引や外国為替予約取引等を利用することがあります。

このため、組入有価証券の時価総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産および外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

3. 運用制限

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

(2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

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

TMA外国債券マザーファンド**1. 基本方針**

信託財産の中長期的な成長を目標とし、主に外国の国債に投資します。

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

2. 運用方法**(1) 投資対象**

外国の国債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

国別配分

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

デュレーション調整

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

銘柄選択

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

3. 運用制限

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

(2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

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

TMA外国株式インデックスマザーファンド**1. 基本方針**

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

2. 運用方法**(1) 投資対象**

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

3. 運用制限

(1) 株式への投資割合には、制限を設けません。

(2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

TMA外国株式マザーファンド**1. 基本方針**

信託財産の中長期的な成長を目標とし、外国の株式に投資します。

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

2. 運用方法**(1) 投資対象**

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

調査対象銘柄の選定

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

個別銘柄の調査・分析

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

ポートフォリオの構築

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

3. 運用制限

(1) 株式への投資割合には、制限を設けません。

(2) 外貨建資産への投資割合は、制限を設けません。

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

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

(5) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

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

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

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

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

「東京海上・J P X日経400インデックスマザーファンド」の運用にあたっては、完全法を用いてJ P X日経400（配当込み）に連動するようポートフォリオを構築します。

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

「TMA外国株式インデックスマザーファンド」の運用にあたっては、リスクモデルを使用し、最適化法を用いてM S C I コクサイ指数（配当込み、円ヘッジなし・円ベース）に連動する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日本債券マザーファンド」、「東京海上・JPX日経400インデックスマザーファンド」、「TMA日本株アクティブマザーファンド」、「TMA外国債券インデックスマザーファンド」、「TMA外国債券マザーファンド」、「TMA外国株式インデックスマザーファンド」、「TMA外国株式マザーファンド」の受益証券および次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

- (1) 株券または新株引受権証券
- (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。)
- (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券
- (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。)
- (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。

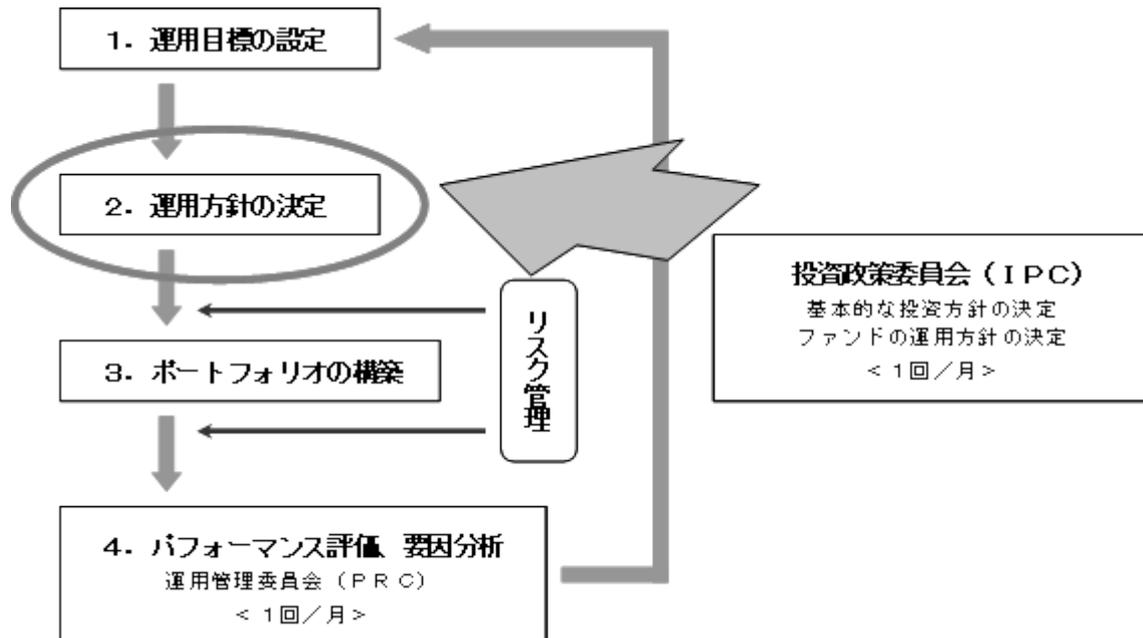
3. 委託会社は、信託金を、上記2.に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

- (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等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
- b. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費（ ）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

（ ）諸経費とは、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（消費税等相当額を含みます。）、信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）ならびに受託会社の立替えた立替金の利息をいいます。

計算期末において信託財産に損失が生じた場合は、次期に繰越します。

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

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

(5)【投資制限】

運用の基本方針に基づく制限(約款別紙「運用の基本方針」)

- a. 株式への実質投資割合には制限を設けません。
 - b. 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
 - c. 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。(以下同じ)
 - d. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券(マザーファンド受益証券ならびに取引所に上場し、かつ当該取引所において常時売却可能な投資信託証券、また既に組入れてい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. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
 - i. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
- 投資する株式等の範囲(約款第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、日本国内の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うこと

の指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

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

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25条)

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

有価証券の貸付(約款第26条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - ・株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ・公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. 上記a.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、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27条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または下記「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28条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入の指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入を行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、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29条）
外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
外国為替予約取引（約款第30条）
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. 上記a. の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により上記b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内にその超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- 信用リスク集中回避のための投資制限（約款第31条）
一般社団法人投資信託協会規則に定める一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37条）
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

3【投資リスク】

1. 投資リスク

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

(1) 価格変動リスク

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

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

投資信託は預貯金や保険と異なります。

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

株価変動リスク

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

金利変動リスク

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

信用リスク

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

為替変動リスク

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

カントリーリスク

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

流動性リスク

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

(2) デリバティブ取引のリスク

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

2. その他の留意事項

(1) 一般的な留意事項

投資信託は、その商品性格から次の特徴をご理解のうえご購入ください。

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

(2) 法令・税制・会計等の変更可能性

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

(3) その他の留意点

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

一部解約金、収益分配金および償還金の支払は全て販売会社を通じて行われます。

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

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

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

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

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

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

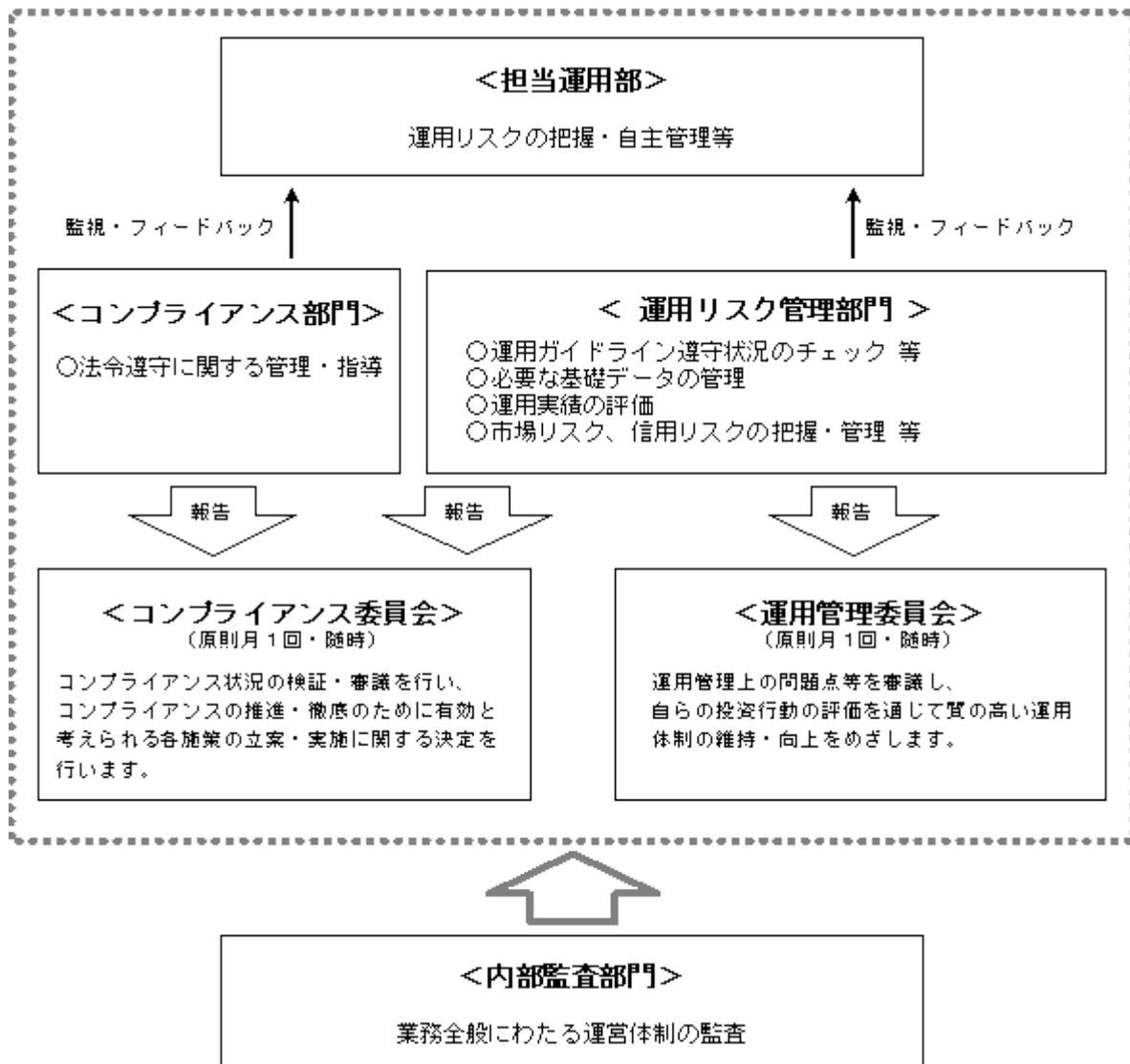
3. 管理体制

<リスク管理体制>

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

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

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



<流動性リスク管理>

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

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

参考情報

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。

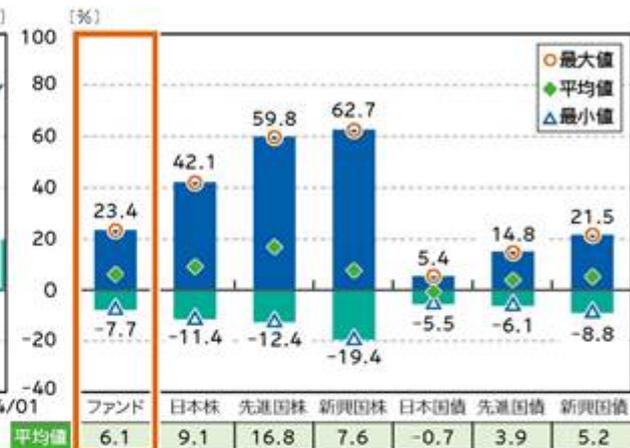


※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものと計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。

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

ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較

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



※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

代表的な資産クラスと指数名

日本株 TOPIX (東証株価指数) (配当込み)

先進国株 MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ベース)

新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

日本国債 NOMURA-BPI (国債)

先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

新興国債 JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)

指数について

●TOPIXの指数値およびTOPIXにかかる標準または商標は、株式会社J.P.X.編研または株式会社J.P.X.編研の関連会社(以下、J.P.X.といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXにかかる標準または商標に関するすべての権利はJ.P.X.が有します。J.P.X.は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J.P.X.により提供、保証または販売されるものではなく、ファンドの設立、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リー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。●FTSE世界国債インデックスは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、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・ディバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

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

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

(2)【換金（解約）手数料】

換金時（解約時）の手数料はありません。

(3)【信託報酬等】

委託会社、販売会社および受託会社の信託報酬の総額は信託財産の純資産総額に対し、年率1.3695%（税抜1.245%）を乗じて得た金額とし、計算期間を通じて、毎日計上します。

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0.6%	年率0.6%	年率0.045%

*1 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価

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

*3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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)」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超過額に対する所得税および地方税はかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

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

* 上記は、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
1.39%	1.37%	0.02%

(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	6,571,647,577	99.99
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		91,983	0.00
合計（純資産総額）		6,571,739,560	100.00

（ご参考：親投資信託の投資状況）

当ファンドが主要投資対象とする親投資信託の投資状況は以下の通りです。

TMA日本債券インデックスマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	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

TMA日本債券マザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	46,531,465,650	57.65
社債券	日本	33,105,852,976	41.02
	フランス	390,708,000	0.48
	イギリス	293,670,000	0.36
	小計	33,790,230,976	41.86
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		384,500,614	0.47
合計（純資産総額）		80,706,197,240	100.00

東京海上・JPX日経400インデックスマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	6,627,420,440	93.38
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		469,568,577	6.61
合計（純資産総額）		7,096,989,017	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	434,095,000	6.11

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

TMA日本株アクティブマザーファンド

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

株式	日本	101,407,476,490	98.74
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		1,285,816,302	1.25
合計（純資産総額）		102,693,292,792	100.00

T M A 外国債券インデックスマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	9,086,591,778	46.65
	カナダ	389,530,207	1.99
	ドイツ	1,220,945,589	6.26
	イタリア	1,391,812,586	7.14
	フランス	1,568,946,407	8.05
	オーストラリア	261,537,998	1.34
	イギリス	1,012,660,458	5.19
	シンガポール	87,295,402	0.44
	マレーシア	95,833,458	0.49
	ニュージーランド	47,754,287	0.24
	オランダ	277,888,846	1.42
	スペイン	911,860,994	4.68
	ベルギー	325,327,789	1.67
	スウェーデン	36,849,453	0.18
	ノルウェー	31,476,064	0.16
	オーストリア	223,346,114	1.14
	フィンランド	103,482,193	0.53
	デンマーク	54,987,601	0.28
	メキシコ	162,169,532	0.83
	アイルランド	113,884,242	0.58
イスラエル	59,439,035	0.30	
ポーランド	99,008,661	0.50	
中華人民共和国	1,603,698,586	8.23	
	小計	19,166,327,280	98.40
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		311,193,485	1.59
合計（純資産総額）		19,477,520,765	100.00

T M A 外国債券マザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	14,459,000,281	44.72
	カナダ	826,711,419	2.55
	ドイツ	1,646,460,190	5.09
	イタリア	3,081,583,694	9.53
	フランス	2,825,714,879	8.73
	オーストラリア	880,805,107	2.72
	イギリス	2,519,298,138	7.79
	オランダ	316,164,708	0.97
	スペイン	1,565,555,203	4.84
	ベルギー	486,056,047	1.50

	オーストリア	331,443,442	1.02
	メキシコ	902,087,115	2.79
	中華人民共和国	2,050,804,455	6.34
	小計	31,891,684,678	98.64
	コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)	439,405,069	1.35
	合計(純資産総額)	32,331,089,747	100.00

T M A 外国株式インデックスマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	141,340,678,110	71.05
	カナダ	6,713,500,590	3.37
	ドイツ	4,705,022,228	2.36
	イタリア	1,022,398,201	0.51
	フランス	6,114,845,117	3.07
	オーストラリア	3,827,511,162	1.92
	イギリス	7,602,196,198	3.82
	スイス	6,173,348,363	3.10
	バミューダ	282,617,287	0.14
	香港	878,349,095	0.44
	シンガポール	614,341,606	0.30
	ニュージーランド	168,562,246	0.08
	オランダ	3,736,567,678	1.87
	スペイン	1,409,202,419	0.70
	ベルギー	386,221,043	0.19
	スウェーデン	1,667,898,587	0.83
	ノルウェー	424,700,458	0.21
	オーストリア	115,405,712	0.05
	ルクセンブルク	73,778,895	0.03
	フィンランド	618,497,000	0.31
	デンマーク	1,959,801,119	0.98
	アイルランド	3,557,164,207	1.78
	イスラエル	302,556,100	0.15
	ポルトガル	142,749,621	0.07
	ケイマン	118,793,714	0.05
	キュラソー	252,947,960	0.12
	ジャージー	517,710,317	0.26
小計	194,727,365,033	97.89	
投資証券	アメリカ	3,255,712,523	1.63
	カナダ	29,904,834	0.01
	フランス	119,195,985	0.05
	オーストラリア	244,227,596	0.12
	イギリス	103,230,794	0.05
	香港	49,961,721	0.02
	シンガポール	86,838,968	0.04
	小計	3,889,072,421	1.95

コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)	297,697,383	0.14
合計(純資産総額)	198,914,134,837	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	地域	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,081,982,142	1.04
	買建	ドイツ	381,979,565	0.19
	買建	イギリス	186,470,155	0.09

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

TMA外国株式マザーファンド

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	59,153,149,384	76.77
	カナダ	1,551,322,004	2.01
	ドイツ	246,927,132	0.32
	イタリア	160,716,995	0.20
	フランス	4,018,206,041	5.21
	オーストラリア	1,014,352,378	1.31
	イギリス	1,954,959,022	2.53
	スイス	1,535,156,973	1.99
	オランダ	1,521,919,863	1.97
	スペイン	124,240,700	0.16
	スウェーデン	540,247,758	0.70
	ノルウェー	221,481,183	0.28
	デンマーク	2,035,947,969	2.64
	アイルランド	654,139,317	0.84
	キュラソー	72,815,925	0.09
小計	74,805,582,644	97.08	
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		2,243,140,189	2.91
合計(純資産総額)		77,048,722,833	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a. 主要銘柄の明細

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外国株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	133,176,790	6.3112	840,512,647	6.4178	854,702,002	13.00
2	東京海上・JPX日経400インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	305,576,478	2.7603	843,499,297	2.7807	849,716,512	12.92
3	TMA日本株アクティブマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	302,383,834	2.7811	840,980,923	2.7897	843,560,181	12.83
4	TMA外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	149,152,629	5.5659	830,178,567	5.6238	838,804,554	12.76

5	TMA外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	415,624,780	1.9335	803,624,423	1.9389	805,854,885	12.26
6	TMA外国債券マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	285,237,203	2.8093	801,336,785	2.8188	804,026,627	12.23
7	TMA日本債券マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	588,631,412	1.3360	786,432,767	1.3380	787,588,829	11.98
8	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	642,875,561	1.2229	786,195,679	1.2248	787,393,987	11.98

b. 投資有価証券の種類

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

【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

TMA日本債券マザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	額面	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
							単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	第164回利付 国債(5年)	日本	国債証券	0.200	2028/12/20	3,206,000,000	99.80	3,199,797,960	99.49	3,189,777,640	3.95
2	第365回利付 国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2031/12/20	3,103,000,000	95.92	2,976,706,900	96.67	2,999,763,190	3.71
3	第453回利付 国債(2年)	日本	国債証券	0.005	2025/10/01	2,367,000,000	100.00	2,367,130,160	99.95	2,365,816,500	2.93
4	第167回利付 国債(20年)	日本	国債証券	0.500	2038/12/20	1,922,000,000	90.97	1,748,529,050	90.81	1,745,483,520	2.16
5	第185回利付 国債(20年)	日本	国債証券	1.100	2043/06/20	1,828,000,000	93.15	1,702,854,920	93.64	1,711,775,760	2.12

6	第362回利付 国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2031/03/20	1,613,000,000	98.02	1,581,154,900	97.58	1,573,997,660	1.95
7	第80回利付国 債(30年)	日本	国債証券	1.800	2053/09/20	1,566,000,000	105.02	1,644,764,140	100.48	1,573,595,100	1.94
8	第454回利付 国債(2年)	日本	国債証券	0.100	2025/11/01	1,532,000,000	100.19	1,534,967,350	100.11	1,533,731,160	1.90
9	第455回利付 国債(2年)	日本	国債証券	0.005	2025/12/01	1,485,000,000	99.94	1,484,126,610	99.90	1,483,633,800	1.83
10	第360回利付 国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2030/09/20	1,472,000,000	97.95	1,441,824,000	98.09	1,443,928,960	1.78
11	第155回利付 国債(20年)	日本	国債証券	1.000	2035/12/20	1,222,000,000	105.04	1,283,637,100	101.07	1,235,112,060	1.53
12	第170回利付 国債(20年)	日本	国債証券	0.300	2039/09/20	1,337,000,000	91.38	1,221,750,600	86.72	1,159,513,250	1.43
13	第176回利付 国債(20年)	日本	国債証券	0.500	2041/03/20	958,000,000	92.51	886,245,800	86.96	833,124,700	1.03
14	第150回利付 国債(20年)	日本	国債証券	1.400	2034/09/20	763,000,000	109.50	835,517,200	106.13	809,840,570	1.00
15	第153回利付 国債(20年)	日本	国債証券	1.300	2035/06/20	770,000,000	108.85	838,145,000	104.72	806,367,100	0.99
16	第181回利付 国債(20年)	日本	国債証券	0.900	2042/06/20	830,000,000	98.22	815,226,000	91.61	760,437,700	0.94
17	第186回利付 国債(20年)	日本	国債証券	1.500	2043/09/20	750,000,000	102.74	770,565,080	100.07	750,562,500	0.92
18	第14回利付国 債(40年)	日本	国債証券	0.700	2061/03/20	1,081,000,000	81.03	875,934,300	69.20	748,095,240	0.92
19	第151回利付 国債(20年)	日本	国債証券	1.200	2034/12/20	712,000,000	107.82	767,728,240	103.95	740,138,240	0.91
20	第370回利付 国債(10年)	日本	国債証券	0.500	2033/03/20	749,000,000	98.31	736,367,570	98.66	738,993,360	0.91
21	第152回利付 国債(20年)	日本	国債証券	1.200	2035/03/20	683,000,000	107.73	735,850,540	103.82	709,104,260	0.87
22	第165回利付 国債(20年)	日本	国債証券	0.500	2038/06/20	738,000,000	93.92	693,158,580	91.69	676,716,480	0.83
23	第149回利付 国債(20年)	日本	国債証券	1.500	2034/06/20	620,000,000	111.24	689,688,000	107.22	664,782,600	0.82
24	第81回利付国 債(30年)	日本	国債証券	1.600	2053/12/20	694,000,000	95.64	663,791,970	95.64	663,804,060	0.82
25	第162回利付 国債(20年)	日本	国債証券	0.600	2037/09/20	690,000,000	98.36	678,684,000	94.12	649,483,200	0.80
26	第368回利付 国債(10年)	日本	国債証券	0.200	2032/09/20	670,000,000	96.72	648,053,500	96.59	647,199,900	0.80
27	第159回利付 国債(20年)	日本	国債証券	0.600	2036/12/20	666,000,000	94.41	628,799,220	95.21	634,145,220	0.78
28	第48回利付国 債(30年)	日本	国債証券	1.400	2045/09/20	644,000,000	105.88	681,912,280	96.70	622,799,520	0.77
29	第70回利付国 債(30年)	日本	国債証券	0.700	2051/03/20	790,000,000	86.61	684,282,200	77.40	611,531,100	0.75
30	第169回利付 国債(20年)	日本	国債証券	0.300	2039/06/20	696,000,000	91.75	638,580,000	87.18	606,786,720	0.75

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	東京エレクトロン	日本	電気機器	株式	4,400	20,828.91	91,647,215	27,865.00	122,606,000	1.72
2	信越化学工業	日本	化学	株式	20,600	4,599.31	94,745,795	5,875.00	121,025,000	1.70
3	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	株式	39,300	2,519.01	98,997,150	3,000.00	117,900,000	1.66
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	83,900	1,170.17	98,177,730	1,395.00	117,040,500	1.64
5	伊藤忠商事	日本	卸売業	株式	17,300	5,591.72	96,736,846	6,752.00	116,809,600	1.64
6	日立製作所	日本	電気機器	株式	10,000	9,405.21	94,052,138	11,675.00	116,750,000	1.64
7	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	19,500	4,923.61	96,010,441	5,927.00	115,576,500	1.62
8	任天堂	日本	その他製品	株式	13,800	6,281.07	86,678,785	8,310.00	114,678,000	1.61
9	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	14,200	6,753.70	95,902,680	7,700.00	109,340,000	1.54
10	三菱商事	日本	卸売業	株式	42,600	2,366.27	100,803,424	2,565.00	109,269,000	1.53
11	三井物産	日本	卸売業	株式	17,600	5,518.85	97,131,814	6,031.00	106,145,600	1.49
12	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	62,200	1,531.40	95,253,379	1,675.50	104,216,100	1.46
13	ソニーグループ	日本	電気機器	株式	6,900	12,709.16	87,693,240	14,695.00	101,395,500	1.42
14	東京海上ホールディングス	日本	保険業	株式	25,200	3,243.49	81,736,087	3,930.00	99,036,000	1.39
15	KDDI	日本	情報・通信業	株式	19,800	4,289.28	84,927,889	4,897.00	96,960,600	1.36
16	HOYA	日本	精密機器	株式	4,900	16,340.83	80,070,079	18,945.00	92,830,500	1.30
17	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	487,800	165.63	80,799,032	186.30	90,877,140	1.28
18	みずほフィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	33,600	2,423.15	81,418,081	2,702.00	90,787,200	1.27
19	第一三共	日本	医薬品	株式	20,000	4,229.86	84,597,222	4,423.00	88,460,000	1.24
20	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	20,100	4,454.11	89,527,651	4,362.00	87,676,200	1.23
21	キーエンス	日本	電気機器	株式	1,300	59,885.70	77,851,412	66,580.00	86,554,000	1.21
22	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	12,700	6,702.60	85,123,119	6,460.00	82,042,000	1.15
23	ソフトバンク	日本	情報・通信業	株式	40,800	1,632.94	66,624,250	1,963.50	80,110,800	1.12
24	ダイキン工業	日本	機械	株式	3,100	26,364.60	81,730,260	23,885.00	74,043,500	1.04
25	村田製作所	日本	電気機器	株式	23,400	2,720.30	63,655,022	3,015.00	70,551,000	0.99
26	SMC	日本	機械	株式	800	69,369.07	55,495,256	82,910.00	66,328,000	0.93
27	三菱電機	日本	電気機器	株式	28,700	1,870.73	53,689,977	2,203.00	63,226,100	0.89
28	日本たばこ産業	日本	食料品	株式	15,400	3,197.06	49,234,749	3,895.00	59,983,000	0.84
29	丸紅	日本	卸売業	株式	22,400	2,399.82	53,756,158	2,541.50	56,929,600	0.80
30	住友商事	日本	卸売業	株式	16,100	2,975.42	47,904,388	3,415.00	54,981,500	0.77

TMA日本株アクティブマザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	株式	1,754,800	1,851.21	3,248,503,308	3,000.00	5,264,400,000	5.12
2	ソニーグループ	日本	電気機器	株式	323,200	11,588.50	3,745,403,200	14,695.00	4,749,424,000	4.62
3	信越化学工業	日本	化学	株式	703,900	3,996.31	2,813,002,609	5,875.00	4,135,412,500	4.02
4	第一三共	日本	医薬品	株式	804,600	4,449.59	3,580,140,729	4,423.00	3,558,745,800	3.46

5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	2,475,200	878.73	2,175,032,496	1,395.00	3,452,904,000	3.36
6	ルネサスエレクトロニクス	日本	電気機器	株式	1,325,600	1,813.05	2,403,379,080	2,472.00	3,276,883,200	3.19
7	日立製作所	日本	電気機器	株式	261,500	6,855.48	1,792,708,020	11,675.00	3,053,012,500	2.97
8	東京エレクトロン	日本	電気機器	株式	99,600	15,910.64	1,584,699,744	27,865.00	2,775,354,000	2.70
9	ディスコ	日本	機械	株式	65,900	15,137.60	997,567,840	40,380.00	2,661,042,000	2.59
10	キーエンス	日本	電気機器	株式	35,800	60,212.07	2,155,592,106	66,580.00	2,383,564,000	2.32
11	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	286,900	6,003.73	1,722,470,137	7,700.00	2,209,130,000	2.15
12	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	320,400	5,309.82	1,701,266,355	6,460.00	2,069,784,000	2.01
13	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	10,583,800	160.01	1,693,513,838	186.30	1,971,761,940	1.92
14	村田製作所	日本	電気機器	株式	649,700	2,631.35	1,709,594,393	3,015.00	1,958,845,500	1.90
15	中外製薬	日本	医薬品	株式	361,200	3,763.33	1,359,314,796	5,347.00	1,931,336,400	1.88
16	バンダイナムコホールディングス	日本	その他製品	株式	523,800	2,739.42	1,434,908,196	3,215.00	1,684,017,000	1.63
17	アドバンテスト	日本	電気機器	株式	258,100	4,976.33	1,284,390,773	5,823.00	1,502,916,300	1.46
18	イビデン	日本	電気機器	株式	193,600	7,815.45	1,513,071,282	7,544.00	1,460,518,400	1.42
19	野村総合研究所	日本	情報・通信業	株式	321,600	3,164.47	1,017,693,552	4,533.00	1,457,812,800	1.41
20	任天堂	日本	その他製品	株式	172,900	5,519.49	954,319,821	8,310.00	1,436,799,000	1.39
21	東日本旅客鉄道	日本	陸運業	株式	148,300	7,481.09	1,109,445,647	8,441.00	1,251,800,300	1.21
22	スズキ	日本	輸送用機器	株式	184,700	4,492.57	829,777,679	6,688.00	1,235,273,600	1.20
23	S M C	日本	機械	株式	14,700	67,992.46	999,489,162	82,910.00	1,218,777,000	1.18
24	GMOペイメントゲートウェイ	日本	情報・通信業	株式	133,500	10,021.95	1,337,930,325	9,007.00	1,202,434,500	1.17
25	味の素	日本	食料品	株式	188,100	4,768.36	896,928,516	6,087.00	1,144,964,700	1.11
26	エービーシー・マート	日本	小売業	株式	444,400	2,399.68	1,066,417,792	2,567.50	1,140,997,000	1.11
27	富士電機	日本	電気機器	株式	151,600	5,080.93	770,268,988	7,459.00	1,130,784,400	1.10
28	大和ハウス工業	日本	建設業	株式	237,000	3,225.85	764,526,450	4,584.00	1,086,408,000	1.05
29	T D K	日本	電気機器	株式	140,000	5,142.51	719,951,787	7,442.00	1,041,880,000	1.01
30	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	175,400	5,089.16	892,638,664	5,927.00	1,039,595,800	1.01

T M A 外国債券インデックスマザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	額面	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
							単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	T 3 7/8 12/31/27	アメリカ	国債証券	3.875	2027/12/31	1,100,000	14,364.58	158,010,486	14,662.78	161,290,593	0.82
2	T 4 7/8 10/31/28	アメリカ	国債証券	4.875	2028/10/31	1,000,000	14,945.83	149,458,351	15,296.20	152,962,083	0.78
3	T 5 10/31/25	アメリカ	国債証券	5.000	2025/10/31	1,000,000	14,828.89	148,288,903	14,890.44	148,904,458	0.76

4	T 4 7/8 11/30/25	アメリカ	国債証券	4.875	2025/11/30	1,000,000	14,913.86	149,138,675	14,873.73	148,737,314	0.76
5	T 4 1/8 11/15/32	アメリカ	国債証券	4.125	2032/11/15	900,000	14,250.16	128,251,497	14,840.30	133,562,720	0.68
6	T 4 3/4 07/31/25	アメリカ	国債証券	4.750	2025/07/31	900,000	14,662.78	131,965,031	14,803.41	133,230,729	0.68
7	T 4 5/8 09/15/26	アメリカ	国債証券	4.625	2026/09/15	800,000	14,675.46	117,403,690	14,908.31	119,266,509	0.61
8	T 2 08/15/25	アメリカ	国債証券	2.000	2025/08/15	800,000	13,988.43	111,907,453	14,209.75	113,678,053	0.58
9	T 1 3/8 11/15/31	アメリカ	国債証券	1.375	2031/11/15	900,000	11,614.52	104,530,729	12,156.73	109,410,629	0.56
10	T 3 7/8 12/31/29	アメリカ	国債証券	3.875	2029/12/31	700,000	14,189.92	99,329,441	14,635.11	102,445,809	0.52
11	T 4 1/2 11/15/33	アメリカ	国債証券	4.500	2033/11/15	600,000	15,241.80	91,450,812	15,284.10	91,704,628	0.47
12	CGB 2.44 10/15/27	中華人民 共和国	国債証券	2.440	2027/10/15	4,400,000	2,049.04	90,157,812	2,062.25	90,739,345	0.46
13	FRTR 0 3/4 02/25/28	フランス	国債証券	0.750	2028/02/25	600,000	14,657.59	87,945,587	14,939.59	89,637,589	0.46
14	T 3 7/8 08/15/33	アメリカ	国債証券	3.875	2033/08/15	600,000	13,897.55	83,385,344	14,554.42	87,326,543	0.44
15	T 3 5/8 05/31/28	アメリカ	国債証券	3.625	2028/05/31	600,000	14,141.73	84,850,418	14,516.38	87,098,319	0.44
16	T 1 3/4 12/31/24	アメリカ	国債証券	1.750	2024/12/31	600,000	14,178.63	85,071,796	14,345.77	86,074,675	0.44
17	T 2 3/4 02/15/28	アメリカ	国債証券	2.750	2028/02/15	600,000	13,656.44	81,938,664	14,046.06	84,276,409	0.43
18	T 1 5/8 02/15/26	アメリカ	国債証券	1.625	2026/02/15	600,000	13,712.92	82,277,568	13,978.05	83,868,342	0.43
19	T 1 1/4 12/31/26	アメリカ	国債証券	1.250	2026/12/31	600,000	13,262.20	79,573,253	13,599.96	81,599,760	0.41
20	T 2 7/8 05/15/32	アメリカ	国債証券	2.875	2032/05/15	600,000	12,903.70	77,422,251	13,548.08	81,288,521	0.41
21	T 1 3/8 12/31/28	アメリカ	国債証券	1.375	2028/12/31	600,000	12,535.98	75,215,917	13,035.12	78,210,721	0.40
22	CGB 2.79 12/15/29	中華人民 共和国	国債証券	2.790	2029/12/15	3,700,000	2,072.67	76,689,126	2,094.91	77,512,021	0.39
23	T 4 3/8 11/30/28	アメリカ	国債証券	4.375	2028/11/30	500,000	15,060.98	75,304,923	14,997.07	74,985,368	0.38
24	T 4 5/8 11/15/26	アメリカ	国債証券	4.625	2026/11/15	500,000	14,845.14	74,225,719	14,927.91	74,639,548	0.38
25	T 4 3/8 12/15/26	アメリカ	国債証券	4.375	2026/12/15	500,000	14,895.56	74,477,848	14,840.87	74,204,392	0.38
26	FRTR 0 02/25/27	フランス	国債証券	-	2027/02/25	500,000	14,528.47	72,642,377	14,832.41	74,162,092	0.38
27	T 4 1/8 07/31/28	アメリカ	国債証券	4.125	2028/07/31	500,000	14,419.55	72,097,771	14,819.55	74,097,765	0.38
28	T 4 1/8 06/15/26	アメリカ	国債証券	4.125	2026/06/15	500,000	14,487.56	72,437,828	14,714.65	73,573,271	0.37
29	T 2 11/15/41	アメリカ	国債証券	2.000	2041/11/15	700,000	9,674.81	67,723,720	10,425.32	72,977,307	0.37
30	UKT 2 09/07/25	イギリス	国債証券	2.000	2025/09/07	400,000	17,914.36	71,657,471	18,064.23	72,256,927	0.37

TMA外国債券マザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	額面	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
							単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	T 3 1/8 11/15/28	アメリカ	国債証券	3.125	2028/11/15	7,300,000	14,430.39	1,053,418,470	14,185.54	1,035,545,092	3.20
2	T 0 5/8 07/31/26	アメリカ	国債証券	0.625	2026/07/31	7,400,000	13,308.31	984,815,563	13,510.04	999,743,468	3.09
3	T 2 3/8 02/15/42	アメリカ	国債証券	2.375	2042/02/15	7,200,000	11,750.78	846,056,825	11,051.26	795,691,040	2.46
4	T 1 07/31/28	アメリカ	国債証券	1.000	2028/07/31	5,400,000	12,928.33	698,129,874	12,934.83	698,480,954	2.16
5	T 0 1/2 10/31/27	アメリカ	国債証券	0.500	2027/10/31	5,100,000	12,847.22	655,208,458	12,938.29	659,852,821	2.04
6	T 0 5/8 11/30/27	アメリカ	国債証券	0.625	2027/11/30	4,900,000	12,897.94	631,999,303	12,972.87	635,670,759	1.96
7	BKO 3.1 12/12/25	ドイツ	国債証券	3.100	2025/12/12	3,500,000	16,143.51	565,022,998	16,128.97	564,514,133	1.74
8	T 1 3/4 08/15/41	アメリカ	国債証券	1.750	2041/08/15	5,600,000	10,482.85	587,039,605	10,014.95	560,837,550	1.73
9	FRTR 2 1/2 09/24/26	フランス	国債証券	2.500	2026/09/24	3,400,000	15,764.48	535,992,442	15,973.00	543,082,153	1.67
10	T 3 5/8 02/15/44	アメリカ	国債証券	3.625	2044/02/15	4,000,000	14,197.32	567,893,115	13,227.62	529,105,079	1.63
11	T 0 1/4 10/31/25	アメリカ	国債証券	0.250	2025/10/31	3,800,000	13,450.65	511,125,004	13,723.30	521,485,506	1.61
12	T 4 3/8 12/15/26	アメリカ	国債証券	4.375	2026/12/15	3,500,000	14,856.24	519,968,506	14,840.87	519,430,751	1.60
13	SPGB 0 01/31/27	スペイン	国債証券	-	2027/01/31	2,900,000	14,376.86	416,929,171	14,754.03	427,866,959	1.32
14	T 1 1/4 03/31/28	アメリカ	国債証券	1.250	2028/03/31	3,200,000	13,198.80	422,361,875	13,195.35	422,251,213	1.30
15	T 1 1/8 08/15/40	アメリカ	国債証券	1.125	2040/08/15	4,300,000	9,439.27	405,888,770	9,183.83	394,904,896	1.22
16	T 3 7/8 02/15/43	アメリカ	国債証券	3.875	2043/02/15	2,700,000	13,004.14	351,111,939	13,757.88	371,462,886	1.14
17	T 2 3/8 04/30/26	アメリカ	国債証券	2.375	2026/04/30	2,600,000	14,170.70	368,438,252	14,160.18	368,164,915	1.13
18	T 0 5/8 12/31/27	アメリカ	国債証券	0.625	2027/12/31	2,800,000	12,866.36	360,258,080	12,938.29	362,272,137	1.12
19	UKT 4 1/8 01/29/27	イギリス	国債証券	4.125	2027/01/29	1,700,000	18,517.66	314,800,384	18,798.56	319,575,613	0.98
20	BTPS 5 08/01/34	イタリア	国債証券	5.000	2034/08/01	1,600,000	17,081.61	273,305,865	17,657.48	282,519,817	0.87
21	BTPS 3.8 08/01/28	イタリア	国債証券	3.800	2028/08/01	1,700,000	16,405.93	278,900,976	16,454.51	279,726,741	0.86
22	T 1 5/8 11/30/26	アメリカ	国債証券	1.625	2026/11/30	2,000,000	13,680.65	273,613,031	13,767.10	275,342,134	0.85
23	T 1 1/4 06/30/28	アメリカ	国債証券	1.250	2028/06/30	2,100,000	13,113.50	275,383,631	13,111.20	275,335,215	0.85

24	OBL 0 10/09/26	ドイツ	国債証券	-	2026/10/09	1,800,000	14,776.37	265,974,760	15,028.22	270,507,990	0.83
25	T 1 1/2 01/31/27	アメリカ	国債証券	1.500	2027/01/31	1,900,000	13,543.24	257,321,666	13,670.27	259,735,257	0.80
26	OBL 2.2 04/13/28	ドイツ	国債証券	2.200	2028/04/13	1,600,000	15,881.64	254,106,310	15,994.28	255,908,488	0.79
27	BTPS 4.1 02/01/29	イタリア	国債証券	4.100	2029/02/01	1,500,000	16,798.12	251,971,946	16,673.67	250,105,096	0.77
28	T 1 1/4 04/30/28	アメリカ	国債証券	1.250	2028/04/30	1,900,000	13,186.12	250,536,442	13,163.07	250,098,403	0.77
29	T 3 1/2 01/31/28	アメリカ	国債証券	3.500	2028/01/31	1,700,000	14,295.88	243,029,985	14,455.28	245,739,914	0.76
30	T 0 3/4 04/30/26	アメリカ	国債証券	0.750	2026/04/30	1,800,000	13,458.17	242,247,126	13,651.83	245,732,998	0.76

T M A 外国株式インデックスマザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	株式	364,192	26,955.61	9,817,020,175	27,745.30	10,104,617,025	5.07
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	164,755	53,408.79	8,799,365,607	60,287.45	9,932,659,566	4.99
3	NVIDIA CORP	アメリカ	半導体・半導体製造装置	株式	57,781	69,797.81	4,032,987,672	92,623.03	5,351,851,700	2.69
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	一般消費財・サービス流通・小売り	株式	217,016	20,842.20	4,523,091,745	23,460.44	5,091,293,017	2.55
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	137,836	19,296.37	2,659,735,019	22,347.92	3,080,348,314	1.54
6	META PLATFORMS INC-A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	52,131	47,594.22	2,481,134,325	59,028.85	3,077,233,135	1.54
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	株式	122,681	19,516.99	2,394,364,331	22,582.52	2,770,447,056	1.39
8	TESLA INC	アメリカ	自動車・自動車部品	株式	67,253	31,132.01	2,093,721,208	28,269.10	1,901,182,084	0.95
9	BROADCOM INC	アメリカ	半導体・半導体製造装置	株式	10,452	135,919.20	1,420,627,534	178,264.00	1,863,215,411	0.93
10	ELI LILLY AND COMPANY	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	19,050	87,474.68	1,666,392,719	95,166.79	1,812,927,520	0.91
11	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	株式	67,221	21,492.94	1,444,777,348	26,008.63	1,748,326,688	0.87
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	金融サービス	株式	29,934	51,574.19	1,543,821,839	57,123.98	1,709,949,292	0.85
13	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	ヘルスケア機器・サービス	株式	21,264	79,485.05	1,690,170,133	74,307.65	1,580,077,986	0.79
14	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	金融サービス	株式	36,735	35,812.26	1,315,563,395	40,893.48	1,502,222,079	0.75
15	EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	エネルギー	株式	94,758	15,179.30	1,438,360,477	15,470.61	1,465,964,773	0.73
16	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	54,760	21,871.13	1,197,663,338	23,426.51	1,282,835,879	0.64

17	MASTERCARD INC - A	アメリカ	金融サービス	株式	19,180	57,470.03	1,102,275,240	65,687.78	1,259,891,706	0.63
18	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	家庭用品・パーソナル用品	株式	53,954	22,202.83	1,197,931,579	23,237.64	1,253,764,141	0.63
19	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	76,710	14,949.94	1,146,810,478	16,056.37	1,231,684,296	0.61
20	HOME DEPOT INC	アメリカ	一般消費財・サービス流通・小売り	株式	23,241	42,970.18	998,670,138	52,690.10	1,224,570,730	0.61
21	ASML HOLDING NV	オランダ	半導体・半導体製造装置	株式	9,388	97,388.25	914,280,948	128,183.96	1,203,391,025	0.60
22	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	生活必需品流通・小売り	株式	10,429	83,998.20	876,017,239	103,394.18	1,078,297,976	0.54
23	MERCK & CO. INC.	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	58,670	15,240.19	894,142,529	17,950.93	1,053,181,239	0.52
24	NESTLE SA-REGISTERED	スイス	食品・飲料・タバコ	株式	60,329	17,094.79	1,031,311,918	16,950.96	1,022,634,773	0.51
25	ADOBE INC	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	10,854	85,466.61	927,654,692	92,655.49	1,005,682,775	0.50
26	ABBVIE INC	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	41,114	20,539.11	844,445,311	24,333.94	1,000,465,855	0.50
27	SALESFORCE INC	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	23,243	31,483.96	731,781,683	42,454.56	986,771,372	0.49
28	ADVANCED MICRO DEVICES	アメリカ	半導体・半導体製造装置	株式	38,548	17,024.19	656,248,542	25,387.45	978,635,538	0.49
29	CHEVRONTXACO CORP	アメリカ	エネルギー	株式	43,032	20,982.41	902,915,343	22,150.20	953,167,664	0.47
30	NETFLIX INC	アメリカ	メディア・娯楽	株式	10,449	64,627.93	675,297,283	83,048.51	867,773,959	0.43

T M A 外国株式マザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	89,700	41,353.10	3,709,373,628	60,287.45	5,407,784,668	7.01
2	NVIDIA CORP	アメリカ	半導体・半導体製造装置	株式	43,300	37,957.23	1,643,548,383	92,623.03	4,010,577,502	5.20
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	一般消費財・サービス流通・小売り	株式	131,500	14,600.07	1,919,909,533	23,460.45	3,085,049,175	4.00
4	APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	株式	91,500	23,152.43	2,118,448,148	27,745.30	2,538,695,133	3.29
5	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	ヘルスケア機器・サービス	株式	32,900	69,659.02	2,291,781,855	74,307.65	2,444,721,865	3.17
6	MSCI INC	アメリカ	金融サービス	株式	27,000	79,339.16	2,142,157,584	88,860.51	2,399,233,824	3.11
7	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	金融サービス	株式	53,100	32,130.48	1,706,128,912	40,893.48	2,171,443,920	2.81
8	MASTERCARD INC - A	アメリカ	金融サービス	株式	32,800	52,021.05	1,706,290,633	65,687.78	2,154,559,331	2.79

9	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	126,800	10,653.86	1,350,910,026	16,056.37	2,035,947,969	2.64
10	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	生活必需品流通・小売り	株式	19,600	73,201.03	1,434,740,197	103,394.18	2,026,526,065	2.63
11	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	株式	86,900	15,117.97	1,313,751,853	22,582.52	1,962,421,639	2.54
12	ADOBE INC	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	20,800	52,843.55	1,099,145,985	92,655.49	1,927,234,358	2.50
13	SALESFORCE INC	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	44,300	27,274.61	1,208,265,555	42,454.56	1,880,737,074	2.44
14	HERMES INTERNATIONAL	フランス	耐久消費財・アパレル	株式	5,900	276,930.35	1,633,889,106	314,916.94	1,858,009,957	2.41
15	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	82,900	14,994.03	1,243,005,169	22,347.92	1,852,642,816	2.40
16	MOODY'S CORP	アメリカ	金融サービス	株式	31,200	44,210.65	1,379,372,489	58,505.05	1,825,357,575	2.36
17	L'OREAL	フランス	家庭用品・パーソナル用品	株式	25,200	61,186.92	1,541,910,517	71,394.61	1,799,144,197	2.33
18	ELI LILLY AND COMPANY	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	17,100	48,952.25	837,083,641	95,166.79	1,627,352,262	2.11
19	VERISK ANALYTICS INC	アメリカ	商業・専門サービス	株式	41,300	26,569.32	1,097,313,267	36,310.57	1,499,626,933	1.94
20	ASTRAZENECA PLC	イギリス	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	75,100	20,251.90	1,520,917,817	19,830.75	1,489,289,610	1.93
21	ASML HOLDING NV	オランダ	半導体・半導体製造装置	株式	11,400	95,523.92	1,088,972,739	128,183.96	1,461,297,155	1.89
22	TJX COMPANIES INC	アメリカ	一般消費財・サービス流通・小売り	株式	101,800	11,078.05	1,127,745,897	14,285.79	1,454,293,523	1.88
23	ZOETIS INC	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	48,800	24,460.32	1,193,663,725	28,245.49	1,378,380,229	1.78
24	NETFLIX INC	アメリカ	メディア・娯楽	株式	16,400	44,781.42	734,415,370	83,048.51	1,361,995,687	1.76
25	DOLLARAMA INC	カナダ	一般消費財・サービス流通・小売り	株式	123,600	8,705.74	1,076,030,205	11,001.59	1,359,797,463	1.76
26	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	アメリカ	一般消費財・サービス流通・小売り	株式	8,700	139,620.22	1,214,695,953	153,617.25	1,336,470,127	1.73
27	MERCK & CO. INC.	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	65,500	15,437.65	1,011,166,546	17,950.93	1,175,786,111	1.52
28	NIKE INC -CL B	アメリカ	耐久消費財・アパレル	株式	76,400	17,456.64	1,333,687,334	15,371.75	1,174,402,387	1.52
29	POOL CORP	アメリカ	一般消費財・サービス流通・小売り	株式	19,300	50,402.22	972,763,012	56,017.35	1,081,134,999	1.40

30	COPART INC	アメリカ	商業・専門サービス	株式	142,800	5,143.59	734,505,080	7,222.57	1,031,383,353	1.33
----	------------	------	-----------	----	---------	----------	-------------	----------	---------------	------

b. 投資有価証券の種類

TMA日本債券インデックスマザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	89.12
地方債証券	5.12
特殊債券	0.69
社債券	4.96
合計	99.90

TMA日本債券マザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	57.65
社債券	41.86
合計	99.52

東京海上・JPX日経400インデックスマザーファンド

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.03
		鉱業	0.37
		建設業	2.11
		食料品	3.38
		繊維製品	0.22
		パルプ・紙	0.12
		化学	6.35
		医薬品	5.17
		石油・石炭製品	0.58
		ゴム製品	0.84
		ガラス・土石製品	0.60
		鉄鋼	0.91
		非鉄金属	0.60
		金属製品	0.28
		機械	5.87
		電気機器	16.45
		輸送用機器	6.17
		精密機器	2.71
		その他製品	2.06
		電気・ガス業	1.09
		陸運業	0.44
		海運業	1.15
		倉庫・運輸関連業	0.02
情報・通信業	8.15		
卸売業	7.63		

	小売業	3.61
	銀行業	5.64
	証券、商品先物取引業	0.97
	保険業	2.84
	その他金融業	1.44
	不動産業	2.15
	サービス業	3.24
合 計		93.38

T M A日本株アクティブマザーファンド

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.29
		建設業	1.93
		食料品	3.41
		繊維製品	0.41
		化学	6.86
		医薬品	7.46
		鉄鋼	0.72
		非鉄金属	0.99
		機械	6.92
		電気機器	25.54
		輸送用機器	7.98
		精密機器	0.87
		その他製品	3.73
		陸運業	2.65
		空運業	0.26
		情報・通信業	10.66
		卸売業	2.30
		小売業	3.78
		銀行業	6.52
		保険業	0.43
その他金融業	1.00		
不動産業	0.82		
サービス業	3.08		
合 計			98.74

T M A外国債券インデックスマザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	98.40
合 計	98.40

T M A外国債券マザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	98.64
合 計	98.64

T M A 外国株式インデックスマザーファンド

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	4.65
		素材	3.81
		資本財	6.68
		商業・専門サービス	1.62
		運輸	1.76
		自動車・自動車部品	1.71
		耐久消費財・アパレル	1.56
		消費者サービス	2.10
		メディア・娯楽	6.32
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.73
		生活必需品流通・小売り	1.69
		食品・飲料・タバコ	3.40
		家庭用品・パーソナル用品	1.60
		ヘルスケア機器・サービス	4.32
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.09
		銀行	5.36
		金融サービス	6.83
		保険	3.03
		ソフトウェア・サービス	10.74
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.51
電気通信サービス	1.17		
公益事業	2.52		
半導体・半導体製造装置	7.23		
不動産管理・開発	0.33		
投資証券		-	1.95
合計			99.85

T M A 外国株式マザーファンド

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	3.44
		素材	2.10
		資本財	1.34
		商業・専門サービス	4.22
		耐久消費財・アパレル	3.93
		メディア・娯楽	7.41
		一般消費財・サービス流通・小売り	10.79
		生活必需品流通・小売り	2.63
		食品・飲料・タバコ	1.27
		家庭用品・パーソナル用品	3.34
		ヘルスケア機器・サービス	3.83

	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	12.76
	銀行	1.32
	金融サービス	12.13
	ソフトウェア・サービス	11.96
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.29
	公益事業	1.58
	半導体・半導体製造装置	9.66
合 計		97.08

投資不動産物件

T M A 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。

T M A 日本債券マザーファンド
該当事項はありません。

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

T M A 日本株アクティブマザーファンド
該当事項はありません。

T M A 外国債券インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

T M A 外国債券マザーファンド
該当事項はありません。

T M A 外国株式インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

T M A 外国株式マザーファンド
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

T M A 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。

T M A 日本債券マザーファンド
該当事項はありません。

東京海上・J P X 日経400インデックスマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/ 売建	数量 (枚)	帳簿価額	評価額(円)	投資 比率(%)
株価指数先物取引	日本	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	17	401,239,300.00	434,095,000	6.11

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

T M A 日本株アクティブマザーファンド
該当事項はありません。

T M A 外国債券インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

T M A 外国債券マザーファンド
該当事項はありません。

T M A 外国株式インデックスマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/ 売建	数量 (枚)	通貨	帳簿価額	評価額	評価額(円)	投資 比率(%)
株価指数 先物取引	アメリカ	Chicago Mercantile Exchange	S&P 500 EMIN	買建	57	米ドル	13,834,837.50	14,110,350.00	2,081,982,142	1.04
	ドイツ	Eurex	DJ EU STX 50	買建	51	ユーロ	2,299,290.00	2,387,820.00	381,979,565	0.19
	イギリス	ICE Futures Europe Financials	FTSE 100 IDX	買建	13	英ポンド	988,300.00	995,410.00	186,470,155	0.09

(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。

T M A 外国株式マザーファンド
該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1計算期間末	(2016年 1月25日)	1,526	1,526	0.9182	0.9182
第2計算期間末	(2017年 1月25日)	623	623	0.9639	0.9639
第3計算期間末	(2018年 1月25日)	574	574	1.0813	1.0813
第4計算期間末	(2019年 1月25日)	820	820	1.0090	1.0090
第5計算期間末	(2020年 1月27日)	1,269	1,269	1.1163	1.1163
第6計算期間末	(2021年 1月25日)	1,706	1,706	1.2067	1.2067
第7計算期間末	(2022年 1月25日)	2,715	2,715	1.2656	1.2656
第8計算期間末	(2023年 1月25日)	3,404	3,404	1.2631	1.2631
第9計算期間末	(2024年 1月25日)	6,336	6,336	1.4917	1.4917
	2023年 1月末日	3,394		1.2555	
	2月末日	3,448		1.2742	
	3月末日	3,547		1.2931	
	4月末日	3,522		1.3108	
	5月末日	3,626		1.3524	
	6月末日	3,730		1.4163	
	7月末日	3,621		1.4091	
	8月末日	3,741		1.4235	
	9月末日	4,413		1.4027	
	10月末日	4,605		1.3728	
	11月末日	5,145		1.4402	
	12月末日	5,535		1.4457	
	2024年 1月末日	6,571		1.5002	

【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	2015年 7月17日～2016年 1月25日	8.2
第2計算期間	2016年 1月26日～2017年 1月25日	5.0
第3計算期間	2017年 1月26日～2018年 1月25日	12.2
第4計算期間	2018年 1月26日～2019年 1月25日	6.7
第5計算期間	2019年 1月26日～2020年 1月27日	10.6
第6計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	8.1
第7計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	4.9
第8計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	0.2
第9計算期間	2023年 1月26日～2024年 1月25日	18.1

(4) 【設定及び解約の実績】

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2015年 7月17日～2016年 1月25日	1,666,568,807	4,270,612	1,662,298,195
第2計算期間	2016年 1月26日～2017年 1月25日	70,889,246	1,086,318,747	646,868,694
第3計算期間	2017年 1月26日～2018年 1月25日	279,752,757	394,962,087	531,659,364
第4計算期間	2018年 1月26日～2019年 1月25日	379,742,942	98,391,843	813,010,463
第5計算期間	2019年 1月26日～2020年 1月27日	547,511,806	223,323,526	1,137,198,743
第6計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	600,338,294	323,095,042	1,414,441,995
第7計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	1,022,817,811	291,792,723	2,145,467,083
第8計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	726,639,474	176,834,217	2,695,272,340
第9計算期間	2023年 1月26日～2024年 1月25日	2,262,427,427	709,635,595	4,248,064,172

< 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計除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2015年7月17日です。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第5期	2020/01/27	0円
第6期	2021/01/25	0円
第7期	2022/01/25	0円
第8期	2023/01/25	0円
第9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

資産構成

マザーファンド	組入比率	基本資産配分	差
TMA日本債券インデックスマザーファンド	12.0%	12.5%	-0.5%
TMA日本債券マザーファンド	12.0%	12.5%	-0.5%
東京海上・JPX日経400インデックスマザーファンド	12.9%	12.5%	+0.4%
TMA日本株アクティブマザーファンド	12.8%	12.5%	+0.3%
TMA外国債券インデックスマザーファンド	12.3%	12.5%	-0.2%
TMA外国債券マザーファンド	12.2%	12.5%	-0.3%
TMA外国株式インデックスマザーファンド	12.8%	12.5%	+0.3%
TMA外国株式マザーファンド	13.0%	12.5%	+0.5%
短期金融資産等	0.0%	-	+0.0%

※比率は純資産総額に占める割合です。

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

年間収益率の推移



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

※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- a. 毎営業日にお申込みを受け付けます。ただし、お申込み日が以下の日のいずれかに該当する場合には、取得のお申込みの受付を行いません。

- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
- ・ロンドン証券取引所の休業日

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

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

- c. 販売会社やお申込みのコース等によって申込単位は異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。なお、分配金再投資コースにおける収益分配金の再投資に際しては、1口単位で取得することができます。
- d. 取得申込の受付は、原則として午後3時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みについては翌営業日受付の取扱いとなります。
- e. 受益権の取得申込価額は以下の通りです。
 取得申込受付日の翌営業日の基準価額
 基準価額は原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクに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. 申込手数料は、発行価格に2.2%(税抜2%)の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- g. 上記にかかわらず、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置を取った場合には、販売会社は、受益権の取得申込の受付を中止すること、および既に受け付けた取得申込の受付を取り消すことができます。
- h. 取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関等への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関等への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関等の定める方法により、振替機関等へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。
- i. 定時定額購入サービスを選択した取得申込者は、販売会社との間で定時定額購入サービスに関する取り決めを行います。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

< 主要投資対象資産の評価方法 >

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

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

原則として、2015年7月17日から無期限とします。ただし、後記「(5)その他 信託の終了（繰上償還）」に該当する場合には、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

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

信託約款の変更

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

関係会社との契約の更改等

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

運用報告書

- a. 毎決算時および償還時に、委託会社が、期間中の運用経過のほか、信託財産の内容などを記載した交付運用報告書を作成します。交付運用報告書は、知れている受益者に対して、販売会社から、あらかじめお申し出いただいたご住所にお届けします。
- b. 委託会社は、運用報告書(全体版)を作成し、委託会社のホームページ(<https://www.tokiomarineam.co.jp/>)に掲載します。
- c. 上記b.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があつた場合は、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9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・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 [2023年 1月25日現在]	第9期 [2024年 1月25日現在]
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	3,403,335,794	6,335,310,877
未収入金	24,749,546	39,071,655
流動資産合計	3,428,085,340	6,374,382,532
資産合計	3,428,085,340	6,374,382,532
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,168,542	5,376,191
未払受託者報酬	805,862	1,153,015
未払委託者報酬	21,489,710	30,747,051
その他未払費用	178,996	256,132
流動負債合計	23,643,110	37,532,389
負債合計	23,643,110	37,532,389
純資産の部		
元本等		
元本	1,269,527,340	1,424,064,172
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	709,169,890	2,088,785,971
（分配準備積立金）	189,816,756	762,052,579
元本等合計	3,404,442,230	6,336,850,143
純資産合計	3,404,442,230	6,336,850,143
負債純資産合計	3,428,085,340	6,374,382,532

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第9期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日
営業収益		
受取利息	-	1
有価証券売買等損益	31,040,610	757,850,121
営業収益合計	31,040,610	757,850,122
営業費用		
支払利息	2	25
受託者報酬	1,509,547	2,027,398
委託者報酬	40,254,658	54,063,928
その他費用	335,276	450,341
営業費用合計	42,099,483	56,541,692
営業利益又は営業損失（ ）	11,058,873	701,308,430
経常利益又は経常損失（ ）	11,058,873	701,308,430
当期純利益又は当期純損失（ ）	11,058,873	701,308,430
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（ ）	541,292	73,873,396
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	569,771,282	709,169,890
剰余金増加額又は欠損金減少額	198,093,361	950,929,566
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	198,093,361	950,929,566
剰余金減少額又は欠損金増加額	47,094,588	198,748,519
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	47,094,588	198,748,519
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（ ）	709,169,890	2,088,785,971

(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9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8期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第9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8期 [2023年 1月25日現在]	第9期 [2024年 1月25日現在]
1. 1 期首元本額	2,145,467,083円	2,695,272,340円
期中追加設定元本額	726,639,474円	2,262,427,427円
期中一部解約元本額	176,834,217円	709,635,595円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	2,695,272,340口	4,248,064,172口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第9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（4,999,004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（519,353,134円）及び分配準備積立金（184,817,752円）より、分配対象額は709,169,890円（1万口当たり2,631.14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（65,938,139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（548,596,708円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,326,733,392円）及び分配準備積立金（147,517,732円）より、分配対象額は2,088,785,971円（1万口当たり4,917.00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8期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第9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8期 [2023年 1月25日現在]	第9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8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	38,522,354円
合計	38,522,354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9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	661,164,041円
合計	661,164,041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8期 [2023年 1月25日現在]		第9期 [2024年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額	1.2631円	1口当たり純資産額	1.4917円
(1万口当たり純資産額	12,631円)	(1万口当たり純資産額	14,917円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	TMA日本株アクティブマザーファンド	293,431,143	816,325,439	
	TMA日本債券マザーファンド	570,156,286	761,728,798	
	TMA外国株式マザーファンド	129,288,461	815,810,188	
	TMA外国債券マザーファンド	276,454,804	776,644,480	
	TMA外国債券インデックスマザーファンド	402,858,872	778,927,629	
	TMA外国株式インデックスマザーファンド	144,735,796	805,469,178	
	TMA日本債券インデックスマザーファンド	622,696,317	761,557,595	
	東京海上・JPX日経400インデックス マザーファンド	296,587,189	818,847,570	
親投資信託受益証券 合計		2,736,208,868	6,335,310,877	
合計		2,736,208,868	6,335,310,877	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（ご参考）

当ファンドは、「TMA日本債券インデックスマザーファンド」、「TMA日本債券マザーファンド」、「東京海上・JPX日経400インデックスマザーファンド」、「TMA日本株アクティブマザーファンド」、「TMA外国債券インデックスマザーファンド」、「TMA外国債券マザーファンド」、「TMA外国株式インデックスマザーファンド」、「TMA外国株式マザーファンド」を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同ファンドの受益証券です。なお、同ファンドの状況は次のとおりです。

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

「TMA日本債券インデックスマザーファンド」の状況

（1）貸借対照表

区 分	注記 番号	[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
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 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(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
国債証券	285,222,370円
地方債証券	9,216,300円
特殊債券	806,000円
社債券	9,455,887円
合計	304,700,557円

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

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

(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 (1万口当たり純資産額)	1.2325円 12,325円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2230円 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。

「TMA日本債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	金額（円）	
		[2023年 1月25日現在]	[2024年 1月25日現在]

資産の部

流動資産		
預金	21,808,181	4,107,000
コール・ローン	778,730,575	498,530,165
国債証券	44,491,047,678	45,465,847,430
社債券	41,474,648,856	34,735,454,539
派生商品評価勘定		5,130,200
未収入金	1,507,590,900	429,701,300
未収利息	104,606,798	104,217,891
前払費用	7,342,895	19,967,640
差入委託証拠金		30,782,748
流動資産合計	88,385,775,883	81,293,738,913
資産合計	88,385,775,883	81,293,738,913
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		327,920
前受金		1,350,000
未払金	1,812,089,600	529,526,750
未払解約金	110,034,239	135,996,228
未払利息	378	223
流動負債合計	1,922,124,217	667,201,121
負債合計	1,922,124,217	667,201,121
純資産の部		
元本等		
元本	1	64,534,994,402
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		21,928,657,264
元本等合計		86,463,651,666
純資産合計		80,626,537,792
負債純資産合計	88,385,775,883	81,293,738,913

(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	国債証券、地方債証券及び社債券 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。
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	65,890,862,584円	64,534,994,402円
同期中における追加設定元本額	12,866,665,574円	12,136,984,892円
同期中における一部解約元本額	14,222,533,756円	16,320,546,948円
同期末における元本額	64,534,994,402円	60,351,432,346円
元本の内訳*		
東京海上セレクション・バランス30	4,791,176,227円	5,454,054,289円
東京海上セレクション・バランス50	6,296,036,731円	7,504,157,094円
東京海上セレクション・バランス70	1,665,214,197円	2,090,256,264円
東京海上セレクション・日本債券	11,502,468,436円	11,232,248,362円
東京海上・日本債券オープン(野村SMA向け)	5,403,270,826円	5,245,922,744円
東京海上・日本債券オープン(野村SMA・EW向け)	30,977,464,029円	28,071,508,476円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	308,806,127円	570,156,286円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	106,799,838円	104,620,185円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	69,040,095円	75,243,885円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	2,697,425円	3,264,761円
東京海上・日本債券オープンF(適格機関投資家専用)	3,412,020,471円	円
計	64,534,994,402円	60,351,432,346円
2. 1 本書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	64,534,994,402口	60,351,432,346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。	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。
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	<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 （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 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。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
----------------------------	--	---

(有価証券に関する注記)

(自 2022年1月26日 至 2023年1月25日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	2,110,413,611円
社債券	874,346,072円
合計	2,984,759,683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
国債証券	1,627,448,480円
社債券	96,397,327円
合計	1,723,845,807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

債券関連

(2023年1月25日現在)

該当事項はありません。

(2024年1月25日現在)

(単位：円)

区 分	種 類	契約額等	うち 1年超	時 価	評価損益
市場取引	債券先物取引				
	売建	4,091,990,000		4,087,160,000	4,830,000
	長期国債標準物先物	4,091,990,000		4,087,160,000	4,830,000
	合 計	4,091,990,000		4,087,160,000	4,830,000

(注)1.時価の算定方法

債券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. 債券先物取引の残高は、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	1.3398円	1口当たり純資産額	1.3360円
(1万口当たり純資産額)	(13,398円)	(1万口当たり純資産額)	(13,360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452回利付国債(2年)	16,000,000	15,997,440	
	第453回利付国債(2年)	2,367,000,000	2,366,195,220	
	第454回利付国債(2年)	1,532,000,000	1,534,022,240	
	第455回利付国債(2年)	288,000,000	287,812,800	
	第456回利付国債(2年)	555,000,000	555,427,350	
	第157回利付国債(5年)	99,000,000	98,917,830	
	第159回利付国債(5年)	180,000,000	178,785,000	
	第164回利付国債(5年)	3,106,000,000	3,087,270,820	
	第10回利付国債(40年)	299,000,000	230,681,490	
	第13回利付国債(40年)	85,000,000	54,910,000	
	第14回利付国債(40年)	1,081,000,000	744,225,260	
	第15回利付国債(40年)	405,000,000	307,066,950	
	第16回利付国債(40年)	634,000,000	526,156,600	
	第359回利付国債(10年)	285,000,000	279,838,650	
	第360回利付国債(10年)	1,472,000,000	1,441,529,600	
	第362回利付国債(10年)	1,613,000,000	1,570,642,620	
	第363回利付国債(10年)	190,000,000	184,446,300	
	第364回利付国債(10年)	100,000,000	96,767,000	
	第365回利付国債(10年)	2,513,000,000	2,423,713,110	
	第368回利付国債(10年)	670,000,000	645,833,100	
	第369回利付国債(10年)	3,000,000	2,960,880	
	第370回利付国債(10年)	749,000,000	737,705,080	
	第371回利付国債(10年)	274,000,000	266,749,960	
	第373回利付国債(10年)	300,000,000	295,989,000	
	第15回利付国債(30年)	1,000,000	1,170,480	
	第23回利付国債(30年)	248,000,000	292,253,120	
第26回利付国債(30年)	75,000,000	87,452,250		
第27回利付国債(30年)	40,000,000	47,149,200		

第28回利付国債(30年)	50,000,000	58,892,500	
第33回利付国債(30年)	514,000,000	564,788,340	
第34回利付国債(30年)	150,000,000	169,045,500	
第38回利付国債(30年)	290,000,000	305,207,600	
第40回利付国債(30年)	321,000,000	336,635,910	
第41回利付国債(30年)	147,000,000	151,273,290	
第44回利付国債(30年)	350,000,000	358,491,000	
第47回利付国債(30年)	140,000,000	140,222,600	
第48回利付国債(30年)	644,000,000	620,790,240	
第51回利付国債(30年)	567,000,000	426,474,720	
第54回利付国債(30年)	5,000,000	4,183,050	
第56回利付国債(30年)	20,000,000	16,613,400	
第57回利付国債(30年)	510,000,000	422,305,500	
第58回利付国債(30年)	6,000,000	4,952,640	
第59回利付国債(30年)	165,000,000	132,544,500	
第60回利付国債(30年)	70,000,000	58,841,300	
第61回利付国債(30年)	710,000,000	566,466,400	
第64回利付国債(30年)	410,000,000	298,533,300	
第67回利付国債(30年)	739,000,000	562,201,640	
第68回利付国債(30年)	430,000,000	325,914,200	
第70回利付国債(30年)	790,000,000	611,460,000	
第72回利付国債(30年)	179,000,000	137,692,170	
第77回利付国債(30年)	515,000,000	494,477,250	
第80回利付国債(30年)	1,566,000,000	1,570,541,400	
第81回利付国債(30年)	345,000,000	329,664,750	
第149回利付国債(20年)	620,000,000	663,883,600	
第150回利付国債(20年)	763,000,000	808,711,330	
第151回利付国債(20年)	712,000,000	739,063,120	
第152回利付国債(20年)	683,000,000	707,697,280	
第153回利付国債(20年)	770,000,000	804,742,400	
第154回利付国債(20年)	340,000,000	351,124,800	
第155回利付国債(20年)	1,222,000,000	1,231,812,660	
第156回利付国債(20年)	190,000,000	178,039,500	
第157回利付国債(20年)	100,000,000	91,025,000	
第158回利付国債(20年)	75,000,000	70,590,750	
第159回利付国債(20年)	666,000,000	632,307,060	
第160回利付国債(20年)	295,000,000	282,583,450	
第162回利付国債(20年)	690,000,000	647,516,700	
第164回利付国債(20年)	240,000,000	220,216,800	
第165回利付国債(20年)	738,000,000	674,163,000	
第167回利付国債(20年)	1,922,000,000	1,739,852,060	
第169回利付国債(20年)	696,000,000	604,768,320	
第170回利付国債(20年)	1,337,000,000	1,155,622,580	
第173回利付国債(20年)	585,000,000	505,972,350	
第176回利付国債(20年)	958,000,000	831,314,080	

	第179回利付国債(20年)	228,000,000	195,138,360	
	第180回利付国債(20年)	102,000,000	91,750,020	
	第181回利付国債(20年)	830,000,000	757,648,900	
	第182回利付国債(20年)	116,000,000	109,237,200	
	第183回利付国債(20年)	266,000,000	262,855,880	
	第185回利付国債(20年)	1,828,000,000	1,706,584,240	
	第186回利付国債(20年)	2,277,000,000	2,271,808,440	
	第19回インドネシア共和国円貨債券(2021)	100,000,000	99,935,000	
国債証券	合計	48,162,000,000	45,465,847,430	
社債券	第9回BPCE円貨社債(劣後)	200,000,000	193,622,000	
	第1回クレディ・アグリコル円貨社債(劣後)	100,000,000	100,475,000	
	第9回クレディ・アグリコル円貨社債	200,000,000	197,240,000	
	第12回ロイズ・バンキング・グループ円貨社債(2023)	200,000,000	199,920,000	
	第2回ヤンマーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,360,000	
	第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,585,000	30,290,010	
	第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	31,247,000	31,012,959	
	第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	55,466,000	54,837,570	
	第2回株式会社商工組合中央金庫無担保社債(劣後)	300,000,000	293,517,000	
	ソシエテ・ジェネラルEMTN2021	200,000,000	195,072,000	
	第1回国際石油開発帝石株式会社無担保社債	100,000,000	99,393,000	
	第2回国際石油開発帝石株式会社無担保社債	100,000,000	96,196,000	
	第2回株式会社高松コンストラクショングループ無担保社債	200,000,000	198,886,000	
	第30回清水建設株式会社無担保社債	200,000,000	194,286,000	
	第12回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	195,184,000	
	第14回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	100,000,000	97,402,000	
	第12回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,643,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	95,678,000	
	第30回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	300,387,000	
	第32回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,995,000	

第22回積水ハウス株式会社無担保社債	200,000,000	198,622,000	
第4回高砂熱学工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,622,000	
BNPパリバEMTN2021	200,000,000	195,560,000	
パークレイズEMTN2021	300,000,000	293,796,000	
第14回日本ハム株式会社無担保社債	300,000,000	288,201,000	
第37回サッポロホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	296,682,000	
第1回アサヒグループホールディングス無担保社債(劣後)	200,000,000	200,540,000	
第23回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	297,867,000	
第19回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,848,000	
第20回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	196,676,000	
第9回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,342,000	
第35回双日株式会社無担保社債	100,000,000	99,061,000	
第1回アルフレッサホールディングス無担保社債	100,000,000	100,256,000	
第6回日鉄興和不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,302,000	
第2回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	98,127,000	
第7回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,400,000	
第6回日本アコモデーションファンド投資法人無担保投資法人債	200,000,000	189,640,000	
第15回野村不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	95,922,000	
第16回野村不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,049,000	
第1回株式会社オープンハウス無担保社債	100,000,000	100,002,000	
第22回旭化成株式会社無担保社債	200,000,000	200,196,000	
第1回三井不動産ロジスティクスパーク投資法人債	100,000,000	96,859,000	
第5回日本土地建物株式会社無担保社債	100,000,000	99,658,000	
第28回北越コーポレーション株式会社無担保社債	300,000,000	297,909,000	
第37回昭和電工株式会社無担保社債	100,000,000	99,400,000	
第2回住友化学株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	99,842,000	
第1回日本酸素ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,174,000	

第3回日本酸素ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,956,000	
第41回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	300,000,000	285,021,000	
第16回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,975,000	
第17回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	400,000,000	387,972,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	500,000,000	473,825,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	300,000,000	299,790,000	
第48回D I C株式会社無担保社債	100,000,000	97,498,000	
第12回出光興産株式会社無担保社債	100,000,000	96,987,000	
第1回E N E O Sホールディングス株式会社無担保社債(劣後)	200,000,000	197,632,000	
第15回横浜ゴム株式会社無担保社債	100,000,000	98,591,000	
第36回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,880,000	
第22回三井金属鉱業株式会社無担保社債	100,000,000	99,568,000	
第35回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	98,620,000	
第6回古河機械金属株式会社無担保社債	100,000,000	99,825,000	
第47回古河電気工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,511,000	
第32回住友電気工業株式会社無担保社債	200,000,000	198,418,000	
第1回住友生命2023基金流動化株式会社無担保社債(劣後)	500,000,000	496,250,000	
第1回文化シャッター株式会社無担保社債	100,000,000	99,668,000	
第13回Y K K株式会社無担保社債	100,000,000	99,328,000	
第9回日本発条株式会社無担保社債	200,000,000	198,886,000	
第2回テクノプロ・ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,166,000	
第15回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,813,000	
第8回住友重機械工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,333,000	
第20回日立建機株式会社無担保社債	100,000,000	95,317,000	
第14回株式会社クボタ無担保社債	300,000,000	298,821,000	

第16回株式会社クボタ無担保社債	200,000,000	199,402,000	
第57回日本精工株式会社無担保社債	100,000,000	99,291,000	
第12回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	99,538,000	
第22回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,802,000	
第46回三菱電機株式会社無担保社債	200,000,000	200,070,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,446,000	
第16回日本電産株式会社無担保社債	200,000,000	198,726,000	
第22回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	98,681,000	
第1回パナソニック株式会社無担保社債(劣後)	500,000,000	496,100,000	
第2回パナソニック株式会社無担保社債(劣後)	300,000,000	292,641,000	
第3回パナソニック株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	92,066,000	
第9回TDK株式会社無担保社債	300,000,000	293,016,000	
第27回日立造船株式会社無担保社債	100,000,000	98,916,000	
第5回A号富国生命保険相互会社無担保社債(劣後)	100,000,000	94,536,000	
第20回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	97,919,000	
第21回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,147,000	
第27回J A三井リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,716,000	
第3回株式会社かんぼ生命保険無担保社債(劣後)	100,000,000	100,588,000	
第1回大樹生命保険株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	98,501,000	
第3回明治安田生命保険無担保社債(劣後特約付)	400,000,000	393,252,000	
第31回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	98,972,000	
第26回トヨタ自動車株式会社無担保社債	300,000,000	298,401,000	
第1回日本生命第1回劣後ローン流動化株式会社無担保社債(劣後)	200,000,000	198,742,000	
第1回日本生命第2回劣後ローン流動化株式会社無担保社債(劣後)	300,000,000	296,931,000	
第1回住友生命第1回劣後ローン流動化株式会社無担保(劣後)	100,000,000	99,920,000	

第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	300,000,000	298,227,000	
第23回株式会社ニコン無担保社債	200,000,000	193,812,000	
第4回シチズン時計株式会社無担保社債	100,000,000	99,913,000	
第5回兼松株式会社無担保社債	100,000,000	98,408,000	
第6回兼松株式会社無担保社債	100,000,000	97,412,000	
第7回三菱商事株式会社無担保社債(劣後)	500,000,000	492,890,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	98,799,000	
第44回株式会社丸井グループ無担保社債	300,000,000	298,569,000	
第8回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ	100,000,000	100,015,000	
第12回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ	500,000,000	500,010,000	
第26回株式会社りそなホールディングス無担保社債	200,000,000	198,836,000	
第20回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	100,000,000	99,438,000	
第1回株式会社三井住友フィナンシャルグループ	200,000,000	200,810,000	
第4回株式会社三井住友フィナンシャルグループ	200,000,000	199,394,000	
第15回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	200,000,000	199,914,000	
第1回株式会社千葉銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	100,003,000	
第1回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	100,000,000	100,013,000	
第2回株式会社北國銀行無担保社債(劣後)	200,000,000	198,568,000	
第28回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	500,000,000	497,485,000	
第15回みずほフィナンシャルグループ(劣後)	400,000,000	398,068,000	
第30回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	94,731,000	
第33回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,652,000	
第1回芙蓉総合リース株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	101,490,000	
第7回みずほリース株式会社無担保社債	300,000,000	296,664,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,918,000	
第10回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	94,413,000	

第17回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	198,312,000	
第21回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	198,574,000	
第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,164,000	
第56回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	200,000,000	198,838,000	
第69回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	198,780,000	
第82回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,890,000	
第25回SBIホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,934,000	
第26回SBIホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,231,000	
第100回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,242,000	
第101回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,085,000	
第64回アイフル株式会社無担保社債	100,000,000	100,094,000	
第65回アイフル株式会社無担保社債	100,000,000	100,137,000	
第42回リコーリース株式会社無担保社債	200,000,000	198,954,000	
第16回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,703,000	
第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,413,000	
第22回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	300,000,000	298,329,000	
第80回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,574,000	
第82回アコム株式会社無担保社債	200,000,000	199,196,000	
第83回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	98,770,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,446,000	
第33回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,115,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,243,000	
第205回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	98,139,000	
第1回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債(劣後)	500,000,000	493,405,000	
第36回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,265,000	

第37回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	97,791,000	
第51回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,002,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債(劣後)	200,000,000	198,090,000	
第7回野村ホールディングス無担保社債	300,000,000	300,060,000	
第1回SOMPOホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,192,000	
第1回アニコムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,699,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	198,714,000	
第1回あいおいニッセイ同和損害保険株式会社無担保社債(劣後)	200,000,000	199,732,000	
第20回NECキャピタルソリューション株式会社無担保社債	200,000,000	187,650,000	
第1回株式会社T&Dホールディングス無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	197,340,000	
第2回株式会社T&Dホールディングス無担保社債(劣後)	100,000,000	99,734,000	
第3回株式会社T&Dホールディングス無担保社債(劣後)	100,000,000	96,388,000	
第84回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,109,000	
第5回三菱地所株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	99,667,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	95,546,000	
第142回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,577,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	95,856,000	
第110回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	95,172,000	
第10回NTT都市開発リート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	96,350,000	
第62回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,140,000	
第163回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	198,940,000	
第164回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	500,000,000	480,535,000	
第73回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,466,000	
第124回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,232,000	
第58回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,573,000	

第62回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	95,242,000	
第1回ヤマトホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,210,000	
第8回ニッコンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,969,000	
第43回日本郵船株式会社無担保社債	100,000,000	99,414,000	
第2回飯野海運株式会社無担保社債	100,000,000	100,002,000	
第7回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	94,974,000	
第8回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	191,500,000	
第10回日本航空株式会社無担保社債	200,000,000	199,224,000	
第4回株式会社ヤマタネ無担保社債	200,000,000	199,218,000	
第12回ソフトバンク無担保社債	100,000,000	97,494,000	
第21回ソフトバンク無担保社債	100,000,000	99,118,000	
第1回GMOインターネット株式会社無担保社債	100,000,000	99,950,000	
第2回GMOインターネット株式会社無担保社債	100,000,000	99,059,000	
第546回中部電力株式会社社債	100,000,000	95,278,000	
第1回関西電力株式会社無担保社債(劣後)	400,000,000	399,300,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,974,000	
第416回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,175,000	
第447回中国電力株式会社社債	200,000,000	198,732,000	
第448回中国電力株式会社社債	200,000,000	196,118,000	
第316回北陸電力株式会社社債	400,000,000	386,640,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	96,066,000	
第1回九州電力株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	100,121,000	
第3回九州電力株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	97,869,000	
第516回九州電力株式会社社債	500,000,000	489,470,000	
第72回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	96,441,000	
第15回東京電力パワーグリッド株式会社社債	500,000,000	493,775,000	
第35回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,820,000	
第68回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,433,000	
第2回株式会社JERA無担保社債	300,000,000	288,507,000	
第1回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	200,000,000	199,768,000	

第2回大阪瓦斯株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	95,888,000	
第6回株式会社イチネンホールディングス無担保社債	100,000,000	99,705,000	
第7回株式会社イチネンホールディングス無担保社債	100,000,000	98,623,000	
第8回SCSK株式会社無担保社債	100,000,000	99,375,000	
第9回SCSK株式会社無担保社債	100,000,000	99,051,000	
第14回コナミホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,191,000	
社債券 合計	35,216,298,000	34,735,454,539	
合計	83,378,298,000	80,201,301,969	

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。

「東京海上・JPX日経400インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	[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		179,689,066	436,932,432
株式	2	2,821,103,190	6,581,155,550
派生商品評価勘定		3,554,100	28,945,700
未収配当金		4,733,750	8,668,400
流動資産合計		3,009,080,106	7,055,702,082
資産合計		3,009,080,106	7,055,702,082
負債の部			
流動負債			
前受金		2,934,000	29,204,000
未払解約金		3,093,692	4,883,956
未払利息		87	196
流動負債合計		6,027,779	34,088,152
負債合計		6,027,779	34,088,152
純資産の部			
元本等			
元本	1	1,434,866,743	2,543,227,454
剰余金			
剰余金又は欠損金()		1,568,185,584	4,478,386,476
元本等合計		3,003,052,327	7,021,613,930
純資産合計		3,003,052,327	7,021,613,930

負債純資産合計

3,009,080,106

7,055,702,082

(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	1,654,043,540円	1,434,866,743円
同期中における追加設定元本額	563,214,094円	1,435,164,461円
同期中における一部解約元本額	782,390,891円	326,803,750円
同期末における元本額	1,434,866,743円	2,543,227,454円
元本の内訳*		
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	206,619,251円	296,587,189円
東京海上・J P X日経400インデックスファンド<適格機関投資家限定>	1,228,247,492円	2,246,640,265円
計	1,434,866,743円	2,543,227,454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	1,434,866,743口	2,543,227,454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 58,838,000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 57,088,000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	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	<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	<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。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。</p>	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	48,813,323円
合計	48,813,323円

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

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2022年8月9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	597,450,591円
合計	597,450,591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8月8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	174,591,000		178,155,000	3,564,000
	東証株価指数先物	174,591,000		178,155,000	3,564,000
	合 計	174,591,000		178,155,000	3,564,000

（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	401,236,000		430,185,000	28,949,000
	東証株価指数先物	401,236,000		430,185,000	28,949,000
	合 計	401,236,000		430,185,000	28,949,000

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（1口当たり情報に関する注記）

[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	2.0929円	1口当たり純資産額	2.7609円
（1万口当たり純資産額	20,929円）	（1万口当たり純資産額	27,609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	3,300	792.30	2,614,590	
三井松島ホールディングス	200	2,829.00	565,800	
I N P E X	12,800	1,989.00	25,459,200	
ウエストホールディングス	300	3,260.00	978,000	
ショーボンドホールディングス	700	6,664.00	4,664,800	
ミライト・ワン	1,700	1,921.00	3,265,700	
タマホーム	400	4,130.00	1,652,000	
安藤・間	2,400	1,172.00	2,812,800	
コムシスホールディングス	1,500	3,228.00	4,842,000	
大成建設	2,300	5,387.00	12,390,100	
大林組	8,600	1,353.00	11,635,800	
清水建設	6,500	1,011.50	6,574,750	
長谷工コーポレーション	2,800	1,906.00	5,336,800	
鹿島建設	5,300	2,645.00	14,018,500	
住友林業	2,100	4,424.00	9,290,400	
大和ハウス工業	6,800	4,512.00	30,681,600	
積水ハウス	7,400	3,385.00	25,049,000	
関電工	2,100	1,433.00	3,009,300	
エクシオグループ	1,600	3,247.00	5,195,200	
九電工	700	5,041.00	3,528,700	
インフロニア・ホールディングス	2,500	1,568.50	3,921,250	
森永製菓	1,500	2,757.00	4,135,500	
カルビー	1,200	3,022.00	3,626,400	
森永乳業	800	2,994.50	2,395,600	
ヤクルト本社	3,500	3,230.00	11,305,000	
明治ホールディングス	3,000	3,536.00	10,608,000	
日本ハム	1,200	4,972.00	5,966,400	
アサヒグループホールディングス	5,700	5,474.00	31,201,800	
キリンホールディングス	10,300	2,088.50	21,511,550	
宝ホールディングス	2,400	1,224.50	2,938,800	
サントリー食品インターナショナル	1,700	4,817.00	8,188,900	
キッコーマン	1,600	9,115.00	14,584,000	
味の素	6,000	6,060.00	36,360,000	
ニチレイ	1,200	3,544.00	4,252,800	
東洋水産	1,200	7,863.00	9,435,600	
日清食品ホールディングス	2,700	4,907.00	13,248,900	
日本たばこ産業	15,400	3,811.00	58,689,400	
東レ	16,600	724.60	12,028,360	
ゴールドウイン	400	9,908.00	3,963,200	

王子ホールディングス	10,400	577.10	6,001,840
レンゴー	2,700	954.40	2,576,880
クラレ	3,300	1,537.00	5,072,100
旭化成	17,000	1,110.00	18,870,000
住友化学	17,800	341.10	6,071,580
日産化学	1,100	5,883.00	6,471,300
東ソー	3,100	1,875.00	5,812,500
トクヤマ	1,300	2,494.50	3,242,850
デンカ	1,300	2,572.50	3,344,250
信越化学工業	20,600	5,867.00	120,860,200
エア・ウォーター	2,600	1,958.50	5,092,100
日本酸素ホールディングス	2,300	3,739.00	8,599,700
三菱瓦斯化学	2,300	2,422.50	5,571,750
三井化学	2,000	4,398.00	8,796,000
東京応化工業	1,500	3,469.00	5,203,500
三菱ケミカルグループ	18,200	901.00	16,398,200
KHネオケム	900	2,327.00	2,094,300
ダイセル	2,900	1,456.00	4,222,400
住友ベークライト	500	7,591.00	3,795,500
積水化学工業	4,800	2,140.50	10,274,400
日本ゼオン	1,600	1,312.50	2,100,000
アイカ工業	1,000	3,374.00	3,374,000
扶桑化学工業	600	4,395.00	2,637,000
ADEKA	1,300	2,936.00	3,816,800
日油	800	6,775.00	5,420,000
花王	5,700	5,799.00	33,054,300
日本ペイントホールディングス	13,200	1,182.50	15,609,000
関西ペイント	2,300	2,516.00	5,786,800
太陽ホールディングス	900	3,190.00	2,871,000
富士フイルムホールディングス	4,800	9,217.00	44,241,600
資生堂	5,300	4,009.00	21,247,700
ライオン	3,100	1,311.00	4,064,100
コーセー	500	9,581.00	4,790,500
小林製薬	700	6,657.00	4,659,900
タカラバイオ	1,400	1,242.00	1,738,800
デクセリアルズ	600	4,404.00	2,642,400
日東電工	1,700	11,350.00	19,295,000
ニフコ	1,100	3,851.00	4,236,100
ユニ・チャーム	5,200	5,058.00	26,301,600
協和キリン	3,100	2,353.50	7,295,850
武田薬品工業	20,100	4,340.00	87,234,000
アステラス製薬	22,900	1,701.00	38,952,900
塩野義製薬	3,200	7,157.00	22,902,400
日本新薬	700	5,268.00	3,687,600
中外製薬	8,000	5,455.00	43,640,000

エーザイ	3,100	6,951.00	21,548,100
ロート製薬	2,300	2,983.50	6,862,050
小野薬品工業	5,200	2,620.00	13,624,000
JCRファーマ	1,100	1,121.00	1,233,100
第一三共	20,000	4,300.00	86,000,000
大塚ホールディングス	5,200	5,757.00	29,936,400
ペプチドリーム	1,100	1,347.00	1,481,700
出光興産	13,500	819.50	11,063,250
ENEOSホールディングス	41,500	598.20	24,825,300
コスモエネルギーホールディングス	900	6,140.00	5,526,000
横浜ゴム	1,200	3,444.00	4,132,800
TOYO TIRE	1,500	2,387.00	3,580,500
ブリヂストン	7,400	6,282.00	46,486,800
住友ゴム工業	2,700	1,647.50	4,448,250
AGC	2,300	5,425.00	12,477,500
TOTO	1,600	3,970.00	6,352,000
日本碍子	3,300	1,809.00	5,969,700
日本特殊陶業	1,900	3,936.00	7,478,400
MARUWA	100	29,590.00	2,959,000
フジミインコーポレーテッド	1,000	3,055.00	3,055,000
ニチアス	1,100	3,410.00	3,751,000
日本製鉄	11,500	3,479.00	40,008,500
JFEホールディングス	7,100	2,295.00	16,294,500
東京製鐵	1,000	1,757.00	1,757,000
丸一鋼管	1,000	3,804.00	3,804,000
日本冶金工業	300	4,660.00	1,398,000
大紀アルミニウム工業所	1,000	1,248.00	1,248,000
三井金属鉱業	900	4,657.00	4,191,300
住友金属鉱山	2,900	4,138.00	12,000,200
DOWAホールディングス	800	5,277.00	4,221,600
住友電気工業	9,500	1,933.50	18,368,250
AREホールディングス	1,500	2,020.00	3,030,000
SUMCO	4,500	2,380.50	10,712,250
三和ホールディングス	2,500	2,309.50	5,773,750
リンナイ	1,400	3,398.00	4,757,200
三浦工業	1,400	2,770.00	3,878,000
アマダ	4,200	1,591.50	6,684,300
FUJ I	1,600	2,521.00	4,033,600
DMG森精機	1,900	2,952.50	5,609,750
ディスコ	1,200	41,480.00	49,776,000
ナブテスコ	1,700	2,860.50	4,862,850
SMC	800	83,310.00	66,648,000
小松製作所	12,000	3,914.00	46,968,000
住友重機械工業	1,800	3,793.00	6,827,400
日立建機	1,300	4,096.00	5,324,800

ローツェ	200	16,710.00	3,342,000	
クボタ	13,200	2,220.00	29,304,000	
荏原製作所	1,000	9,484.00	9,484,000	
ダイキン工業	3,100	24,000.00	74,400,000	
オルガノ	500	6,290.00	3,145,000	
ダイフク	4,100	2,973.00	12,189,300	
SANKYO	500	9,280.00	4,640,000	
竹内製作所	700	4,645.00	3,251,500	
セガサミーホールディングス	2,000	2,160.00	4,320,000	
ホシザキ	1,400	5,340.00	7,476,000	
マキタ	3,000	3,982.00	11,946,000	
三菱重工業	4,500	9,618.00	43,281,000	
IHI	1,800	2,803.00	5,045,400	
イビデン	1,400	7,886.00	11,040,400	
ブラザー工業	3,200	2,513.50	8,043,200	
ミネベアミツミ	4,200	3,050.00	12,810,000	
日立製作所	10,000	11,385.00	113,850,000	
三菱電機	28,700	2,153.00	61,791,100	
富士電機	1,500	7,419.00	11,128,500	
安川電機	2,900	5,797.00	16,811,300	
ニデック	5,700	5,712.00	32,558,400	
オムロン	2,000	6,798.00	13,596,000	
MCJ	1,500	1,250.00	1,875,000	
日本電気	3,400	9,380.00	31,892,000	
富士通	2,400	20,935.00	50,244,000	
ルネサスエレクトロニクス	17,100	2,689.50	45,990,450	
セイコーエプソン	3,100	2,204.00	6,832,400	
ワコム	2,500	676.00	1,690,000	
アルバック	600	7,516.00	4,509,600	
エレコム	1,100	1,768.00	1,944,800	
パナソニックホールディングス	30,300	1,373.50	41,617,050	
アンリツ	2,200	1,365.00	3,003,000	
ソニーグループ	6,900	14,355.00	99,049,500	
TDK	4,000	7,366.00	29,464,000	
ヒロセ電機	400	17,645.00	7,058,000	
横河電機	2,600	2,963.50	7,705,100	
アズビル	1,600	4,857.00	7,771,200	
日本光電工業	1,200	4,534.00	5,440,800	
堀場製作所	500	12,185.00	6,092,500	
アドバンテスト	7,400	6,049.00	44,762,600	
キーエンス	1,300	65,950.00	85,735,000	
シスメックス	2,100	7,966.00	16,728,600	
フェローテックホールディングス	700	3,120.00	2,184,000	
レーザーテック	1,200	41,530.00	49,836,000	
日本電子	600	7,322.00	4,393,200	

ファナック	12,600	4,316.00	54,381,600
ローム	4,400	2,678.50	11,785,400
浜松ホトニクス	1,900	6,017.00	11,432,300
三井ハイテック	300	7,020.00	2,106,000
新光電気工業	900	5,553.00	4,997,700
京セラ	15,600	2,217.50	34,593,000
太陽誘電	1,500	3,695.00	5,542,500
村田製作所	23,400	3,061.00	71,627,400
小糸製作所	2,700	2,282.50	6,162,750
S C R E E Nホールディングス	800	14,820.00	11,856,000
東京エレクトロン	4,400	28,655.00	126,082,000
トヨタ紡織	1,500	2,447.50	3,671,250
豊田自動織機	2,100	12,770.00	26,817,000
デンソー	21,500	2,323.50	49,955,250
いすゞ自動車	7,000	2,063.50	14,444,500
トヨタ自動車	39,300	2,964.00	116,485,200
カヤバ	300	5,130.00	1,539,000
アイシン	1,900	5,475.00	10,402,500
マツダ	8,200	1,721.50	14,116,300
本田技研工業	62,200	1,593.50	99,115,700
スズキ	4,700	6,403.00	30,094,100
S U B A R U	7,900	2,910.50	22,992,950
ヤマハ発動機	10,500	1,421.50	14,925,750
豊田合成	1,200	2,840.00	3,408,000
シマノ	1,000	21,695.00	21,695,000
テルモ	7,200	4,998.00	35,985,600
島津製作所	3,200	4,128.00	13,209,600
ナカニシ	900	2,535.00	2,281,500
東京精密	600	10,150.00	6,090,000
オリンパス	15,800	2,196.50	34,704,700
H O Y A	4,900	18,740.00	91,826,000
朝日インテック	2,700	2,942.00	7,943,400
バンダイナムコホールディングス	6,800	3,111.00	21,154,800
パイロットコーポレーション	600	4,137.00	2,482,200
ヤマハ	1,600	3,300.00	5,280,000
ビジョン	1,600	1,621.00	2,593,600
任天堂	13,800	7,972.00	110,013,600
中部電力	9,300	1,882.50	17,507,250
関西電力	9,700	1,959.50	19,007,150
電源開発	1,900	2,435.00	4,626,500
イーレックス	900	760.00	684,000
レノバ	900	1,192.00	1,072,800
東京瓦斯	5,300	3,297.00	17,474,100
大阪瓦斯	5,100	3,039.00	15,498,900
S B Sホールディングス	500	2,528.00	1,264,000

ヤマトホールディングス	3,000	2,589.00	7,767,000	
山九	600	5,183.00	3,109,800	
センコーグループホールディングス	1,900	1,146.00	2,177,400	
AZ-COM丸和ホールディングス	800	1,580.00	1,264,000	
SGホールディングス	4,500	1,985.50	8,934,750	
NIPPON EXPRESSホールディングス	800	8,686.00	6,948,800	
日本郵船	7,200	5,108.00	36,777,600	
商船三井	5,400	5,232.00	28,252,800	
川崎汽船	2,100	7,254.00	15,233,400	
NSユニテッド海運	300	5,240.00	1,572,000	
三井倉庫ホールディングス	400	5,000.00	2,000,000	
NECネットエスアイ	1,400	2,263.00	3,168,200	
システナ	4,300	306.00	1,315,800	
日鉄ソリューションズ	700	4,910.00	3,437,000	
TIS	2,500	3,317.00	8,292,500	
コーエーテクモホールディングス	2,100	1,809.50	3,799,950	
ネクソン	5,700	2,420.00	13,794,000	
SHIFT	200	26,740.00	5,348,000	
ティーガイア	800	1,994.00	1,595,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	900	2,472.50	2,225,250	
GMOペイメントゲートウェイ	400	8,796.00	3,518,400	
インターネットイニシアティブ	1,200	3,058.00	3,669,600	
ラクス	1,000	2,434.00	2,434,000	
チェンジホールディングス	800	1,416.00	1,132,800	
野村総合研究所	5,400	4,359.00	23,538,600	
オービック	900	23,180.00	20,862,000	
ジャストシステム	400	3,260.00	1,304,000	
LINEヤフー	35,600	472.20	16,810,320	
トレンドマイクロ	1,100	8,250.00	9,075,000	
日本オラクル	400	12,030.00	4,812,000	
大塚商会	1,200	6,161.00	7,393,200	
電通総研	400	5,810.00	2,324,000	
東映アニメーション	100	17,300.00	1,730,000	
デジタルガレージ	500	3,545.00	1,772,500	
ネットワンシステムズ	900	2,390.00	2,151,000	
BIPROGY	800	4,325.00	3,460,000	
USEN-NEXT HOLDINGS	500	4,400.00	2,200,000	
日本電信電話	487,800	186.30	90,877,140	
KDDI	19,800	4,903.00	97,079,400	6,000株
ソフトバンク	40,800	1,966.00	80,212,800	
光通信	300	25,795.00	7,738,500	
GMOインターネットグループ	1,100	2,678.50	2,946,350	
KADOKAWA	1,200	3,156.00	3,787,200	

東宝	1,500	4,782.00	7,173,000	
N T Tデータグループ	6,800	2,129.50	14,480,600	
D T S	800	3,620.00	2,896,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,200	5,807.00	6,968,400	
カプコン	2,400	5,573.00	13,375,200	
S C S K	2,100	2,895.00	6,079,500	
N S D	1,000	2,778.00	2,778,000	
コナミグループ	1,000	8,853.00	8,853,000	
ソフトバンクグループ	12,700	6,667.00	84,670,900	
双日	2,800	3,469.00	9,713,200	
アルフレッサ ホールディングス	2,400	2,416.00	5,798,400	
神戸物産	1,900	3,860.00	7,334,000	
ダイワボウホールディングス	1,000	3,239.00	3,239,000	
マクニカホールディングス	600	8,347.00	5,008,200	
シップヘルスケアホールディングス	1,100	2,316.00	2,547,600	
メディパルホールディングス	2,400	2,295.00	5,508,000	
I D O M	1,000	852.00	852,000	
伊藤忠商事	17,300	6,667.00	115,339,100	
丸紅	22,400	2,491.50	55,809,600	
豊田通商	2,300	9,653.00	22,201,900	
兼松	1,600	2,264.00	3,622,400	
三井物産	17,600	5,928.00	104,332,800	
住友商事	16,100	3,348.00	53,902,800	
三菱商事	42,600	2,524.00	107,522,400	
キヤノンマーケティングジャパン	900	4,386.00	3,947,400	
阪和興業	600	5,350.00	3,210,000	
岩谷産業	700	6,596.00	4,617,200	
稲畑産業	800	3,160.00	2,528,000	
伊藤忠エネクス	1,300	1,583.00	2,057,900	
加賀電子	500	6,820.00	3,410,000	
P A L T A C	400	4,580.00	1,832,000	
ミスミグループ本社	3,800	2,466.50	9,372,700	
ローソン	600	8,266.00	4,959,600	
エービーシー・マート	1,200	2,582.00	3,098,400	
アスクル	800	2,109.00	1,687,200	
日本マクドナルドホールディングス	1,500	6,560.00	9,840,000	
セリア	600	2,739.00	1,643,400	
M o n o t a R O	3,500	1,444.00	5,054,000	
マツキヨココカラ&カンパニー	4,700	2,699.00	12,685,300	
Z O Z O	1,600	3,300.00	5,280,000	
ウエルシアホールディングス	1,300	2,358.00	3,065,400	
クリエイトSDホールディングス	900	3,165.00	2,848,500	
ネクステージ	600	2,313.00	1,387,800	
コスモス薬品	300	15,490.00	4,647,000	

セブン&アイ・ホールディングス	9,300	5,785.00	53,800,500	
ツルハホールディングス	500	12,635.00	6,317,500	
クスリのアオキホールディングス	900	3,225.00	2,902,500	
FOOD & LIFE COMPANIES	1,300	3,008.00	3,910,400	
ノジマ	900	1,902.00	1,711,800	
良品計画	2,700	2,328.00	6,285,600	
コーナン商事	400	3,900.00	1,560,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	5,200	3,230.00	16,796,000	
ゼンショーホールディングス	1,400	7,190.00	10,066,000	
ワークマン	400	4,155.00	1,662,000	
V Tホールディングス	1,800	532.00	957,600	
スギホールディングス	600	6,757.00	4,054,200	
日本瓦斯	1,300	2,356.00	3,062,800	
ライフコーポレーション	500	3,760.00	1,880,000	
コメリ	700	3,320.00	2,324,000	
しまむら	300	16,700.00	5,010,000	
イズミ	700	3,440.00	2,408,000	
ヤオコー	300	8,427.00	2,528,100	
ケーズホールディングス	1,800	1,342.00	2,415,600	
ニトリホールディングス	1,000	19,465.00	19,465,000	
ファーストリテイリング	1,200	38,960.00	46,752,000	
サンドラッグ	900	4,484.00	4,035,600	
めぶきフィナンシャルグループ	12,200	444.30	5,420,460	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	12,900	704.00	9,081,600	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	83,900	1,383.50	116,075,650	20,000株
りそなホールディングス	29,300	810.60	23,750,580	
三井住友トラスト・ホールディングス	8,600	2,959.50	25,451,700	
三井住友フィナンシャルグループ	14,200	7,645.00	108,559,000	
千葉銀行	6,900	1,095.00	7,555,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	2,300	3,581.00	8,236,300	
セブン銀行	8,300	305.00	2,531,500	
みずほフィナンシャルグループ	33,600	2,671.50	89,762,400	
SBIホールディングス	3,400	3,629.00	12,338,600	
ジャフコグループ	900	1,699.50	1,529,550	
大和証券グループ本社	18,700	1,060.50	19,831,350	
野村ホールディングス	43,200	757.60	32,728,320	
マネックスグループ	2,500	755.00	1,887,500	
SOMP Oホールディングス	3,800	7,530.00	28,614,000	
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	5,500	6,025.00	33,137,500	
第一生命ホールディングス	12,300	3,181.00	39,126,300	
東京海上ホールディングス	25,200	3,820.00	96,264,000	
全国保証	800	5,504.00	4,403,200	

芙蓉総合リース	300	13,205.00	3,961,500
みずほリース	700	5,290.00	3,703,000
東京センチュリー	2,500	1,624.00	4,060,000
イオンフィナンシャルサービス	1,700	1,325.00	2,252,500
アコム	4,500	369.80	1,664,100
ジャックス	600	5,810.00	3,486,000
オリエントコーポレーション	1,600	1,114.00	1,782,400
オリックス	15,500	2,856.00	44,268,000
三菱HCキャピタル	10,700	1,026.00	10,978,200
日本取引所グループ	6,500	3,180.00	20,670,000
大東建託	900	16,125.00	14,512,500
ヒューリック	5,800	1,555.50	9,021,900
野村不動産ホールディングス	1,700	3,973.00	6,754,100
プレサンスコーポレーション	900	1,667.00	1,500,300
オープンハウスグループ	800	4,535.00	3,628,000
東急不動産ホールディングス	6,800	994.50	6,762,600
飯田グループホールディングス	2,200	2,272.00	4,998,400
ケイアイスター不動産	300	3,540.00	1,062,000
三井不動産	11,500	3,665.00	42,147,500
三菱地所	16,300	2,029.00	33,072,700
東京建物	2,600	2,242.00	5,829,200
住友不動産	3,500	4,571.00	15,998,500
スターツコーポレーション	800	3,055.00	2,444,000
カチタス	1,000	1,914.00	1,914,000
日本M&Aセンターホールディングス	4,100	780.90	3,201,690
UTグループ	700	2,420.00	1,694,000
パソナグループ	600	2,700.00	1,620,000
エス・エム・エス	1,100	2,620.00	2,882,000
パーソルホールディングス	25,000	233.90	5,847,500
総合警備保障	4,000	798.10	3,192,400
カカクコム	1,700	1,700.00	2,890,000
ディップ	600	2,539.00	1,523,400
ベネフィット・ワン	1,100	2,133.50	2,346,850
エムスリー	5,000	2,437.00	12,185,000
博報堂DYホールディングス	2,900	1,120.00	3,248,000
H.U.グループホールディングス	900	2,720.50	2,448,450
ビー・エム・エル	600	2,850.00	1,710,000
ユー・エス・エス	2,600	2,829.00	7,355,400
サイバーエージェント	5,300	948.80	5,028,640
フルキャストホールディングス	900	1,797.00	1,617,300
テクノプロ・ホールディングス	1,400	3,514.00	4,919,600
ジャパンマテリアル	1,000	2,540.00	2,540,000
リクルートホールディングス	19,500	5,914.00	115,323,000
ベルシステム24ホールディングス	800	1,765.00	1,412,000
ペイカレント・コンサルティング	1,900	3,490.00	6,631,000

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	800	2,215.00	1,772,000	
リログループ	1,700	1,603.00	2,725,100	
トランス・コスモス	600	3,130.00	1,878,000	
セコム	2,600	10,775.00	28,015,000	
メイテックグループホールディングス	1,300	2,905.00	3,776,500	
イオンディライト	700	3,750.00	2,625,000	
合 計	2,477,100	-	6,581,155,550	

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

「TMA日本株アクティブマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	[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			
金銭信託		431,650	212,118
コール・ローン		695,012,305	771,587,819
株式		81,197,835,070	101,132,817,080
未収入金		28,772,914	145,313,161
未収配当金		51,835,400	94,082,250
流動資産合計		81,973,887,339	102,144,012,428
資産合計		81,973,887,339	102,144,012,428
負債の部			
流動負債			
未払金		31,762,811	161,909,310
未払解約金		132,326,017	173,078,827
未払利息		337	346
流動負債合計		164,089,165	334,988,483
負債合計		164,089,165	334,988,483
純資産の部			
元本等			
元本	1	37,080,085,188	36,595,983,656
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		44,729,712,986	65,213,040,289
元本等合計		81,809,798,174	101,809,023,945
純資産合計		81,809,798,174	101,809,023,945
負債純資産合計		81,973,887,339	102,144,012,428

(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	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

自 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	35,961,310,316円	37,080,085,188円
同期中における追加設定元本額	7,021,032,890円	5,710,975,637円
同期中における一部解約元本額	5,902,258,018円	6,195,077,169円
同期末における元本額	37,080,085,188円	36,595,983,656円
元本の内訳*		
日本株アクティブファンド<適格機関投資家限定>	109,197,960円	116,045,399円
東京海上セレクション・日本株式	16,168,890,465円	16,001,886,095円
東京海上セレクション・バランス30	1,312,424,300円	1,198,785,062円
東京海上セレクション・バランス50	5,253,932,256円	5,024,572,629円
東京海上セレクション・バランス70	5,360,096,121円	5,398,852,887円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	198,823,934円	293,431,143円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	11,459,232円	9,006,142円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	22,223,787円	19,432,916円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	2,604,943円	2,529,594円
東京海上・日本株式GARP<適格機関投資家限定>	8,640,432,190円	8,531,441,789円
計	37,080,085,188円	36,595,983,656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	37,080,085,188口	36,595,983,656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
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 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(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	2,396,726,457円
合計	2,396,726,457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	18,849,428,208円
合計	18,849,428,208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。

（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)	2.2063円 22,063円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.7820円 27,820円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
サカタのタネ	82,700	3,715.00	307,230,500	
ショーボンドホールディングス	74,500	6,664.00	496,468,000	
大和ハウス工業	237,000	4,512.00	1,069,344,000	
日揮ホールディングス	234,200	1,695.00	396,969,000	
山崎製パン	148,700	3,658.00	543,944,600	
森永乳業	92,700	2,994.50	277,590,150	
アサヒグループホールディングス	163,000	5,474.00	892,262,000	
味の素	188,100	6,060.00	1,139,886,000	
ニチレイ	187,300	3,544.00	663,791,200	
東レ	577,100	724.60	418,166,660	
信越化学工業	703,900	5,867.00	4,129,781,300	
エア・ウォーター	287,500	1,958.50	563,068,750	
三井化学	180,100	4,398.00	792,079,800	
東京応化工業	273,300	3,469.00	948,077,700	
小林製薬	35,800	6,657.00	238,320,600	
ユニ・チャーム	78,400	5,058.00	396,547,200	
アステラス製薬	468,200	1,701.00	796,408,200	
中外製薬	361,200	5,455.00	1,970,346,000	
エーザイ	42,800	6,951.00	297,502,800	
ロート製薬	153,900	2,983.50	459,160,650	
J C R ファーマ	552,600	1,121.00	619,464,600	
第一三共	804,600	4,300.00	3,459,780,000	
日本製鉄	209,700	3,479.00	729,546,300	
住友電気工業	518,600	1,933.50	1,002,713,100	
三浦工業	161,800	2,770.00	448,186,000	
D M G 森精機	328,600	2,952.50	970,191,500	
ディスコ	65,900	41,480.00	2,733,532,000	
S M C	14,700	83,310.00	1,224,657,000	
小松製作所	237,600	3,914.00	929,966,400	
ホシザキ	149,000	5,340.00	795,660,000	
イビデン	193,600	7,886.00	1,526,729,600	
日立製作所	261,500	11,385.00	2,977,177,500	
富士電機	151,600	7,419.00	1,124,720,400	
ニデック	87,500	5,712.00	499,800,000	
日本電気	53,900	9,380.00	505,582,000	

富士通	48,500	20,935.00	1,015,347,500	
ルネサスエレクトロニクス	1,325,600	2,689.50	3,565,201,200	
パナソニック ホールディングス	423,700	1,373.50	581,951,950	
ソニーグループ	323,200	14,355.00	4,639,536,000	
TDK	140,000	7,366.00	1,031,240,000	
アドバンテスト	258,100	6,049.00	1,561,246,900	
キーエンス	35,800	65,950.00	2,361,010,000	
シスメックス	36,100	7,966.00	287,572,600	
村田製作所	649,700	3,061.00	1,988,731,700	
東京エレクトロン	99,600	28,655.00	2,854,038,000	
デンソー	406,000	2,323.50	943,341,000	
トヨタ自動車	1,754,800	2,964.00	5,201,227,200	
本田技研工業	447,300	1,593.50	712,772,550	
スズキ	184,700	6,403.00	1,182,634,100	
テルモ	178,200	4,998.00	890,643,600	
バンダイナムコホールディングス	523,800	3,111.00	1,629,541,800	
アシックス	158,400	4,494.00	711,849,600	
任天堂	172,900	7,972.00	1,378,358,800	
東日本旅客鉄道	184,100	8,426.00	1,551,226,600	
九州旅客鉄道	188,000	3,198.00	601,224,000	
SGホールディングス	450,900	1,985.50	895,261,950	
GMOペイメントゲートウェイ	133,500	8,796.00	1,174,266,000	
Appier Group	124,600	1,813.00	225,899,800	
野村総合研究所	321,600	4,359.00	1,401,854,400	
J TOWER	72,300	4,785.00	345,955,500	
大塚商会	85,600	6,161.00	527,381,600	
ANYCOLOR	148,800	3,775.00	561,720,000	
日本電信電話	10,583,800	186.30	1,971,761,940	
KADOKAWA	182,900	3,156.00	577,232,400	
東宝	104,500	4,782.00	499,719,000	
カプコン	110,000	5,573.00	613,030,000	
コナミグループ	99,400	8,853.00	879,988,200	
ソフトバンクグループ	320,400	6,667.00	2,136,106,800	
伊藤忠商事	144,700	6,667.00	964,714,900	
三菱商事	388,100	2,524.00	979,564,400	
トラスコ中山	153,700	2,479.00	381,022,300	
エービーシー・マート	444,400	2,582.00	1,147,440,800	
良品計画	363,900	2,328.00	847,159,200	
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	255,200	3,230.00	824,296,000	
ニトリホールディングス	25,600	19,465.00	498,304,000	
ファーストリテイリング	15,100	38,960.00	588,296,000	
楽天銀行	242,100	2,315.00	560,461,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,475,200	1,383.50	3,424,439,200	
三井住友フィナンシャルグループ	286,900	7,645.00	2,193,350,500	

千葉銀行	437,500	1,095.00	479,062,500	
T & Dホールディングス	181,300	2,382.00	431,856,600	
オリックス	359,300	2,856.00	1,026,160,800	
S R Eホールディングス	87,800	2,779.00	243,996,200	
三井不動産	144,400	3,665.00	529,226,000	
エムスリー	126,200	2,437.00	307,549,400	
サイバーエージェント	674,100	948.80	639,586,080	
リクルートホールディングス	175,400	5,914.00	1,037,315,600	
ベイカレント・コンサルティング	224,300	3,490.00	782,807,000	
アンビスホールディングス	148,100	2,719.00	402,683,900	
合 計	35,991,700	-	101,132,817,080	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「TMA外国債券インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	[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			
預金		41,652,155	100,656,584
コール・ローン		27,761,637	47,267,448
国債証券		13,014,141,470	18,933,471,567
未収利息		81,921,771	144,129,802
前払費用		7,283,851	15,722,579
流動資産合計		13,172,760,884	19,241,247,980
資産合計		13,172,760,884	19,241,247,980
負債の部			
流動負債			
未払金			21,186,745
未払解約金		18,357,395	31,848,913
未払利息		13	21
流動負債合計		18,357,408	53,035,679
負債合計		18,357,408	53,035,679
純資産の部			
元本等			
元本	1	7,737,975,705	9,924,087,582
剰余金			
剰余金又は欠損金()		5,416,427,771	9,264,124,719
元本等合計		13,154,403,476	19,188,212,301
純資産合計		13,154,403,476	19,188,212,301
負債純資産合計		13,172,760,884	19,241,247,980

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[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	5,942,840,376円	7,737,975,705円
同期中における追加設定元本額	2,793,945,488円	3,322,941,314円
同期中における一部解約元本額	998,810,159円	1,136,829,437円
同期末における元本額	7,737,975,705円	9,924,087,582円
元本の内訳*		
東京海上セレクション・外国債券インデックス	4,838,451,794円	5,985,783,289円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型）	247,034,039円	402,858,872円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	110,052,574円	183,626,027円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	56,161,429円	99,133,432円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	34,507,253円	62,954,554円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	56,800,810円	100,152,462円
TMA外国債券インデックスVA<適格機 関投資家限定>	37,476,579円	20,115,363円
東京海上・世界インデックス・バランス40 <適格機関投資家限定>	550,363,074円	681,108,831円
東京海上・世界インデックス・バランス60 <適格機関投資家限定>	1,807,128,153円	2,388,354,752円
計	7,737,975,705円	9,924,087,582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	7,737,975,705口	9,924,087,582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、為替予約取引が含 まれております。当該有価証券 及びデリバティブ取引には、性 質に応じてそれぞれ価格変動リ スク、流動性リスク、信用リス ク等があります。	同左

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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[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 （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>
<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。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。</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
国債証券	342,354,032円
合計	342,354,032円

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

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

（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	497,164,632円
合計	497,164,632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。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（2023年1月25日現在）

該当事項はありません。

（2024年1月25日現在）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

[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	1.7000円	1口当たり純資産額	1.9335円
（1万口当たり純資産額	17,000円）	（1万口当たり純資産額	19,335円）

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル			米ドル	
		T 0 1/2 02/28/26	100,000.00	92,343.75	
		T 0 1/2 04/30/27	100,000.00	88,890.62	
		T 0 1/2 05/31/27	200,000.00	177,234.37	
		T 0 1/2 06/30/27	100,000.00	88,375.00	
		T 0 1/2 08/31/27	300,000.00	263,765.62	
		T 0 1/2 10/31/27	200,000.00	174,843.75	
		T 0 1/4 05/31/25	200,000.00	188,593.75	
		T 0 1/4 06/30/25	300,000.00	282,187.50	
		T 0 1/4 07/31/25	100,000.00	93,742.18	
		T 0 1/4 08/31/25	300,000.00	280,312.50	
		T 0 1/4 09/30/25	200,000.00	186,375.00	
		T 0 1/4 10/31/25	400,000.00	371,750.00	
		T 0 3/4 01/31/28	300,000.00	262,781.25	
		T 0 3/4 03/31/26	300,000.00	278,015.62	
		T 0 3/4 04/30/26	200,000.00	184,750.00	
		T 0 3/4 05/31/26	100,000.00	92,140.62	
		T 0 3/4 08/31/26	300,000.00	274,429.68	
		T 0 3/8 01/31/26	500,000.00	461,718.75	
		T 0 3/8 04/30/25	100,000.00	94,750.00	
		T 0 3/8 07/31/27	200,000.00	175,531.25	
		T 0 3/8 09/30/27	400,000.00	349,000.00	
		T 0 3/8 11/30/25	100,000.00	92,843.75	
		T 0 3/8 12/31/25	300,000.00	277,875.00	
		T 0 5/8 05/15/30	400,000.00	322,531.25	
		T 0 5/8 07/31/26	300,000.00	274,171.87	
		T 0 5/8 08/15/30	400,000.00	319,968.75	
		T 0 5/8 11/30/27	400,000.00	350,375.00	
		T 0 5/8 12/31/27	300,000.00	262,101.56	
		T 0 7/8 06/30/26	200,000.00	184,531.25	
		T 0 7/8 09/30/26	400,000.00	366,531.25	
		T 0 7/8 11/15/30	500,000.00	404,882.15	
		T 1 07/31/28	300,000.00	261,820.31	
		T 1 1/2 01/31/27	200,000.00	184,906.25	
		T 1 1/2 02/15/25	300,000.00	289,781.25	
		T 1 1/2 02/15/30	500,000.00	429,765.62	
		T 1 1/2 11/30/28	400,000.00	354,500.00	
		T 1 1/4 04/30/28	300,000.00	266,554.68	
		T 1 1/4 05/15/50	200,000.00	100,078.12	
		T 1 1/4 05/31/28	300,000.00	265,992.18	
T 1 1/4 06/30/28	200,000.00	176,953.12			
T 1 1/4 08/15/31	500,000.00	406,914.06			

T 1 1/4 09/30/28	400,000.00	351,625.00	
T 1 1/4 11/30/26	500,000.00	460,585.94	
T 1 1/4 12/31/26	600,000.00	551,953.12	
T 1 1/8 01/15/25	300,000.00	289,406.25	
T 1 1/8 02/15/31	500,000.00	410,664.06	
T 1 1/8 02/28/25	300,000.00	288,421.87	
T 1 1/8 02/29/28	300,000.00	266,367.18	
T 1 1/8 05/15/40	200,000.00	123,109.37	
T 1 1/8 08/15/40	100,000.00	60,812.50	
T 1 1/8 08/31/28	300,000.00	262,757.81	
T 1 1/8 10/31/26	400,000.00	368,031.25	
T 1 3/4 01/31/29	200,000.00	178,828.12	
T 1 3/4 03/15/25	200,000.00	193,375.00	
T 1 3/4 08/15/41	300,000.00	199,406.25	
T 1 3/4 11/15/29	300,000.00	264,539.06	
T 1 3/4 12/31/24	600,000.00	582,984.37	
T 1 3/4 12/31/26	300,000.00	280,054.68	
T 1 3/8 01/31/25	200,000.00	193,171.87	
T 1 3/8 08/15/50	200,000.00	103,609.37	
T 1 3/8 10/31/28	400,000.00	353,093.75	
T 1 3/8 11/15/31	900,000.00	734,695.31	
T 1 3/8 11/15/40	400,000.00	253,250.00	
T 1 3/8 12/31/28	600,000.00	527,437.50	
T 1 5/8 02/15/26	600,000.00	567,843.75	
T 1 5/8 05/15/26	200,000.00	188,312.50	
T 1 5/8 05/15/31	500,000.00	421,757.81	
T 1 5/8 08/15/29	300,000.00	263,531.25	
T 1 5/8 09/30/26	200,000.00	186,953.12	
T 1 5/8 11/15/50	500,000.00	277,226.56	
T 1 5/8 11/30/26	300,000.00	279,445.31	
T 1 7/8 02/15/32	500,000.00	422,343.75	
T 1 7/8 02/15/41	300,000.00	206,250.00	
T 1 7/8 02/15/51	300,000.00	177,562.50	
T 1 7/8 02/28/27	300,000.00	280,054.68	
T 1 7/8 02/28/29	200,000.00	179,671.87	
T 1 7/8 07/31/26	100,000.00	94,398.43	
T 1 7/8 11/15/51	600,000.00	353,250.00	
T 2 02/15/25	200,000.00	194,187.50	
T 2 02/15/50	500,000.00	307,968.75	
T 2 08/15/25	800,000.00	769,625.00	
T 2 08/15/51	400,000.00	243,750.00	
T 2 1/2 02/15/46	100,000.00	71,390.62	
T 2 1/2 03/31/27	200,000.00	190,171.87	

T 2 1/2 05/15/46	100,000.00	71,187.50	
T 2 1/4 02/15/52	300,000.00	194,250.00	
T 2 1/4 05/15/41	300,000.00	218,671.87	
T 2 1/4 08/15/27	100,000.00	93,710.93	
T 2 1/4 08/15/46	200,000.00	134,921.87	
T 2 1/4 08/15/49	200,000.00	131,187.50	
T 2 1/4 11/15/27	400,000.00	373,593.75	
T 2 1/8 05/15/25	300,000.00	290,437.50	
T 2 11/15/26	100,000.00	94,164.06	
T 2 11/15/41	700,000.00	484,531.25	
T 2 3/4 02/15/28	600,000.00	569,203.12	
T 2 3/4 04/30/27	200,000.00	191,453.12	
T 2 3/4 05/15/25	300,000.00	292,921.87	
T 2 3/4 05/31/29	200,000.00	187,000.00	
T 2 3/4 07/31/27	300,000.00	286,265.62	
T 2 3/4 08/15/32	300,000.00	269,460.93	
T 2 3/4 08/15/42	100,000.00	77,695.31	
T 2 3/4 08/15/47	100,000.00	73,835.93	
T 2 3/4 11/15/42	200,000.00	154,953.12	
T 2 3/4 11/15/47	200,000.00	147,343.74	
T 2 3/8 02/15/42	300,000.00	220,218.75	
T 2 3/8 03/31/29	300,000.00	275,835.93	
T 2 3/8 05/15/27	100,000.00	94,468.75	
T 2 3/8 05/15/29	100,000.00	91,789.06	
T 2 3/8 05/15/51	300,000.00	200,507.81	
T 2 3/8 11/15/49	400,000.00	269,468.75	
T 2 5/8 01/31/26	100,000.00	96,656.25	
T 2 5/8 02/15/29	100,000.00	93,265.62	
T 2 5/8 03/31/25	100,000.00	97,671.87	
T 2 5/8 04/15/25	200,000.00	195,062.50	
T 2 5/8 05/31/27	200,000.00	190,390.62	
T 2 5/8 07/31/29	200,000.00	185,265.62	
T 2 7/8 04/30/29	200,000.00	188,359.37	
T 2 7/8 05/15/28	100,000.00	95,109.37	
T 2 7/8 05/15/32	600,000.00	545,812.50	
T 2 7/8 05/15/43	100,000.00	78,601.56	
T 2 7/8 05/15/52	300,000.00	223,945.31	
T 2 7/8 05/31/25	200,000.00	195,515.62	
T 2 7/8 06/15/25	300,000.00	293,085.93	
T 2 7/8 07/31/25	100,000.00	97,539.06	
T 2 7/8 08/15/28	100,000.00	94,890.62	
T 2 7/8 08/15/45	100,000.00	76,984.37	
T 2 7/8 11/15/46	200,000.00	152,171.86	

T 3 02/15/47	300,000.00	232,992.18	
T 3 02/15/48	300,000.00	231,539.06	
T 3 02/15/49	400,000.00	307,406.25	
T 3 05/15/47	100,000.00	77,531.25	
T 3 07/15/25	300,000.00	293,320.31	
T 3 08/15/48	200,000.00	154,031.25	
T 3 08/15/52	300,000.00	229,921.87	
T 3 1/2 01/31/28	300,000.00	293,039.06	
T 3 1/2 01/31/30	200,000.00	193,265.62	
T 3 1/2 02/15/33	500,000.00	474,765.62	
T 3 1/2 04/30/30	200,000.00	192,968.75	
T 3 1/2 09/15/25	200,000.00	196,796.87	
T 3 1/4 05/15/42	100,000.00	84,148.43	
T 3 1/4 06/30/27	300,000.00	291,421.87	
T 3 1/4 06/30/29	200,000.00	191,515.62	
T 3 1/8 02/15/43	100,000.00	81,976.56	
T 3 1/8 05/15/48	100,000.00	78,906.25	
T 3 1/8 08/15/25	300,000.00	293,648.43	
T 3 1/8 08/15/44	300,000.00	243,304.68	
T 3 1/8 08/31/27	300,000.00	289,803.24	
T 3 1/8 08/31/29	100,000.00	94,984.37	
T 3 1/8 11/15/28	200,000.00	191,468.75	
T 3 1/8 11/15/41	100,000.00	83,164.06	
T 3 11/15/44	100,000.00	79,171.87	
T 3 11/15/45	400,000.00	314,187.50	
T 3 3/4 04/15/26	200,000.00	197,546.87	
T 3 3/4 05/31/30	200,000.00	195,609.37	
T 3 3/4 06/30/30	200,000.00	195,562.50	
T 3 3/4 11/15/43	200,000.00	179,406.25	
T 3 3/8 05/15/33	500,000.00	469,453.12	
T 3 3/8 08/15/42	300,000.00	256,640.62	
T 3 3/8 11/15/48	300,000.00	247,382.81	
T 3 5/8 02/15/44	100,000.00	87,960.93	
T 3 5/8 02/15/53	300,000.00	260,507.81	
T 3 5/8 03/31/28	300,000.00	294,304.68	
T 3 5/8 03/31/30	300,000.00	291,585.93	
T 3 5/8 05/15/26	400,000.00	394,031.25	
T 3 5/8 05/15/53	300,000.00	260,765.62	
T 3 5/8 05/31/28	600,000.00	588,620.76	
T 3 5/8 08/15/43	100,000.00	88,148.43	
T 3 7/8 01/15/26	300,000.00	297,000.00	
T 3 7/8 02/15/43	100,000.00	91,531.25	
T 3 7/8 03/31/25	100,000.00	99,023.27	

T 3 7/8 05/15/43	300,000.00	274,453.12	
T 3 7/8 08/15/33	600,000.00	585,726.54	
T 3 7/8 08/15/40	200,000.00	186,765.62	
T 3 7/8 09/30/29	300,000.00	296,109.37	
T 3 7/8 11/30/27	400,000.00	396,156.25	
T 3 7/8 11/30/29	100,000.00	98,648.43	
T 3 7/8 12/31/27	1,100,000.00	1,089,773.44	
T 3 7/8 12/31/29	700,000.00	690,375.00	
T 4 02/15/26	100,000.00	99,257.81	
T 4 02/28/30	100,000.00	99,242.18	
T 4 02/29/28	200,000.00	199,031.25	
T 4 07/31/30	300,000.00	297,492.18	
T 4 1/2 07/15/26	200,000.00	201,015.62	
T 4 1/2 11/15/25	300,000.00	300,187.50	
T 4 1/2 11/15/33	500,000.00	512,773.43	
T 4 1/4 10/15/25	300,000.00	298,757.81	
T 4 1/4 11/15/40	100,000.00	97,757.81	
T 4 1/4 12/31/24	100,000.00	99,398.43	
T 4 1/8 01/31/25	300,000.00	297,843.75	
T 4 1/8 06/15/26	500,000.00	498,046.87	
T 4 1/8 07/31/28	500,000.00	500,351.56	
T 4 1/8 08/15/53	400,000.00	380,718.72	
T 4 1/8 08/31/30	200,000.00	199,671.87	
T 4 1/8 09/30/27	200,000.00	199,812.50	
T 4 1/8 10/31/27	300,000.00	299,742.18	
T 4 1/8 11/15/32	900,000.00	896,906.25	
T 4 10/31/29	300,000.00	297,820.31	
T 4 11/15/42	300,000.00	280,171.87	
T 4 11/15/52	400,000.00	372,000.00	
T 4 12/15/25	300,000.00	297,679.68	
T 4 3/4 02/15/41	100,000.00	103,679.68	
T 4 3/4 07/31/25	900,000.00	902,460.91	
T 4 3/4 11/15/43	200,000.00	205,953.12	
T 4 3/4 11/15/53	200,000.00	211,390.62	
T 4 3/8 02/15/38	100,000.00	101,171.87	
T 4 3/8 05/15/40	100,000.00	99,570.31	
T 4 3/8 08/15/43	200,000.00	195,937.50	
T 4 3/8 08/31/28	100,000.00	101,132.81	
T 4 3/8 11/15/39	200,000.00	199,671.87	
T 4 3/8 11/30/28	500,000.00	506,171.86	
T 4 3/8 11/30/30	300,000.00	303,937.50	
T 4 3/8 12/15/26	500,000.00	502,246.05	
T 4 5/8 02/28/25	300,000.00	299,517.63	

	T 4 5/8 03/15/26	100,000.00	100,546.87	
	T 4 5/8 09/15/26	800,000.00	807,375.00	
	T 4 5/8 09/30/30	200,000.00	205,484.37	
	T 4 5/8 10/15/26	200,000.00	201,945.31	
	T 4 5/8 11/15/26	500,000.00	505,214.82	
	T 4 7/8 10/31/28	1,000,000.00	1,032,734.35	
	T 4 7/8 10/31/30	200,000.00	208,429.68	
	T 4 7/8 11/30/25	1,000,000.00	1,007,382.80	
	T 5 05/15/37	50,000.00	54,035.15	
	T 5 08/31/25	200,000.00	201,343.74	
	T 5 10/31/25	1,000,000.00	1,008,632.80	
	T 5 3/8 02/15/31	100,000.00	107,945.31	
	米ドル小計	67,150,000.00	60,625,850.09 (8,964,138,194)	
		銘柄数	225	
		比 率	46.7%	47.3%
	加ドル			加ドル
	CAN 0 1/2 09/01/25	100,000.00	94,273.00	
	CAN 0 1/2 12/01/30	200,000.00	164,170.00	
	CAN 0 1/4 03/01/26	100,000.00	92,640.00	
	CAN 1 06/01/27	100,000.00	91,880.00	
	CAN 1 1/2 06/01/26	100,000.00	94,750.00	
	CAN 1 1/2 06/01/31	200,000.00	174,960.00	
	CAN 1 1/2 12/01/31	200,000.00	172,796.00	
	CAN 1 1/4 03/01/25	100,000.00	96,517.00	
	CAN 1 1/4 06/01/30	100,000.00	87,455.00	
	CAN 1 3/4 12/01/53	200,000.00	138,120.00	
	CAN 2 06/01/28	100,000.00	93,939.00	
	CAN 2 06/01/32	100,000.00	89,610.00	
	CAN 2 1/2 12/01/32	200,000.00	185,720.00	
	CAN 2 1/4 06/01/29	100,000.00	94,185.00	
	CAN 2 12/01/51	200,000.00	147,356.00	
	CAN 2 3/4 09/01/27	100,000.00	97,085.00	
	CAN 2 3/4 12/01/48	100,000.00	87,777.00	
	CAN 2 3/4 12/01/55	100,000.00	87,210.00	
	CAN 3 04/01/26	100,000.00	98,045.00	
	CAN 3 1/2 08/01/25	100,000.00	98,760.00	
	CAN 3 1/2 12/01/45	100,000.00	99,783.00	
	CAN 3 1/4 09/01/28	100,000.00	98,741.00	
	CAN 3 10/01/25	100,000.00	97,995.40	
	CAN 3 3/4 02/01/25	100,000.00	99,061.00	
	CAN 3 3/4 05/01/25	100,000.00	99,094.00	
	CAN 4 03/01/29	100,000.00	102,480.00	
	CAN 4 06/01/41	100,000.00	106,018.00	

	CAN 4 1/2 02/01/26	100,000.00	100,920.00	
	CAN 4 1/2 11/01/25	200,000.00	201,028.00	
	CAN 5 3/4 06/01/33	200,000.00	235,586.00	
加ドル小計		3,800,000.00	3,527,954.40 (385,605,415)	
	銘柄数	30		
	比率	2.0%	2.0%	
メキシコペソ			メキシコペソ	
	MBONO 10 11/20/36	400,000.00	426,356.00	
	MBONO 5 03/06/25	1,200,000.00	1,140,150.00	
	MBONO 5 1/2 03/04/27	2,400,000.00	2,146,454.40	
	MBONO 5 3/4 03/05/26	2,200,000.00	2,042,739.60	
	MBONO 7 09/03/26	700,000.00	656,141.50	
	MBONO 7 1/2 05/26/33	1,500,000.00	1,335,681.00	
	MBONO 7 1/2 06/03/27	1,700,000.00	1,619,076.60	
	MBONO 7 3/4 05/29/31	2,400,000.00	2,226,616.80	
	MBONO 7 3/4 11/13/42	1,700,000.00	1,466,785.50	
	MBONO 7 3/4 11/23/34	500,000.00	451,061.00	
	MBONO 8 05/24/35	100,000.00	90,142.50	
	MBONO 8 07/31/53	1,100,000.00	950,063.40	
	MBONO 8 1/2 03/01/29	500,000.00	484,939.50	
	MBONO 8 1/2 05/31/29	1,500,000.00	1,470,004.50	
	MBONO 8 1/2 11/18/38	1,200,000.00	1,123,474.80	
	MBONO 8 11/07/47	1,400,000.00	1,220,955.40	
メキシコペソ小計		20,500,000.00	18,850,642.50 (161,663,110)	
	銘柄数	16		
	比率	0.8%	0.9%	
ユーロ			ユーロ	
	BGB 0 10/22/27	100,000.00	91,830.00	
	BGB 0 10/22/31	100,000.00	81,100.00	
	BGB 0.1 06/22/30	100,000.00	85,260.00	
	BGB 0.35 06/22/32	100,000.00	81,850.00	
	BGB 0.8 06/22/25	100,000.00	96,300.00	
	BGB 0.8 06/22/27	100,000.00	94,305.00	
	BGB 0.8 06/22/28	100,000.00	92,590.00	
	BGB 0.9 06/22/29	100,000.00	91,615.00	
	BGB 1 06/22/26	200,000.00	192,160.00	
	BGB 1 06/22/31	100,000.00	88,570.00	
	BGB 1 1/4 04/22/33	100,000.00	87,620.00	
	BGB 1.4 06/22/53	100,000.00	63,920.00	
	BGB 1.6 06/22/47	100,000.00	72,280.00	
	BGB 1.7 06/22/50	100,000.00	70,750.00	
	BGB 1.9 06/22/38	100,000.00	85,270.00	

BGB 3 06/22/34	100,000.00	100,590.00	
BGB 3 3/4 06/22/45	100,000.00	106,410.00	
BGB 3.3 06/22/54	100,000.00	97,320.00	
BGB 4 1/4 03/28/41	100,000.00	113,070.00	
BGB 5 03/28/35	100,000.00	118,830.00	
BGB 5 1/2 03/28/28	100,000.00	111,550.00	
BKO 2 1/2 03/13/25	100,000.00	99,301.00	
BKO 2.8 06/12/25	100,000.00	99,756.00	
BKO 3.1 09/18/25	100,000.00	100,441.00	
BKO 3.1 12/12/25	200,000.00	201,420.00	
BTPS 0 04/01/26	200,000.00	187,240.00	
BTPS 0 08/01/26	200,000.00	185,480.00	
BTPS 0 1/2 02/01/26	100,000.00	95,000.00	
BTPS 0 1/2 07/15/28	100,000.00	89,030.00	
BTPS 0 1/4 03/15/28	100,000.00	88,930.00	
BTPS 0.35 02/01/25	200,000.00	194,040.00	
BTPS 0.45 02/15/29	100,000.00	87,030.00	
BTPS 0.6 08/01/31	100,000.00	80,700.00	
BTPS 0.85 01/15/27	300,000.00	281,910.00	
BTPS 0.9 04/01/31	100,000.00	83,490.00	
BTPS 0.95 03/01/37	200,000.00	137,380.00	
BTPS 0.95 06/01/32	100,000.00	80,780.00	
BTPS 0.95 08/01/30	200,000.00	170,900.00	
BTPS 0.95 12/01/31	200,000.00	164,120.00	
BTPS 1 1/2 04/30/45	100,000.00	61,700.00	
BTPS 1 1/2 06/01/25	100,000.00	97,700.00	
BTPS 1.1 04/01/27	100,000.00	94,160.00	
BTPS 1.2 08/15/25	200,000.00	194,080.00	
BTPS 1.45 03/01/36	100,000.00	75,610.00	
BTPS 1.6 06/01/26	200,000.00	193,620.00	
BTPS 1.65 03/01/32	100,000.00	86,410.00	
BTPS 1.65 12/01/30	200,000.00	177,600.00	
BTPS 1.7 09/01/51	100,000.00	59,540.00	
BTPS 1.8 03/01/41	100,000.00	70,570.00	
BTPS 1.85 07/01/25	200,000.00	196,240.00	
BTPS 2 02/01/28	100,000.00	95,850.00	
BTPS 2 1/2 12/01/32	200,000.00	182,120.00	
BTPS 2 1/4 09/01/36	100,000.00	82,390.00	
BTPS 2 12/01/25	100,000.00	98,050.00	
BTPS 2.45 09/01/33	100,000.00	89,460.00	
BTPS 2.45 09/01/50	100,000.00	70,850.00	
BTPS 2.65 12/01/27	300,000.00	295,170.00	
BTPS 2.7 03/01/47	100,000.00	77,180.00	

BTPS 2.8 03/01/67	100,000.00	71,250.00	
BTPS 2.8 06/15/29	100,000.00	97,380.00	
BTPS 2.8 12/01/28	100,000.00	98,150.00	
BTPS 2.95 09/01/38	100,000.00	86,800.00	
BTPS 3 08/01/29	200,000.00	196,860.00	
BTPS 3 1/2 01/15/26	100,000.00	100,730.00	
BTPS 3 1/2 03/01/30	100,000.00	100,640.00	
BTPS 3 1/4 03/01/38	100,000.00	90,330.00	
BTPS 3 1/4 09/01/46	100,000.00	84,790.00	
BTPS 3.1 03/01/40	100,000.00	86,810.00	
BTPS 3.35 03/01/35	100,000.00	94,580.00	
BTPS 3.4 03/28/25	100,000.00	100,060.00	
BTPS 3.4 04/01/28	100,000.00	100,930.00	
BTPS 3.45 03/01/48	100,000.00	87,230.00	
BTPS 3.6 09/29/25	100,000.00	100,760.00	
BTPS 3.7 06/15/30	100,000.00	101,320.00	
BTPS 3.8 04/15/26	100,000.00	101,580.00	
BTPS 3.8 08/01/28	200,000.00	205,000.00	
BTPS 3.85 09/01/49	100,000.00	92,380.00	
BTPS 3.85 09/15/26	200,000.00	204,160.00	
BTPS 3.85 12/15/29	200,000.00	204,800.00	
BTPS 4 02/01/37	100,000.00	99,650.00	
BTPS 4 04/30/35	100,000.00	100,690.00	
BTPS 4 10/30/31	100,000.00	102,810.00	
BTPS 4 11/15/30	100,000.00	103,020.00	
BTPS 4 3/4 09/01/28	100,000.00	106,540.00	
BTPS 4 3/4 09/01/44	100,000.00	105,360.00	
BTPS 4.1 02/01/29	100,000.00	103,800.00	
BTPS 4.35 11/01/33	200,000.00	208,820.00	
BTPS 4.4 05/01/33	100,000.00	105,110.00	
BTPS 4.45 09/01/43	100,000.00	101,330.00	
BTPS 5 08/01/34	200,000.00	219,040.00	
BTPS 5 08/01/39	100,000.00	108,740.00	
BTPS 5 09/01/40	100,000.00	108,720.00	
BTPS 5 3/4 02/01/33	100,000.00	115,500.00	
BTPS 6 05/01/31	100,000.00	116,080.00	
BTPS 6 1/2 11/01/27	100,000.00	112,030.00	
BTPS 7 1/4 11/01/26	100,000.00	111,150.00	
DBR 0 02/15/30	100,000.00	87,615.00	
DBR 0 02/15/31	200,000.00	171,480.00	
DBR 0 02/15/32	200,000.00	167,398.00	
DBR 0 05/15/35	100,000.00	76,466.00	
DBR 0 05/15/36	100,000.00	74,252.00	

DBR 0 08/15/26	100,000.00	94,046.00	
DBR 0 08/15/29	200,000.00	177,180.00	
DBR 0 08/15/30	400,000.00	346,780.00	
DBR 0 08/15/31	200,000.00	169,526.00	
DBR 0 08/15/50	300,000.00	155,991.00	
DBR 0 08/15/52	200,000.00	99,060.00	
DBR 0 1/2 02/15/25	100,000.00	97,253.00	
DBR 0 1/2 02/15/26	100,000.00	95,867.00	
DBR 0 1/4 02/15/27	100,000.00	93,896.00	
DBR 0 1/4 02/15/29	100,000.00	90,729.00	
DBR 0 1/4 08/15/28	300,000.00	274,650.00	
DBR 0 11/15/27	200,000.00	183,608.00	
DBR 0 11/15/28	300,000.00	270,003.00	
DBR 1 05/15/38	100,000.00	81,968.00	
DBR 1 08/15/25	100,000.00	97,239.00	
DBR 1 1/4 08/15/48	200,000.00	154,012.00	
DBR 1.7 08/15/32	100,000.00	95,771.00	
DBR 1.8 08/15/53	200,000.00	170,270.00	
DBR 2 1/2 07/04/44	200,000.00	197,968.00	
DBR 2 1/2 08/15/46	200,000.00	198,562.00	
DBR 2.1 11/15/29	200,000.00	198,494.00	
DBR 2.3 02/15/33	100,000.00	100,214.00	
DBR 2.3 02/15/33	300,000.00	300,621.00	
DBR 2.4 11/15/30	100,000.00	100,939.00	
DBR 3 1/4 07/04/42	100,000.00	109,958.00	
DBR 4 01/04/37	200,000.00	233,470.00	
DBR 4 3/4 07/04/34	100,000.00	121,921.00	
DBR 4 3/4 07/04/40	100,000.00	129,317.00	
DBR 4.25 07/04/39	100,000.00	121,598.00	
DBR 5.5 01/04/31	100,000.00	120,659.00	
DBR 6.5 07/04/27	100,000.00	113,600.00	
FRTR 0 02/25/25	400,000.00	386,400.00	
FRTR 0 02/25/26	300,000.00	283,755.00	
FRTR 0 02/25/27	500,000.00	462,200.00	
FRTR 0 03/25/25	300,000.00	289,320.00	
FRTR 0 05/25/32	100,000.00	80,030.00	
FRTR 0 1/2 05/25/25	100,000.00	96,748.00	
FRTR 0 1/2 05/25/26	100,000.00	95,170.00	
FRTR 0 1/2 05/25/29	200,000.00	179,650.00	
FRTR 0 1/2 05/25/40	200,000.00	132,740.00	
FRTR 0 1/2 05/25/72	100,000.00	38,480.00	
FRTR 0 1/2 06/25/44	100,000.00	59,650.00	
FRTR 0 1/4 11/25/26	300,000.00	280,920.00	

FRTR 0 11/25/29	300,000.00	258,630.00	
FRTR 0 11/25/30	500,000.00	419,075.00	
FRTR 0 11/25/31	400,000.00	325,280.00	
FRTR 0 3/4 02/25/28	600,000.00	558,420.00	
FRTR 0 3/4 05/25/28	100,000.00	92,695.00	
FRTR 0 3/4 05/25/52	200,000.00	107,640.00	
FRTR 0 3/4 05/25/53	200,000.00	106,320.00	
FRTR 0 3/4 11/25/28	300,000.00	275,610.00	
FRTR 1 05/25/27	300,000.00	285,120.00	
FRTR 1 1/2 05/25/31	200,000.00	185,040.00	
FRTR 1 1/2 05/25/50	200,000.00	137,600.00	
FRTR 1 1/4 05/25/34	300,000.00	256,980.00	
FRTR 1 1/4 05/25/36	300,000.00	246,240.00	
FRTR 1 1/4 05/25/38	100,000.00	78,660.00	
FRTR 1 11/25/25	200,000.00	193,600.00	
FRTR 1 3/4 05/25/66	100,000.00	67,000.00	
FRTR 1 3/4 06/25/39	200,000.00	166,860.00	
FRTR 2 05/25/48	200,000.00	157,120.00	
FRTR 2 1/2 05/25/30	200,000.00	198,920.00	
FRTR 2 1/2 05/25/43	100,000.00	89,360.00	
FRTR 2 1/2 09/24/26	400,000.00	398,440.00	
FRTR 2 11/25/32	400,000.00	375,960.00	
FRTR 2 3/4 02/25/29	300,000.00	302,280.00	
FRTR 3 05/25/33	200,000.00	203,440.00	
FRTR 3 1/2 04/25/26	200,000.00	203,470.00	
FRTR 3 1/2 11/25/33	100,000.00	105,660.00	
FRTR 3 1/4 05/25/45	200,000.00	199,940.00	
FRTR 4 04/25/55	100,000.00	112,660.00	
FRTR 4 04/25/60	100,000.00	113,990.00	
FRTR 4 10/25/38	100,000.00	110,830.00	
FRTR 4 3/4 04/25/35	200,000.00	234,520.00	
FRTR 5 1/2 04/25/29	200,000.00	228,120.00	
FRTR 5 3/4 10/25/32	200,000.00	245,780.00	
FRTR 6 10/25/25	100,000.00	105,260.00	
FRTR4.5 04/25/41	200,000.00	235,160.00	
IRISH 0.2 10/18/30	100,000.00	85,625.00	
IRISH 1 05/15/26	100,000.00	97,000.00	
IRISH 1 1/2 05/15/50	100,000.00	71,730.00	
IRISH 1.3 05/15/33	100,000.00	88,620.00	
IRISH 1.35 03/18/31	100,000.00	92,300.00	
IRISH 1.7 05/15/37	100,000.00	86,470.00	
IRISH 2 02/18/45	100,000.00	83,170.00	
IRISH 5.4 03/13/25	100,000.00	102,450.00	

NETHER 0 01/15/26	100,000.00	94,880.00	
NETHER 0 01/15/27	100,000.00	92,935.00	
NETHER 0 01/15/29	100,000.00	88,640.00	
NETHER 0 01/15/38	100,000.00	67,980.00	
NETHER 0 01/15/52	100,000.00	47,830.00	
NETHER 0 07/15/30	100,000.00	85,310.00	
NETHER 0 07/15/31	100,000.00	83,110.00	
NETHER 0 1/2 01/15/40	100,000.00	70,940.00	
NETHER 0 1/2 07/15/26	100,000.00	95,135.00	
NETHER 0 1/2 07/15/32	100,000.00	83,580.00	
NETHER 0 1/4 07/15/25	100,000.00	96,262.00	
NETHER 0 3/4 07/15/27	100,000.00	94,365.00	
NETHER 0 3/4 07/15/28	100,000.00	92,870.00	
NETHER 2 1/2 01/15/33	100,000.00	99,380.00	
NETHER 2 1/2 07/15/33	100,000.00	99,060.00	
NETHER 2 3/4 01/15/47	100,000.00	100,010.00	
NETHER 3 3/4 01/15/42	100,000.00	113,210.00	
NETHER 4 01/15/37	100,000.00	113,330.00	
NETHER 5 1/2 01/15/28	100,000.00	111,220.00	
OBL 0 04/10/26	200,000.00	189,292.00	
OBL 0 04/11/25	200,000.00	192,876.00	
OBL 0 04/16/27	100,000.00	92,821.00	
OBL 0 10/09/26	300,000.00	281,169.00	
OBL 0 10/10/25	200,000.00	191,028.00	
OBL 1.3 10/15/27	400,000.00	386,148.00	
OBL 2.2 04/13/28	100,000.00	99,691.00	
OBL 2.4 10/19/28	300,000.00	301,809.00	
RAGB 0 02/20/30	100,000.00	85,295.00	
RAGB 0 02/20/31	100,000.00	82,710.00	
RAGB 0 1/2 02/20/29	100,000.00	89,935.00	
RAGB 0 1/2 04/20/27	100,000.00	93,555.00	
RAGB 0 1/4 10/20/36	100,000.00	70,820.00	
RAGB 0 10/20/28	100,000.00	88,470.00	
RAGB 0 10/20/40	100,000.00	59,940.00	
RAGB 0 3/4 03/20/51	100,000.00	57,400.00	
RAGB 0 3/4 10/20/26	100,000.00	94,920.00	
RAGB 0.9 02/20/32	100,000.00	86,560.00	
RAGB 1 1/2 02/20/47	100,000.00	73,250.00	
RAGB 2 07/15/26	100,000.00	98,355.00	
RAGB 2.4 05/23/34	100,000.00	95,650.00	
RAGB 2.9 02/20/33	100,000.00	100,540.00	
RAGB 3.15 06/20/44	100,000.00	99,960.00	
RAGB 4.15 03/37	100,000.00	111,640.00	

RFGB 0 09/15/30	100,000.00	83,860.00	
RFGB 0 1/2 09/15/28	100,000.00	90,770.00	
RFGB 0 3/4 04/15/31	100,000.00	87,090.00	
RFGB 1 1/8 04/15/34	100,000.00	84,300.00	
RFGB 2 5/8 07/04/42	100,000.00	93,370.00	
RFGB 3 09/15/33	100,000.00	100,990.00	
RFGB 4 07/04/25	100,000.00	101,450.00	
SPGB 0 01/31/25	300,000.00	289,890.00	
SPGB 0 01/31/26	200,000.00	188,200.00	
SPGB 0 01/31/27	300,000.00	275,760.00	
SPGB 0 01/31/28	400,000.00	357,620.00	
SPGB 0 05/31/25	200,000.00	191,620.00	
SPGB 0 1/2 10/31/31	200,000.00	164,820.00	
SPGB 0.1 04/30/31	100,000.00	81,000.00	
SPGB 0.6 10/31/29	100,000.00	87,700.00	
SPGB 0.8 07/30/27	200,000.00	186,490.00	
SPGB 0.8 07/30/29	300,000.00	267,570.00	
SPGB 0.85 07/30/37	100,000.00	71,110.00	
SPGB 1 07/30/42	100,000.00	64,120.00	
SPGB 1 1/4 10/31/30	200,000.00	178,790.00	
SPGB 1 10/31/50	100,000.00	52,910.00	
SPGB 1.2 10/31/40	100,000.00	69,550.00	
SPGB 1.3 10/31/26	200,000.00	191,500.00	
SPGB 1.4 07/30/28	100,000.00	94,090.00	
SPGB 1.45 04/30/29	100,000.00	93,205.00	
SPGB 1.45 10/31/27	100,000.00	95,195.00	
SPGB 1.85 07/30/35	100,000.00	85,300.00	
SPGB 1.9 10/31/52	100,000.00	65,850.00	
SPGB 1.95 04/30/26	100,000.00	97,925.00	
SPGB 1.95 07/30/30	200,000.00	188,200.00	
SPGB 2.15 10/31/25	100,000.00	98,510.00	
SPGB 2.35 07/30/33	200,000.00	185,600.00	
SPGB 2.55 10/31/32	300,000.00	286,380.00	
SPGB 2.7 10/31/48	100,000.00	82,280.00	
SPGB 2.8 05/31/26	200,000.00	199,420.00	
SPGB 2.9 10/31/46	100,000.00	86,680.00	
SPGB 3.45 07/30/43	100,000.00	95,300.00	
SPGB 3.45 07/30/66	100,000.00	89,040.00	
SPGB 3.55 10/31/33	200,000.00	204,880.00	
SPGB 3.9 07/30/39	100,000.00	103,160.00	
SPGB 4.2 01/31/37	100,000.00	107,550.00	
SPGB 4.7 07/30/41	100,000.00	113,090.00	
SPGB 4.9 07/30/40	100,000.00	114,750.00	

	SPGB 5 3/4 07/30/32	100,000.00	119,610.00	
	SPGB 5.15 10/31/28	100,000.00	110,035.00	
	SPGB 5.15 10/31/44	100,000.00	119,890.00	
	SPGB 6 01/31/29	100,000.00	114,580.00	
ユーロ小計		41,400,000.00	38,194,738.00 (6,142,095,817)	
	銘柄数	277		
	比率	32.0%	32.4%	
英債券			英債券	
	UKT 0 1/2 01/31/29	200,000.00	169,540.00	
	UKT 0 1/2 10/22/61	100,000.00	29,475.00	
	UKT 0 1/4 07/31/31	200,000.00	152,900.00	
	UKT 0 1/8 01/30/26	100,000.00	92,320.00	
	UKT 0 1/8 01/31/28	100,000.00	86,140.00	
	UKT 0 3/8 10/22/26	100,000.00	90,620.00	
	UKT 0 3/8 10/22/30	100,000.00	79,600.00	
	UKT 0 5/8 06/07/25	200,000.00	189,960.00	
	UKT 0 5/8 07/31/35	100,000.00	67,900.00	
	UKT 0 5/8 10/22/50	100,000.00	39,860.00	
	UKT 0 7/8 01/31/46	100,000.00	49,230.00	
	UKT 0 7/8 07/31/33	100,000.00	75,250.00	
	UKT 0 7/8 10/22/29	100,000.00	84,930.00	
	UKT 1 01/31/32	200,000.00	160,060.00	
	UKT 1 1/2 07/22/26	100,000.00	94,080.00	
	UKT 1 1/2 07/22/47	100,000.00	56,040.00	
	UKT 1 1/4 07/22/27	100,000.00	91,370.00	
	UKT 1 1/4 07/31/51	100,000.00	48,520.00	
	UKT 1 1/4 10/22/41	100,000.00	60,860.00	
	UKT 1 1/8 01/31/39	200,000.00	128,540.00	
	UKT 1 1/8 10/22/2073	100,000.00	36,410.00	
	UKT 1 3/4 07/22/57	100,000.00	52,830.00	
	UKT 1 3/4 09/07/37	100,000.00	73,870.00	
	UKT 1 5/8 10/22/28	100,000.00	90,540.00	
	UKT 1 5/8 10/22/54	100,000.00	51,980.00	
	UKT 1 5/8 10/22/71	100,000.00	46,090.00	
	UKT 2 09/07/25	400,000.00	385,360.00	
	UKT 2 1/2 07/22/65	100,000.00	63,420.00	
	UKT 3 1/2 01/22/45	100,000.00	85,650.00	
	UKT 3 1/2 07/22/68	100,000.00	81,950.00	
	UKT 3 1/4 01/22/44	100,000.00	82,740.00	
	UKT 3 1/4 01/31/33	200,000.00	188,780.00	
	UKT 3 3/4 01/29/38	100,000.00	93,830.00	
	UKT 3 3/4 07/22/52	100,000.00	86,960.00	
	UKT 3 3/4 10/22/53	200,000.00	172,880.00	

	UKT 4 01/22/60	100,000.00	91,010.00	
	UKT 4 1/2 06/07/28	200,000.00	204,420.00	
	UKT 4 1/2 12/07/42	100,000.00	99,870.00	
	UKT 4 1/4 03/07/36	100,000.00	100,560.00	
	UKT 4 1/4 12/07/27	30,000.00	30,339.00	
	UKT 4 1/4 12/07/40	100,000.00	97,580.00	
	UKT 4 1/4 12/07/46	100,000.00	95,310.00	
	UKT 4 1/4 12/07/49	100,000.00	94,880.00	
	UKT 4 1/4 12/07/55	100,000.00	94,730.00	
	UKT 4 1/8 01/29/27	200,000.00	200,280.00	
	UKT 4 10/22/63	100,000.00	90,730.00	
	UKT 4 3/4 10/22/43	100,000.00	102,570.00	
	UKT 4 3/4 12/07/30	100,000.00	105,360.00	
	UKT 4 3/4 12/07/38	100,000.00	104,200.00	
	UKT 4 5/8 01/31/34	100,000.00	104,470.00	
	UKT 4.25 06/07/32	100,000.00	102,450.00	
	UKT 4.5 09/07/34	100,000.00	103,370.00	
	UKT 6 12/07/28	10,000.00	10,940.00	
英債券小計		6,340,000.00	5,273,554.00 (991,059,003)	
	銘柄数	53		
	比率	5.2%	5.2%	
スウェーデン クローネ			スウェーデン クローネ	
	SGB 0 1/8 05/12/31	300,000.00	257,367.00	
	SGB 0 3/4 05/12/28 #1060	300,000.00	281,010.00	
	SGB 0 3/4 11/12/29 #1061	400,000.00	367,432.00	
	SGB 1 11/12/26 #1059	500,000.00	479,920.00	
	SGB 1 3/4 11/11/33 #1065	200,000.00	190,362.00	
	SGB 2 1/2 05/12/25 #1058	500,000.00	496,615.00	
	SGB 2 1/4 06/01/32 #1056	300,000.00	299,400.00	
	SGB 3 1/2 03/30/39	200,000.00	226,584.00	
スウェーデンクローネ小計		2,700,000.00	2,598,690.00 (36,771,463)	
	銘柄数	8		
	比率	0.2%	0.2%	

ノルウェー クローネ			ノルウェー クローネ	
	NGB 1 1/2 02/19/26	300,000.00	286,890.00	
	NGB 1 1/4 09/17/31	200,000.00	168,760.00	
	NGB 1 3/4 02/17/27	300,000.00	283,980.00	
	NGB 1 3/4 03/13/25	300,000.00	291,960.00	
	NGB 1 3/4 09/06/29	200,000.00	182,240.00	
	NGB 1 3/8 08/19/30	300,000.00	262,530.00	
	NGB 2 04/26/28	200,000.00	188,020.00	
	NGB 2 1/8 05/18/32	200,000.00	178,900.00	
	NGB 3 08/15/33	300,000.00	285,240.00	
NGB 3 1/2 10/06/42	100,000.00	99,970.00		
ノルウェークローネ小計		2,400,000.00	2,228,490.00 (31,443,993)	
	銘柄数	10		
	比率	0.2%	0.2%	
デンマーク クローネ			デンマーク クローネ	
	DGB 0 1/2 11/15/27	400,000.00	372,480.00	
	DGB 0 1/2 11/15/29	400,000.00	359,480.00	
	DGB 0 1/4 11/15/52	300,000.00	159,240.00	
	DGB 0 11/15/31	400,000.00	332,600.00	
	DGB 1 3/4 11/15/25	400,000.00	392,920.00	
	DGB 2 1/4 11/15/33	200,000.00	195,740.00	
DGB 4 1/2 11/15/39	600,000.00	743,760.00		
デンマーククローネ小計		2,700,000.00	2,556,220.00 (55,137,665)	
	銘柄数	7		
	比率	0.3%	0.3%	

ポーランドズロチ			ポーランドズロチ	
	POLGB 0 1/4 10/25/26	200,000.00	175,900.00	
	POLGB 0 10/25/25	100,000.00	92,200.00	
	POLGB 0 3/4 04/25/25	300,000.00	283,320.00	
	POLGB 1 1/4 10/25/30	200,000.00	155,860.00	
	POLGB 1 3/4 04/25/32	200,000.00	153,360.00	
	POLGB 2 1/2 07/25/26	200,000.00	188,300.00	
	POLGB 2 1/2 07/25/27	100,000.00	92,020.00	
	POLGB 2 3/4 04/25/28	200,000.00	182,200.00	
	POLGB 2 3/4 10/25/29	500,000.00	445,550.00	
	POLGB 3 1/4 07/25/25	100,000.00	96,451.00	
	POLGB 3 3/4 05/25/27	300,000.00	286,740.00	
	POLGB 6 10/25/33	200,000.00	210,500.00	
POLGB 7 1/2 07/25/28	300,000.00	329,340.00		
ポーランドズロチ小計	2,900,000.00	2,691,741.00 (98,857,956)		
	銘柄数	13		
	比率	0.5%	0.5%	
豪ドル			豪ドル	
	ACGB 0 1/2 09/21/26	100,000.00	91,730.30	
	ACGB 0 1/4 11/21/25	100,000.00	93,649.20	
	ACGB 1 1/2 06/21/31	200,000.00	167,160.00	
	ACGB 1 1/4 05/21/32	100,000.00	79,703.50	
	ACGB 1 11/21/31	100,000.00	79,312.40	
	ACGB 1 12/21/30	200,000.00	163,750.80	
	ACGB 1 3/4 06/21/51	100,000.00	55,763.30	
	ACGB 1 3/4 11/21/32	200,000.00	164,243.00	
	ACGB 2 1/2 05/21/30	100,000.00	91,730.00	
	ACGB 2 1/4 05/21/28	100,000.00	93,700.00	
	ACGB 2 3/4 05/21/41	100,000.00	78,790.10	
	ACGB 2 3/4 11/21/27	200,000.00	192,320.00	
	ACGB 2 3/4 11/21/28	100,000.00	95,090.00	
	ACGB 2 3/4 11/21/29	100,000.00	93,840.00	
	ACGB 3 03/21/47	100,000.00	77,100.00	
	ACGB 3 1/2 12/21/34	100,000.00	93,359.50	
	ACGB 3 1/4 04/21/25	100,000.00	99,020.00	
	ACGB 3 1/4 04/21/29	100,000.00	97,018.30	
	ACGB 3 1/4 06/21/39	100,000.00	86,370.00	
	ACGB 3 11/21/33	100,000.00	90,208.90	
ACGB 3 3/4 04/21/37	100,000.00	93,710.00		
ACGB 3 3/4 05/21/34	100,000.00	95,916.60		
ACGB 4 1/2 04/21/33	200,000.00	204,180.00		
ACGB 4 1/4 04/21/26	200,000.00	201,660.00		

豪ドル小計		3,000,000.00	2,679,325.90 (260,350,097)	
	銘柄数	24		
	比率	1.4%	1.4%	
ニュージーランドドル			ニュージーランドドル	
	NZGB 1 1/2 05/15/31	100,000.00	80,980.00	
	NZGB 2 05/15/32	100,000.00	81,890.00	
	NZGB 2 3/4 04/15/37	100,000.00	79,120.00	
	NZGB 3 04/20/29	100,000.00	93,310.00	
	NZGB 3 1/2 04/14/33	100,000.00	91,130.00	
	NZGB 4 1/2 04/15/27	100,000.00	99,975.00	
ニュージーランドドル小計		600,000.00	526,405.00 (47,550,163)	
	銘柄数	6		
	比率	0.2%	0.3%	
シンガポールドル			シンガポールドル	
	SIGB 2 1/4 08/01/36	100,000.00	92,760.00	
	SIGB 2 1/8 06/01/26	100,000.00	97,700.00	
	SIGB 2 3/4 03/01/46	100,000.00	96,660.00	
	SIGB 2 3/4 04/01/42	100,000.00	97,150.00	
	SIGB 2 7/8 09/01/30	100,000.00	99,780.00	
	SIGB 3 1/2 03/01/27	200,000.00	203,200.00	
	SIGB 3 3/8 09/01/33	100,000.00	103,630.00	
シンガポールドル小計		800,000.00	790,880.00 (87,297,334)	
	銘柄数	7		
	比率	0.5%	0.5%	

マレーシア リンギット			マレーシア リンギット	
	MGS 2.632 04/15/31	100,000.00	93,148.60	
	MGS 3.502 05/31/27	200,000.00	200,166.20	
	MGS 3.582 07/15/32	100,000.00	98,297.30	
	MGS 3.733 06/15/28	100,000.00	100,461.50	
	MGS 3.757 05/22/40	100,000.00	96,471.90	
	MGS 3.828 07/05/34	100,000.00	99,948.70	
	MGS 3.844 04/15/33	200,000.00	199,997.00	
	MGS 3.885 08/15/29	200,000.00	202,557.40	
	MGS 3.899 11/16/27	100,000.00	101,358.20	
	MGS 3.955 09/15/25	200,000.00	201,942.40	
	MGS 4.065 06/15/50	200,000.00	195,757.60	
	MGS 4.232 06/30/31	100,000.00	103,286.10	
	MGS 4.254 05/31/35	100,000.00	102,940.00	
	MGS 4.392 04/15/26	300,000.00	306,253.80	
	MGS 4.457 03/31/53	100,000.00	104,621.00	
	MGS 4.498 04/15/30	100,000.00	104,178.40	
	MGS 4.696 10/15/42	100,000.00	108,094.90	
	MGS 4.736 03/15/46	100,000.00	107,659.30	
	MGS 4.762 04/07/37	100,000.00	107,990.10	
	MGS 4.893 06/08/38	100,000.00	109,977.00	
	MGS 4.921 07/06/48	100,000.00	110,990.70	
	MGS 4.935 09/30/43	100,000.00	110,240.40	
	MGS 5.248 09/28	100,000.00	106,955.70	
マレーシアリンギット小計		3,000,000.00	3,073,294.20 (96,002,642)	
	銘柄数	23		
	比率	0.5%	0.5%	

イスラエル シュケル			イスラエル シュケル	
	ILGOV 0 1/2 02/27/26	100,000.00	93,800.00	
	ILGOV 0 1/2 04/30/25	200,000.00	192,660.00	
	ILGOV 1 03/31/30	200,000.00	167,740.00	
	ILGOV 1 1/2 05/31/37	100,000.00	70,010.00	
	ILGOV 1 3/4 08/31/25	100,000.00	97,460.00	
	ILGOV 1.3 04/30/32	100,000.00	80,170.00	
	ILGOV 2 03/31/27	200,000.00	192,240.00	
	ILGOV 2 1/4 09/28/28	100,000.00	93,370.00	
	ILGOV 2.8 11/29/52	100,000.00	68,380.00	
	ILGOV 3 3/4 02/28/29	100,000.00	101,530.00	
	ILGOV 3 3/4 03/31/47	100,000.00	88,160.00	
	ILGOV 5 1/2 01/31/42	100,000.00	109,290.00	
ILGOV 6 1/4 10/30/26	100,000.00	107,560.00		
イスラエルシュケル小計	1,600,000.00	1,462,370.00 (58,425,922)		
	銘柄数	13		
	比率	0.3%	0.3%	
オフショア人民元			オフショア人民元	
	CGB 1.99 04/09/25	500,000.00	498,750.00	
	CGB 2 06/15/25	3,300,000.00	3,290,892.00	
	CGB 2 1/2 07/25/27	1,100,000.00	1,105,357.00	
	CGB 2 3/4 02/17/32	300,000.00	304,710.00	
	CGB 2 3/4 06/15/29	500,000.00	507,845.00	
	CGB 2.18 08/15/26	2,200,000.00	2,195,314.00	
	CGB 2.18 08/25/25	1,000,000.00	999,350.00	
	CGB 2.22 09/25/25	1,600,000.00	1,600,368.00	
	CGB 2.24 05/25/25	800,000.00	800,616.00	
	CGB 2.26 02/24/25	700,000.00	701,239.00	
	CGB 2.28 11/25/25	1,300,000.00	1,301,352.00	
	CGB 2.3 05/15/26	1,200,000.00	1,201,092.00	
	CGB 2.33 12/15/25	1,700,000.00	1,703,978.00	
	CGB 2.35 03/15/25	1,700,000.00	1,704,896.00	
	CGB 2.37 01/20/27	600,000.00	600,894.00	
	CGB 2.39 11/15/26	2,000,000.00	2,007,680.00	
	CGB 2.4 07/15/28	2,100,000.00	2,101,638.00	
	CGB 2.44 10/15/27	4,200,000.00	4,211,760.00	
	CGB 2.46 02/15/26	1,900,000.00	1,907,942.00	
	CGB 2.48 04/15/27	600,000.00	602,634.00	
	CGB 2.52 08/25/33	1,500,000.00	1,496,835.00	
	CGB 2.55 10/15/28	2,800,000.00	2,823,380.00	
CGB 2.6 09/01/32	800,000.00	802,904.00		
CGB 2.6 09/15/30	2,400,000.00	2,414,352.00		

CGB 2.62 04/15/28	1,500,000.00	1,516,380.00	
CGB 2.62 06/25/30	1,100,000.00	1,107,865.00	
CGB 2.62 09/25/29	600,000.00	604,932.00	
CGB 2.64 01/15/28	1,100,000.00	1,111,000.00	
CGB 2.67 05/25/33	700,000.00	706,706.00	
CGB 2.67 11/25/33	1,400,000.00	1,420,342.00	
CGB 2.68 05/21/30	700,000.00	707,602.00	
CGB 2.69 08/12/26	900,000.00	909,738.00	
CGB 2.69 08/15/32	400,000.00	404,328.00	
CGB 2.76 05/15/32	300,000.00	304,995.00	
CGB 2.79 12/15/29	3,700,000.00	3,766,119.00	
CGB 2.8 03/24/29	600,000.00	611,040.00	
CGB 2.8 03/25/30	1,400,000.00	1,425,256.00	
CGB 2.8 11/15/32	2,800,000.00	2,859,220.00	
CGB 2.85 06/04/27	500,000.00	508,645.00	
CGB 2.88 02/25/33	900,000.00	925,146.00	
CGB 2.89 11/18/31	1,700,000.00	1,743,622.00	
CGB 2.91 10/14/28	800,000.00	819,000.00	
CGB 3 1/4 06/06/26	500,000.00	512,670.00	
CGB 3 1/4 11/22/28	500,000.00	521,995.00	
CGB 3 10/15/53	300,000.00	316,074.00	
CGB 3.01 05/13/28	700,000.00	719,236.00	
CGB 3.02 05/27/31	500,000.00	517,500.00	
CGB 3.02 10/22/25	500,000.00	507,505.00	
CGB 3.03 03/11/26	700,000.00	712,495.00	
CGB 3.12 10/25/52	900,000.00	956,790.00	
CGB 3.12 12/05/26	800,000.00	820,448.00	
CGB 3.13 11/21/29	400,000.00	415,636.00	
CGB 3.19 04/15/53	700,000.00	759,570.00	
CGB 3.22 12/06/25	400,000.00	407,932.00	
CGB 3.27 11/19/30	1,000,000.00	1,051,680.00	
CGB 3.28 12/03/27	400,000.00	415,464.00	
CGB 3.29 05/23/29	300,000.00	314,388.00	
CGB 3.32 04/15/52	400,000.00	440,200.00	
CGB 3.39 03/16/50	600,000.00	665,820.00	
CGB 3.53 10/18/51	1,100,000.00	1,254,814.00	
CGB 3.54 08/16/28	100,000.00	105,725.00	
CGB 3.72 04/12/51	300,000.00	352,623.00	
CGB 3.81 09/14/50	1,700,000.00	2,023,986.00	
CGB 3.86 07/22/49	1,100,000.00	1,314,390.00	
オフショア人民元小計	71,800,000.00	73,444,655.00 (1,517,072,793)	
	銘柄数	64	
	比率	7.9%	8.0%

国債証券合計		円 18,933,471,567 (18,933,471,567)	
合 計		円 18,933,471,567 (18,933,471,567)	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「TMA外国債券マザーファンド」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			
預金		44,711,424	104,992,902
コール・ローン		64,058,670	117,169,157
国債証券		26,657,034,512	31,643,308,612
未収入金		108,249,122	
未収利息		138,648,515	244,133,154
前払費用		45,434,388	51,250,418
流動資産合計		27,058,136,631	32,160,854,243
資産合計		27,058,136,631	32,160,854,243
負債の部			
流動負債			
前受収益			13,405
未払金		99,818,028	
未払解約金		11,600,230	44,899,844
未払利息		31	52
流動負債合計		111,418,289	44,913,301
負債合計		111,418,289	44,913,301
純資産の部			
元本等			
元本	1	10,945,633,341	11,432,038,479
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		16,001,085,001	20,683,902,463
元本等合計		26,946,718,342	32,115,940,942
純資産合計		26,946,718,342	32,115,940,942
負債純資産合計		27,058,136,631	32,160,854,243

(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	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p>

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

自 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 同期中における追加設定元本額 同期中における一部解約元本額 同期末における元本額	10,755,895,489円 2,078,037,333円 1,888,299,481円 10,945,633,341円	10,945,633,341円 2,099,293,229円 1,612,888,091円 11,432,038,479円
元本の内訳* 東京海上セレクション・外国債券 東京海上セレクション・バランス30 東京海上セレクション・バランス50 東京海上セレクション・バランス70 東京海上・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型） 計	5,480,452,839円 1,131,889,203円 2,589,692,827円 1,572,136,264円 171,462,208円 10,945,633,341円	5,607,634,537円 1,126,226,047円 2,697,342,315円 1,724,380,776円 276,454,804円 11,432,038,479円
2. 1 本書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	10,945,633,341口	11,432,038,479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、為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

・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。	(1)有価証券 同左

	<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)に記載していません。</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>(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	<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。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。</p>	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
国債証券	1,171,890,615円
合計	1,171,890,615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
国債証券	167,307,709円
合計	167,307,709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

(2023年1月25日現在)

該当事項はありません。

(2024年1月25日現在)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

[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	2.4619円	1口当たり純資産額	2.8093円
(1万口当たり純資産額	24,619円)	(1万口当たり純資産額	28,093円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
国債証券	米ドル			米ドル	
		T 0 1/2 05/31/27	1,000,000.00	886,171.88	
		T 0 1/2 08/31/27	800,000.00	703,375.00	
		T 0 1/2 10/31/27	5,100,000.00	4,458,515.62	
		T 0 1/4 10/31/25	3,800,000.00	3,531,625.00	
		T 0 3/4 01/31/28	1,000,000.00	875,937.50	
		T 0 3/4 04/30/26	1,800,000.00	1,662,750.00	
		T 0 3/4 05/31/26	1,500,000.00	1,382,109.37	
		T 0 3/4 08/31/26	200,000.00	182,953.12	
		T 0 3/8 09/30/27	1,100,000.00	959,750.00	
		T 0 3/8 11/30/25	400,000.00	371,375.00	
		T 0 5/8 07/31/26	7,400,000.00	6,762,906.25	
		T 0 5/8 11/30/27	4,900,000.00	4,292,093.75	
		T 0 5/8 12/31/27	2,800,000.00	2,446,281.26	
		T 0 7/8 09/30/26	500,000.00	458,164.06	
		T 1 07/31/28	5,400,000.00	4,712,765.65	
		T 1 1/2 01/31/27	1,900,000.00	1,756,609.35	
T 1 1/2 11/30/28	400,000.00	354,500.00			
T 1 1/4 03/31/28	3,200,000.00	2,849,250.01			

T 1 1/4 04/30/28	1,900,000.00	1,688,179.69	
T 1 1/4 05/31/28	300,000.00	265,992.18	
T 1 1/4 06/30/28	2,100,000.00	1,858,007.82	
T 1 1/4 09/30/28	100,000.00	87,906.25	
T 1 1/4 11/30/26	1,200,000.00	1,105,406.25	
T 1 1/8 02/29/28	100,000.00	88,789.06	
T 1 1/8 08/15/40	4,300,000.00	2,614,937.50	
T 1 1/8 08/31/28	700,000.00	613,101.56	
T 1 1/8 10/31/26	200,000.00	184,015.62	
T 1 3/4 08/15/41	5,600,000.00	3,722,250.00	
T 1 3/8 10/31/28	100,000.00	88,273.43	
T 1 3/8 11/15/40	900,000.00	569,812.50	
T 1 5/8 09/30/26	900,000.00	841,289.06	
T 1 5/8 11/30/26	2,000,000.00	1,862,968.76	
T 1 7/8 02/15/41	2,300,000.00	1,581,250.00	
T 1 7/8 02/28/27	800,000.00	746,812.49	
T 1 7/8 06/30/26	500,000.00	472,851.56	
T 2 1/4 05/15/41	2,200,000.00	1,603,593.75	
T 2 11/15/26	500,000.00	470,820.31	
T 2 3/4 04/30/27	100,000.00	95,726.56	
T 2 3/4 05/15/25	500,000.00	488,203.12	
T 2 3/4 05/31/29	1,000,000.00	935,000.00	
T 2 3/4 08/15/42	1,500,000.00	1,165,429.69	
T 2 3/4 11/15/42	300,000.00	232,429.68	
T 2 3/8 02/15/42	7,200,000.00	5,285,250.00	
T 2 3/8 04/30/26	2,600,000.00	2,492,140.63	
T 2 5/8 02/15/29	300,000.00	279,796.87	
T 2 7/8 04/30/29	200,000.00	188,359.37	
T 2 7/8 05/15/43	1,500,000.00	1,179,023.44	
T 2 7/8 08/15/28	200,000.00	189,781.25	
T 3 05/15/45	2,000,000.00	1,577,343.74	
T 3 1/2 01/31/28	1,700,000.00	1,660,554.62	
T 3 1/4 05/15/42	300,000.00	252,445.30	
T 3 1/8 02/15/43	1,600,000.00	1,311,625.00	
T 3 1/8 08/15/44	800,000.00	648,812.50	
T 3 1/8 11/15/28	7,300,000.00	6,988,609.37	
T 3 3/4 11/15/43	800,000.00	717,625.00	
T 3 5/8 02/15/44	4,000,000.00	3,518,437.51	
T 3 5/8 08/15/43	1,500,000.00	1,322,226.57	
T 3 7/8 02/15/43	2,700,000.00	2,471,343.75	
T 3 7/8 11/30/27	200,000.00	198,078.12	
T 4 02/29/28	300,000.00	298,546.87	
T 4 1/4 10/15/25	1,000,000.00	995,859.38	

	T 4 3/8 12/15/26	3,500,000.00	3,515,722.64	
米ドル小計		113,000,000.00	97,121,761.59 (14,360,423,668)	
	銘柄数	62		
	比率	44.7%	45.4%	
加ドル			加ドル	
	CAN 0 1/4 03/01/26	800,000.00	741,120.00	
	CAN 1 09/01/26	700,000.00	651,833.00	
	CAN 1 1/2 04/01/25	200,000.00	193,156.00	
	CAN 1 1/2 06/01/31	900,000.00	787,320.00	
	CAN 1 1/2 12/01/31	100,000.00	86,398.00	
	CAN 2 06/01/32	1,200,000.00	1,075,320.00	
	CAN 2 1/2 12/01/32	200,000.00	185,720.00	
	CAN 2 12/01/51	100,000.00	73,678.00	
	CAN 2 3/4 09/01/27	600,000.00	582,510.00	
	CAN 2 3/4 12/01/48	100,000.00	87,777.00	
	CAN 2 3/4 12/01/55	300,000.00	261,630.00	
	CAN 3 04/01/26	100,000.00	98,045.00	
	CAN 3 1/2 03/01/28	200,000.00	199,415.00	
	CAN 3 1/2 12/01/45	500,000.00	498,915.00	
	CAN 3 1/4 09/01/28	300,000.00	296,223.00	
	CAN 3 1/4 12/01/33	700,000.00	685,727.00	
	CAN 3 10/01/25	100,000.00	97,995.40	
	CAN 4 06/01/41	400,000.00	424,072.00	
	CAN 5 06/01/37	400,000.00	461,920.00	
加ドル小計		7,900,000.00	7,488,774.40 (818,523,041)	
	銘柄数	19		
	比率	2.5%	2.6%	
メキシコペソ			メキシコペソ	
	MBONO 5 03/06/25	2,000,000.00	1,900,250.00	
	MBONO 5 1/2 03/04/27	31,000,000.00	27,725,036.00	
	MBONO 5 3/4 03/05/26	2,000,000.00	1,857,036.00	
	MBONO 7 09/03/26	18,000,000.00	16,872,210.00	
	MBONO 7 1/2 05/26/33	15,000,000.00	13,356,810.00	
	MBONO 7 3/4 05/29/31	2,000,000.00	1,855,514.00	
	MBONO 7 3/4 11/13/42	24,000,000.00	20,707,560.00	
	MBONO 8 05/24/35	2,000,000.00	1,802,850.00	
	MBONO 8 1/2 11/18/38	20,000,000.00	18,724,580.00	
メキシコペソ小計		116,000,000.00	104,801,846.00 (898,780,631)	
	銘柄数	9		
	比率	2.8%	2.8%	
ユーロ			ユーロ	

BGB 0 10/22/27	100,000.00	91,830.00	
BGB 0.8 06/22/27	600,000.00	565,830.00	
BGB 1 06/22/26	200,000.00	192,160.00	
BGB 1.9 06/22/38	200,000.00	170,540.00	
BGB 2 1/4 06/22/57	100,000.00	77,320.00	
BGB 2 3/4 04/22/39	100,000.00	94,590.00	
BGB 2.15 06/22/66	200,000.00	149,120.00	
BGB 3 06/22/34	300,000.00	301,770.00	
BGB 3.3 06/22/54	300,000.00	291,960.00	
BGB 3.45 06/22/43	100,000.00	102,200.00	
BGB 4 1/4 03/28/41	300,000.00	339,210.00	
BGB 5 03/28/35	500,000.00	594,150.00	
BKO 3.1 12/12/25	3,500,000.00	3,524,850.00	
BTPS 0 04/01/26	1,000,000.00	936,200.00	
BTPS 1 1/4 12/01/26	800,000.00	761,840.00	
BTPS 1.1 04/01/27	500,000.00	470,800.00	
BTPS 2.65 12/01/27	800,000.00	787,120.00	
BTPS 2.8 03/01/67	400,000.00	285,000.00	
BTPS 2.8 06/15/29	200,000.00	194,760.00	
BTPS 3 1/4 03/01/38	1,000,000.00	903,300.00	
BTPS 3.1 03/01/40	1,100,000.00	954,910.00	
BTPS 3.35 03/01/35	1,000,000.00	945,800.00	
BTPS 3.4 04/01/28	300,000.00	302,790.00	
BTPS 3.7 06/15/30	600,000.00	607,920.00	
BTPS 3.8 04/15/26	600,000.00	609,480.00	
BTPS 3.8 08/01/28	1,700,000.00	1,742,500.00	
BTPS 3.85 09/01/49	600,000.00	554,280.00	
BTPS 3.85 09/15/26	300,000.00	306,240.00	
BTPS 3.85 12/15/29	100,000.00	102,400.00	
BTPS 4 02/01/37	600,000.00	597,900.00	
BTPS 4 1/2 10/01/53	400,000.00	403,320.00	
BTPS 4 3/4 09/01/44	700,000.00	737,520.00	
BTPS 4.1 02/01/29	1,500,000.00	1,557,000.00	
BTPS 4.35 11/01/33	1,300,000.00	1,357,330.00	
BTPS 4.45 09/01/43	400,000.00	405,320.00	
BTPS 5 08/01/34	1,600,000.00	1,752,320.00	
BTPS 5 08/01/39	1,000,000.00	1,087,400.00	
BTPS 5 09/01/40	300,000.00	326,160.00	
BTPS 5 3/4 02/01/33	400,000.00	462,000.00	
DBR 0 05/15/35	500,000.00	382,330.00	
DBR 0 05/15/36	600,000.00	445,512.00	
DBR 1 05/15/38	500,000.00	409,840.00	
DBR 2 1/2 08/15/46	500,000.00	496,405.00	

FRTR 0 02/25/27	1,500,000.00	1,386,600.00	
FRTR 0 1/2 05/25/40	800,000.00	530,960.00	
FRTR 0 3/4 02/25/28	1,200,000.00	1,116,840.00	
FRTR 1 05/25/27	1,000,000.00	950,400.00	
FRTR 1 1/4 05/25/34	1,500,000.00	1,284,900.00	
FRTR 1 1/4 05/25/36	1,500,000.00	1,231,200.00	
FRTR 1 1/4 05/25/38	1,400,000.00	1,101,240.00	
FRTR 1 3/4 06/25/39	800,000.00	667,440.00	
FRTR 2 1/2 05/25/43	400,000.00	357,440.00	
FRTR 2 1/2 09/24/26	3,400,000.00	3,386,740.00	
FRTR 2 3/4 02/25/29	400,000.00	403,040.00	
FRTR 3 05/25/33	700,000.00	712,040.00	
FRTR 3 05/25/54	200,000.00	186,720.00	
FRTR 3 1/2 11/25/33	200,000.00	211,320.00	
FRTR 4 04/25/55	600,000.00	675,960.00	
FRTR 4 04/25/60	600,000.00	683,940.00	
FRTR 4 3/4 04/25/35	1,000,000.00	1,172,600.00	
FRTR4.5 04/25/41	1,300,000.00	1,528,540.00	
NETHER 0 01/15/27	100,000.00	92,935.00	
NETHER 0 01/15/38	200,000.00	135,960.00	
NETHER 0 1/2 01/15/40	100,000.00	70,940.00	
NETHER 0 3/4 07/15/28	300,000.00	278,610.00	
NETHER 2 01/15/54	100,000.00	85,030.00	
NETHER 2 1/2 01/15/30	200,000.00	200,080.00	
NETHER 2 1/2 07/15/33	200,000.00	198,120.00	
NETHER 3 3/4 01/15/42	400,000.00	452,840.00	
NETHER 4 01/15/37	400,000.00	453,320.00	
OBL 0 04/16/27	1,100,000.00	1,021,031.00	
OBL 0 10/09/26	1,800,000.00	1,687,014.00	
OBL 2.2 04/13/28	1,600,000.00	1,595,056.00	
OBL 2.4 10/19/28	700,000.00	704,221.00	
RAGB 0 1/2 04/20/27	400,000.00	374,220.00	
RAGB 0 1/4 10/20/36	200,000.00	141,640.00	
RAGB 0 3/4 10/20/26	400,000.00	379,680.00	
RAGB 0.9 02/20/32	300,000.00	259,680.00	
RAGB 2.1 09/20/17	200,000.00	146,600.00	
RAGB 3.15 06/20/44	100,000.00	99,960.00	
RAGB 3.15 10/20/53	100,000.00	99,600.00	
RAGB 3.8 01/26/62	100,000.00	113,720.00	
RAGB 4.15 03/37	400,000.00	446,560.00	
SPGB 0 01/31/27	2,900,000.00	2,665,680.00	
SPGB 0 01/31/28	600,000.00	536,430.00	
SPGB 0.85 07/30/37	800,000.00	568,880.00	

	SPGB 1.85 07/30/35	700,000.00	597,100.00	
	SPGB 2.8 05/31/26	1,500,000.00	1,495,650.00	
	SPGB 3.15 04/30/33	200,000.00	199,100.00	
	SPGB 3.45 07/30/43	300,000.00	285,900.00	
	SPGB 3.45 07/30/66	100,000.00	89,040.00	
	SPGB 3.9 07/30/39	300,000.00	309,480.00	
	SPGB 4.2 01/31/37	300,000.00	322,650.00	
	SPGB 4.7 07/30/41	700,000.00	791,630.00	
	SPGB 4.9 07/30/40	1,200,000.00	1,377,000.00	
	SPGB 5.15 10/31/44	500,000.00	599,450.00	
ユーロ小計		65,800,000.00	63,843,954.00 (10,266,746,242)	
	銘柄数	96		
	比率	32.0%	32.4%	
英ポンド			英ポンド	
	UKT 0 1/2 01/31/29	800,000.00	678,160.00	
	UKT 0 5/8 07/31/35	1,000,000.00	679,000.00	
	UKT 0 7/8 07/31/33	500,000.00	376,250.00	
	UKT 1 01/31/32	700,000.00	560,210.00	
	UKT 1 1/8 01/31/39	300,000.00	192,810.00	
	UKT 1 3/4 09/07/37	900,000.00	664,830.00	
	UKT 3 1/2 07/22/68	600,000.00	491,700.00	
	UKT 3 1/2 10/22/25	300,000.00	295,620.00	
	UKT 3 1/4 01/22/44	800,000.00	661,920.00	
	UKT 3 3/4 01/29/38	1,000,000.00	938,300.00	
	UKT 3 3/4 03/07/27	100,000.00	98,960.00	
	UKT 3 3/4 10/22/53	500,000.00	432,200.00	
	UKT 4 1/2 06/07/28	800,000.00	817,680.00	
	UKT 4 1/2 12/07/42	800,000.00	798,960.00	
	UKT 4 1/4 03/07/36	900,000.00	905,040.00	
	UKT 4 1/4 09/07/39	1,100,000.00	1,079,870.00	
	UKT 4 1/4 12/07/40	800,000.00	780,640.00	
	UKT 4 1/4 12/07/46	400,000.00	381,240.00	
	UKT 4 1/8 01/29/27	1,700,000.00	1,702,380.00	
	UKT 4 3/4 10/22/43	300,000.00	307,710.00	
	UKT 4 3/4 12/07/38	400,000.00	416,800.00	
	UKT 4 5/8 01/31/34	100,000.00	104,470.00	
英ポンド小計		14,800,000.00	13,364,750.00 (2,511,637,467)	
	銘柄数	22		
	比率	7.8%	7.9%	

豪ドル			豪ドル	
	ACGB 0 1/2 09/21/26	1,400,000.00	1,284,224.20	
	ACGB 1 1/2 06/21/31	2,000,000.00	1,671,600.00	
	ACGB 1 1/4 05/21/32	1,300,000.00	1,036,145.50	
	ACGB 2 1/2 05/21/30	500,000.00	458,650.00	
	ACGB 2 1/4 05/21/28	1,100,000.00	1,030,700.00	
	ACGB 2 3/4 05/21/41	600,000.00	472,740.60	
	ACGB 3 03/21/47	500,000.00	385,500.00	
	ACGB 3 1/4 06/21/39	500,000.00	431,850.00	
	ACGB 4 1/2 04/21/33	800,000.00	816,720.00	
	ACGB 4 3/4 04/21/27	1,400,000.00	1,440,502.00	
豪ドル小計	10,100,000.00	9,028,632.30 (877,312,200)		
	銘柄数	10		
	比率	2.7%	2.8%	
オフショア人民元			オフショア人民元	
CGB 2 06/15/25	3,000,000.00	2,991,720.00		
CGB 2 1/2 07/25/27	1,500,000.00	1,507,305.00		
CGB 2 3/4 06/15/29	1,300,000.00	1,320,397.00		
CGB 2.18 08/15/26	2,400,000.00	2,394,888.00		
CGB 2.18 08/25/25	1,900,000.00	1,898,765.00		
CGB 2.22 09/25/25	1,200,000.00	1,200,276.00		
CGB 2.24 05/25/25	1,500,000.00	1,501,155.00		
CGB 2.26 02/24/25	100,000.00	100,177.00		
CGB 2.28 11/25/25	2,300,000.00	2,302,392.00		
CGB 2.3 05/15/26	1,100,000.00	1,101,001.00		
CGB 2.33 12/15/25	1,500,000.00	1,503,510.00		
CGB 2.35 03/15/25	3,200,000.00	3,209,216.00		
CGB 2.37 01/20/27	900,000.00	901,341.00		
CGB 2.39 11/15/26	1,200,000.00	1,204,608.00		
CGB 2.4 07/15/28	3,800,000.00	3,802,964.00		
CGB 2.44 10/15/27	7,700,000.00	7,721,560.00		
CGB 2.46 02/15/26	3,700,000.00	3,715,466.00		
CGB 2.48 04/15/27	900,000.00	903,951.00		
CGB 2.52 08/25/33	3,000,000.00	2,993,670.00		
CGB 2.55 10/15/28	3,700,000.00	3,730,895.00		
CGB 2.6 09/01/32	1,800,000.00	1,806,534.00		
CGB 2.6 09/15/30	5,400,000.00	5,432,292.00		
CGB 2.62 04/15/28	600,000.00	606,552.00		
CGB 2.62 06/25/30	2,600,000.00	2,618,590.00		
CGB 2.62 09/25/29	1,000,000.00	1,008,220.00		
CGB 2.64 01/15/28	1,300,000.00	1,313,000.00		
CGB 2.67 05/25/33	2,000,000.00	2,019,160.00		
CGB 2.67 11/25/33	2,000,000.00	2,029,060.00		

CGB 2.68 05/21/30	400,000.00	404,344.00	
CGB 2.69 08/12/26	600,000.00	606,492.00	
CGB 2.69 08/15/32	500,000.00	505,410.00	
CGB 2.76 05/15/32	1,100,000.00	1,118,315.00	
CGB 2.79 12/15/29	6,700,000.00	6,819,729.00	
CGB 2.8 03/24/29	600,000.00	611,040.00	
CGB 2.8 03/25/30	900,000.00	916,236.00	
CGB 2.8 11/15/32	2,300,000.00	2,348,645.00	
CGB 2.88 02/25/33	1,500,000.00	1,541,910.00	
CGB 2.89 11/18/31	1,300,000.00	1,333,358.00	
CGB 2.91 10/14/28	400,000.00	409,500.00	
CGB 3 1/4 06/06/26	300,000.00	307,602.00	
CGB 3 1/4 11/22/28	1,000,000.00	1,043,990.00	
CGB 3 10/15/53	100,000.00	105,358.00	
CGB 3.01 05/13/28	200,000.00	205,496.00	
CGB 3.02 05/27/31	500,000.00	517,500.00	
CGB 3.03 03/11/26	800,000.00	814,280.00	
CGB 3.12 10/25/52	2,100,000.00	2,232,510.00	
CGB 3.12 12/05/26	400,000.00	410,224.00	
CGB 3.19 04/15/53	1,300,000.00	1,410,630.00	
CGB 3.22 12/06/25	500,000.00	509,915.00	
CGB 3.27 11/19/30	600,000.00	631,008.00	
CGB 3.32 04/15/52	800,000.00	880,400.00	
CGB 3.39 03/16/50	600,000.00	665,820.00	
CGB 3.53 10/18/51	1,200,000.00	1,368,888.00	
CGB 3.72 04/12/51	300,000.00	352,623.00	
CGB 3.81 09/14/50	400,000.00	476,232.00	
CGB 3.86 07/22/49	900,000.00	1,075,410.00	
オフショア人民元小計	90,900,000.00	92,461,530.00 (1,909,885,363)	
	銘柄数	56	
	比率	5.9%	6.0%
国債証券合計		円 31,643,308,612 (31,643,308,612)	
合計		円 31,643,308,612 (31,643,308,612)	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「TMA外国株式インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	[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			
預金		1,042,322,595	55,734,413
コール・ローン		273,949,540	500,801,455
株式		106,523,621,280	190,082,847,206
投資証券		2,511,220,942	3,813,498,630
派生商品評価勘定		71,883,902	27,773,053
未収入金			1,395,441,206
未収配当金		80,912,443	127,038,297
差入委託証拠金		894,288,095	1,624,275,010
流動資産合計		111,398,198,797	197,627,409,270
資産合計		111,398,198,797	197,627,409,270
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		566,713	3,127,155
未払解約金		31,497,411	934,624,097
未払利息		132	224
流動負債合計		32,064,256	937,751,476
負債合計		32,064,256	937,751,476
純資産の部			
元本等			
元本	1	26,873,327,459	35,343,594,383
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		84,492,807,082	161,346,063,411
元本等合計		111,366,134,541	196,689,657,794
純資産合計		111,366,134,541	196,689,657,794
負債純資産合計		111,398,198,797	197,627,409,270

(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	株式及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

自 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 同期中における追加設定元本額 同期中における一部解約元本額 同期末における元本額	16,521,030,366円 12,349,504,370円 1,997,207,277円 26,873,327,459円	26,873,327,459円 12,293,130,413円 3,822,863,489円 35,343,594,383円
元本の内訳* 東京海上セレクション・外国株式インデックス 東京海上・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型） 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	9,199,572,062円 103,112,339円 137,808,850円 75,014,168円	11,397,249,258円 144,735,796円 198,135,559円 114,095,210円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	47,531,242円	74,722,237円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	82,980,639円	126,076,990円
TMA外国株式インデックスVA<適格機 関投資家限定>	15,177,952円	5,995,329円
東京海上・世界インデックス・バラン ス40<適格機関投資家限定>	192,040,331円	206,096,641円
東京海上・世界インデックス・バラン ス60<適格機関投資家限定>	1,513,308,733円	1,733,876,818円
先進国株式インデックス(適格機 関投資家専用)	2,531,615,905円	2,143,061,739円
東京海上セレクション・外国株式 インデックス2<適格機関投資家 限定>	12,975,165,238円	19,199,548,806円
計	26,873,327,459円	35,343,594,383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	26,873,327,459口	35,343,594,383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、先物取引及び為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

<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 （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>
<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。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。</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
株式	7,080,492,632円
投資証券	226,637,472円
合計	7,307,130,104円

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

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

（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	17,557,958,620円
投資証券	389,015,022円
合計	17,946,973,642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。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(1) 株式関連

（2023年1月25日現在）

（単位：円）

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

（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		

株価指数先物取引				
市場取引	買建	2,773,947,330	2,797,704,768	23,757,438
	S&P 500 EMIN	2,152,793,544	2,172,654,838	19,861,294
	DJ EU STX 50	406,300,936	412,895,755	6,594,819
	FTSE 100 IDX	214,852,850	212,154,175	2,698,675
合 計		2,773,947,330	2,797,704,768	23,757,438

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(2) 通貨関連

(2023年1月25日現在)

該当事項はありません。

(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 以外の取引	為替予約取引				
	売建	459,182,850		458,294,390	888,460
	米ドル	459,182,850		458,294,390	888,460
合 計		459,182,850		458,294,390	888,460

(注)1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(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)	4.1441円 41,441円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.5651円 55,651円)
---------------------------	---------------------	---------------------------	---------------------

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
米ドル	株	米ドル	米ドル	
BAKER HUGHES COMPANY	26,456	30.04	794,738.24	
CHENIERE ENERGY INC	6,342	165.33	1,048,522.86	
CHEVRONTEXACO CORP	42,522	144.92	6,162,288.24	
CONOCOPHILLIPS	28,934	109.67	3,173,191.78	
COTERRA ENERGY INC	23,499	25.02	587,944.98	
DEVON ENERGY CORPORATION	18,193	41.62	757,192.66	
EOG RESOURCES INC	14,759	112.09	1,654,336.31	
EXXON MOBIL CORPORATION	93,561	99.60	9,318,675.60	
HALLIBURTON CO	23,764	36.83	875,228.12	
HESS CORP	7,461	140.27	1,046,554.47	
KINDER MORGAN INC	42,986	16.89	726,033.54	
MARATHON PETROLEUM CORP	10,012	155.10	1,552,861.20	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	17,978	57.31	1,030,319.18	
ONEOK INC	14,709	68.86	1,012,861.74	
PHILLIPS 66	11,199	133.67	1,496,970.33	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6,071	222.96	1,353,590.16	
SCHLUMBERGER LTD	34,425	51.67	1,778,739.75	
VALERO ENERGY CORP	8,677	130.15	1,129,311.55	
WILLIAMS COS INC	29,147	34.03	991,872.41	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,855	257.16	1,248,511.80	
ALBEMARLE CORP	3,407	121.69	414,597.83	
AMCOR PLC	26,681	9.31	248,400.11	
AVERY DENNISON CORP	1,849	198.46	366,952.54	
BALL CORP	8,168	55.87	456,346.16	
CELANESE CORP-SERIES A	3,423	143.30	490,515.90	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,333	76.77	409,414.41	
CLEVELAND-CLIFFS INC	19,190	18.27	350,601.30	
CORTEVA INC	13,724	45.41	623,206.84	
CROWN HOLDINGS INC	3,057	89.99	275,099.43	
DOW INC	14,058	53.09	746,339.22	
DUPONT DE NEMOURS INC	9,189	64.20	589,933.80	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	2,688	83.80	225,254.40	
ECOLAB INC	5,669	196.62	1,114,638.78	
FMC CORP	3,775	57.01	215,212.75	
FREEMPORT-MCMORAN INC	36,910	39.72	1,466,065.20	
INTERNATIONAL PAPER CO	7,165	36.18	259,229.70	

INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,176	79.04	567,191.04
LINDE PLC	11,106	401.28	4,456,615.68
LyondellBasell Industries NV	6,315	93.42	589,947.30
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,578	494.68	780,605.04
MOSAIC CO/THE	10,745	31.96	343,410.20
NEWMONT CORPORATION	26,835	34.44	924,197.40
NUCOR CORP	5,909	172.63	1,020,070.67
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,101	165.01	346,686.01
PPG INDUSTRIES INC	5,219	141.03	736,035.57
RPM INTERNATIONAL INC	3,822	106.52	407,119.44
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,899	301.06	1,775,952.94
STEEL DYNAMICS INC	4,389	116.54	511,494.06
VULCAN MATERIALS CO	3,056	219.80	671,708.80
WESTROCK CO	8,798	40.80	358,958.40
3M CO	12,350	93.24	1,151,514.00
ALLEGION PLC	2,388	122.93	293,556.84
AMETEK INC	4,028	162.74	655,516.72
AXON ENTERPRISE INC	2,238	251.24	562,275.12
BOEING CO	13,781	214.13	2,950,925.53
CARLISLE COS INC	1,559	302.19	471,114.21
CARRIER GLOBAL CORP	20,933	54.97	1,150,687.01
CATERPILLAR INC	11,973	290.68	3,480,311.64
CUMMINS INC	3,181	235.80	750,079.80
DEERE & CO	6,265	388.41	2,433,388.65
DOVER CORP	2,945	148.01	435,889.45
EATON CORP PLC	9,598	241.57	2,318,588.86
EMERSON ELECTRIC CO	13,359	94.39	1,260,956.01
FASTENAL CO	11,682	68.84	804,188.88
FERGUSON PLC	4,992	187.05	933,753.60
FORTIVE CORP	7,650	73.74	564,111.00
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	4,780	75.90	362,802.00
GENERAL DYNAMICS CORP	5,035	261.18	1,315,041.30
GENERAL ELECTRIC CO	26,186	129.93	3,402,346.98
GRACO INC	4,284	84.04	360,027.36
HEICO CORP	1,000	179.20	179,200.00
HEICO CORP	2,752	140.32	386,160.64
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	14,495	199.87	2,897,115.65
HOWMET AEROSPACE INC	11,586	56.34	652,755.24
HUBBELL INC	1,614	328.16	529,650.24
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,321	253.64	335,058.44
IDEX CORP	1,507	205.69	309,974.83
ILLINOIS TOOL WORKS INC	6,127	258.60	1,584,442.20
INGERSOLL-RAND INC	11,259	78.84	887,659.56

JARDINE MATHESON HLDGS LTD	3,200	40.65	130,080.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	15,287	55.02	841,090.74
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	4,658	204.25	951,396.50
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,099	432.69	475,526.31
LOCKHEED MARTIN CORP	5,006	431.65	2,160,839.90
MASCO CORP	6,370	65.47	417,043.90
NORDSON CORP	1,120	251.05	281,176.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,301	463.92	1,531,399.92
OTIS WORLDWIDE CORP	7,991	88.01	703,287.91
OWENS CORNING	3,115	146.85	457,437.75
PACCAR INC	12,507	100.83	1,261,080.81
PARKER HANNIFIN CORP	3,286	464.88	1,527,595.68
PENTAIR PLC	5,871	70.69	415,020.99
QUANTA SERVICES INC	4,117	193.28	795,733.76
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,862	300.35	859,601.70
RTX CORPORATION	34,452	89.49	3,083,109.48
SMITH (A.O.) CORP	3,568	80.33	286,617.44
SNAP-ON INC	1,235	286.28	353,555.80
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,448	92.89	413,174.72
TEXTRON INC	5,747	85.55	491,655.85
TRANE TECHNOLOGIES PLC	5,571	251.13	1,399,045.23
TRANSDIGM GROUP INC	1,413	1,059.92	1,497,666.96
UNITED RENTALS INC	1,842	576.90	1,062,649.80
WABTEC CORP/DE	5,254	129.50	680,393.00
WW GRAINGER INC	1,034	871.24	900,862.16
XYLEM INC	5,818	111.70	649,870.60
AUTOMATIC DATA PROCESSING	9,197	238.44	2,192,932.68
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	3,750	129.15	484,312.50
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	3,167	206.07	652,623.69
CINTAS CORP	2,022	597.95	1,209,054.90
COPART INC	22,427	48.65	1,091,073.55
EQUIFAX INC	3,386	247.42	837,764.12
JACOBS SOLUTIONS INC	3,313	134.09	444,240.17
LEIDOS HOLDINGS INC	3,726	110.16	410,456.16
PAYCHEX INC	6,634	121.89	808,618.26
PAYCOM SOFTWARE INC	2,044	193.42	395,350.48
REPUBLIC SERVICES INC	4,818	169.34	815,880.12
ROBERT HALF INC	2,534	81.09	205,482.06
ROLLINS INC	8,098	43.29	350,562.42
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	5,892	60.94	359,058.48
TRANSUNION	6,716	69.57	467,232.12
VERALTO CORP	5,907	76.26	450,467.82
VERISK ANALYTICS INC	3,342	244.65	817,620.30

WASTE CONNECTIONS INC	5,761	151.80	874,519.80
WASTE MANAGEMENT INC	8,944	183.80	1,643,907.20
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,601	85.57	222,567.57
CSX CORP	43,814	34.39	1,506,763.46
DELTA AIR LINES INC	2,000	38.19	76,380.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,429	127.18	436,100.22
FEDEX CORP	5,633	249.73	1,406,729.09
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,272	203.71	462,829.12
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4,969	56.98	283,133.62
NORFOLK SOUTHERN CORP	5,054	237.07	1,198,151.78
OLD DOMINION FREIGHT LINE INC	2,442	391.68	956,482.56
SOUTHWEST AIRLINES CO	8,560	31.11	266,301.60
UBER TECHNOLOGIES INC	44,601	63.76	2,843,759.76
UNION PACIFIC CORP	13,883	242.33	3,364,267.39
UNITED PARCEL SERVICE CL B	15,687	156.58	2,456,270.46
APTIV PLC	7,577	83.08	629,497.16
BORGWARNER INC	8,387	33.27	279,035.49
FORD MOTOR CO	97,613	11.03	1,076,671.39
GENERAL MOTORS CO	33,035	34.70	1,146,314.50
LEAR CORP	2,180	130.39	284,250.20
TESLA INC	66,236	207.83	13,765,827.88
DR HORTON INC	7,944	139.21	1,105,884.24
GARMIN LTD	3,495	125.11	437,259.45
HASBRO INC	4,103	48.12	197,436.36
LENNAR CORP-CL A	6,642	145.12	963,887.04
LULULEMON ATHLETICA INC	2,849	474.84	1,352,819.16
NIKE INC -CL B	28,627	100.76	2,884,456.52
NVR INC	84	6,857.43	576,024.12
PULTE HOMES INC	6,519	102.36	667,284.84
VF CORP	12,957	16.81	217,807.17
AIRBNB INC-CLASS A	10,914	141.19	1,540,947.66
BOOKING HOLDINGS INC	863	3,496.75	3,017,695.25
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A	700	2,334.80	1,634,360.00
DARDEN RESTAURANTS INC	3,738	161.66	604,285.08
DOMINO'S PIZZA INC	967	421.77	407,851.59
EXPEDIA GROUP INC	4,201	148.57	624,142.57
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	6,835	187.57	1,282,040.95
LAS VEGAS SANDS CORP	11,822	49.64	586,844.08
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	6,483	237.87	1,542,111.21
MCDONALD'S CORP	17,049	300.44	5,122,201.56
STARBUCKS CORP	27,948	92.04	2,572,333.92
VAIL RESORTS INC	1,591	224.51	357,195.41
YUM! BRANDS INC	6,777	129.44	877,214.88

ALPHABET INC-CL A	136,073	148.70	20,234,055.10
ALPHABET INC-CL C	120,917	150.35	18,179,870.95
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	2,212	371.39	821,514.68
COMCAST CORP-CL A	91,262	43.80	3,997,275.60
ELECTRONIC ARTS INC	5,875	137.86	809,927.50
FOX CORP-CLASS A	3,111	31.41	97,716.51
FOX CORP-CLASS B	4,481	29.06	130,217.86
INTERPUBLIC GROUP COS INC	9,676	32.23	311,857.48
LIBERTY BROADBAND-C	2,799	78.16	218,769.84
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	7,559	31.14	235,387.26
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	5,392	68.26	368,057.92
LIVE NATION	4,576	89.35	408,865.60
META PLATFORMS INC-A	51,433	390.70	20,094,873.10
NETFLIX INC	10,354	544.87	5,641,583.98
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	11,333	24.63	279,131.79
OMNICOM GROUP	4,455	89.15	397,163.25
PARAMOUNT GLOBAL CLASS-B	17,905	13.36	239,210.80
PINTEREST INC- CLASS A	17,175	36.52	627,231.00
ROKU INC	4,136	88.23	364,919.28
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	4,865	165.90	807,103.50
THE WALT DISNEY CO	42,255	93.50	3,950,842.50
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	11,447	69.65	797,283.55
WARNER BROS DISCOVERY INC	63,420	10.41	660,202.20
AMAZON.COM INC	214,066	156.87	33,580,533.42
AUTOZONE INC	424	2,751.62	1,166,686.88
BEST BUY COMPANY INC	5,252	73.33	385,129.16
BURLINGTON STORES INC	1,987	190.83	379,179.21
CARMAX INC	5,349	67.45	360,790.05
EBAY INC	12,217	41.61	508,349.37
ETSY INC	4,384	68.32	299,514.88
GENUINE PARTS CO	3,300	141.67	467,511.00
HOME DEPOT INC	23,014	347.27	7,992,071.78
LKQ CORP	6,780	47.46	321,778.80
LOWE'S COMPANIES	13,385	210.55	2,818,211.75
MERCADOLIBRE INC	1,128	1,762.70	1,988,325.60
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,397	1,018.45	1,422,774.65
POOL CORP	1,201	380.90	457,460.90
ROSS STORES INC	8,500	138.73	1,179,205.00
TJX COMPANIES INC	26,348	94.95	2,501,742.60
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,798	226.03	632,431.94
ULTA BEAUTY INC	1,265	478.77	605,644.05
COSTCO WHOLESALE CORP	10,315	686.51	7,081,350.65
DOLLAR GENERAL CORP	5,171	130.67	675,694.57

DOLLAR TREE INC	5,110	130.16	665,117.60
KROGER CO	12,984	46.10	598,562.40
SYSCO CORP	10,106	74.99	757,848.94
TARGET CORP	10,908	139.20	1,518,393.60
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	20,194	22.37	451,739.78
WALMART INC	33,198	160.50	5,328,279.00
ALTRIA GROUP INC	36,905	39.93	1,473,616.65
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	11,598	52.63	610,402.74
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	8,306	54.56	453,175.36
BUNGE GLOBAL SA	3,949	89.11	351,895.39
CAMPBELL SOUP CO	5,786	44.12	255,278.32
COCA-COLA COMPANY	91,658	58.91	5,399,572.78
COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC	6,120	67.55	413,406.00
CONAGRA BRANDS INC	12,081	29.41	355,302.21
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,696	247.41	914,427.36
GENERAL MILS INC	12,487	63.64	794,672.68
HERSHEY CO/THE	2,856	189.31	540,669.36
HORMEL FOODS CORP	8,202	30.40	249,340.80
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	2,940	129.74	381,435.60
KELLANOVA	6,309	53.47	337,342.23
KEURIG DR PEPPER INC	23,525	31.14	732,568.50
KRAFT HEINZ CO/THE	20,674	36.82	761,216.68
LAMB WESTON HOLDING INC	4,635	105.85	490,614.75
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,421	65.78	422,373.38
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	6,054	61.11	369,959.94
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	31,386	73.95	2,320,994.70
MONSTER BEVERAGE CORP	18,494	55.07	1,018,464.58
PEPSICO INC	30,659	165.60	5,077,130.40
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	34,951	90.88	3,176,346.88
TYSON FOODS INC-CL A	7,644	53.18	406,507.92
CHURCH & DWIGHT CO INC	6,460	97.10	627,266.00
CLOROX COMPANY	3,577	139.73	499,814.21
COLGATE-PALMOLIVE CO	15,482	80.08	1,239,798.56
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	6,498	126.16	819,787.68
KENVUE INC	40,992	20.43	837,466.56
KIMBERLY-CLARK CORP	6,090	118.04	718,863.60
PROCTER & GAMBLE CO	53,077	152.12	8,074,073.24
ABBOTT LABORATORIES	38,756	110.77	4,293,002.12
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,039	257.07	524,165.73
BAXTER INTL INC	13,089	37.88	495,811.32
BECTON DICKINSON & CO	6,441	234.57	1,510,865.37
BOSTON SCIENTIFIC CORP	34,091	59.92	2,042,732.72
CARDINAL HEALTH INC	7,032	104.36	733,859.52

GENCORA INC	4,285	217.38	931,473.30
CENTENE CORP	12,498	75.48	943,349.04
COOPER COS INC/THE	1,312	379.93	498,468.16
CVS HEALTH CORPORATION	29,149	74.19	2,162,564.31
DAVITA INC	2,181	104.46	227,827.26
DEXCOM INC	10,009	127.42	1,275,346.78
Edwards Lifesciences Corp	14,379	72.54	1,043,052.66
ELEVANCE HEALTH INC	5,011	473.67	2,373,560.37
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	10,237	71.55	732,457.35
HCA HEALTHCARE INC	4,563	278.93	1,272,757.59
HENRY SCHEIN INC	2,833	73.26	207,545.58
HOLOGIC INC	5,135	74.09	380,452.15
HUMANA INC	2,650	402.40	1,066,360.00
IDEXX LABORATORIES INC	2,071	520.21	1,077,354.91
INTUITIVE SURGICAL INC	8,464	370.07	3,132,272.48
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,880	223.35	419,898.00
MCKESSON CORP	3,123	485.00	1,514,655.00
MEDTRONIC PLC	29,092	84.72	2,464,674.24
MOLINA HEALTHCARE INC	1,547	366.35	566,743.45
QUEST DIAGNOSTICS	2,262	127.76	288,993.12
RESMED INC	3,808	171.78	654,138.24
STERIS PLC	2,542	214.85	546,148.70
STRYKER CORP	7,938	307.75	2,442,919.50
TELEFLEX INC	1,451	241.96	351,083.96
THE CIGNA GROUP	6,891	304.50	2,098,309.50
UNITEDHEALTH GROUP INC	20,999	513.23	10,777,316.77
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	1,529	153.35	234,472.15
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3,731	209.09	780,114.79
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,975	120.52	599,587.00
ABBVIE INC	40,686	164.22	6,681,454.92
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,089	129.78	920,010.42
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,575	185.20	662,090.00
AMGEN INC	12,350	305.50	3,772,925.00
AVANTOR INC	19,570	22.07	431,909.90
BIOGEN INC	3,041	247.16	751,613.56
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,392	92.31	497,735.52
BIO-RAD LABORATORIES-A	776	316.56	245,650.56
BIO-TECHNE CORP	4,779	71.06	339,595.74
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	45,413	50.24	2,281,549.12
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,673	213.11	356,533.03
DANAHER CORP	16,213	228.61	3,706,453.93
ELI LILLY AND COMPANY	18,771	633.70	11,895,182.70
GILEAD SCIENCES INC	28,051	79.53	2,230,896.03

ILLUMINA INC	4,350	141.01	613,393.50
INCYTE CORP	5,261	60.84	320,079.24
IQVIA HOLDINGS INC	4,671	212.88	994,362.48
JOHNSON & JOHNSON	54,002	158.96	8,584,157.92
MERCK & CO. INC.	57,611	118.88	6,848,795.68
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	519	1,204.81	625,296.39
MODERNA INC	8,405	101.11	849,829.55
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,048	140.11	427,055.28
PFIZER INC	126,193	28.33	3,575,047.69
Regeneron Pharmaceuticals Inc	2,478	948.24	2,349,738.72
REVVITY INC	3,764	106.91	402,409.24
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	8,210	29.08	238,746.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,931	539.99	4,822,650.69
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6,215	427.56	2,657,285.40
VIATRIS INC	31,530	11.72	369,531.60
WATERS CORP	1,608	312.42	502,371.36
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	1,958	348.71	682,774.18
ZOETIS INC	10,759	186.07	2,001,927.13
BANK OF AMERICA CORP	164,840	32.98	5,436,423.20
CITIGROUP INC	44,105	53.26	2,349,032.30
CITIZENS FINANCIAL GROUP	12,688	33.68	427,331.84
FIFTH THIRD BANCORP	18,528	34.70	642,921.60
HUNTINGTON BANCSHARES INC	42,632	13.08	557,626.56
JPMORGAN CHASE & CO	66,429	170.50	11,326,144.50
KEYCORP	32,834	14.44	474,122.96
M & T BANK CORP	3,895	142.68	555,738.60
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	9,800	150.23	1,472,254.00
REGIONS FINANCIAL CORP	23,298	19.25	448,486.50
TRUIST FINANCIAL CORP	30,263	37.55	1,136,375.65
US BANCORP	37,530	42.48	1,594,274.40
WELLS FARGO & COMPANY	84,297	49.49	4,171,858.53
ALLY FINANCIAL INC	9,692	36.48	353,564.16
AMERICAN EXPRESS COMPANY	14,286	185.82	2,654,624.52
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,410	389.46	938,598.60
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	10,708	98.08	1,050,240.64
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	16,808	54.91	922,927.28
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	29,460	376.59	11,094,341.40
BLACKROCK INC	3,399	785.75	2,670,764.25
BLACKSTONE INC	17,612	120.63	2,124,535.56
BLOCK INC	14,895	62.57	931,980.15
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	9,181	131.09	1,203,537.29
CARLYLE GROUP INC/THE	8,937	39.73	355,067.01
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,806	188.80	529,772.80

CME GROUP INC	8,081	204.27	1,650,705.87
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	6,498	101.22	657,727.56
EQUITABLE HOLDINGS INC	12,717	33.21	422,331.57
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	889	470.85	418,585.65
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	15,213	61.06	928,905.78
FISERV INC	14,414	140.00	2,017,960.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,886	287.40	542,036.40
FRANKLIN RESOURCES INC	11,099	26.88	298,341.12
GLOBAL PAYMENTS INC	6,441	130.01	837,394.41
GOLDMAN SACHS GROUP INC	7,678	379.40	2,913,033.20
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	13,059	127.04	1,659,015.36
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,879	166.63	313,097.77
KKR & CO INC	15,093	83.34	1,257,850.62
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	1,976	242.07	478,330.32
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,058	274.89	290,833.62
MASTERCARD INC - A	18,981	438.70	8,326,964.70
MOODY'S CORP	3,765	389.94	1,468,124.10
MORGAN STANLEY	29,163	87.57	2,553,803.91
MSCI INC	1,843	558.46	1,029,241.78
NASDAQ INC	8,119	58.20	472,525.80
NORTHERN TRUST CORP	5,536	80.88	447,751.68
PAYPAL HOLDINGS INC	24,114	63.02	1,519,664.28
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,380	112.53	605,411.40
S&P GLOBAL INC	7,732	445.90	3,447,698.80
SCHWAB (CHARLES) CORP	36,150	63.48	2,294,802.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,164	64.59	75,182.76
STATE STREET CORP	7,773	73.84	573,958.32
SYNCHRONY FINANCIAL	10,821	37.97	410,873.37
T ROWE PRICE GROUP INC	4,880	109.75	535,580.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	3,347	97.82	327,403.54
VISA INC-CLASS A SHARES	36,301	271.65	9,861,166.65
AFLAC INC	12,075	85.00	1,026,375.00
ALLSTATE CORP	6,420	157.42	1,010,636.40
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,447	120.32	174,103.04
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	16,774	69.16	1,160,089.84
AON PLC	4,268	304.06	1,297,728.08
ARCH CAPITAL GROUP LTD	9,390	80.13	752,420.70
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5,301	239.07	1,267,310.07
ASSURANT INC	1,692	169.59	286,946.28
BROWN & BROWN INC	6,645	77.60	515,652.00
CHUBB LTD	8,791	241.58	2,123,729.78
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,750	112.95	423,562.50
EVEREST GROUP LTD	1,214	375.01	455,262.14

FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	9,149	49.53	453,149.97
GLOBE LIFE INC	1,803	122.04	220,038.12
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	5,550	86.42	479,631.00
LOEWS CORP	4,839	73.09	353,682.51
MARKEL GROUP INC	328	1,468.78	481,759.84
MARSH & MCLENNAN COS	10,853	198.69	2,156,382.57
METLIFE INC	14,397	69.68	1,003,182.96
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,112	79.90	488,348.80
PROGRESSIVE CORP	13,789	178.36	2,459,406.04
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	8,251	104.79	864,622.29
TRAVELERS COS INC/THE	4,218	210.98	889,913.64
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,414	250.99	605,889.86
WR BERKLEY CORP	5,324	77.69	413,621.56
ACCENTURE PLC-CL A	14,589	368.90	5,381,882.10
ADOBE INC	10,712	606.48	6,496,613.76
AKAMAI TECHNOLOGIES	4,162	123.76	515,089.12
ANSYS INC	2,357	339.57	800,366.49
AUTODESK INC	5,547	252.66	1,401,505.02
CADENCE DESIGN SYS INC	6,793	294.91	2,003,323.63
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,376	157.34	373,839.84
CLOUDFLARE INC - CLASS A	8,361	82.33	688,361.13
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	11,096	76.95	853,837.20
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC-A	5,735	300.28	1,722,105.80
CYBERARK SOFTWARE LTD	1,731	231.72	401,107.32
DATADOG INC - CLASS A	7,052	122.58	864,434.16
DOCUSIGN INC	7,077	62.47	442,100.19
DYNATRACE INC	8,430	58.65	494,419.50
EPAM SYSTEMS INC	1,620	288.33	467,094.60
FAIR ISAAC CORP	694	1,275.55	885,231.70
FORTINET INC	17,601	66.11	1,163,602.11
GARTNER INC	2,143	463.08	992,380.44
GEN DIGITAL INC	18,022	23.50	423,517.00
GODADDY INC - CLASS A	4,641	108.35	502,852.35
HUBSPOT INC	1,360	585.70	796,552.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	21,036	173.93	3,658,791.48
INTUIT INC	6,686	636.18	4,253,499.48
MICROSOFT CORP	162,424	402.56	65,385,405.44
MONGODB INC	2,032	410.11	833,343.52
ORACLE CORPORATION	38,812	114.31	4,436,599.72
PALO ALTO NETWORKS INC	7,544	340.24	2,566,770.56
PTC INC	3,620	178.71	646,930.20
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,290	547.77	1,254,393.30
SALESFORCE INC	22,899	276.88	6,340,275.12

SERVICENOW INC	4,897	763.42	3,738,467.74
SNOWFLAKE INC-CLASS A	7,261	203.81	1,479,864.41
SYNOPSYS INC	3,804	540.46	2,055,909.84
TWILIO INC - A	5,806	72.80	422,676.80
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,324	439.29	581,619.96
VERISIGN INC	1,817	203.98	370,631.66
WORKDAY INC-CLASS A	5,292	295.50	1,563,786.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	7,825	69.04	540,238.00
ZSCALER INC	2,705	241.38	652,932.90
AMPHENOL CORP-CL A	13,695	100.66	1,378,538.70
APPLE INC	359,013	194.50	69,828,028.50
ARISTA NETWORKS INC	6,640	262.47	1,742,800.80
CDW CORP/DE	3,399	226.33	769,295.67
CISCO SYSTEMS INC	88,928	51.31	4,562,895.68
CORNING INC	17,801	30.37	540,616.37
DELL TECHNOLOGIES -C	7,604	83.71	636,530.84
F5 INC	1,339	181.33	242,800.87
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	35,713	15.76	562,836.88
HP INC	21,214	29.56	627,085.84
JUNIPER NETWORKS INC	7,155	37.19	266,094.45
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	4,276	155.22	663,720.72
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,868	328.35	1,270,057.80
NETAPP INC	6,049	88.69	536,485.81
TE CONNECTIVITY LTD	6,512	143.63	935,318.56
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,261	417.92	526,997.12
TRIMBLE INC	7,208	50.74	365,733.92
WESTERN DIGITAL CORP	10,212	58.03	592,602.36
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,597	254.17	405,909.49
AT&T INC	165,977	16.68	2,768,496.36
T-MOBILE US INC	12,929	162.00	2,094,498.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	95,553	41.28	3,944,427.84
AES CORPORATION	22,929	16.50	378,328.50
ALLIANT ENERGY CORP	6,060	48.14	291,728.40
AMEREN CORPORATION	5,961	68.36	407,493.96
AMERICAN ELECTRIC POWER	10,283	76.99	791,688.17
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,852	121.94	591,652.88
ATMOS ENERGY CORP	3,799	110.89	421,271.11
CENTERPOINT ENERGY INC	18,593	27.14	504,614.02
CMS ENERGY CORP	7,500	55.61	417,075.00
CONSOLIDATED EDISON INC	5,615	88.32	495,916.80
CONSTELLATION ENERGY	8,527	115.67	986,318.09
DOMINION ENERGY INC	19,537	44.15	862,558.55
DTE ENERGY COMPANY	4,608	102.36	471,674.88

DUKE ENERGY CORP	16,435	94.54	1,553,764.90	
EDISON INTERNATIONAL	10,804	65.18	704,204.72	
ENTERGY CORP	5,100	97.20	495,720.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	8,574	35.78	306,777.72	
EVERGY INC	5,503	49.35	271,573.05	
EVERSOURCE ENERGY	8,721	53.16	463,608.36	
EXELON CORP	23,104	34.08	787,384.32	
FIRSTENERGY CORP	12,231	35.96	439,826.76	
NEXTERA ENERGY INC	47,830	57.01	2,726,788.30	
NISOURCE INC	13,487	25.18	339,602.66	
NRG ENERGY INC	8,205	52.03	426,906.15	
PPL CORPORATION	15,393	25.44	391,597.92	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	9,474	56.98	539,828.52	
SEMPRA	13,175	70.11	923,699.25	
SOUTHERN CO	24,494	68.20	1,670,490.80	
WEC ENERGY GROUP INC	6,777	79.06	535,789.62	
XCEL ENERGY INC	11,589	58.22	674,711.58	
ADVANCED MICRO DEVICES	38,039	178.29	6,781,973.31	
ANALOG DEVICES	11,244	198.30	2,229,685.20	
APPLIED MATERIALS INC	19,392	174.14	3,376,922.88	
BROADCOM INC	10,302	1,253.87	12,917,368.74	
ENPHASE ENERGY INC	3,998	108.07	432,063.86	
FIRST SOLAR INC	2,873	148.87	427,703.51	
INTEL CORP	97,828	49.09	4,802,376.52	
KLA CORPORATION	3,308	638.45	2,111,992.60	
LAM RESEARCH CORP	3,147	848.16	2,669,159.52	
MARVELL TECHNOLOGY INC	21,017	72.28	1,519,108.76	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,290	90.56	1,112,982.40	
MICRON TECHNOLOGY INC	25,935	88.08	2,284,354.80	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,188	632.00	750,816.00	
NVIDIA CORP	56,959	613.62	34,951,181.58	
NXP SEMICONDUCTORS NV	5,986	221.69	1,327,036.34	
ON SEMICONDUCTOR CORP	10,902	75.15	819,285.30	
QORVO INC	2,456	105.96	260,237.76	
QUALCOMM INC	25,269	154.37	3,900,775.53	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	3,366	107.80	362,854.80	
TERADYNE INC	3,950	110.67	437,146.50	
TEXAS INSTRUMENTS	19,610	170.07	3,335,072.70	
CBRE GROUP INC - A	7,338	85.85	629,967.30	
COSTAR GROUP INC	9,985	83.76	836,343.60	
米ドル小計	7,499,307		965,802,104.26 (142,803,499,135)	
銘柄数		506		

	比 率	72.6%	75.1%	
加ドル	株	加ドル	加ドル	
CAMECO CORP	13,182	64.17	845,888.94	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	27,537	85.33	2,349,732.21	
CENOVUS ENERGY INC	42,264	20.89	882,894.96	
ENBRIDGE INC	47,050	48.03	2,259,811.50	
IMPERIAL OIL LTD	7,218	75.23	543,010.14	
KEYERA CORP	11,729	32.91	386,001.39	
PEMBINA PIPELINE CORP	16,343	46.26	756,027.18	
SUNCOR ENERGY INC	29,391	43.05	1,265,282.55	
TC ENERGY CORP	24,254	51.99	1,260,965.46	
AGNICO EAGLE MINES LTD	13,852	66.22	917,279.44	
BARRICK GOLD CORP	42,681	21.02	897,154.62	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,862	57.71	280,586.02	
FRANCO-NEVADA CORP	4,320	145.52	628,646.40	
NUTRIEN LTD	12,633	69.19	874,077.27	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	13,175	62.22	819,748.50	
CAE INC	11,870	27.45	325,831.50	
WSP GLOBAL INC	3,729	192.95	719,510.55	
RB GLOBAL INC	5,493	83.29	457,511.97	
THOMSON REUTERS CORP	4,388	202.49	888,526.12	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	11,724	166.39	1,950,756.36	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	22,264	105.44	2,347,516.16	
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,046	74.42	673,203.32	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,543	43.50	328,120.50	
RESTAURANT BRANDS INTERN	8,670	103.00	893,010.00	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	1,983	147.28	292,056.24	
DOLLARAMA INC	8,542	100.14	855,395.88	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	18,828	81.36	1,531,846.08	
LOBLAW COMPANIES LTD	4,143	134.39	556,777.77	
METRO INC	5,695	70.88	403,661.60	
WESTON (GEORGE) LTD	2,428	172.49	418,805.72	
SAPUTO INC	9,339	28.37	264,947.43	
BANK OF MONTREAL	17,036	130.04	2,215,361.44	
BANK OF NOVA SCOTIA	24,604	61.67	1,517,328.68	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	22,276	61.47	1,369,305.72	
NATIONAL BANK OF CANADA	8,536	102.26	872,891.36	
ROYAL BANK OF CANADA	30,810	132.34	4,077,395.40	
TORONTO-DOMINION BANK	40,073	82.29	3,297,607.17	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	11,025	53.52	590,058.00	
BROOKFIELD CORP	35,677	54.42	1,941,542.34	
IGM FINANCIAL INC	7,744	36.38	281,726.72	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	654	1,329.58	869,545.32	

GREAT-WEST LIFE CO INC	10,841	43.84	475,269.44	
INTACT FINANCIAL CORP	4,371	208.25	910,260.75	
MANULIFE FINANCIAL CORP	37,956	29.24	1,109,833.44	
POWER CORP OF CANADA	17,777	39.50	702,191.50	
SUN LIFE FINANCIAL INC	10,581	69.17	731,887.77	
CGI INC	5,482	146.25	801,742.50	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	520	3,657.15	1,901,718.00	
OPEN TEXT CORP	10,117	56.68	573,431.56	
SHOPIFY INC - CLASS A	29,616	109.25	3,235,548.00	
BCE INC	5,471	55.04	301,123.84	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	11,507	64.04	736,908.28	
TELUS CORP	1,600	24.50	39,200.00	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	31,725	7.90	250,627.50	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	9,455	31.00	293,105.00	
EMERA INC	8,328	48.26	401,909.28	
FORTIS INC	11,977	53.36	639,092.72	
HYDRO ONE LTD	12,657	39.27	497,040.39	
加ドル小計	864,592		58,508,235.90 (6,394,950,183)	
	銘柄数	58		
	比率	3.3%	3.4%	
ユーロ	株	ユーロ	ユーロ	
ENI SPA	43,467	14.49	629,836.83	
Galp Energia SGPS SA	20,290	14.16	287,306.40	
NESTE OYJ	11,108	32.14	357,011.12	
OMV AG	6,892	38.80	267,409.60	
REPSOL SA	30,688	13.15	403,547.20	
TENARIS SA	15,402	14.98	230,721.96	
TOTALENERGIES SE	55,040	58.86	3,239,654.40	
AIR LIQUIDE	11,340	172.46	1,955,696.40	
AKZO NOBEL	3,793	70.74	268,316.82	
ARCELORMITTAL	9,253	25.42	235,257.52	
Arkema SA	1,578	100.35	158,352.30	
BASF SE	19,016	43.78	832,520.48	
COVESTRO AG	5,735	47.82	274,247.70	
DSM-FIRMENICH AG	3,976	91.20	362,611.20	
EVONIK INDUSTRIES AG	6,597	17.04	112,445.86	
HEIDELBERG MATERIALS AG	3,341	82.98	277,236.18	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	6,318	34.65	218,918.70	
STORA ENSO OYJ-R SHS	16,906	11.71	197,969.26	
SYENSQO SA	2,285	80.65	184,285.25	
SYMRISE AG	3,277	92.70	303,777.90	
UMICORE	7,141	21.64	154,531.24	

UPM-KYMMENE OYJ	12,254	33.76	413,695.04
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6,388	39.66	253,348.08
ACS ACTIVIDADES DE CONS-RTS	6,388	0.46	2,970.42
AIRBUS SE	13,794	146.74	2,024,131.56
ALSTOM	19,230	11.25	216,433.65
BOUYGUES	6,300	35.05	220,815.00
BRENNTAG SE	3,269	79.76	260,735.44
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,470	63.40	663,798.00
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	12,520	32.35	405,022.00
Eiffage SA	1,164	98.96	115,189.44
GEA GROUP AG	2,984	35.96	107,304.64
IMCD NV	1,811	142.05	257,252.55
KINGSPAN GROUP PLC	4,720	73.76	348,147.20
KNORR-BREMSE AG	1,898	57.48	109,097.04
KONE OYJ-B	7,315	44.53	325,736.95
Legrand SA	5,221	90.62	473,127.02
MTU AERO ENGINES AG	1,511	217.70	328,944.70
OUTOTEC OYJ	30,732	9.41	289,188.12
Prysmian SpA	7,273	40.78	296,592.94
RHEINMETALL AG	1,211	331.70	401,688.70
SAFRAN SA	8,572	171.36	1,468,897.92
SCHNEIDER ELECTRIC SE	12,398	182.50	2,262,635.00
SIEMENS AG	17,681	167.50	2,961,567.50
SIEMENS ENERGY AG	24,069	13.56	326,495.98
THALES SA	2,907	134.50	390,991.50
VINCI S.A.	10,539	117.42	1,237,489.38
WARTSILA	19,406	13.38	259,652.28
Bureau Veritas SA	5,163	24.45	126,235.35
RANDSTAD NV	2,583	52.38	135,297.54
TELEPERFORMANCE	1,724	153.20	264,116.80
WOLTERS KLUWER	5,526	139.20	769,219.20
AENA SME SA	1,869	161.75	302,310.75
Aéroports de Paris	1,443	120.60	174,025.80
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	31,746	7.68	243,968.01
DHL GROUP	19,891	44.97	894,597.72
GETLINK SE	13,705	16.19	221,952.47
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	5,521	93.55	516,489.55
Bayerische Motoren Werke AG	2,918	87.60	255,616.80
CONTINENTAL AG	3,033	72.88	221,045.04
DR ING HC F PORSCHE AG	2,781	75.34	209,520.54
FERRARI NV	3,159	309.20	976,762.80
MERCEDES-BENZ GROUP AG	16,115	60.73	978,663.95
MICHELIN (CGDE)	13,843	30.84	426,918.12

PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	2,526	45.61	115,210.86
STELLANTIS NV	57,677	19.56	1,128,392.82
VOLKSWAGEN AG	1,861	127.60	237,463.60
VOLKSWAGEN AG PFD	3,305	116.00	383,380.00
ADIDAS AG	3,968	166.14	659,243.52
HERMES INTERNATIONAL	755	1,831.80	1,383,009.00
KERING	1,499	364.75	546,760.25
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	6,372	683.40	4,354,624.80
MONCLER SPA	5,930	51.96	308,122.80
PUMA AG	3,430	38.49	132,020.70
ACCOR SA	8,673	36.20	313,962.60
AMADEUS IT GROUP SA	11,097	64.84	719,529.48
SODEXO	3,184	100.95	321,424.80
BOLLORE	20,638	5.84	120,525.92
PUBLICIS GROUPE	5,206	88.76	462,084.56
SCOUT24 SE	2,483	66.80	165,864.40
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	18,291	27.47	502,453.77
VIVENDI SA	20,210	9.97	201,534.12
INDITEX	25,193	39.01	982,778.93
PROSUS NV	36,350	27.98	1,017,073.00
ZALANDO SE	8,167	18.20	148,680.23
CARREFOUR SA	12,917	15.86	204,928.20
HELLOFRESH SE	8,130	12.97	105,446.10
JERONIMO MARTINS	9,932	21.02	208,770.64
KESKO OYJ-B SHS	6,537	17.13	111,978.81
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	16,561	25.95	429,840.75
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	19,646	57.76	1,134,752.96
DANONE	12,838	61.35	787,611.30
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	20,903	9.02	188,545.06
HEINEKEN HOLDING NV	2,599	75.85	197,134.15
HEINEKEN NV	5,890	90.74	534,458.60
JDE PEET'S NV	5,525	22.42	123,870.50
KERRY GROUP PLC-A	3,039	79.70	242,208.30
PERNOD-RICARD	4,491	144.05	646,928.55
REMY COINTREAU	1,464	88.00	128,832.00
BEIERSDORF AG	2,483	132.40	328,749.20
HENKEL AG & CO KGAA	1,673	63.76	106,670.48
HENKEL AG AND CO KGAA VORZUG	3,167	71.44	226,250.48
L'OREAL	5,415	429.00	2,323,035.00
ESSILORLUXOTTICA	6,487	177.56	1,151,831.72
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	5,409	36.83	199,213.47
Fresenius SE & CO KG	9,942	26.57	264,158.94
KONINKLIJKE PHILIPS NV	21,815	21.13	460,950.95

SIEMENS HEALTHINEERS AG	7,212	51.20	369,254.40
ARGENX SE	1,761	336.80	593,104.80
BAYER AG	22,454	32.62	732,561.75
EUROFINS SCIENTIFIC	3,972	56.74	225,371.28
MERCK KGAA	2,993	146.85	439,522.05
ORION OYJ	4,594	43.60	200,298.40
QIAGEN N V	5,017	40.52	203,288.84
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,752	49.94	187,374.88
SANOFI	25,896	92.55	2,396,674.80
SARTORIUS AG-VORZUG	959	300.00	287,700.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,095	221.30	242,323.50
UCB SA	3,204	86.84	278,235.36
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	146,938	8.22	1,208,711.98
BANCO SANTANDER S.A	367,122	3.72	1,368,814.37
BNP PARIBAS	24,396	61.99	1,512,308.04
CaixaBank SA	115,228	3.93	453,537.40
COMMERZBANK AG	35,611	10.79	384,242.69
CREDIT AGRICOLE SA	31,699	13.38	424,132.62
ERSTE GROUP BANK AG	11,025	39.88	439,677.00
FINECOBANK SPA	19,939	13.74	274,061.55
ING GROEP NV-CVA	83,231	13.04	1,085,831.62
INTESA SANPAOLO	385,474	2.83	1,092,626.05
KBC GROEP NV	6,171	60.50	373,345.50
MEDIOBANCA SPA	22,824	12.09	275,942.16
NORDEA BANK ABP	40,000	11.26	450,640.00
SOCIETE GENERALE-A	19,064	23.68	451,435.52
UNICREDIT SPA	41,169	26.99	1,111,357.15
ADYEN NV	622	1,183.60	736,199.20
AMUNDI - W/I	1,000	63.80	63,800.00
DEUTSCHE BANK AG -REG	50,491	12.16	614,172.52
DEUTSCHE BOERSE AG	4,297	186.75	802,464.75
EDENRED	6,769	55.96	378,793.24
EXOR NV	1,764	87.26	153,926.64
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,775	69.68	123,682.00
WORLDLINE SA	15,364	14.15	217,477.42
AEGON LTD	52,691	5.62	296,544.94
AGEAS	3,676	39.22	144,172.72
ALLIANZ SE	8,563	248.50	2,127,905.50
ASSICURAZIONI GENERALI	17,765	20.41	362,583.65
AXA SA	36,002	30.94	1,113,901.88
HANNOVER RUECK SE	1,598	227.10	362,905.80
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,046	396.40	1,207,434.40
NN GROUP NV	7,172	37.82	271,245.04

POSTE ITALIANE SPA	15,892	10.31	163,846.52	
SAMPO OYJ-A SHS	9,149	38.31	350,543.93	
CAPGEMINI	3,877	203.80	790,132.60	
DASSAULT SYSTEMES SE	16,921	47.48	803,493.68	
SAP SE	24,487	160.76	3,936,530.12	
NOKIA OYJ	104,021	3.14	327,562.12	
CELLNEX TELECOM SAU	15,690	34.70	544,443.00	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	72,097	23.26	1,676,976.22	
ELISA OYJ	1,979	43.52	86,126.08	
KONIKLIJKE KPN NV	54,449	3.14	171,351.00	
ORANGE	35,550	11.25	400,079.70	
TELEFONICA SA	112,460	3.81	428,809.98	
E.ON SE	57,215	12.42	710,896.37	
ENAGAS SA	7,060	15.27	107,841.50	
ENDESA SA	9,215	18.70	172,366.57	
ENEL SPA	181,959	6.31	1,149,253.04	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	94,696	4.23	401,416.34	
ENGIE	46,146	15.26	704,557.12	
FORTUM OYJ	14,725	12.60	185,608.62	
IBERDROLA SA	125,802	11.12	1,399,547.25	
NATURGY ENERGY GROUP SA	8,123	25.56	207,623.88	
REDEIA CORPORACION SA	6,256	14.98	93,746.16	
RWE AG	15,540	36.72	570,628.80	
SNAM SPA	36,170	4.62	167,358.59	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	35,363	7.70	272,436.55	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	19,000	29.13	553,470.00	
ASM INTERNATIONAL NV	1,222	525.80	642,527.60	
ASML HOLDING NV	9,229	775.80	7,159,858.20	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	2,555	147.15	375,968.25	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	29,997	34.90	1,047,045.28	
STMICROELECTRONICS NV	15,315	42.61	652,572.15	
LEG IMMOBILIEN SE	2,922	74.34	217,221.48	
VONOVIA SE	20,440	27.52	562,508.80	
ユーロ小計	3,951,083		111,473,580.04 (17,926,066,406)	
	銘柄数	183		
	比率	9.1%	9.4%	
英ポンド	株	英ポンド	英ポンド	
BP PLC	419,208	4.52	1,898,802.63	
SHELL PLC-NEW	145,063	23.79	3,451,048.77	
ANGLO AMERICAN PLC	35,400	18.60	658,723.20	
CRH PLC	16,962	54.46	923,750.52	
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,886	45.35	176,230.10	

GLENCORE PLC	263,374	4.17	1,098,532.95
MONDI PLC	10,110	14.29	144,522.45
RIO TINTO PLC	27,742	54.94	1,524,145.48
ASHTED GROUP PLC	11,467	48.64	557,754.88
BAE SYSTEMS PLC	76,370	11.76	898,493.05
BUNZL PLC	7,624	31.57	240,689.68
DCC PLC	3,941	57.08	224,952.28
SMITHS GROUP PLC	5,911	16.50	97,561.05
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,147	96.80	207,829.60
EXPERIAN PLC	21,794	32.46	707,433.24
INTERTEK GROUP PLC	3,244	43.90	142,411.60
RELX PLC	42,624	32.63	1,390,821.12
RENTOKIL INITIAL PLC	81,209	3.93	319,232.57
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,327	5.34	210,242.14
BURBERRY GROUP PLC	11,363	12.90	146,639.51
PERSIMMON PLC	8,661	14.54	125,930.94
COMPASS GROUP PLC	41,535	21.20	880,542.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	4,909	158.90	780,040.10
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	5,455	74.46	406,179.30
Whitbread PLC	7,789	36.09	281,105.01
AUTO TRADER GROUP PLC	24,048	7.30	175,646.59
INFORMA PLC	39,087	7.62	297,842.94
WPP PLC	21,784	7.54	164,338.49
KINGFISHER PLC	64,393	2.25	145,206.21
NEXT PLC	3,241	83.86	271,790.26
SAINSBURY (J) PLC	70,105	2.83	198,817.78
TESCO PLC	162,169	2.98	484,560.97
Associated British Foods PLC	11,090	23.25	257,842.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	45,026	23.13	1,041,676.51
DIAGEO PLC	50,568	26.99	1,365,083.16
IMPERIAL BRANDS PLC	19,519	19.16	374,081.63
HALEON PLC	133,652	3.13	418,798.54
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	15,028	55.14	828,643.92
UNILEVER PLC	53,639	37.24	1,997,516.36
SMITH & NEPHEW PLC	19,374	10.80	209,336.07
ASTRAZENECA PLC	35,964	104.54	3,759,676.56
GSK PLC	89,270	15.54	1,387,969.96
BARCLAYS PLC	364,862	1.47	537,587.67
HSBC HOLDINGS PLC	451,415	6.04	2,730,609.33
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,472,781	0.42	620,850.83
NATWEST GROUP PLC	157,196	2.17	342,058.49
STANDARD CHARTERED PLC	66,141	6.09	403,063.25
3I GROUP PLC	24,310	23.58	573,229.80

ABRDN PLC	109,122	1.75	190,963.50	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	14,289	7.46	106,624.51	
London Stock Exchange Group PLC	9,792	90.70	888,134.40	
M&G PLC	105,547	2.24	237,058.56	
SCHRODERS PLC	22,394	4.19	93,875.64	
ST JAMES'S PLACE PLC	28,939	6.76	195,627.64	
ADMIRAL GROUP PLC	7,925	25.02	198,283.50	
AVIVA PLC	66,136	4.36	288,352.96	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	147,275	2.53	373,194.85	
PRUDENTIAL PLC	63,564	8.33	529,869.50	
SAGE GROUP PLC/THE	34,420	11.52	396,518.40	
HALMA PLC	10,150	21.58	219,037.00	
BT GROUP PLC	167,694	1.16	194,860.42	
VODAFONE GROUP PLC	510,760	0.68	351,964.71	
NATIONAL GRID PLC	77,212	10.33	797,986.02	
SEVERN TRENT PLC	10,396	25.13	261,251.48	
SSE PLC	27,945	17.40	486,243.00	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	22,831	10.31	235,501.76	
英ポンド小計	6,128,168		42,125,189.84 (7,916,586,926)	
	銘柄数	66		
	比率	4.0%	4.2%	
スイスフラン	株	スイスフラン	スイスフラン	
CLARIANT AG-REG	15,724	11.10	174,536.40	
EMS-CHEMIE HOLDING AG	160	644.00	103,040.00	
GIVAUDAN-REG	214	3,317.00	709,838.00	
HOLCIM LTD	11,762	63.90	751,591.80	
SIKA AG-REG	3,643	235.30	857,197.90	
ABB LTD	35,398	36.28	1,284,239.44	
GEBERIT AG-REG	736	497.80	366,380.80	
Schindler Holding AG	1,015	199.60	202,594.00	
Schindler Holding AG	546	208.10	113,622.60	
ADECCO GROUP AG(REG)	6,237	36.96	230,519.52	
SGS SA-REG	2,466	75.58	186,380.28	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,469	285.70	419,693.30	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	12,540	121.40	1,522,356.00	
THE SWATCH GROUP AG-B	933	197.85	184,594.05	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	87	1,258.00	109,446.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	109,200.00	327,600.00	
Lindt & Spruengli AG	26	10,950.00	284,700.00	
NESTLE SA-REGISTERED	59,614	95.32	5,682,406.48	
ALCON INC	11,937	66.48	793,571.76	
SONOVA HOLDING AG	1,373	274.20	376,476.60	

STRAUMANN HOLDING AG-REG	3,289	131.80	433,490.20	
LONZA GROUP AG-REG	1,810	381.40	690,334.00	
NOVARTIS AG-REG SHS	46,244	93.53	4,325,201.32	
ROCHE HOLDING AG-BR	1,075	262.80	282,510.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	15,401	245.15	3,775,555.15	
SANDOZ GROUP AG	12,180	29.45	358,701.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	6,339	46.13	292,418.07	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	564	1,127.50	635,910.00	
UBS GROUP AG	80,916	25.57	2,069,022.12	
Baloise Holding AG	1,074	136.60	146,708.40	
SWISS LIFE HOLDING AG	765	604.40	462,366.00	
SWISS RE AG	7,654	98.76	755,909.04	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,992	441.40	1,320,668.80	
TEMENOS GROUP AG-REG	2,258	87.14	196,762.12	
Logitech International SA	4,922	75.20	370,134.40	
SWISSCOM AG-REG	416	515.00	214,240.00	
SWISS PRIME SITE	1,537	87.95	135,179.15	
スイスフラン小計	355,319		31,145,894.70 (5,327,193,829)	
	銘柄数	37		
	比率	2.7%	2.8%	
スウェーデンクローネ	株	スウェーデン クローネ	スウェーデン クローネ	
BOLIDEN AB	10,678	281.80	3,009,060.40	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	15,155	140.10	2,123,215.50	
ALFA LAVAL AB	7,723	375.10	2,896,897.30	
ASSA ABLOY AB-B	20,135	284.20	5,722,367.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	53,020	170.90	9,061,118.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	46,093	148.20	6,830,982.60	
EPIROC AB-A	10,201	187.50	1,912,687.50	
EPIROC AB-B	14,415	167.00	2,407,305.00	
Husqvarna AB	25,347	79.10	2,004,947.70	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	42,589	61.40	2,614,964.60	
SANDVIK AB	21,469	212.40	4,560,015.60	
SKANSKA AB-B SHS	11,621	173.00	2,010,433.00	
SKF AB-B SHARES	9,900	196.15	1,941,885.00	
VOLVO AB-A SHS	10,888	256.40	2,791,683.20	
VOLVO AB-B SHS	27,113	250.10	6,780,961.30	
SECURITAS AB-B SHS	15,856	101.05	1,602,248.80	
EVOLUTION AB	5,515	1,230.00	6,783,450.00	
HENNES & MAURITZ AB-B	20,747	163.22	3,386,325.34	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	14,619	246.10	3,597,735.90	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	38,436	142.90	5,492,504.40	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	38,948	110.80	4,315,438.40	

Swedbank AB	21,452	201.70	4,326,868.40	
EQT AB	13,800	274.20	3,783,960.00	
Industrivarden AB	3,333	323.90	1,079,558.70	
Industrivarden AB	7,770	323.90	2,516,703.00	
INVESTOR AB-B SHS	30,216	241.25	7,289,610.00	
ERICSSON LM-B SHS	71,196	60.40	4,300,238.40	
HEXAGON AB-B SHS	49,766	114.20	5,683,277.20	
TELE2 AB-B SHS	27,629	87.02	2,404,275.58	
TELIA COMPANY AB	79,288	26.89	2,132,054.32	
スウェーデンクローネ小計	764,918		115,362,772.14 (1,632,383,225)	
	銘柄数	30		
	比率	0.8%	0.9%	
ノルウェークローネ	株	ノルウェークローネ	ノルウェークローネ	
AKER BP ASA	12,579	271.60	3,416,456.40	
EQUINOR ASA	25,058	296.15	7,420,926.70	
NORSK HYDRO ASA	52,829	62.24	3,288,076.96	
YARA INTERNATIONAL ASA	3,824	344.90	1,318,897.60	
MOWI ASA	11,467	194.70	2,232,624.90	
ORKLA ASA	22,531	83.36	1,878,184.16	
DNB BANK ASA	23,593	214.30	5,055,979.90	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,301	175.60	2,335,655.60	
TELENOR ASA	17,521	120.75	2,115,660.75	
ノルウェークローネ小計	182,703		29,062,462.97 (410,071,352)	
	銘柄数	9		
	比率	0.2%	0.2%	
デンマーククローネ	株	デンマーククローネ	デンマーククローネ	
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	2,725	543.80	1,481,855.00	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,508	357.20	1,610,257.60	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	25,608	196.46	5,030,947.68	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	126	12,750.00	1,606,500.00	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	93	12,975.00	1,206,675.00	
DSV A/S	4,392	1,228.50	5,395,572.00	
PANDORA A/S	2,572	989.00	2,543,708.00	
CARLSBERG AS-B	2,026	877.20	1,777,207.20	
COLOPLAST-B	3,344	769.40	2,572,873.60	
DEMANT A/S	5,150	308.80	1,590,320.00	
GENMAB A/S	1,595	1,886.50	3,008,967.50	
NOVO NORDISK A/S-B	75,741	725.00	54,912,225.00	
DANSKE BANK A/S	18,910	188.50	3,564,535.00	
TRYG A/S	6,476	142.20	920,887.20	

ORSTED A/S	6,451	385.20	2,484,925.20	
デンマーククローネ小計	159,717		89,707,455.98 (1,934,989,825)	
	銘柄数	15		
	比率	1.0%	1.0%	
豪ドル	株	豪ドル	豪ドル	
AMPOL LTD	10,457	35.32	369,341.24	
SANTOS LTD	104,925	7.61	798,479.25	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	51,265	30.97	1,587,677.05	
BHP GROUP LIMITED	117,028	46.86	5,483,932.08	
BLUESCOPE STEEL LTD	15,517	22.81	353,942.77	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	42,634	28.39	1,210,379.26	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	12,814	55.98	717,327.72	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	41,317	12.81	529,270.77	
ORICA LTD	16,815	15.88	267,022.20	
RIO TINTO LIMITED	8,927	129.02	1,151,761.54	
SOUTH32 LTD	175,168	3.34	585,061.12	
BRAMBLES LTD	35,355	14.72	520,425.60	
COMPUTERSHARE LTD	16,589	25.59	424,512.51	
TRANSURBAN GROUP	72,379	13.14	951,060.06	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	17,871	43.51	777,567.21	
LOTTERY CORP LTD/THE	82,882	4.85	401,977.70	
SEEK LTD	16,222	25.50	413,661.00	
WESFARMERS LIMITED	23,193	57.50	1,333,597.50	
COLES GROUP LTD	23,798	15.72	374,104.56	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	40,603	5.46	221,692.38	
WOOLWORTHS GROUP LTD	21,167	36.19	766,033.73	
TREASURY WINE ESTATES LTD	26,232	10.28	269,664.96	
COCHLEAR LIMITED	1,913	297.79	569,672.27	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,708	51.59	346,065.72	
SONIC HEALTHCARE LTD	9,289	31.47	292,324.83	
CSL LIMITED	11,191	291.40	3,261,057.40	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	63,674	26.59	1,693,091.66	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	37,735	114.70	4,328,204.50	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	70,211	31.87	2,237,624.57	
WESTPAC BANKING CORPORATION	77,201	23.56	1,818,855.56	
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	4,246	66.32	281,594.72	
MACQUARIE GROUP LTD	8,461	186.98	1,582,037.78	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	63,716	5.90	375,924.40	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	41,945	15.58	653,503.10	
SUNCORP GROUP LTD	34,703	14.13	490,353.39	
XERO LTD	5,373	113.00	607,149.00	
TELSTRA GROUP LTD	63,795	4.00	255,180.00	

APA GROUP	42,549	8.22	349,752.78	
ORIGIN ENERGY LIMITED	61,199	8.27	506,115.73	
豪ドル小計	1,577,067		39,156,999.62 (3,804,885,653)	
	銘柄数	39		
	比率	1.9%	2.0%	
ニュージーランドドル	株	ニュージーランド ドル	ニュージーランド ドル	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	43,048	8.58	369,351.84	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	16,123	23.95	386,145.85	
SPARK NEW ZEALAND LTD	23,917	5.31	126,999.27	
MERIDIAN ENERGY LTD	61,615	5.65	348,124.75	
ニュージーランドドル小計	144,703		1,230,621.71 (111,162,059)	
	銘柄数	4		
	比率	0.1%	0.1%	
香港ドル	株	香港ドル	香港ドル	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	40,828	39.60	1,616,788.80	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	39,500	89.20	3,523,400.00	
MTR CORPORATION	28,000	26.55	743,400.00	
Galaxy Entertainment Group Limited	79,000	40.30	3,183,700.00	
Sands China Ltd	114,000	21.55	2,456,700.00	
WH Group Limited	259,500	4.88	1,266,360.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	67,000	19.02	1,274,340.00	
HANG SENG BANK	11,500	83.45	959,675.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	28,954	239.20	6,925,796.80	
AIA GROUP LTD	267,510	62.90	16,826,379.00	
HKT Trust / HKT Ltd	85,000	9.39	798,150.00	
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)	40,500	45.70	1,850,850.00	
CLP HOLDINGS LIMITED	35,500	60.90	2,161,950.00	
HONG KONG & CHINA GAS	237,589	5.53	1,313,867.17	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	17,500	45.50	796,250.00	
CK ASSET HOLDINGS LIMITED	29,328	35.55	1,042,610.40	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	79,403	21.20	1,683,343.60	
SINO LAND CO	149,800	8.04	1,204,392.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	28,500	75.95	2,164,575.00	
SWIRE PACIFIC LTD A	28,500	62.10	1,769,850.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	54,000	15.26	824,040.00	
香港ドル小計	1,721,412		54,386,417.77 (1,028,447,160)	
	銘柄数	21		
	比率	0.5%	0.5%	
シンガポールドル	株	シンガポールドル	シンガポールドル	

KEPPEL LTD	62,800	6.86	430,808.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	75,300	3.87	291,411.00	
GENTING SINGAPORE LTD	348,800	0.98	341,824.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	80,275	3.29	264,104.75	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	35,181	31.84	1,120,163.04	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	59,713	12.90	770,297.70	
UNITED OVERSEAS BANK	25,849	27.90	721,187.10	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	26,380	9.70	255,886.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	190,800	2.42	461,736.00	
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	111,700	2.94	328,398.00	
CITY DEVELOPMENTS	43,700	6.28	274,436.00	
UNITED OVERSEAS LAND LTD	43,400	6.27	272,118.00	
シンガポールドル小計	1,103,898		5,532,369.59 (610,662,955)	
	銘柄数	12		
	比率	0.3%	0.3%	
イスラエルシュケル	株	イスラエル シュケル	イスラエル シュケル	
ICL GROUP LTD	22,863	17.00	388,671.00	
ELBIT SYSTEMS LTD	450	752.00	338,400.00	
BANK HAPOLIM BM	31,102	31.03	965,095.06	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	20,216	27.47	555,333.52	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	20,800	17.40	361,920.00	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,541	132.40	733,628.40	
NICE LTD	863	809.90	698,943.70	
AZRIELI GROUP LTD	2,148	238.40	512,083.20	
イスラエルシュケル小計	103,983		4,554,074.88 (181,948,498)	
	銘柄数	8		
	比率	0.1%	0.1%	
合計	株		円 190,082,847,206 (190,082,847,206)	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

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

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,026	606,990.02	
		AMERICAN TOWER CORP	11,030	2,170,262.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,910	512,247.30	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,431	382,668.26	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,913	284,250.54	

	CROWN CASTLE INC	10,017	1,057,394.52	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	7,527	1,038,199.11	
	EQUINIX INC	2,195	1,745,507.90	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	4,897	320,998.35	
	EQUITY RESIDENTIAL	7,361	432,532.36	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,502	352,459.32	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,383	790,816.53	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	15,452	295,596.76	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	21,017	408,990.82	
	INVITATION HOMES INC	15,414	510,511.68	
	KIMCO REALTY CORP	22,961	464,041.81	
	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	2,542	340,780.52	
	PROLOGIS INC	21,988	2,758,174.72	
	PUBLIC STORAGE	3,576	1,032,426.96	
	REALTY INCOME CORP	15,017	825,784.83	
	REGENCY CENTERS CORP	4,167	259,229.07	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	7,737	1,094,708.13	
	SUN COMMUNITIES INC	3,722	464,021.74	
	UDR INC	8,652	317,614.92	
	VENTAS INC	10,584	503,269.20	
	VICI PROPERTIES INC	21,297	646,150.98	
	WELLTOWER INC	12,130	1,056,886.90	
	WEYERHAEUSER CO	18,569	615,190.97	
	WP CAREY INC	5,558	354,100.18	
米ドル小計		276,575	21,641,807.20 (3,199,957,612)	
	銘柄数	29		
	比率	1.6%	83.9%	
加ドル	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,624	272,591.36	加ドル
加ドル小計		14,624	272,591.36 (29,794,235)	
	銘柄数	1		
	比率	0.0%	0.8%	

ユーロ	COVIVIO	4,118	ユーロ 189,757.44
	GECINA SA	1,309	136,790.50
	KLEPIERRE	6,892	162,237.68
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,892	259,518.56
ユーロ小計		16,211	748,304.18 (120,334,795)
	銘柄数	4	
	比率	0.1%	3.2%
英ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	30,484	英ポンド 199,975.04
	SEGRO PLC	39,270	333,716.46
英ポンド小計		69,754	533,691.50 (100,296,643)
	銘柄数	2	
	比率	0.1%	2.6%
豪ドル	DEXUS/AU	22,492	豪ドル 166,215.88
	GOODMAN GROUP	44,514	1,102,166.64
	GPT GROUP	48,454	215,620.30
	MIRVAC GROUP	131,767	276,710.70
	SCENTRE GROUP	111,253	324,858.76
	STOCKLAND	77,932	339,783.52
豪ドル小計		436,412	2,425,355.80 (235,671,823)
	銘柄数	6	
	比率	0.1%	6.2%
香港ドル	LINK REIT	64,100	香港ドル 2,538,360.00
香港ドル小計		64,100	2,538,360.00 (48,000,387)
	銘柄数	1	
	比率	0.0%	1.3%
シンガポール ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	219,400	シンガポールドル 440,994.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	171,000	278,730.00
シンガポールドル小計		390,400	719,724.00 (79,443,135)
	銘柄数	2	
	比率	0.0%	2.1%
投資証券合計			円 3,813,498,630 (3,813,498,630)
合計			円 3,813,498,630 (3,813,498,630)

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

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

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「TMA外国株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	[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			
預金		108,154,025	456,883,365
コール・ローン		1,607,446,866	1,489,877,422
株式		51,638,137,832	73,515,629,503
未収配当金		13,359,516	14,015,471
流動資産合計		53,367,098,239	75,476,405,761
資産合計		53,367,098,239	75,476,405,761
負債の部			
流動負債			
未払解約金		39,596,205	100,004,463
未払利息		780	668
流動負債合計		39,596,985	100,005,131
負債合計		39,596,985	100,005,131
純資産の部			
元本等			
元本	1	12,191,756,692	11,945,459,179
剰余金			
剰余金又は欠損金()		41,135,744,562	63,430,941,451
元本等合計		53,327,501,254	75,376,400,630
純資産合計		53,327,501,254	75,376,400,630
負債純資産合計		53,367,098,239	75,476,405,761

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

自 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	11,842,545,070円	12,191,756,692円
同期中における追加設定元本額	2,615,917,709円	1,996,078,880円
同期中における一部解約元本額	2,266,706,087円	2,242,376,393円
同期末における元本額	12,191,756,692円	11,945,459,179円
元本の内訳*		
東京海上セレクション・外国株式	9,545,506,667円	9,639,937,011円
東京海上セレクション・バランス30	328,380,778円	263,887,704円
東京海上セレクション・バランス50	1,126,974,975円	948,008,094円

東京海上セレクション・バランス70	1,073,231,649円	950,703,737円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	99,503,356円	129,288,461円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	5,733,635円	3,965,167円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	11,121,756円	8,555,376円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	1,303,876円	1,113,629円
計	12,191,756,692円	11,945,459,179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	12,191,756,692口	11,945,459,179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、為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[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	<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。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。</p>	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	2,398,681,449円
合計	2,398,681,449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	15,100,826,620円
合計	15,100,826,620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

（2023年1月25日現在）

該当事項はありません。

（2024年1月25日現在）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

[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	4.3741円	1口当たり純資産額	6.3100円
（1万口当たり純資産額	43,741円）	（1万口当たり純資産額	63,100円）

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘 柄	株式数	評価額		備 考
		単価	金額	
米ドル	株	米ドル	米ドル	
CHEVRONTEXACO CORP	15,600	144.92	2,260,752.00	
CONOCOPHILLIPS	14,100	109.67	1,546,347.00	
EOG RESOURCES INC	12,200	112.09	1,367,498.00	
EXXON MOBIL CORPORATION	33,100	99.60	3,296,760.00	
HALLIBURTON CO	12,000	36.83	441,960.00	
KINDER MORGAN INC	12,000	16.89	202,680.00	
PHILLIPS 66	4,700	133.67	628,249.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,000	222.96	668,880.00	
SCHLUMBERGER LTD	10,000	51.67	516,700.00	

AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,600	257.16	411,456.00
BALL CORP	10,000	55.87	558,700.00
CORTEVA INC	5,791	45.41	262,969.31
DOW INC	5,791	53.09	307,444.19
DUPONT DE NEMOURS INC	5,791	64.20	371,782.20
ECOLAB INC	1,500	196.62	294,930.00
INTERNATIONAL PAPER CO	5,000	36.18	180,900.00
LINDE PLC	3,300	401.28	1,324,224.00
PPG INDUSTRIES INC	2,200	141.03	310,266.00
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,800	301.06	541,908.00
AMETEK INC	20,300	162.74	3,303,622.00
COPART INC	142,800	48.65	6,947,220.00
ROLLINS INC	113,200	43.29	4,900,428.00
VERISK ANALYTICS INC	41,300	244.65	10,104,045.00
NIKE INC -CL B	76,400	100.76	7,698,064.00
ALPHABET INC-CL A	82,900	148.70	12,327,230.00
ALPHABET INC-CL C	86,900	150.35	13,065,415.00
NETFLIX INC	16,400	544.87	8,935,868.00
THE WALT DISNEY CO	37,600	93.50	3,515,600.00
AMAZON.COM INC	131,500	156.87	20,628,405.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,700	1,018.45	8,860,515.00
POOL CORP	19,300	380.90	7,351,370.00
TJX COMPANIES INC	101,800	94.95	9,665,910.00
COSTCO WHOLESALE CORP	19,600	686.51	13,455,596.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	62,100	73.95	4,592,295.00
MONSTER BEVERAGE CORP	34,800	55.07	1,916,436.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	52,500	97.10	5,097,750.00
MEDTRONIC PLC	35,500	84.72	3,007,560.00
TELADOC HEALTH INC	19,300	20.19	389,667.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	32,900	513.23	16,885,267.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,500	92.31	692,325.00
ELI LILLY AND COMPANY	17,100	633.70	10,836,270.00
MERCK & CO. INC.	65,500	118.88	7,786,640.00
ZOETIS INC	48,800	186.07	9,080,216.00
HDFC Bank Ltd	124,200	54.80	6,806,160.00
MASTERCARD INC - A	32,800	438.70	14,389,360.00
MOODY'S CORP	31,200	389.94	12,166,128.00
MSCI INC	27,000	558.46	15,078,420.00
PAYPAL HOLDINGS INC	85,000	63.02	5,356,700.00
VISA INC-CLASS A SHARES	53,100	271.65	14,424,615.00
ADOBE INC	20,800	606.48	12,614,784.00
MICROSOFT CORP	89,700	402.56	36,109,632.00
SALESFORCE INC	44,300	276.88	12,265,784.00

APPLE INC	91,500	194.50	17,796,750.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	4,900	76.99	377,251.00	
CONSTELLATION ENERGY	2,833	115.67	327,693.11	
DOMINION ENERGY INC	4,000	44.15	176,600.00	
DUKE ENERGY CORP	10,300	94.54	973,762.00	
EXELON CORP	8,500	34.08	289,680.00	
NEXTERA ENERGY INC	24,900	57.01	1,419,549.00	
PPL CORPORATION	30,600	25.44	778,464.00	
SOUTHERN CO	12,200	68.20	832,040.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	30,900	178.29	5,509,161.00	
LAM RESEARCH CORP	3,800	848.16	3,223,008.00	
NVIDIA CORP	43,300	613.62	26,569,746.00	
Taiwan Semiconductor Manufacturing	42,200	116.52	4,917,144.00	
米ドル小計	2,252,206		398,940,550.81 (58,987,349,842)	
	銘柄数	65		
	比率	78.3%	80.2%	
加ドル	株	加ドル	加ドル	
ENBRIDGE INC	13,000	48.03	624,390.00	
SUNCOR ENERGY INC	12,900	43.05	555,345.00	
TC ENERGY CORP	10,000	51.99	519,900.00	
DOLLARAMA INC	123,600	100.14	12,377,304.00	
加ドル小計	159,500		14,076,939.00 (1,538,609,432)	
	銘柄数	4		
	比率	2.0%	2.1%	
ユーロ	株	ユーロ	ユーロ	
ENI SPA	25,400	14.49	368,046.00	
TOTALENERGIES SE	17,400	58.86	1,024,164.00	
AIR LIQUIDE	6,281	172.46	1,083,221.26	
AKZO NOBEL	5,333	70.74	377,256.42	
BASF SE	13,200	43.78	577,896.00	
SYMRIS AG	3,500	92.70	324,450.00	
HERMES INTERNATIONAL	5,900	1,831.80	10,807,620.00	
L'OREAL	25,200	429.00	10,810,800.00	
E.ON SE	50,000	12.42	621,250.00	
ENEL SPA	100,000	6.31	631,600.00	
ENGIE	8,000	15.26	122,144.00	
IBERDROLA SA	70,000	11.12	778,750.00	
ASML HOLDING NV	11,400	775.80	8,844,120.00	
ユーロ小計	341,614		36,371,317.68 (5,848,871,596)	
	銘柄数	13		

	比 率	7.8%	8.0%	
英ポンド	株	英ポンド	英ポンド	
BP PLC	140,000	4.52	634,130.00	
SHELL PLC-NEW	47,300	23.79	1,125,267.00	
JOHNSON MATTHEY PLC	9,722	16.14	156,961.69	
ASTRAZENECA PLC	75,100	104.54	7,850,954.00	
NATIONAL GRID PLC	47,941	10.33	495,470.23	
英ポンド小計	320,063		10,262,782.92 (1,928,684,794)	
	銘柄数	5		
	比 率	2.6%	2.6%	
スイスフラン	株	スイスフラン	スイスフラン	
GIVAUDAN-REG	300	3,317.00	995,100.00	
LONZA GROUP AG-REG	6,300	381.40	2,402,820.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	20,900	245.15	5,123,635.00	
スイスフラン小計	27,500		8,521,555.00 (1,457,526,767)	
	銘柄数	3		
	比 率	1.9%	2.0%	
スウェーデンクローネ	株	スウェーデン クローネ	スウェーデン クローネ	
ATLAS COPCO AB-A SHS	230,300	170.90	39,358,270.00	
スウェーデンクローネ小計	230,300		39,358,270.00 (556,919,520)	
	銘柄数	1		
	比 率	0.7%	0.8%	
ノルウェークローネ	株	ノルウェー クローネ	ノルウェー クローネ	
EQUINOR ASA	45,000	296.15	13,326,750.00	
YARA INTERNATIONAL ASA	6,000	344.90	2,069,400.00	
ノルウェークローネ小計	51,000		15,396,150.00 (217,239,676)	
	銘柄数	2		
	比 率	0.3%	0.3%	
デンマーククローネ	株	デンマーク クローネ	デンマーク クローネ	
NOVO NORDISK A/S-B	126,800	725.00	91,930,000.00	
デンマーククローネ小計	126,800		91,930,000.00 (1,982,930,100)	
	銘柄数	1		
	比 率	2.6%	2.7%	
豪ドル	株	豪ドル	豪ドル	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	7,228	30.97	223,851.16	
BHP GROUP LIMITED	40,000	46.86	1,874,400.00	
RIO TINTO LIMITED	10,000	129.02	1,290,200.00	

CSL LIMITED	23,600	291.40	6,877,040.00	
豪ドル小計	80,828		10,265,491.16 (997,497,776)	
	銘柄数	4		
	比率	1.3%	1.4%	
合計	株 3,589,811		円 73,515,629,503 (73,515,629,503)	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	6,574,691,429 円
負債総額	2,951,869 円
純資産総額（ - ）	6,571,739,560 円
発行済数量	4,380,515,140 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.5002 円

（ご参考：親投資信託の現況）

T M A 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

T M A 日本債券マザーファンド

2024年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	82,010,025,620 円
負債総額	1,303,828,380 円
純資産総額（ - ）	80,706,197,240 円
発行済数量	60,317,467,637 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.3380 円

東京海上・J P X 日経400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	7,097,177,249 円
負債総額	188,232 円
純資産総額（ - ）	7,096,989,017 円
発行済数量	2,552,216,743 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.7807 円

T M A日本株アクティブマザーファンド

2024年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	103,098,015,862 円
負債総額	404,723,070 円
純資産総額(-)	102,693,292,792 円
発行済数量	36,812,039,403 口
1 単位当たり純資産額(/)	2.7897 円

T M A外国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	19,671,639,840 円
負債総額	194,119,075 円
純資産総額(-)	19,477,520,765 円
発行済数量	10,045,417,710 口
1 単位当たり純資産額(/)	1.9389 円

T M A外国債券マザーファンド

2024年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	32,599,439,214 円
負債総額	268,349,467 円
純資産総額(-)	32,331,089,747 円
発行済数量	11,469,812,746 口
1 単位当たり純資産額(/)	2.8188 円

T M A外国株式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	201,901,284,973 円
負債総額	2,987,150,136 円
純資産総額(-)	198,914,134,837 円
発行済数量	35,369,790,647 口
1 単位当たり純資産額(/)	5.6238 円

T M A 外国株式マザーファンド

2024年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	77,088,887,793 円
負債総額	40,164,960 円
純資産総額 (-)	77,048,722,833 円
発行済数量	12,005,495,054 口
1 単位当たり純資産額 (/)	6.4178 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

1. 名義書換

該当事項はありません。

2. 受益者に対する特典

特典はありません。

3. 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

4. 受益権の譲渡

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

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

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

5. 受益権の譲渡の対抗要件

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

6. 受益権の再分割

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

7. 償還金

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

8. 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【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	* 1 459,081	* 1 433,750
建物	342,403	307,934
器具備品	116,678	125,816
無形固定資産	228,727	348,422
電話加入権	3,795	3,795
ソフトウェア	188,720	314,954
ソフトウェア仮勘定	36,211	29,672
投資その他の資産	3,576,825	3,508,324
投資有価証券	42,253	48,291
関係会社株式	1,673,049	1,668,529
その他の関係会社有価証券	521,200	520,000
長期前払費用	40,588	30,700
敷金	474,324	474,324
その他長期差入保証金	21,230	21,230
繰延税金資産	804,178	954,048
投資損失引当金	-	208,800
固定資産計	4,264,634	4,290,497
資産合計	31,511,279	31,743,550
負債の部		
流動負債		
未払金	3,183,398	3,477,655
未払手数料	1,306,204	1,464,843
その他未払金	1,877,194	2,012,811
未払費用	398,447	335,471
未払消費税等	277,096	266,103
未払法人税等	1,152,000	1,210,000
預り金	46,775	60,297
前受収益	2,286	2,579
賞与引当金	287,955	288,706
その他の流動負債	7	8
流動負債計	5,347,968	5,640,822
固定負債		
退職給付引当金	845,039	886,720
固定負債計	845,039	886,720
負債合計	6,193,007	6,527,543
純資産の部		
株主資本	25,312,741	25,210,382
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	400,000	400,000
その他資本剰余金	400,000	400,000
利益剰余金	22,912,741	22,810,382
利益準備金	500,000	500,000
その他利益剰余金	22,412,741	22,310,382
繰越利益剰余金	22,412,741	22,310,382

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

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

(3)【株主資本等変動計算書】

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位：千円)

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

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

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益 剰余金
				繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	22,412,741
当期変動額					
剰余金の配当					4,750,617
当期純利益					4,648,257
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	-	102,359
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	22,310,382

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

注記事項

（重要な会計方針）

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券

移動平均法による原価法

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

当事業年度末日の市場価格等に基づく時価法

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当期負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の日から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
<p>(1) 金融商品に対する取組方針 当社の資本は本来の事業目的のために使用することを基本とし、資産の運用に際しては、資産運用リスクを極力最小限に留めることを基本方針としております。</p> <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク 営業債権である未収収益は顧客の信用リスクに晒されており、未収委託者報酬は市場リスクに晒されております。投資有価証券は、主にファンドの自己設定に関連する投資信託であり、基準価額の変動リスクに晒されております。</p> <p>営業債務である未払金は、ほとんど1年以内の支払期日であり、流動性リスクに晒されております。</p> <p>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 未収収益については、管理部門において取引先ごとに期日及び残高を把握することで、回収懸念の早期把握や軽減を図っております。</p> <p>市場リスク 未収委託者報酬には、運用資産の悪化から回収できず当社が損失を被るリスクが存在しますが、過去の回収実績からリスクは僅少であると判断しております。</p> <p>投資有価証券については、管理部門において定期的に時価を把握する体制としております。</p> <p>流動性リスク 当社は、日々資金残高管理を行っており流動性リスクを管理しております。</p>	<p>(1) 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク 同左</p> <p>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 同左</p> <p>市場リスク 同左</p> <p>流動性リスク 同左</p>

2．金融商品の時価等に関する事項

第37期（2022年3月31日現在）

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

（単位：千円）

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

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

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

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

(単位：千円)

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

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

(注4) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

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

第38期(2023年3月31日現在)

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

(単位：千円)

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

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

現金・預金
未収委託者報酬
未収収益
未収入金
預り金
未払金
未払費用

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

(単位：千円)

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

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

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

第37期（2022年3月31日現在）

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

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

(1)時価で貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

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

(2)時価で貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

(単位：千円)

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

(注)時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

投資有価証券

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

敷金

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

第38期（2023年3月31日現在）

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

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

(1)時価で貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

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

(2)時価で貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

(単位：千円)

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

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

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

投資有価証券

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

敷金

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

(有価証券関係)

第37期 2022年3月31日現在				第38期 2023年3月31日現在			
1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券				1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券			
子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 子会社株式1,640,302千円、関連会社株式32,747千円)並びにその他の関係会社有価証券(貸借対照表計上額 521,200千円)は、市場価格のない株式等又は貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資に該当することから、記載しておりません。				子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 子会社株式1,640,302千円、関連会社株式28,227千円)並びにその他の関係会社有価証券(貸借対照表計上額 520,000千円)は、市場価格のない株式等に該当することから、記載しておりません。			
2. その他有価証券 (単位:千円)				2. その他有価証券 (単位:千円)			
	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。)

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

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

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

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

<参考情報：再信託受託会社の概要>

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

(2) 販売会社

名称	資本金の額（ ）	事業の内容
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323百万円	
CHEER証券株式会社	100百万円	
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	
株式会社足利銀行	135,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社池田泉州銀行	61,385百万円	
株式会社愛媛銀行	21,367百万円	
株式会社群馬銀行	48,652百万円	
株式会社西日本シティ銀行	85,745百万円	
株式会社山形銀行	12,008百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	

() 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・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型）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・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型）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
業務執行社員 公認会計士 久保直毅指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 石井章悟

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。