

【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】	2025年 4 月25日
【発行者名】	東京海上アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 横田 靖博
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目 8 番 2 号
【事務連絡者氏名】	尾崎 正幸
【電話番号】	0 3 - 3 2 1 2 - 8 4 2 1
【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・円資産インデックスバランスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	上限 1 兆円
【縦覧に供する場所】	該当なし

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

東京海上・円資産インデックスバランスファンド

愛称を「つみたて円奏会」とします。

上記を以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

当初の1口当たり元本は1円です。

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額

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】

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。

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。

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】

2025年4月26日から2025年10月24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】

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。

基本的性格

当ファンドは、追加型投信／国内／資産複合に属します。

当ファンドの商品分類表および属性区分表は、以下の通りです。

商品分類表

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

属性区分表

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

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

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

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

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

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

信託金の限度額

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

ファンドの特色

1

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

2

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

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

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



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

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

次ページへ続く

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

● 価格変動リスクとは

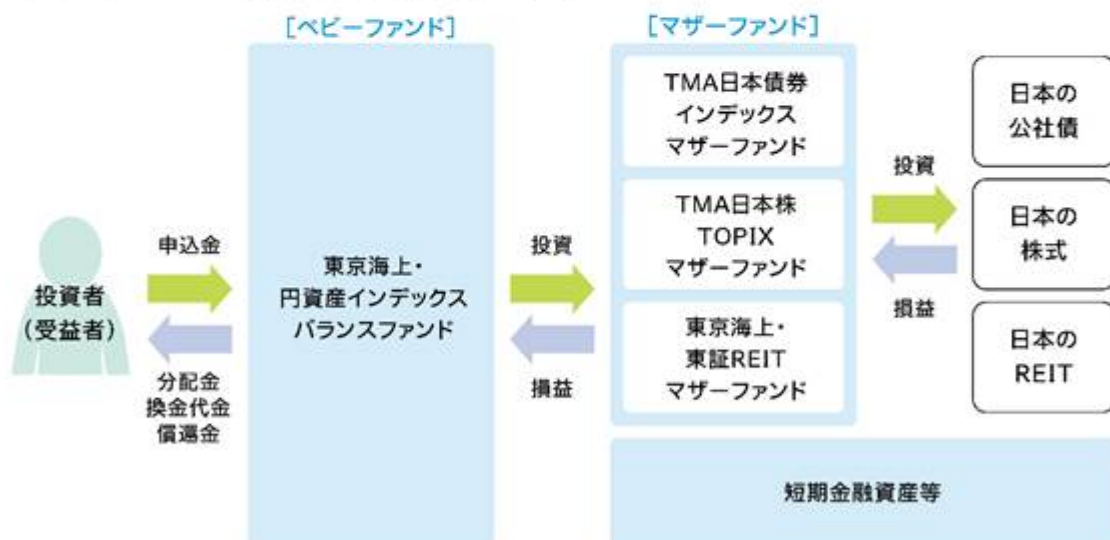
価格が下落した場合だけでなく、上昇した場合も含めた「値動きの振れ幅の程度」をいいます。リスクの大小を数値で表す場合、一般的には「標準偏差」を用います。標準偏差とは、価格の変化率（リターン）のばらつき度合いを示す指標です。標準偏差が小さいほど値動きが緩やかでリスクは小さく、標準偏差が大きいほど値動きは荒くリスクが大きいことを示します。

＜各マザーファンドが対象とする指数について＞

- NOMURA-BPI(総合)とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下、NFRCといいます。))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。
- 配当込みTOPIX(以下「TOPIX(配当込み)」といいます。))は、株式会社J P X総研が算出する株価指数であり、日本の株式市場を広くに網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。TOPIX(配当込み)の指数値およびTOPIX(配当込み)にかかる標準または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」といいます。))の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIX(配当込み)に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX(配当込み)にかかる標準または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、TOPIX(配当込み)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。
- 配当込み東証REIT指数(以下「東証REIT指数(配当込み)」といいます。))は、株式会社J P X総研が算出する株価指数であり、東証市場に上場するREIT全銘柄を対象とした浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。東証REIT指数(配当込み)の指数値および東証REIT指数(配当込み)にかかる標準または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」といいます。))の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等東証REIT指数(配当込み)に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数(配当込み)にかかる標準または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、東証REIT指数(配当込み)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

ファンドの仕組み

- ファミリーファンド方式により運用を行います。



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

次ページへ続く

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

主な投資制限

株 式	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
デリバティブ等	デリバティブ取引等は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

分配方針

◎年1回決算を行います。

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

《イメージ図》

決 算	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
分 配												

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

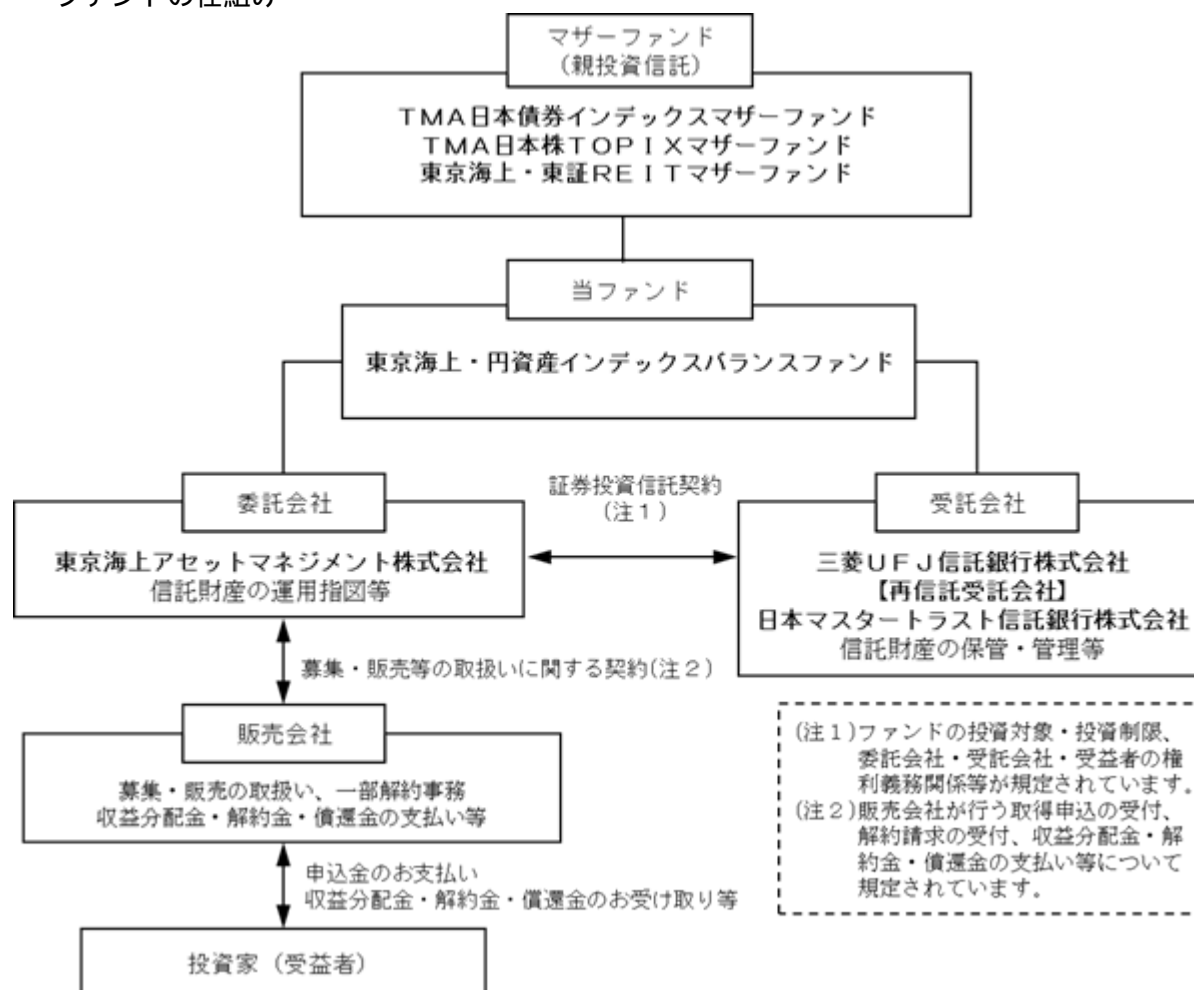
資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2017年10月11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】

ファンドの仕組み



委託会社の概況

- ・名称 東京海上アセットマネジメント株式会社
- ・資本金の額 20億円（2025年1月末日現在）
- ・会社の沿革

1985年12月 東京海上グループ（現：東京海上日動グループ）等の出資により、資産運用ビジネスの戦略的位置付けで、東京海上エム・シー投資顧問株式会社の社名にて資本金2億円で設立

1987年2月 投資顧問業者として登録

同年6月 投資一任業務認可取得

1991年4月 国内および海外年金の運用受託を開始

1998年5月 東京海上アセットマネジメント投信株式会社に社名変更し、投資信託法上の委託会社としての免許取得

2007年9月 金融商品取引業者として登録

2014年4月 東京海上アセットマネジメント株式会社に社名変更

2018年10月 東京海上不動産投資顧問株式会社と合併

- ・大株主の状況（2025年1月末日現在）

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 主要投資対象

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

TMA日本債券インデックスマザーファンド受益証券

TMA日本株TOPIXマザーファンド受益証券

東京海上・東証REITマザーファンド受益証券

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

原則として月次でリバランスを実施します。

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

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

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

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

2．運用方法**(1) 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

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

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

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

(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

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

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

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

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。

東京海上・東証REITマザーファンド**1．基本方針**

東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果の達成を目標とします。

2．運用方法**(1) 主要投資対象**

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

(2) 投資態度

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

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

原則として、REITへの組入比率を高位に維持します。

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) 株式への直接投資は行いません。

(2) 外貨建資産への直接投資は行いません。

(3) 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

(6) 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、35%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」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日本株TOPIXマザーファンド」の運用にあたっては、TOPIX（東証株価指数）採用銘柄から時価総額・業種別構成比率等を勘案し、層化抽出法を用いてTOPIX（配当込み）に連動するようポートフォリオを構築します。

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

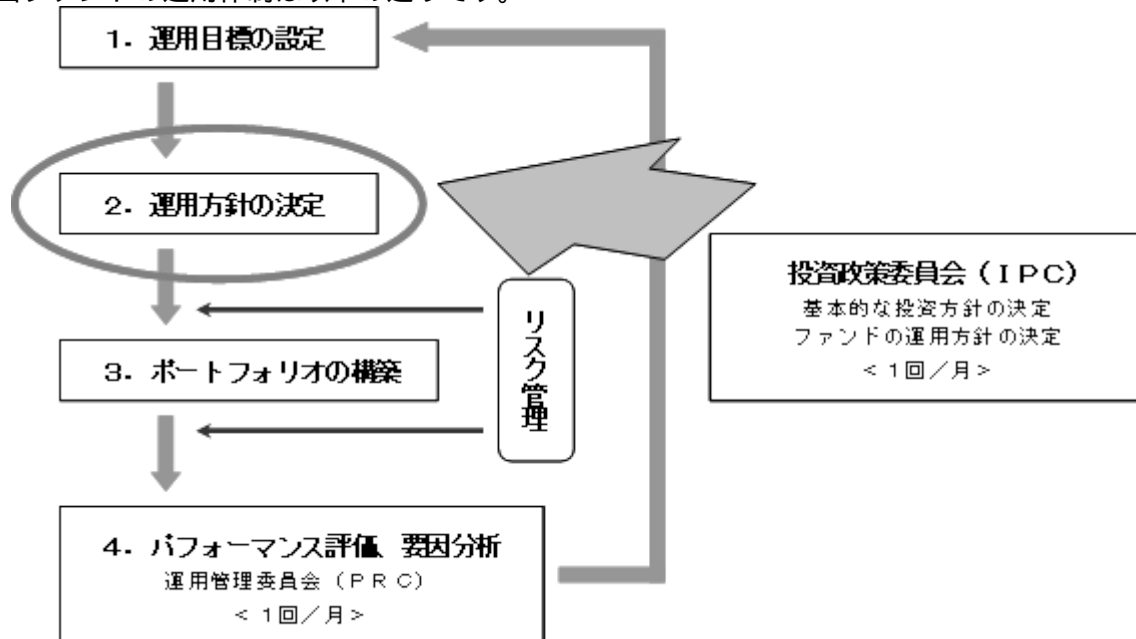
(2)【投資対象】

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

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

(3)【運用体制】

当ファンドの運用体制は以下の通りです。



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

運用におけるリスク管理は、運用リスク管理部門（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、2025年1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。

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。

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】

運用の基本方針に基づく制限（約款別紙「運用の基本方針」）

- a. 委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドに属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。

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

- b. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドに属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

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

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

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

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

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

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

投資する株式等の範囲（約款）

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

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

信用取引（約款）

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

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

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

先物取引等（約款）

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

スワップ取引（約款）

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

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。

デリバティブ取引等に係る投資制限（約款）

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

有価証券の貸付（約款）

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

有価証券の空売（約款）

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

有価証券の借入（約款）

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入の指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入を行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、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。

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款）

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

外国為替予約取引（約款）

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

信用リスク集中回避のための投資制限（約款）

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

資金の借入（約款）

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

3【投資リスク】

1．投資リスク

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

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。

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。

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

金利変動リスク

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

信用リスク

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

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

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

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

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。

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度が小さかった場合も同様です。

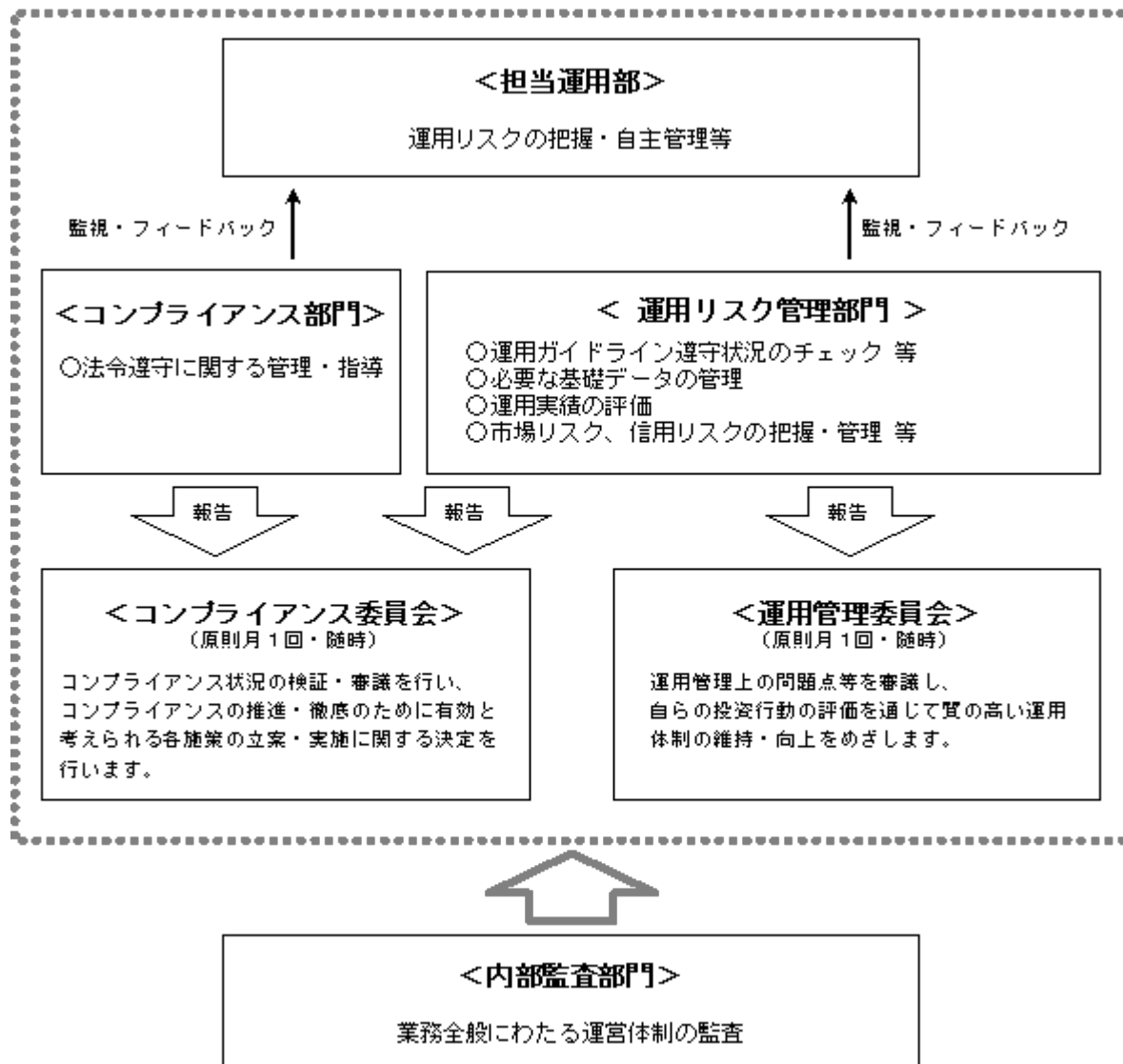
3．管理体制

<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

2020年2月～2025年1月

ファンドの年間騰落率および
分配金再投資基準価額の推移

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



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

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

ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較

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



※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

代表的な資産クラスと指数名

日本株 TOPIX (東証株価指数) (配当込み)

先進国株 MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ベース)

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

日本国債 NOMURA-BPI (国債)

先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

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

指数について

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

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

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

無手数料とします。

(2)【換金（解約）手数料】

換金（解約）手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

委託会社、販売会社および受託会社の信託報酬の総額は信託財産の純資産総額に対し、年率0.418%（税抜0.38%）を乗じて得た金額とし、計算期間を通じて、毎日計上します。

の信託報酬（消費税および地方消費税（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。

信託報酬の配分については以下の通りとします。

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

*1 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価

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

*3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（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。

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。

また、当ファンドが実質的に投資するREITについては、市場の需給等により価格形成されるため、REITの費用は表示していません。

(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、2025年1月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容等が変更される場合があります。

（参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間（以下「当期間」といいます。）（2024年1月26日～2025年1月27日）におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

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

（比率は年率、表示桁数未満を四捨五入）

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

※入手し得る情報において計算に含まれていない費用はありません。

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

※詳細につきましては、当期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

5【運用状況】

以下は2025年1月31日現在の運用状況です。

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

(1)【投資状況】

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	284,513,682	91.26
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		27,241,908	8.73
合計（純資産総額）		311,755,590	100.00

（ご参考：親投資信託の投資状況）

当ファンドが主要投資対象とする親投資信託の投資状況は以下の通りです。

TMA日本株TOPIXマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	72,438,649,220	94.75
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		4,013,524,067	5.24
合計（純資産総額）		76,452,173,287	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	地域	時価（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	3,935,310,000	5.14

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

TMA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	28,725,456,640	90.05
地方債証券	日本	1,535,877,976	4.81
特殊債券	日本	97,704,000	0.30
社債券	日本	1,486,294,835	4.65
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		53,914,015	0.16
合計（純資産総額）		31,899,247,466	100.00

東京海上・東証REITマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	8,977,540,300	97.18
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		260,403,305	2.81
合計（純資産総額）		9,237,943,605	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	255,492,000	2.76

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a. 主要銘柄の明細

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率（％）
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	TMA日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	182,485,374	1.1907	217,285,356	1.1885	216,883,866	69.56
2	東京海上・東証REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	24,528,450	1.3846	33,962,265	1.4014	34,374,169	11.02
3	TMA日本株TOPIXマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	12,642,810	2.6009	32,882,792	2.6304	33,255,647	10.66

b. 投資有価証券の種類

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	91.26
合 計	91.26

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（ご参考：親投資信託の投資資産）

投資有価証券の主要銘柄

a. 主要銘柄の明細

TMA日本株TOPIXマザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率（％）
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	株式	969,500	3,728.77	3,615,044,677	2,973.50	2,882,808,250	3.77
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	1,148,000	1,581.50	1,815,562,000	1,978.50	2,271,318,000	2.97
3	ソニーグループ	日本	電気機器	株式	626,900	2,686.32	1,684,054,008	3,440.00	2,156,536,000	2.82
4	日立製作所	日本	電気機器	株式	472,200	2,879.80	1,359,842,044	3,946.00	1,863,301,200	2.43
5	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	145,600	6,996.70	1,018,719,857	10,930.00	1,591,408,000	2.08
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	372,300	3,025.20	1,126,283,166	3,868.00	1,440,056,400	1.88
7	キーエンス	日本	電気機器	株式	18,300	71,745.79	1,312,948,101	67,250.00	1,230,675,000	1.60
8	任天堂	日本	その他製品	株式	115,000	8,347.09	959,916,427	10,230.00	1,176,450,000	1.53
9	みずほフィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	242,200	3,048.86	738,435,997	4,307.00	1,043,155,400	1.36

10	東京エレクトロン	日本	電気機器	株式	38,700	38,470.11	1,488,793,257	26,205.00	1,014,133,500	1.32
11	伊藤忠商事	日本	卸売業	株式	130,200	6,692.06	871,306,248	7,183.00	935,226,600	1.22
12	東京海上ホールディングス	日本	保険業	株式	176,100	4,852.92	854,600,740	5,160.00	908,676,000	1.18
13	三菱商事	日本	卸売業	株式	357,800	3,515.25	1,257,756,450	2,489.50	890,743,100	1.16
14	三井物産	日本	卸売業	株式	285,000	3,553.58	1,012,770,300	3,086.00	879,510,000	1.15
15	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	90,800	9,240.39	839,028,215	9,411.00	854,518,800	1.11
16	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	5,441,900	177.60	966,494,505	152.70	830,978,130	1.08
17	信越化学工業	日本	化学	株式	164,100	6,786.91	1,113,732,232	4,877.00	800,315,700	1.04
18	ＨＯＹＡ	日本	精密機器	株式	36,000	19,714.44	709,719,868	20,975.00	755,100,000	0.98
19	三菱重工業	日本	機械	株式	324,800	1,374.58	446,466,786	2,296.00	745,740,800	0.97
20	第一三共	日本	医薬品	株式	171,100	4,962.83	849,141,375	4,277.00	731,794,700	0.95
21	ＫＤＤＩ	日本	情報・通信業	株式	134,300	4,533.56	608,857,522	5,186.00	696,479,800	0.91
22	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	159,500	4,358.83	695,234,676	4,209.00	671,335,500	0.87
23	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	428,900	1,865.81	800,248,380	1,478.50	634,128,650	0.82
24	ソフトバンク	日本	情報・通信業	株式	2,895,000	201.45	583,217,754	200.20	579,579,000	0.75
25	ファーストリテイリング	日本	小売業	株式	10,800	45,447.59	490,834,005	51,030.00	551,124,000	0.72
26	セブン&アイ・ホールディングス	日本	小売業	株式	211,800	2,178.03	461,308,184	2,469.50	523,040,100	0.68
27	富士通	日本	電気機器	株式	169,800	2,575.22	437,272,825	3,018.00	512,456,400	0.67
28	アドバンテスト	日本	電気機器	株式	57,500	6,821.41	392,231,184	8,659.00	497,892,500	0.65
29	三菱電機	日本	電気機器	株式	185,600	2,553.39	473,910,074	2,571.50	477,270,400	0.62
30	キャノン	日本	電気機器	株式	90,600	4,518.77	409,400,722	5,018.00	454,630,800	0.59

T M A日本債券インデックスマザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	額面	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
							単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	第356回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2029/09/20	425,000,000	97.45	414,170,200	96.44	409,895,500	1.28
2	第149回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.005	2026/09/20	351,000,000	99.13	347,963,850	98.92	347,240,790	1.08
3	第372回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.800	2033/09/20	355,000,000	99.26	352,378,200	97.40	345,787,750	1.08
4	第373回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.600	2033/12/20	350,000,000	97.25	340,405,960	95.45	334,089,000	1.04
5	第366回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.200	2032/03/20	353,000,000	96.18	339,546,850	94.61	333,998,010	1.04
6	第359回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2030/06/20	342,000,000	97.05	331,911,000	95.82	327,718,080	1.02
7	第354回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2029/03/20	336,000,000	97.85	328,806,240	96.95	325,765,440	1.02
8	第367回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.200	2032/06/20	345,000,000	95.94	330,993,000	94.31	325,369,500	1.01
9	第360回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2030/09/20	326,000,000	96.78	315,525,650	95.58	311,613,620	0.97
10	第358回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2030/03/20	319,000,000	97.06	309,640,650	96.03	306,348,460	0.96

11	第347回利付国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2027/06/20	310,000,000	98.99	306,869,000	98.55	305,511,200	0.95
12	第355回利付国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2029/06/20	313,000,000	97.67	305,713,360	96.69	302,649,090	0.94
13	第357回利付国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2029/12/20	313,000,000	97.33	304,642,900	96.21	301,159,210	0.94
14	第361回利付国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2030/12/20	313,000,000	96.71	302,714,820	95.34	298,439,240	0.93
15	第365回利付国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2031/12/20	316,000,000	95.77	302,633,200	94.23	297,795,240	0.93
16	第370回利付国債（10年）	日本	国債証券	0.500	2033/03/20	310,000,000	97.34	301,759,700	95.59	296,350,700	0.92
17	第362回利付国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2031/03/20	311,000,000	96.49	300,085,100	95.08	295,701,910	0.92
18	第371回利付国債（10年）	日本	国債証券	0.400	2033/06/20	306,000,000	96.25	294,542,880	94.48	289,127,160	0.90
19	第153回利付国債（5年）	日本	国債証券	0.005	2027/06/20	293,000,000	98.75	289,346,290	98.33	288,106,900	0.90
20	第148回利付国債（5年）	日本	国債証券	0.005	2026/06/20	287,000,000	99.28	284,942,210	99.14	284,534,670	0.89
21	第363回利付国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2031/06/20	295,000,000	96.27	284,008,300	94.80	279,671,800	0.87
22	第150回利付国債（5年）	日本	国債証券	0.005	2026/12/20	282,000,000	99.00	279,180,000	98.73	278,418,600	0.87
23	第151回利付国債（5年）	日本	国債証券	0.005	2027/03/20	275,000,000	98.86	271,873,400	98.53	270,971,250	0.84
24	第154回利付国債（5年）	日本	国債証券	0.100	2027/09/20	275,000,000	98.81	271,743,800	98.36	270,498,250	0.84
25	第158回利付国債（5年）	日本	国債証券	0.100	2028/03/20	276,000,000	98.53	271,967,200	97.95	270,358,560	0.84
26	第368回利付国債（10年）	日本	国債証券	0.200	2032/09/20	287,000,000	95.57	274,287,230	93.96	269,676,680	0.84
27	第364回利付国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2031/09/20	284,000,000	95.74	271,913,010	94.52	268,445,320	0.84
28	第352回利付国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2028/09/20	272,000,000	98.22	267,158,400	97.46	265,099,360	0.83
29	第156回利付国債（5年）	日本	国債証券	0.200	2027/12/20	269,000,000	98.99	266,303,080	98.45	264,833,190	0.83
30	第375回利付国債（10年）	日本	国債証券	1.100	2034/06/20	264,000,000	101.19	267,143,910	99.19	261,885,360	0.82

東京海上・東証REITマザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	5,299	123,305.57	653,396,242	123,500.00	654,426,500	7.08
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	4,666	108,708.55	507,234,129	109,400.00	510,460,400	5.52
3	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	4,711	90,515.66	426,419,308	94,500.00	445,189,500	4.81
4	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	投資証券	2,908	145,914.32	424,318,860	149,500.00	434,746,000	4.70
5	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	2,542	152,316.53	387,188,620	155,100.00	394,264,200	4.26
6	GLP投資法人	日本	投資証券	3,052	125,902.72	384,255,112	127,200.00	388,214,400	4.20

7	日本プロロジスリート投資法人	日本	投資証券	1,583	233,417.45	369,499,827	236,900.00	375,012,700	4.05
8	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	5,006	68,299.38	341,906,739	67,800.00	339,406,800	3.67
9	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	1,355	237,527.70	321,850,037	244,300.00	331,026,500	3.58
10	オリックス不動産投資法人	日本	投資証券	1,810	169,411.52	306,634,855	172,400.00	312,044,000	3.37
11	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	2,018	149,008.58	300,699,331	150,400.00	303,507,200	3.28
12	アドバンス・レジデンス投資法人	日本	投資証券	1,786	144,507.77	258,090,887	142,900.00	255,219,400	2.76
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	3,338	72,600.47	242,340,382	72,000.00	240,336,000	2.60
14	積水ハウス・リート投資法人	日本	投資証券	2,730	79,003.05	215,678,350	79,400.00	216,762,000	2.34
15	日本プライムリアルティ投資法人	日本	投資証券	621	341,006.92	211,765,301	342,000.00	212,382,000	2.29
16	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	日本	投資証券	1,980	101,001.92	199,983,812	102,100.00	202,158,000	2.18
17	産業ファンド投資法人	日本	投資証券	1,663	118,200.54	196,567,511	116,000.00	192,908,000	2.08
18	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	314	581,019.92	182,440,257	584,000.00	183,376,000	1.98
19	ラサールロジポート投資法人	日本	投資証券	1,163	143,997.80	167,469,451	143,400.00	166,774,200	1.80
20	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	1,830	90,067.12	164,822,837	89,900.00	164,517,000	1.78
21	アクティビア・プロパティーズ投資法人	日本	投資証券	442	334,027.82	147,640,299	338,000.00	149,396,000	1.61
22	イオンリート投資法人	日本	投資証券	1,114	126,100.91	140,476,422	125,400.00	139,695,600	1.51
23	フロンティア不動産投資法人	日本	投資証券	1,685	80,502.26	135,646,313	81,000.00	136,485,000	1.47
24	森ヒルズリート投資法人	日本	投資証券	1,068	125,504.32	134,038,622	125,600.00	134,140,800	1.45
25	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	460	274,211.83	126,137,443	271,600.00	124,936,000	1.35
26	N T T都市開発リート投資法人	日本	投資証券	923	123,335.94	113,839,077	132,200.00	122,020,600	1.32
27	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	1,342	88,903.49	119,308,496	89,400.00	119,974,800	1.29
28	ヒューリックリート投資法人	日本	投資証券	803	139,609.19	112,106,187	141,800.00	113,865,400	1.23
29	三菱地所物流リート投資法人	日本	投資証券	314	352,514.82	110,689,656	356,000.00	111,784,000	1.21
30	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	1,751	62,902.83	110,142,867	63,300.00	110,838,300	1.19

b. 投資有価証券の種類

T M A日本株T O P I X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	0.22
		建設業	2.01
		食料品	2.80
		繊維製品	0.40
		パルプ・紙	0.13
		化学	4.65
		医薬品	4.05
		石油・石炭製品	0.50
		ゴム製品	0.56
		ガラス・土石製品	0.60
		鉄鋼	0.79
		非鉄金属	0.80
		金属製品	0.45
		機械	5.25
		電気機器	16.88
		輸送用機器	7.25

	精密機器	2.31
	その他製品	2.67
	電気・ガス業	1.13
	陸運業	2.13
	海運業	0.61
	空運業	0.33
	倉庫・運輸関連業	0.13
	情報・通信業	7.17
	卸売業	6.09
	小売業	4.36
	銀行業	8.60
	証券、商品先物取引業	0.94
	保険業	2.97
	その他金融業	1.07
	不動産業	1.75
	サービス業	4.92
合 計		94.75

T M A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	90.05
地方債証券	4.81
特殊債券	0.30
社債券	4.65
合 計	99.83

東京海上・東証REITマザーファンド

種類	投資比率(%)
投資証券	97.18
合 計	97.18

投資不動産物件

T M A日本株T O P I Xマザーファンド
該当事項はありません。

T M A日本債券インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

東京海上・東証REITマザーファンド
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

T M A日本株T O P I X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	141	3,879,225,900.00	3,935,310,000	5.14

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

T M A 日本債券インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

東京海上・東証ＲＥＩＴマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/ 売建	数量 (枚)	帳簿価額	評価額(円)	投資 比率(%)
株価指数先物取引	日本	大阪取引所	東証ＲＥＩＴ指数先物	買建	151	252,396,500.00	255,492,000	2.76

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

(3)【運用実績】
【純資産の推移】

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1計算期間末	(2018年 1月25日)	1	1	1.0294	1.0294
第2計算期間末	(2019年 1月25日)	4	4	1.0243	1.0243
第3計算期間末	(2020年 1月27日)	44	44	1.0829	1.0829
第4計算期間末	(2021年 1月25日)	76	76	1.0180	1.0180
第5計算期間末	(2022年 1月25日)	134	134	1.0267	1.0267
第6計算期間末	(2023年 1月25日)	218	218	1.0010	1.0010
第7計算期間末	(2024年 1月25日)	252	252	1.0109	1.0109
第8計算期間末	(2025年 1月27日)	311	311	0.9947	0.9947
2024年 1月末日		253	—	1.0121	—
2月末日		255	—	1.0140	—
3月末日		263	—	1.0171	—
4月末日		264	—	1.0086	—
5月末日		268	—	0.9957	—
6月末日		275	—	0.9977	—
7月末日		281	—	0.9959	—
8月末日		290	—	1.0064	—
9月末日		297	—	1.0052	—
10月末日		301	—	1.0010	—
11月末日		302	—	0.9944	—
12月末日		308	—	0.9974	—
2025年 1月末日		311	—	0.9958	—

【分配の推移】

該当事項はありません。

【収益率の推移】

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

第7計算期間	2023年 1月26日～2024年 1月25日	1.0
第8計算期間	2024年 1月26日～2025年 1月27日	1.6

(4) 【設定及び解約の実績】

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2017年10月11日～2018年 1月25日	1,081,855	—	1,081,855
第2計算期間	2018年 1月26日～2019年 1月25日	3,969,342	218,643	4,832,554
第3計算期間	2019年 1月26日～2020年 1月27日	48,695,808	12,789,758	40,738,604
第4計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	60,312,399	26,011,910	75,039,093
第5計算期間	2021年 1月26日～2022年 1月25日	106,661,951	50,413,953	131,287,091
第6計算期間	2022年 1月26日～2023年 1月25日	123,183,694	36,463,073	218,007,712
第7計算期間	2023年 1月26日～2024年 1月25日	120,508,317	88,999,190	249,516,839
第8計算期間	2024年 1月26日～2025年 1月27日	512,344,892	449,115,744	312,745,987

< 参考情報 >

基準日：2025年1月31日

基準価額・純資産の推移



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

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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第4期	2021/01/25	0円
第5期	2022/01/25	0円
第6期	2023/01/25	0円
第7期	2024/01/25	0円
第8期	2025/01/27	0円
設定来累計		分配実績なし

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

主要な資産の状況

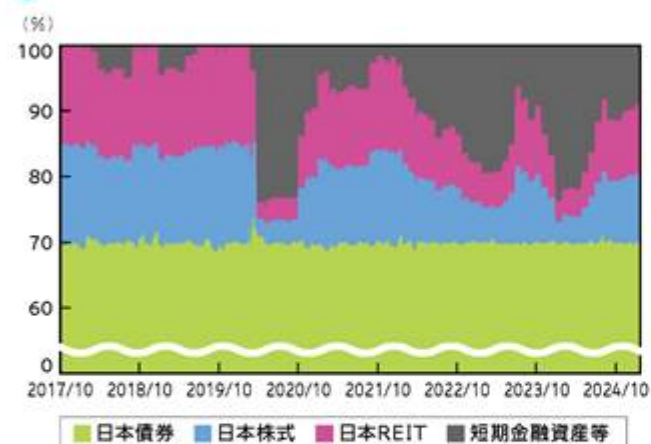
各マザーファンド組入比率、騰落率

マザーファンド	組入比率	基本資産 配分	差	騰落率				
				1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年
日本債券	69.6%	70.0%	-0.4%	-0.73%	-1.53%	-0.59%	-2.96%	-7.57%
日本株式	10.7%	15.0%	-4.3%	+0.13%	+3.66%	+1.01%	+11.94%	+58.92%
日本REIT	11.0%	15.0%	-4.0%	+3.52%	+2.65%	+1.49%	-0.55%	-0.28%
短期金融資産等	8.7%	-	+8.7%					

※比率は、純資産総額に占める割合です。

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

各マザーファンド組入比率の推移



※比率は、純資産総額（一部の未払金の計上を除く）に占める割合です。

各マザーファンドの組入上位銘柄

TMA日本債券インデックスマザーファンド

	銘柄	クーポン	比率
1	第356回利付国債(10年)	0.100%	1.3%
2	第149回利付国債(5年)	0.005%	1.1%
3	第372回利付国債(10年)	0.800%	1.1%

TMA日本株TOPIXマザーファンド

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.8%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	3.0%
3	ソニーグループ	2.8%

東京海上・東証REITマザーファンド

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	7.1%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.5%
3	日本都市ファンド投資法人	4.8%

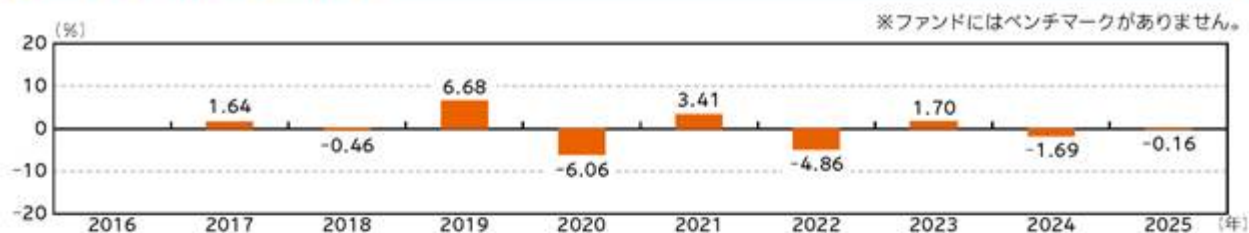
※比率は、各マザーファンドの純資産総額に占める割合です。

次ページへ続く

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

基準日: 2025年1月31日

年間収益率の推移



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

※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

- c. 販売会社やお申込みのコース等によって申込単位は異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。なお、分配金再投資コースにおける収益分配金の再投資に際しては、1口単位で取得することができます。
- d. 取得申込の受付は、原則として午後3時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。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、振替機関等は、委託会社から振替機関等への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関等の定める方法により、振替機関等へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。
- i. 定時定額購入サービスを選択した取得申込者は、販売会社との間で定時定額購入サービスに関する取り決めを行います。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

- a. 受益者は、自己に帰属する受益権につき、一部解約の実行請求（解約請求）の方法によりご換金の請求を行うことができます。
- b. ご換金のお申込みは販売会社で受け付けます。なお、販売会社の買取りによるご換金の請求については、販売会社にお問い合わせください。
- c. 解約請求による換金のお申込みは、毎営業日に行うことができます。
- d. 解約単位は、販売会社やお申込みのコース等によって異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- e. 解約請求のお申込みの受付は、原則として午後3時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します。受付時間を過ぎてからのお申込みは翌営業日受付としてお取り扱いします。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
不動産 投資信託証券	原則として、計算日の取引所における最終相場で評価します。

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

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

ときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

- f. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。
- g. 上記f.の規定にかかわらず、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、信託は、「信託約款の変更」b.の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社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、「信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- i. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

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

関係会社との契約の更改等

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

運用報告書

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。

公告

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

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

4【受益者の権利等】

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

収益分配金の請求権

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

償還金の請求権

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

換金（解約）請求権

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

買取請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、第8期計算期間(2024年1月26日から2025年1月27日まで)の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【東京海上・円資産インデックスバランスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 [2024年 1月25日現在]	第8期 [2025年 1月27日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	60,357,684	27,377,972
親投資信託受益証券	192,289,919	283,863,987
未収入金	1,416,319	1,937,456
未収利息	-	304
流動資産合計	254,063,922	313,179,719
資産合計	254,063,922	313,179,719
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,303,153	1,430,534
未払受託者報酬	26,932	33,739
未払委託者報酬	484,793	607,419
未払利息	27	-
その他未払費用	13,376	16,776
流動負債合計	1,828,281	2,088,468
負債合計	1,828,281	2,088,468
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 249,516,839	¹ 312,745,987
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	² 2,718,802	² 1,654,736
（分配準備積立金）	2,614,313	2,186,194
元本等合計	252,235,641	311,091,251
純資産合計	252,235,641	311,091,251
負債純資産合計	254,063,922	313,179,719

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日	第8期 自 2024年 1月26日 至 2025年 1月27日
営業収益		
受取利息	191	46,007
有価証券売買等損益	3,289,308	3,344,337
営業収益合計	3,289,499	3,298,330
営業費用		
支払利息	12,471	586
受託者報酬	52,211	62,933
委託者報酬	939,710	1,132,825
その他費用	25,920	31,269
営業費用合計	1,030,312	1,227,613
営業利益又は営業損失（ ）	2,259,187	4,525,943
経常利益又は経常損失（ ）	2,259,187	4,525,943
当期純利益又は当期純損失（ ）	2,259,187	4,525,943
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（ ）	922,472	2,545,671
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	223,249	2,718,802
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,492,872	343,068
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	1,492,872	343,068
剰余金減少額又は欠損金増加額	334,034	2,736,334
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	334,034	2,736,334
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（ ）	2,718,802	1,654,736

(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8期 自 2024年 1月26日 至 2025年 1月27日
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間末日の取扱い 2025年1月25日が休日のため、当計算期間末日を2025年1月27日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第7期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日	第8期 自 2024年 1月26日 至 2025年 1月27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7期 [2024年 1月25日現在]	第8期 [2025年 1月27日現在]
1. 1 期首元本額	218,007,712円	249,516,839円
期中追加設定元本額	120,508,317円	512,344,892円
期中一部解約元本額	88,999,190円	449,115,744円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	249,516,839口	312,745,987口
3. 2 元本の欠損	—	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,654,736円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日	第8期 自 2024年 1月26日 至 2025年 1月27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 (1,246,550円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(17,087,441円)及び分配準備積立金(1,367,763円)より、分配対象額は19,701,754円(1万口当たり789.57円)ですが、分配を行っておりません。	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 (1,624,112円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(24,495,251円)及び分配準備積立金(562,082円)より、分配対象額は26,681,445円(1万口当たり853.12円)ですが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）
・金融商品の状況に関する事項

区 分	第7期 自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日	第8期 自 2024年 1月26日 至 2025年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

・ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第7期 [2024年 1月25日現在]	第8期 [2025年 1月27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）

第7期（自 2023年1月26日 至 2024年1月25日）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	935,338円
合計	935,338円

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

第8期（自 2024年1月26日 至 2025年1月27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	87,668円
合計	87,668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7期 [2024年 1月25日現在]		第8期 [2025年 1月27日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0109円 10,109円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9947円 9,947円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
親投資信託 受益証券	T M A日本株T O P I Xマザーファンド	12,629,936	32,851,726	
	T M A日本債券インデックスマザーファンド	182,299,551	217,082,305	
	東京海上・東証R E I Tマザーファンド	24,503,471	33,929,956	
親投資信託受益証券 合計		219,432,958	283,863,987	
合計		219,432,958	283,863,987	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（ご参考）

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

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の状況

（１）貸借対照表

		[2024年 1月25日現在]	[2025年 1月27日現在]
区 分	注記 番号	金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,927,488,425	4,138,846,180
株式	2	57,153,417,110	71,730,156,830
派生商品評価勘定		238,725,500	5,306,700
未収入金		—	52,779,743
未収配当金		76,149,950	96,674,462
未収利息		—	46,097
前払金		—	60,000
流動資産合計		61,395,780,985	76,023,870,012
資産合計		61,395,780,985	76,023,870,012
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		24,400	3,219,900
前受金		240,970,600	—
未払解約金		99,029,469	160,526,110
未払利息		1,762	—
流動負債合計		340,026,231	163,746,010
負債合計		340,026,231	163,746,010
純資産の部			
元本等			
元本	1	26,182,773,837	29,164,238,883
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		34,872,980,917	46,695,885,119
元本等合計		61,055,754,754	75,860,124,002
純資産合計		61,055,754,754	75,860,124,002
負債純資産合計		61,395,780,985	76,023,870,012

(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 2025年 1月27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 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日	自 2024年 1月26日 至 2025年 1月27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	[2024年 1月25日現在]	[2025年 1月27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	9,160,136,053円
同期中における一部解約元本額	6,921,826,850円	6,178,671,007円
同期末における元本額	26,182,773,837円	29,164,238,883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	20,332,096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	140,208,581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	109,803,841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	139,142,148円
東京海上セレクション・日本株ＴＯＰＩＸ	17,768,224,715円	18,717,056,860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	12,629,936円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035	481,270,679円	630,178,497円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	277,141,805円	386,185,570円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	181,498,545円	249,770,300円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	306,236,025円	389,477,171円
T M A 日本株式インデックスV A < 適格機 関投資家限定 >	1,063,320,955円	1,332,564,346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	320,425,818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	2,368,948,280円
東京海上・T O P I X インデックスファン ド < 適格機関投資家限定 >	3,435,130,500円	4,062,161,948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	93,038,483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	192,315,008円
計	26,182,773,837円	29,164,238,883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	26,182,773,837口	29,164,238,883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 1,452,900,000円

（注1）＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（注2）3.については、決算日現在の代用有価証券の時価額を記載

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日	自 2024年 1月26日 至 2025年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び 投資法人に関する法律」（昭和 26年法律第198号）第2条第4項 に定める証券投資信託であり、 有価証券等の金融商品への投資 を信託約款に定める「運用の基 本方針」に基づき行なっており ます。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融 商品は「重要な会計方針に係る 事項に関する注記」の「有価証 券の評価基準及び評価方法」に 記載の有価証券及びデリバティ ブ取引であります。デリバティ ブ取引には、先物取引が含まれ ております。当該有価証券及び デリバティブ取引には、性質に 応じてそれぞれ価格変動リス ク、流動性リスク、信用リス ク等があります。	同左

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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2024年 1月25日現在]	[2025年 1月27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ぬ。	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 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。

（自 2024年1月26日 至 2025年1月27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	664,077,093円
合計	664,077,093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(2024年3月22日から2025年1月27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
（2024年1月25日現在）

（単位：円）

区 分	種 類	契約額等	うち	時 価	評価損益
			1 年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	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

(2025年1月27日現在)

(単位：円)

区 分	種 類	契約額等	うち	時 価	評価損益
			1 年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,960,060,000	—	3,962,160,000	2,100,000
	東証株価指数先物	3,960,060,000	—	3,962,160,000	2,100,000
合 計		3,960,060,000	—	3,962,160,000	2,100,000

(注)1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報に関する注記)

[2024年 1月25日現在]		[2025年 1月27日現在]	
1口当たり純資産額	2.3319円	1口当たり純資産額	2.6011円
(1万口当たり純資産額	23,319円)	(1万口当たり純資産額	26,011円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘 柄	株式数	評価額		備 考
		単価	金額	
ニッセイ	25,800	861.30	22,221,540	
マルハニチロ	5,200	2,961.00	15,397,200	
サカタのタネ	3,600	3,610.00	12,996,000	
ホクト	3,700	1,826.00	6,756,200	
住石ホールディングス	4,600	765.00	3,519,000	
I N P E X	77,700	1,887.00	146,619,900	
石油資源開発	14,500	1,114.00	16,153,000	
K & Oエナジーグループ	3,000	3,280.00	9,840,000	
ショーボンドホールディングス	3,300	5,005.00	16,516,500	
ミライト・ワン	7,200	2,266.50	16,318,800	
安藤・間	13,000	1,140.00	14,820,000	
東急建設	10,700	725.00	7,757,500	
コムシスホールディングス	7,500	3,218.00	24,135,000	
東建コーポレーション	900	12,180.00	10,962,000	
ヤマウラ	6,800	1,236.00	8,404,800	
オリエンタル白石	23,600	383.00	9,038,800	
大成建設	16,600	6,495.00	107,817,000	
大林組	63,600	2,042.00	129,871,200	

清水建設	52,600	1,333.50	70,142,100	
長谷工コーポレーション	14,700	2,047.00	30,090,900	
鹿島建設	39,700	2,720.00	107,984,000	
西松建設	3,400	5,088.00	17,299,200	
三井住友建設	30,800	418.00	12,874,400	
奥村組	3,400	3,865.00	13,141,000	
東鉄工業	3,100	3,150.00	9,765,000	
戸田建設	23,300	934.60	21,776,180	
熊谷組	3,900	3,845.00	14,995,500	
東亜道路工業	6,200	1,286.00	7,973,200	
東亜建設工業	11,200	1,184.00	13,260,800	
五洋建設	29,600	651.40	19,281,440	
住友林業	15,800	5,334.00	84,277,200	
大和ハウス工業	53,000	4,755.00	252,015,000	
積水ハウス	54,700	3,658.00	200,092,600	
北陸電気工事	4,900	1,132.00	5,546,800	
中電工	2,400	3,095.00	7,428,000	
関電工	11,600	2,358.00	27,352,800	
きんでん	11,900	3,060.00	36,414,000	
日本電設工業	3,300	1,979.00	6,530,700	
エクシオグループ	14,800	1,684.00	24,923,200	
新日本空調	5,800	1,862.00	10,799,600	
九電工	4,200	5,300.00	22,260,000	
三機工業	6,400	3,045.00	19,488,000	
日揮ホールディングス	18,400	1,337.50	24,610,000	
中外炉工業	2,800	3,445.00	9,646,000	
高砂熱学工業	5,400	5,888.00	31,795,200	
大気社	3,000	4,660.00	13,980,000	
ダイダン	3,600	3,585.00	12,906,000	
日比谷総合設備	3,600	3,755.00	13,518,000	
インフロニア・ホールディングス	20,000	1,157.00	23,140,000	
レイズネクスト	5,700	1,530.00	8,721,000	
シマダヤ	3,500	1,430.00	5,005,000	
ニッポン	6,400	2,150.00	13,760,000	
日清製粉グループ本社	15,800	1,790.00	28,282,000	
フィード・ワン	7,800	814.00	6,349,200	
日本甜菜製糖	1,700	2,356.00	4,005,200	
D M三井製糖ホールディングス	3,700	3,350.00	12,395,000	
森永製菓	7,900	2,666.50	21,065,350	
江崎グリコ	4,600	4,670.00	21,482,000	
井村屋グループ	2,900	2,451.00	7,107,900	
山崎製パン	12,600	2,801.50	35,298,900	
亀田製菓	1,900	3,915.00	7,438,500	
寿スピリッツ	10,000	2,254.00	22,540,000	
カルビー	8,000	2,968.00	23,744,000	

森永乳業	7,100	2,808.00	19,936,800	
ヤクルト本社	25,400	2,840.50	72,148,700	
明治ホールディングス	21,200	3,095.00	65,614,000	
雪印メグミルク	4,700	2,619.00	12,309,300	
プリマハム	2,900	2,180.00	6,322,000	
日本ハム	7,200	5,058.00	36,417,600	
丸大食品	2,600	1,646.00	4,279,600	
S F o o d s	2,700	2,542.00	6,863,400	
伊藤ハム米久ホールディングス	2,100	3,835.00	8,053,500	
サッポロホールディングス	6,100	7,145.00	43,584,500	
アサヒグループホールディングス	134,100	1,665.50	223,343,550	
キリンホールディングス	72,200	1,982.50	143,136,500	
宝ホールディングス	15,100	1,364.50	20,603,950	
オエノンホールディングス	14,200	378.00	5,367,600	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	13,300	2,411.50	32,072,950	
サントリー食品インターナショナル	12,000	4,840.00	58,080,000	
ダイドーグループホールディングス	2,600	3,355.00	8,723,000	
伊藤園	6,200	3,447.00	21,371,400	
キーコーヒー	4,700	2,052.00	9,644,400	
日清オイリオグループ	3,000	4,980.00	14,940,000	
不二製油グループ本社	4,800	3,385.00	16,248,000	
J - オイルミルズ	4,400	2,028.00	8,923,200	
キッコーマン	59,900	1,642.50	98,385,750	
味の素	42,200	6,314.00	266,450,800	
キューピー	9,100	3,096.00	28,173,600	
ハウス食品グループ本社	4,300	2,813.00	12,095,900	
カゴメ	8,000	2,890.00	23,120,000	
アリアケジャパン	2,000	5,150.00	10,300,000	
ニチレイ	8,200	3,975.00	32,595,000	
東洋水産	9,200	10,195.00	93,794,000	
日清食品ホールディングス	22,000	3,567.00	78,474,000	
フジッコ	3,600	1,653.00	5,950,800	
ロック・フィールド	5,100	1,567.00	7,991,700	
日本たばこ産業	107,700	3,952.00	425,630,400	
なとり	2,100	2,137.00	4,487,700	
ユーグレナ	23,500	442.00	10,387,000	
片倉工業	3,300	2,023.00	6,675,900	
ゲンゼ	1,400	5,270.00	7,378,000	
東洋紡	6,000	987.00	5,922,000	
倉敷紡績	3,000	5,600.00	16,800,000	
シキボウ	2,300	1,010.00	2,323,000	
日本毛織	6,400	1,327.00	8,492,800	
帝国繊維	2,700	2,344.00	6,328,800	
帝人	17,500	1,336.50	23,388,750	

東レ	124,900	1,068.00	133,393,200	
セーレン	4,300	2,708.00	11,644,400	
小松マテール	2,600	818.00	2,126,800	
ワコールホールディングス	3,600	5,569.00	20,048,400	
ホギメディカル	2,900	4,840.00	14,036,000	
T S Iホールディングス	11,000	1,210.00	13,310,000	
三陽商会	1,900	3,105.00	5,899,500	
ゴールドウイン	3,400	8,104.00	27,553,600	
特種東海製紙	1,600	3,575.00	5,720,000	
王子ホールディングス	63,100	629.20	39,702,520	
日本製紙	12,400	903.00	11,197,200	
北越コーポレーション	13,500	1,470.00	19,845,000	
大王製紙	8,000	859.00	6,872,000	
レンゴー	12,900	876.30	11,304,270	
ザ・パックス	2,000	3,470.00	6,940,000	
クラレ	26,400	2,339.50	61,762,800	
旭化成	120,100	1,057.50	127,005,750	
レゾナック・ホールディングス	17,600	3,915.00	68,904,000	
住友化学	138,200	338.90	46,835,980	
住友精化	1,200	4,675.00	5,610,000	
日産化学	8,800	4,763.00	41,914,400	
クレハ	4,400	2,933.00	12,905,200	
石原産業	5,700	1,553.00	8,852,100	
日本曹達	5,200	2,853.00	14,835,600	
東ソー	23,400	2,082.50	48,730,500	
トクヤマ	6,600	2,651.50	17,499,900	
セントラル硝子	3,400	3,310.00	11,254,000	
東亜合成	7,800	1,465.00	11,427,000	
大阪ソーダ	9,500	1,744.00	16,568,000	
デンカ	6,200	2,220.00	13,764,000	
信越化学工業	164,100	5,149.00	844,950,900	
日本カーバイド工業	2,700	1,775.00	4,792,500	
堺化学工業	3,600	2,562.00	9,223,200	
エア・ウォーター	16,500	1,934.00	31,911,000	
日本酸素ホールディングス	17,900	4,325.00	77,417,500	
日本パーカライジング	9,500	1,266.00	12,027,000	
ステラ ケミファ	2,400	4,400.00	10,560,000	
日本触媒	7,600	1,896.00	14,409,600	
カネカ	3,500	3,803.00	13,310,500	
三菱瓦斯化学	12,900	2,789.50	35,984,550	
三井化学	15,500	3,400.00	52,700,000	
東京応化工業	9,300	3,697.00	34,382,100	
三菱ケミカルグループ	132,600	789.40	104,674,440	
K Hネオケム	5,500	2,112.00	11,616,000	
ダイセル	24,200	1,376.00	33,299,200	

住友ベークライト	4,900	3,798.00	18,610,200	
積水化学工業	34,800	2,440.00	84,912,000	
日本ゼオン	11,600	1,449.00	16,808,400	
アイカ工業	3,900	3,275.00	12,772,500	
U B E	7,400	2,353.00	17,412,200	
旭有機材	2,600	4,345.00	11,297,000	
日本化薬	10,000	1,293.00	12,930,000	
A D E K A	6,000	2,942.50	17,655,000	
日油	20,700	2,110.00	43,677,000	
ハリマ化成グループ	4,800	861.00	4,132,800	
花王	43,800	6,082.00	266,391,600	
三洋化成工業	1,200	3,915.00	4,698,000	
日本ペイントホールディングス	80,000	1,015.00	81,200,000	
関西ペイント	17,000	2,114.00	35,938,000	
中国塗料	6,900	2,321.00	16,014,900	
太陽ホールディングス	4,500	4,320.00	19,440,000	
D I C	5,700	3,387.00	19,305,900	
サカタインクス	6,700	1,698.00	11,376,600	
a r t i e n c e	4,600	3,090.00	14,214,000	
富士フイルムホールディングス	107,500	3,400.00	365,500,000	
資生堂	39,000	2,643.00	103,077,000	
ライオン	21,800	1,662.00	36,231,600	
高砂香料工業	2,100	5,290.00	11,109,000	
マンダム	5,200	1,252.00	6,510,400	
ミルボン	3,500	3,230.00	11,305,000	
コーセー	4,000	6,989.00	27,956,000	
コタ	4,500	1,625.00	7,312,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	9,700	1,438.50	13,953,450	
ノエビアホールディングス	1,100	4,640.00	5,104,000	
エステー	3,400	1,507.00	5,123,800	
長谷川香料	3,900	3,130.00	12,207,000	
小林製薬	5,600	5,784.00	32,390,400	
荒川化学工業	4,500	1,095.00	4,927,500	
メック	2,700	3,340.00	9,018,000	
タカラバイオ	7,400	1,034.00	7,651,600	
J C U	2,800	3,605.00	10,094,000	
デクセリアルズ	15,900	2,070.00	32,913,000	
アース製薬	1,700	5,140.00	8,738,000	
大成ラミック	1,800	2,560.00	4,608,000	
クミアイ化学工業	10,800	752.00	8,121,600	
日本農薬	8,900	738.00	6,568,200	
日東電工	58,000	2,820.00	163,560,000	
レック	6,400	1,217.00	7,788,800	
前澤化成工業	4,200	1,683.00	7,068,600	
エフピコ	3,900	2,830.00	11,037,000	

天馬	2,400	2,797.00	6,712,800	
信越ポリマー	5,800	1,655.00	9,599,000	
ニフコ	5,300	3,734.00	19,790,200	
バルカー	2,700	3,520.00	9,504,000	
ユニ・チャーム	112,200	1,232.00	138,230,400	
協和キリン	21,200	2,324.00	49,268,800	
武田薬品工業	159,500	4,093.00	652,833,500	
アステラス製薬	159,700	1,518.50	242,504,450	
住友ファーマ	18,800	570.00	10,716,000	
塩野義製薬	66,900	2,307.50	154,371,750	
日本新薬	6,100	3,795.00	23,149,500	
中外製薬	57,300	6,472.00	370,845,600	
科研製薬	2,700	4,313.00	11,645,100	
エーザイ	23,000	4,676.00	107,548,000	
ロート製薬	19,100	2,672.00	51,035,200	
小野薬品工業	37,800	1,621.50	61,292,700	
久光製薬	3,700	4,566.00	16,894,200	
持田製薬	2,000	3,370.00	6,740,000	
参天製薬	32,200	1,551.50	49,958,300	
ツムラ	5,900	4,560.00	26,904,000	
キッセイ薬品工業	3,500	4,005.00	14,017,500	
生化学工業	7,000	788.00	5,516,000	
栄研化学	4,500	2,192.00	9,864,000	
鳥居薬品	2,100	5,050.00	10,605,000	
J C R ファーマ	11,800	569.00	6,714,200	
東和薬品	3,400	3,070.00	10,438,000	
ゼリア新薬工業	4,000	2,254.00	9,016,000	
第一三共	171,100	4,388.00	750,786,800	
杏林製薬	4,100	1,471.00	6,031,100	
大幸薬品	16,400	316.00	5,182,400	
大塚ホールディングス	45,400	8,034.00	364,743,600	
ペプチドリーム	9,600	2,094.00	20,102,400	
あすか製薬ホールディングス	4,700	1,972.00	9,268,400	
サワイグループホールディングス	12,900	2,031.50	26,206,350	
ニチレキグループ	4,700	2,383.00	11,200,100	
出光興産	93,000	1,029.00	95,697,000	
E N E O S ホールディングス	294,600	789.60	232,616,160	
コスモエネルギーホールディングス	6,600	6,743.00	44,503,800	
横浜ゴム	9,200	3,359.00	30,902,800	
T O Y O T I R E	11,000	2,510.00	27,610,000	
ブリヂストン	52,200	5,525.00	288,405,000	
住友ゴム工業	16,700	1,787.00	29,842,900	
藤倉コンポジット	3,500	1,563.00	5,470,500	
オカモト	1,400	5,220.00	7,308,000	
ニッタ	2,100	3,565.00	7,486,500	

住友理工	4,100	1,582.00	6,486,200	
三ツ星ベルト	2,100	3,930.00	8,253,000	
バンドー化学	6,800	1,870.00	12,716,000	
日東紡績	2,700	5,780.00	15,606,000	
A G C	17,300	4,562.00	78,922,600	
日本電気硝子	6,500	3,485.00	22,652,500	
住友大阪セメント	4,400	3,365.00	14,806,000	
太平洋セメント	10,900	3,987.00	43,458,300	
日本ヒューム	7,000	1,344.00	9,408,000	
東海カーボン	18,500	885.90	16,389,150	
日本カーボン	1,900	4,320.00	8,208,000	
東洋炭素	2,000	4,015.00	8,030,000	
T O T O	13,100	3,724.00	48,784,400	
日本碍子	19,700	1,984.00	39,084,800	
日本特殊陶業	15,400	5,005.00	77,077,000	
M A R U W A	800	45,330.00	36,264,000	
フジミインコーポレーテッド	6,100	2,282.00	13,920,200	
ニチアス	4,700	5,117.00	24,049,900	
ニチハ	2,800	2,861.00	8,010,800	
日本製鉄	91,800	3,173.00	291,281,400	
神戸製鋼所	38,400	1,627.50	62,496,000	
合同製鐵	2,100	3,975.00	8,347,500	
J F E ホールディングス	52,200	1,788.00	93,333,600	
東京製鐵	8,200	1,560.00	12,792,000	
共英製鋼	3,500	1,954.00	6,839,000	
大和工業	3,700	7,372.00	27,276,400	
大阪製鐵	2,200	2,717.00	5,977,400	
淀川製鋼所	2,300	5,550.00	12,765,000	
丸一鋼管	5,300	3,397.00	18,004,100	
モリ工業	1,000	4,535.00	4,535,000	
大同特殊鋼	11,500	1,212.00	13,938,000	
山陽特殊製鋼	4,100	1,898.00	7,781,800	
愛知製鋼	1,800	5,730.00	10,314,000	
大平洋金属	4,500	1,530.00	6,885,000	
新日本電工	28,500	280.00	7,980,000	
三菱製鋼	4,300	1,601.00	6,884,300	
エンビプロ・ホールディングス	7,800	401.00	3,127,800	
シンニッタン	3,800	209.00	794,200	
日本軽金属ホールディングス	6,800	1,541.00	10,478,800	
三井金属鉱業	6,000	4,740.00	28,440,000	
三菱マテリアル	13,700	2,471.50	33,859,550	
住友金属鉱山	23,300	3,635.00	84,695,500	
D O W A ホールディングス	4,900	4,630.00	22,687,000	
古河機械金属	4,300	1,792.00	7,705,600	
U A C J	3,400	5,140.00	17,476,000	

古河電気工業	7,100	7,108.00	50,466,800	
住友電気工業	69,800	2,856.50	199,383,700	
フジクラ	23,100	6,522.00	150,658,200	
リョービ	4,500	2,299.00	10,345,500	
トーカロ	6,100	1,800.00	10,980,000	
SUMCO	36,900	1,216.00	44,870,400	
東洋製罐グループホールディングス	8,600	2,376.00	20,433,600	
横河ブリッジホールディングス	4,600	2,752.00	12,659,200	
駒井ハルテック	500	1,609.00	804,500	
三和ホールディングス	18,700	4,618.00	86,356,600	
文化シャッター	6,500	1,845.00	11,992,500	
三協立山	5,400	600.00	3,240,000	
LIXIL	27,400	1,715.00	46,991,000	
ノーリツ	4,900	1,730.00	8,477,000	
長府製作所	2,200	1,951.00	4,292,200	
リンナイ	8,900	3,418.00	30,420,200	
日東精工	9,700	584.00	5,664,800	
東プレ	5,000	1,912.00	9,560,000	
高周波熱錬	7,300	995.00	7,263,500	
サンコール	3,400	255.00	867,000	
パイオラックス	4,600	2,370.00	10,902,000	
日本発條	16,400	2,023.50	33,185,400	
日本製鋼所	5,500	5,722.00	31,471,000	
三浦工業	8,000	3,797.00	30,376,000	
タクマ	7,300	1,651.00	12,052,300	
オークマ	3,800	3,470.00	13,186,000	
芝浦機械	2,700	3,580.00	9,666,000	
アマダ	25,200	1,590.50	40,080,600	
アイダエンジニアリング	6,100	814.00	4,965,400	
FUJ I	6,200	2,367.00	14,675,400	
牧野フライス製作所	2,300	11,750.00	27,025,000	
オーエスジー	6,600	1,689.50	11,150,700	
旭ダイヤモンド工業	10,000	861.00	8,610,000	
D M G 森精機	13,000	2,445.00	31,785,000	
ディスコ	9,000	46,580.00	419,220,000	
日東工器	3,100	2,384.00	7,390,400	
富士ダイス	2,600	807.00	2,098,200	
リケンN P R	2,700	2,497.00	6,741,900	
島精機製作所	5,400	1,061.00	5,729,400	
日阪製作所	5,300	1,045.00	5,538,500	
ナブテスコ	11,700	2,795.50	32,707,350	
S M C	5,500	60,500.00	332,750,000	
ユニオンツール	1,300	4,715.00	6,129,500	
オイレス工業	4,400	2,475.00	10,890,000	
サトーホールディングス	4,100	2,208.00	9,052,800	

小松製作所	92,000	4,521.00	415,932,000	
住友重機械工業	10,500	3,195.00	33,547,500	
日立建機	8,500	3,753.00	31,900,500	
巴工業	2,400	3,745.00	8,988,000	
井関農機	3,900	944.00	3,681,600	
T O W A	7,200	1,986.00	14,299,200	
ローツェ	12,000	1,732.00	20,784,000	
タカキタ	4,000	373.00	1,492,000	
クボタ	96,000	1,920.00	184,320,000	
月島ホールディングス	4,900	1,441.00	7,060,900	
帝国電機製作所	2,900	2,747.00	7,966,300	
新東工業	4,900	931.00	4,561,900	
小森コーポレーション	6,500	1,198.00	7,787,000	
鶴見製作所	3,200	3,350.00	10,720,000	
酒井重工業	2,200	2,307.00	5,075,400	
荏原製作所	39,100	2,653.00	103,732,300	
西島製作所	4,500	2,313.00	10,408,500	
ダイキン工業	23,700	19,080.00	452,196,000	
オルガノ	3,000	8,050.00	24,150,000	
栗田工業	10,600	5,488.00	58,172,800	
椿本チエイン	6,600	1,880.00	12,408,000	
ダイフク	31,900	3,205.00	102,239,500	
タダノ	13,600	1,146.00	15,585,600	
フジテック	5,400	5,766.00	31,136,400	
C K D	5,600	2,509.00	14,050,400	
平和	6,000	2,299.00	13,794,000	
S A N K Y O	22,000	2,105.00	46,310,000	
日本金銭機械	5,900	1,126.00	6,643,400	
フクシマガリレイ	3,600	2,571.00	9,255,600	
竹内製作所	3,800	5,350.00	20,330,000	
アマノ	4,500	4,107.00	18,481,500	
グローリー	5,300	2,605.00	13,806,500	
大和冷機工業	5,900	1,567.00	9,245,300	
セガサミーホールディングス	17,200	2,882.50	49,579,000	
ホシザキ	12,000	5,756.00	69,072,000	
大豊工業	6,500	634.00	4,121,000	
日本精工	24,100	680.80	16,407,280	
N T N	41,600	250.20	10,408,320	
ジェイテクト	14,600	1,161.00	16,950,600	
不二越	1,800	3,430.00	6,174,000	
日本トムソン	6,900	512.00	3,532,800	
T H K	10,100	3,789.00	38,268,900	
ユーシン精機	5,600	699.00	3,914,400	
キッツ	8,100	1,177.00	9,533,700	
マキタ	21,900	4,678.00	102,448,200	

カナデビア	17,000	1,060.00	18,020,000	
三菱重工業	324,800	2,284.50	742,005,600	
I H I	14,800	8,860.00	131,128,000	
スター精密	4,800	1,934.00	9,283,200	
日清紡ホールディングス	13,500	897.80	12,120,300	
イビデン	10,600	4,792.00	50,795,200	
コニカミノルタ	39,900	627.10	25,021,290	
ブラザー工業	24,500	2,697.00	66,076,500	
ミネベアミツミ	32,100	2,520.00	80,892,000	
日立製作所	472,200	3,880.00	1,832,136,000	
三菱電機	185,600	2,638.50	489,705,600	
富士電機	11,500	7,962.00	91,563,000	
安川電機	20,300	4,537.00	92,101,100	
明電舎	4,500	4,080.00	18,360,000	
K O K U S A I E L E C T R I C	13,400	2,241.50	30,036,100	
ソシオネクスト	18,400	2,584.50	47,554,800	
東芝テック	2,900	3,390.00	9,831,000	
マブチモーター	7,700	2,172.00	16,724,400	
ニデック	81,600	2,807.00	229,051,200	
東光高岳	3,300	1,927.00	6,359,100	
ダイヘン	2,300	7,210.00	16,583,000	
J V C ケンウッド	15,900	1,763.00	28,031,700	
オムロン	16,300	5,125.00	83,537,500	
日東工業	3,500	2,944.00	10,304,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7,600	2,514.50	19,110,200	
メルコホールディングス	1,500	2,120.00	3,180,000	
テクノメディカ	3,000	1,786.00	5,358,000	
日本電気	25,800	12,940.00	333,852,000	
富士通	169,800	2,805.50	476,373,900	
沖電気工業	11,900	988.00	11,757,200	
サンケン電気	2,100	6,164.00	12,944,400	
アイホン	2,800	2,700.00	7,560,000	
ルネサスエレクトロニクス	141,100	2,118.50	298,920,350	
セイコーエプソン	22,400	2,707.50	60,648,000	
ワコム	15,600	676.00	10,545,600	
アルバック	4,200	6,078.00	25,527,600	
アクセル	2,000	1,319.00	2,638,000	
E I Z O	4,000	2,141.00	8,564,000	
日本信号	5,300	912.00	4,833,600	
能美防災	3,300	3,075.00	10,147,500	
ホーチキ	3,900	2,469.00	9,629,100	
エレコム	6,200	1,480.00	9,176,000	
パナソニック ホールディングス	217,500	1,519.50	330,491,250	
シャープ	31,700	951.40	30,159,380	
アンリツ	13,400	1,316.00	17,634,400	

富士通ゼネラル	6,200	2,760.00	17,112,000	
ソニーグループ	635,300	3,261.00	2,071,713,300	
T D K	158,000	1,909.50	301,701,000	
アルプスアルパイン	15,500	1,594.00	24,707,000	
日本トリム	1,700	3,705.00	6,298,500	
フォスター電機	5,000	1,644.00	8,220,000	
ヨコオ	3,300	1,677.00	5,534,100	
ホシデン	5,900	2,132.00	12,578,800	
ヒロセ電機	2,600	18,740.00	48,724,000	
日本航空電子工業	6,100	2,864.00	17,470,400	
アイコム	2,200	2,770.00	6,094,000	
横河電機	20,100	3,422.00	68,782,200	
アズビル	50,800	1,186.00	60,248,800	
日本光電工業	15,900	2,220.00	35,298,000	
堀場製作所	3,700	9,506.00	35,172,200	
アドバンテスト	57,500	9,185.00	528,137,500	
キーエンス	18,300	68,240.00	1,248,792,000	
日置電機	1,300	8,140.00	10,582,000	
シスメックス	47,400	3,009.00	142,626,600	
日本マイクロニクス	3,500	3,955.00	13,842,500	
O B A R A G R O U P	1,900	3,860.00	7,334,000	
コーセル	6,600	1,063.00	7,015,800	
イリソ電子工業	2,500	2,676.00	6,690,000	
オプテックスグループ	5,400	1,699.00	9,174,600	
千代田インテグレ	2,400	2,966.00	7,118,400	
レーザーテック	8,500	15,180.00	129,030,000	
スタンレー電気	11,000	2,635.50	28,990,500	
ウシオ電機	7,900	2,105.00	16,629,500	
日本セラミック	3,100	2,527.00	7,833,700	
図研	2,500	4,670.00	11,675,000	
日本電子	5,000	5,810.00	29,050,000	
カシオ計算機	12,300	1,290.00	15,867,000	
ファナック	88,000	4,692.00	412,896,000	
ローム	33,600	1,529.00	51,374,400	
浜松ホトニクス	30,400	1,927.00	58,580,800	
三井ハイテック	13,300	932.00	12,395,600	
新光電気工業	6,300	5,868.00	36,968,400	
京セラ	108,800	1,637.50	178,160,000	
太陽誘電	10,200	2,277.50	23,230,500	
村田製作所	163,200	2,516.00	410,611,200	
双葉電子工業	3,500	486.00	1,701,000	
ニチコン	9,200	1,132.00	10,414,400	
日本ケミコン	4,500	1,009.00	4,540,500	
K O A	7,500	1,025.00	7,687,500	
小糸製作所	19,500	2,043.50	39,848,250	

ミツバ	8,200	889.00	7,289,800	
S C R E E Nホールディングス	7,700	10,700.00	82,390,000	
キヤノン電子	3,600	2,620.00	9,432,000	
キヤノン	90,600	4,965.00	449,829,000	
リコー	45,200	1,752.50	79,213,000	
象印マホービン	5,100	1,657.00	8,450,700	
東京エレクトロン	38,700	25,805.00	998,653,500	
イノテック	2,900	1,400.00	4,060,000	
トヨタ紡織	7,800	1,993.50	15,549,300	
ユニプレス	7,300	1,098.00	8,015,400	
豊田自動織機	15,400	13,265.00	204,281,000	
モリタホールディングス	6,100	2,130.00	12,993,000	
デンソー	174,200	2,190.50	381,585,100	
東海理化電機製作所	6,000	2,225.00	13,350,000	
川崎重工業	15,700	6,915.00	108,565,500	
日産自動車	239,600	422.60	101,254,960	
いすゞ自動車	51,000	2,089.00	106,539,000	
トヨタ自動車	969,500	2,922.00	2,832,879,000	300,000株
日野自動車	34,000	566.30	19,254,200	
三菱自動車工業	72,700	451.90	32,853,130	
武蔵精密工業	6,300	3,210.00	20,223,000	
日産車体	4,900	1,008.00	4,939,200	
新明和工業	7,400	1,359.00	10,056,600	
極東開発工業	4,300	2,414.00	10,380,200	
トピー工業	3,300	2,060.00	6,798,000	
ティラド	2,000	3,555.00	7,110,000	
N O K	5,800	2,303.00	13,357,400	
フタバ産業	11,800	715.00	8,437,000	
カヤバ	5,200	2,913.00	15,147,600	
プレス工業	16,500	562.00	9,273,000	
アイシン	40,500	1,699.50	68,829,750	
マツダ	61,600	1,052.50	64,834,000	
今仙電機製作所	1,800	554.00	997,200	
本田技研工業	428,900	1,494.50	640,991,050	
スズキ	145,100	1,869.50	271,264,450	
S U B A R U	57,300	2,701.50	154,795,950	
ヤマハ発動機	80,100	1,336.50	107,053,650	
エクセディ	3,800	4,345.00	16,511,000	
豊田合成	6,500	2,623.00	17,049,500	
愛三工業	7,300	1,827.00	13,337,100	
ヨロズ	4,400	1,050.00	4,620,000	
エフ・シー・シー	4,900	3,095.00	15,165,500	
シマノ	7,900	21,935.00	173,286,500	
テイ・エス テック	6,600	1,760.50	11,619,300	
テルモ	120,000	3,056.00	366,720,000	

クリエートメディック	1,200	918.00	1,101,600	
島津製作所	25,000	4,455.00	111,375,000	
バイ・テクノロジー	2,700	2,374.00	6,409,800	
東京計器	3,300	3,170.00	10,461,000	
東京精密	4,000	7,537.00	30,148,000	
マニー	8,200	1,485.50	12,181,100	
ニコン	27,300	1,706.50	46,587,450	
トプコン	10,900	2,945.00	32,100,500	
オリンパス	104,600	2,367.00	247,588,200	
理研計器	3,000	3,160.00	9,480,000	
タムロン	5,000	4,210.00	21,050,000	
HOYA	36,000	21,395.00	770,220,000	
朝日インテック	22,800	2,637.50	60,135,000	
シチズン時計	20,800	941.00	19,572,800	
メニコン	9,000	1,408.00	12,672,000	
セイコーグループ	3,700	5,110.00	18,907,000	
ニプロ	14,700	1,480.00	21,756,000	
パラマウントベッドホールディングス	4,600	2,846.00	13,091,600	
バンダイナムコホールディングス	49,700	3,704.00	184,088,800	
アイフィスジャパン	1,300	529.00	687,700	
パイロットコーポレーション	2,800	4,473.00	12,524,400	
フジシールインターナショナル	3,600	2,408.00	8,668,800	
タカラトミー	8,400	4,287.00	36,010,800	
広済堂ホールディングス	10,000	512.00	5,120,000	
タカノ	1,200	727.00	872,400	
TOPPANホールディングス	22,700	4,433.00	100,629,100	
大日本印刷	36,600	2,288.00	83,740,800	
NISSHA	5,000	1,674.00	8,370,000	
アシックス	68,600	3,551.00	243,598,600	
小松ウオール工業	4,600	1,514.00	6,964,400	
ヤマハ	34,200	1,081.00	36,970,200	
クリナップ	8,700	640.00	5,568,000	
ピジョン	11,200	1,476.00	16,531,200	
キングジム	6,700	856.00	5,735,200	
リンテック	3,500	2,955.00	10,342,500	
イトーキ	9,700	1,575.00	15,277,500	
任天堂	115,000	9,793.00	1,126,195,000	
三菱鉛筆	4,200	2,223.00	9,336,600	
タカラスタANDARD	3,900	1,661.00	6,477,900	
コクヨ	7,000	2,655.50	18,588,500	
オカムラ	6,500	1,957.00	12,720,500	
美津濃	2,500	8,570.00	21,425,000	
東京電力ホールディングス	168,200	426.20	71,686,840	
中部電力	63,400	1,620.00	102,708,000	
関西電力	85,900	1,715.00	147,318,500	

中国電力	32,100	870.90	27,955,890	
北陸電力	18,600	812.80	15,118,080	
東北電力	48,900	1,133.00	55,403,700	
四国電力	15,600	1,211.00	18,891,600	
九州電力	42,900	1,370.50	58,794,450	
北海道電力	21,800	793.60	17,300,480	
沖縄電力	7,000	909.00	6,363,000	
電源開発	12,500	2,473.50	30,918,750	
レノバ	8,500	652.00	5,542,000	
東京瓦斯	35,500	4,096.00	145,408,000	
大阪瓦斯	35,700	3,080.00	109,956,000	
東邦瓦斯	7,500	3,870.00	29,025,000	
北海道瓦斯	18,000	536.00	9,648,000	
西部ガスホールディングス	2,300	1,696.00	3,900,800	
静岡ガス	5,700	1,006.00	5,734,200	
東武鉄道	20,200	2,652.00	53,570,400	
相鉄ホールディングス	5,600	2,528.50	14,159,600	
東急	50,200	1,711.00	85,892,200	
京浜急行電鉄	23,800	1,339.00	31,868,200	
小田急電鉄	31,200	1,448.00	45,177,600	
京王電鉄	8,400	3,938.00	33,079,200	
京成電鉄	36,600	1,424.50	52,136,700	
富士急行	4,400	2,249.00	9,895,600	
東日本旅客鉄道	100,300	2,737.00	274,521,100	
西日本旅客鉄道	43,600	2,787.00	121,513,200	
東海旅客鉄道	69,500	2,857.00	198,561,500	
東京地下鉄	30,300	1,699.00	51,479,700	
西武ホールディングス	22,600	3,235.00	73,111,000	
西日本鉄道	5,400	2,201.50	11,888,100	
ハマキョウレックス	11,200	1,341.00	15,019,200	
近鉄グループホールディングス	19,200	3,317.00	63,686,400	
阪急阪神ホールディングス	23,900	3,916.00	93,592,400	
南海電気鉄道	8,300	2,494.00	20,700,200	
京阪ホールディングス	10,500	3,264.00	34,272,000	
名古屋鉄道	18,300	1,720.00	31,476,000	
ヤマトホールディングス	22,500	1,923.50	43,278,750	
山九	4,300	5,501.00	23,654,300	
センコーグループホールディングス	12,100	1,495.00	18,089,500	
トナミホールディングス	900	6,410.00	5,769,000	
ニッコンホールディングス	11,400	2,221.50	25,325,100	
福山通運	2,400	3,710.00	8,904,000	
セイノーホールディングス	9,900	2,350.50	23,269,950	
九州旅客鉄道	13,100	3,689.00	48,325,900	
S Gホールディングス	30,000	1,471.50	44,145,000	

N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	19,500	2,513.50	49,013,250	
日本郵船	37,600	4,832.00	181,683,200	
商船三井	34,800	5,131.00	178,558,800	
川崎汽船	45,600	1,962.00	89,467,200	
飯野海運	8,900	1,138.00	10,128,200	
日本航空	44,100	2,492.00	109,897,200	
A N Aホールディングス	48,600	2,845.50	138,291,300	
三菱倉庫	21,000	1,105.50	23,215,500	
三井倉庫ホールディングス	2,500	7,500.00	18,750,000	
住友倉庫	5,100	2,667.00	13,601,700	
東陽倉庫	800	1,442.00	1,153,600	
安田倉庫	5,300	1,751.00	9,280,300	
上組	7,600	3,397.00	25,817,200	
キムラユニティー	1,700	1,456.00	2,475,200	
キューソー流通システム	3,600	2,220.00	7,992,000	
エーアイティー	3,900	1,686.00	6,575,400	
N E C ネットエスアイ	7,300	3,340.00	24,382,000	
システナ	35,500	350.00	12,425,000	
デジタルアーツ	2,700	5,900.00	15,930,000	
日鉄ソリューションズ	6,500	3,838.00	24,947,000	
T I S	19,400	3,372.00	65,416,800	
グリーホールディングス	13,100	469.00	6,143,900	
コーエーテクモホールディングス	12,800	1,867.50	23,904,000	
三菱総合研究所	1,900	4,695.00	8,920,500	
ブレインパッド	6,600	1,111.00	7,332,600	
ポルトゥウィンホールディングス	7,100	442.00	3,138,200	
ネクソン	41,100	2,077.00	85,364,700	
エイチーム	8,400	1,001.00	8,408,400	
コロプラ	9,900	494.00	4,890,600	
C A R T A H O L D I N G S	2,900	1,404.00	4,071,600	
S H I F T	22,500	1,283.50	28,878,750	
ティーガイア	3,100	2,659.00	8,242,900	
セック	1,100	4,700.00	5,170,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5,800	3,245.00	18,821,000	
G M O ペイメントゲートウェイ	4,400	8,007.00	35,230,800	
インターネットイニシアティブ	10,400	2,862.50	29,770,000	
ラクス	9,700	1,831.00	17,760,700	
チェンジホールディングス	6,900	1,428.00	9,853,200	
マネーフォワード	4,900	4,227.00	20,712,300	
電算システムホールディングス	2,500	2,332.00	5,830,000	
A p p i e r G r o u p	8,400	1,461.00	12,272,400	
ビジョナル	2,400	7,681.00	18,434,400	
野村総合研究所	39,800	4,771.00	189,885,800	

日本システム技術	3,000	1,832.00	5,496,000	
インテージホールディングス	4,700	1,508.00	7,087,600	
東邦システムサイエンス	1,900	1,319.00	2,506,100	
ラクスル	6,900	1,377.00	9,501,300	
メルカリ	10,500	1,854.00	19,467,000	
ウイングアーク 1 s t	2,600	3,330.00	8,658,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	5,700	885.00	5,044,500	
S a n s a n	7,600	2,385.00	18,126,000	
J M D C	3,800	4,000.00	15,200,000	
フジ・メディア・ホールディングス	14,400	1,975.00	28,440,000	
オービック	33,700	4,537.00	152,896,900	
ジャストシステム	3,400	3,370.00	11,458,000	
L I N E ヤフー	290,500	447.80	130,085,900	
トレンドマイクロ	9,900	8,944.00	88,545,600	
日本オラクル	3,500	14,575.00	51,012,500	
フューチャー	5,600	1,784.00	9,990,400	
C A C H o l d i n g s	3,900	1,729.00	6,743,100	
オービックビジネスコンサルタント	3,200	7,617.00	24,374,400	
大塚商会	19,400	3,435.00	66,639,000	
サイボウズ	4,800	2,575.00	12,360,000	
電通総研	2,600	5,560.00	14,456,000	
デジタルガレージ	4,000	3,805.00	15,220,000	
ウェザーニューズ	2,600	3,525.00	9,165,000	
ビジネスエンジニアリング	1,000	3,600.00	3,600,000	
ネットワンシステムズ	7,800	4,482.00	34,959,600	
アルゴグラフィックス	2,600	4,865.00	12,649,000	
エイベックス	5,300	1,453.00	7,700,900	
B I P R O G Y	6,200	4,549.00	28,203,800	
都築電気	1,500	2,859.00	4,288,500	
T B S ホールディングス	8,900	3,945.00	35,110,500	
日本テレビホールディングス	15,300	2,786.50	42,633,450	
テレビ朝日ホールディングス	5,100	2,369.00	12,081,900	
スカパー J S A T ホールディングス	18,500	913.00	16,890,500	
テレビ東京ホールディングス	2,500	3,150.00	7,875,000	
U - N E X T H O L D I N G S	8,400	1,679.00	14,103,600	
日本電信電話	5,441,900	153.00	832,610,700	
K D D I	134,300	5,103.00	685,332,900	
ソフトバンク	2,895,000	199.50	577,552,500	
光通信	2,000	35,370.00	70,740,000	
GMOインターネットグループ	8,000	2,677.50	21,420,000	
K A D O K A W A	10,400	3,247.00	33,768,800	
ゼンリン	6,600	849.00	5,603,400	
松竹	1,300	11,870.00	15,431,000	
東宝	11,100	6,712.00	74,503,200	

東映	3,000	5,800.00	17,400,000	
N T T データグループ	49,600	3,028.00	150,188,800	
ビジネスブレイン太田昭和	2,900	2,104.00	6,101,600	
D T S	3,400	4,195.00	14,263,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,400	6,222.00	58,486,800	
カプコン	35,700	3,360.00	119,952,000	
S C S K	13,700	3,272.00	44,826,400	
N S W	2,200	2,847.00	6,263,400	
アイネス	4,000	1,876.00	7,504,000	
T K C	3,100	3,730.00	11,563,000	
富士ソフト	5,300	9,790.00	51,887,000	
N S D	6,900	3,209.00	22,142,100	
コナミグループ	6,800	13,825.00	94,010,000	
福井コンピュータホールディングス	2,700	2,897.00	7,821,900	
J B C C ホールディングス	2,300	4,185.00	9,625,500	
ソフトバンクグループ	90,800	9,681.00	879,034,800	
リョーサン菱洋ホールディングス	6,500	2,575.00	16,737,500	
高千穂交易	600	3,955.00	2,373,000	
伊藤忠食品	800	7,190.00	5,752,000	
東京エレクトロン デバイス	2,300	3,065.00	7,049,500	
双日	21,900	3,193.00	69,926,700	
アルフレッサ ホールディングス	18,000	2,140.50	38,529,000	
横浜冷凍	7,900	861.00	6,801,900	
ラサ商事	3,600	1,399.00	5,036,400	
アルコニックス	6,700	1,512.00	10,130,400	
神戸物産	15,200	3,460.00	52,592,000	
あい ホールディングス	3,800	2,026.00	7,698,800	
ダイワボウホールディングス	7,800	2,991.00	23,329,800	
マクニカホールディングス	14,400	1,835.00	26,424,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,400	1,205.00	5,302,000	
レスター	3,100	2,513.00	7,790,300	
T O K A I ホールディングス	8,400	937.00	7,870,800	
シップヘルスケアホールディングス	7,400	2,179.00	16,124,600	
明治電機工業	2,900	1,460.00	4,234,000	
コメダホールディングス	6,200	2,722.00	16,876,400	
佐島電機	1,700	1,650.00	2,805,000	
エコートレーディング	1,800	877.00	1,578,600	
伯東	1,200	4,380.00	5,256,000	
ナガイレーベン	3,200	2,086.00	6,675,200	
三菱食品	1,900	4,900.00	9,310,000	
松田産業	2,800	3,020.00	8,456,000	
第一興商	10,500	1,817.50	19,083,750	
メディパルホールディングス	17,600	2,347.50	41,316,000	
アズワン	6,000	2,556.50	15,339,000	

尾家産業	1,000	1,999.00	1,999,000	
ドウシシャ	3,300	2,103.00	6,939,900	
リックス	1,200	2,871.00	3,445,200	
橋本総業ホールディングス	4,300	1,237.00	5,319,100	
日本ライフライン	7,700	1,398.00	10,764,600	
進和	2,900	2,893.00	8,389,700	
オーハシテクニカ	3,900	2,011.00	7,842,900	
白銅	3,100	2,390.00	7,409,000	
伊藤忠商事	130,200	7,128.00	928,065,600	
丸紅	159,900	2,288.00	365,851,200	
長瀬産業	7,600	2,963.50	22,522,600	
豊田通商	56,000	2,675.00	149,800,000	
兼松	8,700	2,573.50	22,389,450	
三井物産	285,000	3,065.00	873,525,000	
日本紙パルプ商事	11,000	657.00	7,227,000	
山善	6,400	1,335.00	8,544,000	
住友商事	116,900	3,320.00	388,108,000	
内田洋行	1,200	6,590.00	7,908,000	
三菱商事	357,800	2,486.00	889,490,800	
キヤノンマーケティングジャパン	3,400	4,966.00	16,884,400	
西華産業	3,000	4,370.00	13,110,000	
東京産業	5,300	736.00	3,900,800	
阪和興業	3,500	4,810.00	16,835,000	
岩谷産業	18,800	1,705.50	32,063,400	
アステナホールディングス	12,300	438.00	5,387,400	
三愛オブリ	4,600	1,794.00	8,252,400	
稲畑産業	4,400	3,185.00	14,014,000	
ワキタ	6,500	1,825.00	11,862,500	
東邦ホールディングス	5,100	4,390.00	22,389,000	
サンゲツ	4,600	2,872.00	13,211,200	
シナネンホールディングス	1,000	6,510.00	6,510,000	
伊藤忠エネクス	5,800	1,549.00	8,984,200	
サンリオ	16,100	5,516.00	88,807,600	
三信電気	2,700	1,923.00	5,192,100	
モスフードサービス	2,800	3,490.00	9,772,000	
加賀電子	4,600	2,740.00	12,604,000	
ソーダニッカ	3,700	1,097.00	4,058,900	
立花エレテック	2,600	2,645.00	6,877,000	
フォーバル	4,700	1,323.00	6,218,100	
PALTAC	2,400	4,283.00	10,279,200	
トラスコ中山	5,000	2,049.00	10,245,000	
オートバックスセブン	5,000	1,478.00	7,390,000	
加藤産業	2,100	4,310.00	9,051,000	
杉本商事	5,000	1,325.00	6,625,000	
因幡電機産業	3,600	3,708.00	13,348,800	

ミスミグループ本社	29,300	2,284.00	66,921,200	
スズケン	6,700	4,846.00	32,468,200	
ジェコス	5,200	1,002.00	5,210,400	
サンエー	3,600	2,926.00	10,533,600	
エービーシー・マート	8,000	3,179.00	25,432,000	
ハードオフコーポレーション	4,300	1,911.00	8,217,300	
アスクル	5,300	1,661.00	8,803,300	
ゲオホールディングス	4,300	1,739.00	7,477,700	
アダストリア	3,000	3,295.00	9,885,000	
エディオン	5,900	1,796.00	10,596,400	
あみやき亭	5,400	1,601.00	8,645,400	
ハニーズホールディングス	4,000	1,682.00	6,728,000	
ジンズホールディングス	2,000	6,550.00	13,100,000	
ビックカメラ	11,400	1,631.50	18,599,100	
D C Mホールディングス	9,700	1,428.00	13,851,600	
M o n o t a R O	27,900	2,475.00	69,052,500	
J . フロント リテイリング	23,800	2,079.50	49,492,100	
ドトール・日レスホールディングス	4,600	2,325.00	10,695,000	
マツキヨココカラ&カンパニー	35,500	2,320.00	82,360,000	
ブロンコビリー	2,600	3,625.00	9,425,000	
Z O Z O	14,400	4,951.00	71,294,400	
トレジャー・ファクトリー	3,400	1,656.00	5,630,400	
物語コーポレーション	3,900	3,375.00	13,162,500	
三越伊勢丹ホールディングス	32,900	2,588.50	85,161,650	
ウエルシアホールディングス	11,200	2,237.00	25,054,400	
クリエイトS Dホールディングス	3,000	2,836.00	8,508,000	
シュッピン	4,800	1,088.00	5,222,400	
オイシックス・ラ・大地	5,200	1,474.00	7,664,800	
ジョイフル本田	5,100	1,864.00	9,506,400	
すかいらーくホールディングス	26,200	2,333.50	61,137,700	
ヨシックスホールディングス	2,000	2,979.00	5,958,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	11,000	773.00	8,503,000	
あさひ	5,800	1,462.00	8,479,600	
コスモス薬品	3,600	7,310.00	26,316,000	
セブン&アイ・ホールディングス	211,800	2,435.00	515,733,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	14,900	1,302.00	19,399,800	
ツルハホールディングス	4,000	9,358.00	37,432,000	
サンマルクホールディングス	2,900	2,499.00	7,247,100	
トリドールホールディングス	5,900	3,716.00	21,924,400	
クスリのアオキホールディングス	6,100	3,166.00	19,312,600	
力の源ホールディングス	3,600	1,192.00	4,291,200	
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	11,000	3,323.00	36,553,000	

ノジマ	6,400	2,157.00	13,804,800	
カップ・クリエイト	5,700	1,418.00	8,082,600	
ライトオン	5,300	205.00	1,086,500	
良品計画	23,400	3,960.00	92,664,000	
パリミキホールディングス	1,700	307.00	521,900	
アドヴァングループ	5,300	1,012.00	5,363,600	
G - 7ホールディングス	4,300	1,362.00	5,856,600	
コーナン商事	2,500	3,550.00	8,875,000	
エコス	2,900	2,040.00	5,916,000	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	39,500	4,119.00	162,700,500	
西松屋チェーン	5,700	2,252.00	12,836,400	
ゼンショーホールディングス	10,800	8,614.00	93,031,200	
サイゼリヤ	3,000	4,790.00	14,370,000	
魚力	2,500	2,445.00	6,112,500	
ユナイテッドアローズ	3,700	2,712.00	10,034,400	
ハイデイ日高	3,600	2,949.00	10,616,400	
コロワイド	11,500	1,673.00	19,239,500	
壱番屋	7,500	985.00	7,387,500	
スギホールディングス	11,900	2,630.00	31,297,000	
薬王堂ホールディングス	2,700	1,900.00	5,130,000	
スクロール	5,400	1,055.00	5,697,000	
木曽路	3,400	2,141.00	7,279,400	
千趣会	14,100	239.00	3,369,900	
上新電機	2,300	2,311.00	5,315,300	
日本瓦斯	9,600	2,175.00	20,880,000	
ロイヤルホールディングス	4,800	2,394.00	11,491,200	
チヨダ	3,000	1,392.00	4,176,000	
ライフコーポレーション	2,200	3,555.00	7,821,000	
A O K Iホールディングス	8,500	1,312.00	11,152,000	
コメリ	2,600	3,165.00	8,229,000	
青山商事	6,000	2,172.00	13,032,000	
しまむら	4,300	8,526.00	36,661,800	
高島屋	27,000	1,256.50	33,925,500	
松屋	6,300	1,042.00	6,564,600	
エイチ・ツー・オー リテイリング	10,200	2,279.00	23,245,800	
丸井グループ	13,400	2,586.00	34,652,400	
アクシアル リテイリング	8,000	890.00	7,120,000	
イオン	69,600	3,682.00	256,267,200	
イズミ	3,900	3,045.00	11,875,500	
平和堂	3,300	2,343.00	7,731,900	
フジ	2,400	2,110.00	5,064,000	
ヤオコー	2,300	9,020.00	20,746,000	
ゼビオホールディングス	3,500	1,250.00	4,375,000	
ケーズホールディングス	9,800	1,410.50	13,822,900	

Genky Drug Stores	2,600	3,115.00	8,099,000	
ブックオフグループホールディングス	4,500	1,354.00	6,093,000	
アインホールディングス	2,900	4,625.00	13,412,500	
ヤマダホールディングス	57,700	447.20	25,803,440	
アークランズ	6,900	1,687.00	11,640,300	
ニトリホールディングス	7,000	18,240.00	127,680,000	
吉野家ホールディングス	7,300	2,914.50	21,275,850	
王将フードサービス	4,800	2,950.00	14,160,000	
ミニストップ	3,400	1,683.00	5,722,200	
アークス	3,100	2,691.00	8,342,100	
バローホールディングス	3,700	2,174.00	8,043,800	
大庄	3,500	1,119.00	3,916,500	
ファーストリテイリング	10,800	50,000.00	540,000,000	
サンドラッグ	6,000	4,190.00	25,140,000	
ヤマザワ	700	1,160.00	812,000	
ベルーナ	10,200	868.00	8,853,600	
いよぎんホールディングス	20,600	1,611.50	33,196,900	
しずおかフィナンシャルグループ	35,600	1,339.00	47,668,400	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12,500	1,640.00	20,500,000	
楽天銀行	9,100	4,516.00	41,095,600	
京都フィナンシャルグループ	21,300	2,269.50	48,340,350	
めぶきフィナンシャルグループ	78,400	662.60	51,947,840	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,700	4,625.00	17,112,500	
九州フィナンシャルグループ	35,200	760.30	26,762,560	
ゆうちょ銀行	141,500	1,576.50	223,074,750	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	91,800	867.00	79,590,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,100	2,022.00	18,400,200	
三十三フィナンシャルグループ	300	2,340.00	702,000	
第四北越フィナンシャルグループ	5,600	2,890.00	16,184,000	
ひろぎんホールディングス	19,800	1,183.50	23,433,300	
おきなわフィナンシャルグループ	3,800	2,513.00	9,549,400	
十六フィナンシャルグループ	2,300	4,405.00	10,131,500	
北國フィナンシャルホールディングス	2,000	5,170.00	10,340,000	
プロクレアホールディングス	2,600	1,703.00	4,427,800	
あいちフィナンシャルグループ	4,200	2,559.00	10,747,800	
あおぞら銀行	13,200	2,376.00	31,363,200	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,148,000	1,921.00	2,205,308,000	300,000株
りそなホールディングス	223,300	1,119.50	249,984,350	
三井住友トラストグループ	63,300	3,788.00	239,780,400	
三井住友フィナンシャルグループ	372,300	3,808.00	1,417,718,400	
千葉銀行	51,400	1,275.00	65,535,000	
群馬銀行	33,700	1,071.00	36,092,700	
武蔵野銀行	2,100	3,070.00	6,447,000	
千葉興業銀行	6,700	1,531.00	10,257,700	
七十七銀行	4,800	4,469.00	21,451,200	

秋田銀行	2,900	2,227.00	6,458,300	
山形銀行	3,300	1,003.00	3,309,900	
岩手銀行	2,900	2,853.00	8,273,700	
東邦銀行	18,200	294.00	5,350,800	
東北銀行	900	1,132.00	1,018,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	14,900	4,100.00	61,090,000	
スルガ銀行	16,200	1,200.00	19,440,000	
八十二銀行	33,200	993.00	32,967,600	
山梨中央銀行	4,400	2,156.00	9,486,400	
大垣共立銀行	3,200	1,936.00	6,195,200	
福井銀行	2,500	1,880.00	4,700,000	
滋賀銀行	3,200	4,290.00	13,728,000	
南都銀行	3,100	3,375.00	10,462,500	
百五銀行	18,500	655.00	12,117,500	
紀陽銀行	6,300	2,179.00	13,727,700	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,400	1,983.00	18,640,200	
山陰合同銀行	10,500	1,271.00	13,345,500	
鳥取銀行	900	1,276.00	1,148,400	
百十四銀行	4,000	3,405.00	13,620,000	
阿波銀行	1,800	2,729.00	4,912,200	
大分銀行	2,200	3,095.00	6,809,000	
宮崎銀行	1,900	3,080.00	5,852,000	
佐賀銀行	3,000	2,267.00	6,801,000	
琉球銀行	8,400	1,090.00	9,156,000	
セブン銀行	62,600	307.10	19,224,460	
みずほフィナンシャルグループ	242,200	4,049.00	980,667,800	
山口フィナンシャルグループ	14,800	1,657.50	24,531,000	
名古屋銀行	1,700	6,770.00	11,509,000	
北洋銀行	30,500	472.00	14,396,000	
愛媛銀行	4,100	1,114.00	4,567,400	
トマト銀行	900	1,219.00	1,097,100	
京葉銀行	11,400	779.00	8,880,600	
栃木銀行	18,600	287.00	5,338,200	
トモニホールディングス	22,400	433.00	9,699,200	
フィデアホールディングス	4,200	1,473.00	6,186,600	
池田泉州ホールディングス	35,300	401.00	14,155,300	
F P G	9,700	2,791.00	27,072,700	
S B I ホールディングス	29,600	4,151.00	122,869,600	
ジャフコ グループ	6,700	2,181.00	14,612,700	
大和証券グループ本社	138,000	1,047.00	144,486,000	
野村ホールディングス	297,900	986.00	293,729,400	
岡三証券グループ	22,200	646.00	14,341,200	
丸三証券	12,800	1,045.00	13,376,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	26,800	498.00	13,346,400	

いちよし証券	7,200	898.00	6,465,600	
松井証券	12,000	825.00	9,900,000	
マネックスグループ	21,300	900.00	19,170,000	
極東証券	6,200	1,642.00	10,180,400	
かんぽ生命保険	18,800	2,969.50	55,826,600	
S O M P Oホールディングス	87,200	4,287.00	373,826,400	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	130,600	3,233.00	422,229,800	
第一生命ホールディングス	84,700	4,154.00	351,843,800	
東京海上ホールディングス	176,100	5,209.00	917,304,900	
T & Dホールディングス	48,900	2,889.00	141,272,100	
全国保証	4,300	5,443.00	23,404,900	
ジェイリース	5,200	1,249.00	6,494,800	
クレディセゾン	12,000	3,654.00	43,848,000	
芙蓉総合リース	1,700	11,420.00	19,414,000	
みずほリース	16,000	1,020.00	16,320,000	
東京センチュリー	13,600	1,479.00	20,114,400	
日本証券金融	8,800	1,977.00	17,397,600	
アイフル	42,800	328.00	14,038,400	
リコーリース	1,700	5,100.00	8,670,000	
イオンフィナンシャルサービス	11,300	1,236.50	13,972,450	
アコム	31,700	373.50	11,839,950	
オリエントコーポレーション	8,200	814.00	6,674,800	
オリックス	108,400	3,304.00	358,153,600	
三菱H C キャピタル	76,000	1,033.00	78,508,000	
日本取引所グループ	105,600	1,701.00	179,625,600	
アサックス	2,000	698.00	1,396,000	
N E C キャピタルソリューション	2,300	3,870.00	8,901,000	
大東建託	6,600	16,890.00	111,474,000	
いちご	24,400	354.00	8,637,600	
ヒューリック	43,500	1,400.00	60,900,000	
野村不動産ホールディングス	11,300	4,115.00	46,499,500	
プレサンスコーポレーション	5,100	2,391.00	12,194,100	
オープンハウスグループ	7,000	5,114.00	35,798,000	
東急不動産ホールディングス	56,800	984.30	55,908,240	
飯田グループホールディングス	16,900	2,313.50	39,098,150	
パーク 2 4	16,000	2,045.00	32,720,000	
三井不動産	252,900	1,387.50	350,898,750	
三菱地所	104,000	2,241.00	233,064,000	
平和不動産	4,300	4,545.00	19,543,500	
東京建物	17,800	2,368.00	42,150,400	
京阪神ビルディング	5,600	1,513.00	8,472,800	
住友不動産	28,100	5,132.00	144,209,200	
テーオーシー	7,400	662.00	4,898,800	
スターツコーポレーション	4,100	3,770.00	15,457,000	

空港施設	7,600	580.00	4,408,000	
ゴールドクレスト	3,600	2,820.00	10,152,000	
エスリード	2,500	4,620.00	11,550,000	
A V A N T I A	1,900	784.00	1,489,600	
イオンモール	10,300	1,969.50	20,285,850	
カチタス	7,700	2,172.00	16,724,400	
グランディハウス	9,600	576.00	5,529,600	
日本空港ビルデング	6,700	5,018.00	33,620,600	
M I X I	4,700	3,155.00	14,828,500	
日本M & A センターホールディングス	32,600	686.90	22,392,940	
U T グループ	3,900	2,200.00	8,580,000	
オープンアップグループ	6,500	1,853.00	12,044,500	
コシダカホールディングス	10,900	1,038.00	11,314,200	
パソナグループ	3,500	1,996.00	6,986,000	
エス・エム・エス	8,300	1,678.00	13,927,400	
パーソルホールディングス	194,900	231.00	45,021,900	
クックパッド	34,000	147.00	4,998,000	
学情	3,700	2,214.00	8,191,800	
スタジオアリス	2,900	2,131.00	6,179,900	
N J S	2,500	3,350.00	8,375,000	
総合警備保障	27,600	1,039.00	28,676,400	
カカクコム	14,600	2,379.50	34,740,700	
アイロムグループ	2,600	2,788.00	7,248,800	
ディップ	4,700	2,388.00	11,223,600	
エムスリー	39,400	1,438.50	56,676,900	
ディー・エヌ・エー	9,000	2,715.00	24,435,000	
博報堂D Y ホールディングス	23,400	1,157.00	27,073,800	
ぐるなび	19,000	276.00	5,244,000	
ファンコミュニケーションズ	11,400	410.00	4,674,000	
W D B ホールディングス	2,500	1,709.00	4,272,500	
インフォマート	25,600	326.00	8,345,600	
プレステージ・インターナショナル	11,700	653.00	7,640,100	
クイック	3,400	2,185.00	7,429,000	
電通グループ	20,400	3,609.00	73,623,600	
H . U . グループホールディングス	6,100	2,621.00	15,988,100	
日本空調サービス	7,300	1,079.00	7,876,700	
オリエンタルランド	110,000	3,529.00	388,190,000	
ダスキン	3,300	3,696.00	12,196,800	
ラウンドワン	21,000	1,277.00	26,817,000	
リゾートトラスト	8,400	3,102.00	26,056,800	
ビー・エム・エル	2,900	2,912.00	8,444,800	
リソー教育	35,300	299.00	10,554,700	
早稲田アカデミー	4,600	1,857.00	8,542,200	
ユー・エス・エス	41,600	1,378.00	57,324,800	
サイバーエージェント	44,400	1,122.00	49,816,800	

楽天グループ	135,200	947.10	128,047,920	
テー・オー・ダブリュー	19,000	313.00	5,947,000	
エン・ジャパン	4,600	2,012.00	9,255,200	
テクノプロ・ホールディングス	11,200	3,072.00	34,406,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	3,900	747.00	2,913,300	
ジャパンマテリアル	6,200	1,738.00	10,775,600	
キャリアリンク	2,100	2,437.00	5,117,700	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,300	1,010.00	4,343,000	
シグマクシス・ホールディングス	8,600	900.00	7,740,000	
リクルートホールディングス	145,600	10,805.00	1,573,208,000	
エラン	7,600	749.00	5,692,400	
日本郵政	201,600	1,595.00	321,552,000	
ソラスト	14,700	481.00	7,070,700	
ベイカレント	14,200	6,253.00	88,792,600	
M S - J a p a n	4,500	1,071.00	4,819,500	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,300	2,959.00	21,600,700	
アンビスホールディングス	6,100	670.00	4,087,000	
リログループ	13,600	1,851.00	25,173,600	
T R Eホールディングス	5,700	1,429.00	8,145,300	
大栄環境	4,400	2,789.00	12,271,600	
日本管財ホールディングス	3,300	2,633.00	8,688,900	
共立メンテナンス	7,300	3,027.00	22,097,100	
建設技術研究所	4,000	2,637.00	10,548,000	
スバル興業	1,500	3,180.00	4,770,000	
タナベコンサルティンググループ	2,000	1,195.00	2,390,000	
東京都競馬	2,400	4,420.00	10,608,000	
カナモト	4,300	3,095.00	13,308,500	
トランス・コスモス	3,300	3,195.00	10,543,500	
乃村工藝社	9,600	920.00	8,832,000	
白洋舎	800	2,228.00	1,782,400	
セコム	37,600	5,294.00	199,054,400	
セントラル警備保障	2,200	2,896.00	6,371,200	
メイテックグループホールディングス	6,000	2,921.50	17,529,000	
応用地質	3,400	2,410.00	8,194,000	
船井総研ホールディングス	4,400	2,388.00	10,507,200	
イオンディライト	2,100	4,185.00	8,788,500	
ダイセキ	4,300	3,610.00	15,523,000	
ステップ	3,100	2,138.00	6,627,800	
合 計	34,189,200	-	71,730,156,830	

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

(2)株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「TMA日本債券インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		[2024年 1月25日現在]	[2025年 1月27日現在]
区 分	注記 番号	金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		81,185,249	84,336,224
国債証券		25,142,469,150	28,565,301,080
地方債証券		1,468,338,556	1,537,083,828
特殊債券		199,346,000	97,759,000
社債券		1,425,686,907	1,487,608,355
未収利息		42,181,439	52,120,104
前払費用		1,424,753	4,799,638
流動資産合計		28,360,632,054	31,829,008,229
資産合計		28,360,632,054	31,829,008,229
負債の部			
流動負債			
未払金		33,857,110	—
未払解約金		38,497,088	34,851,019
未払利息		36	—
流動負債合計		72,354,234	34,851,019
負債合計		72,354,234	34,851,019
純資産の部			
元本等			
元本	1	23,129,731,957	26,700,045,872
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		5,158,545,863	5,094,111,338
元本等合計		28,288,277,820	31,794,157,210
純資産合計		28,288,277,820	31,794,157,210
負債純資産合計		28,360,632,054	31,829,008,229

(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 2025年 1月27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 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日	自 2024年 1月26日 至 2025年 1月27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	[2024年 1月25日現在]	[2025年 1月27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	7,663,247,452円
同期中における一部解約元本額	4,602,798,560円	4,092,933,537円
同期末における元本額	23,129,731,957円	26,700,045,872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	301,155,725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	2,076,747,309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	1,626,397,162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	2,060,951,614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	4,997,773,613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	1,739,987,828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	182,299,551円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035	850,660,190円	1,382,753,922円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	398,009,076円	688,500,912円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	233,314,011円	398,588,565円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	309,307,029円	552,986,035円

TMA日本債券インデックスV A < 適格機関投資家限定 >	27,956,462円	14,177,837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	1,373,170,726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	5,077,222,460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	1,378,071,075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	2,849,261,538円
計	23,129,731,957円	26,700,045,872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	23,129,731,957口	26,700,045,872口

（注）＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日	自 2024年 1月26日 至 2025年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2024年 1月25日現在]	[2025年 1月27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 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。

(自 2024年1月26日 至 2025年1月27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	309,872,380円
地方債証券	15,015,144円
特殊債券	608,000円
社債券	12,455,660円
合計	337,951,184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(2024年11月12日から2025年1月27日まで)を指しております。

(1口当たり情報に関する注記)

[2024年 1月25日現在]		[2025年 1月27日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額	1.2230円 12,230円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額	1.1908円 11,908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4 5 7 回利付国債(2年)	100,000,000	99,557,000	
	第4 5 8 回利付国債(2年)	105,000,000	104,596,800	
	第4 5 9 回利付国債(2年)	100,000,000	99,569,000	
	第4 6 0 回利付国債(2年)	100,000,000	99,644,000	
	第4 6 1 回利付国債(2年)	140,000,000	139,617,800	
	第4 6 2 回利付国債(2年)	135,000,000	134,570,700	
	第4 6 3 回利付国債(2年)	120,000,000	119,569,200	
	第4 6 4 回利付国債(2年)	166,000,000	165,332,680	
	第4 6 5 回利付国債(2年)	110,000,000	109,517,100	
	第4 6 6 回利付国債(2年)	113,000,000	112,655,350	
	第4 6 7 回利付国債(2年)	22,000,000	21,965,900	
	第1 4 7 回利付国債(5年)	232,000,000	230,526,800	
	第1 4 8 回利付国債(5年)	287,000,000	284,583,460	
	第1 4 9 回利付国債(5年)	351,000,000	347,314,500	

第 1 5 0 回利付国債（ 5 年 ）	282,000,000	278,491,920	
第 1 5 1 回利付国債（ 5 年 ）	275,000,000	271,056,500	
第 1 5 2 回利付国債（ 5 年 ）	181,000,000	178,766,460	
第 1 5 3 回利付国債（ 5 年 ）	293,000,000	288,209,450	
第 1 5 4 回利付国債（ 5 年 ）	275,000,000	270,611,000	
第 1 5 5 回利付国債（ 5 年 ）	124,000,000	122,488,440	
第 1 5 6 回利付国債（ 5 年 ）	259,000,000	255,109,820	
第 1 5 7 回利付国債（ 5 年 ）	101,000,000	99,279,970	
第 1 5 8 回利付国債（ 5 年 ）	276,000,000	270,455,160	
第 1 5 9 回利付国債（ 5 年 ）	120,000,000	117,322,800	
第 1 6 0 回利付国債（ 5 年 ）	136,000,000	133,414,640	
第 1 6 3 回利付国債（ 5 年 ）	235,000,000	231,712,350	
第 1 6 4 回利付国債（ 5 年 ）	140,000,000	136,724,000	
第 1 6 5 回利付国債（ 5 年 ）	123,000,000	120,586,740	
第 1 6 6 回利付国債（ 5 年 ）	155,000,000	152,543,250	
第 1 6 7 回利付国債（ 5 年 ）	160,000,000	157,182,400	
第 1 6 8 回利付国債（ 5 年 ）	150,000,000	148,558,500	
第 1 6 9 回利付国債（ 5 年 ）	31,000,000	30,578,090	
第 1 7 0 回利付国債（ 5 年 ）	128,000,000	126,590,720	
第 1 7 3 回利付国債（ 5 年 ）	59,000,000	58,288,460	
第 1 7 4 回利付国債（ 5 年 ）	164,000,000	162,755,240	
第 1 回利付国債（ 4 0 年 ）	6,000,000	6,379,620	
第 2 回利付国債（ 4 0 年 ）	15,000,000	15,338,550	
第 3 回利付国債（ 4 0 年 ）	3,000,000	3,044,340	
第 4 回利付国債（ 4 0 年 ）	27,000,000	27,135,000	
第 5 回利付国債（ 4 0 年 ）	73,000,000	69,924,510	
第 6 回利付国債（ 4 0 年 ）	71,000,000	66,147,860	
第 7 回利付国債（ 4 0 年 ）	82,000,000	72,405,180	
第 8 回利付国債（ 4 0 年 ）	80,000,000	64,873,600	
第 9 回利付国債（ 4 0 年 ）	124,000,000	72,151,880	
第 1 0 回利付国債（ 4 0 年 ）	103,000,000	70,430,370	
第 1 1 回利付国債（ 4 0 年 ）	94,000,000	61,262,620	
第 1 2 回利付国債（ 4 0 年 ）	101,000,000	57,683,120	
第 1 3 回利付国債（ 4 0 年 ）	113,000,000	63,108,240	
第 1 4 回利付国債（ 4 0 年 ）	119,000,000	70,320,670	
第 1 5 回利付国債（ 4 0 年 ）	140,000,000	90,732,600	
第 1 6 回利付国債（ 4 0 年 ）	143,000,000	100,925,110	
第 1 7 回利付国債（ 4 0 年 ）	107,000,000	97,937,100	
第 1 回利付国債（ 1 0 年 ）	30,000,000	28,852,500	
第 2 回利付国債（ 1 0 年 ）	15,000,000	14,771,100	
第 3 4 2 回利付国債（ 1 0 年 ）	200,000,000	198,946,000	
第 3 4 3 回利付国債（ 1 0 年 ）	195,000,000	193,613,550	
第 3 4 4 回利付国債（ 1 0 年 ）	190,000,000	188,299,500	
第 3 4 5 回利付国債（ 1 0 年 ）	190,000,000	187,974,600	
第 3 4 6 回利付国債（ 1 0 年 ）	221,000,000	218,272,860	

第347回利付国債（10年）	310,000,000	305,622,800	
第348回利付国債（10年）	237,000,000	233,217,480	
第349回利付国債（10年）	246,000,000	241,608,900	
第350回利付国債（10年）	252,000,000	246,937,320	
第351回利付国債（10年）	258,000,000	252,244,020	
第352回利付国債（10年）	272,000,000	265,257,120	
第353回利付国債（10年）	246,000,000	239,316,180	
第354回利付国債（10年）	336,000,000	325,987,200	
第355回利付国債（10年）	313,000,000	302,930,790	
第356回利付国債（10年）	425,000,000	410,482,000	
第357回利付国債（10年）	313,000,000	301,475,340	
第358回利付国債（10年）	309,000,000	296,856,300	
第359回利付国債（10年）	342,000,000	327,759,120	
第360回利付国債（10年）	326,000,000	311,740,760	
第361回利付国債（10年）	313,000,000	298,652,080	
第362回利付国債（10年）	311,000,000	296,006,690	
第363回利付国債（10年）	295,000,000	279,972,700	
第364回利付国債（10年）	277,000,000	262,119,560	
第365回利付国債（10年）	316,000,000	298,139,680	
第366回利付国債（10年）	353,000,000	334,400,430	
第367回利付国債（10年）	345,000,000	325,666,200	
第368回利付国債（10年）	274,000,000	257,702,480	
第369回利付国債（10年）	256,000,000	245,736,960	
第370回利付国債（10年）	310,000,000	296,769,200	
第371回利付国債（10年）	291,000,000	275,454,780	
第372回利付国債（10年）	355,000,000	346,455,150	
第373回利付国債（10年）	350,000,000	334,736,500	
第374回利付国債（10年）	240,000,000	232,956,000	
第375回利付国債（10年）	264,000,000	262,545,360	
第376回利付国債（10年）	262,000,000	255,093,680	
第2回利付国債（30年）	6,000,000	6,449,820	
第3回利付国債（30年）	20,000,000	21,461,600	
第5回利付国債（30年）	20,000,000	21,564,400	
第15回利付国債（30年）	4,000,000	4,474,760	
第17回利付国債（30年）	11,000,000	12,210,440	
第21回利付国債（30年）	7,000,000	7,712,040	
第22回利付国債（30年）	10,000,000	11,222,200	
第23回利付国債（30年）	6,000,000	6,737,760	
第25回利付国債（30年）	15,000,000	16,519,500	
第26回利付国債（30年）	15,000,000	16,677,450	
第27回利付国債（30年）	8,000,000	8,979,040	
第28回利付国債（30年）	31,000,000	34,764,950	
第29回利付国債（30年）	56,000,000	62,095,040	
第30回利付国債（30年）	15,000,000	16,409,400	
第31回利付国債（30年）	48,000,000	51,785,280	

第 3 2 回利付国債（ 3 0 年 ）	29,000,000	31,589,410	
第 3 3 回利付国債（ 3 0 年 ）	40,000,000	41,818,400	
第 3 4 回利付国債（ 3 0 年 ）	84,000,000	89,888,400	
第 3 5 回利付国債（ 3 0 年 ）	50,000,000	51,912,000	
第 3 6 回利付国債（ 3 0 年 ）	73,000,000	75,505,360	
第 3 7 回利付国債（ 3 0 年 ）	66,000,000	67,018,380	
第 3 8 回利付国債（ 3 0 年 ）	87,000,000	86,644,170	
第 3 9 回利付国債（ 3 0 年 ）	78,000,000	78,804,960	
第 4 0 回利付国債（ 3 0 年 ）	81,000,000	80,382,780	
第 4 1 回利付国債（ 3 0 年 ）	69,000,000	67,174,260	
第 4 2 回利付国債（ 3 0 年 ）	65,000,000	63,130,600	
第 4 3 回利付国債（ 3 0 年 ）	71,000,000	68,743,620	
第 4 4 回利付国債（ 3 0 年 ）	74,000,000	71,473,640	
第 4 5 回利付国債（ 3 0 年 ）	94,000,000	87,560,060	
第 4 6 回利付国債（ 3 0 年 ）	87,000,000	80,812,560	
第 4 7 回利付国債（ 3 0 年 ）	86,000,000	81,017,160	
第 4 8 回利付国債（ 3 0 年 ）	75,000,000	67,928,250	
第 4 9 回利付国債（ 3 0 年 ）	106,000,000	95,710,580	
第 5 0 回利付国債（ 3 0 年 ）	114,000,000	90,839,760	
第 5 1 回利付国債（ 3 0 年 ）	68,000,000	48,052,880	
第 5 2 回利付国債（ 3 0 年 ）	92,000,000	67,873,920	
第 5 3 回利付国債（ 3 0 年 ）	88,000,000	66,119,680	
第 5 4 回利付国債（ 3 0 年 ）	92,000,000	72,072,800	
第 5 5 回利付国債（ 3 0 年 ）	99,000,000	77,222,970	
第 5 6 回利付国債（ 3 0 年 ）	69,000,000	53,588,850	
第 5 7 回利付国債（ 3 0 年 ）	81,000,000	62,637,300	
第 5 8 回利付国債（ 3 0 年 ）	112,000,000	86,236,640	
第 5 9 回利付国債（ 3 0 年 ）	88,000,000	65,834,560	
第 6 0 回利付国債（ 3 0 年 ）	88,000,000	68,815,120	
第 6 1 回利付国債（ 3 0 年 ）	86,000,000	63,798,240	
第 6 2 回利付国債（ 3 0 年 ）	86,000,000	60,287,720	
第 6 3 回利付国債（ 3 0 年 ）	96,000,000	65,107,200	
第 6 4 回利付国債（ 3 0 年 ）	90,000,000	60,669,900	
第 6 5 回利付国債（ 3 0 年 ）	80,000,000	53,604,800	
第 6 6 回利付国債（ 3 0 年 ）	80,000,000	53,243,200	
第 6 7 回利付国債（ 3 0 年 ）	107,000,000	74,898,930	
第 6 8 回利付国債（ 3 0 年 ）	101,000,000	70,244,490	
第 6 9 回利付国債（ 3 0 年 ）	107,000,000	76,068,440	
第 7 0 回利付国債（ 3 0 年 ）	113,000,000	79,896,650	
第 7 1 回利付国債（ 3 0 年 ）	100,000,000	70,316,000	
第 7 2 回利付国債（ 3 0 年 ）	94,000,000	65,784,020	
第 7 3 回利付国債（ 3 0 年 ）	93,000,000	64,777,290	
第 7 4 回利付国債（ 3 0 年 ）	85,000,000	64,124,850	
第 7 5 回利付国債（ 3 0 年 ）	82,000,000	66,652,060	
第 7 6 回利付国債（ 3 0 年 ）	83,000,000	69,034,420	

第 7 7 回利付国債（ 3 0 年）	83,000,000	72,267,270	
第 7 8 回利付国債（ 3 0 年）	93,000,000	76,926,810	
第 7 9 回利付国債（ 3 0 年）	75,000,000	58,809,750	
第 8 0 回利付国債（ 3 0 年）	89,000,000	80,688,290	
第 8 1 回利付国債（ 3 0 年）	82,000,000	70,746,320	
第 8 2 回利付国債（ 3 0 年）	79,000,000	71,423,110	
第 8 3 回利付国債（ 3 0 年）	94,000,000	92,839,100	
第 8 4 回利付国債（ 3 0 年）	69,000,000	66,567,060	
第 8 5 回利付国債（ 2 0 年）	20,000,000	20,348,800	
第 8 6 回利付国債（ 2 0 年）	20,000,000	20,394,000	
第 8 7 回利付国債（ 2 0 年）	25,000,000	25,464,250	
第 8 8 回利付国債（ 2 0 年）	20,000,000	20,466,400	
第 8 9 回利付国債（ 2 0 年）	20,000,000	20,438,800	
第 9 0 回利付国債（ 2 0 年）	65,000,000	66,649,050	
第 9 3 回利付国債（ 2 0 年）	8,000,000	8,223,520	
第 9 4 回利付国債（ 2 0 年）	8,000,000	8,240,400	
第 9 5 回利付国債（ 2 0 年）	16,000,000	16,608,000	
第 9 9 回利付国債（ 2 0 年）	20,000,000	20,785,000	
第 1 0 0 回利付国債（ 2 0 年）	20,000,000	20,899,000	
第 1 0 5 回利付国債（ 2 0 年）	20,000,000	20,939,000	
第 1 0 6 回利付国債（ 2 0 年）	20,000,000	21,009,800	
第 1 0 7 回利付国債（ 2 0 年）	8,000,000	8,392,640	
第 1 0 8 回利付国債（ 2 0 年）	25,000,000	26,038,250	
第 1 0 9 回利付国債（ 2 0 年）	9,000,000	9,389,160	
第 1 1 1 回利付国債（ 2 0 年）	11,000,000	11,636,020	
第 1 1 2 回利付国債（ 2 0 年）	10,000,000	10,535,900	
第 1 1 3 回利付国債（ 2 0 年）	5,000,000	5,281,550	
第 1 1 5 回利付国債（ 2 0 年）	10,000,000	10,631,700	
第 1 1 6 回利付国債（ 2 0 年）	40,000,000	42,638,000	
第 1 1 7 回利付国債（ 2 0 年）	60,000,000	63,661,800	
第 1 1 8 回利付国債（ 2 0 年）	10,000,000	10,581,900	
第 1 2 0 回利付国債（ 2 0 年）	37,000,000	38,371,220	
第 1 2 1 回利付国債（ 2 0 年）	30,000,000	31,653,600	
第 1 2 2 回利付国債（ 2 0 年）	35,000,000	36,740,900	
第 1 2 3 回利付国債（ 2 0 年）	58,000,000	61,981,700	
第 1 2 4 回利付国債（ 2 0 年）	40,000,000	42,521,600	
第 1 2 5 回利付国債（ 2 0 年）	45,000,000	48,460,050	
第 1 2 6 回利付国債（ 2 0 年）	40,000,000	42,596,800	
第 1 2 7 回利付国債（ 2 0 年）	25,000,000	26,477,500	
第 1 2 8 回利付国債（ 2 0 年）	33,000,000	34,994,520	
第 1 2 9 回利付国債（ 2 0 年）	28,000,000	29,522,920	
第 1 3 0 回利付国債（ 2 0 年）	54,000,000	56,992,680	
第 1 3 1 回利付国債（ 2 0 年）	45,000,000	47,212,200	
第 1 3 2 回利付国債（ 2 0 年）	52,000,000	54,593,240	
第 1 3 3 回利付国債（ 2 0 年）	71,000,000	75,024,990	

第 1 3 4 回利付国債（ 2 0 年 ）	46,000,000	48,646,380	
第 1 3 5 回利付国債（ 2 0 年 ）	40,000,000	42,019,600	
第 1 3 6 回利付国債（ 2 0 年 ）	40,000,000	41,752,000	
第 1 3 7 回利付国債（ 2 0 年 ）	47,000,000	49,383,370	
第 1 3 8 回利付国債（ 2 0 年 ）	47,000,000	48,717,850	
第 1 3 9 回利付国債（ 2 0 年 ）	52,000,000	54,259,400	
第 1 4 0 回利付国債（ 2 0 年 ）	78,000,000	81,935,100	
第 1 4 1 回利付国債（ 2 0 年 ）	86,000,000	90,337,840	
第 1 4 2 回利付国債（ 2 0 年 ）	84,000,000	88,882,920	
第 1 4 3 回利付国債（ 2 0 年 ）	137,000,000	142,917,030	
第 1 4 4 回利付国債（ 2 0 年 ）	62,000,000	64,187,980	
第 1 4 5 回利付国債（ 2 0 年 ）	211,000,000	221,661,830	
第 1 4 6 回利付国債（ 2 0 年 ）	135,000,000	141,728,400	
第 1 4 7 回利付国債（ 2 0 年 ）	127,000,000	132,196,840	
第 1 4 8 回利付国債（ 2 0 年 ）	126,000,000	129,969,000	
第 1 4 9 回利付国債（ 2 0 年 ）	125,000,000	128,762,500	
第 1 5 0 回利付国債（ 2 0 年 ）	151,000,000	153,875,040	
第 1 5 1 回利付国債（ 2 0 年 ）	188,000,000	187,749,960	
第 1 5 2 回利付国債（ 2 0 年 ）	189,000,000	188,317,710	
第 1 5 3 回利付国債（ 2 0 年 ）	180,000,000	180,743,400	
第 1 5 4 回利付国債（ 2 0 年 ）	161,000,000	159,792,500	
第 1 5 5 回利付国債（ 2 0 年 ）	191,000,000	185,266,180	
第 1 5 6 回利付国債（ 2 0 年 ）	198,000,000	179,263,260	
第 1 5 7 回利付国債（ 2 0 年 ）	165,000,000	145,261,050	
第 1 5 8 回利付国債（ 2 0 年 ）	169,000,000	153,463,830	
第 1 5 9 回利付国債（ 2 0 年 ）	162,000,000	148,255,920	
第 1 6 0 回利付国債（ 2 0 年 ）	160,000,000	147,611,200	
第 1 6 1 回利付国債（ 2 0 年 ）	164,000,000	148,808,680	
第 1 6 2 回利付国債（ 2 0 年 ）	170,000,000	153,574,600	
第 1 6 3 回利付国債（ 2 0 年 ）	140,000,000	125,910,400	
第 1 6 4 回利付国債（ 2 0 年 ）	171,000,000	151,068,240	
第 1 6 5 回利付国債（ 2 0 年 ）	141,000,000	123,961,560	
第 1 6 6 回利付国債（ 2 0 年 ）	136,000,000	122,360,560	
第 1 6 7 回利付国債（ 2 0 年 ）	171,000,000	148,941,000	
第 1 6 8 回利付国債（ 2 0 年 ）	167,000,000	142,576,250	
第 1 6 9 回利付国債（ 2 0 年 ）	150,000,000	125,427,000	
第 1 7 0 回利付国債（ 2 0 年 ）	153,000,000	127,213,380	
第 1 7 1 回利付国債（ 2 0 年 ）	135,000,000	111,609,900	
第 1 7 2 回利付国債（ 2 0 年 ）	159,000,000	132,831,780	
第 1 7 3 回利付国債（ 2 0 年 ）	170,000,000	141,229,200	
第 1 7 4 回利付国債（ 2 0 年 ）	173,000,000	142,911,840	
第 1 7 5 回利付国債（ 2 0 年 ）	158,000,000	131,963,180	
第 1 7 6 回利付国債（ 2 0 年 ）	148,000,000	122,937,680	
第 1 7 7 回利付国債（ 2 0 年 ）	156,000,000	126,672,000	
第 1 7 8 回利付国債（ 2 0 年 ）	154,000,000	126,575,680	

	第 1 7 9 回利付国債（ 2 0 年）	151,000,000	123,412,300	
	第 1 8 0 回利付国債（ 2 0 年）	154,000,000	132,011,880	
	第 1 8 1 回利付国債（ 2 0 年）	156,000,000	135,429,840	
	第 1 8 2 回利付国債（ 2 0 年）	130,000,000	116,333,100	
	第 1 8 3 回利付国債（ 2 0 年）	145,000,000	135,862,100	
	第 1 8 4 回利付国債（ 2 0 年）	81,000,000	71,966,880	
	第 1 8 5 回利付国債（ 2 0 年）	128,000,000	113,347,840	
	第 1 8 6 回利付国債（ 2 0 年）	149,000,000	140,794,570	
	第 1 8 7 回利付国債（ 2 0 年）	80,000,000	72,820,000	
	第 1 8 8 回利付国債（ 2 0 年）	102,000,000	97,431,420	
	第 1 8 9 回利付国債（ 2 0 年）	106,000,000	106,074,200	
	第 1 9 0 回利付国債（ 2 0 年）	83,000,000	81,520,940	
国債証券	合計	30,613,000,000	28,565,301,080	
地方債証券	第 7 8 1 回東京都公募公債	100,000,000	97,627,000	
	第 2 6 回神奈川県公募公債（ 2 0 年）	20,000,000	20,372,400	
	第 6 回大阪府公募公債（ 2 0 年）	50,000,000	52,691,500	
	平成 2 8 年度第 2 回京都府公募公債（ 1 5 年）	50,000,000	47,578,000	
	第 2 回兵庫県公募公債（ 1 5 年）	100,000,000	101,407,000	
	第 4 回静岡県公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	103,199,000	
	平成 3 1 年度第 1 回愛知県公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	96,462,000	
	平成 2 9 年度第 7 回広島県公募公債	100,000,000	97,976,000	
	第 4 回埼玉県公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	97,710,000	
	平成 2 7 年度第 3 回福岡県公募公債	200,000,000	200,008,000	
	令和 4 年度第 1 回長野県公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	94,598,000	
	第 2 4 回群馬県公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	93,964,000	
	令和 4 年度第 2 回熊本県公募公債（ 5 年）	140,400,000	137,987,928	
	平成 2 4 年度第 2 回福井県公募公債	100,000,000	104,359,000	
	令和元年度第 2 回徳島県公募公債	100,000,000	95,830,000	
	令和元年度第 3 回岡山県公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	95,314,000	
地方債証券	合計	1,560,400,000	1,537,083,828	
特殊債券	第 3 4 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,759,000	
特殊債券	合計	100,000,000	97,759,000	
社債券	第 3 3 回道路債券	100,000,000	113,516,000	
	第 2 3 回国際協力銀行債券	100,000,000	101,265,000	
	第 1 0 1 回都市再生債券	100,000,000	99,548,000	
	第 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,837,000	20,096,864	

第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,284,000	22,530,683	
第 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,291,000	21,534,356	
第 5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,772,000	23,048,452	
第 1 5 回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	98,374,000	
第 2 1 回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	98,346,000	
第 8 0 回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,451,000	
第 3 2 回 N T T ファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,121,000	
第 8 7 回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	97,930,000	
第 1 1 8 回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,747,000	
第 8 3 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,360,000	
第 5 0 3 回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,009,000	
第 5 3 6 回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,032,000	
第 4 6 3 回中国電力株式会社社債	100,000,000	97,942,000	
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	97,757,000	
社債券 合計	1,486,184,000	1,487,608,355	
合計	33,759,584,000	31,687,752,263	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「東京海上・東証ＲＥＩＴマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		[2024年 1月25日現在]	[2025年 1月27日現在]
区 分	注記 番号	金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		261,917,401	139,976,795
投資証券		12,878,239,550	9,941,255,900
派生商品評価勘定		—	10,210,620
未収入金		217,614,681	213,287,112
未収配当金		102,787,667	100,945,126
未収利息		—	1,559
差入委託証拠金		19,016,144	13,512,088
流動資産合計		13,479,575,443	10,419,189,200
資産合計		13,479,575,443	10,419,189,200
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		640,800	—
前受金		2,118,200	5,680,620
未払解約金		271,860,622	208,350,006
未払利息		117	—
流動負債合計		274,619,739	214,030,626
負債合計		274,619,739	214,030,626
純資産の部			
元本等			
元本	1	9,363,911,642	7,369,828,614
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,841,044,062	2,835,329,960
元本等合計		13,204,955,704	10,205,158,574
純資産合計		13,204,955,704	10,205,158,574
負債純資産合計		13,479,575,443	10,419,189,200

(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 2025年 1月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日	自 2024年 1月26日 至 2025年 1月27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	[2024年 1月25日現在]	[2025年 1月27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	8,878,547,954円	9,363,911,642円
同期中における追加設定元本額	4,777,616,857円	5,079,713,884円
同期中における一部解約元本額	4,292,253,169円	7,073,796,912円
同期末における元本額	9,363,911,642円	7,369,828,614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 >	9,663,771円	39,455,885円
円資産バランスファンド2019 - 05 < 適格機関投資家限定 >	65,776,411円	272,084,773円
円資産バランスファンド2019 - 09 < 適格機関投資家限定 >	55,526,729円	213,082,202円
円資産バランスファンド2019 - 12 < 適格機関投資家限定 >	71,129,064円	270,015,284円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	5,720,716円	24,503,471円
東京海上・東証 R E I T インデックスファンド < 適格機関投資家限定 >	9,003,106,649円	5,996,783,320円
円資産バランスオープン < 適格機関投資家限定 >	46,012,164円	180,547,827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)	106,976,138円	373,355,852円

計	9,363,911,642円	7,369,828,614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	9,363,911,642口	7,369,828,614口

（注）＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2023年 1月26日 至 2024年 1月25日	自 2024年 1月26日 至 2025年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、先物取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2024年 1月25日現在]	[2025年 1月27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ぬ。	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つた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

（自 2023年1月26日 至 2024年1月25日）

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	232,299,817円
合 計	232,299,817円

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

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2023年1月26日から2024年1月25日まで)を指しております。

（自 2024年1月26日 至 2025年1月27日）

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	420,536,530円
合 計	420,536,530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(2024年1月26日から2025年1月27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

（2024年1月25日現在）

（単位：円）

区 分	種 類	契約額等	うち	時 価	評価損益
			1 年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	318,815,800	—	318,175,000	640,800
	東証 R E I T 指数先物	318,815,800	—	318,175,000	640,800
合 計		318,815,800	—	318,175,000	640,800

（2025年1月27日現在）

（単位：円）

区 分	種 類	契約額等	うち	時 価	評価損益
			1 年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	242,185,880	—	252,396,500	10,210,620
	東証 R E I T 指数先物	242,185,880	—	252,396,500	10,210,620
合 計		242,185,880	—	252,396,500	10,210,620

(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）

[2024年 1月25日現在]		[2025年 1月27日現在]	
1口当たり純資産額	1.4102円	1口当たり純資産額	1.3847円
（1万口当たり純資産額	14,102円）	（1万口当たり純資産額	13,847円）

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	225	25,965,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	325	26,390,000	
	S O S i L A 物流リート投資法人	506	55,862,400	
	東海道リート投資法人	173	18,562,900	
	日本アコモデーションファンド投資法人	350	203,350,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,193	149,721,500	
	産業ファンド投資法人	1,857	219,497,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人	997	288,133,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	493	164,662,000	
	G L P 投資法人	3,408	429,067,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	514	140,938,800	
	日本プロロジスリート投資法人	1,767	412,417,800	
	星野リゾート・リート投資法人	429	89,703,900	
	O n e リート投資法人	177	43,188,000	
	イオンリート投資法人	1,244	156,868,400	
	ヒューリックリート投資法人	896	125,081,600	
	日本リート投資法人	1,318	106,362,600	
	積水ハウス・リート投資法人	3,048	240,792,000	
	トーセイ・リート投資法人	221	28,288,000	
	ヘルスケア & メディカル投資法人	250	27,050,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	276	26,413,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	3,247	473,737,300	
	いちごホテルリート投資法人	168	23,755,200	
	ラサールロジポート投資法人	1,299	187,056,000	
	スターアジア不動産投資法人	1,869	99,804,600	
	マリモ地方創生リート投資法人	184	19,872,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,211	223,311,000	
	日本ホテル&レジデンシャル投資法人	214	14,445,000	

投資法人みらい	1,397	57,416,700	
三菱地所物流リート投資法人	350	123,375,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	437	64,544,900	
ザイマックス・リート投資法人	174	20,149,200	
タカラレーベン不動産投資法人	663	58,476,600	
日本ビルファンド投資法人	5,917	729,566,100	
ジャパンリアルエステイト投資法人	5,210	566,327,000	
日本都市ファンド投資法人	5,260	476,030,000	
オリックス不動産投資法人	2,021	342,357,400	
日本プライムリアルティ投資法人	694	236,654,000	
N T T 都市開発リート投資法人	1,031	127,122,300	
東急リアル・エステート投資法人	680	109,208,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	735	76,734,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	2,253	335,697,000	
森トラストリート投資法人	1,955	122,969,500	
インヴィンシブル投資法人	5,589	381,728,700	
フロンティア不動産投資法人	1,882	151,501,000	
平和不動産リート投資法人	744	95,232,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	682	184,276,400	
福岡リート投資法人	572	83,912,400	
K D X 不動産投資法人	2,838	432,227,400	
いちごオフィスリート投資法人	740	62,160,000	
大和証券オフィス投資法人	416	118,684,800	
阪急阪神リート投資法人	484	61,419,600	
スターツプロシード投資法人	176	31,398,400	
大和ハウスリート投資法人	1,513	359,337,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	3,727	270,580,200	
大和証券リビング投資法人	1,498	133,172,200	
ジャパンエクセレント投資法人	871	108,700,800	
投資証券 合計	79,368	9,941,255,900	
合計	79,368	9,941,255,900	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2025年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	314,128,267 円
負債総額	2,372,677 円
純資産総額（ - ）	311,755,590 円
発行済数量	313,064,970 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.9958 円

（ご参考：親投資信託の現況）

TMA日本株TOPIXマザーファンド

2025年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	76,939,734,532 円
負債総額	487,561,245 円
純資産総額（ - ）	76,452,173,287 円
発行済数量	29,065,045,951 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.6304 円

TMA日本債券インデックスマザーファンド

2025年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	32,235,868,147 円
負債総額	336,620,681 円
純資産総額（ - ）	31,899,247,466 円
発行済数量	26,840,399,681 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.1885 円

東京海上・東証REITマザーファンド

2025年1月31日 現在

種類	金額
資産総額	10,325,585,266 円
負債総額	1,087,641,661 円
純資産総額（ - ）	9,237,943,605 円
発行済数量	6,591,763,873 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.4014 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

1. 名義書換
該当事項はありません。
2. 受益者に対する特典
特典はありません。
3. 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

4. 受益権の譲渡

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

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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てします。）にお支払いします。

8. 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

2025年1月末日現在、資本金の額は20億円です。なお、会社の発行可能株式総数は160,000株であり、38,300株を発行済みです。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。

運用本部で運用計画案、収益分配方針案等の運用の基本方針案を作成します。

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

決定された運用の基本方針に基づき、具体的運用計画を策定し、運用を行います。

売買の執行はトレーディング部が行います。

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2025年1月末日現在、委託会社が運用を行っている証券投資信託（親投資信託を除きます。）は次の通りです。

	本数	純資産総額（百万円）
追加型公社債投資信託	0	0
追加型株式投資信託	169	2,875,562
単位型公社債投資信託	1	2,682
単位型株式投資信託	19	91,765
合計	189	2,970,009

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
また、当社の中間財務諸表は、「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282条及び第306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。
また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人による中間監査を受けております。

(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	* 1
建物	433,750	631,543
器具備品	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
ソフトウェア	314,954	372,797
ソフトウェア仮勘定	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
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

市場価格のない株式等以外のもの

当事業年度末日の市場価格等に基づく時価法

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

(2) 無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当期負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の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。	* 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	建物 245,354千円
器具備品 477,945千円	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 信用リスク 未収収益については、管理部門において取引先ごとに期日及び残高を把握することで、回収懸念の早期把握や軽減を図っております。 市場リスク 未収委託者報酬には、運用資産の悪化から回収できず当社が損失を被るリスクが存在しますが、過去の回収実績からリスクは僅少であると判断しております。 投資有価証券については、管理部門において定期的に時価を把握する体制としております。 流動性リスク 当社は、日々資金残高管理を行っており流動性リスクを管理しております。	(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 同左 市場リスク 同左 流動性リスク 同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

第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 其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 其他有価証券	-	48,291	-	48,291
資産計	-	48,291	-	48,291

(2)時価で貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

（単位：千円）

	時価			
	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 其他有価証券	-	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
貸借対照表計上額が取得原価を超えるものの証券投資信託	27,605	18,645	8,960
貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの証券投資信託	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
貸借対照表計上額が取得原価を超えるものの証券投資信託	37,893	20,877	17,015
貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの証券投資信託	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
その他の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）

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												
[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	日本	その他	合計	25,542,522	3,571,980	29,114,502	[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	日本	その他	合計	27,411,151	3,624,988	31,036,140
日本	その他	合計											
25,542,522	3,571,980	29,114,502											
日本	その他	合計											
27,411,151	3,624,988	31,036,140											

（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	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
						役員の 兼任				

（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いません。	
（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

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間 (2024年9月30日現在)		
資産の部		
流動資産		
現金・預金		1,645,916
前払費用		445,712
関係会社短期貸付金	* 1	16,221,561
未収委託者報酬		3,309,378
未収収益		4,469,276
未収入金		36,149
その他の流動資産		32,038
流動資産計		26,160,035
固定資産		
有形固定資産	* 2	575,879

建物	410,868
器具備品	165,010
無形固定資産	391,206
電話加入権	3,795
ソフトウェア	363,120
ソフトウェア仮勘定	24,290
投資その他の資産	3,670,742
投資有価証券	45,368
関係会社株式	1,669,314
その他の関係会社有価証券	80,000
長期前払費用	16,599
敷金	474,324
その他長期差入保証金	21,230
繰延税金資産	1,363,906
固定資産計	4,637,828
資産合計	30,797,863
負債の部	
流動負債	
未払金	3,575,044
未払手数料	1,469,010
その他未払金	2,106,034
未払費用	417,932
未払消費税等	265,456
未払法人税等	1,238,000
預り金	68,079
前受収益	12,827
賞与引当金	414,756
流動負債計	5,992,095
固定負債	
退職給付引当金	907,625
固定負債計	907,625
負債合計	6,899,721
純資産の部	
株主資本	23,888,762
資本金	2,000,000
資本剰余金	400,000
その他資本剰余金	400,000
利益剰余金	21,488,762
利益準備金	500,000
その他利益剰余金	20,988,762
繰越利益剰余金	20,988,762
評価・換算差額等	9,379
その他有価証券評価差額金	9,379
純資産合計	23,898,141
負債・純資産合計	30,797,863

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	8,038,620

運用受託報酬	6,708,309
投資助言報酬	59,208
その他営業収益	346,477
営業収益計	15,152,615
営業費用	
支払手数料	3,610,428
広告宣伝費	110,741
調査費	4,419,764
調査費	1,792,091
委託調査費	2,627,672
委託計算費	64,325
営業雑経費	136,280
通信費	29,635
印刷費	77,926
協会費	13,804
諸会費	10,164
図書費	4,750
営業費用計	8,341,540
一般管理費	
給料	1,768,814
役員報酬	39,165
給料・手当	1,586,043
賞与	143,605
交際費	7,666
寄付金	200
旅費交通費	77,766
租税公課	88,884
不動産賃借料	234,046
退職給付費用	89,439
賞与引当金繰入	414,756
固定資産減価償却費	* 1 123,747
法定福利費	349,296
福利厚生費	8,552
諸経費	231,573
一般管理費計	3,394,743
営業利益	3,416,330
営業外収益	
受取利息	8,215
受取配当金	1,300
為替差益	7,169
雑益	6,792
営業外収益計	23,477
営業外費用	
雑損	4,606
営業外費用計	4,606
経常利益	3,435,202
特別利益	-
特別損失	-
税引前中間純利益	3,435,202
法人税、住民税及び事業税	1,161,368
法人税等調整額	105,882
法人税等合計	1,055,485

中間純利益

2,379,716

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	22,396,494
当中間期変動額					
剰余金の配当					3,787,448
中間純利益					2,379,716
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	-	-	1,407,732
当中間期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	20,988,762

	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	22,896,494	25,296,494	10,599	10,599	25,307,093
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,787,448	3,787,448			3,787,448
中間純利益	2,379,716	2,379,716			2,379,716
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			1,219	1,219	1,219
当中間期変動額合計	1,407,732	1,407,732	1,219	1,219	1,408,951
当中間期末残高	21,488,762	23,888,762	9,379	9,379	23,898,141

注記事項

(重要な会計方針)

当中間会計期間 自 2024年4月1日 至 2024年9月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法 (1) 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

(2) 無形固定資産

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

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当中間会計期間末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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。

（中間貸借対照表関係）

	当中間会計期間 (2024年9月30日現在)
--	---------------------------

* 1 . 貸出コミットメント	当社は、グループ全体の資金管理や資金効率の向上をはかることを目的として、キャッシュ・マネジメント・サービス（以下「CMS」）を導入しております。当社は、関係会社と、CMSによる貸出コミットメントを定めた金銭消費貸借契約を締結しています。「関係会社短期貸付金」は、これによる貸付金であります。CMSにおける貸出コミットメントに係る貸出未実行残高は次のとおりであります。 <table> <tr> <td>貸出コミットメントの総額</td><td>30,000,000千円</td></tr> <tr> <td>貸出実行残高</td><td>16,221,561千円</td></tr> <tr> <td>差引額</td><td>13,778,438千円</td></tr> </table> なお、上記金銭消費貸借契約書において、経済情勢、金融情勢の変化、契約当事者の経営状態の変化、その他事由があるときには、貸出コミットメントの金額及び利息の条件について、契約当事者間で同意の上で変更できるものと定められており、必ずしも全額が貸出実行されるものではありません。また、当社の資金が不足している場合には、資金を借り入れる場合があります。	貸出コミットメントの総額	30,000,000千円	貸出実行残高	16,221,561千円	差引額	13,778,438千円
貸出コミットメントの総額	30,000,000千円						
貸出実行残高	16,221,561千円						
差引額	13,778,438千円						
* 2 . 有形固定資産の減価償却累計額	<table> <tr> <td>建物</td><td>269,340千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>490,446千円</td></tr> </table>	建物	269,340千円	器具備品	490,446千円		
建物	269,340千円						
器具備品	490,446千円						

（中間損益計算書関係）

	当中間会計期間 自 2024年4月1日 至 2024年9月30日				
* 1 . 減価償却実施額	<table> <tr> <td>有形固定資産</td><td>62,689千円</td></tr> <tr> <td>無形固定資産</td><td>61,057千円</td></tr> </table>	有形固定資産	62,689千円	無形固定資産	61,057千円
有形固定資産	62,689千円				
無形固定資産	61,057千円				

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間 自 2024年4月1日 至 2024年9月30日				
1 . 発行済株式の種類及び総数に関する事項				
株式の種類	当事業年度期首 (株)	当中間会計期間 増加 (株)	当中間会計期間 減少 (株)	当中間会計期間末 (株)
普通株式	38,300	-	-	38,300
2 . 配当に関する事項				
配当金支払額 2024年6月26日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。				
・ 普通株式の配当に関する事項				
(イ) 配当金の総額・・・・・・・・・・3,787,448千円				
(ロ) 1株当たり配当額・・・・・・・・・・98,889円				
(ハ) 基準日・・・・・・・・・・2024年3月31日				
(ニ) 効力発生日・・・・・・・・・・2024年6月26日				

（金融商品関係）

当中間会計期間（2024年9月30日現在）

1 . 金融商品の時価等に関する事項

2024年9月30日現在における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
--	------------	----	----

投資有価証券 其他有価証券	45,368	45,368	-
敷金	474,324	472,101	2,223
資産計	519,692	517,469	2,223

（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
関係会社短期貸付金
未収委託者報酬
未収収益
未収入金
預り金
未払金
未払費用

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

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額
関係会社株式	
子会社株式	1,641,087
関連会社株式	28,227
その他の関係会社有価証券	80,000

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

(1)時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

（単位：千円）

	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券 其他有価証券	-	45,368	-	45,368
資産計	-	45,368	-	45,368

(2)時価で中間貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

（単位：千円）

	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
敷金	-	472,101	-	472,101
資産計	-	472,101	-	472,101

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

投資有価証券

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

敷金

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

（有価証券関係）

当中間会計期間（2024年9月30日現在）

その他有価証券

（単位：千円）

	種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	証券投資信託	33,767	18,915	14,852
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	証券投資信託	11,600	12,933	1,332
合計		45,368	31,849	13,519

（収益認識関係）

当中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

（単位：千円）

	運用報酬	成功報酬	合計
委託者報酬	8,038,620	-	8,038,620
運用受託報酬	6,708,309	-	6,708,309
投資助言報酬	59,208	-	59,208
その他営業収益	346,477	-	346,477
合計	15,152,615	-	15,152,615

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

顧客との契約から生じた債権等

顧客との契約から生じた債権（期首残高） 7,611,757千円

顧客との契約から生じた債権（期末残高） 7,778,655千円

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

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

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

[関連情報]

当中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	その他	合計
13,310,666	1,841,948	15,152,615

(注)営業収益は顧客の所在地を基準とし、国ごとに分類しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

当社は、外部顧客からの収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

(1 株当たり情報)

当中間会計期間 自 2024年4月1日 至 2024年9月30日	
1株当たり純資産額	623,972円37銭
1株当たり中間純利益金額	62,133円59銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	23,898,141千円
純資産の部の合計額から控除する金額	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額	23,898,141千円
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数	38,300株
1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益金額	2,379,716千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	2,379,716千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

- ・ 名称 三菱UFJ信託銀行株式会社
(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)
- ・ 資本金の額 324,279百万円（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
三菱UFJ eスマート証券株式会社	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。
S M B C 日興証券株式会社	135,000百万円	
株式会社 S B I 証券	54,323百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	13,195百万円	
楽天証券株式会社	19,495百万円（注）	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社愛媛銀行	21,367百万円	
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 公認会計士 久保直毅
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 石井章悟
業務執行社員

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

（注） １．上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年3月28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 将太郎

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上・円資産インデックスバランスファンドの2024年1月26日から2025年1月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上・円資産インデックスバランスファンドの2025年1月27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12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 公認会計士 石井章悟
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 奈良将太郎
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント株式会社の2024年4月1日から2025年3月31日までの第40期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント株式会社の2024年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

（注） １．上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

２．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。