【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2024年10月25日
【発行者名】	東京海上アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長　　横田　靖博
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	尾崎　正幸
【電話番号】	０３－３２１２－８４２１
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	上限　各１兆円
【縦覧に供する場所】	該当なし

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065
※愛称を「年金コンパス」とします。
※上記のそれぞれをまたは総称して、以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。
※「東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035」は「2035」、「東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045」は「2045」、「東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055」は「2055」、「東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065」は「2065」ということがあります。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。
当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定に基づく投資信託の受益権であり、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である東京海上アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。
当初の１口当たり元本は１円です。
委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

各１兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額
基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせください。
●委託会社のお問い合わせ先（以下「委託会社サービスデスク」といいます。）
東京海上アセットマネジメント　サービスデスク
０１２０－７１２－０１６（営業日の９時～17時）
ホームページ
https://www.tokiomarineam.co.jp/

(5)【申込手数料】

無手数料とします。

(6)【申込単位】

① 申込方法には、収益分配金の受取方法によって、以下の２種類のコースがあります。

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

② 申込単位は販売会社が定めます。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
③ 分配金再投資コースにおいて収益分配金を再投資する場合は、１口単位とします。

(7)【申込期間】

2024年10月26日から2025年４月25日まで

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

(8)【申込取扱場所】

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

(9)【払込期日】

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

各取得申込日の発行価額の総額は各追加信託が行われる日に、販売会社から、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定する当ファンドの口座に振込まれます。

(10)【払込取扱場所】

申込金は、お申込みの販売会社にお支払いください。

(11)【振替機関に関する事項】

当ファンドの受益権の振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

該当ありません。

第二部【ファンド情報】
第１【ファンドの状況】
１【ファンドの性格】
(1)【ファンドの目的及び基本的性格】
① ファンドの目的
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 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
追加型投信	海　　外	債　　券
	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		
	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
不動産投信	その他 （　　）	アフリカ		
その他資産（投資信託証券（資産複合（株式・債券）資産配分変更型））		中近東 （中東）		
資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

※当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。
※投資形態が、ファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資することとなりますので、商品分類表と属性区分表の投資対象資産が異なります。
※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型投信	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

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

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

属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	目論見書または投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	目論見書または投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	目論見書または投資信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	目論見書または投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。

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

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

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

③ 信託金の限度額

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

④ ファンドの特色

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

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

- 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

2 当初設定時は以下の資産配分比率を参考にポートフォリオを構築します。

＜当初設定時＞

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

次ページへ続く

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

3 資産配分比率は、原則として以下の方針で１年ごとに変更します。

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

＜2024年4月時点＞

ファンド	資産配分比率			
	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	30%	30%	30%	10%
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	32%	26%	32%	10%
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	33%	24%	33%	10%
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	34%	22%	34%	10%

＜ターゲットイヤーの10年前＞

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

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

次ページへ続く

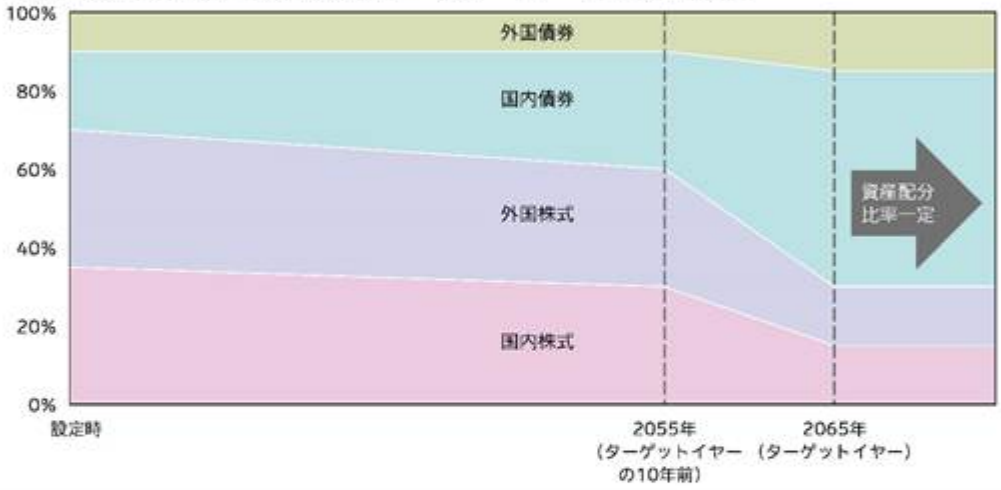
資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

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

＜ターゲットイヤーの資産配分比率見直し実施日以降＞

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

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



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

＜各マザーファンドが対象とする指数について＞

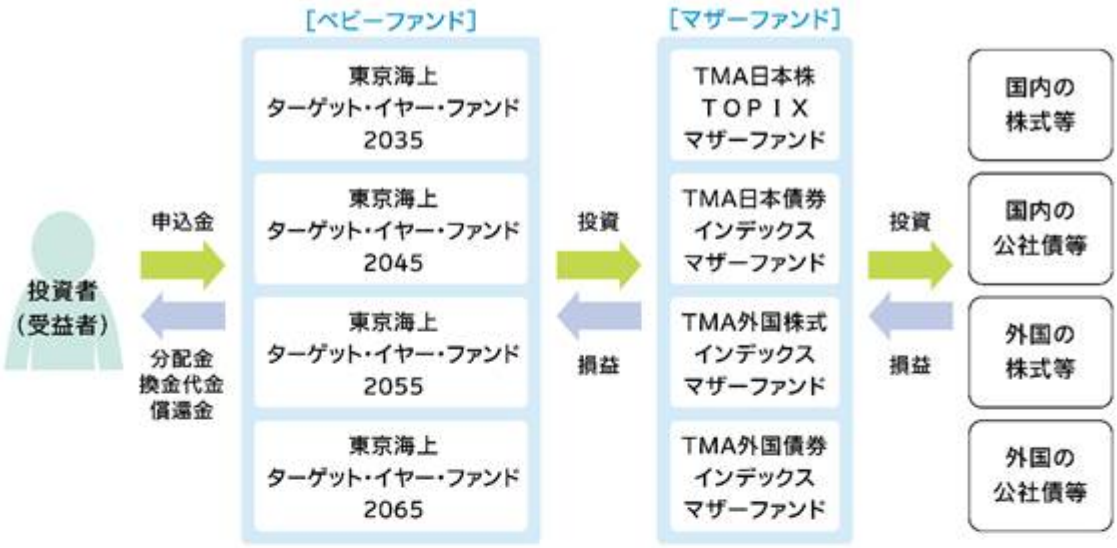
- 配当込みTOPIX(以下「TOPIX(配当込み)」といいます。)は、株式会社ＪＰＸ総研が算出する株価指数であり、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。TOPIX(配当込み)の指数値およびTOPIX(配当込み)にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社(以下「ＪＰＸ」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIX(配当込み)に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX(配当込み)にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸは、TOPIX(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。
- 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募債券流通市場全体の動向を的確に表す代表的な指標です。NOMURA－BPIは、NFRCの知的財産です。NFRCは、ファンドの運用成績等に関し、一切責任ありません。
- MSCIコクサイ指数とは、MSCI社が発表している日本を除く主要先進国の株式市場の動きを捉える代表的な株価指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。
- FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

次ページへ続く

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

ファンドの仕組み

- ファミリーファンド方式により運用を行います。



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

主な投資制限

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

次ページへ続く

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

分配方針

◎年1回決算を行います。

- 1月25日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として次の方針に基づき分配を行います。

分配対象額は、経費控除後の、繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
収益分配金額は、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。

《イメージ図》

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

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

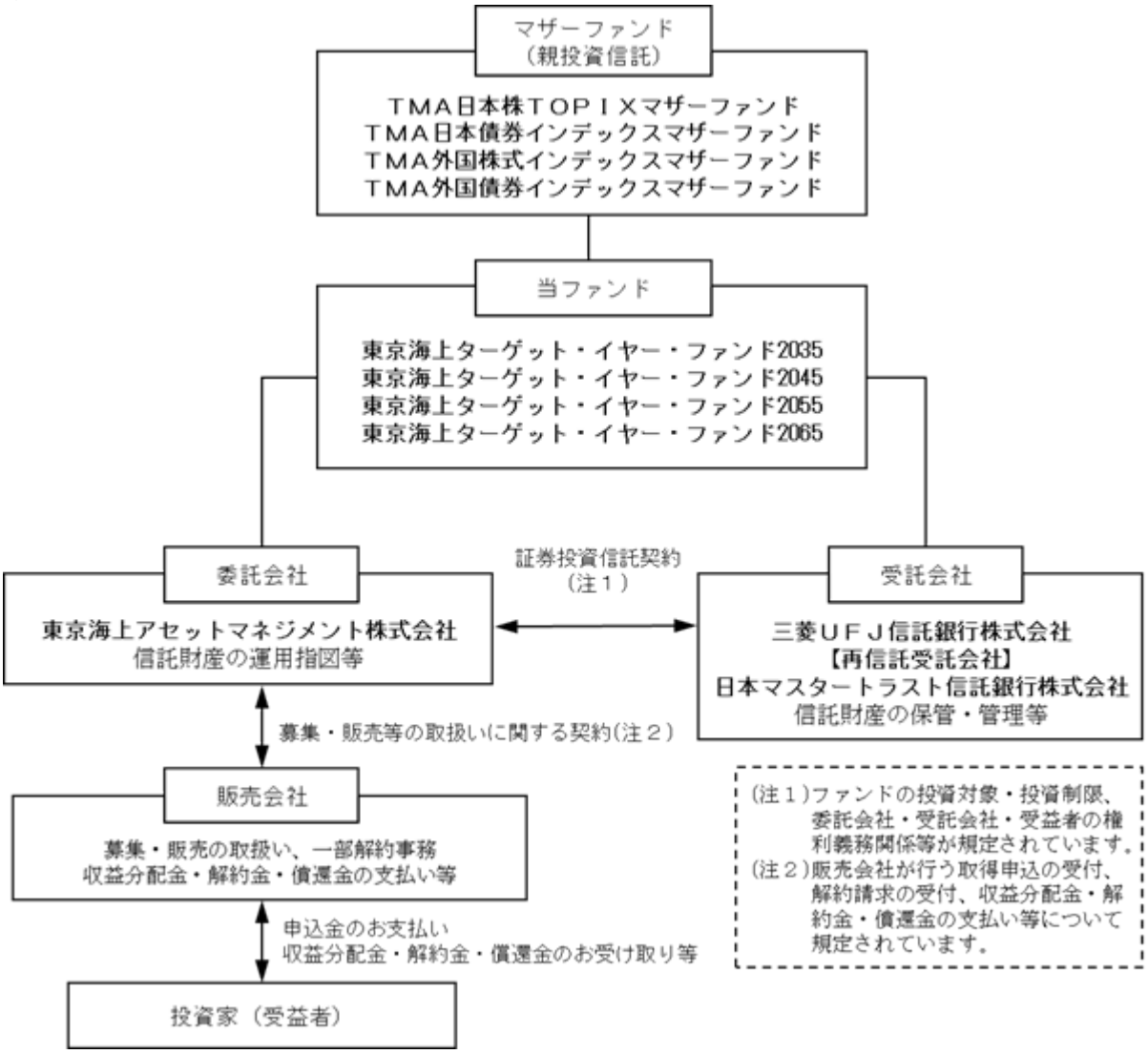
資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【ファンドの沿革】

2019年９月20日　　信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

① ファンドの仕組み



② 委託会社の概況

・名称　　東京海上アセットマネジメント株式会社

・資本金の額　20億円（2024年７月末日現在）

・会社の沿革

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

・大株主の状況（2024年７月末日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

１．基本方針

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

２．運用方法

(1) 主要投資対象

主として以下の親投資信託（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。

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

(2) 投資態度

●東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

①主として、以下の各指数に連動する投資成果をめざして運用を行う各マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式および債券に分散投資を行います。

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

②当初設定時は以下の資産配分比率を参考にポートフォリオを構築します。

国内株式：31%
国内債券：28%
外国株式：31%
外国債券：10%

③資産配分比率は、原則として以下の方針で1年ごとに変更します。

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

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

④2035年の資産配分比率見直し実施日以降は、マザーファンドへの投資を通じた各資産への当該比率を一定とします。

⑤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。

⑥実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

⑦資金動向、市況動向、残存期間等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。

●東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

①主として、以下の各指数に連動する投資成果をめざして運用を行う各マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式および債券に分散投資を行います。

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

②当初設定時は以下の資産配分比率を参考にポートフォリオを構築します。
国内株式：32%
国内債券：26%
外国株式：32%
外国債券：10%

③資産配分比率は、原則として以下の方針で1年ごとに変更します。
イ．2045年（ターゲットイヤー）の10年前となる2035年に近づくにしたがい、リスク性資産（国内外の株式）の比率をゆるやかに減少させ、安定性資産（国内外の債券）の比率をゆるやかに増加させる運用をめざします。
ロ．2035年からターゲットイヤーに近づくにしたがい、リスク性資産の比率を大きく引き下げ、安定性資産の比率を大きく引き上げる運用をめざします。

④2045年の資産配分比率見直し実施日以降は、マザーファンドへの投資を通じた各資産への当該比率を一定とします。

⑤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。

⑥実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

⑦資金動向、市況動向、残存期間等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。

●東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

①主として、以下の各指数に連動する投資成果をめざして運用を行う各マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式および債券に分散投資を行います。

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

②当初設定時は以下の資産配分比率を参考にポートフォリオを構築します。
国内株式：34%
国内債券：22%
外国株式：34%
外国債券：10%

③資産配分比率は、原則として以下の方針で1年ごとに変更します。
イ．2055年（ターゲットイヤー）の10年前となる2045年に近づくにしたがい、リスク性資産（国内外の株式）の比率をゆるやかに減少させ、安定性資産（国内外の債券）の比率をゆるやかに増加させる運用をめざします。
ロ．2045年からターゲットイヤーに近づくにしたがい、リスク性資産の比率を大きく引き下げ、安定性資産の比率を大きく引き上げる運用をめざします。

④2055年の資産配分比率見直し実施日以降は、マザーファンドへの投資を通じた各資産への当該比率を一定とします。

⑤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。

⑥実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

⑦資金動向、市況動向、残存期間等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。

●東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

①主として、以下の各指数に連動する投資成果をめざして運用を行う各マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式および債券に分散投資を行います。

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

②当初設定時は以下の資産配分比率を参考にポートフォリオを構築します。
国内株式：35%
国内債券：20%
外国株式：35%
外国債券：10%

③資産配分比率は、原則として以下の方針で1年ごとに変更します。
イ．2065年（ターゲットイヤー）の10年前となる2055年に近づくにしたがい、リスク性資産（国内外の株式）の比率をゆるやかに減少させ、安定性資産（国内外の債券）の比率をゆるやかに増加させる運用をめざします。
ロ．2055年からターゲットイヤーに近づくにしたがい、リスク性資産の比率を大きく引き下げ、安定性資産の比率を大きく引き上げる運用をめざします。

④2065年の資産配分比率見直し実施日以降は、マザーファンドへの投資を通じた各資産への当該比率を一定とします。

⑤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。

⑥実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

⑦資金動向、市況動向、残存期間等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。

＜参考情報＞マザーファンドの運用の基本方針、主な投資対象と投資制限（要約）

◇TMA日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド

１．基本方針

ＴＯＰＩＸ（配当込み）に連動する投資成果の達成を目標とします。

２．運用方法

(1) 主要投資対象

ＴＯＰＩＸに採用されている銘柄を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

①ＴＯＰＩＸに採用されている銘柄を中心に、ＴＯＰＩＸ（配当込み）との連動性を考慮し組入を行います。

②流動性、機動性、コストなどの観点から、株価指数先物取引を行うことがあります。

③基本的には株式への組入比率を高位に保ちますが、資金動向、市況動向によっては実質株式組入比率の調整を機動的に行います。

④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、日本において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における日本の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引を行うことがあります。また、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（スワップ取引）を行うことがあります。

⑤大量の追加設定または解約が生じたとき、市況の急激な変化が予想されるとき、ならびに信託財産の規模によっては上記のような運用ができない場合があります。

３．運用制限

(1) 株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

(8) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、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。

◇TMA日本債券インデックスマザーファンド

１．基本方針

ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）に連動する投資成果の達成を目標とします。

２．運用方法

(1) 主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

③資金動向、市況動向、残存期間等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。

３．運用制限

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

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

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

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

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

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

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

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

(9) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、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。

◇TMA外国株式インデックスマザーファンド

１．基本方針

ＭＳＣＩコクサイ指数（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) 主要投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

①主として外国の株式に投資し、ＭＳＣＩコクサイ指数（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。

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

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

④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。

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。

(9) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、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。

◇TMA外国債券インデックスマザーファンド

１．基本方針

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

２．運用方法

(1) 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

④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。

３．運用制限

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

(2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

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

(10) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、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。

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

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

※「TMA外国株式インデックスマザーファンド」の運用にあたっては、リスクモデルを使用し、最適化法を用いてＭＳＣＩコクサイ指数（配当込み、円ヘッジなし・円ベース）に連動するようポートフォリオを構築します。

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

(2)【投資対象】

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

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

① 有価証券

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

③ 金銭債権（①④に掲げるものに該当するものを除きます。）

④ 約束手形（金融商品取引法第２条第１項第15号に掲げるものを除きます。）

(2) 次に掲げる特定資産以外の資産

為替手形

２．委託会社は、信託金を、主として東京海上アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託会社として締結された「ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド」、「ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド」、「ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド」、「ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド」の受益証券および次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

(1) 株券または新株引受権証書
(2) 国債証券
(3) 地方債証券
(4) 特別の法律により法人の発行する債券
(5) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
(6) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
(7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
(8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
(9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
(10)コマーシャル・ペーパー
(11)新株引受権証券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）および新株予約権証券
(12)外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(1)から(11)までの証券または証書の性質を有するもの
(13)投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
(14)投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）
(15)外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
(16)オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
(17)預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
(18)外国法人が発行する譲渡性預金証書
(19)指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
(20)抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます。）
(21)貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
(22)受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定めるものをいい、上記(1)から(21)に該当するものを除きます。）
(23)外国の者に対する権利で上記(21)および(22)の有価証券の性質を有するもの

なお、(1)の証券または証書、(12)および(17)の証券または証書のうち(1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(2)から(6)までの証券、(12)および(17)の証券または証書のうち(2)から(6)までの証券の性質を有するものならびに(14)の投資法人債券を以下「公社債」といい、(13)の証券および(14)の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

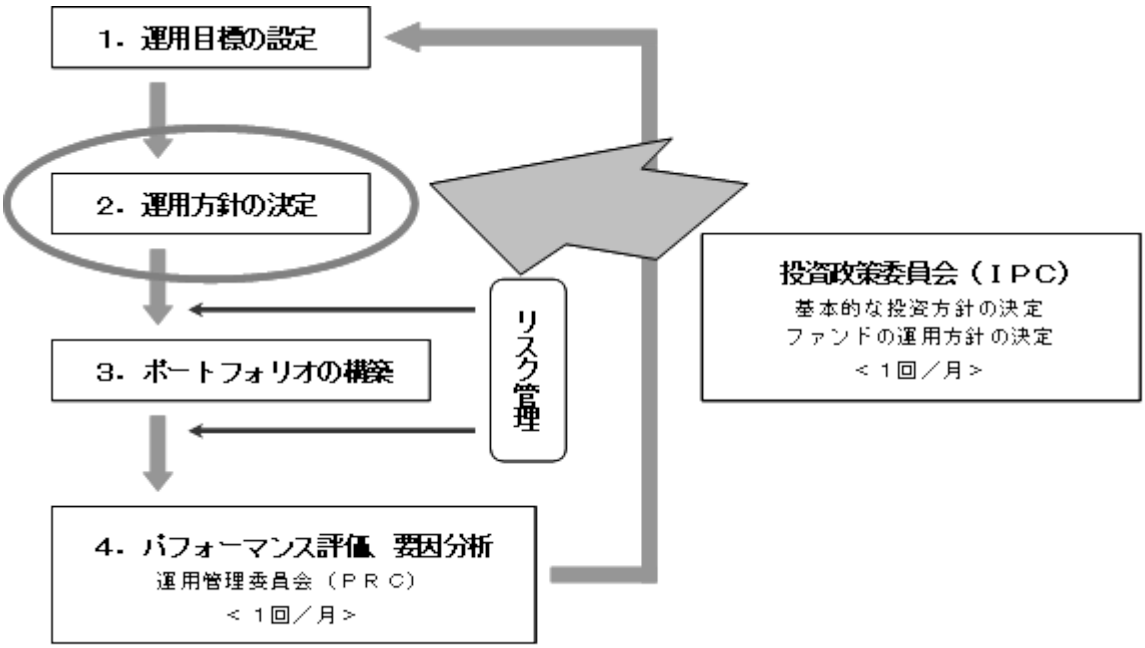
３．委託会社は、信託金を、上記２．に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

(1) 預金
(2) 指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
(3) コール・ローン
(4) 手形割引市場において売買される手形
(5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
(6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

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

(3)【運用体制】

当ファンドの運用体制は以下の通りです。



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

運用におけるリスク管理は、運用リスク管理部門（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７月末日現在）

(4)【分配方針】

毎決算時に、原則として次の方針に基づき分配を行います。

① 分配対象額は、経費控除後の、繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

② 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。

③ 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、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(5)【投資制限】

① 運用の基本方針に基づく制限（約款別紙「運用の基本方針」）

a.株式への実質投資割合には制限を設けません。

b.外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

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。

② 投資する株式等の範囲（約款）

a.委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

b.上記a.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

③ 信用取引（約款）

a.委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡または買戻により行うことの指図をすることができるものとします。

b.上記a.の信用取引の指図は、当該売付にかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付にかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

c.信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の売付にかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

④ 先物取引等（約款）

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

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

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

⑤ スワップ取引（約款）

a.委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

b.スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

c.スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。

d.委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入が必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。

⑥ 金利先渡取引および為替先渡取引（約款）

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

⑦ デリバティブ取引等に係る投資制限（約款）

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

⑧ 有価証券の貸付（約款）

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

⑨ 有価証券の空売（約款）

a.委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または下記「⑩ 有価証券の借入」の規定により借入れた有価証券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売付けた有価証券の引渡または買戻により行うことの指図をすることができるものとします。
b.上記a.の売付の指図は、当該売付にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うことができるものとします。
c.信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の売付にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その額を超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

⑩ 有価証券の借入（約款）

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

⑪ 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款）

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

⑫ 外国為替予約取引（約款）

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

⑬ 信用リスク集中回避のための投資制限（約款）

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

⑭ 資金の借入（約款）

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。

基準価額の変動要因

・投資する有価証券等の値動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本は保証されているものではなく、投資元本を割り込むことがあります。
・運用による損益は、全て投資者に帰属します。
・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ます。

① 価格変動リスク
株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績・財務状況、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。）。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

② 金利変動リスク
公社債は、一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、反対に金利が下落した場合には価格は上昇します。したがって、金利が上昇した場合、基準価額が下落する要因となります。

③ 信用リスク
一般に、公社債や短期金融商品等の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合、またはデフォルトが予想される場合には、当該公社債等の価格は大幅に下落することになります。したがって、組入公社債等にデフォルトが生じた場合、またデフォルトが予想される場合には、基準価額が下落する要因となります。

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

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

⑥ 流動性リスク
受益者から解約申込があった場合、組入資産を売却することで解約資金の手当てを行うことがあります。その際、組入資産の市場における流動性が低いときには直前の市場価格よりも大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

2．その他の留意事項

① 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。

② 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。

③ 投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等による売買等が発生した場合等には、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

④ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全額が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

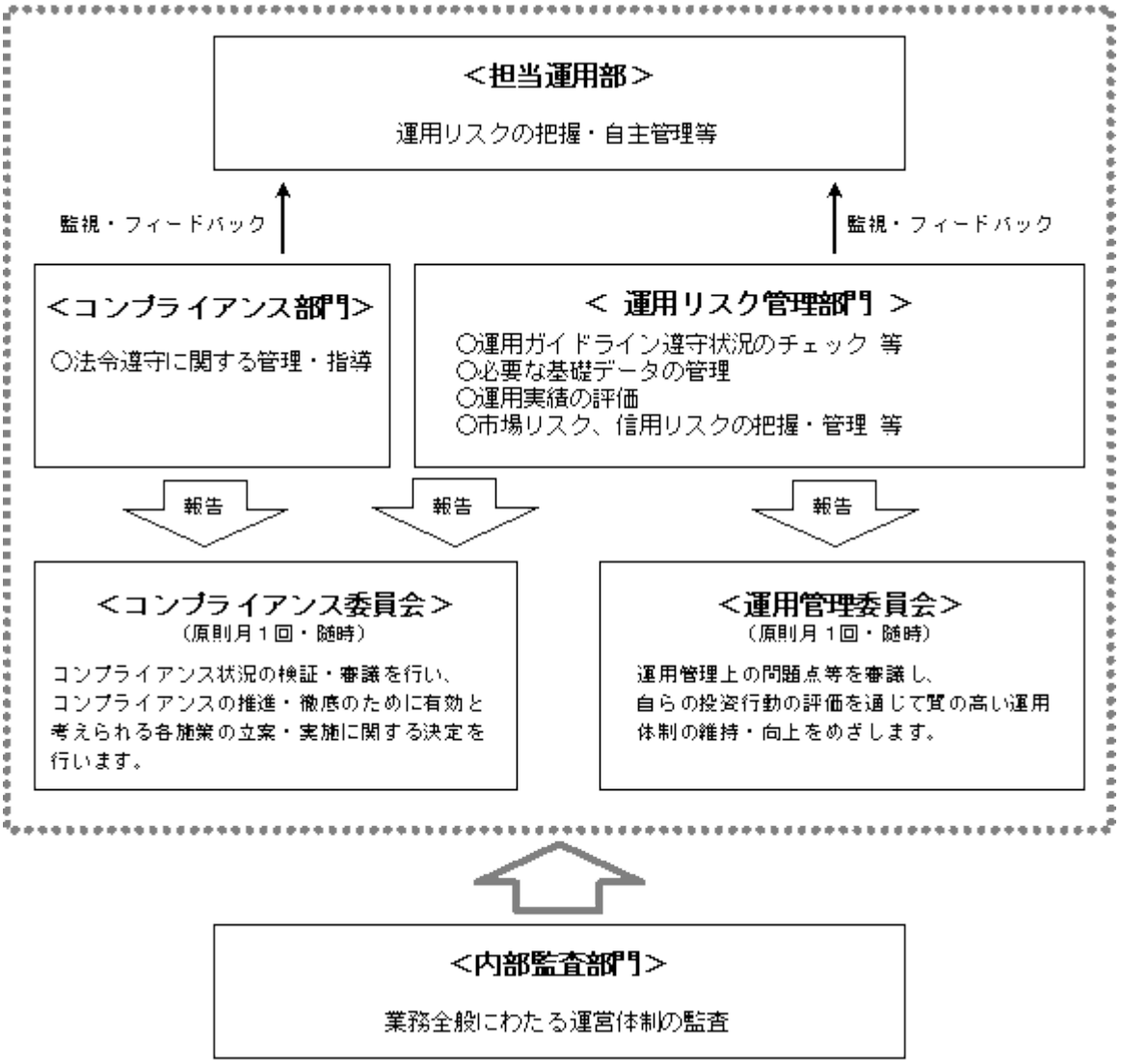
3．管理体制

＜リスク管理体制＞

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

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

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



＜流動性リスク管理＞

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

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

参考情報

2019年8月～2024年7月

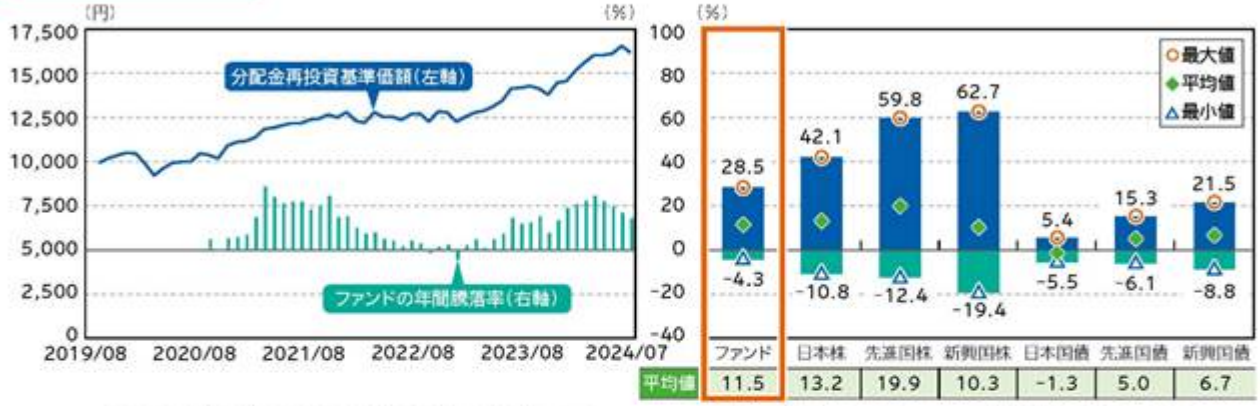
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

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

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

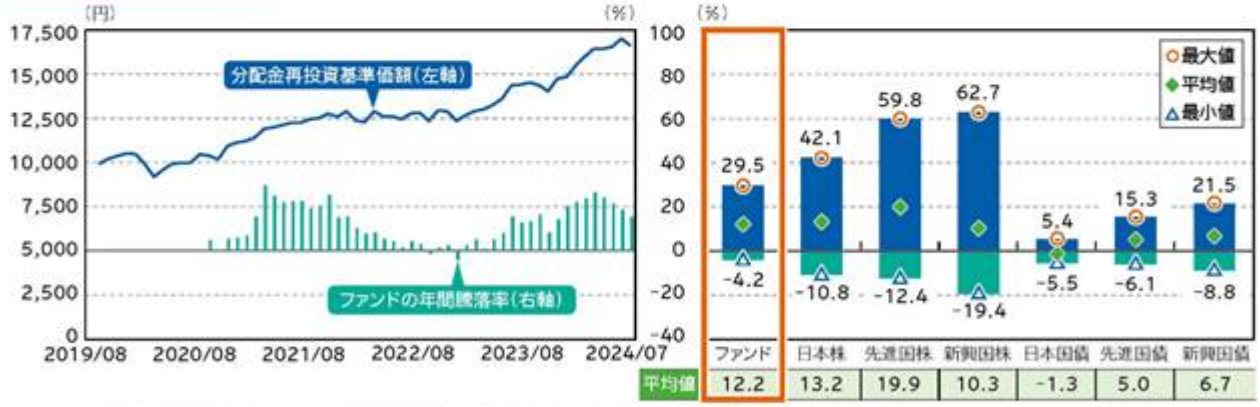
2035



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

※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。
※ファンドは分記金再投資基準価額の年間騰落率です。税引前分記金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
※ファンドは2020年9月以降の年間騰落率を用いています。

2045



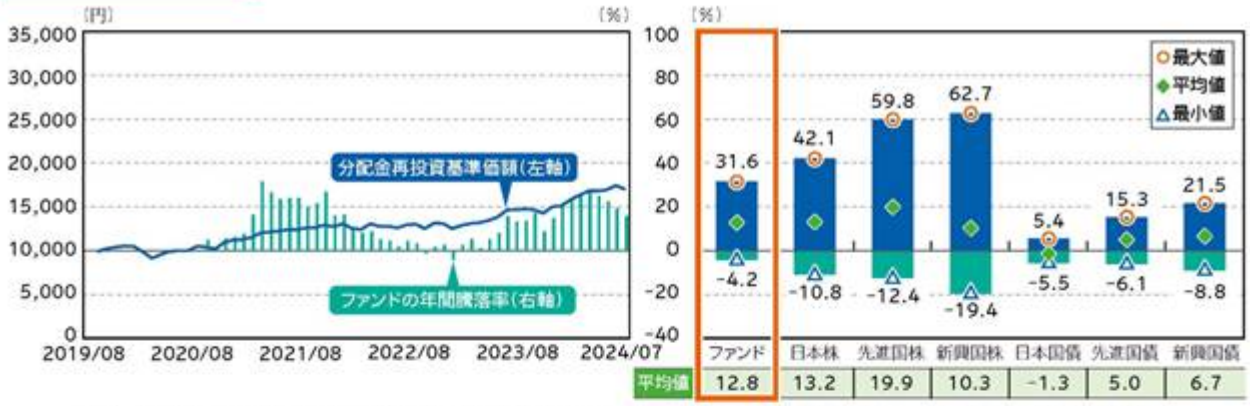
※分記金再投資基準価額は、税引前分記金を再投資したものとして計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。
※年間騰落率は、税引前分記金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※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。
※ファンドは分記金再投資基準価額の年間騰落率です。税引前分記金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
※ファンドは2020年9月以降の年間騰落率を用いています。

次ページへ続く

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

2055



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

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
※ファンドは分配金再投資基準価額の年間騰落率です。税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
※ファンドは2020年9月以降の年間騰落率を用いています。

2065

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

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
※ファンドは分配金再投資基準価額の年間騰落率です。税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
※ファンドは2020年9月以降の年間騰落率を用いています。

次ページへ続く

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

代表的な資産クラスと指数名

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

指数について

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

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

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

無手数料とします。

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金（解約）手数料
ありません。
② 信託財産留保額
ありません。

(3)【信託報酬等】

① 委託会社、販売会社および受託会社の信託報酬の総額は信託財産の純資産総額に対し、所定の信託報酬率を乗じて得た金額とし、計算期間を通じて、毎日計上します。
② ①の信託報酬（消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を含みます。）は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。
③ 信託報酬率およびその配分については以下の通りとします。

●東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

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

＊１ 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価
＊２ 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
＊３ 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

●東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

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

＊１ 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価
＊２ 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
＊３ 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

●東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

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

＊1 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価
＊2 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
＊3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

●東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

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

＊1 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価
＊2 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
＊3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

① 信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用であり、毎日、純資産総額に対し、年率0.011%（税抜0.01%）を乗じて得た金額（ただし、年99万円（税抜90万円）の１日分相当額を上限とします。）を計上し、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。
② 信託財産に関する租税および信託事務等に要する諸費用ならびに受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
③ ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（消費税等相当額を含みます。）、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は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
④ 信託財産の一部解約に伴う支払資金の手当て、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行った場合、借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

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

(5)【課税上の取扱い】

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

＜個人の受益者に対する課税＞

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

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

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

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

少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。
ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入する等、一定の条件に該当する方が対象となります。
当ファンドは、「ＮＩＳＡ」の「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

＜法人の受益者に対する課税＞

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

＜確定拠出年金に対する課税＞

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

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

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

＊上記は、2024年７月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容等が変更される場合があります。

（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
2035	0.32%	0.30%	0.02%
2045	0.32%	0.30%	0.02%
2055	0.32%	0.30%	0.02%
2065	0.32%	0.30%	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7月31日現在の運用状況です。
また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	4,735,688,396	99.99
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		96,092	0.00
合計（純資産総額）		4,735,784,488	100.00

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	2,655,369,065	99.99
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		49,366	0.00
合計（純資産総額）		2,655,418,431	100.00

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	1,685,366,474	99.99
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		32,208	0.00
合計（純資産総額）		1,685,398,682	100.00

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	2,579,569,513	99.99
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		53,351	0.00
合計（純資産総額）		2,579,622,864	100.00

（ご参考：親投資信託の投資状況）

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

ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	69,890,878,850	94.05
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		4,417,081,977	5.94
合計（純資産総額）		74,307,960,827	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	地域	時価（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	4,587,080,000	6.17

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

ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	10,632,652,478	46.43
	カナダ	450,389,374	1.96
	ドイツ	1,368,512,820	5.97
	イタリア	1,596,387,603	6.97
	フランス	1,725,928,871	7.53
	オーストラリア	286,569,092	1.25
	イギリス	1,196,564,285	5.22
	シンガポール	90,273,204	0.39
	マレーシア	112,286,788	0.49
	ニュージーランド	57,623,931	0.25
	オランダ	334,308,900	1.46
	スペイン	1,045,867,278	4.56
	ベルギー	372,139,899	1.62
	スウェーデン	34,921,255	0.15
	ノルウェー	32,704,659	0.14
	オーストリア	260,558,783	1.13
	フィンランド	121,805,534	0.53
	デンマーク	57,370,078	0.25
	メキシコ	167,710,123	0.73
	アイルランド	116,230,167	0.50
	イスラエル	68,177,034	0.29
	ポーランド	124,336,906	0.54
	中華人民共和国	2,325,730,117	10.15
	小計	22,579,049,179	98.60
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		318,377,544	1.39
合計（純資産総額）		22,897,426,723	100.00

ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	179,174,815,158	70.74
	カナダ	8,031,922,134	3.17
	ドイツ	5,774,073,377	2.27
	イタリア	1,408,726,924	0.55
	フランス	6,904,664,462	2.72
	オーストラリア	4,542,221,056	1.79
	イギリス	9,694,678,933	3.82
	スイス	7,522,679,944	2.97
	バミューダ	363,877,239	0.14
	香港	970,374,401	0.38
	シンガポール	814,543,296	0.32
	ニュージーランド	205,572,655	0.08
	オランダ	4,384,816,845	1.73
	スペイン	1,740,010,332	0.68
	ベルギー	503,944,872	0.19
	スウェーデン	2,065,668,395	0.81
	ノルウェー	474,710,230	0.18
	オーストリア	135,318,185	0.05
	ルクセンブルク	87,689,527	0.03
	フィンランド	693,644,167	0.27
	デンマーク	2,556,071,164	1.00
	アイルランド	4,297,737,105	1.69
	イスラエル	373,464,088	0.14
	ポルトガル	154,604,654	0.06
	ケイマン	165,430,776	0.06
	キュラソー	279,071,865	0.11
	ジャージー	599,175,703	0.23
	小計	243,919,507,487	96.30
投資証券	アメリカ	4,019,003,965	1.58
	カナダ	29,253,051	0.01
	フランス	145,098,078	0.05
	オーストラリア	357,766,681	0.14
	イギリス	109,039,441	0.04
	香港	57,441,829	0.02
	シンガポール	63,101,076	0.02
	小計	4,780,704,121	1.88
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		4,565,701,627	1.80
合計（純資産総額）		253,265,913,235	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	6,006,440,880	2.37
	買建	ドイツ	1,116,648,271	0.44
	買建	イギリス	632,644,443	0.24

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

ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	28,326,841,500	90.95
地方債証券	日本	1,450,301,092	4.65
特殊債券	日本	98,238,000	0.31
社債券	日本	1,304,834,861	4.18
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		△37,227,094	△0.11
合計（純資産総額）		31,142,988,359	100.00

(2)【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

a.主要銘柄の明細

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	ＴＭＡ日本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	1,214,009,449	1.2146	1,474,593,518	1.1956	1,451,469,697	30.64
2	ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	554,800,695	2.3765	1,318,507,642	2.6042	1,444,811,969	30.50
3	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	215,460,145	5.7008	1,228,307,957	6.3705	1,372,588,853	28.98
4	ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	229,823,689	1.9476	447,626,925	2.0312	466,817,877	9.85

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	TMA日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	332,216,495	2.3801	790,731,136	2.6042	865,158,196	32.58
2	TMA外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	129,021,313	5.7211	738,147,256	6.3705	821,930,274	30.95
3	TMA日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	590,673,359	1.2141	717,155,955	1.1956	706,209,068	26.59
4	TMA外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	129,023,005	1.9510	251,725,218	2.0312	262,071,527	9.86

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	TMA日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	217,576,255	2.3823	518,334,637	2.6042	566,612,083	33.61
2	TMA外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	84,500,426	5.7256	483,817,183	6.3705	538,309,963	31.93
3	TMA日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	346,274,665	1.2140	420,382,899	1.1956	414,005,989	24.56
4	TMA外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	81,940,941	1.9516	159,919,414	2.0312	166,438,439	9.87

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	TMA日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	343,308,712	2.3842	818,542,868	2.6042	894,044,547	34.65
2	TMA外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	133,334,402	5.7305	764,085,051	6.3705	849,406,807	32.92
3	TMA日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	486,128,879	1.2140	590,165,514	1.1956	581,215,687	22.53
4	TMA外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	125,493,537	1.9526	245,048,255	2.0312	254,902,472	9.88

b.投資有価証券の種類

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合　計	99.99

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合　計	99.99

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合　計	99.99

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合　計	99.99

②【投資不動産物件】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

該当事項はありません。

（ご参考：親投資信託の投資資産）
①投資有価証券の主要銘柄
a.主要銘柄の明細
ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	株式	944,300	3,762.44	3,552,876,277	2,949.00	2,784,740,700	3.74
2	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	1,066,500	1,579.20	1,684,217,704	1,750.00	1,866,375,000	2.51
3	ソニーグループ	日本	電気機器	株式	124,500	13,408.93	1,669,412,742	13,530.00	1,684,485,000	2.26
4	日立製作所	日本	電気機器	株式	431,700	2,782.04	1,201,009,887	3,288.00	1,419,429,600	1.91
5	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	122,500	9,005.24	1,103,142,030	10,915.00	1,337,087,500	1.79
6	キーエンス	日本	電気機器	株式	17,800	71,908.60	1,279,973,101	65,890.00	1,172,842,000	1.57
7	東京エレクトロン	日本	電気機器	株式	37,600	38,915.23	1,463,212,757	31,020.00	1,166,352,000	1.56
8	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	131,600	6,730.18	885,692,388	8,658.00	1,139,392,800	1.53
9	三菱商事	日本	卸売業	株式	361,500	3,534.54	1,277,738,570	3,144.00	1,136,556,000	1.52
10	信越化学工業	日本	化学	株式	159,600	6,817.27	1,088,037,232	6,748.00	1,076,980,800	1.44
11	東京海上ホールディングス	日本	保険業	株式	171,000	4,846.69	828,784,540	6,022.00	1,029,762,000	1.38
12	三井物産	日本	卸売業	株式	282,300	3,572.96	1,008,648,815	3,530.00	996,519,000	1.34
13	伊藤忠商事	日本	卸売業	株式	126,800	6,675.41	846,442,048	7,783.00	986,884,400	1.32
14	第一三共	日本	医薬品	株式	155,300	4,956.24	769,704,960	6,148.00	954,784,400	1.28
15	任天堂	日本	その他製品	株式	111,900	8,367.85	936,362,627	8,388.00	938,617,200	1.26
16	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	5,300,000	178.36	945,351,405	160.40	850,120,000	1.14
17	みずほフィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	235,400	3,055.50	719,266,797	3,448.00	811,659,200	1.09
18	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	88,300	9,264.36	818,043,215	9,162.00	809,004,600	1.08
19	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	417,000	1,877.02	782,719,680	1,647.00	686,799,000	0.92
20	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	155,400	4,364.24	678,203,276	4,302.00	668,530,800	0.89
21	ＨＯＹＡ	日本	精密機器	株式	35,000	19,732.99	690,654,868	18,940.00	662,900,000	0.89
22	ＫＤＤＩ	日本	情報・通信業	株式	130,600	4,526.58	591,171,522	4,520.00	590,312,000	0.79
23	三菱重工業	日本	機械	株式	315,900	1,363.98	430,882,886	1,830.00	578,097,000	0.77
24	ソフトバンク	日本	情報・通信業	株式	282,200	2,014.97	568,625,054	1,965.00	554,523,000	0.74
25	村田製作所	日本	電気機器	株式	159,000	2,929.59	465,804,863	3,351.00	532,809,000	0.71
26	三菱電機	日本	電気機器	株式	196,500	2,560.13	503,066,441	2,601.00	511,096,500	0.68
27	ダイキン工業	日本	機械	株式	21,500	20,859.14	448,471,523	21,905.00	470,957,500	0.63
28	日本たばこ産業	日本	食料品	株式	104,600	3,998.61	418,255,540	4,434.00	463,796,400	0.62
29	富士通	日本	電気機器	株式	165,100	2,567.08	423,826,125	2,732.50	451,135,750	0.60
30	丸紅	日本	卸売業	株式	155,400	2,677.60	416,099,140	2,860.50	444,521,700	0.59

ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	額面	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
							単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	T 3 7/8 12/31/27	アメリカ	国債証券	3.875	2027/12/31	1,100,000	14,840.65	163,247,160	15,124.31	166,367,418	0.72
2	T 4 7/8 10/31/28	アメリカ	国債証券	4.875	2028/10/31	1,000,000	15,441.15	154,411,596	15,714.42	157,144,203	0.68
3	T 5 10/31/25	アメリカ	国債証券	5.000	2025/10/31	1,000,000	15,320.33	153,203,392	15,302.65	153,026,537	0.66
4	T 4 7/8 11/30/25	アメリカ	国債証券	4.875	2025/11/30	1,000,000	15,408.13	154,081,326	15,291.63	152,916,375	0.66
5	T 4 1/8 11/15/32	アメリカ	国債証券	4.125	2032/11/15	1,000,000	14,755.95	147,559,537	15,263.35	152,633,527	0.66
6	T 4 1/2 11/15/33	アメリカ	国債証券	4.500	2033/11/15	900,000	15,686.67	141,180,057	15,662.01	140,958,171	0.61
7	T 4 3/4 07/31/25	アメリカ	国債証券	4.750	2025/07/31	900,000	15,148.72	136,338,525	15,237.84	137,140,638	0.59
8	T 4 5/8 09/15/26	アメリカ	国債証券	4.625	2026/09/15	800,000	15,161.82	121,294,602	15,331.23	122,649,888	0.53
9	CGB 2.55 10/15/28	中華人民共和国	国債証券	2.550	2028/10/15	5,600,000	2,127.24	119,125,640	2,164.21	121,195,989	0.52
10	T 2 08/15/25	アメリカ	国債証券	2.000	2025/08/15	800,000	14,452.02	115,616,212	14,823.16	118,585,307	0.51
11	CGB 2.33 12/15/25	中華人民共和国	国債証券	2.330	2025/12/15	5,400,000	2,116.55	114,293,936	2,129.11	114,972,336	0.50
12	T 1 3/8 11/15/31	アメリカ	国債証券	1.375	2031/11/15	900,000	11,999.44	107,995,014	12,652.22	113,870,000	0.49
13	T 4 1/4 12/31/25	アメリカ	国債証券	4.250	2025/12/31	700,000	15,123.88	105,867,169	15,173.43	106,214,057	0.46
14	T 3 7/8 12/31/29	アメリカ	国債証券	3.875	2029/12/31	700,000	14,660.19	102,621,348	15,105.85	105,740,958	0.46
15	T 4 02/15/34	アメリカ	国債証券	4.000	2034/02/15	700,000	14,826.16	103,783,141	15,071.31	105,499,196	0.46
16	T 3 3/4 12/31/28	アメリカ	国債証券	3.750	2028/12/31	700,000	15,020.59	105,144,142	15,051.36	105,359,559	0.46
17	CGB 2.44 10/15/27	中華人民共和国	国債証券	2.440	2027/10/15	4,900,000	2,105.09	103,149,836	2,149.23	105,312,757	0.45
18	FRTR 0 3/4 02/25/28	フランス	国債証券	0.750	2028/02/25	600,000	15,108.40	90,650,421	15,403.94	92,423,648	0.40
19	T 4 7/8 05/31/26	アメリカ	国債証券	4.875	2026/05/31	600,000	15,276.95	91,661,743	15,360.71	92,164,271	0.40
20	T 4 1/4 01/31/26	アメリカ	国債証券	4.250	2026/01/31	600,000	15,186.74	91,120,488	15,177.30	91,063,845	0.39
21	T 3 5/8 05/31/28	アメリカ	国債証券	3.625	2028/05/31	600,000	14,610.41	87,662,472	14,991.22	89,947,340	0.39
22	T 3 7/8 08/15/33	アメリカ	国債証券	3.875	2033/08/15	600,000	14,358.14	86,148,844	14,940.01	89,640,078	0.39
23	CGB 2.8 11/15/32	中華人民共和国	国債証券	2.800	2032/11/15	4,000,000	2,145.58	85,823,270	2,217.26	88,690,719	0.38
24	T 1 5/8 02/15/26	アメリカ	国債証券	1.625	2026/02/15	600,000	14,167.39	85,004,355	14,591.36	87,548,197	0.38
25	T 2 3/4 02/15/28	アメリカ	国債証券	2.750	2028/02/15	600,000	14,109.03	84,654,218	14,555.63	87,333,828	0.38

26	T 1 1/4 12/31/26	アメリカ	国債証券	1.250	2026/12/31	600,000	13,701.73	82,210,414	14,207.28	85,243,733	0.37
27	T 2 7/8 05/15/32	アメリカ	国債証券	2.875	2032/05/15	600,000	13,331.35	79,988,126	14,004.82	84,028,976	0.36
28	CGB 2.79 12/15/29	中華人民共和国	国債証券	2.790	2029/12/15	3,800,000	2,128.15	80,869,747	2,195.56	83,431,330	0.36
29	FRTR 2 3/4 02/25/29	フランス	国債証券	2.750	2029/02/25	500,000	16,411.65	82,058,266	16,490.97	82,454,893	0.36
30	FRTR 2 1/2 09/24/26	フランス	国債証券	2.500	2026/09/24	500,000	16,307.22	81,536,126	16,394.14	81,970,735	0.35

TMA外国株式インデックスマザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	株式	383,427	27,890.14	10,693,833,194	33,353.87	12,788,775,079	5.04
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	184,573	56,080.25	10,350,900,002	64,469.92	11,899,407,430	4.69
3	NVIDIA CORP	アメリカ	半導体・半導体製造装置	株式	654,554	8,135.17	5,324,914,326	15,812.60	10,350,201,365	4.08
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	一般消費財・サービス流通・小売り	株式	245,014	22,213.98	5,442,736,450	27,699.87	6,786,856,536	2.67
5	META PLATFORMS INC-A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	57,463	51,309.60	2,948,403,650	70,608.68	4,057,386,785	1.60
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	155,101	20,435.68	3,169,595,166	25,959.00	4,026,268,037	1.58
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	株式	133,074	20,521.07	2,730,821,306	26,198.33	3,486,317,684	1.37
8	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	21,254	93,712.54	1,991,766,405	120,459.61	2,560,248,601	1.01
9	TESLA INC	アメリカ	自動車・自動車部品	株式	75,379	31,754.05	2,393,588,860	33,936.19	2,558,076,277	1.01
10	BROADCOM INC	アメリカ	半導体・半導体製造装置	株式	115,590	14,678.43	1,696,680,134	21,878.18	2,528,899,843	0.99
11	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	株式	75,025	22,997.36	1,725,377,443	32,803.56	2,461,087,359	0.97
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	金融サービス	株式	33,707	54,303.09	1,830,394,459	67,265.67	2,267,324,087	0.89
13	EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	エネルギー	株式	117,464	15,736.46	1,848,467,813	18,013.83	2,115,977,090	0.83
14	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	ヘルスケア機器・サービス	株式	23,892	81,366.07	1,943,998,372	87,855.74	2,099,049,464	0.82
15	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	85,578	15,859.18	1,357,197,483	19,810.43	1,695,337,834	0.66

16	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	金融サービス	株式	40,566	37,443.81	1,518,945,628	40,106.96	1,626,979,101	0.64
17	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	61,418	22,660.17	1,391,742,558	24,593.14	1,510,461,791	0.59
18	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	家庭用品・パーソナル用品	株式	60,370	23,139.73	1,396,946,053	24,649.54	1,488,093,212	0.58
19	MASTERCARD INC - A	アメリカ	金融サービス	株式	21,260	60,470.73	1,285,607,811	68,209.27	1,450,129,250	0.57
20	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	生活必需品流通・小売り	株式	11,675	90,022.04	1,051,007,368	123,480.97	1,441,640,362	0.56
21	HOME DEPOT INC	アメリカ	一般消費財・サービス流通・小売り	株式	25,888	45,472.38	1,177,189,229	55,440.90	1,435,254,112	0.56
22	ASML HOLDING NV	オランダ	半導体・半導体製造装置	株式	10,455	105,044.64	1,098,241,800	132,851.87	1,388,966,332	0.54
23	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	46,357	21,792.90	1,010,253,599	28,472.74	1,319,910,956	0.52
24	WALMART INC	アメリカ	生活必需品流通・小売り	株式	114,581	8,469.28	970,419,084	10,547.32	1,208,522,885	0.47
25	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	銀行	株式	186,285	4,411.24	821,749,628	6,292.72	1,172,239,941	0.46
26	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	66,036	16,194.63	1,069,429,042	17,568.70	1,160,167,333	0.45
27	CHEVRONTEXACO CORP	アメリカ	エネルギー	株式	46,212	21,832.64	1,008,929,961	24,324.85	1,124,100,005	0.44
28	NETFLIX INC	アメリカ	メディア・娯楽	株式	11,389	68,841.28	784,033,383	94,906.09	1,080,885,518	0.42
29	COCA-COLA COMPANY	アメリカ	食品・飲料・タバコ	株式	103,471	8,744.75	904,828,210	10,317.13	1,067,524,710	0.42
30	NESTLE SA-REGISTERED	スイス	食品・飲料・タバコ	株式	68,730	17,124.69	1,176,980,241	15,328.33	1,053,516,670	0.41

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	99.76	417,005,160	1.33
2	第１４９回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.005	2026/09/20	351,000,000	99.54	349,410,750	99.07	347,767,290	1.11
3	第３６２回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2031/03/20	356,000,000	96.21	342,518,240	95.80	341,055,120	1.09

4	第３５９回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2030/06/20	349,000,000	97.17	339,132,840	96.55	336,973,460	1.08
5	第１４７回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.005	2026/03/20	332,000,000	99.74	331,136,800	99.40	330,031,240	1.05
6	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	97.80	328,608,000	1.05
7	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	97.59	327,909,120	1.05
8	第３６１回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2030/12/20	334,000,000	97.02	324,075,500	96.06	320,863,780	1.03
9	第３６６回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.200	2032/03/20	331,000,000	95.72	316,837,680	95.27	315,350,320	1.01
10	第１４６回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2025/12/20	315,000,000	100.03	315,094,500	99.68	314,020,350	1.00
11	第３６８回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.200	2032/09/20	331,000,000	95.12	314,854,220	94.62	313,195,510	1.00
12	第３６０回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2030/09/20	325,000,000	96.95	315,100,370	96.32	313,062,750	1.00
13	第３６５回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2031/12/20	330,000,000	95.63	315,591,430	94.85	313,014,900	1.00
14	第３７４回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.800	2034/03/20	316,000,000	98.03	309,798,590	97.89	309,357,680	0.99
15	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	97.32	304,630,380	0.97
16	第３５７回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2029/12/20	313,000,000	97.87	306,358,380	96.96	303,487,930	0.97
17	第３５２回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2028/09/20	307,000,000	98.51	302,440,200	98.02	300,924,470	0.96
18	第３５８回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2030/03/20	304,000,000	97.38	296,037,750	96.77	294,192,960	0.94
19	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	97.14	291,435,000	0.93
20	第１５７回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.200	2028/03/20	294,000,000	99.22	291,727,830	98.77	290,383,800	0.93
21	第１５３回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.005	2027/06/20	293,000,000	99.39	291,239,130	98.63	288,997,620	0.92

22	第１４８回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.005	2026/06/20	287,000,000	99.63	285,941,050	99.20	284,718,350	0.91
23	第３７２回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.800	2033/09/20	289,000,000	100.57	290,670,520	98.44	284,517,610	0.91
24	第３６４回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2031/09/20	297,000,000	96.33	286,110,910	95.17	282,675,690	0.90
25	第３６３回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2031/06/20	295,000,000	96.11	283,543,160	95.49	281,707,300	0.90
26	第３６７回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.200	2032/06/20	283,000,000	95.34	269,812,200	94.95	268,711,330	0.86
27	第３７３回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.600	2033/12/20	275,000,000	98.21	270,083,110	96.40	265,105,500	0.85
28	第１５５回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.300	2027/12/20	266,000,000	100.13	266,363,380	99.25	264,007,660	0.84
29	第１５０回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.005	2026/12/20	264,000,000	99.42	262,483,200	98.93	261,193,680	0.83
30	第１５１回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.005	2027/03/20	260,000,000	99.26	258,078,120	98.79	256,854,000	0.82

b.投資有価証券の種類

ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.07
		鉱業	0.27
		建設業	1.98
		食料品	3.03
		繊維製品	0.36
		パルプ・紙	0.14
		化学	5.40
		医薬品	4.53
		石油・石炭製品	0.50
		ゴム製品	0.60
		ガラス・土石製品	0.62
		鉄鋼	0.83
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.50
		機械	5.13
		電気機器	16.21
		輸送用機器	7.35
		精密機器	2.13
		その他製品	2.26

		電気・ガス業	1.30
		陸運業	2.15
		海運業	0.71
		空運業	0.33
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	6.67
		卸売業	7.03
		小売業	3.81
		銀行業	7.85
		証券、商品先物取引業	0.92
		保険業	3.09
		その他金融業	1.14
		不動産業	1.89
		サービス業	4.31
合　計			94.05

TMA外国債券インデックスマザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	98.60
合　計	98.60

TMA外国株式インデックスマザーファンド

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	4.46
		素材	3.60
		資本財	6.88
		商業・専門サービス	1.62
		運輸	1.55
		自動車・自動車部品	1.61
		耐久消費財・アパレル	1.34
		消費者サービス	1.82
		メディア・娯楽	6.16
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.81
		生活必需品流通・小売り	1.71
		食品・飲料・タバコ	3.11
		家庭用品・パーソナル用品	1.52
		ヘルスケア機器・サービス	4.13
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.97
		銀行	5.65
		金融サービス	6.61
		保険	2.98
		ソフトウェア・サービス	9.71
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.50

		電気通信サービス	1.08
		公益事業	2.63
		半導体・半導体製造装置	8.44
		不動産管理・開発	0.27
投資証券		―	1.88
合　計			98.19

TMA日本債券インデックスマザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	90.95
地方債証券	4.65
特殊債券	0.31
社債券	4.18
合　計	100.11

②投資不動産物件

TMA日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド

該当事項はありません。

TMA外国債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

TMA外国株式インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

TMA日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの

TMA日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/売建	数量(枚)	帳簿価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	日本	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	164	4,592,188,200.00	4,587,080,000	6.17

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

TMA外国債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/売建	数量(枚)	通貨	帳簿価額	評価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	Chicago Mercantile Exchange	S&P 500 EMIN	買建	144	米ドル	39,759,175.00	39,402,000.00	6,006,440,880	2.37
	ドイツ	Eurex	DJ EU STX 50	買建	139	ユーロ	6,822,880.00	6,772,080.00	1,116,648,271	0.44
	イギリス	ICE Futures Europe Financials	FTSE 100 IDX	買建	39	英ポンド	3,218,665.00	3,231,735.00	632,644,443	0.24

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

ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

期	年月日	純資産総額（百万円）（分配落）	純資産総額（百万円）（分配付）	1口当たり純資産額(円)(分配落)	1口当たり純資産額(円)(分配付)
第1計算期間末	（2020年 1月27日）	4	4	1.0509	1.0509
第2計算期間末	（2021年 1月25日）	153	153	1.1305	1.1305
第3計算期間末	（2022年 1月25日）	735	735	1.2250	1.2250
第4計算期間末	（2023年 1月25日）	1,888	1,888	1.2592	1.2592
第5計算期間末	（2024年 1月25日）	3,620	3,620	1.5064	1.5064
2023年 7月末日		2,821	—	1.4176	—
8月末日		2,962	—	1.4274	—
9月末日		2,999	—	1.4138	—
10月末日		3,044	—	1.3794	—
11月末日		3,291	—	1.4476	—
12月末日		3,386	—	1.4560	—
2024年 1月末日		3,690	—	1.5158	—
2月末日		3,872	—	1.5624	—
3月末日		4,239	—	1.6034	—
4月末日		4,303	—	1.6025	—
5月末日		4,507	—	1.6118	—
6月末日		4,724	—	1.6547	—
7月末日		4,735	—	1.6176	—

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

期	年月日	純資産総額（百万円）（分配落）	純資産総額（百万円）（分配付）	1口当たり純資産額(円)(分配落)	1口当たり純資産額(円)(分配付)
第1計算期間末	（2020年 1月27日）	2	2	1.0527	1.0527
第2計算期間末	（2021年 1月25日）	51	51	1.1351	1.1351
第3計算期間末	（2022年 1月25日）	366	366	1.2333	1.2333
第4計算期間末	（2023年 1月25日）	964	964	1.2715	1.2715
第5計算期間末	（2024年 1月25日）	1,959	1,959	1.5386	1.5386
2023年 7月末日		1,508	—	1.4414	—
8月末日		1,588	—	1.4524	—
9月末日		1,602	—	1.4384	—
10月末日		1,607	—	1.4025	—
11月末日		1,757	—	1.4744	—
12月末日		1,811	—	1.4832	—
2024年 1月末日		2,001	—	1.5487	—
2月末日		2,125	—	1.5991	—
3月末日		2,295	—	1.6439	—
4月末日		2,341	—	1.6439	—
5月末日		2,473	—	1.6556	—
6月末日		2,630	—	1.7020	—
7月末日		2,655	—	1.6618	—

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

期	年月日	純資産総額（百万円）（分配落）	純資産総額（百万円）（分配付）	1口当たり純資産額(円)(分配落)	1口当たり純資産額(円)(分配付)
第1計算期間末	（2020年 1月27日）	1	1	1.0565	1.0565
第2計算期間末	（2021年 1月25日）	44	44	1.1445	1.1445
第3計算期間末	（2022年 1月25日）	233	233	1.2487	1.2487
第4計算期間末	（2023年 1月25日）	593	593	1.2904	1.2904
第5計算期間末	（2024年 1月25日）	1,246	1,246	1.5705	1.5705
2023年 7月末日		921	—	1.4680	—
8月末日		979	—	1.4797	—
9月末日		1,007	—	1.4654	—
10月末日		1,011	—	1.4284	—
11月末日		1,118	—	1.5029	—
12月末日		1,160	—	1.5120	—
2024年 1月末日		1,278	—	1.5811	—
2月末日		1,356	—	1.6340	—
3月末日		1,466	—	1.6811	—
4月末日		1,492	—	1.6815	—
5月末日		1,575	—	1.6947	—
6月末日		1,669	—	1.7433	—
7月末日		1,685	—	1.7012	—

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

期	年月日	純資産総額（百万円）（分配落）	純資産総額（百万円）（分配付）	1口当たり純資産額(円)(分配落)	1口当たり純資産額(円)(分配付)
第1計算期間末	（2020年 1月27日）	1	1	1.0584	1.0584
第2計算期間末	（2021年 1月25日）	79	79	1.1490	1.1490
第3計算期間末	（2022年 1月25日）	463	463	1.2579	1.2579
第4計算期間末	（2023年 1月25日）	978	978	1.3059	1.3059
第5計算期間末	（2024年 1月25日）	1,987	1,987	1.6078	1.6078
2023年 7月末日		1,482	―	1.4961	―
8月末日		1,619	―	1.5090	―
9月末日		1,647	―	1.4944	―
10月末日		1,619	―	1.4556	―
11月末日		1,782	―	1.5342	―
12月末日		1,854	―	1.5437	―
2024年 1月末日		2,014	―	1.6190	―
2月末日		2,145	―	1.6762	―
3月末日		2,286	―	1.7275	―
4月末日		2,335	―	1.7281	―
5月末日		2,435	―	1.7428	―
6月末日		2,569	―	1.7940	―
7月末日		2,579	―	1.7496	―

②【分配の推移】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

該当事項はありません。

③【収益率の推移】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

期	計算期間	収益率（%）（分配付）
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	5.1
第2計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	7.6
第3計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	8.4
第4計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	2.8
第5計算期間	2023年 1月26日～2024年 1月25日	19.6
第6中間計算期間	2024年 1月26日～2024年 7月25日	6.5

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

期	計算期間	収益率（%）（分配付）
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	5.3
第2計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	7.8
第3計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	8.7
第4計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	3.1
第5計算期間	2023年 1月26日～2024年 1月25日	21.0
第6中間計算期間	2024年 1月26日～2024年 7月25日	7.1

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

期	計算期間	収益率（%）（分配付）
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	5.7
第2計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	8.3
第3計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	9.1
第4計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	3.3
第5計算期間	2023年 1月26日～2024年 1月25日	21.7
第6中間計算期間	2024年 1月26日～2024年 7月25日	7.3

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

期	計算期間	収益率（%）（分配付）
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	5.8
第2計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	8.6
第3計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	9.5
第4計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	3.8
第5計算期間	2023年 1月26日～2024年 1月25日	23.1
第6中間計算期間	2024年 1月26日～2024年 7月25日	7.8

(4)【設定及び解約の実績】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	4,514,529	―	4,514,529
第2計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	147,556,612	16,408,441	135,662,700
第3計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	541,037,240	76,037,177	600,662,763
第4計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	1,013,766,234	114,944,473	1,499,484,524
第5計算期間	2023年 1月26日～2024年 1月25日	1,071,577,486	167,622,933	2,403,439,077
第6中間計算期間	2024年 1月26日～2024年 7月25日	666,661,957	162,010,529	2,908,090,505

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	2,051,072	―	2,051,072
第2計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	47,146,627	3,465,092	45,732,607
第3計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	271,763,387	20,016,066	297,479,928
第4計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	527,211,069	65,733,276	758,957,721
第5計算期間	2023年 1月26日～2024年 1月25日	607,240,829	92,483,308	1,273,715,242
第6中間計算期間	2024年 1月26日～2024年 7月25日	377,649,987	68,383,760	1,582,981,469

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	1,075,709	―	1,075,709
第2計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	42,994,246	5,274,240	38,795,715
第3計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	173,994,786	26,139,658	186,650,843
第4計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	329,859,329	56,692,136	459,818,036
第5計算期間	2023年 1月26日～2024年 1月25日	427,962,253	94,281,251	793,499,038
第6中間計算期間	2024年 1月26日～2024年 7月25日	250,998,779	64,747,137	979,750,680

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	1,503,582	―	1,503,582
第2計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	88,824,986	20,986,846	69,341,722
第3計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	434,498,332	135,257,180	368,582,874
第4計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	524,519,145	144,133,313	748,968,706
第5計算期間	2023年 1月26日～2024年 1月25日	787,295,943	299,900,325	1,236,364,324
第6中間計算期間	2024年 1月26日～2024年 7月25日	398,958,716	173,591,323	1,461,731,717

＜参考情報＞

基準日：2024年7月31日

基準価額・純資産の推移

2035

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

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

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

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

2045

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

（1万口当たり、税引前）

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

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

次ページへ続く

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

基準日：2024年7月31日

2055

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

(1万口当たり、税引前)

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

2065

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

(1万口当たり、税引前)

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

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

次ページへ続く

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

基準日:2024年7月31日

主要な資産の状況

資産構成

2035

ファンド名	組入比率	基本資産配分	差
TMA日本株TOPIXマザーファンド	30.5%	30.0%	+0.5%
TMA日本債券インデックスマザーファンド	30.6%	30.0%	+0.6%
TMA外国株式インデックスマザーファンド	29.0%	30.0%	−1.0%
TMA外国債券インデックスマザーファンド	9.9%	10.0%	−0.1%
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。

2045

ファンド名	組入比率	基本資産配分	差
TMA日本株TOPIXマザーファンド	32.6%	32.0%	+0.6%
TMA日本債券インデックスマザーファンド	26.6%	26.0%	+0.6%
TMA外国株式インデックスマザーファンド	31.0%	32.0%	−1.0%
TMA外国債券インデックスマザーファンド	9.9%	10.0%	−0.1%
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。

2055

ファンド名	組入比率	基本資産配分	差
TMA日本株TOPIXマザーファンド	33.6%	33.0%	+0.6%
TMA日本債券インデックスマザーファンド	24.6%	24.0%	+0.6%
TMA外国株式インデックスマザーファンド	31.9%	33.0%	−1.1%
TMA外国債券インデックスマザーファンド	9.9%	10.0%	−0.1%
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。

2065

ファンド名	組入比率	基本資産配分	差
TMA日本株TOPIXマザーファンド	34.7%	34.0%	+0.7%
TMA日本債券インデックスマザーファンド	22.5%	22.0%	+0.5%
TMA外国株式インデックスマザーファンド	32.9%	34.0%	−1.1%
TMA外国債券インデックスマザーファンド	9.9%	10.0%	−0.1%
短期金融資産等	0.0%	−	+0.0%

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

次ページへ続く

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

基準日：2024年7月31日

年間収益率の推移

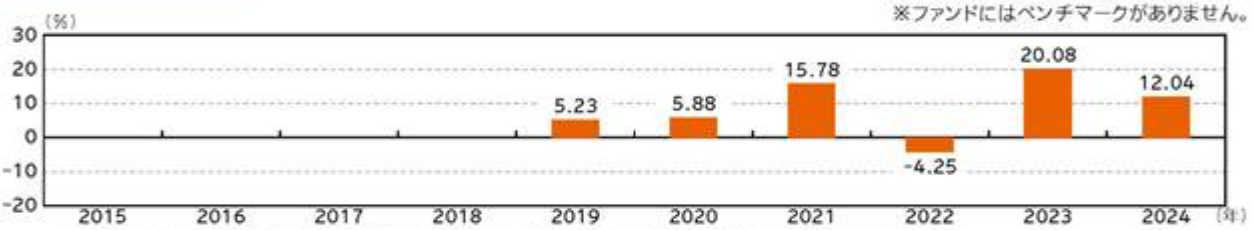
2035

※ファンドにはベンチマークがありません。

※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しており、設定日以降を表示しています。
※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

2045

※ファンドにはベンチマークがありません。



※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しており、設定日以降を表示しています。
※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

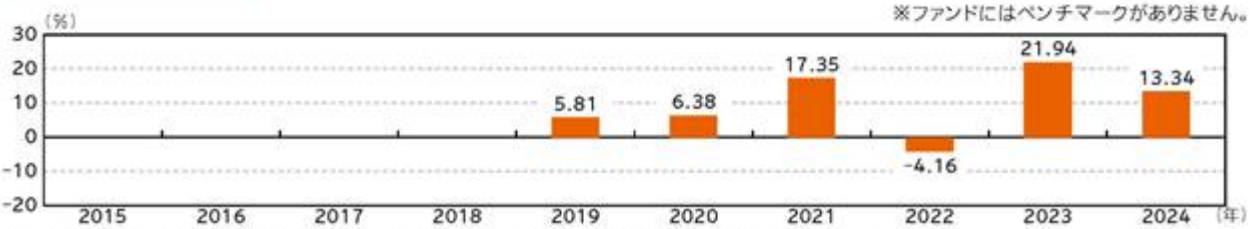
2055

※ファンドにはベンチマークがありません。

※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しており、設定日以降を表示しています。
※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

2065

※ファンドにはベンチマークがありません。



※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しており、設定日以降を表示しています。
※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

a.毎営業日にお申込みを受け付けます。ただし、お申込み日が以下に該当する日には、取得のお申込みの受付を行いません。
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ロンドン証券取引所の休業日
・フランクフルト証券取引所の休業日

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

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

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

d.取得申込の受付は、原則として午後３時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みについては翌営業日受付の取扱いとなります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
※2024年11月５日以降は、原則として午後３時30分までに、販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とする予定です。なお、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。

e.受益権の取得申込価額は以下の通りです。
取得申込受付日の翌営業日の基準価額
基準価額は原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクに問い合わせることにより知ることができます。
●委託会社サービスデスク
東京海上アセットマネジメント　サービスデスク
０１２０－７１２－０１６（営業日の９時～17時）
ホームページ
https://www.tokiomarineam.co.jp/

f.申込手数料は、前記「第１ファンドの状況 ４手数料等及び税金 (1)申込手数料」をご覧ください。

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

h.取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関等への通知を行うものとします。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、解約請求日が以下に該当する日には、お申込みの受付を行いません。
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ロンドン証券取引所の休業日
・フランクフルト証券取引所の休業日
d.解約単位は、販売会社やお申込みのコース等によって異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
e.解約請求のお申込みの受付は、原則として午後３時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みは翌営業日受付としてお取扱いします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
※2024年11月５日以降は、原則として午後３時30分までに、販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とする予定です。なお、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。
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。
g.解約価額は、原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクに問い合わせることにより知ることができます。
h.解約にかかる手数料はありません。
i.解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して５営業日目から、お支払いします。
j.委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよび既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日を解約請求受付日とする解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にその請求を受け付けたものとして取扱います。
k.信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口解約には制限を設ける場合があります。ただし、確定拠出年金制度に基づく受益者である場合には制限はありません。
l.受益者が解約の請求をするときは、振替受益権をもって行うものとし、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請が行われ、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

a.基準価額とは、受益権１口当たりの純資産価額（純資産総額を計算日における受益権総口数で除した金額）をいいます。ただし、便宜上１万口当たりに換算した価額で表示されることがあります。

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

＜主要投資対象資産の評価方法＞

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

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

原則として、2019年９月20日から無期限とします。ただし、後記「(5)その他 ①信託の終了（繰上償還）」に該当する場合には、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

原則として、毎年１月26日から翌年１月25日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日（※）を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。

（※）法令により、これと異なる日を計算期間の末日と定めている場合には、法令にしたがいます。

(5)【その他】

① 信託の終了（繰上償還）

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

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

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

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

② 信託約款の変更

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

③ 関係会社との契約の更改等

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

④ 運用報告書

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、販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

⑤ 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、原則として電子公告の方法により行い、委託会社のホームページ（https://www.tokiomarineam.co.jp/）に掲載します。
なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

４【受益者の権利等】

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

① 収益分配金の請求権

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

② 償還金の請求権

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

③ 換金（解約）請求権

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

④ 買取請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、第5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】
【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 [2023年 1月25日現在]	第5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	1,888,079,937	3,620,317,630
未収入金	3,700,657	6,887,305
流動資産合計	1,891,780,594	3,627,204,935
資産合計	1,891,780,594	3,627,204,935
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,007,806	1,614,148
未払受託者報酬	177,088	346,601
未払委託者報酬	2,302,038	4,505,704
その他未払費用	88,462	173,197
流動負債合計	3,575,394	6,639,650
負債合計	3,575,394	6,639,650
純資産の部		
元本等		
元本	※1 1,499,484,524	※1 2,403,439,077
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	388,720,676	1,217,126,208
（分配準備積立金）	39,154,953	498,634,521
元本等合計	1,888,205,200	3,620,565,285
純資産合計	1,888,205,200	3,620,565,285
負債純資産合計	1,891,780,594	3,627,204,935

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第5期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	29,082,125	489,273,556
営業収益合計	29,082,125	489,273,556
営業費用		
受託者報酬	280,502	591,288
委託者報酬	3,646,359	7,686,644
その他費用	140,080	295,454
営業費用合計	4,066,941	8,573,386
営業利益又は営業損失（△）	25,015,184	480,700,170
経常利益又は経常損失（△）	25,015,184	480,700,170
当期純利益又は当期純損失（△）	25,015,184	480,700,170
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	1,562,544	18,012,353
期首剰余金又は期首欠損金（△）	135,155,108	388,720,676
剰余金増加額又は欠損金減少額	256,991,239	413,314,536
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	256,991,239	413,314,536
剰余金減少額又は欠損金増加額	26,878,311	47,596,821
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	26,878,311	47,596,821
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（△）	388,720,676	1,217,126,208

(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5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4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第5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4期 [2023年 1月25日現在]	第5期 [2024年 1月25日現在]
1.※1　期首元本額	600,662,763円	1,499,484,524円
期中追加設定元本額	1,013,766,234円	1,071,577,486円
期中一部解約元本額	114,944,473円	167,622,933円
2.※1　計算期間末日における受益権の総数	1,499,484,524口	2,403,439,077口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第5期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日
※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（17,980,966円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（5,471,674円）、投資信託約款に規定される収益調整金（349,565,723円）及び分配準備積立金（15,702,313円）より、分配対象額は388,720,676円（１万口当たり2,592.34円）でありますが、分配を行っておりません。	※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（44,918,665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（417,769,152円）、投資信託約款に規定される収益調整金（718,491,687円）及び分配準備積立金（35,946,704円）より、分配対象額は1,217,126,208円（１万口当たり5,064.08円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第5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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	第4期 [2023年 1月25日現在]	第5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4期（自 2022年1月26日　至 2023年1月25日）
売買目的有価証券

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	30,963,711円
合計	30,963,711円

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

第5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	462,816,623円
合計	462,816,623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4期 [2023年 1月25日現在]	第5期 [2024年 1月25日現在]
1口当たり純資産額　1.2592円 （1万口当たり純資産額　12,592円）	1口当たり純資産額　1.5064円 （1万口当たり純資産額　15,064円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
親投資信託受益証券	ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	481,270,679	1,122,275,096	
	ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド	183,626,027	355,040,923	
	ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド	198,135,559	1,102,644,199	
	ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド	850,660,190	1,040,357,412	
親投資信託受益証券　合計		1,713,692,455	3,620,317,630	
合計		1,713,692,455	3,620,317,630	

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 [2023年 1月25日現在]	第5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	964,916,821	1,959,657,817
未収入金	1,711,552	3,450,102
流動資産合計	966,628,373	1,963,107,919
資産合計	966,628,373	1,963,107,919
負債の部		
流動負債		
未払解約金	343,039	635,300
未払受託者報酬	89,989	185,006
未払委託者報酬	1,169,782	2,405,016
その他未払費用	44,895	92,420
流動負債合計	1,647,705	3,317,742
負債合計	1,647,705	3,317,742
純資産の部		
元本等		
元本	※1 758,957,721	※1 1,273,715,242
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	206,022,947	686,074,935
（分配準備積立金）	18,740,074	279,847,799
元本等合計	964,980,668	1,959,790,177
純資産合計	964,980,668	1,959,790,177
負債純資産合計	966,628,373	1,963,107,919

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第5期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	16,133,435	277,332,189
営業収益合計	16,133,435	277,332,189
営業費用		
受託者報酬	144,467	314,258
委託者報酬	1,877,960	4,085,170
その他費用	72,041	156,951
営業費用合計	2,094,468	4,556,379
営業利益又は営業損失（△）	14,038,967	272,775,810
経常利益又は経常損失（△）	14,038,967	272,775,810
当期純利益又は当期純損失（△）	14,038,967	272,775,810
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	1,051,269	10,019,607
期首剰余金又は期首欠損金（△）	69,387,846	206,022,947
剰余金増加額又は欠損金減少額	139,746,400	244,609,142
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	139,746,400	244,609,142
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,098,997	27,313,357
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,098,997	27,313,357
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（△）	206,022,947	686,074,935

(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5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4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第5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4期 [2023年 1月25日現在]	第5期 [2024年 1月25日現在]
1.※1　期首元本額	297,479,928円	758,957,721円
期中追加設定元本額	527,211,069円	607,240,829円
期中一部解約元本額	65,733,276円	92,483,308円
2.※1　計算期間末日における受益権の総数	758,957,721口	1,273,715,242口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第5期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日
※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（9,602,509円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（3,385,189円）、投資信託約款に規定される収益調整金（187,282,873円）及び分配準備積立金（5,752,376円）より、分配対象額は206,022,947円（１万口当たり2,714.52円）でありますが、分配を行っておりません。	※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（24,761,336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（237,994,867円）、投資信託約款に規定される収益調整金（406,227,136円）及び分配準備積立金（17,091,596円）より、分配対象額は686,074,935円（１万口当たり5,386.36円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第5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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	第4期 [2023年 1月25日現在]	第5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4期（自 2022年1月26日　至 2023年1月25日）
売買目的有価証券

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	16,875,262円
合計	16,875,262円

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

第5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	262,854,099円
合計	262,854,099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4期 [2023年 1月25日現在]	第5期 [2024年 1月25日現在]
1口当たり純資産額　1.2715円 （1万口当たり純資産額　12,715円）	1口当たり純資産額　1.5386円 （1万口当たり純資産額　15,386円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
親投資信託受益証券	ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	277,141,805	646,266,975	
	ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド	99,133,432	191,674,490	
	ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド	114,095,210	634,951,253	
	ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド	398,009,076	486,765,099	
親投資信託受益証券　合計		888,379,523	1,959,657,817	
合計		888,379,523	1,959,657,817	

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 [2023年 1月25日現在]	第5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	593,301,979	1,246,138,843
未収入金	856,206	4,815,315
流動資産合計	594,158,185	1,250,954,158
資産合計	594,158,185	1,250,954,158
負債の部		
流動負債		
未払解約金	23,859	3,046,112
未払受託者報酬	54,758	116,307
未払委託者報酬	711,814	1,511,944
その他未払費用	27,280	58,066
流動負債合計	817,711	4,732,429
負債合計	817,711	4,732,429
純資産の部		
元本等		
元本	※1 459,818,036	※1 793,499,038
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	133,522,438	452,722,691
（分配準備積立金）	13,102,298	177,295,732
元本等合計	593,340,474	1,246,221,729
純資産合計	593,340,474	1,246,221,729
負債純資産合計	594,158,185	1,250,954,158

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第5期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	11,482,548	179,877,235
営業収益合計	11,482,548	179,877,235
営業費用		
受託者報酬	88,695	196,306
委託者報酬	1,152,978	2,551,805
その他費用	44,151	97,972
営業費用合計	1,285,824	2,846,083
営業利益又は営業損失（△）	10,196,724	177,031,152
経常利益又は経常損失（△）	10,196,724	177,031,152
当期純利益又は当期純損失（△）	10,196,724	177,031,152
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（△）	977,744	10,990,090
期首剰余金又は期首欠損金（△）	46,423,532	133,522,438
剰余金増加額又は欠損金減少額	92,577,140	183,217,810
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	92,577,140	183,217,810
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,697,214	30,058,619
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	14,697,214	30,058,619
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（△）	133,522,438	452,722,691

(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5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4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第5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4期 [2023年 1月25日現在]	第5期 [2024年 1月25日現在]
1.※1　期首元本額	186,650,843円	459,818,036円
期中追加設定元本額	329,859,329円	427,962,253円
期中一部解約元本額	56,692,136円	94,281,251円
2.※1　計算期間末日における受益権の総数	459,818,036口	793,499,038口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第5期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日
※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（6,186,168円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（3,032,812円）、投資信託約款に規定される収益調整金（120,420,140円）及び分配準備積立金（3,883,318円）より、分配対象額は133,522,438円（１万口当たり2,903.77円）でありますが、分配を行っておりません。	※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（15,728,398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（150,312,664円）、投資信託約款に規定される収益調整金（275,426,959円）及び分配準備積立金（11,254,670円）より、分配対象額は452,722,691円（１万口当たり5,705.38円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第5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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	第4期 [2023年 1月25日現在]	第5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4期（自 2022年1月26日　至 2023年1月25日）
売買目的有価証券

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	11,609,304円
合計	11,609,304円

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

第5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	166,264,683円
合計	166,264,683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4期 [2023年 1月25日現在]	第5期 [2024年 1月25日現在]
1口当たり純資産額　1.2904円 （1万口当たり純資産額　12,904円）	1口当たり純資産額　1.5705円 （1万口当たり純資産額　15,705円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
親投資信託受益証券	ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	181,498,545	423,236,457	
	ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド	62,954,554	121,722,630	
	ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド	74,722,237	415,836,721	
	ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド	233,314,011	285,343,035	
親投資信託受益証券　合計		552,489,347	1,246,138,843	
合計		552,489,347	1,246,138,843	

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 [2023年 1月25日現在]	第5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	978,021,736	1,987,670,124
未収入金	2,024,175	16,845,305
流動資産合計	980,045,911	2,004,515,429
資産合計	980,045,911	2,004,515,429
負債の部		
流動負債		
未払解約金	635,301	13,990,263
未払受託者報酬	91,339	187,681
未払委託者報酬	1,187,337	2,439,774
その他未払費用	45,571	93,743
流動負債合計	1,959,548	16,711,461
負債合計	1,959,548	16,711,461
純資産の部		
元本等		
元本	※1 748,968,706	※1 1,236,364,324
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	229,117,657	751,439,644
（分配準備積立金）	23,609,226	284,064,666
元本等合計	978,086,363	1,987,803,968
純資産合計	978,086,363	1,987,803,968
負債純資産合計	980,045,911	2,004,515,429

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第5期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	25,459,223	306,173,084
営業収益合計	25,459,223	306,173,084
営業費用		
受託者報酬	154,126	318,031
委託者報酬	2,003,578	4,134,267
その他費用	76,878	158,829
営業費用合計	2,234,582	4,611,127
営業利益又は営業損失（△）	23,224,641	301,561,957
経常利益又は経常損失（△）	23,224,641	301,561,957
当期純利益又は当期純損失（△）	23,224,641	301,561,957
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（△）	3,572,724	34,917,015
期首剰余金又は期首欠損金（△）	95,073,109	229,117,657
剰余金増加額又は欠損金減少額	152,839,227	357,944,764
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	152,839,227	357,944,764
剰余金減少額又は欠損金増加額	38,446,596	102,267,719
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	38,446,596	102,267,719
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（△）	229,117,657	751,439,644

(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5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4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第5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4期 [2023年 1月25日現在]	第5期 [2024年 1月25日現在]
1.※1　期首元本額	368,582,874円	748,968,706円
期中追加設定元本額	524,519,145円	787,295,943円
期中一部解約元本額	144,133,313円	299,900,325円
2.※1　計算期間末日における受益権の総数	748,968,706口	1,236,364,324口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第5期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日
※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（11,421,806円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（7,685,676円）、投資信託約款に規定される収益調整金（205,508,431円）及び分配準備積立金（4,501,744円）より、分配対象額は229,117,657円（１万口当たり3,059.09円）でありますが、分配を行っておりません。	※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（26,442,050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（240,202,892円）、投資信託約款に規定される収益調整金（467,374,978円）及び分配準備積立金（17,419,724円）より、分配対象額は751,439,644円（１万口当たり6,077.78円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	第4期 自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	第5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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	第4期 [2023年 1月25日現在]	第5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4期（自 2022年1月26日　至 2023年1月25日）
売買目的有価証券

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	23,440,334円
合計	23,440,334円

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

第5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	267,524,767円
合計	267,524,767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4期 [2023年 1月25日現在]	第5期 [2024年 1月25日現在]
1口当たり純資産額　1.3059円 （1万口当たり純資産額　13,059円）	1口当たり純資産額　1.6078円 （1万口当たり純資産額　16,078円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
親投資信託受益証券	ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	306,236,025	714,111,786	
	ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド	100,152,462	193,644,785	
	ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド	126,076,990	701,631,057	
	ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド	309,307,029	378,282,496	
親投資信託受益証券　合計		841,772,506	1,987,670,124	
合計		841,772,506	1,987,670,124	

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（ご参考）

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

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

「ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

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

(2) 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

自 2022年 1月26日 至 2023年 1月25日	自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。	同左

（貸借対照表に関する注記）

区　分		[2023年 1月25日現在]	[2024年 1月25日現在]
1.※1	本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	23,726,938,838円	23,852,460,915円
	同期中における追加設定元本額	5,866,161,102円	9,252,139,772円
	同期中における一部解約元本額	5,740,639,025円	6,921,826,850円
	同期末における元本額	23,852,460,915円	26,182,773,837円
	元本の内訳＊		
	円資産バランスファンド2018－09＜適格機関投資家限定＞	36,060,550円	6,250,808円
	円資産バランスファンド2019－05＜適格機関投資家限定＞	131,700,571円	42,546,714円
	円資産バランスファンド2019－09＜適格機関投資家限定＞	97,231,433円	35,916,299円
	円資産バランスファンド2019－12＜適格機関投資家限定＞	133,598,486円	46,008,342円
	東京海上セレクション・日本株ＴＯＰＩＸ	16,706,542,164円	17,768,224,715円
	東京海上・円資産インデックスバランスファンド	7,844,364円	3,711,227円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	324,325,891円	481,270,679円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	176,536,831円	277,141,805円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	111,856,787円	181,498,545円

	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	195,274,138円	306,236,025円
	ＴＭＡ日本株式インデックスＶＡ＜適格機関投資家限定＞	777,803,719円	1,063,320,955円
	東京海上・世界インデックス・バランス40＜適格機関投資家限定＞	269,737,004円	304,257,874円
	東京海上・世界インデックス・バランス60＜適格機関投資家限定＞	1,771,350,438円	2,132,302,054円
	東京海上・ＴＯＰＩＸインデックスファンド＜適格機関投資家限定＞	2,895,680,866円	3,435,130,500円
	円資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞	82,378,826円	29,762,003円
	円資産インデックスバランス＜円奏会ベーシック＞（適格機関投資家専用）	134,538,847円	69,195,292円
	計	23,852,460,915円	26,182,773,837円
2.※1	本書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	23,852,460,915口	26,182,773,837口
3.※2	担保資産	代用有価証券として、担保に供している資産は次のとおりであります。 株式 860,160,000円	代用有価証券として、担保に供している資産は次のとおりであります。 株式 1,304,250,000円

（注1）＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額
（注2）3.については、決算日現在の代用有価証券の時価額を記載

（金融商品に関する注記）
Ⅰ．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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	[2023年 1月25日現在]	[2024年 1月25日現在]
1．　貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．　時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

（自 2022年1月26日　至 2023年1月25日）

売買目的有価証券

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

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

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

（自 2023年1月26日　至 2024年1月25日）

売買目的有価証券

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	12,674,224,413円
合計	12,674,224,413円

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

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2023年3月21日から2024年1月25日まで)を指しております。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

（2023年1月25日現在）

（単位：円）

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

（2024年1月25日現在）

（単位：円）

区　分	種　類	契約額等	うち1年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,506,389,400	—	3,745,140,000	238,750,600
	東証株価指数先物	3,506,389,400	—	3,745,140,000	238,750,600
合　計		3,506,389,400	—	3,745,140,000	238,750,600

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

（1口当たり情報に関する注記）

[2023年 1月25日現在]	[2024年 1月25日現在]
1口当たり純資産額　1.7784円 （1万口当たり純資産額　17,784円）	1口当たり純資産額　2.3319円 （1万口当たり純資産額　23,319円）

(3) 附属明細表
第1　有価証券明細表
(1)株式

（単位：円）

銘　柄	株式数	評価額		備　考
		単価	金額	
ニッスイ	20,900	792.30	16,559,070	
マルハニチロ	3,600	2,953.50	10,632,600	
サカタのタネ	2,700	3,715.00	10,030,500	
ホクト	2,700	1,778.00	4,800,600	
住石ホールディングス	2,500	1,828.00	4,570,000	
ＩＮＰＥＸ	82,100	1,989.00	163,296,900	
石油資源開発	2,900	6,010.00	17,429,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	3,000	2,283.00	6,849,000	
ショーボンドホールディングス	3,300	6,664.00	21,991,200	
ミライト・ワン	6,000	1,921.00	11,526,000	
ベステラ	3,000	1,071.00	3,213,000	
安藤・間	13,000	1,172.00	15,236,000	
東急建設	10,700	826.00	8,838,200	
コムシスホールディングス	6,300	3,228.00	20,336,400	
東建コーポレーション	900	9,300.00	8,370,000	
ヤマウラ	5,200	1,662.00	8,642,400	
オリエンタル白石	22,900	366.00	8,381,400	
大成建設	14,500	5,387.00	78,111,500	
大林組	52,700	1,353.00	71,303,100	
清水建設	42,400	1,011.50	42,887,600	

長谷工コーポレーション	13,900	1,906.00	26,493,400	
鹿島建設	33,300	2,645.00	88,078,500	
西松建設	3,400	4,054.00	13,783,600	
三井住友建設	21,900	404.00	8,847,600	
奥村組	3,300	5,040.00	16,632,000	
東鉄工業	3,100	3,025.00	9,377,500	
戸田建設	16,900	936.20	15,821,780	
熊谷組	3,900	3,715.00	14,488,500	
東亜道路工業	700	7,000.00	4,900,000	
東亜建設工業	2,800	3,805.00	10,654,000	
五洋建設	22,900	795.30	18,212,370	
住友林業	13,500	4,424.00	59,724,000	
日本基礎技術	3,200	498.00	1,593,600	
大和ハウス工業	41,900	4,512.00	189,052,800	
積水ハウス	46,400	3,385.00	157,064,000	
北陸電気工事	4,900	1,176.00	5,762,400	
中電工	2,400	2,684.00	6,441,600	
関電工	9,400	1,433.00	13,470,200	
きんでん	8,800	2,419.00	21,287,200	
日本電設工業	3,300	2,031.00	6,702,300	
エクシオグループ	6,800	3,247.00	22,079,600	
新日本空調	2,900	2,487.00	7,212,300	
九電工	3,300	5,041.00	16,635,300	
三機工業	4,300	1,836.00	7,894,800	
日揮ホールディングス	17,200	1,695.00	29,154,000	
中外炉工業	2,800	2,648.00	7,414,400	
ヤマト	3,900	981.00	3,825,900	
高砂熱学工業	5,400	3,340.00	18,036,000	
三晃金属工業	900	4,980.00	4,482,000	
大氣社	2,500	4,260.00	10,650,000	
ダイダン	1,200	1,672.00	2,006,400	
日比谷総合設備	3,600	2,587.00	9,313,200	
インフロニア・ホールディングス	16,400	1,568.50	25,723,400	
レイズネクスト	5,700	1,572.00	8,960,400	
ニップン	4,000	2,229.00	8,916,000	
日清製粉グループ本社	14,000	2,063.00	28,882,000	
鳥越製粉	3,700	692.00	2,560,400	
フィード・ワン	2,400	830.00	1,992,000	
日本甜菜製糖	1,500	2,164.00	3,246,000	
DM三井製糖ホールディングス	3,700	3,200.00	11,840,000	
森永製菓	6,800	2,757.00	18,747,600	
江崎グリコ	3,600	4,266.00	15,357,600	
井村屋グループ	2,700	2,427.00	6,552,900	
山崎製パン	11,100	3,658.00	40,603,800	
亀田製菓	1,900	4,150.00	7,885,000	
寿スピリッツ	8,500	1,982.50	16,851,250	
カルビー	7,800	3,022.00	23,571,600	
森永乳業	5,800	2,994.50	17,368,100	

ヤクルト本社	22,200	3,230.00	71,706,000	
明治ホールディングス	18,200	3,536.00	64,355,200	
雪印メグミルク	2,900	2,236.00	6,484,400	
プリマハム	2,400	2,388.00	5,731,200	
日本ハム	6,000	4,972.00	29,832,000	
丸大食品	2,600	1,632.00	4,243,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	2,400	3,315.00	7,956,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	2,100	4,105.00	8,620,500	
サッポロホールディングス	5,600	6,884.00	38,550,400	
アサヒグループホールディングス	36,200	5,474.00	198,158,800	
キリンホールディングス	65,500	2,088.50	136,796,750	
宝ホールディングス	7,800	1,224.50	9,551,100	
オエノンホールディングス	14,200	356.00	5,055,200	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	10,800	2,005.50	21,659,400	
サントリー食品インターナショナル	10,900	4,817.00	52,505,300	
ダイドーグループホールディングス	2,600	2,898.00	7,534,800	
伊藤園	5,600	4,304.00	24,102,400	
キーコーヒー	3,800	2,102.00	7,987,600	
ユニカフェ	3,400	907.00	3,083,800	
ジャパンフーズ	2,400	1,264.00	3,033,600	
日清オイリオグループ	2,000	4,420.00	8,840,000	
不二製油グループ本社	3,400	2,280.50	7,753,700	
Ｊ－オイルミルズ	4,400	2,029.00	8,927,600	
キッコーマン	10,400	9,115.00	94,796,000	
味の素	37,200	6,060.00	225,432,000	
キユーピー	8,300	2,606.50	21,633,950	
ハウス食品グループ本社	4,300	3,218.00	13,837,400	
カゴメ	6,500	3,165.00	20,572,500	
アリアケジャパン	1,800	4,540.00	8,172,000	
ニチレイ	7,300	3,544.00	25,871,200	
東洋水産	7,900	7,863.00	62,117,700	
日清食品ホールディングス	16,200	4,907.00	79,493,400	
フジッコ	3,600	1,953.00	7,030,800	
ロック・フィールド	4,300	1,607.00	6,910,100	
日本たばこ産業	94,300	3,811.00	359,377,300	
なとり	1,400	2,136.00	2,990,400	
ユーグレナ	14,400	688.00	9,907,200	
片倉工業	2,500	1,704.00	4,260,000	
グンゼ	1,400	5,250.00	7,350,000	
東洋紡	6,000	1,106.00	6,636,000	
倉敷紡績	3,000	3,055.00	9,165,000	
シキボウ	1,200	1,204.00	1,444,800	
日本毛織	6,400	1,465.00	9,376,000	
帝国繊維	2,400	2,245.00	5,388,000	
帝人	13,700	1,348.50	18,474,450	
東レ	103,100	724.60	74,706,260	
日本フエルト	4,500	436.00	1,962,000	

セーレン	4,200	2,484.00	10,432,800	
小松マテーレ	2,200	809.00	1,779,800	
ワコールホールディングス	3,600	3,392.00	12,211,200	
ホギメディカル	2,700	3,470.00	9,369,000	
ＴＳＩホールディングス	11,000	687.00	7,557,000	
三陽商会	600	2,636.00	1,581,600	
ゴールドウイン	2,800	9,908.00	27,742,400	
デサント	3,000	3,670.00	11,010,000	
特種東海製紙	1,600	3,925.00	6,280,000	
王子ホールディングス	57,900	577.10	33,414,090	
日本製紙	8,800	1,381.00	12,152,800	
三菱製紙	4,300	584.00	2,511,200	
北越コーポレーション	13,500	1,386.00	18,711,000	
大王製紙	7,000	1,129.00	7,903,000	
レンゴー	10,100	954.40	9,639,440	
ザ・パック	2,000	3,375.00	6,750,000	
クラレ	23,000	1,537.00	35,351,000	
旭化成	102,400	1,110.00	113,664,000	
共和レザー	3,600	773.00	2,782,800	
レゾナック・ホールディングス	14,800	3,017.00	44,651,600	
住友化学	114,500	341.10	39,055,950	
住友精化	400	5,310.00	2,124,000	
日産化学	7,700	5,883.00	45,299,100	
クレハ	3,900	2,895.00	11,290,500	
石原産業	5,100	1,556.00	7,935,600	
片倉コープアグリ	2,100	1,134.00	2,381,400	
日本曹達	2,500	5,810.00	14,525,000	
東ソー	20,900	1,875.00	39,187,500	
トクヤマ	6,300	2,494.50	15,715,350	
セントラル硝子	3,400	2,751.00	9,353,400	
東亞合成	7,700	1,362.00	10,487,400	
大阪ソーダ	1,900	9,860.00	18,734,000	
デンカ	5,600	2,572.50	14,406,000	
信越化学工業	143,800	5,867.00	843,674,600	
日本カーバイド工業	1,800	1,525.00	2,745,000	
堺化学工業	2,500	1,906.00	4,765,000	
エア・ウォーター	15,100	1,958.50	29,573,350	
日本酸素ホールディングス	15,500	3,739.00	57,954,500	
日本パーカライジング	7,600	1,177.00	8,945,200	
ステラ　ケミファ	2,400	3,285.00	7,884,000	
日本触媒	1,900	5,501.00	10,451,900	
カネカ	3,500	3,623.00	12,680,500	
三菱瓦斯化学	11,400	2,422.50	27,616,500	
三井化学	12,600	4,398.00	55,414,800	
ＪＳＲ	17,600	4,056.00	71,385,600	
東京応化工業	9,000	3,469.00	31,221,000	
三菱ケミカルグループ	114,300	901.00	102,984,300	
ＫＨネオケム	4,300	2,327.00	10,006,100	

ダイセル	24,200	1,456.00	35,235,200	
住友ベークライト	2,200	7,591.00	16,700,200	
積水化学工業	30,800	2,140.50	65,927,400	
日本ゼオン	10,000	1,312.50	13,125,000	
アイカ工業	3,100	3,374.00	10,459,400	
ＵＢＥ	6,900	2,421.50	16,708,350	
タキロンシーアイ	3,300	661.00	2,181,300	
旭有機材	2,600	4,050.00	10,530,000	
タイガースポリマー	4,400	920.00	4,048,000	
ミライアル	1,900	1,575.00	2,992,500	
日本化薬	8,600	1,325.00	11,395,000	
ＡＤＥＫＡ	5,200	2,936.00	15,267,200	
日油	4,800	6,775.00	32,520,000	
ハリマ化成グループ	4,800	872.00	4,185,600	
花王	35,700	5,799.00	207,024,300	
ニイタカ	1,500	1,884.00	2,826,000	
三洋化成工業	1,200	4,290.00	5,148,000	
日本ペイントホールディングス	85,000	1,182.50	100,512,500	
関西ペイント	15,900	2,516.00	40,004,400	
中国塗料	6,900	1,747.00	12,054,300	
太陽ホールディングス	4,000	3,190.00	12,760,000	
ＤＩＣ	5,300	2,842.50	15,065,250	
サカタインクス	6,700	1,423.00	9,534,100	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	3,400	2,761.00	9,387,400	
富士フイルムホールディングス	29,200	9,217.00	269,136,400	
資生堂	33,300	4,009.00	133,499,700	
ライオン	20,000	1,311.00	26,220,000	
高砂香料工業	2,100	3,555.00	7,465,500	
マンダム	4,100	1,281.00	5,252,100	
ミルボン	2,600	3,506.00	9,115,600	
ファンケル	7,100	2,312.00	16,415,200	
コーセー	3,300	9,581.00	31,617,300	
コタ	4,100	1,595.00	6,539,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,400	1,542.00	11,410,800	
ノエビアホールディングス	1,100	5,220.00	5,742,000	
エステー	3,400	1,537.00	5,225,800	
長谷川香料	3,000	3,235.00	9,705,000	
小林製薬	4,500	6,657.00	29,956,500	
荒川化学工業	4,500	1,058.00	4,761,000	
メック	2,700	4,435.00	11,974,500	
タカラバイオ	6,100	1,242.00	7,576,200	
ＪＣＵ	2,800	3,885.00	10,878,000	
デクセリアルズ	5,200	4,404.00	22,900,800	
アース製薬	1,400	4,465.00	6,251,000	
大成ラミック	1,800	3,005.00	5,409,000	
クミアイ化学工業	8,800	855.00	7,524,000	
日本農薬	8,900	684.00	6,087,600	
日東電工	10,900	11,350.00	123,715,000	

レック	6,400	1,054.00	6,745,600	
前澤化成工業	4,200	1,577.00	6,623,400	
エフピコ	2,600	2,875.50	7,476,300	
天馬	2,400	2,259.00	5,421,600	
信越ポリマー	5,100	1,757.00	8,960,700	
ニフコ	5,300	3,851.00	20,410,300	
バルカー	2,500	4,415.00	11,037,500	
ユニ・チャーム	32,800	5,058.00	165,902,400	
協和キリン	19,100	2,353.50	44,951,850	
武田薬品工業	140,500	4,340.00	609,770,000	
アステラス製薬	146,600	1,701.00	249,366,600	
住友ファーマ	11,900	459.00	5,462,100	
塩野義製薬	20,200	7,157.00	144,571,400	
日本新薬	4,400	5,268.00	23,179,200	
中外製薬	49,700	5,455.00	271,113,500	
科研製薬	1,800	3,497.00	6,294,600	
エーザイ	19,200	6,951.00	133,459,200	
ロート製薬	15,700	2,983.50	46,840,950	
小野薬品工業	34,100	2,620.00	89,342,000	
久光製薬	3,700	4,198.00	15,532,600	
持田製薬	2,000	3,310.00	6,620,000	
参天製薬	27,400	1,473.00	40,360,200	
ツムラ	3,900	2,683.50	10,465,650	
キッセイ薬品工業	2,300	3,200.00	7,360,000	
生化学工業	7,000	769.00	5,383,000	
栄研化学	4,500	1,755.00	7,897,500	
鳥居薬品	2,100	3,800.00	7,980,000	
ＪＣＲファーマ	7,600	1,121.00	8,519,600	
東和薬品	3,100	2,514.00	7,793,400	
ゼリア新薬工業	4,000	2,033.00	8,132,000	
第一三共	139,200	4,300.00	598,560,000	
杏林製薬	4,100	1,799.00	7,375,900	
大幸薬品	11,100	309.00	3,429,900	
大塚ホールディングス	32,700	5,757.00	188,253,900	
大正製薬ホールディングス	2,800	8,618.00	24,130,400	
ペプチドリーム	8,800	1,347.00	11,853,600	
あすか製薬ホールディングス	4,700	1,993.00	9,367,100	
サワイグループホールディングス	3,500	5,644.00	19,754,000	
ニチレキ	4,700	2,505.00	11,773,500	
出光興産	82,000	819.50	67,199,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	255,300	598.20	152,720,460	
コスモエネルギーホールディングス	6,600	6,140.00	40,524,000	
横浜ゴム	8,900	3,444.00	30,651,600	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	9,000	2,387.00	21,483,000	
ブリヂストン	46,000	6,282.00	288,972,000	
住友ゴム工業	13,600	1,647.50	22,406,000	
藤倉コンポジット	1,000	1,505.00	1,505,000	
オカモト	1,400	5,070.00	7,098,000	

ニッタ	2,100	3,800.00	7,980,000	
住友理工	2,900	1,170.00	3,393,000	
三ツ星ベルト	2,100	4,825.00	10,132,500	
バンドー化学	6,800	1,760.00	11,968,000	
日東紡績	2,700	4,940.00	13,338,000	
ＡＧＣ	15,100	5,425.00	81,917,500	
日本電気硝子	6,500	3,176.00	20,644,000	
住友大阪セメント	2,900	3,672.00	10,648,800	
太平洋セメント	9,600	2,973.50	28,545,600	
日本ヒューム	7,000	909.00	6,363,000	
東海カーボン	15,600	1,032.00	16,099,200	
日本カーボン	700	4,465.00	3,125,500	
東洋炭素	2,000	5,040.00	10,080,000	
ＴＯＴＯ	11,000	3,970.00	43,670,000	
日本碍子	17,600	1,809.00	31,838,400	
日本特殊陶業	12,700	3,936.00	49,987,200	
ＭＡＲＵＷＡ	700	29,590.00	20,713,000	
フジミインコーポレーテッド	5,100	3,055.00	15,580,500	
ニチアス	3,700	3,410.00	12,617,000	
ニチハ	2,000	2,971.00	5,942,000	
日本製鉄	74,000	3,479.00	257,446,000	
神戸製鋼所	33,300	1,973.50	65,717,550	
合同製鐵	800	4,940.00	3,952,000	
ＪＦＥホールディングス	46,000	2,295.00	105,570,000	
東京製鐵	7,200	1,757.00	12,650,400	
共英製鋼	3,500	2,097.00	7,339,500	
大和工業	3,200	8,066.00	25,811,200	
大阪製鐵	2,200	2,330.00	5,126,000	
淀川製鋼所	2,300	3,920.00	9,016,000	
丸一鋼管	4,600	3,804.00	17,498,400	
モリ工業	500	4,700.00	2,350,000	
大同特殊鋼	10,500	1,500.50	15,755,250	
山陽特殊製鋼	3,100	2,525.00	7,827,500	
愛知製鋼	1,200	3,420.00	4,104,000	
大平洋金属	3,400	1,274.00	4,331,600	
新日本電工	21,300	289.00	6,155,700	
三菱製鋼	4,100	1,594.00	6,535,400	
エンビプロ・ホールディングス	1,900	619.00	1,176,100	
シンニッタン	7,600	266.00	2,021,600	
日本軽金属ホールディングス	4,100	1,846.00	7,568,600	
三井金属鉱業	4,600	4,657.00	21,422,200	
三菱マテリアル	11,500	2,712.50	31,193,750	
住友金属鉱山	19,200	4,138.00	79,449,600	
ＤＯＷＡホールディングス	4,200	5,277.00	22,163,400	
古河機械金属	4,300	1,895.00	8,148,500	
ＵＡＣＪ	3,400	4,115.00	13,991,000	
古河電気工業	4,000	2,616.50	10,466,000	
住友電気工業	57,500	1,933.50	111,176,250	

フジクラ	20,000	1,195.00	23,900,000	
タツタ電線	9,800	695.00	6,811,000	
リョービ	4,500	2,672.00	12,024,000	
ＡＲＥホールディングス	7,700	2,020.00	15,554,000	
トーカロ	4,900	1,520.00	7,448,000	
ＳＵＭＣＯ	28,900	2,380.50	68,796,450	
東洋製罐グループホールディングス	8,000	2,355.00	18,840,000	
横河ブリッジホールディングス	4,000	2,782.00	11,128,000	
駒井ハルテック	1,100	2,117.00	2,328,700	
三和ホールディングス	15,900	2,309.50	36,721,050	
文化シヤッター	6,500	1,459.00	9,483,500	
三協立山	5,400	887.00	4,789,800	
ＬＩＸＩＬ	25,200	1,967.00	49,568,400	
ノーリツ	4,900	1,546.00	7,575,400	
長府製作所	1,300	2,068.00	2,688,400	
リンナイ	8,100	3,398.00	27,523,800	
日東精工	9,700	544.00	5,276,800	
東プレ	5,000	2,169.00	10,845,000	
高周波熱錬	7,300	1,057.00	7,716,100	
サンコール	2,600	475.00	1,235,000	
パイオラックス	4,600	2,529.00	11,633,400	
日本発條	13,000	1,218.00	15,834,000	
三益半導体工業	2,600	3,435.00	8,931,000	
日本製鋼所	4,500	2,431.50	10,941,750	
三浦工業	6,000	2,770.00	16,620,000	
タクマ	6,200	1,748.00	10,837,600	
オークマ	1,600	6,568.00	10,508,800	
芝浦機械	2,700	3,575.00	9,652,500	
アマダ	22,200	1,591.50	35,331,300	
アイダエンジニアリング	6,100	850.00	5,185,000	
ＦＵＪＩ	5,500	2,521.00	13,865,500	
牧野フライス製作所	2,100	6,050.00	12,705,000	
オーエスジー	6,000	2,063.00	12,378,000	
旭ダイヤモンド工業	10,000	882.00	8,820,000	
DMG森精機	10,000	2,952.50	29,525,000	
ディスコ	7,600	41,480.00	315,248,000	
日東工器	3,100	1,928.00	5,976,800	
冨士ダイス	1,900	695.00	1,320,500	
リケンＮＰＲ	1,400	2,709.00	3,792,600	
島精機製作所	3,200	1,525.00	4,880,000	
日阪製作所	5,300	974.00	5,162,200	
ナブテスコ	9,100	2,860.50	26,030,550	
ＳＭＣ	4,800	83,310.00	399,888,000	
ユニオンツール	1,300	3,425.00	4,452,500	
オイレス工業	4,400	2,128.00	9,363,200	
サトーホールディングス	4,100	2,215.00	9,081,500	
小松製作所	75,500	3,914.00	295,507,000	
住友重機械工業	8,700	3,793.00	32,999,100	

日立建機	6,800	4,096.00	27,852,800	
巴工業	2,400	3,705.00	8,892,000	
井関農機	3,900	1,143.00	4,457,700	
ＴＯＷＡ	1,700	8,110.00	13,787,000	
ローツェ	1,200	16,710.00	20,052,000	
タカキタ	8,100	486.00	3,936,600	
クボタ	84,500	2,220.00	187,590,000	
月島ホールディングス	4,900	1,364.00	6,683,600	
帝国電機製作所	2,900	3,145.00	9,120,500	
新東工業	3,800	1,116.00	4,240,800	
小森コーポレーション	6,500	1,369.00	8,898,500	
鶴見製作所	3,200	3,685.00	11,792,000	
酒井重工業	300	6,970.00	2,091,000	
荏原製作所	6,400	9,484.00	60,697,600	
酉島製作所	4,500	2,465.00	11,092,500	
ダイキン工業	19,200	24,000.00	460,800,000	
オルガノ	1,500	6,290.00	9,435,000	
栗田工業	9,300	5,520.00	51,336,000	
椿本チエイン	2,200	4,210.00	9,262,000	
ダイフク	27,100	2,973.00	80,568,300	
タダノ	10,200	1,175.50	11,990,100	
フジテック	5,200	3,708.00	19,281,600	
ＣＫＤ	5,200	2,691.00	13,993,200	
平和	3,900	2,193.00	8,552,700	
ＳＡＮＫＹＯ	3,700	9,280.00	34,336,000	
日本金銭機械	5,900	1,588.00	9,369,200	
フクシマガリレイ	1,800	5,190.00	9,342,000	
竹内製作所	3,800	4,645.00	17,651,000	
アマノ	3,800	3,420.00	12,996,000	
グローリー	4,200	3,050.00	12,810,000	
大和冷機工業	5,900	1,597.00	9,422,300	
セガサミーホールディングス	13,600	2,160.00	29,376,000	
ホシザキ	9,400	5,340.00	50,196,000	
大豊工業	6,500	839.00	5,453,500	
日本精工	23,800	796.60	18,959,080	
ＮＴＮ	40,100	268.00	10,746,800	
ジェイテクト	11,100	1,310.50	14,546,550	
不二越	1,800	3,475.00	6,255,000	
日本トムソン	6,500	592.00	3,848,000	
ＴＨＫ	8,900	2,888.50	25,707,650	
ユーシン精機	5,600	672.00	3,763,200	
キッツ	7,800	1,216.00	9,484,800	
マキタ	19,100	3,982.00	76,056,200	
日立造船	17,000	920.00	15,640,000	
三菱重工業	28,100	9,618.00	270,265,800	
ＩＨＩ	12,500	2,803.00	35,037,500	
スター精密	4,800	1,801.00	8,644,800	
日清紡ホールディングス	9,100	1,209.50	11,006,450	

イビデン	9,300	7,886.00	73,339,800	
コニカミノルタ	32,800	411.50	13,497,200	
ブラザー工業	20,500	2,513.50	51,526,750	
ミネベアミツミ	26,700	3,050.00	81,435,000	
日立製作所	78,000	11,385.00	888,030,000	
三菱電機	176,800	2,153.00	380,650,400	
富士電機	9,700	7,419.00	71,964,300	
安川電機	18,600	5,797.00	107,824,200	
明電舎	4,000	2,677.00	10,708,000	
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	3,500	3,915.00	13,702,500	
ソシオネクスト	11,500	3,433.00	39,479,500	
東芝テック	2,000	3,025.00	6,050,000	
マブチモーター	6,600	2,507.50	16,549,500	
ニデック	38,500	5,712.00	219,912,000	
東光高岳	3,200	2,151.00	6,883,200	
ダイヘン	2,200	6,990.00	15,378,000	
ＪＶＣケンウッド	13,000	769.00	9,997,000	
オムロン	13,900	6,798.00	94,492,200	
日東工業	3,500	3,970.00	13,895,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	5,300	2,093.50	11,095,550	
メルコホールディングス	1,500	3,335.00	5,002,500	
テクノメディカ	3,000	1,991.00	5,973,000	
日本電気	21,700	9,380.00	203,546,000	
富士通	15,500	20,935.00	324,492,500	
沖電気工業	5,400	1,029.00	5,556,600	
サンケン電気	1,700	7,211.00	12,258,700	
アイホン	2,800	2,951.00	8,262,800	
ルネサスエレクトロニクス	105,000	2,689.50	282,397,500	
セイコーエプソン	19,200	2,204.00	42,316,800	
ワコム	15,200	676.00	10,275,200	
アルバック	3,800	7,516.00	28,560,800	
アクセル	700	2,261.00	1,582,700	
ＥＩＺＯ	2,000	5,170.00	10,340,000	
日本信号	5,300	939.00	4,976,700	
能美防災	2,700	2,260.00	6,102,000	
ホーチキ	3,900	1,984.00	7,737,600	
エレコム	6,200	1,768.00	10,961,600	
パナソニック　ホールディングス	188,500	1,373.50	258,904,750	
シャープ	26,100	1,033.50	26,974,350	
アンリツ	11,200	1,365.00	15,288,000	
富士通ゼネラル	4,700	2,212.00	10,396,400	
ソニーグループ	112,400	14,355.00	1,613,502,000	
ＴＤＫ	25,200	7,366.00	185,623,200	
アルプスアルパイン	12,500	1,273.50	15,918,750	
日本トリム	1,700	3,125.00	5,312,500	
ローランド　ディー．ジー．	500	3,830.00	1,915,000	
フォスター電機	5,000	1,119.00	5,595,000	
ヨコオ	2,800	1,484.00	4,155,200	

ホシデン	5,900	1,773.00	10,460,700	
ヒロセ電機	2,300	17,645.00	40,583,500	
日本航空電子工業	3,900	3,110.00	12,129,000	
アイコム	2,200	3,670.00	8,074,000	
横河電機	17,300	2,963.50	51,268,550	
アズビル	10,400	4,857.00	50,512,800	
日本光電工業	6,900	4,534.00	31,284,600	
堀場製作所	3,300	12,185.00	40,210,500	
アドバンテスト	47,100	6,049.00	284,907,900	
キーエンス	15,900	65,950.00	1,048,605,000	
日置電機	1,200	6,350.00	7,620,000	
シスメックス	13,800	7,966.00	109,930,800	
日本マイクロニクス	2,900	4,370.00	12,673,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	1,900	4,070.00	7,733,000	
コーセル	6,600	1,499.00	9,893,400	
イリソ電子工業	1,900	3,495.00	6,640,500	
オプテックスグループ	4,500	1,806.00	8,127,000	
千代田インテグレ	2,400	2,812.00	6,748,800	
レーザーテック	7,300	41,530.00	303,169,000	
スタンレー電気	10,600	2,815.50	29,844,300	
ウシオ電機	7,800	2,130.00	16,614,000	
日本セラミック	3,100	2,697.00	8,360,700	
図研	2,500	4,065.00	10,162,500	
日本電子	4,300	7,322.00	31,484,600	
カシオ計算機	12,300	1,281.00	15,756,300	
ファナック	76,600	4,316.00	330,605,600	
ローム	28,200	2,678.50	75,533,700	
浜松ホトニクス	12,000	6,017.00	72,204,000	
三井ハイテック	1,900	7,020.00	13,338,000	
新光電気工業	5,800	5,553.00	32,207,400	
京セラ	96,000	2,217.50	212,880,000	
太陽誘電	7,900	3,695.00	29,190,500	
村田製作所	142,500	3,061.00	436,192,500	
双葉電子工業	3,500	533.00	1,865,500	
ニチコン	6,300	1,298.00	8,177,400	
日本ケミコン	3,900	1,386.00	5,405,400	
ＫＯＡ	4,700	1,578.00	7,416,600	
小糸製作所	17,900	2,282.50	40,856,750	
ミツバ	8,200	1,105.00	9,061,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	5,800	14,820.00	85,956,000	
キヤノン電子	3,600	2,027.00	7,297,200	
キヤノン	78,200	3,769.00	294,735,800	
リコー	37,400	1,174.00	43,907,600	
象印マホービン	4,700	1,483.00	6,970,100	
東京エレクトロン	33,500	28,655.00	959,942,500	
イノテック	2,900	1,860.00	5,394,000	
トヨタ紡織	5,900	2,447.50	14,440,250	
ユニプレス	7,300	1,030.00	7,519,000	

豊田自動織機	13,300	12,770.00	169,841,000	
モリタホールディングス	6,100	1,564.00	9,540,400	
デンソー	129,400	2,323.50	300,660,900	
東海理化電機製作所	4,800	2,306.00	11,068,800	
川崎重工業	12,900	3,263.00	42,092,700	
日産自動車	223,400	575.80	128,633,720	
いすゞ自動車	46,400	2,063.50	95,746,400	
トヨタ自動車	872,600	2,964.00	2,586,386,400	300,000株
日野自動車	24,200	499.60	12,090,320	
三菱自動車工業	65,400	461.20	30,162,480	
武蔵精密工業	6,100	1,689.00	10,302,900	
日産車体	4,900	993.00	4,865,700	
新明和工業	7,400	1,234.00	9,131,600	
極東開発工業	4,300	2,005.00	8,621,500	
トピー工業	3,300	2,858.00	9,431,400	
ティラド	2,000	3,635.00	7,270,000	
ＮＯＫ	5,600	1,948.00	10,908,800	
フタバ産業	7,200	903.00	6,501,600	
カヤバ	2,600	5,130.00	13,338,000	
プレス工業	16,500	643.00	10,609,500	
アイシン	11,700	5,475.00	64,057,500	
マツダ	52,600	1,721.50	90,550,900	
今仙電機製作所	3,600	634.00	2,282,400	
本田技研工業	384,200	1,593.50	612,222,700	
スズキ	29,300	6,403.00	187,607,900	
ＳＵＢＡＲＵ	50,100	2,910.50	145,816,050	
ヤマハ発動機	70,800	1,421.50	100,642,200	
エクセディ	3,800	2,815.00	10,697,000	
豊田合成	4,600	2,840.00	13,064,000	
愛三工業	7,300	1,375.00	10,037,500	
ヨロズ	4,400	919.00	4,043,600	
エフ・シー・シー	4,900	1,928.00	9,447,200	
シマノ	6,400	21,695.00	138,848,000	
テイ・エス　テック	6,600	1,845.50	12,180,300	
テルモ	47,600	4,998.00	237,904,800	
クリエートメディック	2,500	899.00	2,247,500	
島津製作所	20,200	4,128.00	83,385,600	
ブイ・テクノロジー	2,700	2,866.00	7,738,200	
東京計器	1,300	1,879.00	2,442,700	
東京精密	3,600	10,150.00	36,540,000	
マニー	6,000	2,082.50	12,495,000	
ニコン	23,000	1,503.00	34,569,000	
トプコン	9,100	1,625.50	14,792,050	
オリンパス	99,100	2,196.50	217,673,150	
理研計器	1,500	7,460.00	11,190,000	
タムロン	2,500	5,640.00	14,100,000	
ＨＯＹＡ	31,800	18,740.00	595,932,000	
朝日インテック	17,300	2,942.00	50,896,600	

シチズン時計	20,800	928.00	19,302,400	
メニコン	6,100	2,260.50	13,789,050	
セイコーグループ	3,700	2,628.00	9,723,600	
ニプロ	12,200	1,198.00	14,615,600	
パラマウントベッドホールディングス	4,000	2,706.00	10,824,000	
バンダイナムコホールディングス	42,900	3,111.00	133,461,900	
アイフィスジャパン	2,700	608.00	1,641,600	
パイロットコーポレーション	2,200	4,137.00	9,101,400	
フジシールインターナショナル	3,400	1,769.00	6,014,600	
タカラトミー	7,500	2,508.50	18,813,750	
広済堂ホールディングス	3,500	821.00	2,873,500	
タカノ	2,500	1,033.00	2,582,500	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	18,800	4,151.00	78,038,800	
大日本印刷	17,100	4,243.00	72,555,300	
ＮＩＳＳＨＡ	5,000	1,612.00	8,060,000	
アシックス	14,300	4,494.00	64,264,200	
小松ウオール工業	2,300	3,180.00	7,314,000	
ヤマハ	10,100	3,300.00	33,330,000	
クリナップ	8,700	736.00	6,403,200	
ピジョン	10,400	1,621.00	16,858,400	
キングジム	6,700	875.00	5,862,500	
リンテック	2,900	2,813.00	8,157,700	
イトーキ	9,700	1,506.00	14,608,200	
任天堂	99,500	7,972.00	793,214,000	
三菱鉛筆	4,200	2,065.00	8,673,000	
タカラスタンダード	3,800	1,754.00	6,665,200	
コクヨ	5,200	2,396.50	12,461,800	
オカムラ	6,500	2,259.00	14,683,500	
美津濃	2,500	4,380.00	10,950,000	
東京電力ホールディングス	143,400	787.40	112,913,160	
中部電力	56,400	1,882.50	106,173,000	
関西電力	61,500	1,959.50	120,509,250	
中国電力	27,300	1,035.50	28,269,150	
北陸電力	15,800	721.80	11,404,440	
東北電力	41,900	986.40	41,330,160	
四国電力	14,000	1,064.50	14,903,000	
九州電力	36,500	1,087.50	39,693,750	
北海道電力	21,800	657.50	14,333,500	
沖縄電力	7,000	1,161.00	8,127,000	
電源開発	12,000	2,435.00	29,220,000	
レノバ	5,700	1,192.00	6,794,400	
東京瓦斯	33,300	3,297.00	109,790,100	
大阪瓦斯	31,500	3,039.00	95,728,500	
東邦瓦斯	6,500	2,991.00	19,441,500	
北海道瓦斯	3,600	2,284.00	8,222,400	
西部ガスホールディングス	2,300	1,935.00	4,450,500	
静岡ガス	5,700	1,012.00	5,768,400	
東武鉄道	16,900	3,950.00	66,755,000	

相鉄ホールディングス	5,200	2,771.00	14,409,200	
東急	43,100	1,734.50	74,756,950	
京浜急行電鉄	21,500	1,293.50	27,810,250	
小田急電鉄	26,300	2,273.50	59,793,050	
京王電鉄	8,200	4,364.00	35,784,800	
京成電鉄	10,200	6,778.00	69,135,600	
富士急行	2,700	4,485.00	12,109,500	
東日本旅客鉄道	29,200	8,426.00	246,039,200	
西日本旅客鉄道	20,000	6,081.00	121,620,000	
東海旅客鉄道	61,600	3,644.00	224,470,400	
西武ホールディングス	20,700	2,075.00	42,952,500	
西日本鉄道	3,700	2,480.50	9,177,850	
ハマキョウレックス	1,400	4,150.00	5,810,000	
近鉄グループホールディングス	15,900	4,594.00	73,044,600	
阪急阪神ホールディングス	20,600	4,514.00	92,988,400	
南海電気鉄道	7,200	2,848.00	20,505,600	
京阪ホールディングス	8,800	3,635.00	31,988,000	
名古屋鉄道	15,700	2,263.50	35,536,950	
ヤマトホールディングス	20,500	2,589.00	53,074,500	
山九	4,300	5,183.00	22,286,900	
センコーグループホールディングス	10,000	1,146.00	11,460,000	
トナミホールディングス	600	4,795.00	2,877,000	
ニッコンホールディングス	4,700	3,118.00	14,654,600	
福山通運	2,400	4,125.00	9,900,000	
セイノーホールディングス	9,900	2,149.00	21,275,100	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	3,600	1,726.00	6,213,600	
九州旅客鉄道	10,300	3,198.00	32,939,400	
ＳＧホールディングス	29,000	1,985.50	57,579,500	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	5,500	8,686.00	47,773,000	
日本郵船	46,000	5,108.00	234,968,000	
商船三井	35,200	5,232.00	184,166,400	
川崎汽船	13,600	7,254.00	98,654,400	
飯野海運	8,900	1,291.00	11,489,900	
日本航空	38,500	2,838.50	109,282,250	
ＡＮＡホールディングス	43,400	3,191.00	138,489,400	
三菱倉庫	3,500	4,534.00	15,869,000	
三井倉庫ホールディングス	2,500	5,000.00	12,500,000	
住友倉庫	5,100	2,642.00	13,474,200	
東陽倉庫	1,600	1,546.00	2,473,600	
安田倉庫	5,300	1,223.00	6,481,900	
上組	7,600	3,427.00	26,045,200	
キムラユニティー	3,500	1,476.00	5,166,000	
キユーソー流通システム	3,600	944.00	3,398,400	
エーアイテイー	3,900	1,801.00	7,023,900	
ＮＥＣネッツエスアイ	6,600	2,263.00	14,935,800	
システナ	33,700	306.00	10,312,200	
デジタルアーツ	1,700	5,140.00	8,738,000	

日鉄ソリューションズ	2,300	4,910.00	11,293,000	
ＴＩＳ	17,000	3,317.00	56,389,000	
テクミラホールディングス	7,500	432.00	3,240,000	
グリー	11,500	589.00	6,773,500	
コーエーテクモホールディングス	10,300	1,809.50	18,637,850	
三菱総合研究所	300	4,855.00	1,456,500	
ブレインパッド	6,200	1,232.00	7,638,400	
ＫＬａｂ	11,700	286.00	3,346,200	
ポールトゥウィンホールディングス	5,200	542.00	2,818,400	
ネクソン	38,300	2,420.00	92,686,000	
エイチーム	6,700	587.00	3,932,900	
コロプラ	9,800	620.00	6,076,000	
サイバーリンクス	3,500	810.00	2,835,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	2,900	1,510.00	4,379,000	
ＳＨＩＦＴ	1,200	26,740.00	32,088,000	
ティーガイア	3,100	1,994.00	6,181,400	
セック	300	5,350.00	1,605,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,400	2,472.50	10,879,000	
GMOペイメントゲートウェイ	3,500	8,796.00	30,786,000	
ザッパラス	6,600	444.00	2,930,400	
インターネットイニシアティブ	9,900	3,058.00	30,274,200	
ラクス	9,000	2,434.00	21,906,000	
チェンジホールディングス	5,600	1,416.00	7,929,600	
マネーフォワード	4,300	5,498.00	23,641,400	
電算システムホールディングス	2,500	2,958.00	7,395,000	
Ａｐｐｉｅｒ　Ｇｒｏｕｐ	5,500	1,813.00	9,971,500	
フェイス	2,500	481.00	1,202,500	
野村総合研究所	34,900	4,359.00	152,129,100	
ＣＥホールディングス	6,000	638.00	3,828,000	
日本システム技術	600	3,430.00	2,058,000	
インテージホールディングス	4,700	1,701.00	7,994,700	
東邦システムサイエンス	1,000	1,320.00	1,320,000	
ラクスル	6,800	1,212.00	8,241,600	
メルカリ	10,400	2,453.50	25,516,400	
ウイングアーク１ｓｔ	1,600	2,831.00	4,529,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,500	1,200.00	3,000,000	
Ｓａｎｓａｎ	7,600	1,385.00	10,526,000	
ＪＭＤＣ	3,000	4,084.00	12,252,000	
フジ・メディア・ホールディングス	12,200	1,750.50	21,356,100	
オービック	5,100	23,180.00	118,218,000	
ジャストシステム	3,400	3,260.00	11,084,000	
ＬＩＮＥヤフー	224,500	472.20	106,008,900	
トレンドマイクロ	7,600	8,250.00	62,700,000	
日本オラクル	3,000	12,030.00	36,090,000	
フューチャー	5,600	1,787.00	10,007,200	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,900	1,778.00	6,934,200	

ＳＢテクノロジー	2,800	2,491.00	6,974,800	
オービックビジネスコンサルタント	3,200	6,933.00	22,185,600	
大塚商会	8,600	6,161.00	52,984,600	
サイボウズ	4,000	2,165.00	8,660,000	
電通総研	2,600	5,810.00	15,106,000	
デジタルガレージ	3,200	3,545.00	11,344,000	
ウェザーニューズ	1,100	5,450.00	5,995,000	
ビジネスエンジニアリング	300	4,655.00	1,396,500	
日本エンタープライズ	22,700	126.00	2,860,200	
ネットワンシステムズ	6,600	2,390.00	15,774,000	
アルゴグラフィックス	2,600	3,900.00	10,140,000	
エイベックス	5,300	1,410.00	7,473,000	
ＢＩＰＲＯＧＹ	5,900	4,325.00	25,517,500	
都築電気	800	2,206.00	1,764,800	
ＴＢＳホールディングス	7,000	3,584.00	25,088,000	
日本テレビホールディングス	10,700	1,739.00	18,607,300	
テレビ朝日ホールディングス	5,100	1,775.00	9,052,500	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	17,600	767.00	13,499,200	
テレビ東京ホールディングス	2,500	3,140.00	7,850,000	
ＵＳＥＮ−ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	1,800	4,400.00	7,920,000	
日本電信電話	4,773,600	186.30	889,321,680	
ＫＤＤＩ	122,700	4,903.00	601,598,100	
ソフトバンク	254,000	1,966.00	499,364,000	
光通信	1,800	25,795.00	46,431,000	
GMOインターネットグループ	7,000	2,678.50	18,749,500	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	8,800	3,156.00	27,772,800	
ゼンリン	6,600	877.00	5,788,200	
松竹	1,100	9,616.00	10,577,600	
東宝	9,500	4,782.00	45,429,000	
東映	600	20,600.00	12,360,000	
ＮＴＴデータグループ	49,600	2,129.50	105,623,200	
ビジネスブレイン太田昭和	2,900	2,237.00	6,487,300	
ＤＴＳ	3,200	3,620.00	11,584,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,900	5,807.00	45,875,300	
カプコン	15,200	5,573.00	84,709,600	
ＳＣＳＫ	12,300	2,895.00	35,608,500	
ＮＳＷ	700	2,910.00	2,037,000	
アイネス	4,000	1,614.00	6,456,000	
ＴＫＣ	2,100	3,820.00	8,022,000	
富士ソフト	3,800	6,450.00	24,510,000	
ＮＳＤ	5,500	2,778.00	15,279,000	
コナミグループ	6,400	8,853.00	56,659,200	
福井コンピュータホールディングス	700	2,629.00	1,840,300	
ＪＢＣＣホールディングス	700	4,230.00	2,961,000	
ソフトバンクグループ	78,900	6,667.00	526,026,300	
高千穂交易	300	4,215.00	1,264,500	
伊藤忠食品	800	7,500.00	6,000,000	

エレマテック	4,300	1,879.00	8,079,700	
東京エレクトロン　デバイス	600	6,290.00	3,774,000	
双日	19,800	3,469.00	68,686,200	
アルフレッサ　ホールディングス	14,800	2,416.00	35,756,800	
横浜冷凍	7,900	1,101.00	8,697,900	
ラサ商事	2,000	1,649.00	3,298,000	
アルコニックス	2,900	1,395.00	4,045,500	
神戸物産	12,700	3,860.00	49,022,000	
あい　ホールディングス	3,400	2,519.00	8,564,600	
ダイワボウホールディングス	5,900	3,239.00	19,110,100	
マクニカホールディングス	4,300	8,347.00	35,892,100	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,400	1,144.00	3,889,600	
レスターホールディングス	3,100	3,105.00	9,625,500	
ＯＣＨＩホールディングス	2,100	1,569.00	3,294,900	
ＴＯＫＡＩホールディングス	7,900	984.00	7,773,600	
シップヘルスケアホールディングス	5,400	2,316.00	12,506,400	
明治電機工業	2,900	1,448.00	4,199,200	
コメダホールディングス	5,600	2,782.00	15,579,200	
佐鳥電機	600	2,461.00	1,476,600	
エコートレーディング	3,700	1,202.00	4,447,400	
伯東	600	6,120.00	3,672,000	
ナガイレーベン	2,600	2,396.00	6,229,600	
三菱食品	1,900	5,030.00	9,557,000	
松田産業	2,400	2,705.00	6,492,000	
第一興商	6,600	2,068.00	13,648,800	
メディパルホールディングス	15,300	2,295.00	35,113,500	
アズワン	2,400	5,558.00	13,339,200	
尾家産業	2,000	1,793.00	3,586,000	
ドウシシャ	3,200	2,224.00	7,116,800	
リックス	400	3,730.00	1,492,000	
橋本総業ホールディングス	4,300	1,303.00	5,602,900	
日本ライフライン	6,700	1,311.00	8,783,700	
進和	2,900	2,434.00	7,058,600	
オーハシテクニカ	3,900	1,765.00	6,883,500	
白銅	2,400	2,480.00	5,952,000	
伊藤忠商事	113,400	6,667.00	756,037,800	
丸紅	140,000	2,491.50	348,810,000	
長瀬産業	5,900	2,387.00	14,083,300	
豊田通商	14,800	9,653.00	142,864,400	
兼松	6,700	2,264.00	15,168,800	
三井物産	127,200	5,928.00	754,041,600	
日本紙パルプ商事	1,100	5,090.00	5,599,000	
山善	6,400	1,289.00	8,249,600	
住友商事	102,300	3,348.00	342,500,400	
内田洋行	1,200	7,640.00	9,168,000	
三菱商事	334,200	2,524.00	843,520,800	
キヤノンマーケティングジャパン	3,400	4,386.00	14,912,400	
西華産業	3,000	3,085.00	9,255,000	

菱洋エレクトロ	2,700	3,995.00	10,786,500	
東京産業	5,000	751.00	3,755,000	
阪和興業	3,200	5,350.00	17,120,000	
岩谷産業	3,900	6,596.00	25,724,400	
アステナホールディングス	12,300	483.00	5,940,900	
三愛オブリ	4,600	1,680.00	7,728,000	
稲畑産業	3,900	3,160.00	12,324,000	
ワキタ	6,500	1,560.00	10,140,000	
東邦ホールディングス	3,500	3,210.00	11,235,000	
サンゲツ	4,000	3,280.00	13,120,000	
シナネンホールディングス	1,000	4,065.00	4,065,000	
伊藤忠エネクス	5,800	1,583.00	9,181,400	
サンリオ	5,000	6,178.00	30,890,000	
リョーサン	2,900	5,190.00	15,051,000	
三信電気	2,700	2,453.00	6,623,100	
モスフードサービス	2,800	3,400.00	9,520,000	
加賀電子	2,300	6,820.00	15,686,000	
ソーダニッカ	1,900	1,233.00	2,342,700	
立花エレテック	2,600	3,160.00	8,216,000	
フォーバル	4,700	1,464.00	6,880,800	
ＰＡＬＴＡＣ	2,100	4,580.00	9,618,000	
トラスコ中山	4,400	2,479.00	10,907,600	
オートバックスセブン	5,000	1,591.00	7,955,000	
加藤産業	2,000	4,745.00	9,490,000	
杉本商事	2,500	2,263.00	5,657,500	
因幡電機産業	3,000	3,535.00	10,605,000	
ミスミグループ本社	24,800	2,466.50	61,169,200	
スズケン	6,000	4,613.00	27,678,000	
ジェコス	5,200	1,106.00	5,751,200	
グローセル	2,800	674.00	1,887,200	
ローソン	4,200	8,266.00	34,717,200	
サンエー	1,600	4,570.00	7,312,000	
エービーシー・マート	6,000	2,582.00	15,492,000	
ハードオフコーポレーション	4,300	1,814.00	7,800,200	
アスクル	4,200	2,109.00	8,857,800	
ゲオホールディングス	4,300	2,297.00	9,877,100	
アダストリア	2,900	3,265.00	9,468,500	
ジーフット	8,100	295.00	2,389,500	
エディオン	5,900	1,611.00	9,504,900	
あみやき亭	1,800	4,160.00	7,488,000	
ハニーズホールディングス	3,800	1,638.00	6,224,400	
ジンズホールディングス	2,000	4,120.00	8,240,000	
ビックカメラ	8,600	1,379.00	11,859,400	
ＤＣＭホールディングス	7,100	1,355.00	9,620,500	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	24,300	1,444.00	35,089,200	
Ｊ．フロント　リテイリング	20,700	1,376.50	28,493,550	
ドトール・日レスホールディングス	4,600	2,170.00	9,982,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	30,200	2,699.00	81,509,800	

ブロンコビリー	600	3,435.00	2,061,000	
ＺＯＺＯ	10,900	3,300.00	35,970,000	
トレジャー・ファクトリー	3,400	1,213.00	4,124,200	
物語コーポレーション	2,700	5,140.00	13,878,000	
三越伊勢丹ホールディングス	28,100	1,713.00	48,135,300	
ウエルシアホールディングス	9,000	2,358.00	21,222,000	
クリエイトＳＤホールディングス	2,500	3,165.00	7,912,500	
シュッピン	4,400	1,052.00	4,628,800	
オイシックス・ラ・大地	3,400	1,388.00	4,719,200	
ジョイフル本田	4,600	1,947.00	8,956,200	
すかいらーくホールディングス	20,800	2,380.00	49,504,000	
ヨシックスホールディングス	500	2,975.00	1,487,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,500	1,019.00	5,604,500	
あさひ	3,500	1,294.00	4,529,000	
コスモス薬品	1,700	15,490.00	26,333,000	
トーエル	2,400	804.00	1,929,600	
セブン&アイ・ホールディングス	57,900	5,785.00	334,951,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	12,600	1,099.00	13,847,400	
ツルハホールディングス	3,600	12,635.00	45,486,000	
サンマルクホールディングス	2,900	2,217.00	6,429,300	
トリドールホールディングス	5,200	4,446.00	23,119,200	
クスリのアオキホールディングス	4,500	3,225.00	14,512,500	
力の源ホールディングス	800	1,428.00	1,142,400	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	10,000	3,008.00	30,080,000	
ノジマ	5,000	1,902.00	9,510,000	
カッパ・クリエイト	5,700	1,736.00	9,895,200	
ライトオン	3,200	415.00	1,328,000	
良品計画	18,100	2,328.00	42,136,800	
パリミキホールディングス	3,400	522.00	1,774,800	
アドヴァングループ	5,300	1,064.00	5,639,200	
Ｇ－７ホールディングス	4,300	1,254.00	5,392,200	
コーナン商事	2,500	3,900.00	9,750,000	
エコス	2,900	2,459.00	7,131,100	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	34,300	3,230.00	110,789,000	
西松屋チェーン	5,700	2,130.00	12,141,000	
ゼンショーホールディングス	9,300	7,190.00	66,867,000	
サイゼリヤ	3,000	5,090.00	15,270,000	
魚力	2,500	2,317.00	5,792,500	
ユナイテッドアローズ	3,100	1,942.00	6,020,200	
ハイデイ日高	3,100	2,873.00	8,906,300	
コロワイド	7,000	2,309.50	16,166,500	
壱番屋	1,200	6,160.00	7,392,000	
スギホールディングス	3,200	6,757.00	21,622,400	
薬王堂ホールディングス	2,700	2,555.00	6,898,500	
スクロール	5,400	1,022.00	5,518,800	

木曽路	3,400	2,626.00	8,928,400	
千趣会	14,100	315.00	4,441,500	
上新電機	2,300	2,469.00	5,678,700	
日本瓦斯	8,800	2,356.00	20,732,800	
ロイヤルホールディングス	4,800	2,593.00	12,446,400	
いなげや	3,800	1,281.00	4,867,800	
チヨダ	2,800	895.00	2,506,000	
ライフコーポレーション	2,100	3,760.00	7,896,000	
ＡＯＫＩホールディングス	8,500	1,186.00	10,081,000	
コメリ	1,700	3,320.00	5,644,000	
青山商事	6,000	1,743.00	10,458,000	
しまむら	1,800	16,700.00	30,060,000	
高島屋	12,400	2,035.00	25,234,000	
松屋	6,300	948.00	5,972,400	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	8,700	1,620.00	14,094,000	
丸井グループ	13,400	2,494.00	33,419,600	
アクシアル　リテイリング	2,000	4,080.00	8,160,000	
イオン	56,800	3,457.00	196,357,600	
イズミ	2,500	3,440.00	8,600,000	
平和堂	3,100	2,183.00	6,767,300	
フジ	2,400	1,964.00	4,713,600	
ヤオコー	1,600	8,427.00	13,483,200	
ゼビオホールディングス	3,500	976.00	3,416,000	
ケーズホールディングス	9,800	1,342.00	13,151,600	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	1,300	6,290.00	8,177,000	
ブックオフグループホールディングス	4,500	1,288.00	5,796,000	
アインホールディングス	2,500	4,535.00	11,337,500	
ヤマダホールディングス	57,700	455.00	26,253,500	
アークランズ	3,200	1,693.00	5,417,600	
ニトリホールディングス	6,600	19,465.00	128,469,000	
吉野家ホールディングス	5,700	3,263.00	18,599,100	
王将フードサービス	800	8,070.00	6,456,000	
ミニストップ	3,200	1,535.00	4,912,000	
アークス	3,000	2,903.00	8,709,000	
バローホールディングス	2,800	2,493.00	6,980,400	
大庄	2,200	1,317.00	2,897,400	
ファーストリテイリング	7,500	38,960.00	292,200,000	
サンドラッグ	5,600	4,484.00	25,110,400	
ヤマザワ	1,400	1,272.00	1,780,800	
ベルーナ	10,200	629.00	6,415,800	
いよぎんホールディングス	17,400	999.30	17,387,820	
しずおかフィナンシャルグループ	31,600	1,343.50	42,454,600	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12,300	1,039.50	12,785,850	
楽天銀行	6,000	2,315.00	13,890,000	
京都フィナンシャルグループ	17,600	2,397.50	42,196,000	
めぶきフィナンシャルグループ	72,800	444.30	32,345,040	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,700	4,255.00	15,743,500	
九州フィナンシャルグループ	25,800	910.10	23,480,580	

ゆうちょ銀行	167,700	1,542.50	258,677,250	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	75,900	704.00	53,433,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	7,600	1,714.00	13,026,400	
三十三フィナンシャルグループ	300	1,909.00	572,700	
第四北越フィナンシャルグループ	2,800	4,055.00	11,354,000	
ひろぎんホールディングス	19,100	989.80	18,905,180	
おきなわフィナンシャルグループ	2,000	2,464.00	4,928,000	
十六フィナンシャルグループ	2,300	3,965.00	9,119,500	
北國フィナンシャルホールディングス	2,000	4,410.00	8,820,000	
プロクレアホールディングス	2,600	1,891.00	4,916,600	
あいちフィナンシャルグループ	4,200	2,585.00	10,857,000	
あおぞら銀行	9,300	3,247.00	30,197,100	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	961,000	1,383.50	1,329,543,500	300,000株
りそなホールディングス	189,200	810.60	153,365,520	
三井住友トラスト・ホールディングス	55,000	2,959.50	162,772,500	
三井住友フィナンシャルグループ	110,700	7,645.00	846,301,500	
千葉銀行	39,500	1,095.00	43,252,500	
群馬銀行	28,500	730.30	20,813,550	
武蔵野銀行	1,400	2,782.00	3,894,800	
千葉興業銀行	1,400	869.00	1,216,600	
七十七銀行	4,800	3,610.00	17,328,000	
秋田銀行	2,900	1,982.00	5,747,800	
山形銀行	3,300	1,111.00	3,666,300	
岩手銀行	2,900	2,550.00	7,395,000	
東邦銀行	8,200	305.00	2,501,000	
東北銀行	1,800	1,186.00	2,134,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,200	3,581.00	43,688,200	
スルガ銀行	16,200	852.00	13,802,400	
八十二銀行	31,700	807.00	25,581,900	
山梨中央銀行	4,400	1,747.00	7,686,800	
大垣共立銀行	3,100	1,958.00	6,069,800	
福井銀行	1,600	1,704.00	2,726,400	
滋賀銀行	3,100	3,450.00	10,695,000	
南都銀行	3,100	2,629.00	8,149,900	
百五銀行	12,400	575.00	7,130,000	
紀陽銀行	4,700	1,678.00	7,886,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,300	1,576.00	14,656,800	
山陰合同銀行	10,500	1,045.00	10,972,500	
鳥取銀行	1,800	1,434.00	2,581,200	
百十四銀行	4,000	2,444.00	9,776,000	
阿波銀行	1,800	2,443.00	4,397,400	
大分銀行	1,900	2,654.00	5,042,600	
宮崎銀行	1,800	2,712.00	4,881,600	
佐賀銀行	2,600	1,942.00	5,049,200	
琉球銀行	8,400	1,148.00	9,643,200	
セブン銀行	52,600	305.00	16,043,000	
みずほフィナンシャルグループ	210,500	2,671.50	562,350,750	
山口フィナンシャルグループ	14,400	1,383.00	19,915,200	

名古屋銀行	1,700	5,470.00	9,299,000	
北洋銀行	20,500	368.00	7,544,000	
愛媛銀行	3,900	1,054.00	4,110,600	
トマト銀行	1,900	1,223.00	2,323,700	
京葉銀行	11,400	716.00	8,162,400	
栃木銀行	18,600	312.00	5,803,200	
トモニホールディングス	14,000	406.00	5,684,000	
フィデアホールディングス	3,800	1,595.00	6,061,000	
池田泉州ホールディングス	35,300	334.00	11,790,200	
ＦＰＧ	9,700	1,693.00	16,422,100	
ＳＢＩホールディングス	21,300	3,629.00	77,297,700	
ジャフコ　グループ	6,700	1,699.50	11,386,650	
大和証券グループ本社	114,700	1,060.50	121,639,350	
野村ホールディングス	266,800	757.60	202,127,680	
岡三証券グループ	22,200	757.00	16,805,400	
丸三証券	12,800	893.00	11,430,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	26,800	559.00	14,981,200	
いちよし証券	7,200	778.00	5,601,600	
松井証券	12,000	814.00	9,768,000	
マネックスグループ	21,300	755.00	16,081,500	
極東証券	6,200	1,051.00	6,516,200	
アイザワ証券グループ	6,400	1,232.00	7,884,800	
かんぽ生命保険	16,100	2,721.00	43,808,100	
ＳＯＭＰＯホールディングス	25,900	7,530.00	195,027,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	34,300	6,025.00	206,657,500	
第一生命ホールディングス	76,900	3,181.00	244,618,900	
東京海上ホールディングス	154,800	3,820.00	591,336,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	45,100	2,382.00	107,428,200	
全国保証	4,000	5,504.00	22,016,000	
ジェイリース	1,200	2,325.00	2,790,000	
クレディセゾン	10,500	2,779.00	29,179,500	
芙蓉総合リース	1,700	13,205.00	22,448,500	
みずほリース	3,200	5,290.00	16,928,000	
東京センチュリー	10,400	1,624.00	16,889,600	
日本証券金融	8,800	1,565.00	13,772,000	
アイフル	35,100	371.00	13,022,100	
リコーリース	1,700	5,110.00	8,687,000	
イオンフィナンシャルサービス	9,400	1,325.00	12,455,000	
アコム	31,700	369.80	11,722,660	
オリエントコーポレーション	7,600	1,114.00	8,466,400	
オリックス	100,000	2,856.00	285,600,000	
三菱ＨＣキャピタル	63,500	1,026.00	65,151,000	
日本取引所グループ	42,300	3,180.00	134,514,000	
アサックス	4,000	731.00	2,924,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	2,300	3,730.00	8,579,000	
大東建託	5,700	16,125.00	91,912,500	

いちご	22,700	373.00	8,467,100	
ヒューリック	35,200	1,555.50	54,753,600	
野村不動産ホールディングス	10,300	3,973.00	40,921,900	
プレサンスコーポレーション	2,500	1,667.00	4,167,500	
オープンハウスグループ	6,300	4,535.00	28,570,500	
東急不動産ホールディングス	47,000	994.50	46,741,500	
飯田グループホールディングス	13,000	2,272.00	29,536,000	
パーク２４	13,000	1,867.00	24,271,000	
三井不動産	71,700	3,665.00	262,780,500	
三菱地所	102,500	2,029.00	207,972,500	
平和不動産	3,400	3,900.00	13,260,000	
東京建物	15,900	2,242.00	35,647,800	
京阪神ビルディング	5,600	1,455.00	8,148,000	
住友不動産	23,700	4,571.00	108,332,700	
テーオーシー	7,400	693.00	5,128,200	
スターツコーポレーション	3,500	3,055.00	10,692,500	
空港施設	7,600	654.00	4,970,400	
ゴールドクレスト	3,600	2,321.00	8,355,600	
エスリード	2,500	3,645.00	9,112,500	
ＡＶＡＮＴＩＡ	3,900	898.00	3,502,200	
イオンモール	7,800	1,792.50	13,981,500	
カチタス	5,300	1,914.00	10,144,200	
グランディハウス	2,300	652.00	1,499,600	
日本空港ビルデング	5,800	5,874.00	34,069,200	
ＭＩＸＩ	3,500	2,534.00	8,869,000	
日本M&Aセンターホールディングス	32,600	780.90	25,457,340	
ＵＴグループ	3,900	2,420.00	9,438,000	
オープンアップグループ	4,400	2,224.00	9,785,600	
コシダカホールディングス	6,300	995.00	6,268,500	
パソナグループ	3,500	2,700.00	9,450,000	
エス・エム・エス	6,800	2,620.00	17,816,000	
パーソルホールディングス	167,000	233.90	39,061,300	
クックパッド	25,000	116.00	2,900,000	
学情	3,700	1,769.00	6,545,300	
スタジオアリス	2,900	2,099.00	6,087,100	
シミックホールディングス	3,400	2,643.00	8,986,200	
ＮＪＳ	2,500	2,811.00	7,027,500	
綜合警備保障	27,000	798.10	21,548,700	
カカクコム	12,900	1,700.00	21,930,000	
アイロムグループ	2,600	2,062.00	5,361,200	
ディップ	3,300	2,539.00	8,378,700	
キャリアデザインセンター	1,800	2,104.00	3,787,200	
ベネフィット・ワン	7,700	2,133.50	16,427,950	
エムスリー	32,700	2,437.00	79,689,900	
アウトソーシング	11,200	1,743.00	19,521,600	
ディー・エヌ・エー	7,000	1,521.50	10,650,500	
博報堂ＤＹホールディングス	19,900	1,120.00	22,288,000	
ぐるなび	16,400	277.00	4,542,800	

ファンコミュニケーションズ	11,400	403.00	4,594,200	
ＷＤＢホールディングス	1,500	2,307.00	3,460,500	
インフォマート	25,000	415.00	10,375,000	
プレステージ・インターナショナル	7,700	606.00	4,666,200	
クイック	3,400	2,532.00	8,608,800	
電通グループ	15,900	3,948.00	62,773,200	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	4,700	2,720.50	12,786,350	
日本空調サービス	7,300	839.00	6,124,700	
オリエンタルランド	86,100	5,562.00	478,888,200	
ダスキン	2,600	3,392.00	8,819,200	
ラウンドワン	21,000	658.00	13,818,000	
リゾートトラスト	7,000	2,537.00	17,759,000	
ビー・エム・エル	2,900	2,850.00	8,265,000	
リソー教育	20,900	242.00	5,057,800	
早稲田アカデミー	4,600	1,682.00	7,737,200	
ユー・エス・エス	17,000	2,829.00	48,093,000	
サイバーエージェント	40,600	948.80	38,521,280	
楽天グループ	141,200	661.50	93,403,800	
テー・オー・ダブリュー	19,000	335.00	6,365,000	
エン・ジャパン	4,600	2,646.00	12,171,600	
テクノプロ・ホールディングス	9,700	3,514.00	34,085,800	
アイ・アールジャパンホールディングス	2,500	1,568.00	3,920,000	
ジャパンマテリアル	5,000	2,540.00	12,700,000	
キャリアリンク	2,100	2,578.00	5,413,800	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,000	1,032.00	4,128,000	
シグマクシス・ホールディングス	2,200	1,361.00	2,994,200	
リクルートホールディングス	120,900	5,914.00	715,002,600	
エラン	7,600	1,064.00	8,086,400	
日本郵政	187,500	1,420.50	266,343,750	
ソラスト	7,100	586.00	4,160,600	
ベイカレント・コンサルティング	13,000	3,490.00	45,370,000	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,500	1,232.00	5,544,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,300	2,215.00	13,954,500	
アンビスホールディングス	1,800	2,719.00	4,894,200	
リログループ	11,200	1,603.00	17,953,600	
ＴＲＥホールディングス	3,300	1,268.00	4,184,400	
大栄環境	2,900	2,564.00	7,435,600	
日本管財ホールディングス	3,300	2,626.00	8,665,800	
共立メンテナンス	3,600	5,958.00	21,448,800	
建設技術研究所	2,000	5,940.00	11,880,000	
スバル興業	100	15,580.00	1,558,000	
タナベコンサルティンググループ	1,100	1,055.00	1,160,500	
東京都競馬	2,400	4,595.00	11,028,000	
カナモト	4,300	2,904.00	12,487,200	
トランス・コスモス	3,200	3,130.00	10,016,000	
乃村工藝社	9,600	868.00	8,332,800	
白洋舎	1,700	2,792.00	4,746,400	

セコム	16,100	10,775.00	173,477,500	
セントラル警備保障	2,200	2,535.00	5,577,000	
メイテックグループホールディングス	4,900	2,905.00	14,234,500	
応用地質	3,400	2,235.00	7,599,000	
船井総研ホールディングス	4,200	2,629.00	11,041,800	
ベネッセホールディングス	5,900	2,620.00	15,458,000	
イオンディライト	2,100	3,750.00	7,875,000	
ダイセキ	3,400	4,275.00	14,535,000	
ステップ	3,100	1,956.00	6,063,600	
合　計	24,373,700	－	57,153,417,110	

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

(2)株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「TMA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] 金額（円）	[2024年 1月25日現在] 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	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

自 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	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）

Ⅰ．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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	[2023年 1月25日現在]	[2024年 1月25日現在]
1．　貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．　時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

（自 2022年1月26日　至 2023年1月25日）

売買目的有価証券

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額
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 （1万口当たり純資産額　17,000円）	1口当たり純資産額　1.9335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%	
	英ポンド			英ポンド	
		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	
英ポンド小計		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] 金額（円）	[2024年 1月25日現在] 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	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

自 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	16,521,030,366円	26,873,327,459円
	同期中における追加設定元本額	12,349,504,370円	12,293,130,413円
	同期中における一部解約元本額	1,997,207,277円	3,822,863,489円
	同期末における元本額	26,873,327,459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	9,199,572,062円	11,397,249,258円
	東京海上・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）	103,112,339円	144,735,796円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	137,808,850円	198,135,559円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	75,014,168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）

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	[2023年 1月25日現在]	[2024年 1月25日現在]
1．貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）
（自 2022年1月26日　至 2023年1月25日）
売買目的有価証券

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額
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1年超	時　価	評価損益
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1年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	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1年超	時　価	評価損益
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。
①同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
②同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
(2)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
(3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.換算において円未満の端数は切り捨てております。
3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報に関する注記）

[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 4.1441円 （1万口当たり純資産額 41,441円）	1口当たり純資産額 5.5651円 （1万口当たり純資産額 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	
FREEPORT-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 INTERNATION	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 SOFTWRE	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	
CENCORA 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 LIFECO 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	
Aeroports 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	
ASHTEAD 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 HAPOALIM 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 24,556,870		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			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			加ドル	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,624	272,591.36	
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			ユーロ	
	COVIVIO	4,118	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			英ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	30,484	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			豪ドル	
	DEXUS/AU	22,492	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			香港ドル	
	LINK REIT	64,100	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] 金額（円）	[2024年 1月25日現在] 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）
Ｉ．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

Ⅱ．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　1.2325円 （1万口当たり純資産額　12,325円）	1口当たり純資産額　1.2230円 （1万口当たり純資産額　12,230円）

(3) 附属明細表
第1　有価証券明細表
(1)株式
該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
国債証券	第４４５回利付国債（２年）	192,000,000	192,086,400	
	第４４６回利付国債（２年）	18,000,000	18,006,840	
	第４４７回利付国債（２年）	46,000,000	46,016,100	
	第４４８回利付国債（２年）	60,000,000	60,015,000	
	第４４９回利付国債（２年）	114,000,000	114,014,820	
	第４５０回利付国債（２年）	68,000,000	68,004,760	
	第４５１回利付国債（２年）	60,000,000	60,000,000	
	第４５２回利付国債（２年）	130,000,000	129,979,200	
	第４５３回利付国債（２年）	124,000,000	123,957,840	
	第４５４回利付国債（２年）	45,000,000	45,059,400	
	第１４３回利付国債（５年）	319,000,000	319,491,260	
	第１４４回利付国債（５年）	130,000,000	130,189,800	
	第１４５回利付国債（５年）	418,000,000	418,618,640	
	第１４６回利付国債（５年）	392,000,000	392,482,160	
	第１４７回利付国債（５年）	482,000,000	481,532,460	
	第１４８回利付国債（５年）	422,000,000	421,493,600	

第１４９回利付国債（５年）	281,000,000	280,589,740	
第１５０回利付国債（５年）	174,000,000	173,646,780	
第１５１回利付国債（５年）	205,000,000	204,389,100	
第１５２回利付国債（５年）	150,000,000	150,000,000	
第１５３回利付国債（５年）	153,000,000	152,378,820	
第１５４回利付国債（５年）	226,000,000	225,548,000	
第１５５回利付国債（５年）	210,000,000	210,934,500	
第１５６回利付国債（５年）	153,000,000	153,088,740	
第１５７回利付国債（５年）	119,000,000	118,901,230	
第１５８回利付国債（５年）	160,000,000	159,211,200	
第１５９回利付国債（５年）	102,000,000	101,311,500	
第１６０回利付国債（５年）	156,000,000	155,625,600	
第１６３回利付国債（５年）	160,000,000	160,769,600	
第５回利付国債（４０年）	36,000,000	37,875,600	
第６回利付国債（４０年）	76,000,000	78,124,200	
第７回利付国債（４０年）	84,000,000	82,117,560	
第８回利付国債（４０年）	85,000,000	76,834,050	
第９回利付国債（４０年）	99,000,000	65,017,260	
第１０回利付国債（４０年）	100,000,000	77,151,000	
第１１回利付国債（４０年）	99,000,000	73,187,730	
第１２回利付国債（４０年）	104,000,000	68,080,480	
第１３回利付国債（４０年）	92,000,000	59,432,000	
第１４回利付国債（４０年）	88,000,000	60,584,480	
第１５回利付国債（４０年）	93,000,000	70,511,670	
第１６回利付国債（４０年）	76,000,000	63,072,400	
第３３８回利付国債（１０年）	101,000,000	101,502,980	
第３３９回利付国債（１０年）	160,000,000	160,904,000	
第３４０回利付国債（１０年）	70,000,000	70,450,100	
第３４１回利付国債（１０年）	90,000,000	90,451,800	
第３４２回利付国債（１０年）	200,000,000	200,214,000	
第３４３回利付国債（１０年）	195,000,000	195,208,650	
第３４４回利付国債（１０年）	190,000,000	190,199,500	
第３４５回利付国債（１０年）	170,000,000	170,122,400	
第３４６回利付国債（１０年）	234,000,000	234,000,000	
第３４７回利付国債（１０年）	145,000,000	144,876,750	
第３４８回利付国債（１０年）	145,000,000	144,710,000	
第３４９回利付国債（１０年）	174,000,000	173,425,800	
第３５０回利付国債（１０年）	252,000,000	250,757,640	
第３５１回利付国債（１０年）	258,000,000	256,258,500	
第３５２回利付国債（１０年）	297,000,000	294,410,160	
第３５３回利付国債（１０年）	336,000,000	332,512,320	
第３５４回利付国債（１０年）	336,000,000	332,172,960	
第３５５回利付国債（１０年）	313,000,000	309,181,400	
第３５６回利付国債（１０年）	316,000,000	311,794,040	
第３５７回利付国債（１０年）	303,000,000	298,621,650	
第３５８回利付国債（１０年）	264,000,000	259,715,280	
第３５９回利付国債（１０年）	263,000,000	258,237,070	
第３６０回利付国債（１０年）	253,000,000	247,762,900	

第３６１回利付国債（１０年）	187,000,000	182,620,460	
第３６２回利付国債（１０年）	298,000,000	290,174,520	
第３６３回利付国債（１０年）	255,000,000	247,546,350	
第３６４回利付国債（１０年）	264,000,000	255,464,880	
第３６５回利付国債（１０年）	270,000,000	260,406,900	
第３６６回利付国債（１０年）	266,000,000	257,937,540	
第３６７回利付国債（１０年）	273,000,000	263,952,780	
第３６８回利付国債（１０年）	303,000,000	292,070,790	
第３６９回利付国債（１０年）	144,000,000	142,122,240	
第３７０回利付国債（１０年）	240,000,000	236,380,800	
第３７１回利付国債（１０年）	256,000,000	249,226,240	
第３７２回利付国債（１０年）	94,000,000	94,720,980	
第１回利付国債（３０年）	5,000,000	5,688,050	
第２回利付国債（３０年）	24,000,000	26,939,520	
第３回利付国債（３０年）	20,000,000	22,394,600	
第５回利付国債（３０年）	40,000,000	44,892,000	
第１８回利付国債（３０年）	4,000,000	4,611,600	
第２１回利付国債（３０年）	7,000,000	8,079,260	
第２２回利付国債（３０年）	8,000,000	9,416,800	
第２５回利付国債（３０年）	5,000,000	5,772,250	
第２６回利付国債（３０年）	11,000,000	12,826,330	
第２７回利付国債（３０年）	8,000,000	9,429,840	
第２８回利付国債（３０年）	20,000,000	23,557,000	
第２９回利付国債（３０年）	50,000,000	58,200,500	
第３１回利付国債（３０年）	44,000,000	49,862,560	
第３２回利付国債（３０年）	13,000,000	14,883,700	
第３３回利付国債（３０年）	45,000,000	49,446,450	
第３４回利付国債（３０年）	53,000,000	59,729,410	
第３５回利付国債（３０年）	40,000,000	43,736,800	
第３６回利付国債（３０年）	53,000,000	57,810,280	
第３７回利付国債（３０年）	64,000,000	68,579,840	
第３８回利付国債（３０年）	66,000,000	69,461,040	
第３９回利付国債（３０年）	73,000,000	77,913,630	
第４０回利付国債（３０年）	69,000,000	72,360,990	
第４１回利付国債（３０年）	71,000,000	73,063,970	
第４２回利付国債（３０年）	70,000,000	71,887,200	
第４３回利付国債（３０年）	71,000,000	72,819,730	
第４４回利付国債（３０年）	68,000,000	69,649,680	
第４５回利付国債（３０年）	73,000,000	72,082,390	
第４６回利付国債（３０年）	72,000,000	70,974,000	
第４７回利付国債（３０年）	67,000,000	67,106,530	
第４８回利付国債（３０年）	71,000,000	68,441,160	
第４９回利付国債（３０年）	71,000,000	68,309,100	
第５０回利付国債（３０年）	85,000,000	72,169,250	
第５１回利付国債（３０年）	72,000,000	54,155,520	
第５２回利付国債（３０年）	86,000,000	67,576,220	
第５３回利付国債（３０年）	84,000,000	67,326,840	
第５４回利付国債（３０年）	82,000,000	68,602,020	

第５５回利付国債（３０年）	83,000,000	69,163,900	
第５６回利付国債（３０年）	83,000,000	68,945,610	
第５７回利付国債（３０年）	79,000,000	65,415,950	
第５８回利付国債（３０年）	76,000,000	62,733,440	
第５９回利付国債（３０年）	77,000,000	61,854,100	
第６０回利付国債（３０年）	70,000,000	58,841,300	
第６１回利付国債（３０年）	70,000,000	55,848,800	
第６２回利付国債（３０年）	132,000,000	99,621,720	
第６３回利付国債（３０年）	87,000,000	63,608,310	
第６４回利付国債（３０年）	85,000,000	61,891,050	
第６５回利付国債（３０年）	95,000,000	68,890,200	
第６６回利付国債（３０年）	84,000,000	60,613,560	
第６７回利付国債（３０年）	82,000,000	62,382,320	
第６８回利付国債（３０年）	83,000,000	62,909,020	
第６９回利付国債（３０年）	82,000,000	63,689,400	
第７０回利付国債（３０年）	84,000,000	65,016,000	
第７１回利付国債（３０年）	82,000,000	63,244,140	
第７２回利付国債（３０年）	82,000,000	63,076,860	
第７３回利付国債（３０年）	84,000,000	64,444,800	
第７４回利付国債（３０年）	81,000,000	67,322,340	
第７５回利付国債（３０年）	76,000,000	68,090,680	
第７６回利付国債（３０年）	77,000,000	70,577,430	
第７７回利付国債（３０年）	73,000,000	70,090,950	
第７８回利付国債（３０年）	87,000,000	79,586,730	
第７９回利付国債（３０年）	73,000,000	63,361,080	
第８０回利付国債（３０年）	60,000,000	60,174,000	
第７５回利付国債（２０年）	30,000,000	30,733,500	
第７６回利付国債（２０年）	10,000,000	10,221,600	
第７８回利付国債（２０年）	10,000,000	10,266,100	
第７９回利付国債（２０年）	10,000,000	10,280,100	
第８０回利付国債（２０年）	20,000,000	20,588,200	
第８１回利付国債（２０年）	28,000,000	28,918,680	
第８２回利付国債（２０年）	40,000,000	41,378,400	
第８３回利付国債（２０年）	15,000,000	15,587,700	
第８４回利付国債（２０年）	60,000,000	62,236,800	
第８５回利付国債（２０年）	20,000,000	20,878,400	
第８６回利付国債（２０年）	20,000,000	20,964,200	
第８７回利付国債（２０年）	25,000,000	26,151,750	
第８８回利付国債（２０年）	20,000,000	21,074,800	
第８９回利付国債（２０年）	20,000,000	21,027,000	
第９０回利付国債（２０年）	65,000,000	68,679,000	
第９３回利付国債（２０年）	8,000,000	8,476,560	
第９４回利付国債（２０年）	8,000,000	8,501,600	
第９５回利付国債（２０年）	16,000,000	17,180,000	
第９９回利付国債（２０年）	20,000,000	21,486,600	
第１００回利付国債（２０年）	20,000,000	21,635,400	
第１０５回利付国債（２０年）	20,000,000	21,665,600	
第１０６回利付国債（２０年）	20,000,000	21,757,400	

第１０７回利付国債（２０年）	8,000,000	8,690,960	
第１０８回利付国債（２０年）	25,000,000	26,918,000	
第１１１回利付国債（２０年）	11,000,000	12,100,330	
第１１２回利付国債（２０年）	10,000,000	10,947,300	
第１１３回利付国債（２０年）	5,000,000	5,492,300	
第１１５回利付国債（２０年）	10,000,000	11,078,700	
第１１６回利付国債（２０年）	40,000,000	44,451,600	
第１１７回利付国債（２０年）	60,000,000	66,316,200	
第１２０回利付国債（２０年）	25,000,000	26,913,250	
第１２１回利付国債（２０年）	30,000,000	32,914,500	
第１２２回利付国債（２０年）	35,000,000	38,173,450	
第１２３回利付国債（２０年）	58,000,000	64,511,080	
第１２４回利付国債（２０年）	40,000,000	44,222,000	
第１２５回利付国債（２０年）	45,000,000	50,451,300	
第１２６回利付国債（２０年）	31,000,000	34,314,210	
第１２７回利付国債（２０年）	25,000,000	27,499,750	
第１２８回利付国債（２０年）	20,000,000	22,020,800	
第１２９回利付国債（２０年）	28,000,000	30,629,200	
第１３０回利付国債（２０年）	54,000,000	59,128,380	
第１３１回利付国債（２０年）	45,000,000	48,942,000	
第１３２回利付国債（２０年）	52,000,000	56,569,240	
第１３３回利付国債（２０年）	71,000,000	77,776,950	
第１３４回利付国債（２０年）	46,000,000	50,443,140	
第１３５回利付国債（２０年）	40,000,000	43,552,000	
第１３６回利付国債（２０年）	60,000,000	64,860,600	
第１３７回利付国債（２０年）	58,000,000	63,201,440	
第１３８回利付国債（２０年）	47,000,000	50,441,810	
第１３９回利付国債（２０年）	52,000,000	56,224,480	
第１４０回利付国債（２０年）	78,000,000	85,020,000	
第１４１回利付国債（２０年）	86,000,000	93,793,320	
第１４２回利付国債（２０年）	72,000,000	79,131,600	
第１４３回利付国債（２０年）	124,000,000	134,168,000	
第１４４回利付国債（２０年）	92,000,000	98,750,040	
第１４５回利付国債（２０年）	211,000,000	230,314,940	
第１４６回利付国債（２０年）	131,000,000	142,969,470	
第１４７回利付国債（２０年）	127,000,000	137,389,870	
第１４８回利付国債（２０年）	126,000,000	135,035,460	
第１４９回利付国債（２０年）	125,000,000	133,847,500	
第１５０回利付国債（２０年）	161,000,000	170,645,510	
第１５１回利付国債（２０年）	192,000,000	199,297,920	
第１５２回利付国債（２０年）	166,000,000	172,002,560	
第１５３回利付国債（２０年）	193,000,000	201,708,160	
第１５４回利付国債（２０年）	164,000,000	169,366,080	
第１５５回利付国債（２０年）	166,000,000	167,332,980	
第１５６回利付国債（２０年）	163,000,000	152,739,150	
第１５７回利付国債（２０年）	162,000,000	147,460,500	
第１５８回利付国債（２０年）	155,000,000	145,887,550	
第１５９回利付国債（２０年）	147,000,000	139,563,270	

	第１６０回利付国債（２０年）	123,000,000	117,822,930	
	第１６１回利付国債（２０年）	143,000,000	134,728,880	
	第１６２回利付国債（２０年）	133,000,000	124,811,190	
	第１６３回利付国債（２０年）	143,000,000	133,654,950	
	第１６４回利付国債（２０年）	144,000,000	132,130,080	
	第１６５回利付国債（２０年）	141,000,000	128,803,500	
	第１６６回利付国債（２０年）	126,000,000	117,929,700	
	第１６７回利付国債（２０年）	135,000,000	122,206,050	
	第１６８回利付国債（２０年）	133,000,000	118,001,590	
	第１６９回利付国債（２０年）	129,000,000	112,090,680	
	第１７０回利付国債（２０年）	131,000,000	113,228,540	
	第１７１回利付国債（２０年）	137,000,000	117,784,380	
	第１７２回利付国債（２０年）	126,000,000	109,550,700	
	第１７３回利付国債（２０年）	135,000,000	116,762,850	
	第１７４回利付国債（２０年）	134,000,000	115,361,940	
	第１７５回利付国債（２０年）	133,000,000	115,928,120	
	第１７６回利付国債（２０年）	142,000,000	123,221,920	
	第１７７回利付国債（２０年）	140,000,000	118,752,200	
	第１７８回利付国債（２０年）	139,000,000	119,519,150	
	第１７９回利付国債（２０年）	136,000,000	116,398,320	
	第１８０回利付国債（２０年）	133,000,000	119,634,830	
	第１８１回利付国債（２０年）	128,000,000	116,842,240	
	第１８２回利付国債（２０年）	134,000,000	126,187,800	
	第１８３回利付国債（２０年）	133,000,000	131,427,940	
	第１８４回利付国債（２０年）	102,000,000	95,504,640	
	第１８５回利付国債（２０年）	107,000,000	99,893,060	
	第１８６回利付国債（２０年）	89,000,000	88,797,080	
国債証券　合計		26,014,000,000	25,142,469,150	

地方債証券	第７８１回東京都公募公債	100,000,000	99,111,000	
	第２６回神奈川県公募公債（２０年）	20,000,000	21,096,400	
	第６回大阪府公募公債（２０年）	50,000,000	54,650,500	
	平成２８年度第２回京都府公募公債（１５年）	50,000,000	48,594,000	
	第２回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	103,806,000	
	第４回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	106,500,000	
	平成３１年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	98,227,000	
	平成２９年度第７回広島県公募公債	100,000,000	99,446,000	
	平成２７年度第３回福岡県公募公債	200,000,000	201,304,000	
	令和４年度第１回長野県公募公債（１０年）	100,000,000	96,724,000	
	第２４回群馬県公募公債（１０年）	100,000,000	95,925,000	
	令和４年度第２回熊本県公募公債（５年）	140,400,000	139,717,656	
	平成２４年度第２回福井県公募公債	100,000,000	107,977,000	
	令和元年度第２回徳島県公募公債	100,000,000	97,897,000	
	令和元年度第３回岡山県公募公債（１０年）	100,000,000	97,363,000	
地方債証券　合計		1,460,400,000	1,468,338,556	
特殊債券	第３４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,270,000	
	第５８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,076,000	
特殊債券　合計		200,000,000	199,346,000	
社債券	第１０６回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,995,000	
	第３３回道路債券	100,000,000	118,563,000	
	第２３回国際協力銀行債券	100,000,000	103,604,000	
	第１０１回都市再生債券	100,000,000	102,289,000	
	第５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,879,000	22,566,875	
	第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,602,000	25,349,654	
	第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,335,000	24,044,850	
	第５９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,922,000	25,711,528	
	第１６回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	100,363,000	
	第１５回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,513,000	
	第２１回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,453,000	
	第８０回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,086,000	

	第１１８回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,720,000	
	第８３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,766,000	
	第５０３回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,439,000	
	第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,974,000	
	第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,249,000	
社債券　合計		1,394,738,000	1,425,686,907	
合計		29,069,138,000	28,235,840,613	

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【中間財務諸表】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、当中間計算期間(2024年1月26日から2024年7月25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り中間監査を受けております。

中間財務諸表
【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035】
(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2024年 1月25日現在	当中間計算期間末 2024年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	3,620,317,630	4,665,473,968
未収入金	6,887,305	9,121,162
流動資産合計	3,627,204,935	4,674,595,130
資産合計	3,627,204,935	4,674,595,130
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,614,148	2,006,969
未払受託者報酬	346,601	467,119
未払委託者報酬	4,505,704	6,072,428
その他未払費用	173,197	233,467
流動負債合計	6,639,650	8,779,983
負債合計	6,639,650	8,779,983
純資産の部		
元本等		
元本	※1 2,403,439,077	※1 2,908,090,505
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,217,126,208	1,757,724,642
（分配準備積立金）	498,634,521	469,104,121
元本等合計	3,620,565,285	4,665,815,147
純資産合計	3,620,565,285	4,665,815,147
負債純資産合計	3,627,204,935	4,674,595,130

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日	当中間計算期間 自 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	274,705,911	248,953,053
営業収益合計	274,705,911	248,953,053
営業費用		
受託者報酬	244,687	467,119
委託者報酬	3,180,940	6,072,428
その他費用	122,257	233,467
営業費用合計	3,547,884	6,773,014
営業利益又は営業損失（△）	271,158,027	242,180,039
経常利益又は経常損失（△）	271,158,027	242,180,039
中間純利益又は中間純損失（△）	271,158,027	242,180,039
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	4,005,485	13,136,221
期首剰余金又は期首欠損金（△）	388,720,676	1,217,126,208
剰余金増加額又は欠損金減少額	170,097,097	394,845,550
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	170,097,097	394,845,550
剰余金減少額又は欠損金増加額	17,018,309	83,290,934
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	17,018,309	83,290,934
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	808,952,006	1,757,724,642

(3)【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当中間計算期間 自 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

区　分	前期 2024年 1月25日現在	当中間計算期間末 2024年 7月25日現在
1.※1　期首元本額	1,499,484,524円	2,403,439,077円
期中追加設定元本額	1,071,577,486円	666,661,957円
期中一部解約元本額	167,622,933円	162,010,529円
2.※1　中間計算期間末日における受益権の総数	2,403,439,077口	2,908,090,505口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

前中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日	当中間計算期間 自 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
該当事項はありません。	同　左

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	前期 2024年 1月25日現在	当中間計算期間末 2024年 7月25日現在
1.　中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2.　時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（1口当たり情報に関する注記）

前期 2024年 1月25日現在	当中間計算期間末 2024年 7月25日現在
1口当たり純資産額　1.5064円 （1万口当たり純資産額　15,064円）	1口当たり純資産額　1.6044円 （1万口当たり純資産額　16,044円）

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045】
(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2024年 1月25日現在	当中間計算期間末 2024年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,959,657,817	2,607,509,077
未収入金	3,450,102	4,865,377
流動資産合計	1,963,107,919	2,612,374,454
資産合計	1,963,107,919	2,612,374,454
負債の部		
流動負債		
未払解約金	635,300	970,448
未払受託者報酬	185,006	255,766
未払委託者報酬	2,405,016	3,324,942
その他未払費用	92,420	127,794
流動負債合計	3,317,742	4,678,950
負債合計	3,317,742	4,678,950
純資産の部		
元本等		
元本	※1 1,273,715,242	※1 1,582,981,469
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	686,074,935	1,024,714,035
（分配準備積立金）	279,847,799	266,712,212
元本等合計	1,959,790,177	2,607,695,504
純資産合計	1,959,790,177	2,607,695,504
負債純資産合計	1,963,107,919	2,612,374,454

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日	当中間計算期間 自 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	153,566,478	144,924,838
営業収益合計	153,566,478	144,924,838
営業費用		
受託者報酬	129,252	255,766
委託者報酬	1,680,154	3,324,942
その他費用	64,531	127,794
営業費用合計	1,873,937	3,708,502
営業利益又は営業損失（△）	151,692,541	141,216,336
経常利益又は経常損失（△）	151,692,541	141,216,336
中間純利益又は中間純損失（△）	151,692,541	141,216,336
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	3,126,795	6,068,312
期首剰余金又は期首欠損金（△）	206,022,947	686,074,935
剰余金増加額又は欠損金減少額	105,483,762	240,957,007
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	105,483,762	240,957,007
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,409,528	37,465,931
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,409,528	37,465,931
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	447,662,927	1,024,714,035

(3)【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当中間計算期間 自 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

区　分	前期 2024年 1月25日現在	当中間計算期間末 2024年 7月25日現在
1.※1　期首元本額	758,957,721円	1,273,715,242円
期中追加設定元本額	607,240,829円	377,649,987円
期中一部解約元本額	92,483,308円	68,383,760円
2.※1　中間計算期間末日における受益権の総数	1,273,715,242口	1,582,981,469口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

前中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日	当中間計算期間 自 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
該当事項はありません。	同　左

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	前期 2024年 1月25日現在	当中間計算期間末 2024年 7月25日現在
1.　中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2.　時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（1口当たり情報に関する注記）

前期 2024年 1月25日現在	当中間計算期間末 2024年 7月25日現在
1口当たり純資産額　1.5386円 （1万口当たり純資産額　15,386円）	1口当たり純資産額　1.6473円 （1万口当たり純資産額　16,473円）

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055】
(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2024年 1月25日現在	当中間計算期間末 2024年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,246,138,843	1,651,613,957
未収入金	4,815,315	2,941,299
流動資産合計	1,250,954,158	1,654,555,256
資産合計	1,250,954,158	1,654,555,256
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,046,112	458,102
未払受託者報酬	116,307	163,057
未払委託者報酬	1,511,944	2,119,690
その他未払費用	58,066	81,437
流動負債合計	4,732,429	2,822,286
負債合計	4,732,429	2,822,286
純資産の部		
元本等		
元本	※1 793,499,038	※1 979,750,680
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	452,722,691	671,982,290
（分配準備積立金）	177,295,732	164,769,287
元本等合計	1,246,221,729	1,651,732,970
純資産合計	1,246,221,729	1,651,732,970
負債純資産合計	1,250,954,158	1,654,555,256

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日	当中間計算期間 自 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	98,093,734	96,537,660
営業収益合計	98,093,734	96,537,660
営業費用		
受託者報酬	79,999	163,057
委託者報酬	1,039,861	2,119,690
その他費用	39,906	81,437
営業費用合計	1,159,766	2,364,184
営業利益又は営業損失（△）	96,933,968	94,173,476
経常利益又は経常損失（△）	96,933,968	94,173,476
中間純利益又は中間純損失（△）	96,933,968	94,173,476
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	3,848,808	5,887,754
期首剰余金又は期首欠損金（△）	133,522,438	452,722,691
剰余金増加額又は欠損金減少額	76,155,370	168,512,413
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	76,155,370	168,512,413
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,672,780	37,538,536
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,672,780	37,538,536
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	289,090,188	671,982,290

(3)【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当中間計算期間 自 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

区　分	前期 2024年 1月25日現在	当中間計算期間末 2024年 7月25日現在
1.※1　期首元本額	459,818,036円	793,499,038円
期中追加設定元本額	427,962,253円	250,998,779円
期中一部解約元本額	94,281,251円	64,747,137円
2.※1　中間計算期間末日における受益権の総数	793,499,038口	979,750,680口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

前中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日	当中間計算期間 自 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
該当事項はありません。	同　左

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	前期 2024年 1月25日現在	当中間計算期間末 2024年 7月25日現在
1.　中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2.　時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（1口当たり情報に関する注記）

前期 2024年 1月25日現在	当中間計算期間末 2024年 7月25日現在
1口当たり純資産額　1.5705円 （1万口当たり純資産額　15,705円）	1口当たり純資産額　1.6859円 （1万口当たり純資産額　16,859円）

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065】
(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2024年 1月25日現在	当中間計算期間末 2024年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,987,670,124	2,533,492,973
未収入金	16,845,305	8,645,686
流動資産合計	2,004,515,429	2,542,138,659
資産合計	2,004,515,429	2,542,138,659
負債の部		
流動負債		
未払解約金	13,990,263	4,770,010
未払受託者報酬	187,681	254,448
未払委託者報酬	2,439,774	3,307,702
その他未払費用	93,743	127,125
流動負債合計	16,711,461	8,459,285
負債合計	16,711,461	8,459,285
純資産の部		
元本等		
元本	※1 1,236,364,324	※1 1,461,731,717
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	751,439,644	1,071,947,657
（分配準備積立金）	284,064,666	249,457,002
元本等合計	1,987,803,968	2,533,679,374
純資産合計	1,987,803,968	2,533,679,374
負債純資産合計	2,004,515,429	2,542,138,659

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日	当中間計算期間 自 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	166,047,555	161,928,229
営業収益合計	166,047,555	161,928,229
営業費用		
受託者報酬	130,350	254,448
委託者報酬	1,694,493	3,307,702
その他費用	65,086	127,125
営業費用合計	1,889,929	3,689,275
営業利益又は営業損失（△）	164,157,626	158,238,954
経常利益又は経常損失（△）	164,157,626	158,238,954
中間純利益又は中間純損失（△）	164,157,626	158,238,954
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	10,650,495	16,099,847
期首剰余金又は期首欠損金（△）	229,117,657	751,439,644
剰余金増加額又は欠損金減少額	143,374,669	285,590,041
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	143,374,669	285,590,041
剰余金減少額又は欠損金増加額	44,177,733	107,221,135
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	44,177,733	107,221,135
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	481,821,724	1,071,947,657

(3)【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当中間計算期間 自 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

区　分	前期 2024年 1月25日現在	当中間計算期間末 2024年 7月25日現在
1.※1　期首元本額	748,968,706円	1,236,364,324円
期中追加設定元本額	787,295,943円	398,958,716円
期中一部解約元本額	299,900,325円	173,591,323円
2.※1　中間計算期間末日における受益権の総数	1,236,364,324口	1,461,731,717口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

前中間計算期間 自 2023年 1月26日 至 2023年 7月25日	当中間計算期間 自 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
該当事項はありません。	同　左

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区　分	前期 2024年 1月25日現在	当中間計算期間末 2024年 7月25日現在
1.　中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2.　時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（1口当たり情報に関する注記）

前期 2024年 1月25日現在	当中間計算期間末 2024年 7月25日現在
1口当たり純資産額 1.6078円 （1万口当たり純資産額 16,078円）	1口当たり純資産額 1.7333円 （1万口当たり純資産額 17,333円）

（ご参考）

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

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

「ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区　　分	注記番号	2024年 1月25日現在 金額（円）	2024年 7月25日現在 金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,927,488,425	3,980,975,977
株式	※2	57,153,417,110	67,654,990,260
派生商品評価勘定		238,725,500	71,200
未収配当金		76,149,950	78,697,418
未収利息		—	7,411
前払金		—	23,051,500
流動資産合計		61,395,780,985	71,737,793,766
資産合計		61,395,780,985	71,737,793,766
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		24,400	148,019,600
前受金		240,970,600	—
未払解約金		99,029,469	81,455,597
未払利息		1,762	—
流動負債合計		340,026,231	229,475,197
負債合計		340,026,231	229,475,197
純資産の部			
元本等			
元本	※1	26,182,773,837	28,322,908,375
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		34,872,980,917	43,185,410,194
元本等合計		61,055,754,754	71,508,318,569
純資産合計		61,055,754,754	71,508,318,569
負債純資産合計		61,395,780,985	71,737,793,766

(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 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2024年 1月25日現在	2024年 7月25日現在
1.※1　本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	23,852,460,915円	26,182,773,837円
同期中における追加設定元本額	9,252,139,772円	4,964,687,986円
同期中における一部解約元本額	6,921,826,850円	2,824,553,448円
同中間期末における元本額	26,182,773,837円	28,322,908,375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＞	6,250,808円	20,560,909円
円資産バランスファンド2019－05＜適格機関投資家限定＞	42,546,714円	150,990,041円
円資産バランスファンド2019－09＜適格機関投資家限定＞	35,916,299円	118,207,384円
円資産バランスファンド2019－12＜適格機関投資家限定＞	46,008,342円	151,399,378円
東京海上セレクション・日本株ＴＯＰＩＸ	17,768,224,715円	18,392,016,787円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	3,711,227円	9,789,674円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	481,270,679円	551,107,126円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	277,141,805円	329,117,852円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	181,498,545円	215,167,288円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	306,236,025円	340,353,840円
ＴＭＡ日本株式インデックスＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,063,320,955円	1,188,032,625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＞	304,257,874円	297,334,068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＞	2,132,302,054円	2,199,749,069円

	東京海上・ＴＯＰＩＸインデックスファンド＜適格機関投資家限定＞	3,435,130,500円	4,048,607,563円
	円資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞	29,762,003円	94,132,010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）	69,195,292円	216,342,761円
	計	26,182,773,837円	28,322,908,375円
2.※1	本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	26,182,773,837口	28,322,908,375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 1,304,250,000円	代用有価証券として、担保に供している資産は次のとおりであります。 株式 1,408,500,000円

（注1）＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額
（注2）3.については、決算日現在の代用有価証券の時価額を記載

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区　分	2024年 1月25日現在	2024年 7月25日現在
1.　貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2.　時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

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

（2024年7月25日現在）

（単位：円）

区　分	種　類	契約額等	うち1年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,093,511,500	—	3,945,650,000	△147,861,500
	東証株価指数先物	4,093,511,500	—	3,945,650,000	△147,861,500
合　計		4,093,511,500	—	3,945,650,000	△147,861,500

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報に関する注記）

2024年 1月25日現在		2024年 7月25日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額	2.3319円 23,319円）	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額	2.5248円 25,248円）

「TMA外国債券インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区　分	注記番号	2024年 1月25日現在 金額（円）	2024年 7月25日現在 金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		100,656,584	73,894,579
コール・ローン		47,267,448	57,519,381
国債証券		18,933,471,567	22,463,354,684

未収利息		144,129,802	184,658,909
前払費用		15,722,579	18,627,405
流動資産合計		19,241,247,980	22,798,054,958
資産合計		19,241,247,980	22,798,054,958
負債の部			
流動負債			
未払金		21,186,745	—
未払解約金		31,848,913	33,876,007
未払利息		21	—
流動負債合計		53,035,679	33,876,007
負債合計		53,035,679	33,876,007
純資産の部			
元本等			
元本	※1	9,924,087,582	11,212,755,753
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		9,264,124,719	11,551,423,198
元本等合計		19,188,212,301	22,764,178,951
純資産合計		19,188,212,301	22,764,178,951
負債純資産合計		19,241,247,980	22,798,054,958

(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 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
2．デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分		2024年 1月25日現在	2024年 7月25日現在
1.※1	本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	7,737,975,705円	9,924,087,582円
	同期中における追加設定元本額	3,322,941,314円	2,084,066,518円
	同期中における一部解約元本額	1,136,829,437円	795,398,347円
	同中間期末における元本額	9,924,087,582円	11,212,755,753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	5,985,783,289円	6,429,851,877円
	東京海上・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）	402,858,872円	811,831,704円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	183,626,027円	228,294,757円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	99,133,432円	127,820,434円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	62,954,554円	81,034,429円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	100,152,462円	124,414,169円
	ＴＭＡ外国債券インデックスＶＡ＜適格機関投資家限定＞	20,115,363円	9,537,052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＞	681,108,831円	723,277,024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＞	2,388,354,752円	2,676,694,307円
	計	9,924,087,582円	11,212,755,753円
2.※1	本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	9,924,087,582口	11,212,755,753口

（注）＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区　分	2024年 1月25日現在	2024年 7月25日現在
1.　貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2.　時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。	(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。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）
取引の時価等に関する事項
（2024年1月25日現在）
該当事項はありません。

（2024年7月25日現在）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2024年 1月25日現在		2024年 7月25日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額	1.9335円 19,335円）	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額	2.0302円 20,302円）

「TMA外国株式インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区　　分	注記番号	2024年 1月25日現在 金額（円）	2024年 7月25日現在 金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		55,734,413	1,116,101,338
コール・ローン		500,801,455	704,991,696
株式		190,082,847,206	244,959,703,552
投資証券		3,813,498,630	4,724,910,962
派生商品評価勘定		27,773,053	23,735
未収入金		1,395,441,206	—
未収配当金		127,038,297	148,368,208
未収利息		—	1,312
差入委託証拠金		1,624,275,010	2,036,690,339

流動資産合計		197,627,409,270	253,690,791,142
資産合計		197,627,409,270	253,690,791,142
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,127,155	59,708,531
未払金		—	7,241
未払解約金		934,624,097	191,934,585
未払利息		224	—
流動負債合計		937,751,476	251,650,357
負債合計		937,751,476	251,650,357
純資産の部			
元本等			
元本	※1	35,343,594,383	39,629,428,408
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		161,346,063,411	213,809,712,377
元本等合計		196,689,657,794	253,439,140,785
純資産合計		196,689,657,794	253,439,140,785
負債純資産合計		197,627,409,270	253,690,791,142

(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 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2024年 1月25日現在	2024年 7月25日現在
1.※1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	26,873,327,459円	35,343,594,383円
同期中における追加設定元本額	12,293,130,413円	6,277,172,163円
同期中における一部解約元本額	3,822,863,489円	1,991,338,138円
同中間期末における元本額	35,343,594,383円	39,629,428,408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	11,397,249,258円	12,743,536,964円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）	144,735,796円	253,625,121円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	198,135,559円	214,026,889円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	114,095,210円	127,818,821円

	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	74,722,237円	83,565,698円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	126,076,990円	132,187,737円
	ＴＭＡ外国株式インデックスＶＡ＜適格機関投資家限定＞	5,995,329円	1,286,557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＞	206,096,641円	188,740,257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＞	1,733,876,818円	1,676,336,915円
	先進国株式インデックス（適格機関投資家専用）	2,143,061,739円	2,376,009,685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＞	19,199,548,806円	21,832,293,764円
	計	35,343,594,383円	39,629,428,408円
2.※1	本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	35,343,594,383口	39,629,428,408口

（注）＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区　分	2024年 1月25日現在	2024年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）
取引の時価等に関する事項
(1) 株式関連
（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	株価指数先物取引				
	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

（2024年7月25日現在）

（単位：円）

区　分	種　類	契約額等	うち1年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,789,628,797	—	3,729,952,136	△59,676,661
	S&P 500 EMIN	2,946,214,296	—	2,895,191,423	△51,022,873
	DJ EU STX 50	551,073,962	—	544,317,968	△6,755,994
	FTSE 100 IDX	292,340,539	—	290,442,745	△1,897,794
合　計		3,789,628,797	—	3,729,952,136	△59,676,661

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

(2) 通貨関連
（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

（2024年7月25日現在）

（単位：円）

区　分	種　類	契約額等	うち1年超	時　価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	359,222,760	—	359,214,625	△8,135
	米ドル	275,887,800	—	275,881,500	△6,300
	加ドル	19,419,400	—	19,418,875	△525
	ユーロ	19,940,760	—	19,940,256	△504
	英ポンド	4,941,950	—	4,941,907	△43
	スイスフラン	19,928,350	—	19,928,062	△288
	豪ドル	19,104,500	—	19,104,025	△475
合　計		359,222,760	—	359,214,625	△8,135

(注)1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

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

2024年 1月25日現在		2024年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	5.5651円	1口当たり純資産額	6.3952円
（1万口当たり純資産額	55,651円）	（1万口当たり純資産額	63,952円）

「TMA日本債券インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区　分	注記番号	2024年 1月25日現在 金額（円）	2024年 7月25日現在 金額（円）

資産の部			
流動資産			
コール・ローン		**81,185,249**	**114,612,885**
国債証券		**25,142,469,150**	**28,138,362,360**
地方債証券		**1,468,338,556**	**1,451,803,836**
特殊債券		**199,346,000**	**98,379,000**
社債券		**1,425,686,907**	**1,306,259,971**
未収利息		**42,181,439**	**46,506,143**
前払費用		**1,424,753**	**2,855,254**
流動資産合計		**28,360,632,054**	**31,158,779,449**
資産合計		**28,360,632,054**	**31,158,779,449**
負債の部			
流動負債			
未払金		**33,857,110**	**—**
未払解約金		**38,497,088**	**87,861,905**
未払利息		**36**	**—**
流動負債合計		**72,354,234**	**87,861,905**
負債合計		**72,354,234**	**87,861,905**
純資産の部			
元本等			
元本	**※1**	**23,129,731,957**	**25,986,838,508**
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		**5,158,545,863**	**5,084,079,036**
元本等合計		**28,288,277,820**	**31,070,917,544**
純資産合計		**28,288,277,820**	**31,070,917,544**
負債純資産合計		**28,360,632,054**	**31,158,779,449**

(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 2024年 1月26日 至 2024年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分		2024年 1月25日現在	2024年 7月25日現在
1.※1	本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	21,374,821,874円	23,129,731,957円
	同期中における追加設定元本額	6,357,708,643円	4,395,758,333円
	同期中における一部解約元本額	4,602,798,560円	1,538,651,782円
	同中間期末における元本額	23,129,731,957円	25,986,838,508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＞	301,797,247円	304,616,680円
	円資産バランスファンド2019－05＜適格機関投資家限定＞	2,215,804,553円	2,236,967,504円
	円資産バランスファンド2019－09＜適格機関投資家限定＞	1,734,086,242円	1,751,281,579円
	円資産バランスファンド2019－12＜適格機関投資家限定＞	2,221,343,394円	2,243,031,964円
	東京海上セレクション・日本債券インデックス	4,565,507,914円	4,729,492,762円
	東京海上・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）	622,696,317円	1,429,505,326円
	東京海上・円資産インデックスバランスファンド	143,555,484円	163,622,000円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	850,660,190円	1,205,930,012円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	398,009,076円	585,165,905円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	233,314,011円	342,442,407円
	東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	309,307,029円	481,946,252円
	ＴＭＡ日本債券インデックスＶＡ＜適格機関投資家限定＞	27,956,462円	14,206,087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＞	1,049,847,957円	1,254,534,306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＞	3,681,618,910円	4,644,310,137円
	円資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞	1,436,948,709円	1,394,596,926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）	3,337,278,462円	3,205,188,661円
計	23,129,731,957円	25,986,838,508円
2.※1 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	23,129,731,957口	25,986,838,508口

（注）＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区　分	2024年 1月25日現在	2024年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（1口当たり情報に関する注記）

2024年 1月25日現在	2024年 7月25日現在
1口当たり純資産額　1.2230円 （1万口当たり純資産額　12,230円）	1口当たり純資産額　1.1956円 （1万口当たり純資産額　11,956円）

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

2024年7月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	4,740,056,578 円
Ⅱ　負債総額	4,272,090 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,735,784,488 円
Ⅳ　発行済数量	2,927,571,996 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6176 円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

2024年7月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	2,660,826,435 円
Ⅱ　負債総額	5,408,004 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,655,418,431 円
Ⅳ　発行済数量	1,597,878,935 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6618 円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

2024年7月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	1,686,841,837 円
Ⅱ　負債総額	1,443,155 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,685,398,682 円
Ⅳ　発行済数量	990,714,084 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7012 円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

2024年7月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	2,586,821,775 円
Ⅱ　負債総額	7,198,911 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,579,622,864 円
Ⅳ　発行済数量	1,474,416,093 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7496 円

（ご参考：親投資信託の現況）

ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド

2024年7月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	74,660,750,824 円

Ⅱ　負債総額	352,789,997 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	74,307,960,827 円
Ⅳ　発行済数量	28,534,323,820 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.6042 円

ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド

2024年7月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	23,019,221,020 円
Ⅱ　負債総額	121,794,297 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	22,897,426,723 円
Ⅳ　発行済数量	11,272,847,382 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0312 円

ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド

2024年7月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	253,493,608,648 円
Ⅱ　負債総額	227,695,413 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	253,265,913,235 円
Ⅳ　発行済数量	39,755,808,214 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	6.3705 円

ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド

2024年7月31日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	31,755,423,388 円
Ⅱ　負債総額	612,435,029 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	31,142,988,359 円
Ⅳ　発行済数量	26,048,460,647 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1956 円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

１．名義書換
該当事項はありません。

２．受益者に対する特典
特典はありません。

３．内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

４．受益権の譲渡
① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

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

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

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

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

2024年７月末日現在、資本金の額は20億円です。なお、会社の発行可能株式総数は160,000株であり、38,300株を発行済みです。最近５年間における資本金の額の増減はありません。

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

投資信託の投資運用の意思決定プロセスは以下の通りです。

①運用本部で運用計画案、収益分配方針案等の運用の基本方針案を作成します。
②運用の基本方針は、運用本部長を委員長とする投資政策委員会で投資環境見通し等をふまえて決定されます。
③決定された運用の基本方針に基づき、具体的運用計画を策定し、運用を行います。
④売買の執行はトレーディング部が行います。
⑤運用部門とは独立した運用リスク管理部門にて運用評価、ガイドライン遵守状況のチェックを行い、運用リスク管理部門担当役員を委員長としリスク管理部を事務局とする運用管理委員会に結果報告します。
⑥運用管理委員会から投資政策委員会へ運用評価、ガイドライン遵守状況がフィードバックされ次の基本方針決定に生かされます。

２【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年７月末日現在、委託会社が運用を行っている証券投資信託（親投資信託を除きます。）は次の通りです。

	本数	純資産総額（百万円）
追加型公社債投資信託	0	0
追加型株式投資信託	167	2,914,598
単位型公社債投資信託	1	2,660
単位型株式投資信託	17	84,517
合計	185	3,001,776

3【委託会社等の経理状況】

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

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第39期事業年度（2023年４月１日から2024年３月31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。

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

(1)【貸借対照表】

（単位：千円）

	第38期 （2023年３月31日現在）		第39期 （2024年３月31日現在）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		20,784,858		20,242,052
前払費用		427,401		523,560
未収委託者報酬		3,200,726		3,523,505
未収収益		3,021,468		4,088,251
未収入金		4		-
その他の流動資産		18,592		26,495
流動資産計		27,453,052		28,403,865
固定資産				
有形固定資産	＊1	433,750	＊1	631,543
建物		307,934		434,854
器具備品		125,816		196,689
無形固定資産		348,422		397,761
電話加入権		3,795		3,795
ソフトウエア		314,954		372,797
ソフトウエア仮勘定		29,672		21,168
投資その他の資産		3,508,324		3,566,905
投資有価証券		48,291		49,108
関係会社株式		1,668,529		1,668,529
その他の関係会社有価証券		520,000		80,000
長期前払費用		30,700		16,227
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		954,048		1,257,485
投資損失引当金		△ 208,800		-
固定資産計		4,290,497		4,596,210
資産合計		31,743,550		33,000,075
負債の部				
流動負債				
未払金		3,477,655		4,260,390
未払手数料		1,464,843		1,583,647
その他未払金		2,012,811		2,676,743
未払費用		335,471		321,531
未払消費税等		266,103		420,603
未払法人税等		1,210,000		1,391,000
預り金		60,297		72,829
前受収益		2,579		2,583
賞与引当金		288,706		296,807
その他の流動負債		8		24
流動負債計		5,640,822		6,765,771
固定負債				
退職給付引当金		886,720		927,210
固定負債計		886,720		927,210
負債合計		6,527,543		7,692,982
純資産の部				
株主資本		25,210,382		25,296,494
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		22,810,382		22,896,494
利益準備金		500,000		500,000
その他利益剰余金		22,310,382		22,396,494
繰越利益剰余金		22,310,382		22,396,494

評価・換算差額等	5,624	10,599
その他有価証券評価差額金	5,624	10,599
純資産合計	25,216,006	25,307,093
負債・純資産合計	31,743,550	33,000,075

(2)【損益計算書】

（単位：千円）

		第38期 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	第39期 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
営業収益			
委託者報酬		16,696,838	16,958,564
運用受託報酬		11,663,951	13,291,669
投資助言報酬		92,682	107,390
その他営業収益		661,029	678,515
営業収益計		29,114,502	31,036,140
営業費用			
支払手数料		7,669,451	7,801,482
広告宣伝費		206,908	203,242
調査費		7,435,066	8,650,200
調査費		2,823,854	3,298,847
委託調査費		4,611,211	5,351,353
委託計算費		119,180	116,944
営業雑経費		265,287	263,317
通信費		60,267	57,380
印刷費		160,147	157,178
協会費		23,883	24,327
諸会費		12,732	15,737
図書費		8,256	8,693
営業費用計		15,695,895	17,035,188
一般管理費			
給料		3,883,418	4,075,417
役員報酬		83,430	82,371
給料・手当		2,848,648	3,010,062
賞与		951,339	982,983
交際費		13,259	25,693
寄付金		4,696	9,893
旅費交通費		140,480	162,304
租税公課		174,372	246,078
不動産賃借料		468,091	468,091
退職給付費用		163,194	178,404
賞与引当金繰入		288,706	296,807
固定資産減価償却費		165,502	247,247
法定福利費		629,504	686,198
福利厚生費		10,617	14,385
諸経費		503,320	642,231
一般管理費計		6,445,164	7,052,753
営業利益		6,973,442	6,948,198
営業外収益			
受取利息		189	185
受取配当金	＊１	4,304	1,238
雑益		13,722	15,069
営業外収益計		18,216	16,493
営業外費用			
為替差損		54,263	80,542
雑損		9,120	15,415
営業外費用計		63,383	95,958
経常利益		6,928,275	6,868,734
特別利益			

投資有価証券売却益	480	829
その他特別利益	-	402
特別利益計	480	1,232
特別損失		
固定資産除却損	190	30,348
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	382
特別損失計	209,884	30,731
税引前当期純利益	6,718,870	6,839,235
法人税、住民税及び事業税	2,220,524	2,410,514
法人税等調整額	△ 149,911	△ 305,632
法人税等合計	2,070,612	2,104,882
当期純利益	4,648,257	4,734,352

(3)【株主資本等変動計算書】

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

第39期（自　2023年４月１日　至　2024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	22,310,382
当期変動額					
剰余金の配当					△ 4,648,241
当期純利益					4,734,352
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	-	86,111
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	22,396,494

	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
当期変動額					
剰余金の配当	△ 4,648,241	△ 4,648,241			△ 4,648,241
当期純利益	4,734,352	4,734,352			4,734,352
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			4,974	4,974	4,974
当期変動額合計	86,111	86,111	4,974	4,974	91,086
当期末残高	22,896,494	25,296,494	10,599	10,599	25,307,093

注記事項

（重要な会計方針）

第39期（自　2023年４月１日　至　2024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

① 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）

② 市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

２．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

(2) 無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当期負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

① 退職給付見込額の期間帰属方法

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

② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

４．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38期 2023年３月31日現在	第39期 2024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38期 2023年３月31日現在	第39期 2024年３月31日現在
＊１．有形固定資産の減価償却累計額は次のとおりであります。 建物　217,486千円 器具備品　477,945千円	＊１．有形固定資産の減価償却累計額は次のとおりであります 建物　245,354千円 器具備品　481,065千円

（損益計算書関係）

第38期 自　2022年４月１日 至　2023年３月31日	第39期 自　2023年４月１日 至　2024年３月31日
＊１．関係会社との主な取引高は次のとおりであります。 関係会社からの受取配当金 3,605千円 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。	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9,623千円であります。

（株主資本等変動計算書関係）

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) 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

第39期（自　2023年４月１日　至　2024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	2023年４月１日現在	増加	減少	2024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

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

(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

2024年６月26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	3,787,448千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) １株当たり配当額	98,889円
(ニ) 基準日	2024年３月31日
(ホ) 効力発生日	2024年６月26日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

第38期 自　2022年４月１日 至　2023年３月31日	第39期 自　2023年４月１日 至　2024年３月31日
(1) 金融商品に対する取組方針 当社の資本は本来の事業目的のために使用することを基本とし、資産の運用に際しては、資産運用リスクを極力最小限に留めることを基本方針としております。	(1) 金融商品に対する取組方針 同左
(2) 金融商品の内容及びそのリスク 営業債権である未収収益は顧客の信用リスクに晒されており、未収委託者報酬は市場リスクに晒されております。投資有価証券は、主にファンドの自己設定に関連する投資信託であり、基準価額の変動リスクに晒されております。 営業債務である未払金は、ほとんど１年以内の支払期日であり、流動性リスクに晒されております。	(2) 金融商品の内容及びそのリスク 同左
(3) 金融商品に係るリスク管理体制 ① 信用リスク 未収収益については、管理部門において取引先ごとに期日及び残高を把握することで、回収懸念の早期把握や軽減を図っております。	(3) 金融商品に係るリスク管理体制 ① 信用リスク 同左
② 市場リスク 未収委託者報酬には、運用資産の悪化から回収できず当社が損失を被るリスクが存在しますが、過去の回収実績からリスクは僅少であると判断しております。 投資有価証券については、管理部門において定期的に時価を把握する体制としております。	② 市場リスク 同左
③ 流動性リスク 当社は、日々資金残高管理を行っており流動性リスクを管理しております。	③ 流動性リスク 同左

２．金融商品の時価等に関する事項

第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

第39期（2024年３月31日現在）

2024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	49,108	49,108	-
敷金	474,324	472,538	△1,786
資産計	523,432	521,646	△1,786

（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
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	80,000

（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	-	18,872	1,912	1,101
合計	-	18,872	1,912	1,101

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			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
投資有価証券 その他有価証券	-	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			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
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。

第39期（2024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			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
投資有価証券 　その他有価証券	-	49,108	-	49,108
資産計	-	49,108	-	49,108

(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			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
敷金	-	472,538	-	472,538
資産計	-	472,538	-	472,538

（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38期 2023年３月31日現在	第39期 2024年３月31日現在
１．子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券 子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額　子会社株式1,640,302千円、関連会社株式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）	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　80,000千円）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）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
①貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 証券投資信託	27,605	18,645	8,960
②貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 証券投資信託	20,685	21,539	△853
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。

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。

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
①貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 証券投資信託	37,893	20,877	17,015
②貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 証券投資信託	11,214	12,953	△1,738
合計	49,108	33,831	15,277

3．当事業年度中に売却したその他有価証券
（単位：千円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	5,767	829	-
合計	5,767	829	-

4．減損処理を行った有価証券
該当事項はありません。

（収益認識関係）

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。

第39期（自　2023年４月１日　至　2024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	16,958,564	-	16,958,564
運用受託報酬	12,488,818	802,851	13,291,669
投資助言報酬	107,390	-	107,390
その他営業収益	678,515	-	678,515
合計	30,233,289	802,851	31,036,140

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）　6,222,195千円

顧客との契約から生じた債権（期末残高）　7,611,757千円

（＊）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。

第39期（自　2023年４月１日　至　2024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	869,667千円
勤務費用	73,630千円
利息費用	6,822千円
数理計算上の差異の発生額	29,062千円
退職給付の支払額	△38,184千円
退職給付債務の期末残高	940,999千円

(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	940,999千円
未積立退職給付債務	940,999千円
未認識数理計算上の差異	△13,789千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	927,210千円

退職給付引当金	927,210千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	927,210千円

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	73,630千円
利息費用	6,822千円
数理計算上の差異の費用処理額	△1,778千円
その他	10,687千円

確定給付制度に係る退職給付費用　　89,362千円

(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　　0.9%

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、89,041千円であります。

（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38期 （2023年３月31日現在）	第39期 （2024年３月31日現在）
繰延税金資産		
退職給付引当金	271,513千円	283,911千円
未払金	2,092千円	3,362千円
賞与引当金	88,401千円	90,882千円
未払法定福利費	11,663千円	12,359千円
未払事業所税	3,929千円	4,097千円
未払事業税	64,984千円	73,982千円
未払調査費	102,531千円	108,813千円
減価償却超過額	24,211千円	7,259千円
繰延資産超過額	9,605千円	12,236千円
未払確定拠出年金	2,120千円	2,331千円
未収実績連動報酬	48,549千円	264,384千円
投資損失引当金	63,934千円	-
未払費用	267,102千円	404,707千円
繰延税金資産小計	960,642千円	1,268,329千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	960,642千円	1,268,329千円
繰延税金負債		
前払費用	4,110千円	6,166千円
その他有価証券評価差額金	2,482千円	4,677千円
繰延税金負債合計	6,593千円	10,844千円
繰延税金資産の純額	954,048千円	1,257,485千円

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38期 （2023年３月31日現在）	第39期 （2024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、前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）を前事業年度の期首から適用しています。

（セグメント情報等）

<table>
<tr><th>第38期
自　2022年４月１日
至　2023年３月31日</th><th>第39期
自　2023年４月１日
至　2024年３月31日</th></tr>
<tr><td>[セグメント情報]
当社は「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として運用（投資運用業）を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。

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

[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）
<table><tr><th>日本</th><th>その他</th><th>合計</th></tr><tr><td>25,542,522</td><td>3,571,980</td><td>29,114,502</td></tr></table>(注) 営業収益は顧客の所在地を基準とし、国ごとに分類しております。

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

３．主要な顧客ごとの情報
(1) 投資信託の名称
東京海上・円資産バランスファンド（毎月決算型）

(2) 委託者報酬
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</td><td>[セグメント情報]
同左

[関連情報]
１．製品及びサービスごとの情報
同左

２．地域ごとの情報
(1) 営業収益
（単位：千円）
<table><tr><th>日本</th><th>その他</th><th>合計</th></tr><tr><td>27,411,151</td><td>3,624,988</td><td>31,036,140</td></tr></table>(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
3,106,318千円

(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</td></tr>
</table>

（関連当事者情報）

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。

第39期（自　2023年４月１日　至　2024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

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権の所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社をもつ会社	東京海上日動火災保険株式会社	東京都千代田区	101,994,694千円	損害保険業	なし	投資信託の取扱 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払	1,337,087千円	未払手数料	450,379千円

（注）＊取引価格については、市場実勢等を勘案し、交渉の上決定しております。
＊取引金額には、消費税等は含まれておりません。

(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

第39期 自　2023年４月１日 至　2024年３月31日	
１株当たり純資産額	660,759円61銭
１株当たり当期純利益金額	123,612円34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	25,307,093千円
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	25,307,093千円
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	4,734,352千円
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	4,734,352千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

4【利害関係人との取引制限】

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

①自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

②運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

③通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。

④委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

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

・資本金の額　　324,279百万円（2024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（2024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。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	135,000百万円	
株式会社ＳＢＩ証券	54,323百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	13,195百万円	
楽天証券株式会社	19,495百万円(注)	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社群馬銀行	48,652百万円	
株式会社八十二銀行	52,243百万円	
株式会社北洋銀行	121,101百万円	
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

（※）2024年３月末日現在。
（注）2023年12月末日現在。

２【関係業務の概要】

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

３【資本関係】

資本関係はありません。

第３【その他】

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

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2024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 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

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2024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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

（注）　１．上記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ターゲット・イヤー・ファンド2035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、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035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 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ターゲット・イヤー・ファンド2045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、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045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 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ターゲット・イヤー・ファンド2055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、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055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 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ターゲット・イヤー・ファンド2065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、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065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

2024年10月4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　奈良　将太朗

中間監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035の2024年1月26日から2024年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035の2024年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年1月26日から2024年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

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

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

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

諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以　上

（注）1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2024年10月4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　奈良　将太朗

中間監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045の2024年1月26日から2024年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045の2024年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年1月26日から2024年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

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

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

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

諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以　上

（注）1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2024年10月4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　奈良　将太朗

中間監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055の2024年1月26日から2024年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055の2024年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年1月26日から2024年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

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

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

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

諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以　上

（注）1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2024年10月4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　奈良　将太朗

中間監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065の2024年1月26日から2024年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065の2024年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年1月26日から2024年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

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

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

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

諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以　上

（注）1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。