

【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25年10月25日

【計算期間】 第13期中（自 平成25年1月26日 至 平成25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25年8月30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 | 109,406,337 | 69.98 |
| コール・ローン等、その他の資産(負債控除後) | | 46,927,357 | 30.01 |
| 合計(純資産総額) | | 156,333,694 | 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 | 278,162,019 | 84.99 |
| コール・ローン等、その他の資産(負債控除後) | | 49,087,788 | 15.00 |
| 合計(純資産総額) | | 327,249,807 | 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 | 876,543,088 | 95.08 |
| コール・ローン等、その他の資産(負債控除後) | | 45,322,349 | 4.91 |
| 合計(純資産総額) | | 921,865,437 | 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 | 407,617,392 | 95.08 |
| コール・ローン等、その他の資産(負債控除後) | | 21,073,994 | 4.91 |
| 合計(純資産総額) | | 428,691,386 | 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 | 693,589,045 | 100.20 |
| コール・ローン等、その他の資産(負債控除後) | | 1,422,516 | 0.20 |
| 合計(純資産総額) | | 692,166,529 | 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 | 27,337,679,200 | 97.78 |
| コール・ローン等、その他の資産(負債控除後) | | 619,617,549 | 2.21 |
| 合計(純資産総額) | | 27,957,296,749 | 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 | 35,765,973,300 | 76.21 |
| 地方債証券 | 日本 | 99,606,000 | 0.21 |
| 社債券 | 日本 | 10,678,109,846 | 22.75 |
| コール・ローン等、その他の資産(負債控除後) | | 381,882,092 | 0.81 |
| 合計(純資産総額) | | 46,925,571,238 | 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 | 10,208,077,721 | 58.62 |
| | カナダ | 451,420,980 | 2.59 |
| | ドイツ | 348,521,978 | 2.00 |
| | フランス | 620,885,337 | 3.56 |
| | オーストラリア | 345,413,184 | 1.98 |
| | イギリス | 1,989,967,688 | 11.42 |
| | スイス | 727,591,618 | 4.17 |
| | パミュータ | 212,543,708 | 1.22 |
| | 香港 | 86,731,200 | 0.49 |
| | シンガポール | 306,377,299 | 1.75 |
| | ベルギー | 398,715,824 | 2.28 |
| | デンマーク | 163,163,700 | 0.93 |
| | アイルランド | 164,513,001 | 0.94 |
| | ポルトガル | 153,683,200 | 0.88 |
| | 中華人民共和国 | 36,138,000 | 0.20 |
| | ケイマン | 52,178,200 | 0.29 |
| | キュラソー | 166,141,843 | 0.95 |
| 小計 | 16,432,064,481 | 94.36 | |
| 投資証券 | アメリカ | 174,551,623 | 1.00 |
| | オーストラリア | 72,780,825 | 0.41 |
| | シンガポール | 779,242 | 0.00 |
| | 小計 | 248,111,690 | 1.42 |
| コール・ローン等、その他の資産(負債控除後) | | 733,503,154 | 4.21 |
| 合計(純資産総額) | | 17,413,679,325 | 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 | 5,956,418,795 | 42.78 |
| | カナダ | 361,133,310 | 2.59 |
| | ドイツ | 1,605,231,963 | 11.52 |
| | イタリア | 1,422,780,830 | 10.21 |
| | フランス | 1,348,573,985 | 9.68 |
| | オーストラリア | 118,557,000 | 0.85 |
| | イギリス | 856,771,180 | 6.15 |
| | スペイン | 594,811,288 | 4.27 |

| | | | |
|------------------------|-------|----------------|--------|
| | ベルギー | 782,955,993 | 5.62 |
| | メキシコ | 247,577,740 | 1.77 |
| | ポーランド | 248,924,064 | 1.78 |
| | 小計 | 13,543,736,148 | 97.27 |
| コール・ローン等、その他の資産(負債控除後) | | 379,240,232 | 2.72 |
| 合計(純資産総額) | | 13,922,976,380 | 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) |
|------------|---------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 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 |
| 12期 | (平成25年 1月25日) | 166 | 166 | 1.0589 | 1.0589 |
| 平成24年 8月末日 | | 158 | - | 1.0002 | - |
| 9月末日 | | 157 | - | 1.0055 | - |
| 10月末日 | | 157 | - | 1.0081 | - |
| 11月末日 | | 158 | - | 1.0208 | - |
| 12月末日 | | 161 | - | 1.0386 | - |
| 平成25年 1月末日 | | 167 | - | 1.0630 | - |
| 2月末日 | | 166 | - | 1.0721 | - |
| 3月末日 | | 166 | - | 1.0918 | - |
| 4月末日 | | 157 | - | 1.1136 | - |
| 5月末日 | | 158 | - | 1.1119 | - |
| 6月末日 | | 154 | - | 1.1042 | - |
| 7月末日 | | 158 | - | 1.1114 | - |
| 8月末日 | | 156 | - | 1.1080 | - |

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) |
|----|---------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 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 |
| 12期 | (平成25年 1月25日) | 339 | 339 | 1.0473 | 1.0473 |
| 平成24年 8月末日 | | 300 | - | 0.9475 | - |
| 9月末日 | | 302 | - | 0.9553 | - |
| 10月末日 | | 305 | - | 0.9600 | - |
| 11月末日 | | 312 | - | 0.9813 | - |
| 12月末日 | | 324 | - | 1.0143 | - |
| 平成25年 1月末日 | | 340 | - | 1.0550 | - |
| 2月末日 | | 337 | - | 1.0683 | - |
| 3月末日 | | 343 | - | 1.0992 | - |
| 4月末日 | | 344 | - | 1.1430 | - |
| 5月末日 | | 338 | - | 1.1427 | - |
| 6月末日 | | 329 | - | 1.1303 | - |
| 7月末日 | | 331 | - | 1.1411 | - |
| 8月末日 | | 327 | - | 1.1328 | - |

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) |
|------------|---------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 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 |
| 12期 | (平成25年 1月25日) | 963 | 963 | 1.0092 | 1.0092 |
| 平成24年 8月末日 | | 825 | - | 0.8722 | - |
| 9月末日 | | 835 | - | 0.8828 | - |
| 10月末日 | | 840 | - | 0.8887 | - |
| 11月末日 | | 865 | - | 0.9170 | - |
| 12月末日 | | 907 | - | 0.9628 | - |
| 平成25年 1月末日 | | 973 | - | 1.0204 | - |
| 2月末日 | | 965 | - | 1.0374 | - |
| 3月末日 | | 986 | - | 1.0795 | - |
| 4月末日 | | 1,002 | - | 1.1434 | - |
| 5月末日 | | 971 | - | 1.1484 | - |
| 6月末日 | | 944 | - | 1.1307 | - |

| | | | | |
|------|-----|---|--------|---|
| 7月末日 | 936 | - | 1.1469 | - |
| 8月末日 | 921 | - | 1.1329 | - |

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) |
|------------|---------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 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 |
| 12期 | (平成25年 1月25日) | 430 | 430 | 0.9044 | 0.9044 |
| 平成24年 8月末日 | | 356 | - | 0.7472 | - |
| 9月末日 | | 359 | - | 0.7591 | - |
| 10月末日 | | 359 | - | 0.7657 | - |
| 11月末日 | | 372 | - | 0.7972 | - |
| 12月末日 | | 398 | - | 0.8504 | - |
| 平成25年 1月末日 | | 436 | - | 0.9178 | - |
| 2月末日 | | 435 | - | 0.9360 | - |
| 3月末日 | | 442 | - | 0.9838 | - |
| 4月末日 | | 462 | - | 1.0617 | - |
| 5月末日 | | 447 | - | 1.0723 | - |
| 6月末日 | | 426 | - | 1.0508 | - |
| 7月末日 | | 433 | - | 1.0706 | - |
| 8月末日 | | 428 | - | 1.0519 | - |

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) |
|-----|---------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 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 |
| 12期 | (平成25年 1月25日) | 691 | 691 | 0.8168 | 0.8168 |

| | | | | |
|------------|-----|---|--------|---|
| 平成24年 8月末日 | 548 | - | 0.6511 | - |
| 9月末日 | 560 | - | 0.6638 | - |
| 10月末日 | 561 | - | 0.6699 | - |
| 11月末日 | 591 | - | 0.7025 | - |
| 12月末日 | 638 | - | 0.7587 | - |
| 平成25年 1月末日 | 698 | - | 0.8317 | - |
| 2月末日 | 695 | - | 0.8515 | - |
| 3月末日 | 721 | - | 0.9043 | - |
| 4月末日 | 755 | - | 0.9904 | - |
| 5月末日 | 729 | - | 1.0042 | - |
| 6月末日 | 708 | - | 0.9818 | - |
| 7月末日 | 718 | - | 1.0049 | - |
| 8月末日 | 692 | - | 0.9826 | - |

【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) |
|--------------------------------|---------------|--------------|
| 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 |
| 12期 | (平成25年 1月25日) | 6.8 |
| 自 平成24年 9月 3日 至 平成25年 8月30日 | | 10.8 |

東京海上・未来設計ファンド2

| 期 | 年月日 | 収益率(%) (分配付) |
|----|---------------|--------------|
| 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 |
| 12期 | (平成25年 1月25日) | 11.3 |
| 自 平成24年 9月 3日 至 平成25年 8月30日 | | 19.6 |

東京海上・未来設計ファンド3

| 期 | 年月日 | 収益率(%) (分配付) |
|--------------------------------|---------------|--------------|
| 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 |
| 12期 | (平成25年 1月25日) | 16.1 |
| 自 平成24年 9月 3日 至 平成25年 8月30日 | | 29.9 |

東京海上・未来設計ファンド4

| 期 | 年月日 | 収益率(%) (分配付) |
|--------------------------------|---------------|--------------|
| 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 |
| 12期 | (平成25年 1月25日) | 20.6 |
| 自 平成24年 9月 3日 至 平成25年 8月30日 | | 40.8 |

東京海上・未来設計ファンド5

| 期 | 年月日 | 収益率(%) (分配付) |
|----|---------------|--------------|
| 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 |
| 12期 | (平成25年 1月25日) | 24.0 |
| 自 平成24年 9月 3日 至 平成25年 8月30日 | | 50.9 |

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) |
|--------------------------------|------------|------------|-------------|
| 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 |
| 12期 | 28,698,960 | 32,010,990 | 157,458,984 |
| 自 平成24年 9月 3日 至 平成25年 8月30日 | 25,343,318 | 42,350,992 | 141,096,707 |

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) |
|--------------------------------|------------|------------|-------------|
| 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 |
| 12期 | 39,374,423 | 23,261,477 | 323,847,129 |
| 自 平成24年 9月 3日 至 平成25年 8月30日 | 33,288,859 | 61,360,103 | 288,884,126 |

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) |
|---|---------|---------|-----------|
|---|---------|---------|-----------|

| | | | |
|--------------------------------|-------------|-------------|-------------|
| 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 |
| 12期 | 119,278,758 | 88,215,089 | 954,948,371 |
| 自 平成24年 9月 3日 至 平成25年 8月30日 | 93,668,428 | 227,016,075 | 813,701,087 |

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) |
|--------------------------------|-------------|-------------|-------------|
| 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 |
| 12期 | 62,801,120 | 46,806,200 | 476,131,239 |
| 自 平成24年 9月 3日 至 平成25年 8月30日 | 46,609,293 | 116,031,487 | 407,536,880 |

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) |
|--------------------------------|-------------|-------------|-------------|
| 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 |
| 12期 | 120,609,591 | 87,693,752 | 846,791,307 |
| 自 平成24年 9月 3日 至 平成25年 8月30日 | 95,341,138 | 233,492,704 | 704,418,724 |

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25年1月26日から平成25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25年 1月25日現在 | 当中間計算期間末 平成25年 7月25日現在 |
|-----------------|--------------------------|---------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 49,228,697 | 47,377,639 |
| 親投資信託受益証券 | 117,697,967 | 112,540,875 |
| 未収入金 | 453,644 | 511,149 |
| 未収利息 | 89 | 70 |
| 流動資産合計 | 167,380,397 | 160,429,733 |
| 資産合計 | 167,380,397 | 160,429,733 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | - | 80,886 |
| 未払受託者報酬 | 58,935 | 59,039 |
| 未払委託者報酬 | 555,540 | 556,638 |
| その他未払費用 | 33,590 | 33,655 |
| 流動負債合計 | 648,065 | 730,218 |
| 負債合計 | 648,065 | 730,218 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ¹ 157,458,984 | ¹ 142,433,434 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 9,273,348 | 17,266,081 |
| (分配準備積立金) | 8,132,626 | 6,757,495 |
| 元本等合計 | 166,732,332 | 159,699,515 |
| 純資産合計 | 166,732,332 | 159,699,515 |
| 負債純資産合計 | 167,380,397 | 160,429,733 |

(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24年 1月26日 至 平成24年 7月25日 | 当中間計算期間 自 平成25年 1月26日 至 平成25年 7月25日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 15,655 | 14,142 |
| 有価証券売買等損益 | 933,982 | 10,014,485 |
| 営業収益合計 | 949,637 | 10,028,627 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 57,477 | 59,039 |
| 委託者報酬 | 541,867 | 556,638 |
| その他費用 | 32,757 | 33,655 |
| 営業費用合計 | 632,101 | 649,332 |
| 営業利益又は営業損失() | 317,536 | 9,379,295 |
| 経常利益又は経常損失() | 317,536 | 9,379,295 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 317,536 | 9,379,295 |
| 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() | 297,719 | 1,010,059 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 1,418,842 | 9,273,348 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 203,836 | 1,264,408 |
| 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 | 59,456 | 1,264,408 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 1,640,911 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 1,640,911 |
| 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() | 1,195,189 | 17,266,081 |

(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25年 1月26日 至 平成25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。 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 前期 平成25年 1月25日現在 | 当中間計算期間末 平成25年 7月25日現在 |
|-----------------------------|---------------------|---------------------------|
| 1. 1 期首元本額 | 160,771,014円 | 157,458,984円 |
| 期中追加設定元本額 | 28,698,960円 | 12,422,354円 |
| 期中一部解約元本額 | 32,010,990円 | 27,447,904円 |
| 2. 1 中間計算期間末日における受益権 の総数 | 157,458,984口 | 142,433,434口 |

(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24年 1月26日 至 平成24年 7月25日 | 当中間計算期間 自 平成25年 1月26日 至 平成25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25年 1月25日現在 | 当中間計算期間末 平成25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。 (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)

| 前期 平成25年 1月25日現在 | | 当中間計算期間末 平成25年 7月25日現在 | |
|---------------------|----------|---------------------------|----------|
| 1口当たり純資産額 | 1.0589円 | 1口当たり純資産額 | 1.1212円 |
| (1万口当たり純資産額 | 10,589円) | (1万口当たり純資産額 | 11,212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25年 1月25日現在 | 当中間計算期間末 平成25年 7月25日現在 |
|-----------------|--------------------------|---------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 49,497,511 | 49,713,951 |
| 親投資信託受益証券 | 289,944,454 | 289,218,148 |
| 未収入金 | 1,502,317 | 1,628,724 |
| 未収利息 | 89 | 74 |
| 流動資産合計 | 340,944,371 | 340,560,897 |
| 資産合計 | 340,944,371 | 340,560,897 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払受託者報酬 | 114,565 | 124,212 |
| 未払委託者報酬 | 1,587,500 | 1,721,053 |
| その他未払費用 | 65,369 | 70,883 |
| 流動負債合計 | 1,767,434 | 1,916,148 |
| 負債合計 | 1,767,434 | 1,916,148 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ¹ 323,847,129 | ¹ 291,788,886 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 15,329,808 | 46,855,863 |
| (分配準備積立金) | 18,463,575 | 15,830,722 |
| 元本等合計 | 339,176,937 | 338,644,749 |
| 純資産合計 | 339,176,937 | 338,644,749 |
| 負債純資産合計 | 340,944,371 | 340,560,897 |

(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24年 1月26日 至 平成24年 7月25日 | 当中間計算期間 自 平成25年 1月26日 至 平成25年 7月25日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 14,818 | 14,747 |
| 有価証券売買等損益 | 986,858 | 37,062,815 |
| 営業収益合計 | 972,040 | 37,077,562 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 108,804 | 124,212 |
| 委託者報酬 | 1,507,641 | 1,721,053 |
| その他費用 | 62,081 | 70,883 |
| 営業費用合計 | 1,678,526 | 1,916,148 |
| 営業利益又は営業損失() | 2,650,566 | 35,161,414 |
| 経常利益又は経常損失() | 2,650,566 | 35,161,414 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 2,650,566 | 35,161,414 |
| 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() | 232,708 | 3,178,548 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 18,147,179 | 15,329,808 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 720,369 | 1,824,616 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 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 | - | 1,824,616 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 860,921 | 2,281,427 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 2,281,427 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 860,921 | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 21,171,005 | 46,855,863 |

(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25年 1月26日 至 平成25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。 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 前期 平成25年 1月25日現在 | 当中間計算期間末 平成25年 7月25日現在 |
|-------------------------|---------------------|---------------------------|
| 1. 1 期首元本額 | 307,734,183円 | 323,847,129円 |
| 期中追加設定元本額 | 39,374,423円 | 15,053,304円 |
| 期中一部解約元本額 | 23,261,477円 | 47,111,547円 |
| 2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数 | 323,847,129口 | 291,788,886口 |

(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24年 1月26日 至 平成24年 7月25日 | 当中間計算期間 自 平成25年 1月26日 至 平成25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25年 1月25日現在 | 当中間計算期間末 平成25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。 (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)

| 前期 平成25年 1月25日現在 | | 当中間計算期間末 平成25年 7月25日現在 | |
|---------------------|----------|---------------------------|----------|
| 1口当たり純資産額 | 1.0473円 | 1口当たり純資産額 | 1.1606円 |
| (1万口当たり純資産額 | 10,473円) | (1万口当たり純資産額 | 11,606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25年 1月25日現在 | 当中間計算期間末 平成25年 7月25日現在 |
|-----------------|--------------------------|---------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 46,315,674 | 46,959,338 |
| 親投資信託受益証券 | 917,808,016 | 923,891,225 |
| 未収入金 | 7,341,853 | 7,282,310 |
| 未収利息 | 83 | 69 |
| 流動資産合計 | 971,465,626 | 978,132,942 |
| 資産合計 | 971,465,626 | 978,132,942 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 1,423,453 | 579,136 |
| 未払受託者報酬 | 362,879 | 407,890 |
| 未払委託者報酬 | 5,760,600 | 6,475,261 |
| その他未払費用 | 181,338 | 203,306 |
| 流動負債合計 | 7,728,270 | 7,665,593 |
| 負債合計 | 7,728,270 | 7,665,593 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ¹ 954,948,371 | ¹ 825,225,831 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 8,788,985 | 145,241,518 |
| (分配準備積立金) | 61,581,021 | 50,841,366 |
| 元本等合計 | 963,737,356 | 970,467,349 |
| 純資産合計 | 963,737,356 | 970,467,349 |
| 負債純資産合計 | 971,465,626 | 978,132,942 |

(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24年 1月26日 至 平成24年 7月25日 | 当中間計算期間 自 平成25年 1月26日 至 平成25年 7月25日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 13,638 | 14,026 |
| 有価証券売買等損益 | 11,694,249 | 158,185,466 |
| 営業収益合計 | 11,680,611 | 158,199,492 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 343,341 | 407,890 |
| 委託者報酬 | 5,450,472 | 6,475,261 |
| その他費用 | 171,586 | 203,306 |
| 営業費用合計 | 5,965,399 | 7,086,457 |
| 営業利益又は営業損失() | 17,646,010 | 151,113,035 |
| 経常利益又は経常損失() | 17,646,010 | 151,113,035 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 17,646,010 | 151,113,035 |
| 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() | 1,360,308 | 17,422,645 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 120,583,870 | 8,788,985 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 5,631,671 | 4,583,639 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 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 | - | 4,583,639 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 6,902,484 | 1,821,496 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 1,821,496 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 6,902,484 | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 140,861,001 | 145,241,518 |

(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25年 1月26日 至 平成25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。 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 前期 平成25年 1月25日現在 | 当中間計算期間末 平成25年 7月25日現在 |
|-----------------------------|---------------------|---------------------------|
| 1. 1 期首元本額 | 923,884,702円 | 954,948,371円 |
| 期中追加設定元本額 | 119,278,758円 | 40,102,519円 |
| 期中一部解約元本額 | 88,215,089円 | 169,825,059円 |
| 2. 1 中間計算期間末日における受益権 の総数 | 954,948,371口 | 825,225,831口 |

(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24年 1月26日 至 平成24年 7月25日 | 当中間計算期間 自 平成25年 1月26日 至 平成25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25年 1月25日現在 | 当中間計算期間末 平成25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。 (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)

| 前期 平成25年 1月25日現在 | | 当中間計算期間末 平成25年 7月25日現在 | |
|---------------------|----------|---------------------------|----------|
| 1口当たり純資産額 | 1.0092円 | 1口当たり純資産額 | 1.1760円 |
| (1万口当たり純資産額 | 10,092円) | (1万口当たり純資産額 | 11,760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25年 1月25日現在 | 当中間計算期間末 平成25年 7月25日現在 |
|-----------------|--------------------------|---------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 20,387,958 | 21,454,571 |
| 親投資信託受益証券 | 410,378,101 | 427,285,361 |
| 未収入金 | 3,095,816 | 3,667,579 |
| 未収利息 | 36 | 31 |
| 流動資産合計 | 433,861,911 | 452,407,542 |
| 資産合計 | 433,861,911 | 452,407,542 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払受託者報酬 | 157,052 | 186,060 |
| 未払委託者報酬 | 3,023,276 | 3,581,612 |
| その他未払費用 | 78,427 | 92,939 |
| 流動負債合計 | 3,258,755 | 3,860,611 |
| 負債合計 | 3,258,755 | 3,860,611 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ¹ 476,131,239 | ¹ 405,270,398 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | ² 45,528,083 | ² 43,276,533 |
| (分配準備積立金) | 34,745,242 | 28,309,741 |
| 元本等合計 | 430,603,156 | 448,546,931 |
| 純資産合計 | 430,603,156 | 448,546,931 |
| 負債純資産合計 | 433,861,911 | 452,407,542 |

(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24年 1月26日 至 平成24年 7月25日 | 当中間計算期間 自 平成25年 1月26日 至 平成25年 7月25日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 5,908 | 6,305 |
| 有価証券売買等損益 | 10,477,416 | 94,474,118 |
| 営業収益合計 | 10,471,508 | 94,480,423 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 149,557 | 186,060 |
| 委託者報酬 | 2,878,957 | 3,581,612 |
| その他費用 | 74,692 | 92,939 |
| 営業費用合計 | 3,103,206 | 3,860,611 |
| 営業利益又は営業損失() | 13,574,714 | 90,619,812 |
| 経常利益又は経常損失() | 13,574,714 | 90,619,812 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 13,574,714 | 90,619,812 |
| 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() | 684,339 | 10,783,723 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 114,956,208 | 45,528,083 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 4,626,744 | 8,968,527 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 4,626,744 | 8,447,180 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | 521,347 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 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 | 7,700,766 | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 132,289,283 | 43,276,533 |

(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25年 1月26日 至 平成25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。 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 前期 平成25年 1月25日現在 | 当中間計算期間末 平成25年 7月25日現在 |
|-------------------------|--------------------------------------|---------------------------|
| 1. 1 期首元本額 | 460,136,319円 | 476,131,239円 |
| 期中追加設定元本額 | 62,801,120円 | 18,964,166円 |
| 期中一部解約元本額 | 46,806,200円 | 89,825,007円 |
| 2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数 | 476,131,239口 | 405,270,398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45,528,083円です。 | |

(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24年 1月26日 至 平成24年 7月25日 | 当中間計算期間 自 平成25年 1月26日 至 平成25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25年 1月25日現在 | 当中間計算期間末 平成25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。 (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)

| 前期 平成25年 1月25日現在 | | 当中間計算期間末 平成25年 7月25日現在 | |
|---------------------|---------|---------------------------|----------|
| 1口当たり純資産額 | 0.9044円 | 1口当たり純資産額 | 1.1068円 |
| (1万口当たり純資産額 | 9,044円) | (1万口当たり純資産額 | 11,068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25年 1月25日現在 | 当中間計算期間末 平成25年 7月25日現在 |
|-----------------|--------------------------|---------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 691,680,631 | 749,247,274 |
| 未収入金 | 7,111,194 | 8,593,109 |
| 流動資産合計 | 698,791,825 | 757,840,383 |
| 資産合計 | 698,791,825 | 757,840,383 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 1,220,611 | 1,349,951 |
| 未払受託者報酬 | 246,728 | 303,391 |
| 未払委託者報酬 | 5,520,577 | 6,788,166 |
| その他未払費用 | 123,278 | 151,601 |
| 流動負債合計 | 7,111,194 | 8,593,109 |
| 負債合計 | 7,111,194 | 8,593,109 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ¹ 846,791,307 | ¹ 716,349,957 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | ² 155,110,676 | ² 32,897,317 |
| (分配準備積立金) | 49,130,383 | 39,266,468 |
| 元本等合計 | 691,680,631 | 749,247,274 |
| 純資産合計 | 691,680,631 | 749,247,274 |
| 負債純資産合計 | 698,791,825 | 757,840,383 |

(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24年 1月26日 至 平成24年 7月25日 | 当中間計算期間 自 平成25年 1月26日 至 平成25年 7月25日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 24,072,332 | 189,105,287 |
| 営業収益合計 | 24,072,332 | 189,105,287 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 233,101 | 303,391 |
| 委託者報酬 | 5,215,529 | 6,788,166 |
| その他費用 | 116,460 | 151,601 |
| 営業費用合計 | 5,565,090 | 7,243,158 |
| 営業利益又は営業損失() | 29,637,422 | 181,862,129 |
| 経常利益又は経常損失() | 29,637,422 | 181,862,129 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 29,637,422 | 181,862,129 |
| 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() | 1,166,861 | 23,344,449 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 277,731,219 | 155,110,676 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 12,092,144 | 31,461,468 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 12,092,144 | 31,461,468 |
| 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 | 20,937,630 | 1,971,155 |
| 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 | 20,937,630 | 1,971,155 |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 317,380,988 | 32,897,317 |

(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25年 1月26日 至 平成25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。 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 前期 平成25年 1月25日現在 | 当中間計算期間末 平成25年 7月25日現在 |
|-------------------------|---------------------------------------|---------------------------|
| 1. 1 期首元本額 | 813,875,468円 | 846,791,307円 |
| 期中追加設定元本額 | 120,609,591円 | 43,294,643円 |
| 期中一部解約元本額 | 87,693,752円 | 173,735,993円 |
| 2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数 | 846,791,307口 | 716,349,957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155,110,676円です。 | |

(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24年 1月26日 至 平成24年 7月25日 | 当中間計算期間 自 平成25年 1月26日 至 平成25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25年 1月25日現在 | 当中間計算期間末 平成25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。 (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)

| 前期 平成25年 1月25日現在 | | 当中間計算期間末 平成25年 7月25日現在 | |
|---------------------|---------|---------------------------|----------|
| 1口当たり純資産額 | 0.8168円 | 1口当たり純資産額 | 1.0459円 |
| (1万口当たり純資産額 | 8,168円) | (1万口当たり純資産額 | 10,459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25年 1月25日現在 | 平成25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 | | 389,156,746 | 530,747,440 |
| 株式 | | 21,274,268,400 | 29,841,980,500 |
| 未収入金 | | 331,924,492 | 503,057,012 |
| 未収配当金 | | 21,817,600 | 16,190,400 |
| 未収利息 | | 704 | 790 |
| 流動資産合計 | | 22,017,167,942 | 30,891,976,142 |
| 資産合計 | | 22,017,167,942 | 30,891,976,142 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払金 | | 337,717,885 | 461,100,001 |
| 未払解約金 | | 32,604,095 | 126,372,694 |
| 流動負債合計 | | 370,321,980 | 587,472,695 |
| 負債合計 | | 370,321,980 | 587,472,695 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 34,594,340,085 | 34,973,521,051 |
| 剰余金 | | | |

| | | | |
|-------------|---|----------------|----------------|
| 剰余金又は欠損金() | 2 | 12,947,494,123 | 4,669,017,604 |
| 元本等合計 | | 21,646,845,962 | 30,304,503,447 |
| 純資産合計 | | 21,646,845,962 | 30,304,503,447 |
| 負債純資産合計 | | 22,017,167,942 | 30,891,976,142 |

(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25年 1月26日 至 平成25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。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 平成25年 1月25日現在 | 平成25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 | 33,174,122,481円 | 34,594,340,085円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 9,187,037,620円 | 8,915,745,064円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 7,766,820,016円 | 8,536,564,098円 |
| 同中間期末における元本額 | 34,594,340,085円 | 34,973,521,051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> | 676,803,038円 | 3,265,987,183円 |
| 東京海上日本株アクティブ ファンド | 1,646,161,727円 | 1,243,758,519円 |
| 東京海上・未来設計ファンド1 | 27,731,876円 | 19,372,812円 |
| 東京海上・未来設計ファンド2 | 111,393,479円 | 81,289,455円 |
| 東京海上・未来設計ファンド3 | 467,587,555円 | 345,016,458円 |
| 東京海上・未来設計ファンド4 | 274,531,690円 | 209,855,478円 |
| 東京海上・未来設計ファンド5 | 544,367,849円 | 433,181,484円 |
| 東京海上セレクション・日本株式 | 15,784,613,557円 | 16,471,791,833円 |
| 東京海上セレクション・バランス30 | 1,555,363,141円 | 1,295,932,131円 |
| 東京海上セレクション・バランス50 | 6,091,043,957円 | 5,245,305,447円 |
| 東京海上セレクション・バランス70 | 4,896,271,400円 | 4,455,027,522円 |
| TMAバランス25VA 適格機関投資家限定 | 2,107,443,832円 | 1,564,669,521円 |
| TMAバランス50VA 適格機関投資家限定 | 264,140,451円 | 211,878,886円 |
| TMAバランス75VA 適格機関投資家限定 | 146,886,533円 | 130,454,322円 |
| 計 | 34,594,340,085円 | 34,973,521,051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 | 34,594,340,085口 | 34,973,521,051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12,947,494,123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4,669,017,604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25年 1月25日現在 | 平成25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25年 1月25日現在 | | 平成25年 7月25日現在 | |
|---------------|---------|---------------|---------|
| 1口当たり純資産額 | 0.6257円 | 1口当たり純資産額 | 0.8665円 |
| (1万口当たり純資産額 | 6,257円) | (1万口当たり純資産額 | 8,665円) |

「TMA日本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25年 1月25日現在 | 平成25年 7月25日現在 |
|---------|----------|----------------|----------------|
| | | 金額(円) | 金額(円) |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 745,808,848 | 417,151,758 |
| 国債証券 | | 30,905,316,700 | 34,430,974,900 |
| 地方債証券 | | | 99,416,000 |
| 社債券 | | 7,389,985,081 | 9,969,273,533 |

| | | | |
|-------------|---|----------------|----------------|
| 未収入金 | | 1,050,496,500 | 1,222,459,400 |
| 未収利息 | | 75,648,951 | 100,969,121 |
| 前払費用 | | 11,502,058 | 24,107,467 |
| 流動資産合計 | | 40,178,758,138 | 46,264,352,179 |
| 資産合計 | | 40,178,758,138 | 46,264,352,179 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払金 | | 1,588,500,400 | 1,430,743,000 |
| 未払解約金 | | 26,022,941 | 18,352,674 |
| 流動負債合計 | | 1,614,523,341 | 1,449,095,674 |
| 負債合計 | | 1,614,523,341 | 1,449,095,674 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 31,060,520,280 | 35,869,965,446 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 7,503,714,517 | 8,945,291,059 |
| 元本等合計 | | 38,564,234,797 | 44,815,256,505 |
| 純資産合計 | | 38,564,234,797 | 44,815,256,505 |
| 負債純資産合計 | | 40,178,758,138 | 46,264,352,179 |

(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25年 1月26日 至 平成25年 7月25日 |
|-----------------|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券、地方債証券及び社債券 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。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 平成25年 1月25日現在 | 平成25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 | 29,986,546,739円 | 31,060,520,280円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 8,343,295,901円 | 8,560,510,352円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 7,269,322,360円 | 3,751,065,186円 |
| 同中間期末における元本額 | 31,060,520,280円 | 35,869,965,446円 |
| 元本の内訳* | | |
| 東京海上・国内債券ファンド | 1,397,886,362円 | 992,823,660円 |
| 東京海上・未来設計ファンド1 | 59,464,690円 | 56,741,493円 |
| 東京海上・未来設計ファンド2 | 106,145,901円 | 105,727,029円 |
| 東京海上・未来設計ファンド3 | 222,806,818円 | 224,163,701円 |
| 東京海上・未来設計ファンド4 | 32,705,249円 | 34,109,504円 |
| 東京海上セレクション・バランス30 | 1,741,981,290円 | 1,981,778,090円 |
| 東京海上セレクション・バランス50 | 2,239,422,044円 | 2,632,611,069円 |

| | | |
|--|-----------------|-----------------|
| 東京海上セレクション・バランス70 | 466,761,639円 | 579,766,665円 |
| 東京海上セレクション・日本債券 | 7,218,671,575円 | 7,309,561,202円 |
| TMAバランス25VA 適格機関投資家限定 | 6,025,111,243円 | 6,107,181,542円 |
| TMAバランス50VA 適格機関投資家限定 | 251,745,614円 | 275,763,759円 |
| TMAバランス75VA 適格機関投資家限定 | 46,665,703円 | 56,596,129円 |
| 東京海上日本債ファンドM (FOfs用)(適格機関投資家専用) | 11,251,152,152円 | 15,513,141,603円 |
| 計 | 31,060,520,280円 | 35,869,965,446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 | 31,060,520,280口 | 35,869,965,446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25年 1月25日現在 | 平成25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25年 1月25日現在 | | 平成25年 7月25日現在 | |
|---------------|----------|---------------|----------|
| 1口当たり純資産額 | 1.2416円 | 1口当たり純資産額 | 1.2494円 |
| (1万口当たり純資産額 | 12,416円) | (1万口当たり純資産額 | 12,494円) |

「TMA外国株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| | | 平成25年 1月25日現在 | 平成25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 | | 31,780,614 | 50,253,243 |
| コール・ローン | | 328,586,002 | 206,122,943 |
| 株式 | | 15,037,796,951 | 17,607,282,199 |
| 投資証券 | | 212,274,424 | 274,330,176 |
| 未収入金 | | | 925,961 |
| 未収配当金 | | 11,403,619 | 11,515,925 |
| 未収利息 | | 594 | 307 |
| 流動資産合計 | | 15,621,842,204 | 18,150,430,754 |
| 資産合計 | | 15,621,842,204 | 18,150,430,754 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払解約金 | | 55,505,711 | 28,554,941 |
| 流動負債合計 | | 55,505,711 | 28,554,941 |
| 負債合計 | | 55,505,711 | 28,554,941 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 13,235,199,065 | 12,704,793,488 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 2,331,137,428 | 5,417,082,325 |
| 元本等合計 | | 15,566,336,493 | 18,121,875,813 |
| 純資産合計 | | 15,566,336,493 | 18,121,875,813 |
| 負債純資産合計 | | 15,621,842,204 | 18,150,430,754 |

(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25年 1月26日 至 平成25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。 |

| | |
|----------------------------|---|
| 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> |
|----------------------------|---|

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 平成25年 1月25日現在 | 平成25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 | 13,223,639,965円 | 13,235,199,065円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,734,773,394円 | 1,659,396,928円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 2,723,214,294円 | 2,189,802,505円 |
| 同中間期末における元本額 | 13,235,199,065円 | 12,704,793,488円 |
| 元本の内訳* | | |
| 東京海上・外国株式ファンド | 113,331,712円 | 92,649,512円 |
| 東京海上・未来設計ファンド1 | 15,286,048円 | 11,768,650円 |
| 東京海上・未来設計ファンド2 | 46,054,103円 | 37,032,184円 |
| 東京海上・未来設計ファンド3 | 214,813,611円 | 174,630,859円 |
| 東京海上・未来設計ファンド4 | 132,420,747円 | 111,549,598円 |
| 東京海上・未来設計ファンド5 | 270,011,533円 | 236,829,036円 |
| 東京海上セレクション・外国株式 | 8,106,929,927円 | 8,039,471,767円 |
| 東京海上セレクション・バランス30 | 428,784,560円 | 393,750,184円 |
| 東京海上セレクション・バランス50 | 1,439,336,867円 | 1,365,873,036円 |
| 東京海上セレクション・バランス70 | 1,079,638,921円 | 1,082,766,653円 |
| TMAバランス25VA | | |
| 適格機関投資家限定 | 1,161,968,675円 | 950,459,706円 |
| TMAバランス50VA | | |
| 適格機関投資家限定 | 145,635,530円 | 128,738,343円 |
| TMAバランス75VA | | |
| 適格機関投資家限定 | 80,986,831円 | 79,273,960円 |
| 計 | 13,235,199,065円 | 12,704,793,488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 | 13,235,199,065口 | 12,704,793,488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25年 1月25日現在 | 平成25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 | <p>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。</p> | 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25年1月25日現在）

該当事項はありません。

（平成25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25年 1月25日現在 | | 平成25年 7月25日現在 | |
|---------------|----------|---------------|----------|
| 1口当たり純資産額 | 1.1761円 | 1口当たり純資産額 | 1.4264円 |
| （1万口当たり純資産額 | 11,761円） | （1万口当たり純資産額 | 14,264円） |

「TMA外国債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| | | 平成25年 1月25日現在 | 平成25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 | | 41,942,687 | 93,540,177 |

| | | | |
|-------------|---|----------------|----------------|
| コール・ローン | | 72,822,785 | 97,099,833 |
| 国債証券 | | 12,541,387,286 | 13,825,003,428 |
| 未収入金 | | | 611,280,507 |
| 未収利息 | | 128,815,191 | 88,727,839 |
| 前払費用 | | 15,610,252 | 29,170,241 |
| 流動資産合計 | | 12,800,578,201 | 14,744,822,025 |
| 資産合計 | | 12,800,578,201 | 14,744,822,025 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払金 | | | 617,749,859 |
| 未払解約金 | | 24,335,423 | 12,153,733 |
| 流動負債合計 | | 24,335,423 | 629,903,592 |
| 負債合計 | | 24,335,423 | 629,903,592 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 7,467,225,208 | 7,613,418,302 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 5,309,017,570 | 6,501,500,131 |
| 元本等合計 | | 12,776,242,778 | 14,114,918,433 |
| 純資産合計 | | 12,776,242,778 | 14,114,918,433 |
| 負債純資産合計 | | 12,800,578,201 | 14,744,822,025 |

(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25年 1月26日 至 平成25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> |
|----------------------------|---|

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 平成25年 1月25日現在 | 平成25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 | 7,203,832,339円 | 7,467,225,208円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 1,236,341,727円 | 891,476,756円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 972,948,858円 | 745,283,662円 |
| 同中間期末における元本額 | 7,467,225,208円 | 7,613,418,302円 |
| 元本の内訳* | | |
| 東京海上・外国債券ファンド | 87,759,986円 | 47,212,577円 |
| 東京海上・未来設計ファンド1 | 4,989,394円 | 4,355,292円 |
| 東京海上・未来設計ファンド2 | 20,041,248円 | 18,264,714円 |
| 東京海上・未来設計ファンド3 | 56,083,724円 | 51,656,354円 |
| 東京海上・未来設計ファンド4 | 24,697,105円 | 23,578,657円 |
| 東京海上・未来設計ファンド5 | 19,584,515円 | 19,462,019円 |
| 東京海上セレクション・外国債券 | 4,147,733,250円 | 4,173,497,406円 |
| 東京海上セレクション・バランス30 | 559,732,742円 | 582,779,355円 |
| 東京海上セレクション・バランス50 | 1,252,565,751円 | 1,347,680,511円 |
| 東京海上セレクション・バランス70 | 599,110,138円 | 681,097,508円 |
| TMA外国債券アクティブファンド <適格機関投資家限定> | 694,927,355円 | 663,833,909円 |
| 計 | 7,467,225,208円 | 7,613,418,302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 | 7,467,225,208口 | 7,613,418,302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25年 1月25日現在 | 平成25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。 | (1)有価証券 同左 |

| | | |
|----------------------------|---|--|
| | <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)に記載していません。</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>(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 | <p>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。</p> | 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25年1月25日現在)

該当事項はありません。

(平成25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25年 1月25日現在 | | 平成25年 7月25日現在 | |
|---------------|----------|---------------|----------|
| 1口当たり純資産額 | 1.7110円 | 1口当たり純資産額 | 1.8540円 |
| (1万口当たり純資産額 | 17,110円) | (1万口当たり純資産額 | 18,540円) |

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

平成25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25年8月30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 | 6,963 |
| 追加型株式投資信託 | 120 | 1,850,974 |
| 単位型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 単位型株式投資信託 | 13 | 68,269 |
| 合計 | 134 | 1,926,206 |

(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28期事業年度（平成24年4月1日から平成25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27期 （平成24年3月31日現在） | | 第28期 （平成25年3月31日現在） | |
|--------------|------------------------|-------------------|------------------------|-------------------|
| 資産の部 | | | | |
| 流動資産 | | | | |
| 現金・預金 | | 5,761,145 | | 6,753,091 |
| 前払費用 | | 137,793 | | 134,096 |
| 未収委託者報酬 | | 1,436,947 | | 1,616,237 |
| 未収収益 | | 1,777,274 | | 2,117,109 |
| 未収入金 | | 8,319 | | 153,977 |
| 繰延税金資産 | | 190,994 | | 189,883 |
| その他の流動資産 | | 13,153 | | 6,634 |
| 流動資産計 | | 9,325,628 | | 10,971,029 |
| 固定資産 | | | | |
| 有形固定資産 | * 1 | 259,429 | * 1 | 217,693 |
| 建物 | | 153,031 | | 122,475 |
| 器具備品 | | 106,397 | | 95,217 |
| 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 | | 929,396 | | 815,403 |
| 投資有価証券 | | 16,664 | | 19,427 |
| 関係会社株式 | | 254,342 | | 254,342 |
| その他の関係会社有価証券 | | 31,200 | | 31,200 |
| 長期前払費用 | | 143,968 | | 95,530 |
| 敷金 | | 361,849 | | 291,959 |
| 繰延税金資産 | | 121,371 | | 122,944 |
| 固定資産計 | | 1,191,969 | | 1,036,240 |
| 資産合計 | | 10,517,598 | | 12,007,270 |
| 負債の部 | | | | |
| 流動負債 | | | | |
| 預り金 | | 28,305 | | 30,099 |
| 未払金 | * 2 | 1,318,980 | * 2 | 1,569,259 |
| 未払手数料 | | 388,412 | | 454,177 |
| その他未払金 | | 930,567 | | 1,115,081 |
| 未払費用 | | 52,898 | | 57,434 |
| 未払消費税等 | | 67,999 | | 85,291 |
| 未払法人税等 | | 544,000 | | 596,000 |
| 前受収益 | | 415,827 | | 317,700 |
| 賞与引当金 | | 207,304 | | 191,919 |
| その他の流動負債 | | 787 | | - |
| 流動負債計 | | 2,636,103 | | 2,847,704 |
| 固定負債 | | | | |
| 退職給付引当金 | | 115,077 | | 137,928 |
| 役員退職慰労引当金 | | 25,260 | | 31,080 |
| 固定負債計 | | 140,337 | | 169,008 |
| 負債合計 | | 2,776,440 | | 3,016,712 |
| 純資産の部 | | | | |
| 株主資本 | | 7,741,052 | | 8,989,342 |

| | | |
|--------------|------------|------------|
| 資本金 | 2,000,000 | 2,000,000 |
| 利益剰余金 | 5,741,052 | 6,989,342 |
| 利益準備金 | 388,426 | 443,612 |
| その他利益剰余金 | 5,352,625 | 6,545,729 |
| 繰越利益剰余金 | 5,352,625 | 6,545,729 |
| 評価・換算差額等 | 105 | 1,215 |
| その他有価証券評価差額金 | 105 | 1,215 |
| 純資産合計 | 7,741,157 | 8,990,558 |
| 負債・純資産合計 | 10,517,598 | 12,007,270 |

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

| | 第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日) | 第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日) |
|-------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 5,441,098 | 6,959,798 |
| 運用受託報酬 | 6,132,962 | 6,585,557 |
| 投資助言報酬 | 24,836 | 20,963 |
| その他営業収益 | 1,992 | 1,992 |
| 営業収益計 | 11,600,891 | 13,568,311 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 1,957,922 | 2,732,478 |
| 広告宣伝費 | 117,675 | 133,560 |
| 公告費 | 2,281 | 2,244 |
| 調査費 | 3,263,965 | 3,642,781 |
| 調査費 | 1,195,887 | 1,160,919 |
| 委託調査費 | * 1 2,068,077 | * 1 2,481,861 |
| 委託計算費 | 85,593 | 82,588 |
| 営業雑経費 | 127,614 | 128,344 |
| 通信費 | 31,372 | 28,568 |
| 印刷費 | 69,710 | 72,899 |
| 協会費 | 14,644 | 16,766 |
| 諸会費 | 4,391 | 4,213 |
| 図書費 | 7,495 | 5,896 |
| 営業費用計 | 5,555,052 | 6,721,997 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | 2,399,236 | 2,441,088 |
| 役員報酬 | 71,115 | 69,444 |
| 給料・手当 | * 1 1,730,916 | * 1 1,755,780 |
| 賞与 | 597,205 | 615,864 |
| 交際費 | 10,606 | 7,417 |
| 旅費交通費 | 100,354 | 99,221 |
| 租税公課 | 41,500 | 44,567 |
| 不動産賃借料 | 343,381 | 343,381 |
| 役員退職慰労引当金繰入 | 7,090 | 5,820 |
| 退職給付費用 | 72,098 | 70,091 |
| 賞与引当金繰入 | 207,304 | 191,919 |
| 固定資産減価償却費 | 99,879 | 91,309 |
| 法定福利費 | 381,465 | 395,650 |
| 福利厚生費 | 9,181 | 7,867 |
| 諸経費 | 377,049 | 408,719 |
| 一般管理費計 | 4,049,148 | 4,107,055 |
| 営業利益 | 1,996,689 | 2,739,259 |
| 営業外収益 | | |
| 受取配当金 | * 1 115,821 | * 1 145,322 |
| 受取利息 | 1,091 | 1,151 |
| 雑益 | 1,064 | 2,410 |
| 営業外収益計 | 117,976 | 148,885 |

| | | |
|--------------|-----------|-----------|
| 営業外費用 | | |
| 雑損 | 32,361 | 46,933 |
| 営業外費用計 | 32,361 | 46,933 |
| 経常利益 | 2,082,305 | 2,841,210 |
| 特別損失 | | |
| 器具備品除却損 | 71 | 911 |
| 特別損失計 | 71 | 911 |
| 税引前当期純利益 | 2,082,233 | 2,840,299 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 924,989 | 1,041,220 |
| 法人税等調整額 | 21,996 | 1,076 |
| 法人税等合計 | 946,985 | 1,040,144 |
| 当期純利益 | 1,135,247 | 1,800,154 |

(3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

| | 第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日) | 第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25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 | 334,429 | 388,426 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 53,996 | 55,186 |
| 当期変動額合計 | 53,996 | 55,186 |
| 当期末残高 | 388,426 | 443,612 |
| その他利益剰余金 | | |
| 繰越利益剰余金 | | |
| 当期首残高 | 4,811,339 | 5,352,625 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 593,960 | 607,051 |
| 当期純利益 | 1,135,247 | 1,800,154 |
| 当期変動額合計 | 541,286 | 1,193,103 |
| 当期末残高 | 5,352,625 | 6,545,729 |
| 利益剰余金合計 | | |
| 当期首残高 | 5,145,769 | 5,741,052 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 539,964 | 551,864 |
| 当期純利益 | 1,135,247 | 1,800,154 |
| 当期変動額合計 | 595,282 | 1,248,290 |
| 当期末残高 | 5,741,052 | 6,989,342 |
| 株主資本合計 | | |
| 当期首残高 | 7,145,769 | 7,741,052 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 539,964 | 551,864 |
| 当期純利益 | 1,135,247 | 1,800,154 |
| 当期変動額合計 | 595,282 | 1,248,290 |
| 当期末残高 | 7,741,052 | 8,989,342 |

| | | |
|-------------------------|-----------|-----------|
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | | |
| 当期首残高 | 47 | 105 |
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | 153 | 1,109 |
| 当期変動額合計 | 153 | 1,109 |
| 当期末残高 | 105 | 1,215 |
| 評価・換算差額等合計 | | |
| 当期首残高 | 47 | 105 |
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | 153 | 1,109 |
| 当期変動額合計 | 153 | 1,109 |
| 当期末残高 | 105 | 1,215 |
| 純資産合計 | | |
| 当期首残高 | 7,145,721 | 7,741,157 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 539,964 | 551,864 |
| 当期純利益 | 1,135,247 | 1,800,154 |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | 153 | 1,109 |
| 当期変動額合計 | 595,436 | 1,249,400 |
| 当期末残高 | 7,741,157 | 8,990,558 |

重要な会計方針

| 第28期 自 平成24年4月1日 至 平成25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、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(会計方針の変更)

第28期

自 平成24年4月1日
至 平成25年3月31日

(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更)

当社は、法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以降に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

なお、この変更による当事業年度の損益に与える影響額は軽微であります。

(表示方法の変更)

第28期

自 平成24年4月1日
至 平成25年3月31日

前事業年度において、「流動資産」の「その他の流動資産」に含めていた「未収入金」は資産の総額の100分の1を越えたため、当事業年度より独立掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他の流動資産」に表示していた21,473千円は、「未収入金」8,319千円、「その他の流動資産」13,153千円として組み替えております。

(会計上の見積りの変更)

第28期

自 平成24年4月1日
至 平成25年3月31日

当事業年度において、本社事務所の一部解約申し込みを行ったため、当該一部解約に係る建物附属設備の耐用年数、原状回復義務の費用総額及び履行時期の見積りの変更を行っております。なお、原状回復工事は当事業年度末において完了しております。これにより、当該変更前と比べて、当事業年度の固定資産減価償却費が17,384千円、諸経費が16,224千円それぞれ増加し、営業利益、経常利益がそれぞれ33,609千円減少しておりますが、当該変更により特別損失が33,609千円減少していることから、税引前当期純利益に与える影響はありません。

注記事項

(貸借対照表関係)

| 第27期 平成24年3月31日現在 | 第28期 平成25年3月31日現在 | | | | | | | | |
|--|--|----------|------|-----------|---|----|-----------|------|-----------|
| <p>* 1. 有形固定資産の減価償却累計額は次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">建物</td> <td style="text-align: right;">95,026千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">401,705千円</td> </tr> </table> | 建物 | 95,026千円 | 器具備品 | 401,705千円 | <p>* 1. 有形固定資産の減価償却累計額は次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">建物</td> <td style="text-align: right;">103,012千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">418,700千円</td> </tr> </table> | 建物 | 103,012千円 | 器具備品 | 418,700千円 |
| 建物 | 95,026千円 | | | | | | | | |
| 器具備品 | 401,705千円 | | | | | | | | |
| 建物 | 103,012千円 | | | | | | | | |
| 器具備品 | 418,700千円 | | | | | | | | |
| <p>* 2. 関係会社に対する主な資産・負債</p> <p>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とおりであります。</p> | <p>* 2. 関係会社に対する主な資産・負債</p> <p>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とおりであります。</p> | | | | | | | | |

| | | | |
|----------------|------------|----------------|------------|
| 未払金 | 576,853千円 | 未払金 | 709,361千円 |
| (うち支配株主に対するもの) | 124,843千円) | (うち支配株主に対するもの) | 142,986千円) |
| (うち子会社に対するもの) | 123,032千円) | (うち子会社に対するもの) | 150,208千円) |
| (うち関連会社に対するもの) | 328,978千円) | (うち関連会社に対するもの) | 416,166千円) |

(損益計算書関係)

| 第27期 自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日 | 第28期 自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日 | | |
|-------------------------------------|-------------------------------------|-------|-------------|
| * 1. 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。 | * 1. 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。 | | |
| 給与・手当 | 473,719千円 | 給与・手当 | 531,681千円 |
| 委託調査費 | 1,576,497千円 | 委託調査費 | 1,737,827千円 |
| 受取配当金 | 115,821千円 | 受取配当金 | 145,225千円 |

(株主資本等変動計算書関係)

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 |

第28期(自 平成24年4月1日 至 平成25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24年4月1日 現在 | 増加 | 減少 | 平成25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) 1株当たり配当額 | 14,409円 |
| (ハ) 基準日 | 平成24年3月31日 |
| (ニ) 効力発生日 | 平成24年6月27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25年6月28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 | 907,786千円 |
| (ロ) 配当の原資 | 利益剰余金 |
| (ハ) 1株当たり配当額 | 23,702円 |
| (ニ) 基準日 | 平成25年3月31日 |
| (ホ) 効力発生日 | 平成25年6月28日 |

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

| 第27期 自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日 | 第28期 自 平成24年4月1日 至 平成25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)未収入金 | 8,319 | 8,319 | |
| (5)投資有価証券 其他有価証券 | 16,664 | 16,664 | |
| (6)敷金 | 361,849 | 258,063 | 103,786 |
| (7)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。

第28期(平成25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 | 6,753,091 | 6,753,091 | |
| (2)未収委託者報酬 | 1,616,237 | 1,616,237 | |
| (3)未収収益 | 2,117,109 | 2,117,109 | |
| (4)未収入金 | 153,977 | 153,977 | |
| (5)投資有価証券 其他有価証券 | 19,427 | 19,427 | |
| (6)敷金 | 291,959 | 218,507 | 73,451 |
| (7)未払金 | (1,569,259) | (1,569,259) | |

(＊)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並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

| 第27期 平成24年3月31日現在 | 第28期 平成25年3月31日現在 |
|---|--|
| (1)現金・預金、(2)未収委託者報酬(3)未収収益並びに(4)未収入金及び(7)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(3)未収収益並びに(4)未収入金及び(7)未払金 同左 |
| (5)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。 | (5)投資有価証券 同左 |
| (6)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。 | (6)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27期 平成24年3月31日現在 | 第28期 平成25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 |
| 子会社株式 | 221,595 | 子会社株式 | 221,595 |
| 関連会社株式 | 32,747 | 関連会社株式 | 32,747 |
| その他の関係会社 有価証券 | 31,200 | その他の関係会社 有価証券 | 31,200 |

(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27期 平成24年3月31日現在 | 第28期 平成25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27期 平成24年3月31日現在 | | | 第28期 平成25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 | 5,761,116 | | 預金 | 6,752,981 | |
| 未収委託者報酬 | 1,436,947 | | 未収委託者報酬 | 1,616,237 | |
| 未収収益 | 1,777,274 | | 未収収益 | 2,117,109 | |
| 未収入金 | 8,319 | | 未収入金 | 153,977 | |
| 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 | 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 | 8,983,657 | 1,000 | 合計 | 10,640,305 | 1,000 |

(有価証券関係)

| | |
|--|--|
| 第27期 平成24年3月31日現在 | 第28期 平成25年3月31日現在 |
| <p>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> <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、記載しておりません。</p> <p>2. その他有価証券</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> | <p>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> <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、記載しておりません。</p> <p>2. その他有価証券</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> |

| 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 | 15,700 | 15,500 | 200 | 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 | 16,177 | 14,138 | 2,038 |
| 貸借対照 表計上額が 取得原価を 超えないもの 証券投資 信託 | 964 | 1,000 | 35 | 貸借対照 表計上額が 取得原価を 超えないもの 証券投資 信託 | 3,250 | 3,400 | 149 |
| 合計 | 16,664 | 16,500 | 164 | 合計 | 19,427 | 17,538 | 1,888 |
| 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。 | | | | 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 同左 | | | |

(退職給付関係)

| 第27期 自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日 | 第28期 自 平成24年4月1日 至 平成25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 115,077千円 退職給付引当金 115,077千円 | 2. 退職給付債務に関する事項 退職給付債務 137,928千円 退職給付引当金 137,928千円 |
| 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 | 3. 退職給付費用に関する事項 勤務費用 39,545千円 確定拠出年金への掛金支払額 30,545千円 退職給付費用 70,091千円 |
| 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的主要原因別の内訳

| | 第27期 (平成24年3月31日現在) | 第28期 (平成25年3月31日現在) |
|------------------|------------------------|------------------------|
| 繰延税金資産 | | |
| 役員退職慰労引当金 | 9,601千円 | 11,813千円 |
| 退職給付引当金損金算入限度超過額 | 41,013千円 | 49,157千円 |
| 未払金 | 13,175千円 | 5,774千円 |
| 賞与引当金損金算入限度超過額 | 78,796千円 | 72,948千円 |
| 未払法定福利費否認 | 9,234千円 | 8,973千円 |
| 未払事業所税否認 | 3,362千円 | 3,438千円 |
| 未払事業税否認 | 40,452千円 | 50,026千円 |

| | | |
|-------------|-----------|-----------|
| 未払調査費 | 41,860千円 | 46,965千円 |
| ソフトウェア償却超過額 | 63,265千円 | 54,426千円 |
| 敷金償却費 | 7,550千円 | 8,223千円 |
| 未払確定拠出年金 | 927千円 | 982千円 |
| 未払費用 | 3,185千円 | 774千円 |
| 繰延税金資産小計 | 312,424千円 | 313,504千円 |
| 評価性引当額 | - | - |
| 繰延税金資産合計 | 312,424千円 | 313,504千円 |
| 繰延税金負債 | | |
| 其他有価証券評価差額金 | 58千円 | 673千円 |
| その他 | - | 3千円 |
| 繰延税金負債合計 | 58千円 | 677千円 |
| 繰延税金資産の純額 | 312,365千円 | 312,827千円 |

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27期 (平成24年3月31日現在) | | 第28期 (平成25年3月31日現在) |
|--------------------------|-------|---|
| 法定実効税率 | 40.7% | 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100分の5以下であるため注記を省略しております。 |
| (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% | |

(セグメント情報等)

| 第27期 自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日 | 第28期 自 平成24年4月1日 至 平成25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>[セグメント情報]</p> <p>同左</p> |

| [関連情報] | [関連情報] |
|---|---|
| <p>1. 製品及びサービスごとの情報 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 (1) 営業収益 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。 (2) 有形固定資産 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 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せん。</p> | <p>1. 製品及びサービスごとの情報 同左</p> <p>2. 地域ごとの情報 (1) 営業収益 同左 (2) 有形固定資産 同左</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報 当社は、単一の外部顧客からの収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。</p> |

(関連当事者情報)

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。

第28期(自平成24年4月1日至平成25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 | 1,428,822 | 未払金 | 416,166 |

(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27期 自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日 | 第28期 自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日 |
|------------------|--|--|
| 1株当たり純資産額 | 202,119円00銭 | 234,740円42銭 |
| 1株当たり当期純利益 金額 | 29,640円93銭 | 47,001円44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 1,135,247千円 | 当期純利益 1,800,154千円 |
| | 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 1,135,247千円 | 普通株式に係る 当期純利益 1,800,154千円 |
| | 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25年9月4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 涉
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25年1月26日から平成25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25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25年1月26日から平成25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XBR 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25年9月4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25年1月26日から平成25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25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25年1月26日から平成25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XBRL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25年9月4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 涉
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25年1月26日から平成25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25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25年1月26日から平成25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XBR 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25年9月4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 涉
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25年1月26日から平成25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25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25年1月26日から平成25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XBRL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25年9月4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 涉
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25年1月26日から平成25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25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25年1月26日から平成25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XBR 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25年6月28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
業務執行社員指定社員 公認会計士 奈良 昌彦
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、「委託会社等の経営状況」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24年4月1日から平成25年3月31日までの第28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25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。