

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225（配当込み）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8期 運用報告書（全体版）

（決算日 2024年8月6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8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	み金	期騰			
	円		円		%		%	百万円
4期(2020年8月6日)	13,654		0		10.8	36,754.72	11.2	3,455
5期(2021年8月6日)	17,135		0		25.5	46,354.89	26.1	5,487
6期(2022年8月8日)	17,687		0		3.2	48,001.23	3.6	6,939
7期(2023年8月7日)	20,597		0		16.5	56,050.74	16.8	9,633
8期(2024年8月6日)	22,486		0		9.2	61,374.02	9.5	12,377

(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225（配当込み）です。

日経平均株価および日経平均トータルリターン・インデックス（以下、「日経平均株価」といいます。）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、日経平均株価自体およ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ます。

日経およ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ます。

ファンドは、委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用およびファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。

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、遅延または中断に関して、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および公表を停止する権利を有します。

○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) 2023年8月7日	円 20,597	% —	56,050.74	% —	% 95.7	% 4.1
8月末	20,837	1.2	56,720.29	1.2	92.3	7.5
9月末	20,486	△ 0.5	55,787.13	△ 0.5	94.4	5.5
10月末	19,841	△ 3.7	54,040.84	△ 3.6	93.0	11.3
11月末	21,526	4.5	58,651.09	4.6	95.0	5.0
12月末	21,541	4.6	58,704.41	4.7	94.1	5.8
2024年1月末	23,356	13.4	63,659.32	13.6	94.6	5.5
2月末	25,219	22.4	68,747.00	22.7	96.0	4.1
3月末	26,160	27.0	71,346.41	27.3	98.3	3.2
4月末	24,887	20.8	67,877.75	21.1	92.7	7.9
5月末	24,940	21.1	68,023.40	21.4	92.5	7.6
6月末	25,668	24.6	70,056.40	25.0	96.0	2.4
7月末	25,358	23.1	69,208.61	23.5	95.6	4.3
(期 末) 2024年8月6日	22,486	9.2	61,374.02	9.5	97.1	3.1

(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。

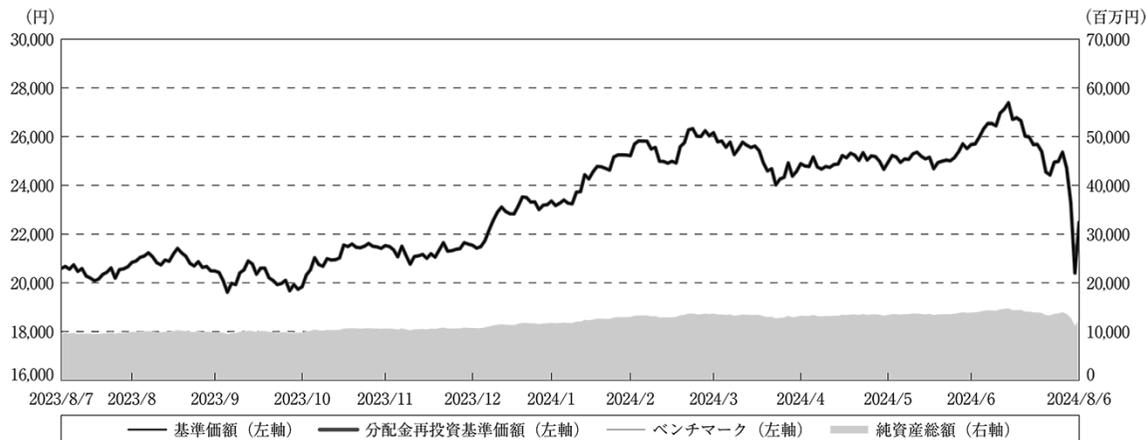
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

○運用経過

(2023年8月8日～2024年8月6日)

■期中の基準価額等の推移



期首：20,597円

期末：22,486円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：9.2% (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(2023年8月7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225(配当込み)です。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・新NISA(少額投資非課税制度)開始に伴う資金流入期待
- ・日米金利差を背景とした円安米ドル高の進行

マイナス要因

- ・中東における地政学的リスクの高まり
- ・日銀の金融政策変更による国内長期金利の上昇への警戒

■投資環境

当期の国内株式市場は上昇しました。

期初から2023年末にかけて、中東の地政学的リスクの高まりや日米の金融政策の先行き不透明感といった要因から、国内株式市場は一進一退の展開となりましたが、2024年に入ると新NISA開始に伴う資金流入期待や円安米ドル高の進行が好感されて上昇しました。3月半ばには日銀がマイナス金利の解除を決定し、金融政策を巡る不透明感の後退から国内株式市場は一段と上昇しましたが、4月に入ると米国で半導体関連株の下落や中東情勢の緊迫化を受けて反落しました。5月以降は、日銀による更なる金融政策変更が意識され国内株式市場は上値を抑えられましたが、7月上旬にかけて円安米ドル高が進行すると上昇し、日経平均株価は最高値を更新しました。その後、円高米ドル安に転じると国内株式市場は反落し、さらに7月末の日銀の利上げと米国の景気不安が重なったことで大きく下落しましたが、期を通しては上昇した水準で終わりました。

■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、9.2%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>

ベンチマークである日経平均トータルリターン・インデックス（日経225（配当込み））に連動する投資成果の達成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、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9.5%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+9.2%となり、ベンチマークの騰落率+9.5%にほぼ連動しました。

(主な差異要因)

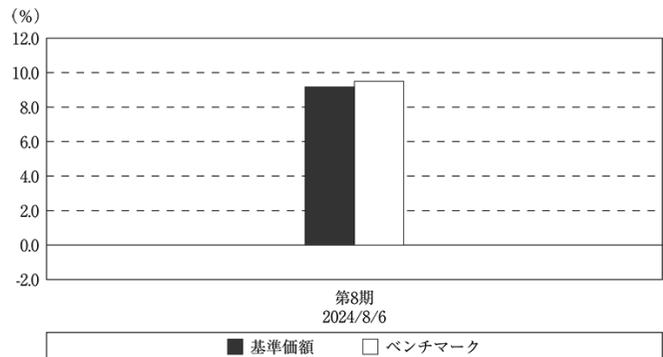
プラス要因

- ・ 特にありません

マイナス要因

- ・ 信託報酬などのコスト

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225（配当込み）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8期
	2023年8月8日～ 2024年8月6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	12,486

(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

(2023年8月8日～2024年8月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 58	% 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)	(26)	(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)	(26)	(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)	(6)	(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	3	0.011	(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)	(3)	(0.011)	*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	62	0.263	
期中の平均基準価額は、23,318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。

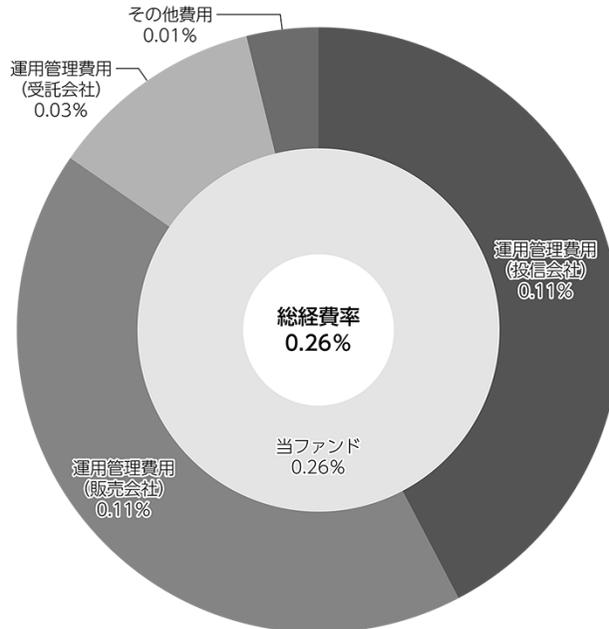
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

(2023年8月8日～2024年8月6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	1,890,588 千口	4,631,315 千円	1,118,563 千口	2,744,249 千円

○株式売買比率

(2023年8月8日～2024年8月6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	45,718,302千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	25,218,835千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.81	

(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

(2023年8月8日～2024年8月6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 155	百万円 106	百万円 211

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

(2024年8月6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	4,444,082	5,216,106	12,377,299

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

(2024年8月6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	12,377,299	99.3
コール・ローン等、その他	91,552	0.7
投資信託財産総額	12,468,851	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年8月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	12,468,851,680
東京海上・日経225インデックスマザーファンド(評価額)	12,377,299,837
未収入金	91,551,843
(B) 負債	91,551,843
未払解約金	74,815,118
未払信託報酬	16,372,979
その他未払費用	363,746
(C) 純資産総額(A-B)	12,377,299,837
元本	5,504,325,220
次期繰越損益金	6,872,974,617
(D) 受益権総口数	5,504,325,220口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,486円

(注) 当ファンドの期首元本額は4,677,024,045円、期中追加設定元本額は1,992,094,372円、期中一部解約元本額は1,164,793,197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 (2023年8月8日～2024年8月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	575,147,331
売買益	874,564,927
売買損	△ 299,417,596
(B) 信託報酬等	△ 29,949,583
(C) 当期損益金(A+B)	545,197,748
(D) 前期繰越損益金	1,555,878,944
(E) 追加信託差損益金	4,771,897,925
(配当等相当額)	(2,254,611,351)
(売買損益相当額)	(2,517,286,574)
(F) 計(C+D+E)	6,872,974,617
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	6,872,974,617
追加信託差損益金	4,771,897,925
(配当等相当額)	(2,261,578,706)
(売買損益相当額)	(2,510,319,219)
分配準備積立金	2,101,076,692

(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)	197,464,549円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	347,733,199円
c. 信託約款に規定する収益調整金	4,771,897,925円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	1,555,878,944円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	6,872,974,617円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	12,486円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○お知らせ

当ファンドおよび当ファンドが投資対象とするマザーファンドについて、従来ベンチマークに「配当を含まない指数」を採用していましたが、ベンチマークをより実態に近い「配当を含む指数」に変更することが顧客本位であると判断し、2023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8期（決算日 2024年8月6日）

（計算期間 2023年8月8日～2024年8月6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
4期(2020年8月6日)	14,264	11.0	36,754.72	11.2	91.4	8.6	16,405
5期(2021年8月6日)	17,944	25.8	46,354.89	26.1	97.8	2.2	23,706
6期(2022年8月8日)	18,569	3.5	48,001.23	3.6	95.0	4.7	21,150
7期(2023年8月7日)	21,677	16.7	56,050.74	16.8	95.7	4.1	22,874
8期(2024年8月6日)	23,729	9.5	61,374.02	9.5	97.1	3.1	32,785

(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225（配当込み）です。

日経平均株価および日経平均トータルリターン・インデックス（以下、「日経平均株価」といいます。）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、日経平均株価自体およ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ます。

日経およ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ます。

ファンドは、委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用およびファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。

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、遅延または中断に関して、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および公表を停止する権利を有します。

○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) 2023年8月7日	円 21,677	% —	56,050.74	% —	% 95.7	% 4.1
8月末	21,933	1.2	56,720.29	1.2	92.3	7.5
9月末	21,568	△ 0.5	55,787.13	△ 0.5	94.4	5.5
10月末	20,894	△ 3.6	54,040.84	△ 3.6	93.0	11.3
11月末	22,672	4.6	58,651.09	4.6	94.9	5.0
12月末	22,692	4.7	58,704.41	4.7	94.0	5.8
2024年1月末	24,607	13.5	63,659.32	13.6	94.5	5.5
2月末	26,576	22.6	68,747.00	22.7	95.9	4.1
3月末	27,573	27.2	71,346.41	27.3	98.2	3.2
4月末	26,237	21.0	67,877.75	21.1	92.7	7.9
5月末	26,299	21.3	68,023.40	21.4	92.4	7.6
6月末	27,071	24.9	70,056.40	25.0	95.9	2.4
7月末	26,750	23.4	69,208.61	23.5	95.5	4.3
(期 末) 2024年8月6日	23,729	9.5	61,374.02	9.5	97.1	3.1

(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

(2023年8月8日～2024年8月6日)

■期中の基準価額等の推移

期首：21,677円

期末：23,729円

騰落率：9.5%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・新NISA（少額投資非課税制度）開始に伴う資金流入期待
- ・日米金利差を背景とした円安米ドル高の進行

マイナス要因

- ・中東における地政学的リスクの高まり
- ・日銀の金融政策変更による国内長期金利の上昇への警戒

■投資環境

当期の国内株式市場は上昇しました。

期初から2023年末にかけて、中東の地政学的リスクの高まりや日米の金融政策の先行き不透明感といった要因から、国内株式市場は一進一退の展開となりましたが、2024年に入ると新NISA開始に伴う資金流入期待や円安米ドル高の進行が好感されて上昇しました。3月半ばには日銀がマイナス金利の解除を決定し、金融政策を巡る不透明感の後退から国内株式市場は一段と上昇しましたが、4月に入ると米国で半導体関連株の下落や中東情勢の緊迫化を受けて反落しました。5月以降は、日銀による更なる金融政策変更が意識され国内株式市場は上値を抑えられましたが、7月上旬にかけて円安米ドル高が進行すると上昇し、日経平均株価は最高値を更新しました。その後、円高米ドル安に転じると国内株式市場は反落し、さらに7月末の日銀の利上げと米国の景気不安が重なったことで大きく下落しましたが、期を通しては上昇した水準で終わりました。



(注) ベンチマークは、期首（2023年8月7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225（配当込み）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トータルリターン・インデックス（日経225（配当込み））に連動する投資成果の達成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、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9.5%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+9.5%となり、ベンチマークの騰落率+9.5%にほぼ連動しました。

(主な差異要因)

プラス要因

- ・特にありません

マイナス要因

- ・株式や先物などの取引コスト

○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

(2023年8月8日～2024年8月6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 3 (3)	% 0.011 (0.011)	(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	3	0.011	
期中の平均基準価額は、24,572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

(2023年8月8日～2024年8月6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		6,325	26,668,087	4,351	19,050,215
		(1,167)	()		

(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		48,178	48,470	5,942	5,951

○株式売買比率

(2023年8月8日～2024年8月6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	45,718,302千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	25,218,835千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.81

(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

(2023年8月8日～2024年8月6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 155	百万円 106	百万円 211

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

(2024年8月6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	23	30	24,120
鉱業 (0.1%)			
I N P E X	9.2	12	24,000
建設業 (1.6%)			
コムシスホールディングス	23	30	86,775
大成建設	4.6	6	34,020
大林組	23	30	56,175
清水建設	23	30	26,592
長谷工コーポレーション	4.6	6	10,215
鹿島建設	11.5	15	38,415
大和ハウス工業	23	30	119,580
積水ハウス	23	30	99,300
日揮ホールディングス	23	30	33,000
食料品 (3.2%)			
日清製粉グループ本社	23	30	53,265
明治ホールディングス	9.2	12	43,620
日本ハム	11.5	15	74,415
サッポロホールディングス	4.6	6	35,004
アサヒグループホールディングス	23	30	150,300
キリンホールディングス	23	30	60,345
宝ホールディングス	23	—	—
キッコーマン	23	150	261,600
味の素	23	30	156,690
ニチレイ	11.5	15	55,335
日本たばこ産業	23	30	113,040
繊維製品 (0.1%)			
帝人	4.6	6	7,866
東レ	23	30	21,060
パルプ・紙 (0.1%)			
王子ホールディングス	23	30	16,554
日本製紙	2.3	3	2,610
化学 (6.8%)			
クラレ	23	30	50,010

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
旭化成	23	30	28,962
レゾナック・ホールディングス	2.3	3	9,018
住友化学	23	30	11,472
日産化学	23	30	135,810
東ソー	11.5	15	27,375
トクヤマ	4.6	6	16,008
デンカ	4.6	6	11,718
信越化学工業	115	150	892,500
三井化学	4.6	6	21,762
三菱ケミカルグループ	11.5	15	12,483
UBE	2.3	3	7,471
花王	23	30	193,500
D I C	2.3	3	8,187
富士フィルムホールディングス	23	90	288,000
資生堂	23	30	133,380
日東電工	23	30	320,550
医薬品 (6.5%)			
協和キリン	23	30	90,450
武田薬品工業	23	30	117,390
アステラス製薬	115	150	244,050
住友ファーマ	23	30	13,020
塩野義製薬	23	30	184,770
中外製薬	69	90	544,230
エーザイ	23	30	157,410
第一三共	69	90	488,340
大塚ホールディングス	23	30	223,530
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	9.2	60	57,378
ENEOSホールディングス	23	30	20,199
ゴム製品 (0.7%)			
横浜ゴム	11.5	15	45,465
ブリヂストン	23	30	173,520
ガラス・土石製品 (0.7%)			
A G C	4.6	6	27,978

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本板硝子	2.3	—	—
日本電気硝子	6.9	9	30,033
住友大阪セメント	2.3	—	—
太平洋セメント	2.3	3	10,659
東海カーボン	23	30	25,458
TOTO	11.5	15	64,485
日本碍子	23	30	53,115
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	2.3	3	9,216
神戸製鋼所	2.3	3	4,876
JFEホールディングス	2.3	3	5,310
大太平洋金属	2.3	—	—
非鉄金属 (0.8%)			
三井金属鉱業	2.3	3	11,970
三菱マテリアル	2.3	3	7,270
住友金属鉱山	11.5	15	59,550
DOWAホールディングス	4.6	6	28,386
古河電気工業	2.3	3	10,332
住友電気工業	23	30	62,910
フジクラ	23	30	73,440
金属製品 (0.0%)			
SUMCO	2.3	3	6,030
機械 (4.9%)			
日本製鋼所	4.6	6	22,332
オークマ	4.6	6	36,150
アマダ	23	30	46,830
ディスコ	—	6	234,600
SMC	2.3	3	201,330
小松製作所	23	30	107,970
住友重機械工業	4.6	6	20,178
日立建機	23	30	91,740
クボタ	23	30	55,020
荏原製作所	4.6	30	53,550
ダイキン工業	23	30	573,000
日本精工	23	30	21,354
NTN	23	30	7,272
ジェイテクト	23	30	27,057
三井E&S	2.3	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日立造船	4.6	6	5,148
三菱重工業	2.3	30	47,205
I H I	2.3	3	13,974
電気機器 (26.4%)			
コニカミノルタ	23	30	10,527
ミネベアミツミ	23	30	82,215
日立製作所	4.6	30	94,320
三菱電機	23	30	62,970
富士電機	4.6	6	43,464
安川電機	23	30	135,000
ソシオネクスト	—	30	76,830
ニデック	18.4	24	139,296
オムロン	23	30	157,050
ジーエス・ユアサコーポレーション	4.6	6	14,106
日本電気	2.3	3	33,540
富士通	2.3	30	73,425
ルネサスエレクトロニクス	23	30	66,615
セイコーエプソン	46	60	143,190
パナソニック ホールディングス	23	30	31,440
シャープ	23	30	24,717
ソニーグループ	23	30	369,450
TDK	69	90	809,460
アルプスアルパイン	23	30	40,530
横河電機	23	30	94,140
アドバンテスト	46	240	1,473,120
キーエンス	2.3	3	187,500
レーザーテック	—	12	267,900
カシオ計算機	23	30	33,855
ファナック	115	150	594,150
京セラ	46	240	379,680
太陽誘電	23	30	112,590
村田製作所	18.4	72	200,232
S C R E E Nホールディングス	4.6	12	122,580
キヤノン	34.5	45	180,495
リコー	23	30	37,920
東京エレクトロン	69	90	2,314,350
輸送用機器 (4.2%)			
デンソー	23	120	257,220

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
川崎重工業	2.3	3	11,550
日産自動車	23	30	12,360
いすゞ自動車	11.5	15	27,315
トヨタ自動車	115	150	377,700
日野自動車	23	30	12,891
三菱自動車工業	2.3	3	1,125
マツダ	4.6	6	6,885
本田技研工業	46	180	258,390
スズキ	23	120	189,060
SUBARU	23	30	71,640
ヤマハ発動機	23	90	108,720
精密機器 (3.8%)			
テルモ	92	240	591,840
ニコン	23	30	44,460
オリンパス	92	120	279,240
HOYA	11.5	15	280,800
シチズン時計	23	30	26,700
その他製品 (2.2%)			
バンダイナムコホールディングス	69	90	267,795
TOPPANホールディングス	11.5	15	58,320
大日本印刷	11.5	15	69,960
ヤマハ	23	30	83,910
任天堂	23	30	225,210
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	2.3	3	1,829
中部電力	2.3	3	5,298
関西電力	2.3	3	7,345
東京瓦斯	4.6	6	19,620
大阪瓦斯	4.6	6	20,256
陸運業 (0.9%)			
東武鉄道	4.6	6	14,283
東急	11.5	15	25,327
小田急電鉄	11.5	15	20,917
京王電鉄	4.6	6	20,514
京成電鉄	11.5	15	63,315
東日本旅客鉄道	2.3	9	23,602
西日本旅客鉄道	2.3	6	15,420
東海旅客鉄道	2.3	15	48,390

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヤマトホールディングス	23	30	46,905
NIPPON EXPRESSホールディングス	2.3	3	20,820
海運業 (0.4%)			
日本郵船	6.9	9	40,815
商船三井	6.9	9	41,490
川崎汽船	6.9	27	53,311
空運業 (0.2%)			
日本航空	23	30	68,565
ANAホールディングス	2.3	3	8,272
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	11.5	15	66,270
情報・通信業 (10.3%)			
ネクソン	46	60	180,420
メルカリ	—	30	60,000
LINEヤフー	9.2	12	4,461
トレンドマイクロ	23	30	197,310
日本電信電話	230	300	43,770
KDDI	138	180	784,620
ソフトバンク	23	30	53,580
東宝	2.3	3	15,165
NTTデータグループ	115	150	329,625
コナミグループ	23	30	333,300
ソフトバンクグループ	138	180	1,290,960
卸売業 (3.0%)			
双日	2.3	3	9,087
伊藤忠商事	23	30	192,000
丸紅	23	30	64,410
豊田通商	23	90	211,230
三井物産	23	60	161,400
住友商事	23	30	89,370
三菱商事	23	90	239,535
小売業 (13.8%)			
J. フロント リテイリング	11.5	15	21,667
ZOZO	—	30	126,000
三越伊勢丹ホールディングス	23	30	68,895
セブン&アイ・ホールディングス	23	90	153,315
高島屋	11.5	15	34,185
丸井グループ	23	30	67,455

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
イオン	23	30	101,430
ニトリホールディングス	—	15	275,250
ファーストリテイリング	69	90	3,538,800
銀行業 (0.6%)			
しずおかフィナンシャルグループ	23	30	36,825
コンコルディア・フィナンシャルグループ	23	30	21,468
あおぞら銀行	2.3	3	6,690
三菱UFJフィナンシャル・グループ	23	30	39,540
りそなホールディングス	2.3	3	2,442
三井住友トラスト・ホールディングス	2.3	6	18,822
三井住友フィナンシャルグループ	2.3	3	24,000
千葉銀行	23	30	29,898
ふくおかフィナンシャルグループ	4.6	6	20,046
みずほフィナンシャルグループ	2.3	3	7,789
証券、商品先物取引業 (0.2%)			
大和証券グループ本社	23	30	27,618
野村ホールディングス	23	30	21,903
松井証券	23	—	—
保険業 (1.2%)			
SOMPOホールディングス	4.6	18	51,381
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	6.9	27	81,000
第一生命ホールディングス	2.3	3	10,782
東京海上ホールディングス	34.5	45	211,500
T&Dホールディングス	4.6	6	13,239

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 (0.9%)			
クレディセゾン	23	30	86,655
オリックス	23	30	96,090
日本取引所グループ	23	30	94,860
不動産業 (1.2%)			
東急不動産ホールディングス	23	30	28,506
三井不動産	23	90	131,085
三菱地所	23	30	68,310
東京建物	11.5	15	35,325
住友不動産	23	30	131,580
サービス業 (4.4%)			
エムスリー	55.2	72	87,408
ディー・エヌ・エー	6.9	9	12,807
電通グループ	23	30	119,490
オリエンタルランド	23	30	119,850
サイバーエージェント	18.4	24	21,156
楽天グループ	23	30	21,963
リクルートホールディングス	69	90	682,380
日本郵政	23	30	41,190
セコム	23	30	280,350
合 計	株数・金額 5,011	8,154	31,821,089
	銘柄数<比率>	225	225 <97.1%>

(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 1,027	百万円 —
	日経225		

○投資信託財産の構成

(2024年8月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	31,821,089	80.6
コール・ローン等、その他	7,652,956	19.4
投資信託財産総額	39,474,045	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年8月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	39,823,146,601
コール・ローン等	6,890,189,808
株式(評価額)	31,821,089,700
未収入金	304,796,400
未収配当金	30,512,250
未収利息	41,446
差入委託証拠金	776,516,997
(B) 負債	7,037,447,521
未払金	6,382,041,652
未払解約金	306,181,869
差入委託証拠金代用有価証券	349,224,000
(C) 純資産総額(A-B)	32,785,699,080
元本	13,816,669,443
次期繰越損益金	18,969,029,637
(D) 受益権総口数	13,816,669,443口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,729円

(注) 当親ファンドの期首元本額は10,552,115,437円、期中追加設定元本額は14,966,167,059円、期中一部解約元本額は11,701,613,053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>	8,194,059,306円
東京海上・日経225インデックスファンド	5,216,106,805円
日経225インデックス(適格機関投資家専用)	406,503,332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) 2024年8月6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 416,973,000円

○損益の状況 (2023年8月8日~2024年8月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	435,629,506
受取配当金	430,801,604
受取利息	537,447
その他収益金	4,607,807
支払利息	△ 317,352
(B) 有価証券売買損益	2,312,073,696
売買益	4,060,365,435
売買損	△ 1,748,291,739
(C) 先物取引等取引損益	373,582,700
取引益	1,058,106,800
取引損	△ 684,524,100
(D) 当期損益金(A+B+C)	3,121,285,902
(E) 前期繰越損益金	12,322,134,636
(F) 追加信託差損益金	19,971,229,283
(G) 解約差損益金	△16,445,620,184
(H) 計(D+E+F+G)	18,969,029,637
次期繰越損益金(H)	18,969,029,637

(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

従来ベンチマークに「配当を含まない指数」を採用していましたが、ベンチマークをより実態に近い「配当を含む指数」に変更することが顧客本位であると判断し、2023年10月1日付で所要の約款変更を行いました。