

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | | |
|--------|--|--|
| 商品分類 | 追加型投信／国内／株式／インデックス型（課税上は株式投資信託として取扱われます。） | |
| 信託期間 | 無期限（2016年10月27日設定） | |
| 運用方針 | 日経平均株価（日経225）に連動する投資成果の達成を目標とします。 | |
| 主要投資対象 | 東京海上・日経225インデックスファンド | 「東京海上・日経225インデックスマザーファンド」を主要投資対象とします。 |
| | 東京海上・日経225インデックスマザーファンド | 日経平均株価（日経225）に採用されている銘柄を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | 東京海上・日経225インデックスファンド | <ul style="list-style-type: none"> ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 |
| | 東京海上・日経225インデックスマザーファンド | <ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・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。 |
| 分配方針 | 毎決算時に、原則として、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。）等から、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。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。 | |

東京海上・日経225 インデックスファンド

第7期 運用報告書（全体版）

（決算日 2023年8月7日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「東京海上・日経225インデックスファンド」は、このたび、第7期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

東京都千代田区丸の内1-8-2 鉄鋼ビルディング

お問い合わせ窓口

東京海上アセットマネジメント サービスデスク 0120-712-016

受付時間：営業日の9時～17時

<https://www.tokiomarineam.co.jp/>

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産額 | |
|---------------|--------|----|----|--------|-----------|--------|--------|------|-------|
| | (分配落) | 税金 | 達配 | み期騰落 | 中率 | | | | 期騰落 |
| | 円 | | 円 | | % | | % | 百万円 | |
| 3期(2019年8月6日) | 12,326 | | 0 | △ 7.0 | 20,585.31 | △ 8.5 | 93.0 | 7.6 | 2,422 |
| 4期(2020年8月6日) | 13,654 | | 0 | 10.8 | 22,418.15 | 8.9 | 91.4 | 8.6 | 3,455 |
| 5期(2021年8月6日) | 17,135 | | 0 | 25.5 | 27,820.04 | 24.1 | 97.8 | 2.2 | 5,487 |
| 6期(2022年8月8日) | 17,687 | | 0 | 3.2 | 28,249.24 | 1.5 | 95.0 | 4.7 | 6,939 |
| 7期(2023年8月7日) | 20,597 | | 0 | 16.5 | 32,254.56 | 14.2 | 95.7 | 4.1 | 9,633 |

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

ベンチマークは「日経平均株価（日経225）」です。

「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体及び「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

「日経」及び「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属しています。

当ファンドは、東京海上アセットマネジメント株式会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均株価」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | ベ ン チ マ ー ク | | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 |
|------------------------|-------------|--------|-------------|--------|-----------|-----------|
| | | 騰 落 率 | | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2022年 8 月 8 日 | 円 17,687 | % — | 28,249.24 | % — | % 95.0 | % 4.7 |
| 8 月 末 | 17,595 | △ 0.5 | 28,091.53 | △ 0.6 | 95.5 | 4.2 |
| 9 月 末 | 16,385 | △ 7.4 | 25,937.21 | △ 8.2 | 96.3 | 3.7 |
| 10 月 末 | 17,423 | △ 1.5 | 27,587.46 | △ 2.3 | 95.8 | 4.0 |
| 11 月 末 | 17,666 | △ 0.1 | 27,968.99 | △ 1.0 | 97.9 | 2.1 |
| 12 月 末 | 16,509 | △ 6.7 | 26,094.50 | △ 7.6 | 95.2 | 4.7 |
| 2023年 1 月 末 | 17,284 | △ 2.3 | 27,327.11 | △ 3.3 | 99.3 | 0.5 |
| 2 月 末 | 17,367 | △ 1.8 | 27,445.56 | △ 2.8 | 96.1 | 3.7 |
| 3 月 末 | 17,898 | 1.2 | 28,041.48 | △ 0.7 | 94.7 | 4.8 |
| 4 月 末 | 18,417 | 4.1 | 28,856.44 | 2.1 | 94.4 | 0.6 |
| 5 月 末 | 19,716 | 11.5 | 30,887.88 | 9.3 | 93.5 | 6.3 |
| 6 月 末 | 21,200 | 19.9 | 33,189.04 | 17.5 | 93.7 | 6.5 |
| 7 月 末 | 21,187 | 19.8 | 33,172.22 | 17.4 | 93.3 | 6.6 |
| (期 末) 2023年 8 月 7 日 | 20,597 | 16.5 | 32,254.56 | 14.2 | 95.7 | 4.1 |

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

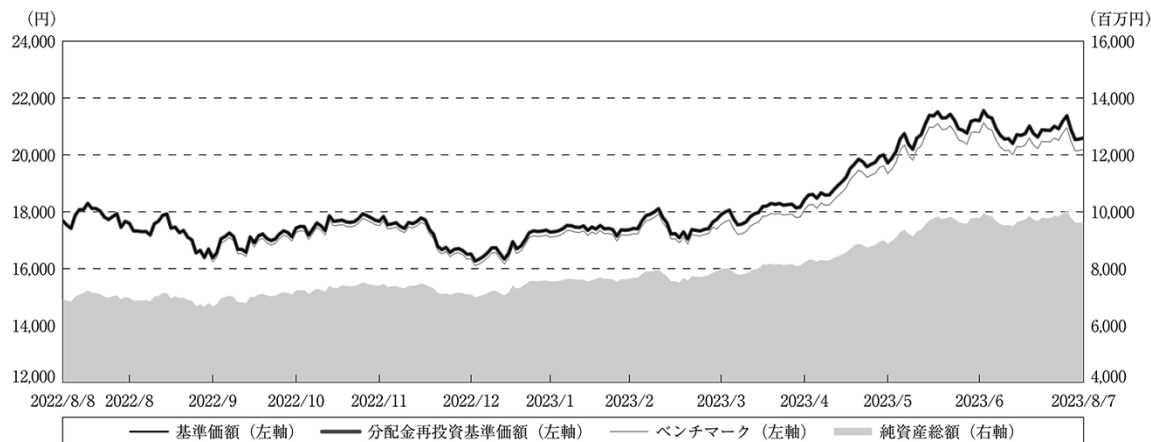
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

○運用経過

(2022年8月9日～2023年8月7日)

■期中の基準価額等の推移



期 首：17,687円

期 末：20,597円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 16.5% (分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2022年8月8日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

(注) ベンチマークは、日経平均株価(日経225)です。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・緩和的な金融政策を通じた国内金利環境継続への期待
- ・東京証券取引所(東証)の要請による国内企業改革への期待

マイナス要因

- ・米国の金融引き締め長期化に対する懸念
- ・日銀による金融緩和政策の転換による長期金利の上昇

■投資環境

当期の国内株式市場は上昇しました。

期初は、米国の金融引き締め政策長期化に対する警戒感や景気後退懸念から、国内株式市場は下落基調で推移しましたが、2022年10月以降は過度な懸念が和らぎ、上昇に転じました。12月に日銀が長期金利の変動許容幅を拡大したことが金融緩和と政策の転換と受け止められ長期金利が上昇し、国内株式市場は下落しましたが、2023年1月には日米の金融政策に対する懸念が後退して、国内株式市場は上昇しました。4月以降は、緩和的な金融政策を通じた国内金利環境継続への安心感や、東証の要請による企業改革への期待から、国内株式市場は上昇基調で推移しました。期末にかけて上値の重い展開となったものの、前期末対比では上昇した水準で期を終えました。

■ポートフォリオについて

<東京海上・日経225インデックスファンド>

「東京海上・日経225インデックスマザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持しました。

当ファンドの基準価額は、マザーファンドの値動きを反映し、16.5%上昇しました。

<東京海上・日経225インデックスマザーファンド>

ベンチマークである日経平均株価（日経225）に連動した投資成果を目標として運用を行っています。個別の銘柄選択は、日経225に採用されている銘柄を主要投資対象とし、当該指数算出方法を考慮した等株数投資を行いました。

当期において、実質的な株式組入比率はほぼ100%に維持しました。

以上のような運用の結果、基準価額は16.7%上昇しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+16.5%となり、株式配当収益分を考慮するとベンチマークの騰落率+14.2%にほぼ連動しました。また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー^{*}は、過去1年で1.1%となりました。

(主な差異要因)

プラス要因

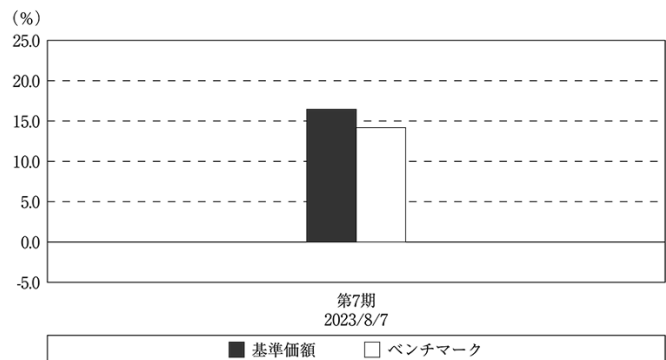
- ・保有銘柄の株式配当収益

マイナス要因

- ・信託報酬などのコスト

^{*}毎月の対ベンチマーク超過収益率（ファンドの収益率とベンチマークの収益率との差）の標準偏差（ばらつき度合い）を年率換算したものです。ベンチマークとの連動性が高いほどこの値は低くなります。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、日経平均株価（日経225）です。

■分配金

当期においては、運用の効率性などを勘案して、収益分配を行わないこととしました。収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

◇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

| 項 目 | 第7期 |
|-----------|-------------------------|
| | 2022年8月9日～ 2023年8月7日 |
| 当期分配金 | — |
| (対基準価額比率) | —% |
| 当期の収益 | — |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 10,597 |

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

<東京海上・日経225インデックスファンド>

「東京海上・日経225インデックスマザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持します。

<東京海上・日経225インデックスマザーファンド>

ファンドの基本方針に基づき、日経225構成銘柄に加え、日経225先物も利用しながら実質的な株式の組入比率をほぼ100%に維持し、ベンチマークとの連動性を高位に保つことを目指した運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年8月9日～2023年8月7日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|---------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 45 | % 0.247 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (20) | (0.110) | *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 |
| （ 販 売 会 社 ） | (20) | (0.110) | *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 |
| （ 受 託 会 社 ） | (5) | (0.027) | *運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 2 | 0.010 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 |
| （ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ） | (2) | (0.010) | *売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (c) そ の 他 費 用 | 1 | 0.005 | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 監 査 費 用 ） | (1) | (0.005) | *監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 |
| 合 計 | 48 | 0.262 | |
| 期中の平均基準価額は、18,220円です。 | | | |

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

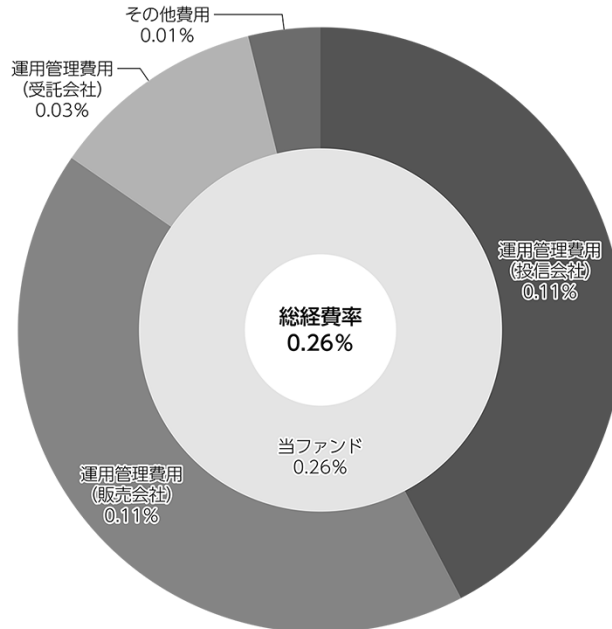
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.26%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、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。

○売買及び取引の状況

(2022年8月9日～2023年8月7日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 | 柄 | 設 定 | | 解 約 | |
|-------------------------|---|-----------|-----------|---------|-----------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 東京海上・日経225インデックスマザーファンド | | 1,646,387 | 3,179,671 | 939,392 | 1,832,528 |

○株式売買比率

(2022年8月9日～2023年8月7日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 | |
|---------------------|-------------------------|--|
| | 東京海上・日経225インデックスマザーファンド | |
| (a) 期中の株式売買金額 | 23,719,522千円 | |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 20,164,450千円 | |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.17 | |

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2022年8月9日～2023年8月7日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

<東京海上・日経225インデックスマザーファンド>

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|-----------|-----------|-------------|
| 株式 | 百万円 55 | 百万円 59 | 百万円 107 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは東京海上ホールディングス株式会社です。

○組入資産の明細

(2023年8月7日現在)

親投資信託残高

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------------|---|-----------|-----------|-----------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | | 千口 | 千口 | 千円 |
| 東京海上・日経225インデックスマザーファンド | | 3,737,086 | 4,444,082 | 9,633,436 |

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2023年8月7日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 東京海上・日経225インデックスマザーファンド | 9,633,436 | 99.4 |
| コール・ローン等、その他 | 54,861 | 0.6 |
| 投資信託財産総額 | 9,688,297 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年8月7日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 9,688,297,356 |
| 東京海上・日経225インデックスマザーファンド(評価額) | 9,633,436,627 |
| 未収入金 | 54,860,729 |
| (B) 負債 | 54,860,729 |
| 未払解約金 | 44,099,011 |
| 未払信託報酬 | 10,527,861 |
| その他未払費用 | 233,857 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 9,633,436,627 |
| 元本 | 4,677,024,045 |
| 次期繰越損益金 | 4,956,412,582 |
| (D) 受益権総口数 | 4,677,024,045口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 20,597円 |

(注) 当ファンドの期首元本額は3,923,475,898円、期中追加設定元本額は1,730,693,153円、期中一部解約元本額は977,145,006円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2022年8月9日～2023年8月7日)

| 項 目 | 当 期 |
|----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 有価証券売買損益 | 1,261,770,115 |
| 売買益 | 1,405,641,507 |
| 売買損 | △ 143,871,392 |
| (B) 信託報酬等 | △ 19,894,663 |
| (C) 当期損益金(A+B) | 1,241,875,452 |
| (D) 前期繰越損益金 | 712,577,051 |
| (E) 追加信託差損益金 | 3,001,960,079 |
| (配当等相当額) | (1,277,252,346) |
| (売買損益相当額) | (1,724,707,733) |
| (F) 計(C+D+E) | 4,956,412,582 |
| (G) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(F+G) | 4,956,412,582 |
| 追加信託差損益金 | 3,001,960,079 |
| (配当等相当額) | (1,283,323,105) |
| (売買損益相当額) | (1,718,636,974) |
| 分配準備積立金 | 1,954,452,503 |

(注) (A)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (B)信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|----------------|
| a. 配当等収益(費用控除後) | 157,590,667円 |
| b. 有価証券等損益額(費用控除後) | 1,084,284,785円 |
| c. 信託約款に規定する収益調整金 | 3,001,960,079円 |
| d. 信託約款に規定する分配準備積立金 | 712,577,051円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 4,956,412,582円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 10,597円 |
| g. 分配金 | 0円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 0円 |

東京海上・日経225インデックスマザーファンド

運用報告書 第7期（決算日 2023年8月7日）

（計算期間 2022年8月9日～2023年8月7日）

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 | | ベンチマ ーク | | 株 式 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|---------------|---------|-------|-----------|-------|-------------|-----------|---------|
| | 期 騰 落 | 中 率 | 期 騰 落 | 中 率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 3期(2019年8月6日) | 12,846 | △ 6.7 | 20,585.31 | △ 8.5 | 93.0 | 7.6 | 29,216 |
| 4期(2020年8月6日) | 14,264 | 11.0 | 22,418.15 | 8.9 | 91.4 | 8.6 | 16,405 |
| 5期(2021年8月6日) | 17,944 | 25.8 | 27,820.04 | 24.1 | 97.8 | 2.2 | 23,706 |
| 6期(2022年8月8日) | 18,569 | 3.5 | 28,249.24 | 1.5 | 95.0 | 4.7 | 21,150 |
| 7期(2023年8月7日) | 21,677 | 16.7 | 32,254.56 | 14.2 | 95.7 | 4.1 | 22,874 |

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

ベンチマークは「日経平均株価（日経225）」です。
「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体及び「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。
「日経」及び「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属しています。
当ファンドは、東京海上アセットマネジメント株式会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。
株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。
株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均株価」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | ベ ン チ マ ー ク | | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 |
|------------------------|-------------|--------|-------------|--------|-----------|-----------|
| | | 騰 落 率 | | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2022年 8 月 8 日 | 円 18,569 | % - | 28,249.24 | % - | % 95.0 | % 4.7 |
| 8 月 末 | 18,476 | △ 0.5 | 28,091.53 | △ 0.6 | 95.5 | 4.2 |
| 9 月 末 | 17,209 | △ 7.3 | 25,937.21 | △ 8.2 | 96.2 | 3.7 |
| 10 月 末 | 18,303 | △ 1.4 | 27,587.46 | △ 2.3 | 95.8 | 4.0 |
| 11 月 末 | 18,562 | △ 0.0 | 27,968.99 | △ 1.0 | 97.8 | 2.1 |
| 12 月 末 | 17,351 | △ 6.6 | 26,094.50 | △ 7.6 | 95.1 | 4.7 |
| 2023年 1 月 末 | 18,168 | △ 2.2 | 27,327.11 | △ 3.3 | 99.1 | 0.5 |
| 2 月 末 | 18,259 | △ 1.7 | 27,445.56 | △ 2.8 | 96.1 | 3.7 |
| 3 月 末 | 18,821 | 1.4 | 28,041.48 | △ 0.7 | 94.6 | 4.8 |
| 4 月 末 | 19,370 | 4.3 | 28,856.44 | 2.1 | 94.4 | 0.6 |
| 5 月 末 | 20,740 | 11.7 | 30,887.88 | 9.3 | 93.4 | 6.3 |
| 6 月 末 | 22,305 | 20.1 | 33,189.04 | 17.5 | 93.6 | 6.5 |
| 7 月 末 | 22,296 | 20.1 | 33,172.22 | 17.4 | 93.2 | 6.6 |
| (期 末) 2023年 8 月 7 日 | 21,677 | 16.7 | 32,254.56 | 14.2 | 95.7 | 4.1 |

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

○運用経過

(2022年8月9日～2023年8月7日)

■期中の基準価額等の推移

期首：18,569円

期末：21,677円

騰落率：16.7%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・緩和的な金融政策を通じた国内金利環境継続への期待
- ・東京証券取引所（東証）の要請による国内企業改革への期待

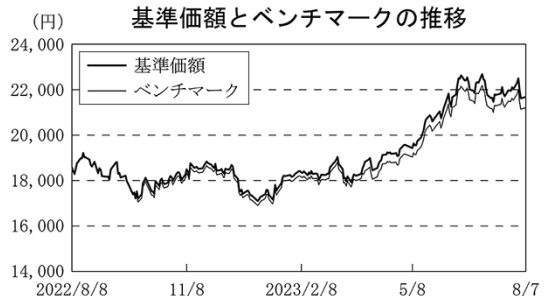
マイナス要因

- ・米国の金融引き締め長期化に対する懸念
- ・日銀による金融緩和政策の転換による長期金利の上昇

■投資環境

当期の国内株式市場は上昇しました。

期初は、米国の金融引き締め政策長期化に対する警戒感や景気後退懸念から、国内株式市場は下落基調で推移しましたが、2022年10月以降は過度な懸念が和らぎ、上昇に転じました。12月に日銀が長期金利の変動許容幅を拡大したことが金融緩和政策の転換と受け止められ長期金利が上昇し、国内株式市場は下落しましたが、2023年1月には日米の金融政策に対する懸念が後退して、国内株式市場は上昇しました。4月以降は、緩和的な金融政策を通じた国内金利環境継続への安心感や、東証の要請による企業改革への期待から、国内株式市場は上昇基調で推移しました。期末にかけて上値の重い展開となったものの、前期末対比では上昇した水準で期を終えました。



(注) ベンチマークは、期首（2022年8月8日）の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) ベンチマークは、日経平均株価（日経225）です。

■ポートフォリオについて

ベンチマークである日経平均株価（日経225）に連動した投資成果を目標として運用を行っています。個別の銘柄選択は、日経225に採用されている銘柄を主要投資対象とし、当該指数算出方法を考慮した等株数投資を行いました。

当期において、実質的な株式組入比率はほぼ100%に維持しました。

以上のような運用の結果、基準価額は16.7%上昇しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+16.7%となり、株式配当収益分を考慮するとベンチマークの騰落率+14.2%にほぼ連動しました。また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー*は、過去1年で年率1.1%となりました。

(主な差異要因)

プラス要因

- ・保有銘柄の株式配当収益

マイナス要因

- ・特にありません

※毎月対ベンチマーク超過収益率（ファンドの収益率とベンチマークの収益率との差）の標準偏差（ばらつき度合い）を年率換算したものです。ベンチマークとの連動性が高いほどこの値は低くなります。

○今後の運用方針

ファンドの基本方針に基づき、日経225構成銘柄に加え、日経225先物も利用しながら実質的な株式の組入比率をほぼ100%に維持し、ベンチマークとの連動性を高位に保つことを目指した運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2022年8月9日～2023年8月7日)

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|---------------------------|---------------|-----------------------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 売買委託手数料 (先物・オプション) | 円 2 (2) | % 0.009 (0.009) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| 合計 | 2 | 0.009 | |
| 期中の平均基準価額は、19,155円です。 | | | |

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2022年8月9日～2023年8月7日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---|----|-----------------|--------------------|-------|------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国 | 上場 | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| 内 | | 2,610 (579) | 11,603,156 (-) | 2,878 | 12,116,366 |

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ()内は株式分割、移転、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | 買 建 | | 売 建 | |
|-------|--------|--------|--------|-------|-------|
| | | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国 | 株式先物取引 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 内 | | 25,626 | 25,771 | 2,256 | 2,254 |

○株式売買比率

(2022年8月9日～2023年8月7日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|--------------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 23,719,522千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 20,164,450千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.17 |

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2022年8月9日～2023年8月7日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|-----------|-----------|-------------|
| 株式 | 百万円 55 | 百万円 59 | 百万円 107 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは東京海上ホールディングス株式会社です。

○組入資産の明細

(2023年8月7日現在)

国内株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 水産・農林業 (0.1%) | | | |
| ニッスイ | 25 | 23 | 17,595 |
| マルハニチロ | 2.5 | — | — |
| 鉱業 (0.1%) | | | |
| I N P E X | 10 | 9.2 | 17,309 |
| 建設業 (1.7%) | | | |
| コムシスホールディングス | 25 | 23 | 65,262 |
| 大成建設 | 5 | 4.6 | 22,604 |
| 大林組 | 25 | 23 | 28,002 |
| 清水建設 | 25 | 23 | 21,999 |
| 長谷工コーポレーション | 5 | 4.6 | 8,316 |
| 鹿島建設 | 12.5 | 11.5 | 25,018 |
| 大和ハウス工業 | 25 | 23 | 88,550 |
| 積水ハウス | 25 | 23 | 66,090 |
| 日揮ホールディングス | 25 | 23 | 46,023 |
| 食料品 (3.4%) | | | |
| 日清製粉グループ本社 | 25 | 23 | 40,618 |
| 明治ホールディングス | 5 | 9.2 | 30,415 |
| 日本ハム | 12.5 | 11.5 | 49,542 |
| サッポロホールディングス | 5 | 4.6 | 16,527 |
| アサヒグループホールディングス | 25 | 23 | 125,971 |
| キリンホールディングス | 25 | 23 | 47,794 |
| 宝ホールディングス | 25 | 23 | 28,692 |
| キッコーマン | 25 | 23 | 178,296 |
| 味の素 | 25 | 23 | 123,924 |
| ニチレイ | 12.5 | 11.5 | 38,076 |
| 日本たばこ産業 | 25 | 23 | 71,070 |
| 繊維製品 (0.1%) | | | |
| 東洋紡 | 2.5 | — | — |
| ユニチカ | 2.5 | — | — |
| 帝人 | 5 | 4.6 | 6,828 |
| 東レ | 25 | 23 | 18,561 |
| パルプ・紙 (0.1%) | | | |
| 王子ホールディングス | 25 | 23 | 12,797 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本製紙 | 2.5 | 2.3 | 3,162 |
| 化学 (6.8%) | | | |
| クラレ | 25 | 23 | 31,199 |
| 旭化成 | 25 | 23 | 21,127 |
| レゾナック・ホールディングス | 2.5 | 2.3 | 4,885 |
| 住友化学 | 25 | 23 | 9,124 |
| 日産化学 | 25 | 23 | 140,645 |
| 東ソー | 12.5 | 11.5 | 20,935 |
| トクヤマ | 5 | 4.6 | 10,936 |
| デンカ | 5 | 4.6 | 11,741 |
| 信越化学工業 | 25 | 115 | 528,195 |
| 三井化学 | 5 | 4.6 | 17,567 |
| 三菱ケミカルグループ | 12.5 | 11.5 | 9,807 |
| UBE | 2.5 | 2.3 | 5,592 |
| 花王 | 25 | 23 | 130,088 |
| D I C | 2.5 | 2.3 | 6,210 |
| 富士フイルムホールディングス | 25 | 23 | 184,276 |
| 資生堂 | 25 | 23 | 142,439 |
| 日東電工 | 25 | 23 | 223,146 |
| 医薬品 (6.8%) | | | |
| 協和キリン | 25 | 23 | 61,214 |
| 武田薬品工業 | 25 | 23 | 100,579 |
| アステラス製薬 | 125 | 115 | 251,965 |
| 住友ファーマ | 25 | 23 | 11,173 |
| 塩野義製薬 | 25 | 23 | 140,346 |
| 中外製薬 | 75 | 69 | 288,213 |
| エーザイ | 25 | 23 | 210,266 |
| 第一三共 | 75 | 69 | 295,251 |
| 大塚ホールディングス | 25 | 23 | 120,451 |
| 石油・石炭製品 (0.2%) | | | |
| 出光興産 | 10 | 9.2 | 27,517 |
| E N E O Sホールディングス | 25 | 23 | 12,100 |
| ゴム製品 (0.8%) | | | |
| 横浜ゴム | 12.5 | 11.5 | 35,190 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ブリヂストン | 25 | 23 | 131,767 |
| ガラス・土石製品 (0.8%) | | | |
| AGC | 5 | 4.6 | 22,287 |
| 日本板硝子 | 2.5 | 2.3 | 1,428 |
| 日本電気硝子 | 7.5 | 6.9 | 17,160 |
| 住友大阪セメント | 2.5 | 2.3 | 9,059 |
| 太平洋セメント | 2.5 | 2.3 | 6,791 |
| 東海カーボン | 25 | 23 | 27,439 |
| TOTO | 12.5 | 11.5 | 46,540 |
| 日本碍子 | 25 | 23 | 40,365 |
| 鉄鋼 (0.1%) | | | |
| 日本製鉄 | 2.5 | 2.3 | 7,774 |
| 神戸製鋼所 | 2.5 | 2.3 | 3,625 |
| JFEホールディングス | 2.5 | 2.3 | 5,138 |
| 大太平洋金属 | 2.5 | 2.3 | 3,818 |
| 非鉄金属 (0.7%) | | | |
| 日本軽金属ホールディングス | 2.5 | — | — |
| 三井金属鉱業 | 2.5 | 2.3 | 7,553 |
| 東邦亜鉛 | 2.5 | — | — |
| 三菱マテリアル | 2.5 | 2.3 | 5,813 |
| 住友金属鉱山 | 12.5 | 11.5 | 54,590 |
| DOWAホールディングス | 5 | 4.6 | 20,419 |
| 古河電気工業 | 2.5 | 2.3 | 5,556 |
| 住友電気工業 | 25 | 23 | 40,020 |
| フジクラ | 25 | 23 | 26,438 |
| 金属製品 (0.0%) | | | |
| SUMCO | 2.5 | 2.3 | 4,568 |
| 機械 (5.7%) | | | |
| 日本製鋼所 | 5 | 4.6 | 13,547 |
| オークマ | 5 | 4.6 | 31,638 |
| アマダ | 25 | 23 | 31,590 |
| SMC | — | 2.3 | 161,345 |
| 小松製作所 | 25 | 23 | 92,069 |
| 住友重機械工業 | 5 | 4.6 | 15,479 |
| 日立建機 | 25 | 23 | 98,716 |
| クボタ | 25 | 23 | 50,232 |
| 荏原製作所 | 5 | 4.6 | 30,392 |
| ダイキン工業 | 25 | 23 | 640,895 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本精工 | 25 | 23 | 19,844 |
| NTN | 25 | 23 | 6,796 |
| ジェイテクト | 25 | 23 | 29,969 |
| 三井E&S | 2.5 | 2.3 | 1,143 |
| 日立造船 | 5 | 4.6 | 3,946 |
| 三菱重工業 | 2.5 | 2.3 | 16,831 |
| IHI | 2.5 | 2.3 | 8,123 |
| 電気機器 (24.6%) | | | |
| コニカミノルタ | 25 | 23 | 10,690 |
| ミネベアミツミ | 25 | 23 | 58,650 |
| 日立製作所 | 5 | 4.6 | 42,540 |
| 三菱電機 | 25 | 23 | 43,240 |
| 富士電機 | 5 | 4.6 | 30,396 |
| 安川電機 | 25 | 23 | 135,309 |
| ニデック | — | 18.4 | 145,507 |
| オムロン | 25 | 23 | 165,071 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 5 | 4.6 | 12,627 |
| 日本電気 | 2.5 | 2.3 | 16,403 |
| 富士通 | 2.5 | 2.3 | 42,331 |
| 神電気工業 | 2.5 | — | — |
| ルネサスエレクトロニクス | — | 23 | 57,247 |
| セイコーエプソン | 50 | 46 | 106,030 |
| パナソニック ホールディングス | 25 | 23 | 38,421 |
| シャープ | 25 | 23 | 20,978 |
| ソニーグループ | 25 | 23 | 297,045 |
| TDK | 75 | 69 | 340,446 |
| アルプスアルパイン | 25 | 23 | 27,117 |
| 横河電機 | 25 | 23 | 59,708 |
| アドバンテスト | 50 | 46 | 857,440 |
| キーエンス | 2.5 | 2.3 | 140,231 |
| カシオ計算機 | 25 | 23 | 29,141 |
| ファナック | 25 | 115 | 472,305 |
| 京セラ | 50 | 46 | 332,764 |
| 太陽誘電 | 25 | 23 | 93,656 |
| 村田製作所 | 20 | 18.4 | 149,849 |
| SCREENホールディングス | 5 | 4.6 | 68,540 |
| キヤノン | 37.5 | 34.5 | 124,200 |
| リコー | 25 | 23 | 28,520 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東京エレクトロン | 25 | 69 | 1,440,375 |
| 輸送用機器 (4.8%) | | | |
| デンソー | 25 | 23 | 226,205 |
| 川崎重工業 | 2.5 | 2.3 | 8,650 |
| 日産自動車 | 25 | 23 | 14,260 |
| いすゞ自動車 | 12.5 | 11.5 | 20,734 |
| トヨタ自動車 | 125 | 115 | 281,060 |
| 日野自動車 | 25 | 23 | 13,298 |
| 三菱自動車工業 | 2.5 | 2.3 | 1,306 |
| マツダ | 5 | 4.6 | 6,502 |
| 本田技研工業 | 50 | 46 | 202,400 |
| スズキ | 25 | 23 | 121,647 |
| SUBARU | 25 | 23 | 60,018 |
| ヤマハ発動機 | 25 | 23 | 92,644 |
| 精密機器 (4.0%) | | | |
| テルモ | 100 | 92 | 409,124 |
| ニコン | 25 | 23 | 42,009 |
| オリンパス | 100 | 92 | 213,026 |
| HOYA | — | 11.5 | 192,165 |
| シチズン時計 | 25 | 23 | 21,321 |
| その他製品 (2.5%) | | | |
| バンダイナムコホールディングス | 25 | 69 | 216,660 |
| 凸版印刷 | 12.5 | 11.5 | 37,375 |
| 大日本印刷 | 12.5 | 11.5 | 45,344 |
| ヤマハ | 25 | 23 | 107,502 |
| 任天堂 | 2.5 | 23 | 143,336 |
| 電気・ガス業 (0.2%) | | | |
| 東京電力ホールディングス | 2.5 | 2.3 | 1,288 |
| 中部電力 | 2.5 | 2.3 | 4,003 |
| 関西電力 | 2.5 | 2.3 | 4,197 |
| 東京瓦斯 | 5 | 4.6 | 14,825 |
| 大阪瓦斯 | 5 | 4.6 | 10,145 |
| 陸運業 (1.4%) | | | |
| 東武鉄道 | 5 | 4.6 | 17,618 |
| 東急 | 12.5 | 11.5 | 20,286 |
| 小田急電鉄 | 12.5 | 11.5 | 23,557 |
| 京王電鉄 | 5 | 4.6 | 22,130 |
| 京成電鉄 | 12.5 | 11.5 | 63,020 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東日本旅客鉄道 | 2.5 | 2.3 | 18,117 |
| 西日本旅客鉄道 | 2.5 | 2.3 | 13,478 |
| 東海旅客鉄道 | 2.5 | 2.3 | 40,514 |
| ヤマトホールディングス | 25 | 23 | 61,916 |
| NIPPON EXPRESSホールディングス | 2.5 | 2.3 | 18,926 |
| 海運業 (0.4%) | | | |
| 日本郵船 | 2.5 | 6.9 | 26,475 |
| 商船三井 | 7.5 | 6.9 | 27,427 |
| 川崎汽船 | 2.5 | 6.9 | 31,546 |
| 空運業 (0.3%) | | | |
| 日本航空 | — | 23 | 68,586 |
| ANAホールディングス | 2.5 | 2.3 | 7,562 |
| 倉庫・運輸関連業 (0.2%) | | | |
| 三菱倉庫 | 12.5 | 11.5 | 42,044 |
| 情報・通信業 (10.4%) | | | |
| ネクソン | 50 | 46 | 117,116 |
| Zホールディングス | 10 | 9.2 | 4,048 |
| トレンドマイクロ | 25 | 23 | 149,753 |
| 日本電信電話 | 10 | 230 | 36,800 |
| KDDI | 150 | 138 | 568,008 |
| ソフトバンク | 25 | 23 | 36,420 |
| 東宝 | 2.5 | 2.3 | 12,714 |
| NTTデータグループ | 125 | 115 | 222,640 |
| コナミグループ | 25 | 23 | 187,197 |
| ソフトバンクグループ | 150 | 138 | 954,546 |
| 卸売業 (3.4%) | | | |
| 双日 | 2.5 | 2.3 | 6,998 |
| 伊藤忠商事 | 25 | 23 | 128,409 |
| 丸紅 | 25 | 23 | 55,867 |
| 豊田通商 | 25 | 23 | 190,785 |
| 三井物産 | 25 | 23 | 126,937 |
| 住友商事 | 25 | 23 | 67,217 |
| 三菱商事 | 25 | 23 | 163,070 |
| 小売業 (12.2%) | | | |
| J.フロント リテイリング | 12.5 | 11.5 | 16,128 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 25 | 23 | 36,650 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 25 | 23 | 134,481 |
| 高島屋 | 12.5 | 11.5 | 23,787 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 丸井グループ | 25 | 23 | 56,913 |
| イオン | 25 | 23 | 70,840 |
| ファーストリテイリング | 25 | 69 | 2,331,510 |
| 銀行業 (0.7%) | | | |
| しずおかフィナンシャルグループ | — | 23 | 26,530 |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 25 | 23 | 14,490 |
| あおぞら銀行 | 2.5 | 2.3 | 6,456 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 25 | 23 | 26,070 |
| りそなホールディングス | 2.5 | 2.3 | 1,699 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 2.5 | 2.3 | 12,183 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 2.5 | 2.3 | 14,979 |
| 千葉銀行 | 25 | 23 | 22,277 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 5 | 4.6 | 15,336 |
| 静岡銀行 | 25 | — | — |
| みずほフィナンシャルグループ | 2.5 | 2.3 | 5,456 |
| 証券、商品先物取引業 (0.2%) | | | |
| 大和証券グループ本社 | 25 | 23 | 17,811 |
| 野村ホールディングス | 25 | 23 | 12,654 |
| 松井証券 | 25 | 23 | 18,009 |
| 保険業 (0.8%) | | | |
| SOMPOホールディングス | 5 | 4.6 | 27,250 |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 7.5 | 6.9 | 34,900 |
| 第一生命ホールディングス | 2.5 | 2.3 | 6,381 |
| 東京海上ホールディングス | 12.5 | 34.5 | 107,467 |
| T&Dホールディングス | 5 | 4.6 | 10,375 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | |
|----------------------|---------|-------|---------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| その他金融業 (0.8%) | | | | |
| クレディセゾン | 25 | 23 | 51,071 | |
| オリックス | 25 | 23 | 59,501 | |
| 日本取引所グループ | 25 | 23 | 59,271 | |
| 不動産業 (1.1%) | | | | |
| 東急不動産ホールディングス | 25 | 23 | 19,175 | |
| 三井不動産 | 25 | 23 | 67,401 | |
| 三菱地所 | 25 | 23 | 39,341 | |
| 東京建物 | 12.5 | 11.5 | 21,240 | |
| 住友不動産 | 25 | 23 | 84,410 | |
| サービス業 (4.6%) | | | | |
| エムスリー | 60 | 55.2 | 168,415 | |
| ディー・エヌ・エー | 7.5 | 6.9 | 11,550 | |
| 電通グループ | 25 | 23 | 107,916 | |
| オリエンタルランド | — | 23 | 120,267 | |
| サイバーエージェント | 20 | 18.4 | 16,957 | |
| 楽天グループ | 25 | 23 | 12,976 | |
| リクルートホールディングス | 75 | 69 | 338,307 | |
| 日本郵政 | 25 | 23 | 23,586 | |
| セコム | 25 | 23 | 217,603 | |
| 合 計 | 株 数・金 額 | 4,700 | 5,011 | 21,891,144 |
| | 銘柄数<比率> | 225 | 225 | <95.7%> |

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 | 別 | 当 期 末 | |
|----|--------|------------|----------|
| | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国内 | 株式先物取引 | 百万円 937 | 百万円 — |
| | 日経225 | | |

○投資信託財産の構成

(2023年8月7日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 21,891,144 | 91.0 |
| コール・ローン等、その他 | 2,154,505 | 9.0 |
| 投資信託財産総額 | 24,045,649 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年8月7日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 24,489,198,268 |
| コール・ローン等 | 2,123,572,998 |
| 株式(評価額) | 21,891,144,470 |
| 未収配当金 | 20,316,800 |
| 差入委託証拠金 | 454,164,000 |
| (B) 負債 | 1,614,948,195 |
| 未払金 | 952,699,937 |
| 未払解約金 | 216,299,158 |
| 未払利息 | 5,100 |
| 差入委託証拠金代用有価証券 | 445,944,000 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 22,874,250,073 |
| 元本 | 10,552,115,437 |
| 次期繰越損益金 | 12,322,134,636 |
| (D) 受益権総口数 | 10,552,115,437口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 21,677円 |

(注) 当親ファンドの期首元本額は11,390,659,241円、期中追加設定元本額は7,404,807,471円、期中一部解約元本額は8,243,351,275円です。

<元本の内訳>

| | |
|---------------------------------|----------------|
| 東京海上・日経225インデックスファンド<適格機関投資家限定> | 5,873,780,079円 |
| 東京海上・日経225インデックスファンド | 4,444,082,035円 |
| 日経225インデックス(適格機関投資家専用) | 234,253,323円 |

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

(注) 2023年8月7日現在、先物取引などに係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は以下の通りです。

| | |
|-----|--------------|
| ・株式 | 581,982,000円 |
|-----|--------------|

○損益の状況 (2022年8月9日~2023年8月7日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 448,336,219 |
| 受取配当金 | 448,854,376 |
| 受取利息 | 3,757 |
| その他収益金 | 17,466 |
| 支払利息 | △ 539,380 |
| (B) 有価証券売買損益 | 2,308,551,254 |
| 売買益 | 3,068,287,700 |
| 売買損 | △ 759,736,446 |
| (C) 先物取引等取引損益 | 95,958,200 |
| 取引益 | 350,501,700 |
| 取引損 | △ 254,543,500 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 2,852,845,673 |
| (E) 前期繰越損益金 | 9,760,322,637 |
| (F) 追加信託差損益金 | 7,637,383,947 |
| (G) 解約差損益金 | △ 7,928,417,621 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 12,322,134,636 |
| 次期繰越損益金(H) | 12,322,134,636 |

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (F)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) (G)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。