

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／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2010年4月28日設定）	
運用方針	NOMURA-BPI（総合）に連動する投資成果の達成を目標とし、主として同じ目標で運用を行う「TMA日本債券インデックスマザーファンド」に投資します。	
主要投資対象	東京海上セレクション・日本債券インデックス	主としてマザーファンド受益証券に投資し、高位の組入比率を維持します。なお、このほかわが国の公社債等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	主としてわが国の公社債に投資します。
投資制限	東京海上セレクション・日本債券インデックス	・株式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。 ・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。
	TMA日本債券インデックスマザーファンド	・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・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。	

東京海上セレクション・日本債券インデックス

第15期 運用報告書（全体版）

（決算日 2025年4月15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、「東京海上セレクション・日本債券インデックス」は、このたび、第15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		債 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金	期 騰 落	中 率		
	円			円		%	%	百万円
11期(2021年 4 月15日)	11, 508			0	△0. 6		99. 7	3, 927
12期(2022年 4 月15日)	11, 305			0	△1. 8		99. 8	4, 626
13期(2023年 4 月17日)	11, 049			0	△2. 3		99. 7	5, 255
14期(2024年 4 月15日)	10, 746			0	△2. 7		99. 7	5, 664
15期(2025年 4 月15日)	10, 326			0	△3. 9		99. 6	5, 997

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

○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	債 組 入 比 率
		騰 落	率		
(期 首)	円		%		%
2024年 4 月15日	10, 746		—	362. 707	99. 7
4 月末	10, 735	△0. 1		362. 353	100. 1
5 月末	10, 561	△1. 7		356. 531	99. 8
6 月末	10, 588	△1. 5		357. 511	100. 1
7 月末	10, 575	△1. 6		357. 155	100. 2
8 月末	10, 699	△0. 4		361. 325	100. 0
9 月末	10, 727	△0. 2		362. 344	100. 1
10月末	10, 672	△0. 7		360. 511	99. 6
11月末	10, 596	△1. 4		357. 991	99. 7
12月末	10, 583	△1. 5		357. 613	99. 8
2025年 1 月末	10, 504	△2. 3		354. 971	99. 9
2 月末	10, 432	△2. 9		352. 609	99. 9
3 月末	10, 329	△3. 9		349. 164	100. 2
(期 末)					
2025年 4 月15日	10, 326	△3. 9		349. 022	99. 6

(注) 騰落率は期首比です。

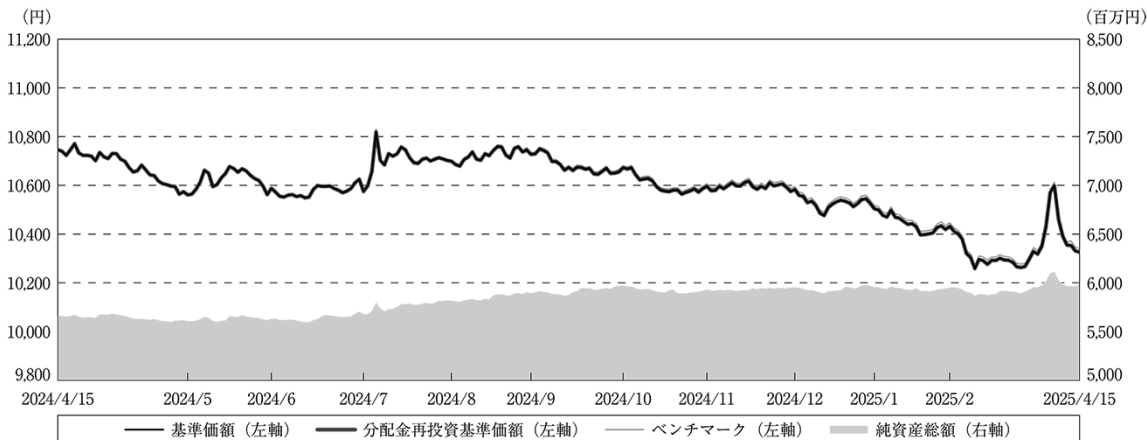
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

ベンチマークはNOMURA-BPI（総合）です。
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）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。その知的財産権はNFRCに帰属します。なお、NFRCは、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果などに関して一切責任を負うものではありません。

○運用経過

(2024年4月16日～2025年4月15日)

■期中の基準価額等の推移



期 首：10,746円

期 末：10,326円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 3.9% (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(2024年4月15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、NOMURA-BPI(総合)です。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・保有債券の利息収入

マイナス要因

- ・日銀による一連の金融政策正常化に向かう動きを受けて、10年国債利回りが上昇(債券価格は下落)したこと

■投資環境

当期、10年国債利回りは上昇しました。

期初、日銀による追加利上げの思惑や国債買入の減額観測が高まったことなどから、10年国債利回りは1.1%程度まで徐々に水準を切り上げる展開となりました。2024年7月末に日銀が追加利上げを決定した直後に株式市場が急落した局面では10年国債利回りは0.8%程度まで大幅に低下しましたが、その後、米国による財政拡張政策への警戒感から円安が進行したことを背景に、追加利上げ観測が高まったことなどから、12月末には1.1%程度まで上昇しました。2025年1月に追加利上げを決定した後も、日銀関係者から利上げ継続に対する前向きなコメントが相次ぐなか、10年国債利回りは1.6%近辺まで上昇しましたが、米国の関税政策による景気後退懸念から、期末にかけて低下し、1.4%程度の水準で期を終えました。

■ポートフォリオについて

＜東京海上セレクション・日本債券インデックス＞

「TMA日本債券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、3.9%下落しました。

＜TMA日本債券インデックスマザーファンド＞

ベンチマークであるNOMURA－BPI（総合）に連動する投資成果の達成を目標として運用しました。
以上のような運用の結果、基準価額は3.8%下落し、ベンチマーク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△3.9%となり、ベンチマークの騰落率△3.8%にほぼ連動しました。

(主な差異要因)

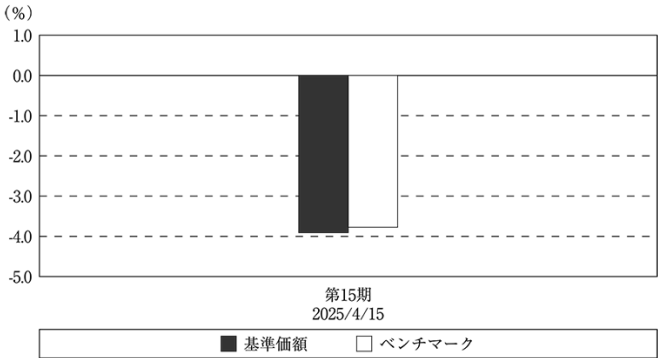
プラス要因

- ・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、NOMURA－BPI（総合）です。

■分配金

当期においては、当ファンドが確定拠出年金向けに設定されたファンドであるという性格を鑑み、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15期
	2024年4月16日～ 2025年4月15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	1,884

(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四捨五入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

＜東京海上セレクション・日本債券インデックス＞

「TMA日本債券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。

＜TMA日本債券インデックスマザーファンド＞

引き続き、ベンチマークに対して高い連動率を維持するよう運用を行う方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2024年4月16日～2025年4月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 信 託 報 酬	16	0.154	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(7)	(0.066)	*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)	(7)	(0.066)	*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)	(2)	(0.022)	*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) そ の 他 費 用	1	0.005	(b) 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	17	0.159	
期中の平均基準価額は、10,583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。

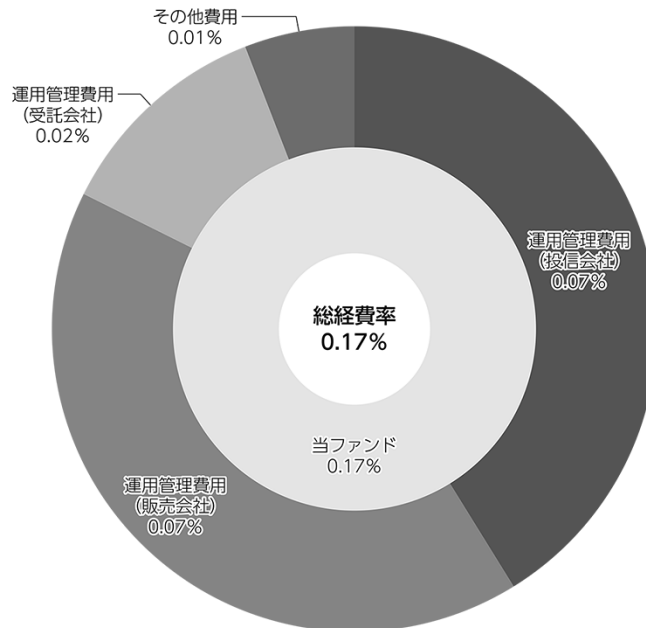
(注) その他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.17%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

(2024年4月16日～2025年4月15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
TMA日本債券インデックスマザーファンド	1,126,375	1,347,772	659,516	788,907

○利害関係人との取引状況等

(2024年4月16日～2025年4月15日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2025年4月15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
TMA日本債券インデックスマザーファンド	4,665,099	5,131,958	5,997,720

○投資信託財産の構成

(2025年4月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA日本債券インデックスマザーファンド	5,997,720	99.8
コール・ローン等、その他	10,230	0.2
投資信託財産総額	6,007,950	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2025年4月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,007,950,928
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	5,997,720,153
未収入金	10,230,775
(B) 負債	10,230,775
未払解約金	5,509,459
未払信託報酬	4,558,594
その他未払費用	162,722
(C) 純資産総額(A－B)	5,997,720,153
元本	5,808,493,838
次期繰越損益金	189,226,315
(D) 受益権総口数	5,808,493,838口
1万口当たり基準価額(C／D)	10,326円

- (注) 当ファンドの期首元本額は5,271,610,590円、期中追加設定元本額は1,273,851,710円、期中一部解約元本額は736,968,462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 (2024年4月16日～2025年4月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	△214,426,190
売買益	6,575,277
売買損	△221,001,467
(B) 信託報酬等	△ 9,292,700
(C) 当期損益金(A＋B)	△223,718,890
(D) 前期繰越損益金	△260,967,800
(E) 追加信託差損益金	673,913,005
(配当等相当額)	(974,871,602)
(売買損益相当額)	(△300,958,597)
(F) 計(C＋D＋E)	189,226,315
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F＋G)	189,226,315
追加信託差損益金	673,913,005
(配当等相当額)	(975,521,770)
(売買損益相当額)	(△301,608,765)
分配準備積立金	118,811,223
繰越損益金	△603,497,913

- (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)	31,109,296円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	975,521,770円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	87,701,927円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	1,094,332,993円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,884円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○お知らせ

- ・2023年11月に成立した「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正の施行により、従来運用報告書の書面交付義務としていた規定が、電磁的方法を含む情報提供義務と改められることに伴い、2025年4月1日付で所要の約款変更を行いました。

上記の通り、2023年11月に「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正が行われ、交付運用報告書については書面交付を原則としていた規定が変更されました。本件により、デジタル化の推進を通じて顧客の利便性向上を図るとともに、ペーパーレス化による地球環境の保全など、サステナビリティへの貢献に繋がるものと捉えております。今後も顧客本位の業務運営を確保しつつ、電磁的方法での情報提供を進めてまいります。

TMA日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第19期（決算日 2024年11月11日）

（計算期間 2023年11月11日～2024年11月11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			債 組 入 比	純 資 産 額
	円	騰 落	中 率 %	騰 落	中 率 %	率		
15期(2020年11月10日)	12,957		△0.9	386.816	△0.8	99.4		百万円 18,955
16期(2021年11月10日)	12,975		0.1	387.538	0.2	99.7		21,249
17期(2022年11月10日)	12,458		△4.0	372.013	△4.0	99.7		25,762
18期(2023年11月10日)	12,149		△2.5	362.801	△2.5	99.7		28,322
19期(2024年11月11日)	12,021		△1.1	359.078	△1.0	99.6		31,869

○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			債 組 入 比	券 率
	円	騰 落	率 %	騰 落	率 %	率		
(期 首) 2023年11月10日	12,149		—	362.801	—	99.7		%
11月末	12,288		1.1	366.877	1.1	100.1		
12月末	12,338		1.6	368.384	1.5	100.0		
2024年1月末	12,248		0.8	365.748	0.8	99.9		
2月末	12,286		1.1	366.902	1.1	100.0		
3月末	12,271		1.0	366.497	1.0	100.1		
4月末	12,131		△0.1	362.353	△0.1	100.1		
5月末	11,937		△1.7	356.531	△1.7	99.7		
6月末	11,968		△1.5	357.511	△1.5	100.0		
7月末	11,956		△1.6	357.155	△1.6	100.1		
8月末	12,097		△0.4	361.325	△0.4	99.9		
9月末	12,131		△0.1	362.344	△0.1	100.1		
10月末	12,070		△0.7	360.511	△0.6	99.6		
(期 末) 2024年11月11日	12,021		△1.1	359.078	△1.0	99.6		

（注）騰落率は期首比です。

ベンチマークはNOMURA-BPI（総合）です。

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）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。その知的財産権はNFRCに帰属します。なお、NFRCは、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果などに関して一切責任を負うものではありません。

○運用経過

(2023年11月11日～2024年11月11日)

■期中の基準価額等の推移

期首：12,149円

期末：12,021円

騰落率：△1.1%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・保有する債券の利息収入

マイナス要因

- ・日銀によるマイナス金利の解除ならびにYCC（イールドカーブ・コントロール）政策の撤廃などを受けて、10年国債利回りが上昇（債券価格は下落）したこと

■投資環境

当期、10年国債利回りは上昇しました。

期初、米国長期金利が大幅に低下するなか、10年国債利回りもつられて低下（債券価格は上昇）しました。2024年1月以降は、米国長期金利が上昇したことや日銀によるマイナス金利解除への思惑が高まったことなどから、10年国債利回りは上昇基調となりました。3月の日銀金融政策決定会合におけるマイナス金利の解除ならびにYCC政策の撤廃後も、今後の追加利上げや国債買入減額観測が高まったことなどから、10年国債利回りは徐々に水準を切り上げる展開となりました。7月末に日銀が追加利上げを決定した後、株式市場が急落する局面で10年国債利回りは大幅に低下しましたが、株式市場が短期間で安定化に向かったことや衆議院選ならびに米国大統領選挙における財政拡張政策への警戒感から期末にかけて上昇し、1.0%程度の水準で期を終えました。

■ポートフォリオについて

ベンチマークであるNOMURA-BPI（総合）に連動することを目標に、ファンドとベンチマークのリスク特性値が近似するように調整して運用を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は1.1%下落しました。

■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△1.1%となり、ベンチマークの騰落率△1.0%にほぼ連動する値動きとなりました。

(主な差異要因)

プラス要因

- ・特にありません

マイナス要因

- ・保有する債券の時価評価の違いなどのテクニカル要因

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、10月末現在、推定値で0.03%となっています。

※2024年10月末のポートフォリオのデータを基にベンチマークとの乖離を推計しています。ベンチマークとの連動が高いほどこの値は低くなります。



(注) ベンチマークは、期首(2023年11月10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、NOMURA-BPI（総合）です。

○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに対する高い連動率を維持するよう運用を行う方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年11月11日～2024年11月11日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2023年11月11日～2024年11月11日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	12,344,467	8,113,428
	地方債証券	99,851	—
	特殊債券	—	(100,000)
	社債券 (投資法人債券を含む)	100,447	(100,000)
			(208,764)

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれていません)

(注) ()内は償還による減少分です。

(注) 社債券 (投資法人債券を含む) には新株予約権付社債 (転換社債) は含まれていません。

○利害関係人との取引状況等

(2023年11月11日～2024年11月11日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2024年11月11日現在)

国内公社債

(A) 国内 (邦貨建) 公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	30,539,000	28,786,231	90.3	—	57.9	21.3	11.0
地方債証券	1,560,400	1,552,098	4.9	—	2.2	2.0	0.6
	(1,560,400)	(1,552,098)	(4.9)	(—)	(2.2)	(2.0)	(0.6)
特殊債券	100,000	98,367	0.3	—	—	0.3	—
(除く金融債)	(100,000)	(98,367)	(0.3)	(—)	(—)	(0.3)	(—)
普通社債券	1,287,493	1,303,022	4.1	—	1.3	2.2	0.6
(含む投資法人債券)	(1,287,493)	(1,303,022)	(4.1)	(—)	(1.3)	(2.2)	(0.6)
合 計	33,486,893	31,739,719	99.6	—	61.4	25.9	12.3
	(2,947,893)	(2,953,488)	(9.3)	(—)	(3.5)	(4.5)	(1.3)

(注) ()内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	利率	当期			償還年月日	銘柄	利率	当期			償還年月日
		額面金額	評価額	額				額面金額	評価額	額	
国債証券	%	千円	千円			国債証券	%	千円	千円		
第455回利付国債 (2年)	0.005	175,000	174,329	2025/12/1	第347回利付国債 (10年)	0.1	345,000	341,539	2027/6/20		
第456回利付国債 (2年)	0.1	100,000	99,677	2026/1/1	第348回利付国債 (10年)	0.1	145,000	143,347	2027/9/20		
第457回利付国債 (2年)	0.1	100,000	99,635	2026/2/1	第349回利付国債 (10年)	0.1	174,000	171,765	2027/12/20		
第458回利付国債 (2年)	0.2	90,000	89,749	2026/3/1	第350回利付国債 (10年)	0.1	252,000	248,391	2028/3/20		
第459回利付国債 (2年)	0.2	100,000	99,683	2026/4/1	第351回利付国債 (10年)	0.1	258,000	253,851	2028/6/20		
第460回利付国債 (2年)	0.3	100,000	99,796	2026/5/1	第352回利付国債 (10年)	0.1	357,000	350,670	2028/9/20		
第461回利付国債 (2年)	0.4	140,000	139,892	2026/6/1	第353回利付国債 (10年)	0.1	346,000	339,273	2028/12/20		
第462回利付国債 (2年)	0.4	200,000	199,804	2026/7/1	第354回利付国債 (10年)	0.1	336,000	328,806	2029/3/20		
第463回利付国債 (2年)	0.4	60,000	59,928	2026/8/1	第355回利付国債 (10年)	0.1	313,000	305,713	2029/6/20		
第464回利付国債 (2年)	0.4	230,000	229,671	2026/9/1	第356回利付国債 (10年)	0.1	430,000	419,065	2029/9/20		
第465回利付国債 (2年)	0.4	27,000	26,954	2026/10/1	第357回利付国債 (10年)	0.1	313,000	304,642	2029/12/20		
第146回利付国債 (5年)	0.1	315,000	314,010	2025/12/20	第358回利付国債 (10年)	0.1	304,000	295,506	2030/3/20		
第147回利付国債 (5年)	0.005	332,000	330,147	2026/3/20	第359回利付国債 (10年)	0.1	349,000	338,714	2030/6/20		
第148回利付国債 (5年)	0.005	287,000	284,942	2026/6/20	第360回利付国債 (10年)	0.1	280,000	271,311	2030/9/20		
第149回利付国債 (5年)	0.005	351,000	347,963	2026/9/20	第361回利付国債 (10年)	0.1	313,000	302,714	2031/12/20		
第150回利付国債 (5年)	0.005	282,000	279,180	2026/12/20	第362回利付国債 (10年)	0.1	341,000	329,058	2031/3/20		
第151回利付国債 (5年)	0.005	260,000	257,067	2027/3/20	第363回利付国債 (10年)	0.1	295,000	284,008	2031/6/20		
第152回利付国債 (5年)	0.1	161,000	159,539	2027/3/20	第364回利付国債 (10年)	0.1	297,000	285,250	2031/9/20		
第153回利付国債 (5年)	0.005	293,000	289,346	2027/6/20	第365回利付国債 (10年)	0.1	320,000	306,486	2031/12/20		
第154回利付国債 (5年)	0.1	235,000	232,321	2027/9/20	第366回利付国債 (10年)	0.2	325,000	312,763	2032/3/20		
第155回利付国債 (5年)	0.3	74,000	73,501	2027/12/20	第367回利付国債 (10年)	0.2	408,000	391,435	2032/6/20		
第156回利付国債 (5年)	0.2	253,000	250,525	2027/12/20	第368回利付国債 (10年)	0.2	310,000	296,580	2032/9/20		
第157回利付国債 (5年)	0.2	94,000	92,963	2028/3/20	第369回利付国債 (10年)	0.5	256,000	250,152	2032/12/20		
第158回利付国債 (5年)	0.1	260,000	256,276	2028/3/20	第370回利付国債 (10年)	0.5	285,000	277,761	2033/3/20		
第159回利付国債 (5年)	0.1	102,000	100,359	2028/6/20	第371回利付国債 (10年)	0.4	276,000	265,934	2033/6/20		
第160回利付国債 (5年)	0.2	136,000	134,294	2028/6/20	第372回利付国債 (10年)	0.8	319,000	317,162	2033/9/20		
第163回利付国債 (5年)	0.4	230,000	228,523	2028/9/20	第373回利付国債 (10年)	0.6	295,000	287,309	2033/12/20		
第164回利付国債 (5年)	0.2	140,000	137,838	2028/12/20	第374回利付国債 (10年)	0.8	229,000	226,341	2034/3/20		
第165回利付国債 (5年)	0.3	115,000	113,685	2028/12/20	第375回利付国債 (10年)	1.1	326,000	330,156	2034/6/20		
第166回利付国債 (5年)	0.4	155,000	153,849	2028/12/20	第376回利付国債 (10年)	0.9	101,000	100,138	2034/9/20		
第167回利付国債 (5年)	0.4	210,000	208,217	2029/3/20	第1回利付国債 (30年)	2.8	5,000	5,515	2029/9/20		
第168回利付国債 (5年)	0.6	150,000	150,000	2029/3/20	第2回利付国債 (30年)	2.4	6,000	6,548	2030/2/20		
第170回利付国債 (5年)	0.6	128,000	127,884	2029/6/20	第3回利付国債 (30年)	2.3	20,000	21,804	2030/5/20		
第173回利付国債 (5年)	0.6	63,000	62,880	2029/9/20	第5回利付国債 (30年)	2.2	20,000	21,945	2031/5/20		
第5回利付国債 (40年)	2.0	73,000	70,627	2052/3/20	第21回利付国債 (30年)	2.3	7,000	7,858	2035/12/20		
第6回利付国債 (40年)	1.9	69,000	64,819	2053/3/20	第22回利付国債 (30年)	2.5	8,000	9,148	2036/3/20		
第7回利付国債 (40年)	1.7	84,000	74,840	2054/3/20	第25回利付国債 (30年)	2.3	5,000	5,604	2036/12/20		
第8回利付国債 (40年)	1.4	80,000	65,492	2055/3/20	第26回利付国債 (30年)	2.4	11,000	12,446	2037/3/20		
第9回利付国債 (40年)	0.4	124,000	72,854	2056/3/20	第27回利付国債 (30年)	2.5	8,000	9,142	2037/9/20		
第10回利付国債 (40年)	0.9	103,000	71,046	2057/3/20	第28回利付国債 (30年)	2.5	20,000	22,847	2038/3/20		
第11回利付国債 (40年)	0.8	92,000	60,371	2058/3/20	第29回利付国債 (30年)	2.4	50,000	56,390	2038/9/20		
第12回利付国債 (40年)	0.5	104,000	59,661	2059/3/20	第31回利付国債 (30年)	2.2	44,000	48,239	2039/9/20		
第13回利付国債 (40年)	0.5	114,000	63,844	2060/3/20	第32回利付国債 (30年)	2.3	13,000	14,387	2040/3/20		
第14回利付国債 (40年)	0.7	108,000	64,137	2061/3/20	第33回利付国債 (30年)	2.0	40,000	42,452	2040/9/20		
第15回利付国債 (40年)	1.0	126,000	82,410	2062/3/20	第34回利付国債 (30年)	2.2	53,000	57,530	2041/3/20		
第16回利付国債 (40年)	1.3	160,000	114,452	2063/3/20	第35回利付国債 (30年)	2.0	40,000	42,151	2041/9/20		
第17回利付国債 (40年)	2.2	72,000	66,918	2064/3/20	第36回利付国債 (30年)	2.0	53,000	55,614	2042/3/20		
第1回利付国債 (10年)	0.7	30,000	29,470	2033/12/20	第37回利付国債 (30年)	1.9	64,000	65,933	2042/9/20		
第2回利付国債 (10年)	1.0	10,000	10,034	2034/3/20	第38回利付国債 (30年)	1.8	66,000	66,689	2043/3/20		
第341回利付国債 (10年)	0.3	90,000	89,915	2025/12/20	第39回利付国債 (30年)	1.9	73,000	74,746	2043/6/20		
第342回利付国債 (10年)	0.1	200,000	199,140	2026/3/20	第40回利付国債 (30年)	1.8	69,000	69,390	2043/9/20		
第343回利付国債 (10年)	0.1	195,000	193,898	2026/6/20	第41回利付国債 (30年)	1.7	71,000	70,089	2043/12/20		
第344回利付国債 (10年)	0.1	190,000	188,689	2026/9/20	第42回利付国債 (30年)	1.7	65,000	63,974	2044/3/20		
第345回利付国債 (10年)	0.1	190,000	188,476	2026/12/20	第43回利付国債 (30年)	1.7	71,000	69,668	2044/6/20		
第346回利付国債 (10年)	0.1	221,000	218,995	2027/3/20	第44回利付国債 (30年)	1.7	74,000	72,387	2044/9/20		

銘 柄	当 期 末				銘 柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円		国債証券	%	千円	千円	
第45回利付国債 (30年)	1.5	101,000	95,122	2044/12/20	第111回利付国債 (20年)	2.2	11,000	11,788	2029/6/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	87,000	81,712	2045/3/20	第112回利付国債 (20年)	2.1	10,000	10,671	2029/6/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	72,000	68,649	2045/6/20	第113回利付国債 (20年)	2.1	5,000	5,348	2029/9/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	81,000	74,230	2045/9/20	第115回利付国債 (20年)	2.2	10,000	10,784	2029/12/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	99,000	90,386	2045/12/20	第116回利付国債 (20年)	2.2	40,000	43,295	2030/3/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	114,000	91,814	2046/3/20	第117回利付国債 (20年)	2.1	60,000	64,648	2030/3/20
第51回利付国債 (30年)	0.3	75,000	53,505	2046/6/20	第120回利付国債 (20年)	1.6	25,000	26,326	2030/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	70,000	52,090	2046/9/20	第121回利付国債 (20年)	1.9	30,000	32,169	2030/9/20
第53回利付国債 (30年)	0.6	87,000	65,954	2046/12/20	第122回利付国債 (20年)	1.8	35,000	37,333	2030/9/20
第54回利付国債 (30年)	0.8	90,000	71,120	2047/3/20	第123回利付国債 (20年)	2.1	58,000	63,029	2030/12/20
第55回利付国債 (30年)	0.8	93,000	73,178	2047/6/20	第124回利付国債 (20年)	2.0	40,000	43,233	2030/12/20
第56回利付国債 (30年)	0.8	69,000	54,020	2047/9/20	第125回利付国債 (20年)	2.2	45,000	49,298	2031/3/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	104,000	81,075	2047/12/20	第126回利付国債 (20年)	2.0	31,000	33,572	2031/3/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	100,000	77,565	2048/3/20	第127回利付国債 (20年)	1.9	25,000	26,922	2031/3/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	95,000	71,582	2048/6/20	第128回利付国債 (20年)	1.9	20,000	21,575	2031/6/20
第60回利付国債 (30年)	0.9	92,000	72,438	2048/9/20	第129回利付国債 (20年)	1.8	28,000	30,028	2031/6/20
第61回利付国債 (30年)	0.7	83,000	61,926	2048/12/20	第130回利付国債 (20年)	1.8	54,000	57,998	2031/9/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	91,000	64,082	2049/3/20	第131回利付国債 (20年)	1.7	45,000	48,037	2031/9/20
第63回利付国債 (30年)	0.4	92,000	62,663	2049/6/20	第132回利付国債 (20年)	1.7	52,000	55,556	2031/12/20
第64回利付国債 (30年)	0.4	90,000	60,933	2049/9/20	第133回利付国債 (20年)	1.8	71,000	76,337	2031/12/20
第65回利付国債 (30年)	0.4	85,000	57,203	2049/12/20	第134回利付国債 (20年)	1.8	46,000	49,519	2032/3/20
第66回利付国債 (30年)	0.4	80,000	53,475	2050/3/20	第135回利付国債 (20年)	1.7	40,000	42,781	2032/3/20
第67回利付国債 (30年)	0.6	101,000	71,097	2050/6/20	第136回利付国債 (20年)	1.6	40,000	42,486	2032/3/20
第68回利付国債 (30年)	0.6	117,000	81,960	2050/9/20	第137回利付国債 (20年)	1.7	28,000	29,967	2032/6/20
第69回利付国債 (30年)	0.7	107,000	76,697	2050/12/20	第138回利付国債 (20年)	1.5	47,000	49,606	2032/6/20
第70回利付国債 (30年)	0.7	103,000	73,489	2051/3/20	第139回利付国債 (20年)	1.6	52,000	55,258	2032/6/20
第71回利付国債 (30年)	0.7	118,000	83,796	2051/6/20	第140回利付国債 (20年)	1.7	78,000	83,527	2032/9/20
第72回利付国債 (30年)	0.7	100,000	70,680	2051/9/20	第141回利付国債 (20年)	1.7	86,000	92,100	2032/12/20
第73回利付国債 (30年)	0.7	93,000	65,425	2051/12/20	第142回利付国債 (20年)	1.8	72,000	77,686	2032/12/20
第74回利付国債 (30年)	1.0	81,000	61,714	2052/3/20	第143回利付国債 (20年)	1.6	124,000	131,867	2033/3/20
第75回利付国債 (30年)	1.3	76,000	62,377	2052/6/20	第144回利付国債 (20年)	1.5	92,000	97,078	2033/3/20
第76回利付国債 (30年)	1.4	85,000	71,345	2052/9/20	第145回利付国債 (20年)	1.7	211,000	226,010	2033/6/20
第77回利付国債 (30年)	1.6	99,000	87,021	2052/12/20	第146回利付国債 (20年)	1.7	131,000	140,283	2033/9/20
第78回利付国債 (30年)	1.4	86,000	71,792	2053/3/20	第147回利付国債 (20年)	1.6	127,000	134,763	2033/12/20
第79回利付国債 (30年)	1.2	55,000	43,474	2053/6/20	第148回利付国債 (20年)	1.5	126,000	132,405	2034/3/20
第80回利付国債 (30年)	1.8	91,000	83,325	2053/9/20	第149回利付国債 (20年)	1.5	125,000	131,165	2034/6/20
第81回利付国債 (30年)	1.6	62,000	54,009	2053/12/20	第150回利付国債 (20年)	1.4	177,000	183,763	2034/9/20
第82回利付国債 (30年)	1.8	88,000	80,289	2054/3/20	第151回利付国債 (20年)	1.2	192,000	195,344	2034/12/20
第83回利付国債 (30年)	2.2	94,000	93,663	2054/6/20	第152回利付国債 (20年)	1.2	195,000	197,915	2035/3/20
第84回利付国債 (30年)	2.1	22,000	21,429	2054/9/20	第153回利付国債 (20年)	1.3	172,000	175,849	2035/6/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	15,000	15,282	2025/12/20	第154回利付国債 (20年)	1.2	161,000	162,638	2035/9/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	60,000	61,065	2025/12/20	第155回利付国債 (20年)	1.0	170,000	167,818	2035/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	20,000	20,452	2026/3/20	第156回利付国債 (20年)	0.4	198,000	182,266	2036/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	20,000	20,506	2026/3/20	第157回利付国債 (20年)	0.2	175,000	156,537	2036/6/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	25,000	25,599	2026/3/20	第158回利付国債 (20年)	0.5	175,000	161,532	2036/9/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	20,000	20,588	2026/6/20	第159回利付国債 (20年)	0.6	162,000	150,690	2036/12/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	20,000	20,556	2026/6/20	第160回利付国債 (20年)	0.7	160,000	150,022	2037/3/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	65,000	67,067	2026/9/20	第161回利付国債 (20年)	0.6	166,000	153,085	2037/6/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	8,000	8,282	2027/3/20	第162回利付国債 (20年)	0.6	176,000	161,627	2037/9/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	8,000	8,301	2027/3/20	第163回利付国債 (20年)	0.6	166,000	151,798	2037/12/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	16,000	16,748	2027/6/20	第164回利付国債 (20年)	0.5	171,000	153,602	2038/3/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	20,000	20,971	2027/12/20	第165回利付国債 (20年)	0.5	141,000	125,994	2038/6/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	20,000	21,106	2028/3/20	第166回利付国債 (20年)	0.7	150,000	137,098	2038/9/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	20,000	21,166	2028/9/20	第167回利付国債 (20年)	0.5	178,000	157,369	2038/12/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	20,000	21,241	2028/9/20	第168回利付国債 (20年)	0.4	170,000	147,395	2039/3/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	8,000	8,490	2028/12/20	第169回利付国債 (20年)	0.3	150,000	127,369	2039/6/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	25,000	26,333	2028/12/20	第170回利付国債 (20年)	0.3	137,000	115,623	2039/9/20

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円		地方債証券	%	千円	千円	
第171回利付国債 (20年)	0.3	135,000	113,238	2039/12/20	令和4年度第2回熊本県公募公債 (5年)	0.11	140,400	138,600	2027/7/29
第172回利付国債 (20年)	0.4	159,000	134,738	2040/3/20	平成24年度第2回福井県公募公債	1.711	100,000	106,370	2032/12/21
第173回利付国債 (20年)	0.4	170,000	143,187	2040/6/20	令和元年度第2回徳島県公募公債	0.09	100,000	96,873	2029/11/28
第174回利付国債 (20年)	0.4	192,000	160,727	2040/9/20	令和元年度第3回岡山県公募公債 (10年)	0.05	100,000	96,485	2030/3/27
第175回利付国債 (20年)	0.5	158,000	133,773	2040/12/20	小 計		1,560,400	1,552,098	
第176回利付国債 (20年)	0.5	158,000	133,059	2041/3/20	特殊債券 (除く金融債)				
第177回利付国債 (20年)	0.4	160,000	131,702	2041/6/20	第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	98,367	2028/5/31
第178回利付国債 (20年)	0.5	157,000	130,859	2041/9/20	小 計		100,000	98,367	
第179回利付国債 (20年)	0.5	163,000	135,110	2041/12/20	普通社債券 (含む投資法人債券)				
第180回利付国債 (20年)	0.8	154,000	133,903	2042/3/20	第503回中部電力株式会社社債	0.584	100,000	100,105	2025/3/25
第181回利付国債 (20年)	0.9	173,000	152,390	2042/6/20	第536回関西電力株式会社社債	0.44	100,000	96,308	2030/12/20
第182回利付国債 (20年)	1.1	130,000	118,021	2042/9/20	第33回道路債券	2.91	100,000	115,773	2034/6/20
第183回利付国債 (20年)	1.4	157,000	149,239	2042/12/20	第23回国際協力銀行債券	2.09	100,000	101,712	2025/12/19
第184回利付国債 (20年)	1.1	71,000	63,967	2043/3/20	第101回都市再生債券	0.935	100,000	100,709	2029/11/20
第185回利付国債 (20年)	1.1	130,000	116,667	2043/6/20	第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	20,141	20,566	2046/11/10
第186回利付国債 (20年)	1.5	132,000	126,424	2043/9/20	第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	22,636	23,092	2046/12/10
第187回利付国債 (20年)	1.3	85,000	78,455	2043/12/20	第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	21,576	22,011	2047/1/10
第188回利付国債 (20年)	1.6	104,000	100,653	2044/3/20	第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	23,140	23,637	2047/4/10
第189回利付国債 (20年)	1.9	106,000	107,457	2044/6/20	第15回株式会社デンソー無担保社債	0.245	100,000	98,749	2027/6/18
第190回利付国債 (20年)	1.8	28,000	27,857	2044/9/20	第21回トヨタ自動車株式会社無担保社債	0.22	100,000	98,707	2027/6/2
小 計		30,539,000	28,786,231		第80回三菱商事株式会社無担保社債	1.485	100,000	102,321	2028/9/8
地方債証券					第32回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.967	100,000	100,131	2029/6/20
第781回東京都公募公債	0.16	100,000	98,274	2028/6/20	第118回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	100,000	98,965	2026/12/18
第26回神奈川県公募公債 (20年)	1.477	20,000	20,754	2034/6/20	第83回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.633	100,000	101,889	2026/12/22
第6回大阪府公募公債 (20年)	1.98	50,000	53,543	2030/9/13	第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.405	100,000	98,345	2028/6/6
平成28年度第2回京都府公募公債 (15年)	0.21	50,000	48,250	2031/4/22	小 計		1,287,493	1,303,022	
第2回兵庫県公募公債 (15年)	1.51	100,000	101,966	2026/12/28	合 計		33,486,893	31,739,719	
第4回静岡県公募公債 (20年)	2.29	100,000	103,989	2027/3/19					
平成31年度第1回愛知県公募公債 (10年)	0.09	100,000	97,343	2029/4/26					
平成29年度第7回広島県公募公債	0.2	100,000	98,584	2028/3/23					
第4回埼玉県公募公債 (10年)	0.995	100,000	99,482	2034/5/19					
平成27年度第3回福岡県公募公債	0.529	200,000	200,218	2025/8/25					
令和4年度第1回長野県公募公債 (10年)	0.299	100,000	96,109	2032/4/23					
第24回群馬県公募公債 (10年)	0.08	100,000	95,258	2031/8/18					

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

(注) 永久債は、実質的な償還日を記載しています。

○投資信託財産の構成

(2024年11月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	31,739,719	99.5
コール・ローン等、その他	151,434	0.5
投資信託財産総額	31,891,153	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年11月11日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	31,891,153,157
コール・ローン等	95,212,423
公社債(評価額)	31,739,719,674
未収利息	51,386,296
前払費用	4,834,764
(B) 負債	21,303,659
未払解約金	21,303,659
(C) 純資産総額(A－B)	31,869,849,498
元本	26,511,945,773
次期繰越損益金	5,357,903,725
(D) 受益権総口数	26,511,945,773口
1万円当たり基準価額(C／D)	12,021円

(注) 当親ファンドの期首元本額は23,312,003,573円、期中追加設定元本額は7,523,090,161円、期中一部解約元本額は4,323,147,961円です。

＜元本の内訳＞

東京海上セレクション・日本債券インデックス	4,939,814,254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＞	4,837,761,695円
円資産インデックスバランス＜円委会ベースック＞(適格専用)	3,006,372,750円
円資産バランスファンド2019-12＜適格機関投資家限定＞	2,203,739,520円
円資産バランスファンド2019-05＜適格機関投資家限定＞	2,171,148,061円
円資産バランスファンド2019-09＜適格機関投資家限定＞	1,720,624,532円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	1,653,366,737円
円資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞	1,369,634,684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＞	1,319,764,350円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	1,285,380,632円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	633,534,181円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	505,677,614円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	366,608,719円
円資産バランスファンド2018-09＜適格機関投資家限定＞	299,312,034円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	185,279,783円
TMA日本債券インデックスV.A＜適格機関投資家限定＞	13,926,227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1万円当たり基準価額が、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11月11日～2024年11月11日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	196,925,235
受取利息	196,931,793
支払利息	△ 6,558
(B) 有価証券売買損益	△ 528,412,335
売買益	45,162,510
売買損	△ 573,574,845
(C) 当期損益金(A+B)	△ 331,487,100
(D) 前期繰越損益金	5,010,067,532
(E) 追加信託差損益金	1,618,205,638
(F) 解約差損益金	△ 938,882,345
(G) 計(C+D+E+F)	5,357,903,725
次期繰越損益金(G)	5,357,903,725

(注) (B)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) (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) (F)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。