

【表紙】

【提出書類】 半期報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成24年10月25日

【計算期間】 第12期中(自平成24年1月26日 至 平成24年7月25日)

【ファンド名】 東京海上・未来設計ファンド1
東京海上・未来設計ファンド2
東京海上・未来設計ファンド3
東京海上・未来設計ファンド4
東京海上・未来設計ファンド5

【発行者名】 東京海上アセットマネジメント投信株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 大場 昭義

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目3番1号

【事務連絡者氏名】 尾崎 正幸

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目3番1号

【電話番号】 03 - 3212 - 8421

【縦覧に供する場所】 該当なし

1【ファンドの運用状況】

以下は平成24年8月31日現在の運用状況です。

また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

東京海上・未来設計ファンド1

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	110,870,679	70.10
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		47,270,728	29.89
合計(純資産総額)		158,141,407	100.00

東京海上・未来設計ファンド2

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	255,685,931	85.14
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		44,625,994	14.85
合計(純資産総額)		300,311,925	100.00

東京海上・未来設計ファンド3

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	786,008,412	95.16
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		39,964,935	4.83
合計(純資産総額)		825,973,347	100.00

東京海上・未来設計ファンド4

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	339,273,666	95.19
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		17,119,128	4.80
合計(純資産総額)		356,392,794	100.00

東京海上・未来設計ファンド5

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	549,691,177	100.20
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		1,119,295	0.20
合計(純資産総額)		548,571,882	100.00

(ご参考：親投資信託の投資状況)

東京海上・未来設計ファンド1、東京海上・未来設計ファンド2、東京海上・未来設計ファンド3、東京海上・未来設計ファンド4、東京海上・未来設計ファンド5が主要投資対象とする親投資信託の投資状況は以下の通りです。

TMA日本株アクティブマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	16,974,206,300	97.32
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		465,814,914	2.67
合計(純資産総額)		17,440,021,214	100.00

TMA日本債券マザーファンド

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	25,187,438,200	74.99
社債券	日本	8,032,017,143	23.91
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		365,356,394	1.08
合計(純資産総額)		33,584,811,737	100.00

TMA外国株式マザーファンド

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	7,009,937,380	56.44
	カナダ	525,443,249	4.23
	ドイツ	304,367,117	2.45
	フランス	409,623,960	3.29
	オーストラリア	394,279,094	3.17
	イギリス	1,185,929,708	9.54
	スイス	653,280,121	5.26
	バミューダ	131,532,070	1.05
	香港	53,790,300	0.43
	シンガポール	225,607,981	1.81
	ベルギー	336,981,678	2.71
	スウェーデン	96,878,880	0.78
	ノルウェー	80,973,984	0.65
	オーストリア	80,381,149	0.64
	デンマーク	105,362,400	0.84
	ポルトガル	79,035,858	0.63
	中華人民共和国	51,911,387	0.41
	ケイマン	25,730,200	0.20
	キュラソー	116,494,632	0.93
小計		11,867,541,148	95.56
投資証券	アメリカ	118,807,044	0.95
	オーストラリア	60,310,950	0.48
	小計	179,117,994	1.44
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		371,924,720	2.99
合計(純資産総額)		12,418,583,862	100.00

TMA外国債券マザーファンド

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	4,472,282,883	41.67
	カナダ	347,289,462	3.23
	ドイツ	1,085,791,771	10.11
	イタリア	1,399,465,722	13.04
	フランス	983,716,161	9.16
	オーストラリア	215,782,952	2.01
	イギリス	845,980,383	7.88
	シンガポール	38,221,800	0.35

	オランダ	174,283,065	1.62
	ベルギー	551,196,683	5.13
	スウェーデン	65,965,838	0.61
	ノルウェー	27,962,064	0.26
	メキシコ	147,268,194	1.37
	ポーランド	79,538,784	0.74
	小計	10,434,745,762	97.23
	コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)	296,200,196	2.76
	合計(純資産総額)	10,730,945,958	100.00

(2)【運用実績】

【純資産の推移】

東京海上・未来設計ファンド1

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
2期	(平成15年 1月27日)	65	65	0.9367	0.9367
3期	(平成16年 1月26日)	41	41	0.9694	0.9694
4期	(平成17年 1月25日)	33	33	0.9780	0.9780
5期	(平成18年 1月25日)	46	46	1.0528	1.0528
6期	(平成19年 1月25日)	64	64	1.0832	1.0832
7期	(平成20年 1月25日)	82	82	1.0562	1.0562
8期	(平成21年 1月26日)	97	97	0.9252	0.9252
9期	(平成22年 1月25日)	125	125	0.9968	0.9968
10期	(平成23年 1月25日)	148	148	1.0116	1.0116
11期	(平成24年 1月25日)	159	159	0.9912	0.9912
	平成23年 8月末日	149	-	0.9841	-
	9月末日	148	-	0.9747	-
	10月末日	151	-	0.9916	-
	11月末日	150	-	0.9766	-
	12月末日	152	-	0.9813	-
	平成24年 1月末日	158	-	0.9886	-
	2月末日	157	-	1.0142	-
	3月末日	157	-	1.0187	-
	4月末日	156	-	1.0136	-
	5月末日	153	-	0.9908	-
	6月末日	156	-	0.9984	-
	7月末日	158	-	0.9992	-
	8月末日	158	-	1.0002	-

東京海上・未来設計ファンド2

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
2期	(平成15年 1月27日)	81	81	0.8897	0.8897
3期	(平成16年 1月26日)	52	52	0.9559	0.9559

4期	(平成17年 1月25日)	58	58	0.9686	0.9686
5期	(平成18年 1月25日)	84	84	1.1090	1.1090
6期	(平成19年 1月25日)	123	123	1.1636	1.1636
7期	(平成20年 1月25日)	141	141	1.0996	1.0996
8期	(平成21年 1月26日)	163	163	0.8594	0.8594
9期	(平成22年 1月25日)	236	236	0.9724	0.9724
10期	(平成23年 1月25日)	281	281	0.9868	0.9868
11期	(平成24年 1月25日)	289	289	0.9410	0.9410
平成23年 8月末日		275	-	0.9332	-
9月末日		270	-	0.9168	-
10月末日		280	-	0.9428	-
11月末日		275	-	0.9193	-
12月末日		278	-	0.9243	-
平成24年 1月末日		287	-	0.9359	-
2月末日		301	-	0.9787	-
3月末日		303	-	0.9862	-
4月末日		301	-	0.9748	-
5月末日		290	-	0.9337	-
6月末日		294	-	0.9475	-
7月末日		297	-	0.9456	-
8月末日		300	-	0.9475	-

東京海上・未来設計ファンド3

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
2期	(平成15年 1月27日)	113	113	0.8223	0.8223
3期	(平成16年 1月26日)	102	102	0.9260	0.9260
4期	(平成17年 1月25日)	119	119	0.9398	0.9398
5期	(平成18年 1月25日)	213	213	1.1520	1.1520
6期	(平成19年 1月25日)	364	364	1.2402	1.2402
7期	(平成20年 1月25日)	488	488	1.1243	1.1243
8期	(平成21年 1月26日)	469	469	0.7701	0.7701
9期	(平成22年 1月25日)	715	715	0.9240	0.9240
10期	(平成23年 1月25日)	832	832	0.9438	0.9438
11期	(平成24年 1月25日)	803	803	0.8695	0.8695
平成23年 8月末日		772	-	0.8583	-
9月末日		752	-	0.8343	-
10月末日		786	-	0.8724	-
11月末日		760	-	0.8386	-
12月末日		767	-	0.8451	-
平成24年 1月末日		794	-	0.8616	-
2月末日		845	-	0.9199	-
3月末日		849	-	0.9305	-

4月末日	838	-	0.9129	-
5月末日	786	-	0.8534	-
6月末日	806	-	0.8721	-
7月末日	818	-	0.8694	-
8月末日	825	-	0.8722	-

東京海上・未来設計ファンド4

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
2期	(平成15年 1月27日)	75	75	0.7453	0.7453
3期	(平成16年 1月26日)	58	58	0.8741	0.8741
4期	(平成17年 1月25日)	74	74	0.8886	0.8886
5期	(平成18年 1月25日)	119	119	1.1632	1.1632
6期	(平成19年 1月25日)	201	201	1.2860	1.2860
7期	(平成20年 1月25日)	228	228	1.1162	1.1162
8期	(平成21年 1月26日)	189	189	0.6516	0.6516
9期	(平成22年 1月25日)	309	309	0.8266	0.8266
10期	(平成23年 1月25日)	363	363	0.8466	0.8466
11期	(平成24年 1月25日)	345	345	0.7502	0.7502
	平成23年 8月末日	324	-	0.7382	-
	9月末日	314	-	0.7095	-
	10月末日	334	-	0.7542	-
	11月末日	318	-	0.7147	-
	12月末日	324	-	0.7214	-
	平成24年 1月末日	340	-	0.7405	-
	2月末日	373	-	0.8069	-
	3月末日	378	-	0.8191	-
	4月末日	367	-	0.7973	-
	5月末日	335	-	0.7265	-
	6月末日	348	-	0.7475	-
	7月末日	353	-	0.7440	-
	8月末日	356	-	0.7472	-

東京海上・未来設計ファンド5

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
2期	(平成15年 1月27日)	137	137	0.6785	0.6785
3期	(平成16年 1月26日)	114	114	0.8345	0.8345
4期	(平成17年 1月25日)	124	124	0.8467	0.8467
5期	(平成18年 1月25日)	175	175	1.1764	1.1764
6期	(平成19年 1月25日)	265	265	1.3290	1.3290
7期	(平成20年 1月25日)	301	301	1.1040	1.1040
8期	(平成21年 1月26日)	257	257	0.5602	0.5602
9期	(平成22年 1月25日)	475	475	0.7473	0.7473

10期	(平成23年 1月25日)	571	571	0.7711	0.7711
11期	(平成24年 1月25日)	536	536	0.6588	0.6588
平成23年 8月末日		496	-	0.6454	-
9月末日		475	-	0.6143	-
10月末日		518	-	0.6629	-
11月末日		488	-	0.6199	-
12月末日		497	-	0.6271	-
平成24年 1月末日		528	-	0.6481	-
2月末日		586	-	0.7181	-
3月末日		596	-	0.7314	-
4月末日		577	-	0.7070	-
5月末日		517	-	0.6296	-
6月末日		538	-	0.6518	-
7月末日		544	-	0.6480	-
8月末日		548	-	0.6511	-

【分配の推移】

東京海上・未来設計ファンド1
該当事項はありません。

東京海上・未来設計ファンド2
該当事項はありません。

東京海上・未来設計ファンド3
該当事項はありません。

東京海上・未来設計ファンド4
該当事項はありません。

東京海上・未来設計ファンド5
該当事項はありません。

【収益率の推移】

東京海上・未来設計ファンド1

期	年月日	収益率(%) (分配付)
2期	(平成15年 1月27日)	4.2
3期	(平成16年 1月26日)	3.5
4期	(平成17年 1月25日)	0.9
5期	(平成18年 1月25日)	7.6
6期	(平成19年 1月25日)	2.9
7期	(平成20年 1月25日)	2.5
8期	(平成21年 1月26日)	12.4
9期	(平成22年 1月25日)	7.7
10期	(平成23年 1月25日)	1.5
11期	(平成24年 1月25日)	2.0
自 平成23年 9月 1日 至 平成24年 8月31日		1.6

東京海上・未来設計ファンド2

期	年月日	収益率(%) (分配付)
2期	(平成15年 1月27日)	7.5
3期	(平成16年 1月26日)	7.4
4期	(平成17年 1月25日)	1.3
5期	(平成18年 1月25日)	14.5
6期	(平成19年 1月25日)	4.9
7期	(平成20年 1月25日)	5.5
8期	(平成21年 1月26日)	21.8
9期	(平成22年 1月25日)	13.1
10期	(平成23年 1月25日)	1.5
11期	(平成24年 1月25日)	4.6
自 平成23年 9月 1日 至 平成24年 8月31日		1.5

東京海上・未来設計ファンド3

期	年月日	収益率(%) (分配付)
2期	(平成15年 1月27日)	12.8
3期	(平成16年 1月26日)	12.6
4期	(平成17年 1月25日)	1.5
5期	(平成18年 1月25日)	22.6
6期	(平成19年 1月25日)	7.7
7期	(平成20年 1月25日)	9.3
8期	(平成21年 1月26日)	31.5
9期	(平成22年 1月25日)	20.0
10期	(平成23年 1月25日)	2.1
11期	(平成24年 1月25日)	7.9
自 平成23年 9月 1日 至 平成24年 8月31日		1.6

東京海上・未来設計ファンド4

期	年月日	収益率(%) (分配付)
2期	(平成15年 1月27日)	18.9
3期	(平成16年 1月26日)	17.3
4期	(平成17年 1月25日)	1.7
5期	(平成18年 1月25日)	30.9
6期	(平成19年 1月25日)	10.6
7期	(平成20年 1月25日)	13.2
8期	(平成21年 1月26日)	41.6
9期	(平成22年 1月25日)	26.9
10期	(平成23年 1月25日)	2.4
11期	(平成24年 1月25日)	11.4
自 平成23年 9月 1日 至 平成24年 8月31日		1.2

東京海上・未来設計ファンド5

期	年月日	収益率(%) (分配付)
---	-----	--------------

2期	(平成15年 1月27日)	24.4
3期	(平成16年 1月26日)	23.0
4期	(平成17年 1月25日)	1.5
5期	(平成18年 1月25日)	38.9
6期	(平成19年 1月25日)	13.0
7期	(平成20年 1月25日)	16.9
8期	(平成21年 1月26日)	49.3
9期	(平成22年 1月25日)	33.4
10期	(平成23年 1月25日)	3.2
11期	(平成24年 1月25日)	14.6
自 平成23年 9月 1日 至 平成24年 8月31日		0.9

2【設定及び解約の実績】

東京海上・未来設計ファンド1

期	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
2期	15,123,879	4,888,340	69,719,759
3期	26,672,202	53,741,555	42,650,406
4期	13,405,492	21,570,596	34,485,302
5期	15,879,897	6,639,895	43,725,304
6期	22,651,263	6,514,385	59,862,182
7期	25,556,793	7,624,816	77,794,159
8期	37,332,571	10,206,491	104,920,239
9期	36,705,403	15,345,850	126,279,792
10期	37,871,070	17,505,959	146,644,903
11期	34,496,983	20,370,872	160,771,014
自 平成23年 9月 1日 至 平成24年 8月31日	31,193,785	24,857,986	158,104,381

東京海上・未来設計ファンド2

期	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
2期	27,050,149	2,905,145	92,036,361
3期	20,059,035	57,281,051	54,814,345
4期	19,212,835	13,383,416	60,643,764
5期	24,424,647	9,107,295	75,961,116
6期	41,334,823	11,347,041	105,948,898
7期	40,629,266	17,717,216	128,860,948
8期	73,073,035	11,173,463	190,760,520
9期	63,854,449	11,356,270	243,258,699
10期	56,319,653	13,954,679	285,623,673
11期	45,395,643	23,285,133	307,734,183
自 平成23年 9月 1日 至 平成24年 8月31日	42,403,558	20,600,017	316,955,370

東京海上・未来設計ファンド3

期	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
---	---------	---------	-----------

2期	48,098,851	2,204,739	138,483,982
3期	49,084,130	77,182,726	110,385,386
4期	38,689,688	21,532,315	127,542,759
5期	83,848,469	26,118,393	185,272,835
6期	163,481,939	54,900,579	293,854,195
7期	187,902,847	47,641,965	434,115,077
8期	205,431,322	29,707,283	609,839,116
9期	192,952,697	27,921,373	774,870,440
10期	161,275,362	54,304,533	881,841,269
11期	144,653,233	102,609,800	923,884,702
自平成23年9月1日 至平成24年8月31日	134,203,533	86,961,859	947,048,734

東京海上・未来設計ファンド4

期	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
2期	22,893,425	1,577,964	100,755,974
3期	27,025,010	60,317,598	67,463,386
4期	33,040,141	16,750,291	83,753,236
5期	47,662,355	28,434,523	102,981,068
6期	70,263,238	16,353,009	156,891,297
7期	77,064,597	29,066,650	204,889,244
8期	100,935,972	14,469,791	291,355,425
9期	105,614,259	22,073,427	374,896,257
10期	84,747,601	30,570,372	429,073,486
11期	72,681,839	41,619,006	460,136,319
自平成23年9月1日 至平成24年8月31日	69,941,492	33,053,958	476,959,074

東京海上・未来設計ファンド5

期	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
2期	55,073,031	14,333,559	202,516,368
3期	37,252,334	102,921,285	136,847,417
4期	42,597,943	32,743,746	146,701,614
5期	52,900,637	50,068,441	149,533,810
6期	97,124,659	46,546,586	200,111,883
7期	131,225,107	57,985,843	273,351,147
8期	218,839,977	32,880,910	459,310,214
9期	221,172,635	43,904,096	636,578,753
10期	173,566,000	69,302,560	740,842,193
11期	149,544,019	76,510,744	813,875,468
自平成23年9月1日 至平成24年8月31日	138,393,532	65,715,984	842,570,290

3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規

則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、当中間計算期間(平成24年1月26日から平成24年7月25日まで)の中間財務諸表について、あらた監査法人により中間監査を受けております。

中間財務諸表

【東京海上・未来設計ファンド1】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前期 平成24年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	47,495,330	47,688,986
親投資信託受益証券	112,047,409	109,899,781
未収入金	444,845	491,674
未収利息	86	86
流動資産合計	159,987,670	158,080,527
資産合計	159,987,670	158,080,527
負債の部		
流動負債		
未払解約金	20,170	70,294
未払受託者報酬	55,955	57,477
未払委託者報酬	527,491	541,867
その他未払費用	31,882	32,757
流動負債合計	635,498	702,395
負債合計	635,498	702,395
純資産の部		
元本等		
元本	₁ 160,771,014	₁ 158,573,321
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	₂ 1,418,842	₂ 1,195,189
(分配準備積立金)	4,763,639	4,271,702
元本等合計	159,352,172	157,378,132
純資産合計	159,352,172	157,378,132
負債純資産合計	159,987,670	158,080,527

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前中間計算期間 自平成23年1月26日 至平成23年7月25日	当中間計算期間 自平成24年1月26日 至平成24年7月25日
営業収益		
受取利息	14,927	15,655
有価証券売買等損益	78,200	933,982
営業収益合計	93,127	949,637
営業費用		
受託者報酬	54,388	57,477
委託者報酬	512,705	541,867
その他費用	30,994	32,757
営業費用合計	598,087	632,101
営業利益又は営業損失()	504,960	317,536
経常利益又は経常損失()	504,960	317,536
中間純利益又は中間純損失()	504,960	317,536
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	23,246	297,719
期首剰余金又は期首欠損金()	1,700,099	1,418,842
剰余金増加額又は欠損金減少額	189,912	203,836
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	144,380
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	189,912	59,456
剰余金減少額又は欠損金増加額	133,420	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	133,420	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	1,274,877	1,195,189

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に 基づいて評価しております。

(追加情報)

当中間計算期間 自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号平成21年12月4日）を適用しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前期 平成24年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	146,644,903円	160,771,014円
期中追加設定元本額	34,496,983円	14,919,750円
期中一部解約元本額	20,370,872円	17,117,443円
2. 1 中間計算期間末日における受益権 の総数	160,771,014口	158,573,321口
3. 2 元本の欠損	純資産額が元本総額を下 回っており、その差額は 1,418,842円であります。	純資産額が元本総額を下 回っており、その差額は 1,195,189円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 平成23年 1月26日 至 平成23年 7月25日	当中間計算期間 自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
該当事項はありません。	同 左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 平成24年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価 及びこれらの差額	時価で計上しているため、その 差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価 証券及びデリバティブ取引 に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項 に関する注記）に記載して おります。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左

	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(1口当たり情報に関する注記)

前期 平成24年 1月25日現在		当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	0.9912円	1口当たり純資産額	0.9925円
(1万口当たり純資産額	9,912円)	(1万口当たり純資産額	9,925円)

【東京海上・未来設計ファンド2】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前期 平成24年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	42,999,343	45,076,936
親投資信託受益証券	246,955,479	249,586,859
未収入金	2,084,693	1,426,745
未収利息	78	82
流動資産合計	292,039,593	296,090,622
資産合計	292,039,593	296,090,622
負債の部		
流動負債		
未払解約金	869,531	-
未払受託者報酬	102,614	108,804
未払委託者報酬	1,421,904	1,507,641
その他未払費用	58,540	62,081
流動負債合計	2,452,589	1,678,526
負債合計	2,452,589	1,678,526
純資産の部		
元本等		
元本	1 307,734,183	1 315,583,101
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2 18,147,179	2 21,171,005
(分配準備積立金)	15,267,724	14,674,510
元本等合計	289,587,004	294,412,096
純資産合計	289,587,004	294,412,096
負債純資産合計	292,039,593	296,090,622

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自平成23年1月26日 至平成23年7月25日	当中間計算期間 自平成24年1月26日 至平成24年7月25日
営業収益		
受取利息	14,271	14,818
有価証券売買等損益	1,930,623	986,858
営業収益合計	1,916,352	972,040
営業費用		
受託者報酬	103,826	108,804
委託者報酬	1,438,599	1,507,641
その他費用	59,235	62,081
営業費用合計	1,601,660	1,678,526
営業利益又は営業損失（ ）	3,518,012	2,650,566
経常利益又は経常損失（ ）	3,518,012	2,650,566
中間純利益又は中間純損失（ ）	3,518,012	2,650,566
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	102,530	232,708
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,759,521	18,147,179
剰余金増加額又は欠損金減少額	180,220	720,369
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	180,220	720,369
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	400,944	860,921
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	400,944	860,921
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,395,727	21,171,005

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に 基づいて評価しております。

(追加情報)

当中間計算期間 自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号平成21年12月4日）を適用しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前期 平成24年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	285,623,673円	307,734,183円
期中追加設定元本額	45,395,643円	20,174,586円
期中一部解約元本額	23,285,133円	12,325,668円
2. 1 中間計算期間末日における受益権 の総数	307,734,183口	315,583,101口
3. 2 元本の欠損	純資産額が元本総額を下 回っており、その差額は 18,147,179円であります。	純資産額が元本総額を下 回っており、その差額は 21,171,005円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 平成23年 1月26日 至 平成23年 7月25日	当中間計算期間 自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
該当事項はありません。	同 左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 平成24年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価 及びこれらの差額	時価で計上しているため、その 差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価 証券及びデリバティブ取引 に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項 に関する注記）に記載して おります。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左

	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(1口当たり情報に関する注記)

前期 平成24年 1月25日現在		当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	0.9410円	1口当たり純資産額	0.9329円
(1万口当たり純資産額	9,410円)	(1万口当たり純資産額	9,329円)

【東京海上・未来設計ファンド3】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前期 平成24年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	39,338,744	41,362,490
親投資信託受益証券	764,304,830	760,431,354
未収入金	6,513,370	5,695,629
未収利息	71	75
流動資産合計	810,157,015	807,489,548
資産合計	810,157,015	807,489,548
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,188,347	30,005
未払受託者報酬	326,214	343,341
未払委託者報酬	5,178,613	5,450,472
その他未払費用	163,009	171,586
流動負債合計	6,856,183	5,995,404
負債合計	6,856,183	5,995,404
純資産の部		
元本等		
元本	1 923,884,702	1 942,355,145
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2 120,583,870	2 140,861,001
(分配準備積立金)	51,855,942	49,474,263
元本等合計	803,300,832	801,494,144
純資産合計	803,300,832	801,494,144
負債純資産合計	810,157,015	807,489,548

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前中間計算期間 自平成23年1月26日 至平成23年7月25日	当中間計算期間 自平成24年1月26日 至平成24年7月25日
営業収益		
受取利息	13,792	13,638
有価証券売買等損益	13,929,874	11,694,249
営業収益合計	13,916,082	11,680,611
営業費用		
受託者報酬	345,404	343,341
委託者報酬	5,483,304	5,450,472
その他費用	172,618	171,586
営業費用合計	6,001,326	5,965,399
営業利益又は営業損失()	19,917,408	17,646,010
経常利益又は経常損失()	19,917,408	17,646,010
中間純利益又は中間純損失()	19,917,408	17,646,010
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	957,604	1,360,308
期首剰余金又は期首欠損金()	49,551,289	120,583,870
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,982,150	5,631,671
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,982,150	5,631,671
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,654,478	6,902,484
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,654,478	6,902,484
中間剰余金又は中間欠損金()	70,183,421	140,861,001

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に 基づいて評価しております。

(追加情報)

当中間計算期間 自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号平成21年12月4日）を適用しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前期 平成24年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	881,841,269円	923,884,702円
期中追加設定元本額	144,653,233円	61,795,608円
期中一部解約元本額	102,609,800円	43,325,165円
2. 1 中間計算期間末日における受益権 の総数	923,884,702口	942,355,145口
3. 2 元本の欠損	純資産額が元本総額を下 回っており、その差額は 120,583,870円でありま す。	純資産額が元本総額を下 回っており、その差額は 140,861,001円でありま す。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 平成23年 1月26日 至 平成23年 7月25日	当中間計算期間 自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
該当事項はありません。	同 左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 平成24年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価 及びこれらの差額	時価で計上しているため、その 差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価 証券及びデリバティブ取引 に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事 項に関する注記）に記載し ております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左

	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(1口当たり情報に関する注記)

前期 平成24年 1月25日現在		当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	0.8695円	1口当たり純資産額	0.8505円
(1万口当たり純資産額	8,695円)	(1万口当たり純資産額	8,505円)

【東京海上・未来設計ファンド4】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前期 平成24年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,726,428	17,896,721
親投資信託受益証券	328,601,046	324,567,583
未収入金	2,800,362	3,328,040
未収利息	30	32
流動資産合計	348,127,866	345,792,376
資産合計	348,127,866	345,792,376
負債の部		
流動負債		
未払解約金	99,999	399,999
未払受託者報酬	137,249	149,557
未払委託者報酬	2,641,975	2,878,957
その他未払費用	68,532	74,692
流動負債合計	2,947,755	3,503,205
負債合計	2,947,755	3,503,205
純資産の部		
元本等		
元本	1 460,136,319	1 474,578,454
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2 114,956,208	2 132,289,283
(分配準備積立金)	30,637,547	29,433,194
元本等合計	345,180,111	342,289,171
純資産合計	345,180,111	342,289,171
負債純資産合計	348,127,866	345,792,376

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自平成23年1月26日 至平成23年7月25日	当中間計算期間 自平成24年1月26日 至平成24年7月25日
営業収益		
受取利息	5,901	5,908
有価証券売買等損益	10,257,256	10,477,416
営業収益合計	10,251,355	10,471,508
営業費用		
受託者報酬	149,822	149,557
委託者報酬	2,883,950	2,878,957
その他費用	74,810	74,692
営業費用合計	3,108,582	3,103,206
営業利益又は営業損失()	13,359,937	13,574,714
経常利益又は経常損失()	13,359,937	13,574,714
中間純利益又は中間純損失()	13,359,937	13,574,714
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	610,716	684,339
期首剰余金又は期首欠損金()	65,815,386	114,956,208
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,174,640	4,626,744
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,174,640	4,626,744
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,693,024	7,700,766
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,693,024	7,700,766
中間剰余金又は中間欠損金()	80,082,991	132,289,283

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に 基づいて評価しております。

(追加情報)

当中間計算期間 自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号平成21年12月4日）を適用しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前期 平成24年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	429,073,486円	460,136,319円
期中追加設定元本額	72,681,839円	33,024,893円
期中一部解約元本額	41,619,006円	18,582,758円
2. 1 中間計算期間末日における受益権 の総数	460,136,319口	474,578,454口
3. 2 元本の欠損	純資産額が元本総額を下 回っており、その差額は 114,956,208円でありま す。	純資産額が元本総額を下 回っており、その差額は 132,289,283円でありま す。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 平成23年 1月26日 至 平成23年 7月25日	当中間計算期間 自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
該当事項はありません。	同 左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 平成24年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価 及びこれらの差額	時価で計上しているため、その 差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価 証券及びデリバティブ取引 に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事 項に関する注記）に記載し ております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左

	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(1口当たり情報に関する注記)

前期 平成24年 1月25日現在		当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	0.7502円	1口当たり純資産額	0.7212円
(1万口当たり純資産額	7,502円)	(1万口当たり純資産額	7,212円)

【東京海上・未来設計ファンド5】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前期 平成24年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	536,144,249	524,957,857
未収入金	5,020,808	5,823,988
流動資産合計	541,165,057	530,781,845
資産合計	541,165,057	530,781,845
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	258,898
未払受託者報酬	210,308	233,101
未払委託者報酬	4,705,448	5,215,529
その他未払費用	105,052	116,460
流動負債合計	5,020,808	5,823,988
負債合計	5,020,808	5,823,988
純資産の部		
元本等		
元本	1 813,875,468	1 842,338,845
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2 277,731,219	2 317,380,988
(分配準備積立金)	41,414,956	39,661,262
元本等合計	536,144,249	524,957,857
純資産合計	536,144,249	524,957,857
負債純資産合計	541,165,057	530,781,845

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自平成23年1月26日 至平成23年7月25日	当中間計算期間 自平成24年1月26日 至平成24年7月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	21,661,719	24,072,332
営業収益合計	21,661,719	24,072,332
営業費用		
受託者報酬	233,559	233,101
委託者報酬	5,225,806	5,215,529
その他費用	116,681	116,460
営業費用合計	5,576,046	5,565,090
営業利益又は営業損失()	27,237,765	29,637,422
経常利益又は経常損失()	27,237,765	29,637,422
中間純利益又は中間純損失()	27,237,765	29,637,422
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	1,082,446	1,166,861
期首剰余金又は期首欠損金()	169,604,183	277,731,219
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,191,129	12,092,144
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,191,129	12,092,144
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	17,070,046	20,937,630
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	17,070,046	20,937,630
中間剰余金又は中間欠損金()	201,638,419	317,380,988

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に 基づいて評価しております。

(追加情報)

当中間計算期間 自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号平成21年12月4日)および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号平成21年12月4日)を適用しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前期 平成24年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	740,842,193円	813,875,468円
期中追加設定元本額	149,544,019円	63,970,862円
期中一部解約元本額	76,510,744円	35,507,485円
2. 1 中間計算期間末日における受益権 の総数	813,875,468口	842,338,845口
3. 2 元本の欠損	純資産額が元本総額を下 回っており、その差額は 277,731,219円でありま す。	純資産額が元本総額を下 回っており、その差額は 317,380,988円でありま す。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 平成23年 1月26日 至 平成23年 7月25日	当中間計算期間 自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
該当事項はありません。	同 左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 平成24年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価 及びこれらの差額	時価で計上しているため、その 差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価 証券及びデリバティブ取引 に関する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事 項に関する注記)に記載し ております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左

	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(1口当たり情報に関する注記)

前期 平成24年 1月25日現在		当中間計算期間末 平成24年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	0.6588円	1口当たり純資産額	0.6232円
(1万口当たり純資産額	6,588円)	(1万口当たり純資産額	6,232円)

(ご参考)

東京海上・未来設計ファンド1、東京海上・未来設計ファンド2、東京海上・未来設計ファンド3、東京海上・未来設計ファンド4、東京海上・未来設計ファンド5は、「TMA日本株アクティブマザーファンド」、「TMA日本債券マザーファンド」、「TMA外国株式マザーファンド」、「TMA外国債券マザーファンド」を主要な投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同ファンドの受益証券です。なお、同ファンドの状況は次のとおりです。

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

「TMA日本株アクティブマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		平成24年 1月25日現在	平成24年 7月25日現在
区 分	注記 番号	金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		395,418,882	271,283,628
株式		17,050,899,600	16,205,464,350
未収入金		295,460,088	
未収配当金		10,643,400	17,273,600
未収利息		722	494
流動資産合計		17,752,422,692	16,494,022,072
資産合計		17,752,422,692	16,494,022,072
負債の部			
流動負債			
未払金		313,095,012	

未払解約金		34,663,970	36,886,235
流動負債合計		347,758,982	36,886,235
負債合計		347,758,982	36,886,235
純資産の部			
元本等			
元本	1	33,174,122,481	34,106,940,751
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	15,769,458,771	17,649,804,914
元本等合計		17,404,663,710	16,457,135,837
純資産合計		17,404,663,710	16,457,135,837
負債純資産合計		17,752,422,692	16,494,022,072

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

(追加情報)

自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
本書における開示対象ファンドの当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成24年 1月25日現在	平成24年 7月25日現在
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	28,778,272,725円	33,174,122,481円
同期中における追加設定元本額	9,633,111,019円	4,859,088,650円
同期中における一部解約元本額	5,237,261,263円	3,926,270,380円
同中間期末における元本額	33,174,122,481円	34,106,940,751円
元本の内訳*		
日本株アクティブファンド<適格機関投資家限定>	640,070,223円	661,010,332円
東京海上日本株アクティブファンド	1,683,465,484円	1,683,614,262円
東京海上・未来設計ファンド1	31,587,125円	30,291,291円
東京海上・未来設計ファンド2	113,903,064円	114,373,602円
東京海上・未来設計ファンド3	468,875,782円	471,549,842円
東京海上・未来設計ファンド4	265,764,391円	271,307,977円
東京海上・未来設計ファンド5	510,677,161円	524,773,404円
東京海上セレクション・日本株式	14,460,793,592円	15,178,050,039円

東京海上セレクション・バランス30	1,557,672,456円	1,591,187,232円
東京海上セレクション・バランス50	5,938,216,147円	6,048,298,229円
東京海上セレクション・バランス70	4,572,216,874円	4,738,235,562円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	2,472,386,697円	2,355,386,060円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	305,769,636円	289,499,725円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	152,723,849円	149,363,194円
計	33,174,122,481円	34,106,940,751円
2. 1 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	33,174,122,481口	34,106,940,751口
3. 2 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は15,769,458,771円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は17,649,804,914円であります。

(注) *は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成24年 1月25日現在	平成24年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(1口当たり情報に関する注記)

平成24年 1月25日現在		平成24年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	0.5246円	1口当たり純資産額	0.4825円
(1万口当たり純資産額)	5,246円)	(1万口当たり純資産額)	4,825円)

「TMA日本債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		平成24年 1月25日現在	平成24年 7月25日現在
区 分	注記 番号	金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		178,719,900	246,727,461
国債証券		28,766,150,400	25,189,070,800
社債券		7,337,462,624	8,157,285,894
未収入金		1,001,217,378	361,988,125
未収利息		88,293,397	97,277,491
前払費用		10,459,008	15,751,307
流動資産合計		37,382,302,707	34,068,101,078
資産合計		37,382,302,707	34,068,101,078
負債の部			
流動負債			
未払金		1,006,984,600	457,674,500
未払解約金		23,965,404	16,934,680
流動負債合計		1,030,950,004	474,609,180
負債合計		1,030,950,004	474,609,180
純資産の部			
元本等			
元本	1	29,986,546,739	27,057,607,823
剰余金			
剰余金又は欠損金()		6,364,805,964	6,535,884,075
元本等合計		36,351,352,703	33,593,491,898
純資産合計		36,351,352,703	33,593,491,898
負債純資産合計		37,382,302,707	34,068,101,078

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。

(追加情報)

自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日

本書における開示対象ファンドの当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号平成21年12月4日)および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号平成21年12月4日)を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成24年 1月25日現在	平成24年 7月25日現在
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	32,913,416,466円	29,986,546,739円
同期中における追加設定元本額	6,939,795,697円	2,890,283,771円
同期中における一部解約元本額	9,866,665,424円	5,819,222,687円
同中間期末における元本額	29,986,546,739円	27,057,607,823円
元本の内訳*		
東京海上・国内債券ファンド	1,627,290,376円	1,213,363,484円
東京海上・未来設計ファンド1	58,474,784円	57,816,284円
東京海上・未来設計ファンド2	93,685,409円	97,044,387円
東京海上・未来設計ファンド3	192,816,237円	200,015,572円
東京海上・未来設計ファンド4	27,325,172円	28,773,967円
東京海上セレクション・バランス30	1,505,943,514円	1,585,163,122円
東京海上セレクション・バランス50	1,884,563,523円	1,978,198,750円
東京海上セレクション・バランス70	376,206,934円	401,727,497円
東京海上セレクション・日本債券	6,592,581,492円	6,979,337,498円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	6,102,662,523円	5,991,752,919円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	251,561,078円	245,476,985円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	41,886,995円	42,217,575円
東京海上日本債ファンドM (FOFs用)(適格機関投資家専用)	11,231,548,702円	8,236,719,783円
計	29,986,546,739円	27,057,607,823円
2. 1 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	29,986,546,739口	27,057,607,823口

(注)*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成24年 1月25日現在	平成24年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左

	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(1口当たり情報に関する注記)

平成24年 1月25日現在		平成24年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.2123円	1口当たり純資産額	1.2416円
(1万口当たり純資産額	12,123円)	(1万口当たり純資産額	12,416円)

「TMA外国株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		平成24年 1月25日現在	平成24年 7月25日現在
区 分	注記 番号	金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		60,869,657	15,684,954
コール・ローン		260,452,407	268,971,227
株式		11,113,025,693	11,291,802,774
投資証券		130,675,448	175,137,820
未収入金		661,759	
未収配当金		8,080,644	11,723,193
未収利息		475	490
流動資産合計		11,573,766,083	11,763,320,458
資産合計		11,573,766,083	11,763,320,458
負債の部			
流動負債			
未払解約金		13,667,999	12,086,938
流動負債合計		13,667,999	12,086,938
負債合計		13,667,999	12,086,938
純資産の部			
元本等			
元本	1	13,223,639,965	13,582,728,424

剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	1,663,541,881	1,831,494,904
元本等合計		11,560,098,084	11,751,233,520
純資産合計		11,560,098,084	11,751,233,520
負債純資産合計		11,573,766,083	11,763,320,458

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客先物売相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(追加情報)

自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
本書における開示対象ファンドの当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成24年 1月25日現在	平成24年 7月25日現在
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	12,675,073,499円	13,223,639,965円
同期中における追加設定元本額	4,387,530,153円	1,531,732,821円
同期中における一部解約元本額	3,838,963,687円	1,172,644,362円
同中間期末における元本額	13,223,639,965円	13,582,728,424円

元本の内訳*		
東京海上・外国株式ファンド	118,379,804円	111,714,106円
東京海上・未来設計ファンド1	19,073,607円	18,161,853円
東京海上・未来設計ファンド2	51,593,856円	51,444,197円
東京海上・未来設計ファンド3	235,997,690円	235,528,985円
東京海上・未来設計ファンド4	140,443,746円	142,248,886円
東京海上・未来設計ファンド5	277,582,991円	282,921,688円
東京海上セレクション・外国株式	7,497,601,867円	7,897,617,817円
東京海上セレクション・バランス30	470,470,307円	477,153,938円
東京海上セレクション・バランス50	1,537,314,221円	1,554,176,392円
東京海上セレクション・バランス70	1,104,747,471円	1,135,521,550円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	1,493,487,195円	1,413,067,106円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	184,693,436円	173,636,875円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	92,253,774円	89,535,031円
計	13,223,639,965円	13,582,728,424円
2. 1 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	13,223,639,965口	13,582,728,424口
3. 2 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,663,541,881円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,831,494,904円であります。

(注) *は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成24年 1月25日現在	平成24年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
----------------------------	--	----

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(平成24年1月25日現在)

該当事項はありません。

(平成24年7月25日現在)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

平成24年 1月25日現在		平成24年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	0.8742円	1口当たり純資産額	0.8652円
(1万口当たり純資産額	8,742円)	(1万口当たり純資産額	8,652円)

「TMA外国債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	平成24年 1月25日現在	平成24年 7月25日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		128,863,188	44,000,590
コール・ローン		111,314,571	112,564,413
国債証券		9,628,610,707	10,038,837,704
未収入金			231,133,494
未収利息		98,339,252	97,575,932
前払費用		13,677,270	17,739,628
流動資産合計		9,980,804,988	10,541,851,761
資産合計		9,980,804,988	10,541,851,761
負債の部			
流動負債			
未払金		107,844,578	235,779,056
未払解約金		9,800,459	4,552,605
流動負債合計		117,645,037	240,331,661

負債合計		117,645,037	240,331,661
純資産の部			
元本等			
元本	1	7,203,832,339	7,449,766,116
剰余金			
剰余金又は欠損金()		2,659,327,612	2,851,753,984
元本等合計		9,863,159,951	10,301,520,100
純資産合計		9,863,159,951	10,301,520,100
負債純資産合計		9,980,804,988	10,541,851,761

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(追加情報)

自 平成24年 1月26日 至 平成24年 7月25日
<p>本書における開示対象ファンドの当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号平成21年12月4日)および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号平成21年12月4日)を適用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成24年 1月25日現在	平成24年 7月25日現在
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	7,507,032,392円	7,203,832,339円

同期中における追加設定元本額	1,608,142,850円	639,808,143円
同期中における一部解約元本額	1,911,342,903円	393,874,366円
同中間期末における元本額	7,203,832,339円	7,449,766,116円
元本の内訳*		
東京海上・外国債券ファンド	89,014,281円	89,309,710円
東京海上・未来設計ファンド1	5,779,782円	5,630,533円
東京海上・未来設計ファンド2	20,832,430円	21,262,488円
東京海上・未来設計ファンド3	57,166,441円	58,424,606円
東京海上・未来設計ファンド4	24,305,302円	25,211,160円
東京海上・未来設計ファンド5	18,682,414円	19,504,517円
東京海上セレクション・外国債券	3,845,760,407円	3,994,939,190円
東京海上セレクション・バランス30	569,780,889円	591,325,635円
東京海上セレクション・バランス50	1,241,216,437円	1,284,381,777円
東京海上セレクション・バランス70	568,655,712円	598,513,810円
TMA外国債券アクティブファンド <適格機関投資家限定>	762,638,244円	761,262,690円
計	7,203,832,339円	7,449,766,116円
2. 1 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	7,203,832,339口	7,449,766,116口

(注)*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成24年 1月25日現在	平成24年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
----------------------------	--	----

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(平成24年1月25日現在)

該当事項はありません。

(平成24年7月25日現在)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

平成24年 1月25日現在		平成24年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3692円	1口当たり純資産額	1.3828円
(1万口当たり純資産額	13,692円)	(1万口当たり純資産額	13,828円)

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

平成24年8月末日現在、資本金の額は20億円です。なお、会社の発行可能株式総数は160,000株であり、38,300株を発行済みです。

(2)【事業の内容及び営業の状況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成24年8月31日現在、委託会社が運用を行っている証券投資信託（親投資信託を除きます。）は次の通りです。

	本数	純資産総額（百万円）
追加型公社債投資信託	1	5,897
追加型株式投資信託	115	1,594,123
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	12	66,878
合計	128	1,666,899

(3)【その他】

提出日現在、訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼした事実、及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

5【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。）並びに同規則第2条により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第27期事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

（単位：千円）

	第26期 （平成23年3月31日現在）	第27期 （平成24年3月31日現在）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	5,046,015	5,761,145
前払費用	125,909	137,793
未収委託者報酬	1,451,584	1,436,947
未収収益	1,921,269	1,777,274
繰延税金資産	205,707	190,994
その他の流動資産	63,354	21,473
流動資産計	8,813,842	9,325,628
固定資産		
有形固定資産	* 1 339,073	* 1 259,429
建物	180,320	153,031
器具備品	158,752	106,397
無形固定資産	3,144	3,144
電話加入権	3,144	3,144
投資その他の資産	1,013,432	929,396
投資有価証券	39,419	16,664
関係会社株式	254,342	254,342
その他の関係会社有価証券	30,000	31,200
長期前払費用	192,205	143,968
敷金	368,720	361,849
繰延税金資産	128,745	121,371
固定資産計	1,355,650	1,191,969
資産合計	10,169,492	10,517,598
負債の部		
流動負債		
預り金	25,297	28,305
未払金	* 2 1,113,561	* 2 1,318,980
未払手数料	387,066	388,412
その他未払金	726,495	930,567
未払費用	322,235	52,898
未払消費税等	100,812	67,999
未払法人税等	616,000	544,000
前受収益	513,554	415,827
賞与引当金	202,702	207,304
その他の流動負債	1,250	787
流動負債計	2,895,413	2,636,103
固定負債		
退職給付引当金	110,188	115,077
役員退職慰労引当金	18,170	25,260
固定負債計	128,358	140,337
負債合計	3,023,771	2,776,440
純資産の部		
株主資本		
資本金	7,145,769	7,741,052
利益剰余金	2,000,000	2,000,000
	5,145,769	5,741,052

利益準備金	334,429	388,426
その他利益剰余金	4,811,339	5,352,625
繰越利益剰余金	4,811,339	5,352,625
評価・換算差額等	47	105
その他有価証券評価差額金	47	105
純資産合計	7,145,721	7,741,157
負債・純資産合計	10,169,492	10,517,598

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	4,632,692	5,441,098
運用受託報酬	5,850,581	6,132,962
投資助言報酬	12,636	24,836
その他営業収益	1,992	1,992
営業収益計	10,497,903	11,600,891
営業費用		
支払手数料	1,391,029	1,957,922
広告宣伝費	174,374	117,675
公告費	-	2,281
調査費	3,295,822	3,263,965
調査費	1,319,199	1,195,887
委託調査費	* 1 1,976,623	* 1 2,068,077
委託計算費	79,398	85,593
営業雑経費	128,802	127,614
通信費	34,541	31,372
印刷費	68,848	69,710
協会費	6,488	14,644
諸会費	10,375	4,391
図書費	8,548	7,495
営業費用計	5,069,426	5,555,052
一般管理費		
給料	2,215,928	2,399,236
役員報酬	66,840	71,115
給料・手当	* 1 1,639,732	* 1 1,730,916
賞与	509,356	597,205
交際費	13,554	10,606
旅費交通費	110,556	100,354
租税公課	40,194	41,500
不動産賃借料	383,281	343,381
役員退職慰労引当金繰入	5,570	7,090
退職給付費用	77,059	72,098
賞与引当金繰入	202,702	207,304
固定資産減価償却費	113,902	99,879
法定福利費	360,240	381,465
福利厚生費	9,681	9,181
諸経費	395,518	377,049
一般管理費計	3,928,188	4,049,148
営業利益	1,500,287	1,996,689
営業外収益		
受取配当金	* 1 117,681	* 1 115,821
受取利息	2,129	1,091
雑益	19,676	1,064
営業外収益計	139,487	117,976
営業外費用		

雑損	25,194	32,361
営業外費用計	25,194	32,361
経常利益	1,614,580	2,082,305
特別損失		
器具備品除却損	1,551	71
投資有価証券売却損	6	
資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額	7,443	
特別損失計	9,000	71
税引前当期純利益	1,605,579	2,082,233
法人税、住民税及び事業税	792,702	924,989
法人税等還付税額	24,710	
法人税等調整額	89,175	21,996
法人税等合計	678,816	946,985
当期純利益	926,763	1,135,247

(3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	2,000,000	2,000,000
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	2,000,000	2,000,000
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	287,619	334,429
当期変動額		
剰余金の配当	46,810	53,996
当期変動額合計	46,810	53,996
当期末残高	334,429	388,426
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
当期首残高	4,399,488	4,811,339
当期変動額		
剰余金の配当	514,912	593,960
当期純利益	926,763	1,135,247
当期変動額合計	411,850	541,286
当期末残高	4,811,339	5,352,625
利益剰余金合計		
当期首残高	4,687,107	5,145,769
当期変動額		
剰余金の配当	468,102	539,964
当期純利益	926,763	1,135,247
当期変動額合計	458,661	595,282
当期末残高	5,145,769	5,741,052
株主資本合計		
当期首残高	6,687,107	7,145,769
当期変動額		
剰余金の配当	468,102	539,964

当期純利益	926,763	1,135,247
当期変動額合計	458,661	595,282
当期末残高	7,145,769	7,741,052
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	73	47
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	121	153
当期変動額合計	121	153
当期末残高	47	105
評価・換算差額等合計		
当期首残高	73	47
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	121	153
当期変動額合計	121	153
当期末残高	47	105
純資産合計		
当期首残高	6,687,181	7,145,721
当期変動額		
剰余金の配当	468,102	539,964
当期純利益	926,763	1,135,247
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	121	153
当期変動額合計	458,540	595,436
当期末残高	7,145,721	7,741,157

重要な会計方針

第27期
自 平成23年4月1日
至 平成24年3月31日

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券

移動平均法による原価法

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)

時価を把握することが極めて困難と認められるもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法

ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)については定額法、少額固定資産(取得価格が10万円以上20万円未満の資産)については3年間で均等償却する方法を採用しております。

(2) 長期前払費用

定額法

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当期負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務に基づき計上しております。

(3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

4. 消費税等の会計処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

追加情報

第27期

自 平成23年4月1日

至 平成24年3月31日

(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用)

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

第26期 平成23年3月31日現在	第27期 平成24年3月31日現在
* 1. 有形固定資産の減価償却累計額は次の通りであります。	* 1. 有形固定資産の減価償却累計額は次の通りであります。
建物 67,520千円	建物 95,026千円
器具備品 337,637千円	器具備品 401,705千円
* 2. 関係会社に対する主な資産・負債	* 2. 関係会社に対する主な資産・負債
区分掲記した以外で各科目に含まれている関係会社に対するものは次の通りであります。	区分掲記した以外で各科目に含まれている関係会社に対するものは次の通りであります。
未払金 541,759千円	未払金 576,853千円
(うち支配株主に対するもの 107,000千円)	(うち支配株主に対するもの 124,843千円)
(うち子会社に対するもの 122,692千円)	(うち子会社に対するもの 123,032千円)
(うち関連会社に対するもの 312,065千円)	(うち関連会社に対するもの 328,978千円)

(損益計算書関係)

第26期 自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日	第27期 自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日
* 1. 関係会社との主な取引高は次の通りであります。	* 1. 関係会社との主な取引高は次の通りであります。
給与・手当 462,103千円	給与・手当 473,719千円
委託調査費 1,279,757千円	委託調査費 1,576,497千円
受取配当金 117,681千円	受取配当金 115,821千円

(株主資本等変動計算書関係)

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位:株)

株式の種類	平成22年4月1日 現在	増加	減少	平成23年3月31日 現在
普通株式	38,300	-	-	38,300

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成22年6月29日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	468,102千円
(ロ) 1株当たり配当額	12,222円
(ハ) 基準日	平成22年3月31日
(ニ) 効力発生日	平成22年6月30日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成23年6月29日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	509,964千円
(ロ) 配当の原資	利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	13,315円
(ニ) 基準日	平成23年3月31日
(ホ) 効力発生日	平成23年6月30日

第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位:株)

株式の種類	平成23年4月1日 現在	増加	減少	平成24年3月31日 現在
普通株式	38,300	-	-	38,300

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成23年6月29日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	509,964千円
(ロ) 1株当たり配当額	13,315円
(ハ) 基準日	平成23年3月31日
(ニ) 効力発生日	平成23年6月30日

(2) 金銭以外による配当

平成23年6月15日の臨時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当財産の種類	株式会社東京海上研究所普通株式
(ロ) 配当財産の帳簿価格	30,000千円
(ハ) 1株当たり配当額	783円
(ニ) 基準日	平成23年6月15日
(ホ) 効力発生日	平成23年6月21日

(3) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成24年6月26日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	551,864千円
(ロ) 配当の原資	利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	14,409円
(ニ) 基準日	平成24年3月31日
(ホ) 効力発生日	平成24年6月27日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

第26期 自平成22年4月1日 至平成23年3月31日	第27期 自平成23年4月1日 至平成24年3月31日

<p>(1) 金融商品に対する取組方針 当社の資本は本来の事業目的のために使用することを基本とし、資産の運用に際しては、資産運用リスクを極力最小限に留めることを基本方針としております。</p> <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク 営業債権である未収収益は顧客の信用リスクに晒されており、未収委託者報酬は市場リスクに晒されております。投資有価証券は、主にファンドの自己設定に関連する投資信託であり、基準価額の変動リスクに晒されております。 営業債務である未払金は、ほとんど1年以内の支払期日であり、流動性リスクに晒されております。</p> <p>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 未収収益については、管理部門において取引先ごとに期日及び残高を把握することで、回収懸念の早期把握や軽減を図っております。 市場リスク 未収委託者報酬には、運用資産の悪化から回収できず当社が損失を被るリスクが存在しますが、過去の回収実績からリスクは僅少であると判断しております。 投資有価証券については、管理部門において定期的に時価を把握する体制としております。 流動性リスク 当社は、日々資金残高管理を行っており流動性リスクを管理しております。</p>	<p>(1) 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク 同左</p> <p>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 同左 市場リスク 同左 流動性リスク 同左</p>
---	---

2. 金融商品の時価等に関する事項

第26期(平成23年3月31日現在)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金・預金	5,046,015	5,046,015	
(2)未収委託者報酬	1,451,584	1,451,584	
(3)未収収益	1,921,269	1,921,269	
(4)投資有価証券 その他有価証券	9,419	9,419	
(5)敷金	368,720	236,852	131,868
(6)未払金	(1,113,561)	(1,113,561)	

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

第27期(平成24年3月31日現在)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
--	-------------	-------	----

(1)現金・預金	5,761,145	5,761,145	
(2)未収委託者報酬	1,436,947	1,436,947	
(3)未収収益	1,777,274	1,777,274	
(4)投資有価証券 其他有価証券	16,664	16,664	
(5)敷金	361,849	258,063	103,786
(6)未払金	(1,318,980)	(1,318,980)	

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1)金融商品の時価の算定方法ならびに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

第26期 平成23年3月31日現在	第27期 平成24年3月31日現在
(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬並びに(3)未収収益及び(6)未払金 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。	(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬並びに(3)未収収益及び(6)未払金 同左
(4)投資有価証券 時価の算定方法につきましては「重要な会計方針」の「1.有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(4)投資有価証券 同左
(5)敷金 当社では、敷金の時価の算定は、その将来キャッシュ・フローを国債の利回り等適切な指標に当該建物の残存耐用年数を加味した利率で割り引いた現在価値より算定しております。	(5)敷金 同左

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

第26期 平成23年3月31日現在	第27期 平成24年3月31日現在
以下については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。	以下については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。
(単位：千円)	(単位：千円)
貸借対照表計上額	貸借対照表計上額
投資有価証券	子会社株式 221,595
其他有価証券	関連会社株式 32,747
非上場株式 30,000	その他の関係会社有価証券 31,200
子会社株式 221,595	
関連会社株式 32,747	
その他の関係会社有価証券 30,000	

(注3)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

第26期 平成23年3月31日現在	第27期 平成24年3月31日現在
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。	同左

(注4)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

第26期 平成23年3月31日現在			第27期 平成24年3月31日現在		
(単位：千円)			(単位：千円)		
	1年以内	1年超		1年以内	1年超
預金	5,045,953		預金	5,761,116	
未収委託者報酬	1,451,584		未収委託者報酬	1,436,947	
未収収益	1,921,269		未収収益	1,777,274	
合計	8,418,807		投資有価証券		
			その他有価証 券のうち満期 があるもの		1,000
			合計	8,975,337	1,000

(有価証券関係)

第26期 平成23年3月31日現在				第27期 平成24年3月31日現在			
1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券				1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券			
<p>子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 子会社株式221,595千円、関連会社株式32,747千円)並びにその他の関係会社有価証券(貸借対照表計上額 30,000千円)は、市場価格がなく時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。</p>				<p>子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 子会社株式221,595千円、関連会社株式32,747千円)並びにその他の関係会社有価証券(貸借対照表計上額 31,200千円)は、市場価格がなく時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。</p>			
2. その他有価証券				2. その他有価証券			
(単位：千円)				(単位：千円)			
区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額	区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの証券投資信託	2,113	2,100	13	貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの証券投資信託	15,700	15,500	200
貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの証券投資信託	7,305	7,400	94	貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの証券投資信託	964	1,000	35
合計	9,419	9,500	80	合計	16,664	16,500	164
(注) 非上場株式(貸借対照表計上額30,000千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表の「その他有価証券」には含めていません。							
3. 当事業年度中に売却したその他有価証券				3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 該当事項はありません。			
区分	第26期 自平成22年4月1日 至平成23年3月31日						
売却額	994千円						
売却益の合計額	-千円						
売却損の合計額	6千円						

(退職給付関係)

第26期 自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日	第27期 自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日
1. 採用している退職給付制度の概要 退職金制度及び確定拠出年金制度を採用しております。	1. 採用している退職給付制度の概要 同左
2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 110,188千円 退職給付引当金 110,188千円	2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 115,077千円 退職給付引当金 115,077千円
3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 51,271千円 確定拠出年金への掛金支払額 25,787千円 退職給付費用 77,059千円	3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 43,770千円 確定拠出年金への掛金支払額 28,327千円 退職給付費用 72,098千円
4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 退職給付債務の計算は簡便法を採用しており、確定拠出年金部分を除く退職給付費用は「勤務費用」に計上しております。	4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 同左

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第26期 (平成23年 3月31日現在)	第27期 (平成24年 3月31日現在)
繰延税金資産		
役員退職慰労引当金	7,393千円	9,601千円
退職給付引当金損金算入限度超過額	44,835千円	41,013千円
未払金	15,454千円	13,175千円
賞与引当金損金算入限度超過額	82,479千円	78,796千円
未払法定福利費否認	8,592千円	9,234千円
未払事業所税否認	3,444千円	3,362千円
未払事業税否認	46,947千円	40,452千円
未払調査費	47,913千円	41,860千円
ソフトウェア償却超過額	70,659千円	63,265千円
敷金償却費	5,824千円	7,550千円
未払確定拠出年金	876千円	927千円
未払費用	-	3,185千円
繰延税金資産小計	334,420千円	312,424千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	334,420千円	312,424千円
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	32千円	58千円
繰延税金負債合計	32千円	58千円
繰延税金資産の純額	334,453千円	312,365千円

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

第26期 (平成23年 3月31日現在)	第27期 (平成24年 3月31日現在)
-------------------------	-------------------------

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の百分の五以下であるため注記を省略しております。	法定実効税率	40.7%
	(調整)	
	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.2%
	タックスヘイブン課税	5.6%
	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.3%
	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2%
	その他	0.2%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	45.5%	

3. 法人税率の変更等による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」(平成23年法律第114号)及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」(平成23年法律第117号)が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については、38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、35.6%となります。

この税率変更により、繰延税金資産(繰延税金負債を控除した金額)は26,174千円減少し、法人税等調整額が26,182千円、その他有価証券評価差額金が8千円それぞれ増加しております。

(セグメント情報等)

第26期	第27期
自 平成22年4月1日	自 平成23年4月1日
至 平成23年3月31日	至 平成24年3月31日

<p>[セグメント情報]</p> <p>当社は「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として運用(投資運用業)を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。</p> <p>当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。</p> <p>[関連情報]</p> <p>1. 製品及びサービスごとの情報</p> <p>単一のサービス区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>2. 地域ごとの情報</p> <p>(1) 営業収益</p> <p>本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>(2) 有形固定資産</p> <p>本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報</p> <p>当社は、単一の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の10%以上に該当する顧客がありますが、秘密保持義務を負っているため記載をしております。</p>	<p>[セグメント情報]</p> <p>同左</p> <p>[関連情報]</p> <p>1. 製品及びサービスごとの情報</p> <p>同左</p> <p>2. 地域ごとの情報</p> <p>(1) 営業収益</p> <p>同左</p> <p>(2) 有形固定資産</p> <p>同左</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報</p> <p>同左</p>
--	---

(関連当事者情報)

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等
重要な取引はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の 所有 割合	関連当 事者との 関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
関連会社	TOKIO MARINE ROGGE ASSET MANAGEMENT LIMITED	英国・ London	300千	金融商品 取引業	(所有) 直接50%	運用の 再委任 役員 の 派遣	委託 調査費 の 支払	1,092,497	未払金	307,738

(注)*取引価格については、市場実勢等を勘案し、交渉の上決定しております。

*取引金額及び期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等
重要な取引はありません。

- (4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主(個人の場合に限る。)等
重要な取引はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する情報

(1) 親会社情報

東京海上ホールディングス株式会社(東京証券取引所及び大阪証券取引所に上場)
東京海上日動火災保険株式会社(非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

重要な関連会社はありません。

第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

1. 関連当事者との取引

- (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等
重要な取引はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の 所有 割合	関連当 事者との 関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
関連会社	TOKIO MARINE ROGGE ASSET MANAGEMENT LIMITED	英国・ London	300千	金融商品取引業	(所有) 直接50%	運用の 再委任 役員 の 派遣	委託 調査費 の支払	1,367,824	未払金	328,743

(注)*取引価格については、市場実勢等を勘案し、交渉の上決定しております。

*取引金額及び期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

- (3) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等
重要な取引はありません。

- (4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主(個人の場合に限る。)等
重要な取引はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する情報

(1) 親会社情報

東京海上ホールディングス株式会社(東京証券取引所及び大阪証券取引所に上場)
東京海上日動火災保険株式会社(非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

重要な関連会社はありません。

(1株当たり情報)

	第26期 自平成22年4月1日 至平成23年3月31日	第27期 自平成23年4月1日 至平成24年3月31日
1株当たり純資産額	186,572円36銭	202,119円00銭
1株当たり当期純利益 金額	24,197円49銭	29,640円93銭
	(注)1. 潜在株式調整後1株当たり 当期純利益については、潜在 株式がないため記載して おりません。 (注)2. 1株当たり当期純利益金額 の算定上の基礎は以下の とおりであります。	(注)1. 潜在株式調整後1株当たり 当期純利益については、潜在 株式がないため記載して おりません。 (注)2. 1株当たり当期純利益金額 の算定上の基礎は以下の とおりであります。

当期純利益	926,763千円	当期純利益	1,135,247千円
普通株主に 帰属しない金額	-	普通株主に 帰属しない金額	-
普通株式に係る 当期純利益	926,763千円	普通株式に係る 当期純利益	1,135,247千円
期中平均株式数	38,300株	期中平均株式数	38,300株

独立監査人の中間監査報告書

平成24年9月5日

東京海上アセットマネジメント投信株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上・未来設計ファンド1の平成24年1月26日から平成24年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上・未来設計ファンド1の平成24年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成24年1月26日から平成24年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

東京海上アセットマネジメント投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）1．上記は、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．中間財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[東京海上・未来設計ファンド2の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年9月5日

東京海上アセットマネジメント投信株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上・未来設計ファンド2の平成24年1月26日から平成24年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上・未来設計ファンド2の平成24年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成24年1月26日から平成24年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

東京海上アセットマネジメント投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）1．上記は、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．中間財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[東京海上・未来設計ファンド3の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年9月5日

東京海上アセットマネジメント投信株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上・未来設計ファンド3の平成24年1月26日から平成24年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上・未来設計ファンド3の平成24年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成24年1月26日から平成24年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

東京海上アセットマネジメント投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）1．上記は、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．中間財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[東京海上・未来設計ファンド4の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年9月5日

東京海上アセットマネジメント投信株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上・未来設計ファンド4の平成24年1月26日から平成24年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上・未来設計ファンド4の平成24年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成24年1月26日から平成24年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

東京海上アセットマネジメント投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）1．上記は、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．中間財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[東京海上・未来設計ファンド5の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年9月5日

東京海上アセットマネジメント投信株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上・未来設計ファンド5の平成24年1月26日から平成24年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上・未来設計ファンド5の平成24年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成24年1月26日から平成24年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

東京海上アセットマネジメント投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）1．上記は、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．中間財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月27日

東京海上アセットマネジメント投信株式会社

取締役会御中

あらた監査法人

指定社員
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫指定社員
業務執行社員 公認会計士 奈良 昌彦

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント投信株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント投信株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。