

【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28年10月25日
【計算期間】	第16期中（自 平成28年1月26日 至 平成28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株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 大庭 雅志
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2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8番2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28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	39,694,791	69.81
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		17,165,413	30.18
合計（純資産総額）		56,860,204	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	96,526,820	84.93
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		17,117,725	15.06
合計（純資産総額）		113,644,545	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	293,090,379	95.07
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		15,171,495	4.92
合計（純資産総額）		308,261,874	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	97,622,923	95.09
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		5,030,267	4.90
合計（純資産総額）		102,653,190	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	312,964,356	100.20
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		647,997	0.20
合計（純資産総額）		312,316,359	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	33,577,741,130	98.98
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		345,045,641	1.01
合計（純資産総額）		33,922,786,771	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	54,015,212,900	71.30
地方債証券	日本	2,114,604,500	2.79
特殊債券	日本	1,776,837,360	2.34
社債券	日本	17,221,641,074	22.73
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		620,410,925	0.81
合計(純資産総額)		75,748,706,759	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	15,222,827,648	69.13
	カナダ	171,426,165	0.77
	ドイツ	320,548,419	1.45
	イタリア	187,697,261	0.85
	フランス	500,737,143	2.27
	オーストラリア	462,545,017	2.10
	イギリス	792,535,643	3.59
	スイス	1,314,010,613	5.96
	香港	57,349,600	0.26
	シンガポール	111,659,400	0.50
	オランダ	472,530,209	2.14
	スペイン	109,246,181	0.49
	ベルギー	475,178,355	2.15
	スウェーデン	189,607,680	0.86
	ノルウェー	96,656,706	0.43
	デンマーク	355,305,102	1.61
	アイルランド	188,184,843	0.85
キュラソー	83,204,352	0.37	
小計		21,111,250,337	95.88
投資証券	アメリカ	292,050,990	1.32
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		614,757,993	2.79
合計(純資産総額)		22,018,059,320	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	6,519,651,016	39.36
	カナダ	310,586,439	1.87
	ドイツ	1,642,471,522	9.91
	イタリア	2,020,064,511	12.19
	フランス	1,384,454,004	8.35
	オーストラリア	293,063,992	1.76
	イギリス	1,286,204,122	7.76
	シンガポール	61,094,940	0.36
	マレーシア	60,811,438	0.36

	スペイン	1,119,779,447	6.76
	ベルギー	333,915,956	2.01
	スウェーデン	68,075,028	0.41
	ノルウェー	76,179,408	0.45
	デンマーク	86,782,836	0.52
	メキシコ	448,332,500	2.70
	アイルランド	103,342,923	0.62
	ポーランド	91,163,424	0.55
	南アフリカ	62,344,006	0.37
	小計	15,968,317,512	96.40
	コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)	594,960,056	3.59
	合計(純資産総額)	16,563,277,568	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)
第6計算期間末	(平成19年 1月25日)	64	64	1.0832	1.0832
第7計算期間末	(平成20年 1月25日)	82	82	1.0562	1.0562
第8計算期間末	(平成21年 1月26日)	97	97	0.9252	0.9252
第9計算期間末	(平成22年 1月25日)	125	125	0.9968	0.9968
第10計算期間末	(平成23年 1月25日)	148	148	1.0116	1.0116
第11計算期間末	(平成24年 1月25日)	159	159	0.9912	0.9912
第12計算期間末	(平成25年 1月25日)	166	166	1.0589	1.0589
第13計算期間末	(平成26年 1月27日)	93	93	1.1491	1.1491
第14計算期間末	(平成27年 1月26日)	52	52	1.2191	1.2191
第15計算期間末	(平成28年 1月25日)	60	60	1.2130	1.2130
	平成27年 8月末日	60	-	1.2283	-
	9月末日	60	-	1.2127	-
	10月末日	61	-	1.2380	-
	11月末日	61	-	1.2411	-
	12月末日	61	-	1.2384	-
	平成28年 1月末日	60	-	1.2237	-
	2月末日	56	-	1.2138	-
	3月末日	57	-	1.2305	-
	4月末日	57	-	1.2320	-
	5月末日	57	-	1.2405	-
	6月末日	56	-	1.2238	-
	7月末日	57	-	1.2315	-
	8月末日	56	-	1.2204	-

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)
第6計算期間末	(平成19年 1月25日)	123	123	1.1636	1.1636
第7計算期間末	(平成20年 1月25日)	141	141	1.0996	1.0996
第8計算期間末	(平成21年 1月26日)	163	163	0.8594	0.8594
第9計算期間末	(平成22年 1月25日)	236	236	0.9724	0.9724
第10計算期間末	(平成23年 1月25日)	281	281	0.9868	0.9868
第11計算期間末	(平成24年 1月25日)	289	289	0.9410	0.9410
第12計算期間末	(平成25年 1月25日)	339	339	1.0473	1.0473
第13計算期間末	(平成26年 1月27日)	190	190	1.2030	1.2030
第14計算期間末	(平成27年 1月26日)	115	115	1.3178	1.3178
第15計算期間末	(平成28年 1月25日)	113	113	1.3045	1.3045
平成27年 8月末日		118	-	1.3424	-
9月末日		116	-	1.3104	-
10月末日		120	-	1.3570	-
11月末日		120	-	1.3640	-
12月末日		117	-	1.3556	-
平成28年 1月末日		114	-	1.3217	-
2月末日		112	-	1.2925	-
3月末日		114	-	1.3202	-
4月末日		114	-	1.3184	-
5月末日		116	-	1.3332	-
6月末日		113	-	1.2944	-
7月末日		114	-	1.3138	-
8月末日		113	-	1.2982	-

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)
第6計算期間末	(平成19年 1月25日)	364	364	1.2402	1.2402
第7計算期間末	(平成20年 1月25日)	488	488	1.1243	1.1243
第8計算期間末	(平成21年 1月26日)	469	469	0.7701	0.7701
第9計算期間末	(平成22年 1月25日)	715	715	0.9240	0.9240
第10計算期間末	(平成23年 1月25日)	832	832	0.9438	0.9438
第11計算期間末	(平成24年 1月25日)	803	803	0.8695	0.8695
第12計算期間末	(平成25年 1月25日)	963	963	1.0092	1.0092
第13計算期間末	(平成26年 1月27日)	598	598	1.2338	1.2338
第14計算期間末	(平成27年 1月26日)	348	348	1.3984	1.3984
第15計算期間末	(平成28年 1月25日)	319	319	1.3710	1.3710
平成27年 8月末日		333	-	1.4403	-
9月末日		322	-	1.3853	-
10月末日		339	-	1.4616	-

11月末日	342	-	1.4736	-
12月末日	339	-	1.4579	-
平成28年 1月末日	324	-	1.3932	-
2月末日	312	-	1.3434	-
3月末日	317	-	1.3844	-
4月末日	314	-	1.3807	-
5月末日	319	-	1.4023	-
6月末日	304	-	1.3365	-
7月末日	312	-	1.3712	-
8月末日	308	-	1.3516	-

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)
第6計算期間末	(平成19年 1月25日)	201	201	1.2860	1.2860
第7計算期間末	(平成20年 1月25日)	228	228	1.1162	1.1162
第8計算期間末	(平成21年 1月26日)	189	189	0.6516	0.6516
第9計算期間末	(平成22年 1月25日)	309	309	0.8266	0.8266
第10計算期間末	(平成23年 1月25日)	363	363	0.8466	0.8466
第11計算期間末	(平成24年 1月25日)	345	345	0.7502	0.7502
第12計算期間末	(平成25年 1月25日)	430	430	0.9044	0.9044
第13計算期間末	(平成26年 1月27日)	240	240	1.1727	1.1727
第14計算期間末	(平成27年 1月26日)	136	136	1.3695	1.3695
第15計算期間末	(平成28年 1月25日)	104	104	1.3263	1.3263
	平成27年 8月末日	113	-	1.4264	-
	9月末日	108	-	1.3508	-
	10月末日	116	-	1.4514	-
	11月末日	115	-	1.4678	-
	12月末日	113	-	1.4446	-
	平成28年 1月末日	106	-	1.3507	-
	2月末日	100	-	1.2817	-
	3月末日	106	-	1.3317	-
	4月末日	105	-	1.3254	-
	5月末日	108	-	1.3516	-
	6月末日	100	-	1.2622	-
	7月末日	104	-	1.3102	-
	8月末日	102	-	1.2895	-

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)
第6計算期間末	(平成19年 1月25日)	265	265	1.3290	1.3290
第7計算期間末	(平成20年 1月25日)	301	301	1.1040	1.1040

第8計算期間末	(平成21年 1月26日)	257	257	0.5602	0.5602
第9計算期間末	(平成22年 1月25日)	475	475	0.7473	0.7473
第10計算期間末	(平成23年 1月25日)	571	571	0.7711	0.7711
第11計算期間末	(平成24年 1月25日)	536	536	0.6588	0.6588
第12計算期間末	(平成25年 1月25日)	691	691	0.8168	0.8168
第13計算期間末	(平成26年 1月27日)	496	496	1.1184	1.1184
第14計算期間末	(平成27年 1月26日)	342	342	1.3412	1.3412
第15計算期間末	(平成28年 1月25日)	328	328	1.2842	1.2842
平成27年 8月末日		358	-	1.4109	-
9月末日		337	-	1.3156	-
10月末日		368	-	1.4398	-
11月末日		374	-	1.4604	-
12月末日		365	-	1.4318	-
平成28年 1月末日		335	-	1.3100	-
2月末日		314	-	1.2287	-
3月末日		333	-	1.2871	-
4月末日		330	-	1.2813	-
5月末日		328	-	1.3119	-
6月末日		301	-	1.2054	-
7月末日		317	-	1.2638	-
8月末日		312	-	1.2411	-

【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	計算期間	収益率(%) (分配付)
第6計算期間	平成18年 1月26日 ~ 平成19年 1月25日	2.9
第7計算期間	平成19年 1月26日 ~ 平成20年 1月25日	2.5
第8計算期間	平成20年 1月26日 ~ 平成21年 1月26日	12.4
第9計算期間	平成21年 1月27日 ~ 平成22年 1月25日	7.7
第10計算期間	平成22年 1月26日 ~ 平成23年 1月25日	1.5
第11計算期間	平成23年 1月26日 ~ 平成24年 1月25日	2.0
第12計算期間	平成24年 1月26日 ~ 平成25年 1月25日	6.8

第13計算期間	平成25年 1月26日～平成26年 1月27日	8.5
第14計算期間	平成26年 1月28日～平成27年 1月26日	6.1
第15計算期間	平成27年 1月27日～平成28年 1月25日	0.5
第16中間計算期間	平成28年 1月26日～平成28年 7月25日	2.0

東京海上・未来設計ファンド2

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第6計算期間	平成18年 1月26日～平成19年 1月25日	4.9
第7計算期間	平成19年 1月26日～平成20年 1月25日	5.5
第8計算期間	平成20年 1月26日～平成21年 1月26日	21.8
第9計算期間	平成21年 1月27日～平成22年 1月25日	13.1
第10計算期間	平成22年 1月26日～平成23年 1月25日	1.5
第11計算期間	平成23年 1月26日～平成24年 1月25日	4.6
第12計算期間	平成24年 1月26日～平成25年 1月25日	11.3
第13計算期間	平成25年 1月26日～平成26年 1月27日	14.9
第14計算期間	平成26年 1月28日～平成27年 1月26日	9.5
第15計算期間	平成27年 1月27日～平成28年 1月25日	1.0
第16中間計算期間	平成28年 1月26日～平成28年 7月25日	1.3

東京海上・未来設計ファンド3

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第6計算期間	平成18年 1月26日～平成19年 1月25日	7.7
第7計算期間	平成19年 1月26日～平成20年 1月25日	9.3
第8計算期間	平成20年 1月26日～平成21年 1月26日	31.5
第9計算期間	平成21年 1月27日～平成22年 1月25日	20.0
第10計算期間	平成22年 1月26日～平成23年 1月25日	2.1
第11計算期間	平成23年 1月26日～平成24年 1月25日	7.9
第12計算期間	平成24年 1月26日～平成25年 1月25日	16.1
第13計算期間	平成25年 1月26日～平成26年 1月27日	22.3
第14計算期間	平成26年 1月28日～平成27年 1月26日	13.3
第15計算期間	平成27年 1月27日～平成28年 1月25日	2.0
第16中間計算期間	平成28年 1月26日～平成28年 7月25日	0.8

東京海上・未来設計ファンド4

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第6計算期間	平成18年 1月26日～平成19年 1月25日	10.6
第7計算期間	平成19年 1月26日～平成20年 1月25日	13.2
第8計算期間	平成20年 1月26日～平成21年 1月26日	41.6
第9計算期間	平成21年 1月27日～平成22年 1月25日	26.9
第10計算期間	平成22年 1月26日～平成23年 1月25日	2.4
第11計算期間	平成23年 1月26日～平成24年 1月25日	11.4
第12計算期間	平成24年 1月26日～平成25年 1月25日	20.6
第13計算期間	平成25年 1月26日～平成26年 1月27日	29.7
第14計算期間	平成26年 1月28日～平成27年 1月26日	16.8

第15計算期間	平成27年 1月27日～平成28年 1月25日	3.2
第16中間計算期間	平成28年 1月26日～平成28年 7月25日	0.3

東京海上・未来設計ファンド5

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第6計算期間	平成18年 1月26日～平成19年 1月25日	13.0
第7計算期間	平成19年 1月26日～平成20年 1月25日	16.9
第8計算期間	平成20年 1月26日～平成21年 1月26日	49.3
第9計算期間	平成21年 1月27日～平成22年 1月25日	33.4
第10計算期間	平成22年 1月26日～平成23年 1月25日	3.2
第11計算期間	平成23年 1月26日～平成24年 1月25日	14.6
第12計算期間	平成24年 1月26日～平成25年 1月25日	24.0
第13計算期間	平成25年 1月26日～平成26年 1月27日	36.9
第14計算期間	平成26年 1月28日～平成27年 1月26日	19.9
第15計算期間	平成27年 1月27日～平成28年 1月25日	4.2
第16中間計算期間	平成28年 1月26日～平成28年 7月25日	0.6

2【設定及び解約の実績】

東京海上・未来設計ファンド1

期	計算期間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第6計算期間	平成18年 1月26日～平成19年 1月25日	22,651,263	6,514,385	59,862,182
第7計算期間	平成19年 1月26日～平成20年 1月25日	25,556,793	7,624,816	77,794,159
第8計算期間	平成20年 1月26日～平成21年 1月26日	37,332,571	10,206,491	104,920,239
第9計算期間	平成21年 1月27日～平成22年 1月25日	36,705,403	15,345,850	126,279,792
第10計算期間	平成22年 1月26日～平成23年 1月25日	37,871,070	17,505,959	146,644,903
第11計算期間	平成23年 1月26日～平成24年 1月25日	34,496,983	20,370,872	160,771,014
第12計算期間	平成24年 1月26日～平成25年 1月25日	28,698,960	32,010,990	157,458,984
第13計算期間	平成25年 1月26日～平成26年 1月27日	23,163,207	99,509,232	81,112,959
第14計算期間	平成26年 1月28日～平成27年 1月26日	5,841,745	44,072,766	42,881,938
第15計算期間	平成27年 1月27日～平成28年 1月25日	9,233,966	2,101,106	50,014,798
第16中間計算期間	平成28年 1月26日～平成28年 7月25日	1,100,770	4,664,468	46,451,100

東京海上・未来設計ファンド2

期	計算期間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第6計算期間	平成18年 1月26日～平成19年 1月25日	41,334,823	11,347,041	105,948,898
第7計算期間	平成19年 1月26日～平成20年 1月25日	40,629,266	17,717,216	128,860,948
第8計算期間	平成20年 1月26日～平成21年 1月26日	73,073,035	11,173,463	190,760,520
第9計算期間	平成21年 1月27日～平成22年 1月25日	63,854,449	11,356,270	243,258,699
第10計算期間	平成22年 1月26日～平成23年 1月25日	56,319,653	13,954,679	285,623,673
第11計算期間	平成23年 1月26日～平成24年 1月25日	45,395,643	23,285,133	307,734,183
第12計算期間	平成24年 1月26日～平成25年 1月25日	39,374,423	23,261,477	323,847,129
第13計算期間	平成25年 1月26日～平成26年 1月27日	28,888,841	194,749,571	157,986,399
第14計算期間	平成26年 1月28日～平成27年 1月26日	4,050,521	74,407,868	87,629,052

第15計算期間	平成27年 1月27日～平成28年 1月25日	4,864,370	5,540,376	86,953,046
第16中間計算期間	平成28年 1月26日～平成28年 7月25日	1,087,846	552,246	87,488,646

東京海上・未来設計ファンド3

期	計算期間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第6計算期間	平成18年 1月26日～平成19年 1月25日	163,481,939	54,900,579	293,854,195
第7計算期間	平成19年 1月26日～平成20年 1月25日	187,902,847	47,641,965	434,115,077
第8計算期間	平成20年 1月26日～平成21年 1月26日	205,431,322	29,707,283	609,839,116
第9計算期間	平成21年 1月27日～平成22年 1月25日	192,952,697	27,921,373	774,870,440
第10計算期間	平成22年 1月26日～平成23年 1月25日	161,275,362	54,304,533	881,841,269
第11計算期間	平成23年 1月26日～平成24年 1月25日	144,653,233	102,609,800	923,884,702
第12計算期間	平成24年 1月26日～平成25年 1月25日	119,278,758	88,215,089	954,948,371
第13計算期間	平成25年 1月26日～平成26年 1月27日	73,752,393	543,734,066	484,966,698
第14計算期間	平成26年 1月28日～平成27年 1月26日	10,117,954	246,106,886	248,977,766
第15計算期間	平成27年 1月27日～平成28年 1月25日	4,033,614	20,039,131	232,972,249
第16中間計算期間	平成28年 1月26日～平成28年 7月25日	1,413,499	6,448,274	227,937,474

東京海上・未来設計ファンド4

期	計算期間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第6計算期間	平成18年 1月26日～平成19年 1月25日	70,263,238	16,353,009	156,891,297
第7計算期間	平成19年 1月26日～平成20年 1月25日	77,064,597	29,066,650	204,889,244
第8計算期間	平成20年 1月26日～平成21年 1月26日	100,935,972	14,469,791	291,355,425
第9計算期間	平成21年 1月27日～平成22年 1月25日	105,614,259	22,073,427	374,896,257
第10計算期間	平成22年 1月26日～平成23年 1月25日	84,747,601	30,570,372	429,073,486
第11計算期間	平成23年 1月26日～平成24年 1月25日	72,681,839	41,619,006	460,136,319
第12計算期間	平成24年 1月26日～平成25年 1月25日	62,801,120	46,806,200	476,131,239
第13計算期間	平成25年 1月26日～平成26年 1月27日	37,880,019	309,141,420	204,869,838
第14計算期間	平成26年 1月28日～平成27年 1月26日	4,298,706	109,687,582	99,480,962
第15計算期間	平成27年 1月27日～平成28年 1月25日	1,135,264	21,964,108	78,652,118
第16中間計算期間	平成28年 1月26日～平成28年 7月25日	1,671,666	621,789	79,701,995

東京海上・未来設計ファンド5

期	計算期間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第6計算期間	平成18年 1月26日～平成19年 1月25日	97,124,659	46,546,586	200,111,883
第7計算期間	平成19年 1月26日～平成20年 1月25日	131,225,107	57,985,843	273,351,147
第8計算期間	平成20年 1月26日～平成21年 1月26日	218,839,977	32,880,910	459,310,214
第9計算期間	平成21年 1月27日～平成22年 1月25日	221,172,635	43,904,096	636,578,753
第10計算期間	平成22年 1月26日～平成23年 1月25日	173,566,000	69,302,560	740,842,193
第11計算期間	平成23年 1月26日～平成24年 1月25日	149,544,019	76,510,744	813,875,468
第12計算期間	平成24年 1月26日～平成25年 1月25日	120,609,591	87,693,752	846,791,307
第13計算期間	平成25年 1月26日～平成26年 1月27日	88,682,467	491,732,457	443,741,317
第14計算期間	平成26年 1月28日～平成27年 1月26日	10,925,591	199,210,501	255,456,407

第15計算期間	平成27年 1月27日 ~ 平成28年 1月25日	29,717,308	29,116,870	256,056,845
第16中間計算期間	平成28年 1月26日 ~ 平成28年 7月25日	5,976,942	10,841,174	251,192,613

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28年1月26日から平成28年7月25日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任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28年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成28年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	18,646,824	17,132,032
親投資信託受益証券	42,099,018	40,405,614
未収入金	177,092	208,137
未収利息	27	-
流動資産合計	60,922,961	57,745,783
資産合計	60,922,961	57,745,783
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	61,233
未払受託者報酬	23,013	21,481
未払委託者報酬	216,929	202,445
未払利息	-	26
その他未払費用	13,049	12,184
流動負債合計	252,991	297,369
負債合計	252,991	297,369
純資産の部		
元本等		
元本	1 50,014,798	1 46,451,100
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	10,655,172	10,997,314
(分配準備積立金)	7,330,903	6,649,627
元本等合計	60,669,970	57,448,414
純資産合計	60,669,970	57,448,414
負債純資産合計	60,922,961	57,745,783

(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27年 1月27日 至 平成27年 7月26日	当中間計算期間 自 平成28年 1月26日 至 平成28年 7月25日
営業収益		
受取利息	4,003	598
有価証券売買等損益	1,544,389	1,400,389
営業収益合計	1,548,392	1,400,987
営業費用		
支払利息	-	3,494
受託者報酬	20,350	21,481
委託者報酬	191,797	202,445
その他費用	11,534	12,583
営業費用合計	223,681	240,003
営業利益又は営業損失()	1,324,711	1,160,984
経常利益又は経常損失()	1,324,711	1,160,984
中間純利益又は中間純損失()	1,324,711	1,160,984
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()	26,524	73,162
期首剰余金又は期首欠損金()	9,395,036	10,655,172
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,238,892	248,202
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,238,892	248,202
剰余金減少額又は欠損金増加額	324,216	993,882
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	324,216	993,882
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()	11,607,899	10,997,314

(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28年 1月26日 至 平成28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28年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成28年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	42,881,938円	50,014,798円
期中追加設定元本額	9,233,966円	1,100,770円
期中一部解約元本額	2,101,106円	4,664,468円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の 総数	50,014,798口	46,451,100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27年 1月27日 至 平成27年 7月26日	当中間計算期間 自 平成28年 1月26日 至 平成28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28年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成28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28年 1月25日現在		当中間計算期間末 平成28年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.2130円	1口当たり純資産額	1.2368円
(1万口当たり純資産額	12,130円)	(1万口当たり純資産額	12,368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28年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成28年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	17,771,033	17,072,327
親投資信託受益証券	95,761,172	98,628,042
未収入金	589,462	561,493
未収利息	25	-
流動資産合計	114,121,692	116,261,862
資産合計	114,121,692	116,261,862
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	44,958	42,829
未払委託者報酬	622,914	593,376
未払利息	-	26
その他未払費用	25,615	24,377
流動負債合計	693,487	660,608
負債合計	693,487	660,608
純資産の部		
元本等		
元本	1,86,953,046	1,87,488,646
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	26,475,159	28,112,608
(分配準備積立金)	24,073,020	23,920,717
元本等合計	113,428,205	115,601,254
純資産合計	113,428,205	115,601,254
負債純資産合計	114,121,692	116,261,862

(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27年 1月27日 至 平成27年 7月26日	当中間計算期間 自 平成28年 1月26日 至 平成28年 7月25日
営業収益		
受取利息	4,353	592
有価証券売買等損益	6,379,726	2,132,964
営業収益合計	6,384,079	2,133,556
営業費用		
支払利息	-	3,513
受託者報酬	44,222	42,829
委託者報酬	612,708	593,376
その他費用	25,182	24,777
営業費用合計	682,112	664,495
営業利益又は営業損失()	5,701,967	1,469,061
経常利益又は経常損失()	5,701,967	1,469,061
中間純利益又は中間純損失()	5,701,967	1,469,061
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()	71,714	7,344
期首剰余金又は期首欠損金()	27,850,289	26,475,159
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,100,876	329,161
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,100,876	329,161
剰余金減少額又は欠損金増加額	747,596	168,117
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	747,596	168,117
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()	33,833,822	28,112,608

(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28年 1月26日 至 平成28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28年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成28年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	87,629,052円	86,953,046円
期中追加設定元本額	4,864,370円	1,087,846円
期中一部解約元本額	5,540,376円	552,246円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の 総数	86,953,046口	87,488,646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27年 1月27日 至 平成27年 7月26日	当中間計算期間 自 平成28年 1月26日 至 平成28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28年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成28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28年 1月25日現在		当中間計算期間末 平成28年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3045円	1口当たり純資産額	1.3213円
(1万口当たり純資産額	13,045円)	(1万口当たり純資産額	13,213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28年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成28年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	17,091,024	15,332,379
親投資信託受益証券	302,450,431	299,710,583
未収入金	2,397,287	2,217,702
未収利息	24	-
流動資産合計	321,938,766	317,260,664
資産合計	321,938,766	317,260,664
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	145,247	134,368
未払委託者報酬	2,305,689	2,132,959
未払利息	-	23
その他未払費用	72,526	67,098
流動負債合計	2,523,462	2,334,448
負債合計	2,523,462	2,334,448
純資産の部		
元本等		
元本	1 232,972,249	1 227,937,474
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	86,443,055	86,988,742
(分配準備積立金)	89,330,195	86,862,182
元本等合計	319,415,304	314,926,216
純資産合計	319,415,304	314,926,216
負債純資産合計	321,938,766	317,260,664

(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27年 1月27日 至 平成27年 7月26日	当中間計算期間 自 平成28年 1月26日 至 平成28年 7月25日
営業収益		
受取利息	4,295	558
有価証券売買等損益	29,393,220	4,702,862
営業収益合計	29,397,515	4,703,420
営業費用		
支払利息	-	3,200
受託者報酬	149,666	134,368
委託者報酬	2,375,917	2,132,959
その他費用	74,736	67,468
営業費用合計	2,600,319	2,337,995
営業利益又は営業損失()	26,797,196	2,365,425
経常利益又は経常損失()	26,797,196	2,365,425
中間純利益又は中間純損失()	26,797,196	2,365,425
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()	1,029,115	54,395
期首剰余金又は期首欠損金()	99,188,022	86,443,055
剰余金増加額又は欠損金減少額	830,666	518,495
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	830,666	518,495
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,376,745	2,392,628
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,376,745	2,392,628
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()	118,410,024	86,988,742

(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28年 1月26日 至 平成28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28年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成28年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	248,977,766円	232,972,249円
期中追加設定元本額	4,033,614円	1,413,499円
期中一部解約元本額	20,039,131円	6,448,274円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の 総数	232,972,249口	227,937,474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27年 1月27日 至 平成27年 7月26日	当中間計算期間 自 平成28年 1月26日 至 平成28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28年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成28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 の差額はありませぬ。	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28年 1月25日現在		当中間計算期間末 平成28年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3710円	1口当たり純資産額	1.3816円
(1万口当たり純資産額	13,710円)	(1万口当たり純資産額	13,816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28年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成28年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,727,171	5,069,604
親投資信託受益証券	98,638,517	100,346,520
未収入金	998,001	878,345
未収利息	8	-
流動資産合計	105,363,697	106,294,469
資産合計	105,363,697	106,294,469
負債の部		
流動負債		
未払解約金	18,159	-
未払受託者報酬	49,763	44,571
未払委託者報酬	957,826	857,813
未払利息	-	7
その他未払費用	24,785	22,191
流動負債合計	1,050,533	924,582
負債合計	1,050,533	924,582
純資産の部		
元本等		
元本	1,78,652,118	1,79,701,995
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	25,661,046	25,667,892
（分配準備積立金）	33,872,039	33,608,061
元本等合計	104,313,164	105,369,887
純資産合計	104,313,164	105,369,887
負債純資産合計	105,363,697	106,294,469

(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27年 1月27日 至 平成27年 7月26日	当中間計算期間 自 平成28年 1月26日 至 平成28年 7月25日
営業収益		
受取利息	1,605	179
有価証券売買等損益	15,506,999	590,547
営業収益合計	15,508,604	590,726
営業費用		
支払利息	-	1,049
受託者報酬	58,103	44,571
委託者報酬	1,118,426	857,813
その他費用	28,960	22,315
営業費用合計	1,205,489	925,748
営業利益又は営業損失()	14,303,115	335,022
経常利益又は経常損失()	14,303,115	335,022
中間純利益又は中間純損失()	14,303,115	335,022
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()	685,202	32,269
期首剰余金又は期首欠損金()	36,762,297	25,661,046
剰余金増加額又は欠損金減少額	189,118	512,331
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	189,118	512,331
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,752,490	202,732
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,752,490	202,732
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()	46,816,838	25,667,892

(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28年 1月26日 至 平成28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28年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成28年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	99,480,962円	78,652,118円
期中追加設定元本額	1,135,264円	1,671,666円
期中一部解約元本額	21,964,108円	621,789円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の 総数	78,652,118口	79,701,995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27年 1月27日 至 平成27年 7月26日	当中間計算期間 自 平成28年 1月26日 至 平成28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28年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成28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28年 1月25日現在		当中間計算期間末 平成28年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3263円	1口当たり純資産額	1.3220円
(1万口当たり純資産額	13,263円)	(1万口当たり純資産額	13,220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28年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成28年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	328,831,654	320,732,416
未収入金	3,757,196	3,290,244
流動資産合計	332,588,850	324,022,660
資産合計	332,588,850	324,022,660
負債の部		
流動負債		
未払解約金	23,147	-
未払受託者報酬	156,413	137,814
未払委託者報酬	3,499,524	3,083,610
その他未払費用	78,112	68,820
流動負債合計	3,757,196	3,290,244
負債合計	3,757,196	3,290,244
純資産の部		
元本等		
元本	1 256,056,845	1 251,192,613
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	72,774,809	69,539,803
（分配準備積立金）	110,809,143	106,195,800
元本等合計	328,831,654	320,732,416
純資産合計	328,831,654	320,732,416
負債純資産合計	332,588,850	324,022,660

(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27年 1月27日 至 平成27年 7月26日	当中間計算期間 自 平成28年 1月26日 至 平成28年 7月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	51,849,184	1,688,184
営業収益合計	51,849,184	1,688,184
営業費用		
受託者報酬	157,527	137,814
委託者報酬	3,524,636	3,083,610
その他費用	78,677	68,820
営業費用合計	3,760,840	3,290,244
営業利益又は営業損失()	48,088,344	1,602,060
経常利益又は経常損失()	48,088,344	1,602,060
中間純利益又は中間純損失()	48,088,344	1,602,060
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()	1,764,449	894
期首剰余金又は期首欠損金()	87,151,727	72,774,809
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,056,681	1,439,999
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,056,681	1,439,999
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,784,260	3,073,839
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,784,260	3,073,839
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()	135,748,043	69,539,803

(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28年 1月26日 至 平成28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28年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成28年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	255,456,407円	256,056,845円
期中追加設定元本額	29,717,308円	5,976,942円
期中一部解約元本額	29,116,870円	10,841,174円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の 総数	256,056,845口	251,192,613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27年 1月27日 至 平成27年 7月26日	当中間計算期間 自 平成28年 1月26日 至 平成28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28年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成28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28年 1月25日現在		当中間計算期間末 平成28年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.2842円	1口当たり純資産額	1.2768円
(1万口当たり純資産額	12,842円)	(1万口当たり純資産額	12,768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28年 1月25日現在	平成28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			
金銭信託		51,612	489,576
コール・ローン		338,870,822	328,822,620
株式		34,514,795,430	34,492,230,340
未収入金		1,082,986,777	558,720,414
未収配当金		46,845,330	33,157,750
未収利息		492	
流動資産合計		35,983,550,463	35,413,420,700
資産合計		35,983,550,463	35,413,420,700
負債の部			
流動負債			
未払金		1,030,483,529	335,520,346
未払解約金		155,142,713	332,028,307
未払利息			513
流動負債合計		1,185,626,242	667,549,166
負債合計		1,185,626,242	667,549,166
純資産の部			

元本等			
元本	1	30,766,525,743	30,965,611,159
剰余金			
剰余金又は欠損金()		4,031,398,478	3,780,260,375
元本等合計		34,797,924,221	34,745,871,534
純資産合計		34,797,924,221	34,745,871,534
負債純資産合計		35,983,550,463	35,413,420,700

(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28年 1月26日 至 平成28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28年 1月25日現在	平成28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	33,641,250,895円	30,766,525,743円
同期中における追加設定元本額	10,428,137,386円	5,268,813,648円
同期中における一部解約元本額	13,302,862,538円	5,069,728,232円
同中間期末における元本額	30,766,525,743円	30,965,611,159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>	1,945,314,000円	780,637,314円
東京海上日本株アクティブファンド	313,351,649円	305,375,867円
東京海上・未来設計ファンド1	4,879,814円	5,311,203円
東京海上・未来設計ファンド2	18,557,513円	21,159,928円
東京海上・未来設計ファンド3	80,153,719円	85,380,812円
東京海上・未来設計ファンド4	35,727,498円	37,592,264円
東京海上・未来設計ファンド5	144,047,062円	141,426,202円
東京海上セレクション・日本株式	16,996,031,490円	17,343,187,451円
東京海上セレクション・バランス30	1,173,270,450円	1,388,475,256円
東京海上セレクション・バランス50	4,878,098,459円	5,459,558,702円
東京海上セレクション・バランス70	4,374,406,793円	4,642,967,718円
東京海上・年金運用型戦略ファンド (年1回決算型)	158,592,441円	170,950,445円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	549,909,309円	482,841,885円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	59,640,083円	65,617,469円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	34,545,463円	35,128,643円
計	30,766,525,743円	30,965,611,159円

2. 1 本書における開示対象ファンドの間 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	30,766,525,743口	30,965,611,159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28年 1月25日現在	平成28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ぬ。	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)

平成28年 1月25日現在		平成28年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.1310円	1口当たり純資産額	1.1221円
(1万口当たり純資産額	11,310円)	(1万口当たり純資産額	11,221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28年 1月25日現在	平成28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		460,803,912	1,382,992,949
国債証券		68,005,939,265	59,044,747,500
地方債証券		200,158,000	2,119,148,500
特殊債券			1,306,231,000

社債券		18,891,621,168	17,824,078,011
未収入金		1,801,936,600	577,741,500
未収利息		186,461,580	156,824,764
前払費用		11,041,069	25,185,679
流動資産合計		89,557,961,594	82,436,949,903
資産合計		89,557,961,594	82,436,949,903
負債の部			
流動負債			
未払金		1,803,111,400	1,308,062,200
未払解約金		91,077,168	224,468,719
未払利息			2,160
流動負債合計		1,894,188,568	1,532,533,079
負債合計		1,894,188,568	1,532,533,079
純資産の部			
元本等			
元本	1	65,245,667,541	57,120,005,087
剰余金			
剰余金又は欠損金()		22,418,105,485	23,784,411,737
元本等合計		87,663,773,026	80,904,416,824
純資産合計		87,663,773,026	80,904,416,824
負債純資産合計		89,557,961,594	82,436,949,903

(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28年 1月26日 至 平成28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、特殊債券及び社債券 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28年 1月25日現在	平成28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	60,632,145,875円	65,245,667,541円
同期中における追加設定元本額	63,881,220,430円	14,941,161,396円
同期中における一部解約元本額	59,267,698,764円	23,066,823,850円
同中間期末における元本額	65,245,667,541円	57,120,005,087円
元本の内訳*		
東京海上・国内債券ファンド	644,388,734円	551,985,733円
東京海上・未来設計ファンド1	20,812,541円	17,944,863円
東京海上・未来設計ファンド2	35,199,625円	31,771,882円
東京海上・未来設計ファンド3	76,051,962円	64,083,560円
東京海上・未来設計ファンド4	8,479,726円	7,052,221円

東京海上セレクション・バランス30	2,612,937,739円	2,450,922,602円
東京海上セレクション・バランス50	3,566,123,889円	3,162,645,296円
東京海上セレクション・バランス70	829,907,098円	697,185,931円
東京海上セレクション・日本債券	9,426,824,967円	10,343,204,883円
東京海上・日本債券オープン (野村SMA向け)	21,787,987,315円	19,825,388,052円
東京海上・日本債券オープン (野村SMA・EW向け)	12,332,234,393円	17,497,615,239円
東京海上・年金運用型戦略ファンド (年1回決算型)	210,435,550円	179,571,765円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	3,136,083,267円	2,174,497,839円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	113,059,717円	98,551,474円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	21,831,234円	17,583,747円
東京海上日本債ファンドM(FOFs 用)(適格機関投資家専用)	10,423,309,784円	円
計	65,245,667,541円	57,120,005,087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	65,245,667,541口	57,120,005,087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28年 1月25日現在	平成28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28年 1月25日現在		平成28年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3436円	1口当たり純資産額	1.4164円
(1万口当たり純資産額	13,436円)	(1万口当たり純資産額	14,164円)

「TMA外国株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	平成28年 1月25日現在	平成28年 7月25日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		28,726,532	50,343,165
コール・ローン		459,605,771	613,054,716
株式		20,781,930,048	21,810,603,644
投資証券		276,556,187	313,749,000
未収配当金		19,102,529	27,402,476
未収利息		668	
流動資産合計		21,565,921,735	22,815,153,001
資産合計		21,565,921,735	22,815,153,001
負債の部			
流動負債			
未払解約金		54,144,086	47,445,665
未払利息			957
流動負債合計		54,144,086	47,446,622
負債合計		54,144,086	47,446,622
純資産の部			
元本等			
元本	1	11,788,943,113	12,168,809,032
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		9,722,834,536	10,598,897,347
元本等合計		21,511,777,649	22,767,706,379
純資産合計		21,511,777,649	22,767,706,379
負債純資産合計		21,565,921,735	22,815,153,001

(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28年 1月26日 至 平成28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	<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28年 1月25日現在	平成28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	11,732,297,774円	11,788,943,113円
同期中における追加設定元本額	2,754,319,083円	1,385,037,388円
同期中における一部解約元本額	2,697,673,744円	1,005,171,469円
同中間期末における元本額	11,788,943,113円	12,168,809,032円
元本の内訳*		
東京海上・外国株式ファンド	21,387,079円	21,757,778円
東京海上・未来設計ファンド1	3,051,258円	3,266,730円
東京海上・未来設計ファンド2	8,702,471円	9,761,488円
東京海上・未来設計ファンド3	41,762,110円	43,767,152円
東京海上・未来設計ファンド4	19,545,045円	20,234,496円
東京海上・未来設計ファンド5	81,052,969円	78,308,084円
東京海上セレクション・外国株式	8,343,747,781円	8,519,071,047円
東京海上セレクション・バランス30	366,782,647円	426,977,958円
東京海上セレクション・バランス50	1,307,047,530円	1,439,154,892円
東京海上セレクション・バランス70	1,093,974,368円	1,142,363,276円
東京海上・年金運用型戦略ファンド (年1回決算型)	99,154,808円	105,217,505円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	343,846,285円	296,961,974円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	37,289,403円	40,358,977円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	21,599,359円	21,607,675円
計	11,788,943,113円	12,168,809,032円

2. 1 本書における開示対象ファンドの間 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	11,788,943,113口	12,168,809,032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28年 1月25日現在	平成28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 (デリバティブ取引等に関する注記)に 記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外 の金融商品 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。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28年1月25日現在)

該当事項はありません。

(平成28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28年 1月25日現在		平成28年 7月25日現在
1口当たり純資産額	1.8247円	1口当たり純資産額	1.8710円

(1万口当たり純資産額	18,247円)	(1万口当たり純資産額	18,710円)
-------------	----------	-------------	----------

「TMA外国債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		平成28年 1月25日現在	平成28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		575,313,717	252,737,627
コール・ローン		162,929,731	253,547,876
国債証券		16,448,252,360	16,097,394,091
派生商品評価勘定		1,393,834	
未収入金		686,565,338	
未収利息		84,919,308	74,897,371
前払費用		18,441,548	10,354,774
流動資産合計		17,977,815,836	16,688,931,739
資産合計		17,977,815,836	16,688,931,739
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		4,520,177	165,000
未払金		667,077,740	32,041,108
未払解約金		20,273,964	17,264,903
未払利息			396
流動負債合計		691,871,881	49,471,407
負債合計		691,871,881	49,471,407
純資産の部			
元本等			
元本	1	7,824,621,677	8,020,237,819
剰余金			
剰余金又は欠損金()		9,461,322,278	8,619,222,513
元本等合計		17,285,943,955	16,639,460,332
純資産合計		17,285,943,955	16,639,460,332
負債純資産合計		17,977,815,836	16,688,931,739

(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28年 1月26日 至 平成28年 7月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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)、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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。</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 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28年 1月25日現在	平成28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	7,304,757,866円	7,824,621,677円
同期中における追加設定元本額	1,795,238,244円	823,405,837円
同期中における一部解約元本額	1,275,374,433円	627,789,695円
同中間期末における元本額	7,824,621,677円	8,020,237,819円
元本の内訳*		
東京海上・外国債券ファンド	19,169,258円	19,031,013円
東京海上・未来設計ファンド1	1,379,952円	1,405,871円
東京海上・未来設計ファンド2	5,250,322円	5,600,352円
東京海上・未来設計ファンド3	15,123,048円	15,061,686円
東京海上・未来設計ファンド4	5,057,720円	4,972,639円
東京海上・未来設計ファンド5	8,155,475円	7,482,359円
東京海上セレクション・外国債券	4,635,475,895円	4,690,313,543円
東京海上セレクション・バランス30	663,458,105円	735,176,334円
東京海上セレクション・バランス50	1,576,128,103円	1,651,426,699円
東京海上セレクション・バランス70	841,616,687円	835,502,481円
東京海上・年金運用型戦略ファンド (年1回決算型)	53,807,112円	54,264,842円
計	7,824,621,677円	8,020,237,819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	7,824,621,677口	8,020,237,819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28年 1月25日現在	平成28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 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 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。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

通貨関連

(平成28年1月25日現在)

(単位：円)

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買建	344,446,408		345,840,242	1,393,834
	米ドル	86,955,768		88,108,186	1,152,418
	ユーロ	257,490,640		257,732,056	241,416
	売建	365,005,569		369,525,746	4,520,177
	米ドル	265,848,262		267,113,572	1,265,310
	ノルウェークローネ	99,157,307		102,412,174	3,254,867
	合計	709,451,977		715,365,988	3,126,343

(平成28年7月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	売建	17,055,000		17,220,000	165,000
	メキシコペソ	17,055,000		17,220,000	165,000
合計		17,055,000		17,220,000	165,000

(注)1.時価の算定方法

(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対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報に関する注記)

平成28年 1月25日現在		平成28年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	2.2092円	1口当たり純資産額	2.0747円
(1万口当たり純資産額	22,092円)	(1万口当たり純資産額	20,747円)

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

平成28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会社は、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28年8月末日現在、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	0	0
追加型株式投資信託	166	1,920,383
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	3	15,552
合計	169	1,935,936

(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31期事業年度(平成27年4月1日から平成28年3月31日まで)の財務諸表について、PwCあらた監査法人により監査を受けております。

なお、従来、当社が監査証明を受けているあらた監査法人は、平成27年7月1日に名称を変更し、PwCあらた監査法人となりました。

(1)【貸借対照表】

（単位：千円）

	第30期 （平成27年3月31日現在）	第31期 （平成28年3月31日現在）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	11,141,499	6,701,500
前払費用	138,645	154,914
未収委託者報酬	1,838,877	1,571,495
未収収益	2,613,524	2,099,418
未収入金	144,239	166,601
繰延税金資産	178,975	173,700
1年内回収予定の敷金	-	315,033
その他の流動資産	7,312	12,650
流動資産計	16,063,074	11,195,315
固定資産		
有形固定資産	* 1 125,305	* 1 74,211
建物	56,587	2,187
器具備品	68,717	72,024
無形固定資産	3,475	5,254
電話加入権	3,144	3,144
ソフトウェア仮勘定	330	2,110
投資その他の資産	766,343	2,366,401
投資有価証券	35,337	43,761
関係会社株式	254,342	1,669,990
その他の関係会社有価証券	31,200	31,200
長期前払費用	11,425	9,018
敷金	315,033	450,152
その他長期差入保証金	-	10,852
繰延税金資産	119,005	151,427
固定資産計	895,124	2,445,867
資産合計	16,958,198	13,641,183
負債の部		
流動負債		
預り金	35,761	39,072
未払金	1,882,737	* 2 2,119,086
未払手数料	641,688	592,624
その他未払金	1,241,048	1,526,461
未払費用	226,407	147,843
未払消費税等	381,984	93,340
未払法人税等	777,000	736,000
前受収益	121,685	3,021
賞与引当金	189,738	196,236
その他の流動負債	1,080	-
流動負債計	3,616,395	3,334,601
固定負債		
退職給付引当金	179,872	197,784
役員退職慰労引当金	18,220	21,270
固定負債計	198,092	219,054
負債合計	3,814,487	3,553,655
純資産の部		
株主資本		
株主資本	13,138,296	10,085,959
資本金	2,000,000	2,000,000
利益剰余金	11,138,296	8,085,959
利益準備金	500,000	500,000
その他利益剰余金	10,638,296	7,585,959
繰越利益剰余金	10,638,296	7,585,959
評価・換算差額等	5,414	1,567
その他有価証券評価差額金	5,414	1,567

純資産合計	13,143,710	10,087,527
負債・純資産合計	16,958,198	13,641,183

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	9,360,564	9,967,549
運用受託報酬	8,312,953	8,310,269
投資助言報酬	54,626	90,084
その他営業収益	2,156	1,114
営業収益計	17,730,301	18,369,017
営業費用		
支払手数料	3,990,900	4,535,693
広告宣伝費	120,842	160,685
公告費	533	150
調査費	5,028,540	5,212,764
調査費	1,359,014	1,906,774
委託調査費	3,669,525	3,305,989
委託計算費	79,315	116,997
営業雑経費	158,665	202,379
通信費	28,778	30,626
印刷費	100,532	143,441
協会費	17,727	17,642
諸会費	5,136	4,682
図書費	6,491	5,986
営業費用計	9,378,797	10,228,671
一般管理費		
給料	2,415,481	2,468,628
役員報酬	76,933	57,936
給料・手当	1,680,443	1,761,103
賞与	658,104	649,589
交際費	8,098	21,912
寄付金	1,064	-
旅費交通費	86,899	97,774
租税公課	48,943	68,294
不動産賃借料	258,391	258,391
役員退職慰労引当金繰入	3,170	3,050
退職給付費用	70,058	86,602
賞与引当金繰入	189,738	196,236
固定資産減価償却費	95,208	98,697
法定福利費	407,477	419,863
福利厚生費	6,193	7,908
諸経費	389,985	416,706
一般管理費計	3,980,710	4,144,067
営業利益	4,370,792	3,996,279
営業外収益		
受取利息	1,803	1,844
受取配当金	* 1 227,154	* 1 145,859
匿名組合投資利益	11,498	* 1 164,645
雑益	14,179	13,905
営業外収益計	254,634	326,255
営業外費用		
為替差損	-	13,297
雑損	82,709	19,880
営業外費用計	82,709	33,178
経常利益	4,542,717	4,289,355

特別利益		
資産除去債務戻入益	34,769	-
特別利益計	34,769	-
特別損失		
器具備品除却損	912	-
特別損失計	912	-
税引前当期純利益	4,576,574	4,289,355
法人税、住民税及び事業税	1,551,017	1,425,847
法人税等調整額	33,368	25,250
法人税等合計	1,584,385	1,400,596
当期純利益	2,992,189	2,888,759

(3)【株主資本等変動計算書】

第30期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本				株主資本合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		
			その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	2,000,000	500,000	8,450,867	8,950,867	10,950,867
当期変動額					
剰余金の配当			804,759	804,759	804,759
当期純利益			2,992,189	2,992,189	2,992,189
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)					
当期変動額合計	-	-	2,187,429	2,187,429	2,187,429
当期末残高	2,000,000	500,000	10,638,296	11,138,296	13,138,296

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	1,809	1,809	10,952,676
当期変動額			
剰余金の配当			804,759
当期純利益			2,992,189
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	3,604	3,604	3,604
当期変動額合計	3,604	3,604	2,191,034
当期末残高	5,414	5,414	13,143,710

第31期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本				株主資本合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		
			その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	

当期首残高	2,000,000	500,000	10,638,296	11,138,296	13,138,296
当期変動額					
剰余金の配当			5,941,096	5,941,096	5,941,096
当期純利益			2,888,759	2,888,759	2,888,759
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)					
当期変動額合計	-	-	3,052,336	3,052,336	3,052,336
当期末残高	2,000,000	500,000	7,585,959	8,085,959	10,085,959

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	5,414	5,414	13,143,710
当期変動額			
剰余金の配当			5,941,096
当期純利益			2,888,759
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	3,846	3,846	3,846
当期変動額合計	3,846	3,846	3,056,183
当期末残高	1,567	1,567	10,087,527

注記事項

重要な会計方針

第31期 自 平成27年 4月 1日 至 平成28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、取得価額が10万円以上20万円未満の少額減価償却資産については、一括償却資産として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	従業員賞与と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、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。

(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。

(貸借対照表関係)

第30期 平成27年3月31日現在	第31期 平成28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とおりであります。	* 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。								
<table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>170,125千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>476,137千円</td> </tr> </table>	建物	170,125千円	器具備品	476,137千円	<table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>226,926千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>496,441千円</td> </tr> </table>	建物	226,926千円	器具備品	496,441千円
建物	170,125千円								
器具備品	476,137千円								
建物	226,926千円								
器具備品	496,441千円								
* 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・負債は次のとおりであります。								
<p>当事業年度において、関係会社に対する負債の合計額が負債及び純資産の合計額の100分の5を超えており、その金額は850,899千円であります。</p>	<table border="0"> <tr> <td>関係会社に対する未払金</td> <td>732,363千円</td> </tr> </table>	関係会社に対する未払金	732,363千円						
関係会社に対する未払金	732,363千円								

(損益計算書関係)

第30期 自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日	第31期 自 平成27年4月1日 至 平成28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。						
<table border="0"> <tr> <td>関係会社からの受取配当金</td> <td>226,798千円</td> </tr> </table> <p>当事業年度において、関係会社に対する営業費用及び一般管理費の合計額が営業費用及び一般管理費の合計額の100分の20を超えており、その金額は3,400,300千円であります。</p>	関係会社からの受取配当金	226,798千円	<table border="0"> <tr> <td>関係会社からの受取配当金</td> <td>142,429千円</td> </tr> <tr> <td>関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配</td> <td>164,645千円</td> </tr> </table> <p>当事業年度において、関係会社に対する営業費用及び一般管理費の合計額が営業費用及び一般管理費の合計額の100分の20を超えており、その金額は3,142,828千円であります。</p>	関係会社からの受取配当金	142,429千円	関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配	164,645千円
関係会社からの受取配当金	226,798千円						
関係会社からの受取配当金	142,429千円						
関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配	164,645千円						

(株主資本等変動計算書関係)

第30期(自 平成26年4月1日 至 平成27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26年4月1日 現在	増加	減少	平成27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26年6月30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	804,759千円
(ロ) 1株当たり配当額	21,012円

(八) 基準日	平成26年 3 月31日
(二) 効力発生日	平成26年 6 月30日

- (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成27年 6 月30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	939,116千円
(ロ) 配当の原資	利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	24,520円
(二) 基準日	平成27年 3 月31日
(ホ) 効力発生日	平成27年 6 月30日

第31期（自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28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27年 4 月 1 日 現在	増加	減少	平成28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27年 6 月30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	939,116千円
(ロ) 1株当たり配当額	24,520円
(ハ) 基準日	平成27年 3 月31日
(二) 効力発生日	平成27年 6 月30日

平成27年11月24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) 配当金の総額	5,001,980千円
(ロ) 1株当たり配当額	130,600円
(ハ) 効力発生日	平成27年11月30日

（注）基準日は設定しておりません。配当の効力発生日時点の株主へ配当を実施しております。

- (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成28年 6 月28日の定時株主総会において、次のとおり配当を提案する予定であります。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	791,278千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	20,660円
(二) 基準日	平成28年 3 月31日
(ホ) 効力発生日	平成28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30期 自 平成26年 4 月 1 日 至 平成27年 3 月31日	第31期 自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>市場リスク 同左</p> <p>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30期(平成27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	11,141,499	11,141,499	-
(2)未収委託者報酬	1,838,877	1,838,877	-
(3)未収収益	2,613,524	2,613,524	-
(4)未収入金	144,239	144,239	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	35,337	35,337	-
(6)敷金	315,033	315,033	-
(7)預り金	(35,761)	(35,761)	-
(8)未払金	(1,882,737)	(1,882,737)	-
(9)未払費用	(226,407)	(226,407)	-
(10)未払消費税等	(381,984)	(381,984)	-
(11)未払法人税等	(777,000)	(777,000)	-

(*)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31期(平成28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)。

	貸借対照表計上額(＊)	時価(＊)	差額
(1)現金・預金	6,701,500	6,701,500	-
(2)未収委託者報酬	1,571,495	1,571,495	-
(3)未収収益	2,099,418	2,099,418	-
(4)未収入金	166,601	166,601	-
(5)1年内回収予定の敷金	315,033	315,033	-
(6)投資有価証券 其他有価証券	43,761	43,761	-
(7)預り金	(39,072)	(39,072)	-
(8)未払金	(2,119,086)	(2,119,086)	-
(9)未払費用	(147,843)	(147,843)	-
(10)未払消費税等	(93,340)	(93,340)	-
(11)未払法人税等	(736,000)	(736,000)	-

(＊)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30期 平成27年3月31日現在	第31期 平成28年3月31日現在
<p>(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収収益、(4)未収入金、(7)預り金、(8)未払金、(9)未払費用並びに(10)未払消費税等及び(11)未払法人税等</p> <p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(6)敷金 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。</p>	<p>(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収収益、(4)未収入金、(5)1年内回収予定の敷金、(7)預り金、(8)未払金、(9)未払費用、(10)未払消費税等及び(11)未払法人税等</p> <p>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。</p> <p>(6)投資有価証券 同左</p>

(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30期 平成27年3月31日現在	第31期 平成28年3月31日現在																				
<p>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。</p> <p style="text-align: right;">(単位:千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>貸借対照表計上額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>子会社株式</td> <td>221,595</td> </tr> <tr> <td>関連会社株式</td> <td>32,747</td> </tr> <tr> <td>その他の関係会社 有価証券</td> <td>31,200</td> </tr> </tbody> </table>		貸借対照表計上額	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	31,200	<p>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。</p> <p style="text-align: right;">(単位:千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>貸借対照表計上額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>子会社株式</td> <td>1,637,243</td> </tr> <tr> <td>関連会社株式</td> <td>32,747</td> </tr> <tr> <td>その他の関係会社 有価証券</td> <td>31,200</td> </tr> <tr> <td>敷金</td> <td>450,152</td> </tr> <tr> <td>その他長期差入保証金</td> <td>10,852</td> </tr> </tbody> </table>		貸借対照表計上額	子会社株式	1,637,243	関連会社株式	32,747	その他の関係会社 有価証券	31,200	敷金	450,152	その他長期差入保証金	10,852
	貸借対照表計上額																				
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	31,200																				
	貸借対照表計上額																				
子会社株式	1,637,243																				
関連会社株式	32,747																				
その他の関係会社 有価証券	31,200																				
敷金	450,152																				
その他長期差入保証金	10,852																				

(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30期 平成27年3月31日現在	第31期 平成28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。	該当事項はありません。

（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30期（平成27年3月31日現在）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	11,141,470	-	-	-
未収委託者報酬	1,838,877	-	-	-
未収収益	2,613,524	-	-	-
未収入金	144,239	-	-	-
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	4,903	-
敷金	-	315,033	-	-
合計	15,738,111	316,033	4,903	-

第31期（平成28年3月31日現在）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	6,701,448	-	-	-
未収委託者報酬	1,571,495	-	-	-
未収収益	2,099,418	-	-	-
未収入金	166,601	-	-	-
1年内回収予定の敷金	315,033	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	-	17,460	3,952	-
合計	10,853,997	17,460	3,952	-

（有価証券関係）

第30期 平成27年3月31日現在	第31期 平成28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、記載していません。</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1,637,243千円、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、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ことから、記載していません。</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	33,921	25,426	8,495	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	26,436	21,324	5,111
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	1,415	1,908	492	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	17,324	20,176	2,851
合計	35,337	27,335	8,002	合計	43,761	41,501	2,259

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)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員の退職給付に備えるため、非積立型の確定給付制度及び確定拠出年金制度を採用しております。

退職一時金制度(非積立型制度であります。)では、当社従業員を制度対象として、給与と勤続年数に基づき算出した一時金を支給しております。受入出向者については退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれております。貸借対照表上は出向期間3年以下の出向者に係る金額が退職給付引当金に、出向期間3年超の出向者に係る金額がその他未払金にそれぞれ含まれております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	第30期		第31期	
	自	平成26年4月1日 至 平成27年3月31日	自	平成27年4月1日 至 平成28年3月31日
退職給付引当金の期首残高		141,238千円		179,872千円
退職給付費用		51,674千円		33,702千円
退職給付の支払額		13,040千円		15,789千円
制度への拠出額		-		-
退職給付引当金の期末残高		179,872千円		197,784千円

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	第30期		第31期	
	平成27年3月31日現在		平成28年3月31日現在	
積立型制度の退職給付債務		-		-
年金資産		-		-
		-		-
非積立型制度の退職給付債務		179,872千円		197,784千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額		179,872千円		197,784千円
退職給付引当金		179,872千円		197,784千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額		179,872千円		197,784千円

(3) 退職給付費用

	第30期		第31期	
	自	平成26年4月1日 至 平成27年3月31日	自	平成27年4月1日 至 平成28年3月31日
簡便法で計算した退職給付費用		51,674千円		33,702千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第30期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) 41,147千円、第31期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) 43,203千円であります。

(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30期	第31期
	(平成27年3月31日現在)	(平成28年3月31日現在)
繰延税金資産		
役員退職慰労引当金	5,892千円	6,512千円
退職給付引当金	58,170千円	60,561千円
未払金	1,846千円	2,992千円
賞与引当金	62,803千円	60,558千円
未払法定福利費	8,288千円	7,858千円
未払事業所税	2,781千円	2,632千円
未払事業税	54,175千円	45,510千円
未払調査費	43,152千円	45,270千円
減価償却超過額	57,530千円	85,044千円
未払確定拠出年金	1,155千円	1,112千円

未払費用	4,771千円	7,764千円
繰延税金資産小計	300,569千円	325,819千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	300,569千円	325,819千円
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	2,587千円	691千円
繰延税金負債合計	2,587千円	691千円
繰延税金資産の純額	297,981千円	325,127千円

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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28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100分の5以下であるため注記を省略しております。	同左

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成28年法律第15号)及び「地方税法等の一部を改正する法律」(平成28年法律第13号)が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等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32.26%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29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30.86%に、平成30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、30.62%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)は15,504千円減少し、法人税等調整額が15,541千円、その他有価証券評価差額金が37千円、それぞれ増加しております。

(セグメント情報等)

第30期 自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日	第31期 自 平成27年4月1日 至 平成28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>

<p>[関連情報]</p> <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、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>	<p>[関連情報]</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 同左</p>
--	--

(関連当事者情報)

第30期（自 平成26年4月1日 至 平成27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・ ロンドン	GBP 300千	金融商品 取引業	(所有) 直接50%	運用の 再委任	委託 調査費 の支払	1,849,352	未払金	376,465
						役員の 派遣			未払費用	36,012

(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31期（自 平成27年4月1日 至 平成28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

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金 (千円)	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)
親会社	東京海上日動火災 保険株式会社	東京都 千代田区	101,994,694	損害保険業	(被所有) 直接100%	投資信託 の取扱 役員 の兼任	投資信託 に係る事 務代行手 数料の 支払	587,292	未払手数料	162,226

(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。

* 取引金額には、消費税等は含まれておりません。

(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)
子会社	TOKIO MARINE ASSET MANAGEMENT INTERNATIONAL PTE.LTD.	シンガポール・ シンガポール	SGD 17,400千	投資運用業 投資助言業	(所有) 直接100%	投資助言 の受入 役員 の兼任	増資の 引受	1,415,648	-	-
関連会社	TOKIO MARINE ROGGE ASSET MANAGEMENT LIMITED	英国・ ロンドン	GBP 300千	投資運用業 投資助言業	(所有) 直接50%	運用の 再委任 役員 の派遣	委託 調査費 の支払	1,250,497	未払金 未払費用	255,308 4,855

(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。

* 取引金額には、消費税等は含まれておりません。

* 増資の引き受けは、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(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30期 自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日
1株当たり純資産額	343,177円83銭
1株当たり当期純利益 金額	78,125円04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。	
当期純利益	2,992,189千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る当期純利益	2,992,189千円
期中平均株式数	38,300株

第31期 (自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月 31 日)	
1 株当たり純資産額	263,381円91銭
1 株当たり当期純利益金額	75,424円51銭
なお、潜在株式調整後 1 株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
(注) 1 株当たり純資産額の算定上の基礎	
貸借対照表の純資産の部の合計額	10,087,527千円
純資産の部の合計額から控除する金額	-
普通株式に係る当期末の純資産額	10,087,527千円
1 株当たり純資産額の算定に用いられた当期末の普通株式の数	38,300株
1 株当たり当期純利益金額の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益金額	2,888,759千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る当期純利益金額	2,888,759千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

(追加情報)

[共通支配下の取引等]

当社は、関係当局の許認可等を前提に平成28年10月1日(予定)を合併の効力発生日として東京海上不動産投資顧問株式会社と合併契約を平成28年3月9日に締結いたしました。

1. 取引の概要

(1) 被取得企業の名称及びその事業の内容

被取得企業の名称 東京海上不動産投資顧問株式会社
事業の内容 不動産を対象とした投資運用業、投資助言葉等

(2) 企業結合日

平成28年10月1日

(3) 企業結合の法的形式

東京海上アセットマネジメント株式会社を吸収合併存続会社、東京海上不動産投資顧問株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併

(4) 結合後企業の名称

東京海上アセットマネジメント株式会社

(5) 企業結合の目的

東京海上グループのアセットマネジメント会社である2社を統合することでのシナジー効果を追求いたします。具体的には、商品のラインアップを拡大することで多様なニーズを有する投資家への訴求力を高めること、コーポレート部門の統合による効率化と機能強化を図ることを目的として行うものであります。

2. 実施予定の会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日公表分)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分)に基づき、共通支配下の取引として処理する予定です。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月8日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた監査法人

指定社員 公認会計士 荒川 進
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株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31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株式会社の平成28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。

強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成28年10月1日を合併の効力発生日として東京海上不動産投資顧問株式会社と合併契約を平成28年3月9日に締結した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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) 1. 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。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年9月7日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

PWCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 荒川 進
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28年1月26日から平成28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28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28年1月26日から平成28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．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年9月7日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

PWCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 荒川 進
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28年1月26日から平成28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28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28年1月26日から平成28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．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年9月7日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

PWCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 荒川 進
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28年1月26日から平成28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28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28年1月26日から平成28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．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年9月7日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

PWCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 荒川 進
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28年1月26日から平成28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28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28年1月26日から平成28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．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年9月7日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

PWCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 荒川 進
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28年1月26日から平成28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28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28年1月26日から平成28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．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。