

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	・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	・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6期 運用報告書（全体版） （決算日 2022年8月8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6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 (分配落)	価 額			ベンチマーク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		税 分	込 配	み 金 期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率			
	円		円	%		%	%	%	百万円
2期(2018年8月6日)	13,251		0	13.9	22,507.32	12.2	96.8	3.2	1,631
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

(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				
(期 首) 2021年8月6日	円	% —	27,820.04	% —	% 97.8	% 2.2
8月末	17,135	1.0	28,089.54	1.0	97.9	1.9
9月末	17,308	6.5	29,452.66	5.9	97.2	2.9
10月末	18,253	4.4	28,892.69	3.9	94.2	4.0
11月末	17,896	0.5	27,821.76	0.0	95.9	6.0
12月末	17,227	4.2	28,791.71	3.5	95.4	4.3
2022年1月末	17,858	△2.2	27,001.98	△2.9	92.5	7.3
2月末	16,751	△3.9	26,526.82	△4.6	94.4	5.4
3月末	16,460	1.5	27,821.43	0.0	95.6	4.2
4月末	17,400	△2.0	26,847.90	△3.5	94.4	1.9
5月末	16,790	△0.4	27,279.80	△1.9	97.6	0.1
6月末	17,066	△3.5	26,393.04	△5.1	93.5	6.3
7月末	16,531	1.6	27,801.64	△0.1	94.6	5.3
(期 末) 2022年8月8日	17,407	3.2	28,249.24	1.5	95.0	4.7

(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。

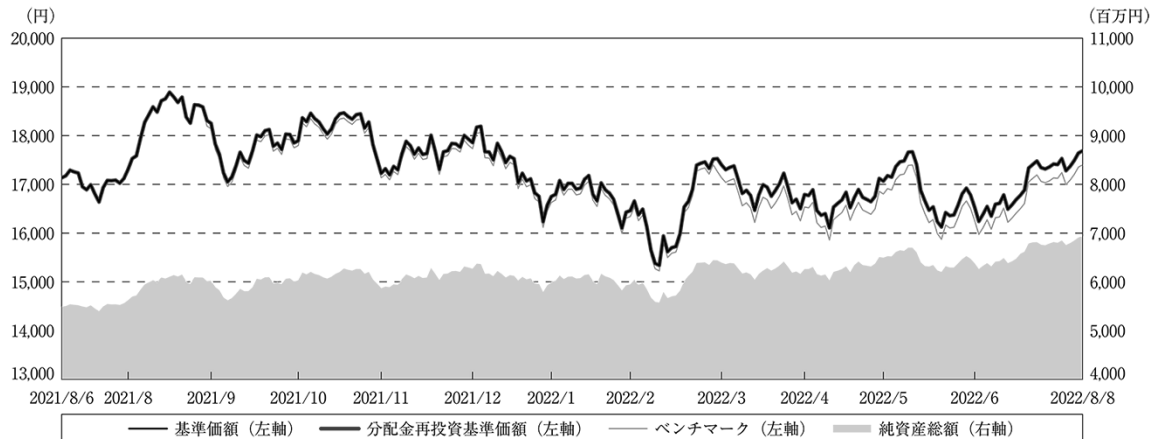
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

○運用経過

(2021年8月7日～2022年8月8日)

■期中の基準価額等の推移



(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（2021年8月6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

- ・衆議院選挙で自民党が絶対安定多数を確保したことにより先行き安心感が広がったこと
- ・新型コロナウイルスの感染収束に伴う行動規制の緩和によって経済活動が再開傾向にあること
- ・大幅な円安進行により企業業績の拡大が期待されたこと

マイナス要因

- ・世界的なインフレ進行と景気後退リスクへの懸念の高まり
- ・ウクライナ情勢悪化による海外の地政学的リスクの高まりおよび資源価格の上昇

■投資環境

当期の国内株式市場は小幅に上昇しました。

期初は、事前の情勢調査結果に反して衆議院選挙で自民党が絶対安定多数を確保したことにより、先行き安心感が広がったことなどから、国内株式市場は上昇しました。2022年1月になると、米国におけるインフレの進行によるFRB（米連邦準備制度理事会）の早期利上げ観測が高まったことによって米国長期金利が上昇し、また2月には、ロシアによるウクライナ侵攻で地政学的リスクが高まったことや資源価格が上昇したことにより、海外株式市場に連動して国内株式市場も下落基調で推移しました。3月以降は、新型コロナウイルスの感染収束に伴う行動規制の緩和によって経済活動が再開傾向になったことや、大幅な円安進行に伴う企業業績拡大への期待がプラス要因となった一方、インフレの進行や景気後退リスクへの懸念などを背景に軟調な展開となった海外株式市場がマイナス要因となり一進一退の動きとなりましたが、前期末対比では小幅に上昇して期を終えました。

■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、3.2%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>

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3.5%上昇し、ベンチマークの騰落率+1.5%にほぼ連動する値動きとなりました。

■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+3.2%となり、ベンチマークの騰落率+1.5%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1.0%となりました。

(主な差異要因)

プラス要因

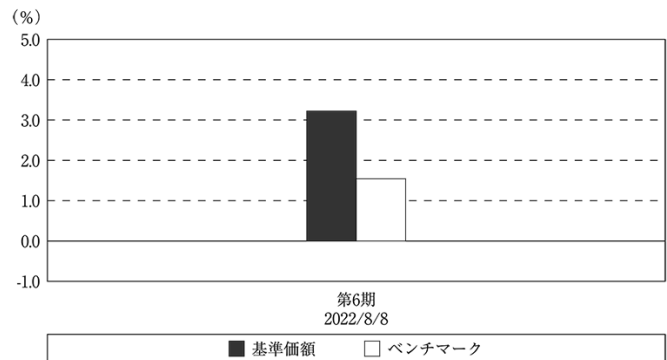
・株式配当収益

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 6 期
	2021年 8 月 7 日～ 2022年 8 月 8 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	7,686

(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

(2021年 8 月 7 日～2022年 8 月 8 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 43	% 0.249	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(19)	(0.111)	* 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)	(19)	(0.111)	* 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)	(0.028)	* 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	46	0.264	
期中の平均基準価額は、17,245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。

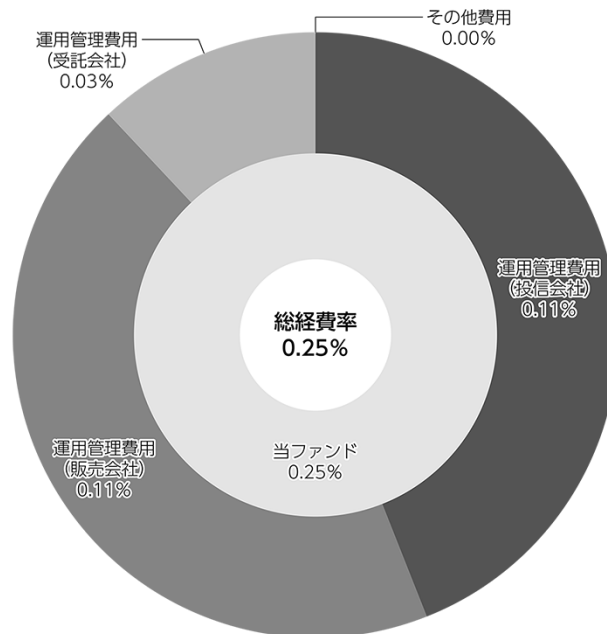
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものをみます。

(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0.25%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

(2021年8月7日～2022年8月8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
	千口	千円	千口	千円
東京海上・日経225インデックスマザーファンド	1,520,595	2,751,051	841,461	1,532,268

○株式売買比率

(2021年8月7日～2022年8月8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	30,069,907千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	23,542,008千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.27

(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

(2021年8月7日～2022年8月8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
	百万円	百万円	百万円
株式	48	68	91

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

(2022年8月8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	3,057,952	3,737,086	6,939,396

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

(2022年8月8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	6,939,396	99.7
コール・ローン等、その他	19,448	0.3
投資信託財産総額	6,958,844	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年8月8日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,958,844,463
東京海上・日経225インデックスマザーファンド(評価額)	6,939,396,131
未収入金	19,448,332
(B) 負債	19,448,332
未払解約金	11,451,764
未払信託報酬	7,822,822
その他未払費用	173,746
(C) 純資産総額(A－B)	6,939,396,131
元本	3,923,475,898
次期繰越損益金	3,015,920,233
(D) 受益権総口数	3,923,475,898口
1万口当たり基準価額(C／D)	17,687円

(注) 当ファンドの期首元本額は3,202,339,837円、期中追加設定元本額は1,594,485,675円、期中一部解約元本額は873,349,614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 (2021年8月7日～2022年8月8日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	219,652,370
売買益	297,866,745
売買損	△ 78,214,375
(B) 信託報酬等	△ 15,632,289
(C) 当期損益金(A＋B)	204,020,081
(D) 前期繰越損益金	687,936,934
(E) 追加信託差損益金	2,123,963,218
(配当等相当額)	(772,391,668)
(売買損益相当額)	(1,351,571,550)
(F) 計(C＋D＋E)	3,015,920,233
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F＋G)	3,015,920,233
追加信託差損益金	2,123,963,218
(配当等相当額)	(777,276,915)
(売買損益相当額)	(1,346,686,303)
分配準備積立金	891,957,015

(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)	108,733,155円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	95,286,926円
c. 信託約款に規定する収益調整金	2,123,963,218円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	687,936,934円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	3,015,920,233円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	7,686円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○お知らせ

当ファンドが投資するマザーファンドにおいて、参照する指数「日経平均株価(日経225)」の算出方法変更に伴い、2021年10月1日付で所要の約款変更を行いました。

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6期（決算日 2022年8月8日）

（計算期間 2021年8月7日～2022年8月8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		株組入比率	株先物比率	純総資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
2期(2018年8月6日)	13,775	14.2	22,507.32	12.2	96.8	3.2	26,324
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

（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				
(期 首) 2021年8月6日	円	% —	27,820.04	% —	% 97.8	% 2.2
8月末	18,128	1.0	28,089.54	1.0	97.9	1.9
9月末	19,122	6.6	29,452.66	5.9	97.1	2.9
10月末	18,752	4.5	28,892.69	3.9	94.2	4.0
11月末	18,055	0.6	27,821.76	0.0	95.8	6.0
12月末	18,720	4.3	28,791.71	3.5	95.3	4.3
2022年1月末	17,565	△2.1	27,001.98	△2.9	92.4	7.3
2月末	17,263	△3.8	26,526.82	△4.6	94.4	5.4
3月末	18,252	1.7	27,821.43	0.0	95.6	4.2
4月末	17,616	△1.8	26,847.90	△3.5	94.4	1.9
5月末	17,909	△0.2	27,279.80	△1.9	97.5	0.1
6月末	17,352	△3.3	26,393.04	△5.1	93.5	6.3
7月末	18,274	1.8	27,801.64	△0.1	94.5	5.3
(期 末) 2022年8月8日	18,569	3.5	28,249.24	1.5	95.0	4.7

(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

(2021年8月7日～2022年8月8日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：17,944円

期 末：18,569円

騰落率： 3.5%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・衆議院選挙で自民党が絶対安定多数を確保したことにより先行き安心感が広がったこと
- ・新型コロナウイルスの感染収束に伴う行動規制の緩和によって経済活動が再開傾向にあること
- ・大幅な円安進行により企業業績の拡大が期待されたこと

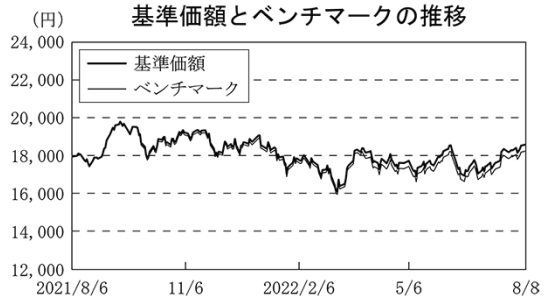
マイナス要因

- ・世界的なインフレ進行と景気後退リスクへの懸念の高まり
- ・ウクライナ情勢悪化による海外の地政学的リスクの高まりおよび資源価格の上昇

■投資環境

当期の国内株式市場は小幅に上昇しました。

期初は、事前の情勢調査結果に反して衆議院選挙で自民党が絶対安定多数を確保したことにより、先行き安心感が広がったことなどから、国内株式市場は上昇しました。2022年1月になると、米国におけるインフレの進行によるFRB（米連邦準備制度理事会）の早期利上げ観測が高まったことによって米国長期金利が上昇し、また2月には、ロシアによるウクライナ侵攻で地政学的リスクが高まったことや資源価格が上昇したことにより、海外株式市場に連動して国内株式市場も下落基調で推移しました。3月以降は、新型コロナウイルスの感染収束に伴う行動規制の緩和によって経済活動が再開傾向になったことや、大幅な円安進行に伴う企業業績拡大への期待がプラス要因となった一方、インフレの進行や景気後退リスクへの懸念などを背景に軟調な展開となった海外株式市場がマイナス要因となり一進一退の動きとなりましたが、前期末対比では小幅に上昇して期を終えました。



(注) ベンチマークは、期首（2021年8月6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

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3.5%上昇し、ベンチマークの騰落率+1.5%にほぼ連動する値動きとなりました。

■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+3.5%となり、ベンチマークの騰落率+1.5%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1.0%となりました。

(主な差異要因)

プラス要因

- ・保有銘柄の配当金収入

※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。

○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 (2021年8月7日～2022年8月8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	% 0.010	(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
	(2)	(0.010)	
合 計	2	0.010	
期中の平均基準価額は、18,084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

(2021年8月7日～2022年8月8日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 3,016 (183)	千円 13,361,240 (—)	千株 3,961	千円 16,708,667

(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 内	株式先物取引	百万円 34,027	百万円 33,617	百万円 3,768	百万円 3,755

○株式売買比率

(2021年8月7日～2022年8月8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	30,069,907千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	23,542,008千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.27

(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

(2021年8月7日～2022年8月8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 48	百万円 68	百万円 91

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

(2022年8月8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%)			
日本水産	30	25	14,475
マルハニチロ	3	2.5	6,197
鉱業 (0.1%)			
I N P E X	12	10	14,710
建設業 (1.7%)			
コムシスホールディングス	30	25	63,850
大成建設	6	5	20,250
大林組	30	25	23,950
清水建設	30	25	18,325
長谷工コーポレーション	6	5	7,915
鹿島建設	15	12.5	18,362
大和ハウス工業	30	25	80,450
積水ハウス	30	25	58,050
日揮ホールディングス	30	25	40,800
食料品 (3.7%)			
日清製粉グループ本社	30	25	40,075
明治ホールディングス	6	5	33,800
日本ハム	15	12.5	50,062
サッポロホールディングス	6	5	14,695
アサヒグループホールディングス	30	25	115,625
麒麟ホールディングス	30	25	56,025
宝ホールディングス	30	25	26,600
キッコーマン	30	25	216,750
味の素	30	25	92,550
ニチレイ	15	12.5	30,975
日本たばこ産業	30	25	57,675
繊維製品 (0.1%)			
東洋紡	3	2.5	2,627
ユニチカ	3	2.5	582
帝人	6	5	7,155
東レ	30	25	18,155
パルプ・紙 (0.1%)			
王子ホールディングス	30	25	13,400

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	3	2.5	2,235
化学 (7.2%)			
クラレ	30	25	26,475
旭化成	30	25	25,512
昭和電工	3	2.5	5,627
住友化学	30	25	13,750
日産化学	30	25	167,250
東ソー	15	12.5	21,675
トクヤマ	6	5	9,090
デンカ	6	5	16,675
信越化学工業	30	25	433,125
三井化学	6	5	14,320
三菱ケミカルグループ	15	12.5	9,153
UBE	3	2.5	5,060
花王	30	25	144,225
D I C	3	2.5	6,217
富士フイルムホールディングス	30	25	188,825
資生堂	30	25	137,300
日東電工	30	25	216,750
医薬品 (7.2%)			
協和キリン	30	25	78,750
武田薬品工業	30	25	94,125
アステラス製薬	150	125	256,500
住友ファーマ	30	25	28,000
塩野義製薬	30	25	171,725
中外製薬	90	75	283,500
エーザイ	30	25	152,800
第一三共	90	75	273,225
大塚ホールディングス	30	25	117,000
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	12	10	33,150
E N E O Sホールディングス	30	25	12,375
ゴム製品 (0.8%)			
横浜ゴム	15	12.5	25,087

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	30	25	134,500
ガラス・土石製品 (1.0%)			
A G C	6	5	24,000
日本板硝子	3	2.5	1,162
日本電気硝子	9	7.5	19,117
住友大阪セメント	3	2.5	9,000
太平洋セメント	3	2.5	5,082
東海カーボン	30	25	26,550
T O T O	15	12.5	57,312
日本碍子	30	25	48,775
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	3	2.5	5,290
神戸製鋼所	3	2.5	1,537
J F Eホールディングス	3	2.5	3,615
大太平洋金属	3	2.5	5,927
非鉄金属 (0.8%)			
日本軽金属ホールディングス	3	2.5	4,047
三井金属鉱業	3	2.5	7,900
東邦亜鉛	3	2.5	5,362
三菱マテリアル	3	2.5	5,032
住友金属鉱山	15	12.5	52,537
DOWAホールディングス	6	5	23,950
古河電気工業	3	2.5	5,962
住友電気工業	30	25	38,700
フジクラ	30	25	22,750
金属製品 (0.0%)			
S U M C O	3	2.5	4,932
東洋製織グループホールディングス	30	—	—
機械 (4.9%)			
日本製鋼所	6	5	15,750
オークマ	6	5	26,700
アマダ	30	25	26,125
小松製作所	30	25	71,700
住友重機械工業	6	5	14,440
日立建機	30	25	72,875
クボタ	30	25	53,937
荏原製作所	6	5	26,350
ダイキン工業	30	25	599,875

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	30	25	19,025
N T N	30	25	6,275
ジェイテクト	30	25	24,475
三井E&Sホールディングス	—	2.5	977
日立造船	6	5	4,180
三菱重工業	3	2.5	11,695
I H I	3	2.5	8,562
電気機器 (23.5%)			
日清紡ホールディングス	30	—	—
コニカミノルタ	30	25	12,150
ミネベアミツミ	30	25	61,975
日立製作所	6	5	33,265
三菱電機	30	25	34,850
富士電機	6	5	29,900
安川電機	30	25	117,000
オムロン	30	25	186,850
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6	5	11,995
日本電気	3	2.5	12,225
富士通	3	2.5	44,387
神電気工業	3	2.5	2,000
セイコーエプソン	60	50	108,100
パナソニック ホールディングス	30	25	28,037
シャープ	30	25	25,550
ソニーグループ	30	25	293,125
T D K	30	75	359,625
アルプスアルパイン	30	25	31,000
横河電機	30	25	57,875
アドバンテスト	60	50	434,500
キーエンス	—	2.5	138,750
カシオ計算機	30	25	34,075
ファナック	30	25	573,625
京セラ	60	50	373,550
太陽誘電	30	25	113,750
村田製作所	—	20	155,540
S C R E E Nホールディングス	6	5	50,150
キヤノン	45	37.5	126,375
リコー	30	25	27,750
東京エレクトロン	30	25	1,242,500

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
輸送用機器 (4.6%)			
デンソー	30	25	190,375
三井E&Sホールディングス	3	—	—
川崎重工業	3	2.5	6,720
日産自動車	30	25	13,105
いすゞ自動車	15	12.5	19,087
トヨタ自動車	30	125	264,500
日野自動車	30	25	16,450
三菱自動車工業	3	2.5	1,212
マツダ	6	5	5,820
本田技研工業	60	50	169,850
スズキ	30	25	119,300
S U B A R U	30	25	60,225
ヤマハ発動機	30	25	67,200
精密機器 (3.8%)			
テルモ	120	100	440,600
ニコン	30	25	39,225
オリンパス	120	100	268,250
シチズン時計	30	25	14,775
その他製品 (3.0%)			
パンダイナムコホールディングス	30	25	250,500
凸版印刷	15	12.5	27,475
大日本印刷	15	12.5	35,612
ヤマハ	30	25	137,250
任天堂	—	2.5	144,275
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	3	2.5	1,232
中部電力	3	2.5	3,462
関西電力	3	2.5	3,140
東京瓦斯	6	5	12,650
大阪瓦斯	6	5	11,610
陸運業 (1.4%)			
東武鉄道	6	5	16,300
東急	15	12.5	20,650
小田急電鉄	15	12.5	24,175
京王電鉄	6	5	26,350
京成電鉄	15	12.5	47,125
東日本旅客鉄道	3	2.5	17,635

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
西日本旅客鉄道	3	2.5	12,942
東海旅客鉄道	3	2.5	39,275
日本通運	3	—	—
ヤマトホールディングス	30	25	57,550
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	—	2.5	18,850
海運業 (0.4%)			
日本郵船	3	2.5	26,925
商船三井	3	7.5	27,825
川崎汽船	3	2.5	24,725
空運業 (0.0%)			
A N Aホールディングス	3	2.5	6,440
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	15	12.5	46,375
情報・通信業 (11.6%)			
ネクソン	60	50	150,250
Zホールディングス	12	10	4,325
トレンドマイクロ	30	25	189,000
スカパー J S A Tホールディングス	3	—	—
日本電信電話	12	10	37,910
K D D I	180	150	630,600
ソフトバンク	30	25	38,187
東宝	3	2.5	13,100
エヌ・ティ・ティ・データ	150	125	250,125
コナミグループ	30	25	172,000
ソフトバンクグループ	180	150	854,250
卸売業 (2.4%)			
双日	3	2.5	5,512
伊藤忠商事	30	25	95,525
丸紅	30	25	33,800
豊田通商	30	25	115,875
三井物産	30	25	74,950
住友商事	30	25	47,262
三菱商事	30	25	104,375
小売業 (12.0%)			
J . フ ロ ン ト リ テ イ リ ン グ	15	12.5	13,400
三越伊勢丹ホールディングス	30	25	25,200
セブン&アイ・ホールディングス	30	25	135,925
高島屋	15	12.5	17,850

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	30	25	59,375
イオン	30	25	68,225
ファーストリテイリング	30	25	2,096,500
銀行業 (0.6%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	30	25	10,975
新生銀行	3	—	—
あおぞら銀行	3	2.5	6,722
三菱UFJフィナンシャル・グループ	30	25	18,047
りそなホールディングス	3	2.5	1,278
三井住友トラスト・ホールディングス	3	2.5	10,697
三井住友フィナンシャルグループ	3	2.5	10,310
千葉銀行	30	25	18,700
ふくおかフィナンシャルグループ	6	5	11,935
静岡銀行	30	25	20,175
みずほフィナンシャルグループ	3	2.5	3,928
証券、商品先物取引業 (0.2%)			
大和証券グループ本社	30	25	15,082
野村ホールディングス	30	25	12,435
松井証券	30	25	20,025
保険業 (0.8%)			
SOMPOホールディングス	7.5	5	28,200
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	9	7.5	30,172
第一生命ホールディングス	3	2.5	5,710
東京海上ホールディングス	15	12.5	91,575
T&Dホールディングス	6	5	7,425

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	30	25	41,750
オリックス	—	25	55,637
日本取引所グループ	30	25	54,287
不動産業 (1.2%)			
東急不動産ホールディングス	30	25	17,875
三井不動産	30	25	70,562
三菱地所	30	25	46,837
東京建物	15	12.5	24,012
住友不動産	30	25	87,550
サービス業 (5.3%)			
エムスリー	72	60	277,140
ディー・エヌ・エー	9	7.5	14,287
電通グループ	30	25	116,500
サイバーエージェント	24	20	28,960
楽天グループ	30	25	16,875
リクルートホールディングス	90	75	376,500
日本郵政	30	25	23,662
セコム	30	25	219,350
合 計	株 数 ・ 金 額	5,461	4,700
	銘柄数<比率>	225	225

(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	日経225	百万円 988	百万円 —

○投資信託財産の構成

(2022年8月8日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	20,095,803	94.3
コール・ローン等、その他	1,213,445	5.7
投資信託財産総額	21,309,248	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年8月8日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	22,182,854,922
コール・ローン等	1,187,054,622
株式(評価額)	20,095,803,000
未収入金	67,001,500
未収配当金	23,979,800
差入委託証拠金	809,016,000
(B) 負債	1,031,873,044
未払解約金	158,266,628
未払利息	416
差入委託証拠金代用有価証券	873,606,000
(C) 純資産総額(A－B)	21,150,981,878
元本	11,390,659,241
次期繰越損益金	9,760,322,637
(D) 受益権総口数	11,390,659,241口
1万口当たり基準価額(C／D)	18,569円

(注) 当親ファンドの期首元本額は13,210,994,248円、期中追加設定元本額は14,456,987,933円、期中一部解約元本額は16,277,322,940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> 7,651,929,952円
東京海上・日経225インデックスファンド 3,737,086,613円
日経225インデックス(適格機関投資家専用) 1,642,676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) 2022年8月8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 1,580,556,000円

○損益の状況 (2021年8月7日～2022年8月8日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	462,098,219
受取配当金	462,546,066
受取利息	3,594
その他収益金	13,547
支払利息	△ 464,988
(B) 有価証券売買損益	267,190,510
売買益	2,243,318,817
売買損	△ 1,976,128,307
(C) 先物取引等取引損益	62,679,050
取引益	594,475,250
取引損	△ 531,796,200
(D) 当期損益金(A+B+C)	791,967,779
(E) 前期繰越損益金	10,495,275,973
(F) 追加信託差損益金	11,982,028,258
(G) 解約差損益金	△13,508,949,373
(H) 計(D+E+F+G)	9,760,322,637
次期繰越損益金(H)	9,760,322,637

(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。

○お知らせ

当ファンドが参照する指数「日経平均株価(日経225)」の算出方法変更に伴い、2021年10月1日付で所要の約款変更を行いました。