

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	・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10期 運用報告書（全体版） （決算日 2026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10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 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	金 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率			
	円		円	%		%	%	%	百万円
6期(2022年8月8日)	17,687		0	3.2	48,001.23	3.6	95.0	4.7	6,939
7期(2023年8月7日)	20,597		0	16.5	56,050.74	16.8	95.7	4.1	9,633
8期(2024年8月6日)	22,486		0	9.2	61,374.02	9.5	97.1	3.1	12,377
9期(2025年8月6日)	26,902		0	19.6	73,623.45	20.0	92.8	1.3	16,205
10期(2026年8月6日)	43,904		0	63.2	120,572.20	63.8	94.9	5.0	29,556

(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) 2025年 8 月 6 日	円	%		%	%	%
	26,902	—	73,623.45	—	92.8	1.3
8 月末	28,183	4.8	77,138.62	4.8	97.3	2.6
9 月末	29,832	10.9	81,678.01	10.9	97.9	2.0
10月末	34,782	29.3	95,279.92	29.4	96.2	3.6
11月末	33,343	23.9	91,370.38	24.1	94.5	5.3
12月末	33,428	24.3	91,630.43	24.5	98.7	1.3
2026年 1 月末	35,404	31.6	97,065.30	31.8	96.7	3.2
2 月末	39,082	45.3	107,181.40	45.6	97.0	2.7
3 月末	34,135	26.9	93,629.13	27.2	93.1	6.9
4 月末	39,631	47.3	108,711.21	47.7	97.4	2.4
5 月末	44,346	64.8	121,628.95	65.2	97.3	2.8
6 月末	46,848	74.1	128,600.30	74.7	94.5	5.7
7 月末	43,005	59.9	118,142.80	60.5	94.7	5.4
(期 末) 2026年 8 月 6 日	43,904	63.2	120,572.20	63.8	94.9	5.0

(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。

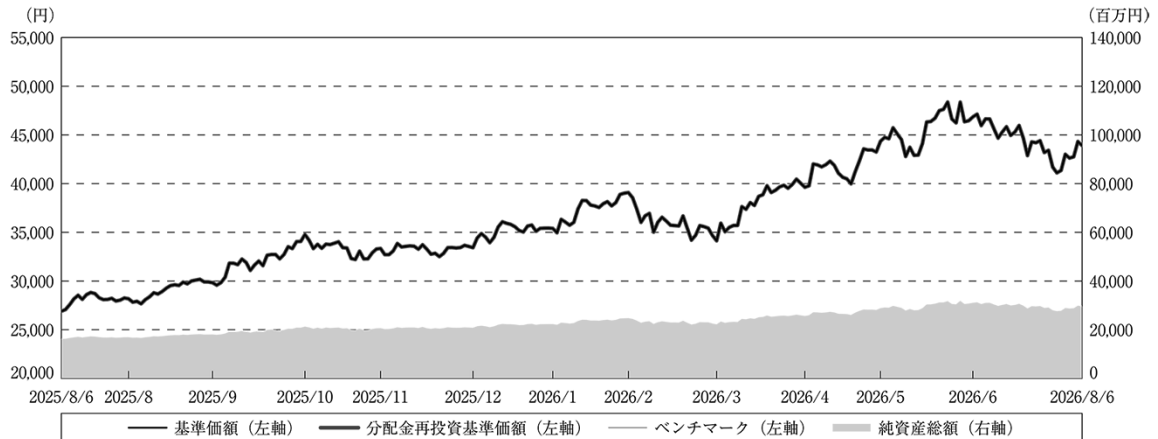
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

○運用経過

(2025年8月7日～2026年8月6日)

■期中の基準価額等の推移



期 首：26,902円

期 末：43,904円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 63.2% (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(2025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225(配当込み)です。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・AI市場の成長期待の高まりから半導体をはじめとしたAI関連株が上昇したこと
- ・衆議院議員選挙において自民党が大きく議席数を伸ばし、政権運営の安定性が高まったこと
- ・中東情勢への懸念が緩和されたこと

マイナス要因

- ・中東情勢の緊迫化に伴う原油価格の上昇により、一時的にリスク回避志向が高まったこと
- ・AI・半導体株の過熱感

■投資環境

当期の国内株式市場は上昇しました。

期前半は、日米の関税交渉が妥結し不透明感が低下したことや、AI市場の成長期待の高まりから半導体・電子部品関連銘柄を中心に株価は上昇しました。2026年2月の衆議院議員選挙では自民党が大きく議席数を伸ばし、政権運営が安定化するとの期待から、国内株式市場はさらに上昇しました。その後、米国とイスラエルによるイランへの軍事攻撃を受けて中東情勢が緊迫化し、原油価格が上昇したことなどから、一時的に投資家のリスク回避志向が高まりましたが、トランプ米大統領がイランとの紛争終結に向けた動きを見せ、国内株式市場はおおむね堅調に推移しました。期末にかけては、AI・半導体株の過熱懸念や半導体株の決算内容が事前の期待に届かなかったことなどを背景に国内株式市場は急落し、上値の重い展開が継続しました。

■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、63.2%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63.6%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+63.2%となり、ベンチマークの騰落率+63.8%にほぼ連動しました。

（主な差異要因）

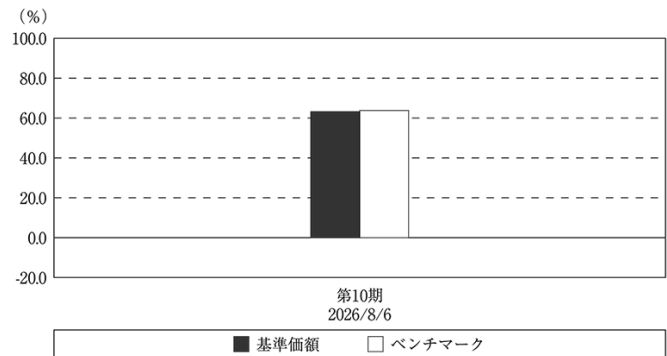
プラス要因

・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10期
	2025年8月7日～ 2026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	33,903

(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

(2025年 8 月 7 日～2026年 8 月 6 日)

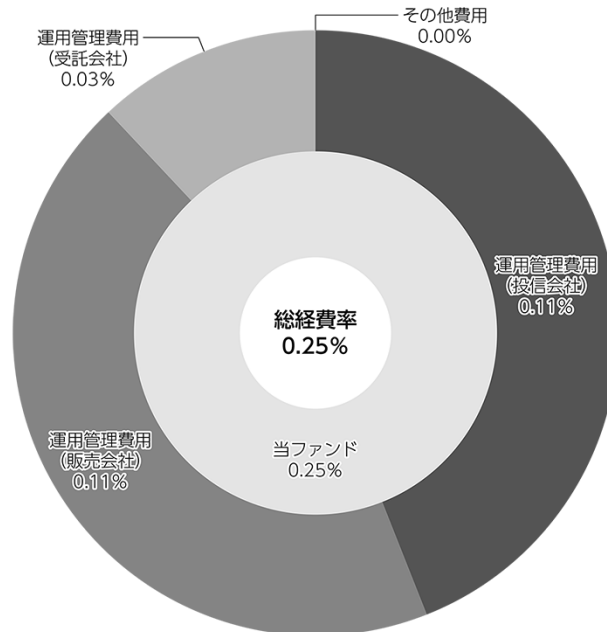
項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 91	% 0.247	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(41)	(0.110)	* 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価
(販 売 会 社)	(41)	(0.110)	* 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受 託 会 社)	(10)	(0.027)	* 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	1	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(1)	(0.002)	* 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	2	0.004	(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)	(2)	(0.004)	* 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	94	0.253	
期中の平均基準価額は、36,834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0.25%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

(2025年8月7日～2026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
	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	2,427,227	9,412,122	1,772,001	6,792,510

○株式売買比率

(2025年8月7日～2026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	24,638,295千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	48,358,384千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.50

(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

(2025年8月7日～2026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
	百万円	百万円	百万円
株式	95	39	398

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

(2026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	5,694,409	6,349,635	29,556,918

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

(2026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	29,556,918	99.6
コール・ローン等、その他	105,676	0.4
投資信託財産総額	29,662,594	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2026年8月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	29,662,594,073
東京海上・日経225インデックスマザーファンド(評価額)	29,556,918,787
未収入金	105,675,286
(B) 負債	105,675,286
未払解約金	72,536,001
未払信託報酬	32,649,861
その他未払費用	489,424
(C) 純資産総額(A－B)	29,556,918,787
元本	6,732,179,349
次期繰越損益金	22,824,739,438
(D) 受益権総口数	6,732,179,349口
1万口当たり基準価額(C／D)	43,904円

- (注) 当ファンドの期首元本額は6,023,664,196円、期中追加設定元本額は2,570,553,943円、期中一部解約元本額は1,862,038,790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 (2025年8月7日～2026年8月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	9,222,585,052
売買益	10,607,082,082
売買損	△ 1,384,497,030
(B) 信託報酬等	△ 58,164,271
(C) 当期損益金(A＋B)	9,164,420,781
(D) 前期繰越損益金	2,807,418,999
(E) 追加信託差損益金	10,852,899,658
(配当等相当額)	(5,003,720,943)
(売買損益相当額)	(5,849,178,715)
(F) 計(C＋D＋E)	22,824,739,438
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F＋G)	22,824,739,438
追加信託差損益金	10,852,899,658
(配当等相当額)	(5,016,379,863)
(売買損益相当額)	(5,836,519,795)
分配準備積立金	11,971,839,780

- (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)	346,811,783円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	8,817,608,998円
c. 信託約款に規定する収益調整金	10,852,899,658円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	2,807,418,999円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	22,824,739,438円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	33,903円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○お知らせ

2026年4月1日付で、「一般社団法人投資信託協会」は「一般社団法人日本投資顧問業協会」と合併し、「一般社団法人資産運用業協会」に名称を変更したことに伴い、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10期（決算日 2026年8月6日）

（計算期間 2025年8月7日～2026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
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
9期(2025年8月6日)	28,458	19.9	73,623.45	20.0	92.8	1.3	37,762
10期(2026年8月6日)	46,549	63.6	120,572.20	63.8	94.9	5.0	70,220

（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	騰 落 率	ベ ン チ マ ー ク	騰 落 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
(期 首) 2025年 8 月 6 日	円 28,458	% －		% －	% 92.8	% 1.3
8 月末	29,817	4.8	73,623.45	4.8	97.3	2.6
9 月末	31,569	10.9	81,678.01	10.9	97.9	2.0
10月末	36,812	29.4	95,279.92	29.4	96.2	3.6
11月末	35,297	24.0	91,370.38	24.1	94.5	5.3
12月末	35,394	24.4	91,630.43	24.5	98.6	1.3
2026年 1 月末	37,493	31.7	97,065.30	31.8	96.6	3.2
2 月末	41,395	45.5	107,181.40	45.6	97.0	2.7
3 月末	36,164	27.1	93,629.13	27.2	93.0	6.9
4 月末	41,993	47.6	108,711.21	47.7	97.4	2.4
5 月末	46,995	65.1	121,628.95	65.2	97.2	2.8
6 月末	49,656	74.5	128,600.30	74.7	94.5	5.7
7 月末	45,596	60.2	118,142.80	60.5	94.6	5.4
(期 末) 2026年 8 月 6 日	46,549	63.6	120,572.20	63.8	94.9	5.0

(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

(2025年8月7日～2026年8月6日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：28,458円

期 末：46,549円

騰落率： 63.6%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・ AI市場の成長期待の高まりから半導体をはじめとしたAI関連株が上昇したこと
- ・ 衆議院議員選挙において自民党が大きく議席数を伸ばし、政権運営の安定性が高まったこと
- ・ 中東情勢への懸念が緩和されたこと

マイナス要因

- ・ 中東情勢の緊迫化に伴う原油価格の上昇により、一時的にリスク回避志向が高まったこと
- ・ AI・半導体株の過熱感

■投資環境

当期の国内株式市場は上昇しました。

期前半は、日米の関税交渉が妥結し不透明感が低下したことや、AI市場の成長期待の高まりから半導体・電子部品関連銘柄を中心に株価は上昇しました。2026年2月の衆議院議員選挙では自民党が大きく議席数を伸ばし、政権運営が安定化するとの期待から、国内株式市場はさらに上昇しました。その後、米国とイスラエルによるイランへの軍事攻撃を受けて中東情勢が緊迫化し、原油価格が上昇したことなどから、一時的に投資家のリスク回避志向が高まりましたが、トランプ米大統領がイランとの紛争終結に向けた動きを見せ、国内株式市場はおおむね堅調に推移しました。期末にかけては、AI・半導体株の過熱懸念や半導体株の決算内容が事前の期待に届かなかったことなどを背景に国内株式市場は急落し、上値の重い展開が継続しました。



(注) ベンチマークは、期首(2025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63.6%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+63.6%となり、ベンチマークの騰落率+63.8%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

・取引などのコスト

○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

(2025年8月7日～2026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	円 1	% 0.002	(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
(先物・オプション)	(1)	(0.002)	
合 計	1	0.002	
期中の平均基準価額は、39,015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

(2025年8月7日～2026年8月6日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 3,329 (1,521)	千円 17,384,096 ()	千株 1,651	千円 7,254,198

(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 36,804	百万円 34,427	百万円 1,241	百万円 1,239

○株式売買比率

(2025年8月7日～2026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	24,638,295千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	48,358,384千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.50

(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

(2025年8月7日～2026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 95	百万円 39	百万円 398

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

(2026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	29	34	42,942
鉱業 (0.1%)			
I N P E X	11.6	13.6	47,056
建設業 (1.4%)			
コムシスホールディングス	29	34	179,792
大成建設	5.8	6.8	92,310
大林組	29	34	107,542
清水建設	29	34	82,297
長谷工コーポレーション	5.8	6.8	18,281
鹿島建設	14.5	17	87,295
大和ハウス工業	29	34	155,992
積水ハウス	29	34	116,110
日揮ホールディングス	29	34	78,404
食料品 (2.3%)			
日清製粉グループ本社	29	34	66,844
明治ホールディングス	11.6	13.6	54,563
日本ハム	14.5	17	101,966
サッポロビール	5.8	34	65,484
アサヒグループホールディングス	87	102	170,238
キリンホールディングス	29	34	99,518
キッコーマン	145	170	300,900
味の素	58	68	353,328
ニチレイ	29	34	75,021
日本たばこ産業	29	34	239,020
繊維製品 (0.1%)			
帝人	5.8	6.8	11,441
東レ	29	34	44,183
パルプ・紙 (0.0%)			
王子ホールディングス	29	34	29,709
化学 (4.5%)			
クラレ	29	34	64,107
旭化成	29	34	56,644
レゾナック・ホールディングス	2.9	3.4	51,527

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
住友化学	29	34	16,969
日産化学	29	34	257,142
東ソー	14.5	17	46,078
トクヤマ	5.8	6.8	27,614
デンカ	5.8	6.8	25,561
信越化学工業	145	170	1,048,390
三井化学	5.8	13.6	29,430
三菱ケミカルグループ	14.5	17	20,136
UBE	2.9	3.4	11,152
花王	29	68	244,596
富士フイルムホールディングス	87	102	395,556
資生堂	29	34	115,294
日東電工	145	170	593,130
医薬品 (3.8%)			
協和キリン	29	34	85,476
武田薬品工業	29	34	184,450
アステラス製薬	145	170	389,045
住友ファーマ	29	34	43,639
塩野義製薬	87	102	288,201
中外製薬	87	102	689,928
エーザイ	29	34	159,494
第一三共	87	102	271,320
大塚ホールディングス	29	34	413,780
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	58	68	85,578
E N E O S ホールディングス	29	34	44,200
ゴム製品 (0.6%)			
横浜ゴム	14.5	17	130,390
ブリヂストン	29	68	271,252
ガラス・土石製品 (0.7%)			
A G C	5.8	6.8	39,344
日本電気硝子	8.7	10.2	49,949
太平洋セメント	2.9	3.4	14,732
東海カーボン	29	34	59,738

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
TOTO	14.5	17	110,976
NGK	29	34	196,248
鉄鋼 (0.0%)			
日本製鉄	2.9	17	11,619
神戸製鋼所	2.9	3.4	6,856
JFEホールディングス	2.9	3.4	6,318
非鉄金属 (2.6%)			
三井金属	2.9	3.4	108,698
三菱マテリアル	2.9	3.4	15,153
住友金属鉱山	14.5	17	154,496
DOWAホールディングス	5.8	6.8	60,567
古河電気工業	2.9	34	132,906
住友電気工業	29	136	293,556
フジクラ	29	204	937,584
金属製品 (0.0%)			
SUMCO	2.9	3.4	12,049
機械 (4.1%)			
日本製鋼所	5.8	6.8	52,618
オークマ	11.6	13.6	75,072
アマダ	29	34	99,943
ディスコ	5.8	6.8	418,812
SMC	2.9	3.4	256,190
小松製作所	29	34	251,702
住友重機械工業	5.8	6.8	40,126
日立建機	29	34	191,658
クボタ	29	34	91,256
荏原製作所	29	34	198,968
ダイキン工業	29	34	751,400
日本精工	29	34	39,899
NTN	29	34	13,260
ジェイテクト	29	34	73,644
カナデビア	5.8	6.8	8,377
三菱重工業	29	34	135,932
IHI	2.9	23.8	62,796
電気機器 (37.8%)			
キオクシアホールディングス	—	23.8	1,160,012
イビデン	—	68	1,292,680
コニカミノルタ	29	34	21,188

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ミネベアミツミ	29	34	127,024
日立製作所	29	34	187,000
三菱電機	29	34	199,580
富士電機	5.8	6.8	97,444
安川電機	29	34	178,670
ソシオネクスト	29	34	68,374
ニデック	46.4	—	—
オムロン	29	34	231,846
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5.8	—	—
日本電気	14.5	17	79,730
富士通	29	34	121,686
ルネサスエレクトロニクス	29	34	124,882
セイコーエプソン	58	68	213,044
パナソニック ホールディングス	29	34	150,042
シャープ	29	34	21,586
ソニーグループ	145	170	616,420
TDK	435	510	1,536,630
アルプスアルパイン	29	34	71,961
横河電機	29	34	181,390
アドバンテスト	232	244.8	8,061,264
キーエンス	2.9	3.4	290,802
レーザーテック	11.6	13.6	589,288
カシオ計算機	29	—	—
ファナック	145	170	1,093,100
ローム	29	34	156,400
京セラ	232	272	1,041,760
太陽誘電	29	34	337,926
村田製作所	69.6	81.6	605,553
SCREENホールディングス	11.6	27.2	372,368
キヤノン	43.5	51	230,877
リコー	29	34	53,448
東京エレクトロン	87	102	5,643,660
輸送用機器 (2.7%)			
ARCHION	—	34	9,146
デンソー	116	136	261,800
川崎重工業	2.9	17	48,764
日産自動車	29	34	11,393
いすゞ自動車	14.5	17	38,760

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トヨタ自動車	145	170	507,195
日野自動車	29	—	—
三菱自動車工業	2.9	3.4	1,173
マツダ	5.8	6.8	7,867
本田技研工業	174	204	333,642
スズキ	116	136	268,940
S U B A R U	29	34	85,510
ヤマハ発動機	87	102	190,944
精密機器 (2.1%)			
デルモ	232	272	628,864
ニコン	29	34	67,864
オリンパス	116	136	254,592
H O Y A	14.5	17	433,075
シチズン時計	29	—	—
その他製品 (1.6%)			
バンダイナムコホールディングス	87	102	498,270
T O P P A Nホールディングス	14.5	17	79,390
大日本印刷	29	34	101,949
ヤマハ	87	102	136,935
任天堂	29	34	259,794
電気・ガス業 (0.1%)			
東京電力ホールディングス	2.9	3.4	1,825
中部電力	2.9	3.4	9,212
関西電力	2.9	3.4	8,063
東京瓦斯	5.8	6.8	40,575
大阪瓦斯	5.8	6.8	36,658
陸運業 (0.6%)			
東武鉄道	5.8	6.8	19,954
東急	14.5	17	28,466
小田急電鉄	14.5	17	28,696
京王電鉄	5.8	34	26,146
京成電鉄	43.5	51	65,178
東日本旅客鉄道	8.7	10.2	34,965
西日本旅客鉄道	5.8	6.8	19,903
東海旅客鉄道	14.5	17	65,399
ヤマトホールディングス	29	34	64,345
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	8.7	10.2	51,816

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
海運業 (0.3%)			
日本郵船	8.7	10.2	60,496
商船三井	8.7	10.2	61,567
川崎汽船	26.1	30.6	85,282
空運業 (0.2%)			
日本航空	29	34	103,530
A N Aホールディングス	2.9	3.4	10,757
情報・通信業 (11.2%)			
ディー・エヌ・エー	—	10.2	24,658
ネクソン	58	68	161,976
S H I F T	—	34	28,118
野村総合研究所	29	34	161,092
メルカリ	29	34	167,314
L I N Eヤフー	11.6	13.6	6,392
トレンドマイクロ	29	34	228,480
N T T	290	340	52,530
K D D I	348	408	1,183,608
ソフトバンク	290	340	77,724
東宝	2.9	17	24,913
コナミグループ	29	34	689,350
ソフトバンクグループ	174	816	4,647,120
卸売業 (3.5%)			
双日	2.9	3.4	18,836
伊藤忠商事	29	170	345,780
丸紅	29	34	167,824
豊田通商	87	102	760,920
三井物産	58	68	323,884
住友商事	29	136	237,796
三菱商事	87	102	484,296
小売業 (11.7%)			
J. フロント リテイリング	14.5	17	50,022
Z O Z O	87	102	117,147
三越伊勢丹ホールディングス	29	34	122,944
セブン&アイ・ホールディングス	87	102	209,253
良品計画	29	68	298,860
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	—	34	30,464
高島屋	29	34	78,234
丸井グループ	29	34	98,566

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	29	102	137,496
ニトリホールディングス	14.5	85	233,750
ファーストリテイリング	69.6	81.6	6,437,424
銀行業 (0.9%)			
しずおかフィナンシャルグループ	29	34	111,078
横浜フィナンシャルグループ	29	34	61,914
あおぞら銀行	2.9	3.4	11,124
三菱UFJフィナンシャル・グループ	29	34	121,516
りそなホールディングス	2.9	3.4	7,962
三井住友トラストグループ	5.8	27.2	45,668
三井住友フィナンシャルグループ	8.7	10.2	69,166
千葉銀行	29	34	90,610
ふくおかフィナンシャルグループ	5.8	6.8	52,047
みずほフィナンシャルグループ	2.9	3.4	28,896
証券、商品先物取引業 (0.2%)			
大和証券グループ本社	29	34	62,067
野村ホールディングス	29	34	53,618
保険業 (1.1%)			
SOMPOホールディングス	17.4	20.4	142,738
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	26.1	30.6	147,706
第一ライフグループ	11.6	13.6	26,125
東京海上ホールディングス	43.5	51	398,667
T&Dホールディングス	5.8	6.8	33,741
その他金融業 (0.8%)			
クレディセゾン	29	34	159,494

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オリックス	29	34	221,442
日本取引所グループ	58	68	155,992
不動産業 (0.9%)			
東急不動産ホールディングス	29	34	43,877
三井不動産	87	102	151,776
三菱地所	29	34	130,560
東京建物	14.5	17	56,236
住友不動産	29	68	241,128
サービス業 (3.8%)			
エムスリー	69.6	81.6	150,225
ディー・エヌ・エー	8.7	—	—
電通グループ	29	34	120,666
オリエンタルランド	29	34	100,436
サイバーエージェント	23.2	27.2	39,984
楽天グループ	29	34	29,240
リクルートホールディングス	87	102	1,310,190
日本郵政	29	34	81,430
ペイカレント	14.5	34	239,564
セコム	58	68	456,960
合 計	株 数 ・ 金 額	9,268	12,467
	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 3,539	百万円 —

○投資信託財産の構成

(2026年 8 月 6 日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	66,619,734	94.2
コール・ローン等、その他	4,132,704	5.8
投資信託財産総額	70,752,438	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2026年 8 月 6 日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	70,841,853,305
コール・ローン等	3,925,071,298
株式(評価額)	66,619,734,640
未収入金	7,930,600
未収配当金	45,765,000
未収利息	102,588
差入委託証拠金	243,249,179
(B) 負債	621,051,562
未払解約金	477,753,562
差入委託証拠金代用有価証券	143,298,000
(C) 純資産総額(A－B)	70,220,801,743
元本	15,085,199,412
次期繰越損益金	55,135,602,331
(D) 受益権総口数	15,085,199,412口
1万口当たり基準価額(C／D)	46,549円

(注) 当親ファンドの期首元本額は13,269,591,005円、期中追加設定元本額は7,896,028,257円、期中一部解約元本額は6,080,419,850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> 7,314,696,534円
東京海上・日経225インデックスファンド 6,349,635,607円
日経225インデックス(適格機関投資家専用) 1,420,867,271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) 2026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 170,094,000円

○損益の状況 (2025年 8 月 7 日～2026年 8 月 6 日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	741,880,318
受取配当金	727,649,770
受取利息	14,208,103
その他収益金	22,445
(B) 有価証券売買損益	21,451,958,396
売買益	22,529,432,308
売買損	△ 1,077,473,912
(C) 先物取引等取引損益	673,557,600
取引益	1,303,352,100
取引損	△ 629,794,500
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	22,867,396,314
(E) 前期繰越損益金	24,493,303,961
(F) 追加信託差損益金	24,402,384,795
(G) 解約差損益金	△16,627,482,739
(H) 計(D＋E＋F＋G)	55,135,602,331
次期繰越損益金(H)	55,135,602,331

(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

2026年 4 月 1 日付で、「一般社団法人投資信託協会」は「一般社団法人日本投資顧問業協会」と合併し、「一般社団法人資産運用業協会」に名称を変更したことに伴い、所要の約款変更を行いました。