

【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29年10月25日
【計算期間】	第17期中（自 平成29年1月26日 至 平成29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29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	41,022,937	70.16
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		17,441,839	29.83
合計（純資産総額）		58,464,776	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	100,448,149	85.17
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		17,487,424	14.82
合計（純資産総額）		117,935,573	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	297,785,828	95.16
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		15,122,105	4.83
合計（純資産総額）		312,907,933	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	105,003,570	95.19
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		5,303,121	4.80
合計（純資産総額）		110,306,691	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	307,528,532	100.20
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		△640,395	△0.20
合計（純資産総額）		306,888,137	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	38,504,471,930	99.51
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		186,080,163	0.48
合計（純資産総額）		38,690,552,093	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	103,525,310,118	79.03
地方債証券	日本	1,910,028,584	1.45
特殊債券	日本	300,757,000	0.22
社債券	日本	23,877,096,783	18.22
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		1,372,960,604	1.04
合計（純資産総額）		130,986,153,089	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	18,091,755,931	70.28
	カナダ	156,081,416	0.60
	ドイツ	309,565,752	1.20
	イタリア	66,786,390	0.25
	フランス	208,539,681	0.81
	オーストラリア	471,211,207	1.83
	イギリス	714,522,411	2.77
	スイス	1,200,154,957	4.66
	香港	57,004,400	0.22
	シンガポール	60,369,120	0.23
	オランダ	460,519,032	1.78
	スペイン	600,858,236	2.33
	ベルギー	682,899,702	2.65
	スウェーデン	546,515,460	2.12
	ノルウェー	118,718,856	0.46
	デンマーク	474,195,573	1.84
	アイルランド	285,575,028	1.10
	中華人民共和国	316,405,109	1.22
	キュラソー	69,995,238	0.27
	小計	24,891,673,499	96.70
投資証券	アメリカ	92,434,790	0.35
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		756,960,797	2.94
合計（純資産総額）		25,741,069,086	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	8,118,587,391	44.14
	カナダ	370,238,079	2.01
	ドイツ	1,338,529,281	7.27
	イタリア	1,244,815,565	6.76
	フランス	3,135,946,077	17.05
	オーストラリア	358,983,036	1.95
	イギリス	1,226,885,344	6.67
	シンガポール	17,437,075	0.09

	スペイン	1,588,990,722	8.64
	スウェーデン	373,821,887	2.03
	フィンランド	44,429,695	0.24
	デンマーク	89,302,734	0.48
	メキシコ	106,476,182	0.57
	ポーランド	71,782,011	0.39
	小計	18,086,225,079	98.35
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		302,935,102	1.64
合計（純資産総額）		18,389,160,181	100.00

(2) 【運用実績】

① 【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
第16計算期間末	(平成29年 1月25日)	62	62	1.2404	1.2404
平成28年 8月末日		56	—	1.2204	—
9月末日		56	—	1.2166	—
10月末日		57	—	1.2210	—
11月末日		57	—	1.2348	—
12月末日		62	—	1.2441	—
平成29年 1月末日		62	—	1.2389	—
2月末日		62	—	1.2431	—
3月末日		58	—	1.2422	—
4月末日		58	—	1.2470	—
5月末日		58	—	1.2541	—
6月末日		58	—	1.2561	—
7月末日		58	—	1.2588	—
8月末日		58	—	1.2624	—

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
第16計算期間末	（平成29年 1月25日）	117	117	1.3465	1.3465
平成28年 8月末日		113	—	1.2982	—
9月末日		113	—	1.2919	—
10月末日		114	—	1.3027	—
11月末日		116	—	1.3309	—
12月末日		117	—	1.3510	—
平成29年 1月末日		117	—	1.3446	—
2月末日		118	—	1.3504	—
3月末日		117	—	1.3492	—
4月末日		118	—	1.3559	—
5月末日		116	—	1.3717	—
6月末日		116	—	1.3779	—
7月末日		117	—	1.3834	—
8月末日		117	—	1.3886	—

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
第16計算期間末	（平成29年 1月25日）	319	319	1.4388	1.4388
平成28年 8月末日		308	—	1.3516	—
9月末日		305	—	1.3423	—
10月末日		309	—	1.3609	—
11月末日		320	—	1.4088	—
12月末日		325	—	1.4428	—
平成29年 1月末日		319	—	1.4369	—
2月末日		321	—	1.4462	—
3月末日		313	—	1.4455	—

4月末日	313	—	1.4541	—
5月末日	316	—	1.4799	—
6月末日	316	—	1.4903	—
7月末日	311	—	1.5001	—
8月末日	312	—	1.5052	—

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
第16計算期間末	(平成29年 1月25日)	108	108	1.4112	1.4112
平成28年 8月末日		102	—	1.2895	—
9月末日		101	—	1.2780	—
10月末日		103	—	1.3032	—
11月末日		107	—	1.3677	—
12月末日		110	—	1.4139	—
平成29年 1月末日		107	—	1.4098	—
2月末日		105	—	1.4216	—
3月末日		105	—	1.4216	—
4月末日		106	—	1.4308	—
5月末日		108	—	1.4650	—
6月末日		109	—	1.4795	—
7月末日		110	—	1.4931	—
8月末日		110	—	1.4967	—

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
第16計算期間末	(平成29年 1月25日)	323	323	1.3920	1.3920
平成28年 8月末日		312	—	1.2411	—
9月末日		308	—	1.2288	—
10月末日		311	—	1.2598	—
11月末日		319	—	1.3372	—
12月末日		326	—	1.3927	—
平成29年 1月末日		323	—	1.3910	—
2月末日		318	—	1.4061	—
3月末日		305	—	1.4067	—
4月末日		306	—	1.4168	—
5月末日		306	—	1.4584	—
6月末日		305	—	1.4753	—
7月末日		308	—	1.4926	—
8月末日		306	—	1.4946	—

②【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。

③【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計算期間	平成28年 1月26日～平成29年 1月25日	2.3
第17中間計算期間	平成29年 1月26日～平成29年 7月25日	1.6

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計算期間	平成28年 1月26日～平成29年 1月25日	3.2
第17中間計算期間	平成29年 1月26日～平成29年 7月25日	3.0

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計算期間	平成28年 1月26日～平成29年 1月25日	4.9
第17中間計算期間	平成29年 1月26日～平成29年 7月25日	4.5

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計算期間	平成28年 1月26日～平成29年 1月25日	6.4
第17中間計算期間	平成29年 1月26日～平成29年 7月25日	6.1

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計算期間	平成28年 1月26日～平成29年 1月25日	8.4
第17中間計算期間	平成29年 1月26日～平成29年 7月25日	7.6

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計算期間	平成28年 1月26日～平成29年 1月25日	7,777,192	7,358,401	50,433,589
第17中間計算期間	平成29年 1月26日～平成29年 7月25日	4,903,284	9,109,787	46,227,086

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計算期間	平成28年 1月26日～平成29年 1月25日	1,867,806	1,532,429	87,288,423
第17中間計算期間	平成29年 1月26日～平成29年 7月25日	724,942	3,126,352	84,887,013

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計算期間	平成28年 1月26日～平成29年 1月25日	8,292,043	18,863,516	222,400,776
第17中間計算期間	平成29年 1月26日～平成29年 7月25日	5,224,425	19,913,293	207,711,908

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計算期間	平成28年 1月26日～平成29年 1月25日	1,992,543	4,107,191	76,537,470
第17中間計算期間	平成29年 1月26日～平成29年 7月25日	399,517	2,683,674	74,253,313

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計算期間	平成28年 1月26日～平成29年 1月25日	13,546,978	37,128,753	232,475,070
第17中間計算期間	平成29年 1月26日～平成29年 7月25日	7,732,557	33,439,329	206,768,298

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29年1月26日から平成29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29年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成29年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	18,885,490	17,480,854
親投資信託受益証券	43,747,976	40,868,013
未収入金	171,856	172,042
流動資産合計	62,805,322	58,520,909
資産合計	62,805,322	58,520,909
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	22,330	22,350
未払委託者報酬	210,508	210,746
未払利息	36	41
その他未払費用	12,673	12,682
流動負債合計	245,547	245,819
負債合計	245,547	245,819
純資産の部		
元本等		
元本	※1 50,433,589	※1 46,227,086
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	12,126,186	12,048,004
（分配準備積立金）	7,087,536	5,844,287
元本等合計	62,559,775	58,275,090
純資産合計	62,559,775	58,275,090
負債純資産合計	62,805,322	58,520,909

(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28年 1月26日 至 平成28年 7月25日	当中間計算期間 自 平成29年 1月26日 至 平成29年 7月25日
営業収益		
受取利息	598	199
有価証券売買等損益	1,400,389	1,224,683
営業収益合計	1,400,987	1,224,882
営業費用		
支払利息	3,494	6,285
受託者報酬	21,481	22,350
委託者報酬	202,445	210,746
その他費用	12,583	12,682
営業費用合計	240,003	252,063
営業利益又は営業損失（△）	1,160,984	972,819
経常利益又は経常損失（△）	1,160,984	972,819
中間純利益又は中間純損失（△）	1,160,984	972,819
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（△）	73,162	95,276
期首剰余金又は期首欠損金（△）	10,655,172	12,126,186
剰余金増加額又は欠損金減少額	248,202	1,236,446
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	248,202	1,236,446
剰余金減少額又は欠損金増加額	993,882	2,192,171
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	993,882	2,192,171
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（△）	10,997,314	12,048,004

(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29年 1月26日 至 平成29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29年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成29年 7月25日現在
1. ※1 期首元本額	50,014,798円	50,433,589円
期中追加設定元本額	7,777,192円	4,903,284円
期中一部解約元本額	7,358,401円	9,109,787円
2. ※1 中間計算期間末日における受益権の総数	50,433,589口	46,227,086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28年 1月26日 至 平成28年 7月25日	当中間計算期間 自 平成29年 1月26日 至 平成29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29年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成29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、その差額はあります。	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29年 1月25日現在		当中間計算期間末 平成29年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.2404円	1口当たり純資産額	1.2606円
(1万口当たり純資産額	12,404円)	(1万口当たり純資産額	12,606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29年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成29年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	17,776,637	17,631,169
親投資信託受益証券	99,862,482	100,145,465
未収入金	585,047	576,351
流動資産合計	118,224,166	118,352,985
資産合計	118,224,166	118,352,985
負債の部		
流動負債		
未払解約金	13,411	—
未払受託者報酬	43,752	43,958
未払委託者報酬	606,220	609,078
未払利息	34	41
その他未払費用	24,912	25,024
流動負債合計	688,329	678,101
負債合計	688,329	678,101
純資産の部		
元本等		
元本	※1 87,288,423	※1 84,887,013
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	30,247,414	32,787,871
（分配準備積立金）	25,968,473	25,042,050
元本等合計	117,535,837	117,674,884
純資産合計	117,535,837	117,674,884
負債純資産合計	118,224,166	118,352,985

(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28年 1月26日 至 平成28年 7月25日	当中間計算期間 自 平成29年 1月26日 至 平成29年 7月25日
営業収益		
受取利息	592	192
有価証券売買等損益	2,132,964	4,084,669
営業収益合計	2,133,556	4,084,861
営業費用		
支払利息	3,513	6,169
受託者報酬	42,829	43,958
委託者報酬	593,376	609,078
その他費用	24,777	25,024
営業費用合計	664,495	684,229
営業利益又は営業損失（△）	1,469,061	3,400,632
経常利益又は経常損失（△）	1,469,061	3,400,632
中間純利益又は中間純損失（△）	1,469,061	3,400,632
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（△）	△7,344	38,884
期首剰余金又は期首欠損金（△）	26,475,159	30,247,414
剰余金増加額又は欠損金減少額	329,161	262,074
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	329,161	262,074
剰余金減少額又は欠損金増加額	168,117	1,083,365
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	168,117	1,083,365
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（△）	28,112,608	32,787,871

(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29年 1月26日 至 平成29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29年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成29年 7月25日現在
1. ※1 期首元本額	86,953,046円	87,288,423円
期中追加設定元本額	1,867,806円	724,942円
期中一部解約元本額	1,532,429円	3,126,352円
2. ※1 中間計算期間末日における受益権の総数	87,288,423口	84,887,013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28年 1月26日 至 平成28年 7月25日	当中間計算期間 自 平成29年 1月26日 至 平成29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29年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成29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、その差額はあります。	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29年 1月25日現在		当中間計算期間末 平成29年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3465円	1口当たり純資産額	1.3863円
(1万口当たり純資産額	13,465円)	(1万口当たり純資産額	13,863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29年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成29年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,147,982	15,576,123
親投資信託受益証券	303,964,320	296,962,187
未収入金	2,279,202	2,241,268
流動資産合計	322,391,504	314,779,578
資産合計	322,391,504	314,779,578
負債の部		
流動負債		
未払解約金	28,710	—
未払受託者報酬	136,439	135,787
未払委託者報酬	2,165,881	2,155,635
未払利息	31	36
その他未払費用	68,132	67,808
流動負債合計	2,399,193	2,359,266
負債合計	2,399,193	2,359,266
純資産の部		
元本等		
元本	※1 222,400,776	※1 207,711,908
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	97,591,535	104,708,404
（分配準備積立金）	91,004,807	82,928,725
元本等合計	319,992,311	312,420,312
純資産合計	319,992,311	312,420,312
負債純資産合計	322,391,504	314,779,578

(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28年 1月26日 至 平成28年 7月25日	当中間計算期間 自 平成29年 1月26日 至 平成29年 7月25日
営業収益		
受取利息	558	173
有価証券売買等損益	4,702,862	16,406,933
営業収益合計	4,703,420	16,407,106
営業費用		
支払利息	3,200	5,543
受託者報酬	134,368	135,787
委託者報酬	2,132,959	2,155,635
その他費用	67,468	67,808
営業費用合計	2,337,995	2,364,773
営業利益又は営業損失（△）	2,365,425	14,042,333
経常利益又は経常損失（△）	2,365,425	14,042,333
中間純利益又は中間純損失（△）	2,365,425	14,042,333
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（△）	△54,395	693,077
期首剰余金又は期首欠損金（△）	86,443,055	97,591,535
剰余金増加額又は欠損金減少額	518,495	2,509,704
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	518,495	2,509,704
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,392,628	8,742,091
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,392,628	8,742,091
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（△）	86,988,742	104,708,404

(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29年 1月26日 至 平成29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29年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成29年 7月25日現在
1. ※1 期首元本額	232,972,249円	222,400,776円
期中追加設定元本額	8,292,043円	5,224,425円
期中一部解約元本額	18,863,516円	19,913,293円
2. ※1 中間計算期間末日における受益権の総数	222,400,776口	207,711,908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28年 1月26日 至 平成28年 7月25日	当中間計算期間 自 平成29年 1月26日 至 平成29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29年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成29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、その差額はあります。	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29年 1月25日現在		当中間計算期間末 平成29年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.4388円	1口当たり純資産額	1.5041円
(1万口当たり純資産額	14,388円)	(1万口当たり純資産額	15,041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29年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成29年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,451,825	5,533,912
親投資信託受益証券	102,605,696	105,725,919
未収入金	898,939	909,977
流動資産合計	108,956,460	112,169,808
資産合計	108,956,460	112,169,808
負債の部		
流動負債		
未払解約金	—	448
未払受託者報酬	45,609	46,140
未払委託者報酬	877,933	888,298
未払利息	10	13
その他未払費用	22,712	22,990
流動負債合計	946,264	957,889
負債合計	946,264	957,889
純資産の部		
元本等		
元本	※1 76,537,470	※1 74,253,313
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	31,472,726	36,958,606
（分配準備積立金）	35,390,550	34,150,466
元本等合計	108,010,196	111,211,919
純資産合計	108,010,196	111,211,919
負債純資産合計	108,956,460	112,169,808

(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28年 1月26日 至 平成28年 7月25日	当中間計算期間 自 平成29年 1月26日 至 平成29年 7月25日
営業収益		
受取利息	179	56
有価証券売買等損益	590,547	7,399,347
営業収益合計	590,726	7,399,403
営業費用		
支払利息	1,049	1,836
受託者報酬	44,571	46,140
委託者報酬	857,813	888,298
その他費用	22,315	22,990
営業費用合計	925,748	959,264
営業利益又は営業損失（△）	△335,022	6,440,139
経常利益又は経常損失（△）	△335,022	6,440,139
中間純利益又は中間純損失（△）	△335,022	6,440,139
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（△）	△32,269	31,160
期首剰余金又は期首欠損金（△）	25,661,046	31,472,726
剰余金増加額又は欠損金減少額	512,331	180,480
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	512,331	180,480
剰余金減少額又は欠損金増加額	202,732	1,103,579
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	202,732	1,103,579
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（△）	25,667,892	36,958,606

(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29年 1月26日 至 平成29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29年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成29年 7月25日現在
1. ※1 期首元本額	78,652,118円	76,537,470円
期中追加設定元本額	1,992,543円	399,517円
期中一部解約元本額	4,107,191円	2,683,674円
2. ※1 中間計算期間末日における受益権の総数	76,537,470口	74,253,313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28年 1月26日 至 平成28年 7月25日	当中間計算期間 自 平成29年 1月26日 至 平成29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29年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成29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、その差額はあります。	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29年 1月25日現在		当中間計算期間末 平成29年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.4112円	1口当たり純資産額	1.4977円
(1万口当たり純資産額	14,112円)	(1万口当たり純資産額	14,977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29年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成29年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	323,595,667	309,674,895
未収入金	4,357,656	3,199,086
流動資産合計	327,953,323	312,873,981
資産合計	327,953,323	312,873,981
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,070,207	17,546
未払受託者報酬	137,700	133,259
未払委託者報酬	3,080,993	2,981,735
その他未払費用	68,756	66,546
流動負債合計	4,357,656	3,199,086
負債合計	4,357,656	3,199,086
純資産の部		
元本等		
元本	※1 232,475,070	※1 206,768,298
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	91,120,597	102,906,597
（分配準備積立金）	105,110,683	90,149,032
元本等合計	323,595,667	309,674,895
純資産合計	323,595,667	309,674,895
負債純資産合計	327,953,323	312,873,981

(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28年 1月26日 至 平成28年 7月25日	当中間計算期間 自 平成29年 1月26日 至 平成29年 7月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,688,184	26,151,859
営業収益合計	1,688,184	26,151,859
営業費用		
受託者報酬	137,814	133,259
委託者報酬	3,083,610	2,981,735
その他費用	68,820	66,546
営業費用合計	3,290,244	3,181,540
営業利益又は営業損失（△）	△1,602,060	22,970,319
経常利益又は経常損失（△）	△1,602,060	22,970,319
中間純利益又は中間純損失（△）	△1,602,060	22,970,319
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（△）	△894	1,577,080
期首剰余金又は期首欠損金（△）	72,774,809	91,120,597
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,439,999	3,512,058
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	1,439,999	3,512,058
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,073,839	13,119,297
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,073,839	13,119,297
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（△）	69,539,803	102,906,597

(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29年 1月26日 至 平成29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29年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成29年 7月25日現在
1. ※1 期首元本額	256,056,845円	232,475,070円
期中追加設定元本額	13,546,978円	7,732,557円
期中一部解約元本額	37,128,753円	33,439,329円
2. ※1 中間計算期間末日における受益権の総数	232,475,070口	206,768,298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28年 1月26日 至 平成28年 7月25日	当中間計算期間 自 平成29年 1月26日 至 平成29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29年 1月25日現在	当中間計算期間末 平成29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、その差額はあります。	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29年 1月25日現在		当中間計算期間末 平成29年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3920円	1口当たり純資産額	1.4977円
(1万口当たり純資産額	13,920円)	(1万口当たり純資産額	14,977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29年 1月25日現在	平成29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		120,123	79,618
コール・ローン		278,737,601	148,934,877
株式		36,295,547,940	38,090,100,680
未収入金		688,854,485	—
未収配当金		32,221,850	36,312,600
流動資産合計		37,295,481,999	38,275,427,775
資産合計		37,295,481,999	38,275,427,775
負債の部			
流動負債			
未払金		678,318,204	—
未払解約金		165,092,229	68,211,460
未払利息		544	353
流動負債合計		843,410,977	68,211,813
負債合計		843,410,977	68,211,813
純資産の部			
元本等			

元本	※1	29,303,653,096	28,240,388,266
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		7,148,417,926	9,966,827,696
元本等合計		36,452,071,022	38,207,215,962
純資産合計		36,452,071,022	38,207,215,962
負債純資産合計		37,295,481,999	38,275,427,775

(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29年 1月26日 至 平成29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29年 1月25日現在	平成29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	30,766,525,743円	29,303,653,096円
同期中における追加設定元本額	8,557,526,361円	2,964,241,522円
同期中における一部解約元本額	10,020,399,008円	4,027,506,352円
同中間期末における元本額	29,303,653,096円	28,240,388,266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〉	402,614,453円	342,189,775円
東京海上日本株アクティブファンド	281,734,088円	239,958,428円
東京海上・未来設計ファンド1	5,092,905円	4,351,211円
東京海上・未来設計ファンド2	19,139,868円	17,524,308円
東京海上・未来設計ファンド3	78,115,157円	69,555,828円
東京海上・未来設計ファンド4	35,115,461円	32,907,775円
東京海上・未来設計ファンド5	131,256,330円	114,191,859円
東京海上セレクション・日本株式	16,826,894,761円	16,284,591,041円
東京海上セレクション・バランス30	1,288,387,327円	1,251,362,597円
東京海上セレクション・バランス50	5,215,461,500円	5,050,657,828円
東京海上セレクション・バランス70	4,538,970,127円	4,479,593,269円
東京海上・年金運用型戦略ファンド （年1回決算型）	63,685,789円	48,666,558円
TMAバランス25V A 〈適格機関投資家限定〉	333,312,769円	239,286,980円
TMAバランス50V A 〈適格機関投資家限定〉	57,245,823円	47,810,491円
TMAバランス75V A 〈適格機関投資家限定〉	26,626,738円	17,740,318円
計	29,303,653,096円	28,240,388,266円

2.※1 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	29,303,653,096口	28,240,388,266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29年 1月25日現在	平成29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、その差額はあります。	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29年 1月25日現在		平成29年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.2439円	1口当たり純資産額	1.3529円
（1万口当たり純資産額	12,439円）	（1万口当たり純資産額	13,529円）

「TMA日本債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		平成29年 1月25日現在	平成29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		786,850,159	678,069,420
国債証券		49,494,218,030	79,415,091,340
地方債証券		5,950,913,256	2,014,626,103
特殊債券		3,781,737,720	501,334,000

社債券		19,835,521,556	24,545,623,829
未収入金		4,811,497,100	7,815,177,130
未収利息		133,222,922	147,691,546
前払費用		53,951,235	50,343,573
流動資産合計		84,847,911,978	115,167,956,941
資産合計		84,847,911,978	115,167,956,941
負債の部			
流動負債			
未払金		4,779,805,700	7,815,140,450
未払解約金		199,453,868	96,666,819
未払利息		1,535	1,608
流動負債合計		4,979,261,103	7,911,808,877
負債合計		4,979,261,103	7,911,808,877
純資産の部			
元本等			
元本	※1	58,166,723,839	77,892,062,792
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		21,701,927,036	29,364,085,272
元本等合計		79,868,650,875	107,256,148,064
純資産合計		79,868,650,875	107,256,148,064
負債純資産合計		84,847,911,978	115,167,956,941

(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29年 1月26日 至 平成29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29年 1月25日現在	平成29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	65,245,667,541円	58,166,723,839円
同期中における追加設定元本額	27,926,398,652円	30,862,825,685円
同期中における一部解約元本額	35,005,342,354円	11,137,486,732円
同中間期末における元本額	58,166,723,839円	77,892,062,792円
元本の内訳※		
東京海上・国内債券ファンド	486,182,294円	431,735,244円
東京海上・未来設計ファンド1	20,472,336円	18,981,847円
東京海上・未来設計ファンド2	34,192,830円	33,983,523円
東京海上・未来設計ファンド3	69,771,011円	67,428,317円
東京海上・未来設計ファンド4	7,842,130円	7,976,647円

東京海上セレクション・バランス30	2,704,435,992円	2,851,581,081円
東京海上セレクション・バランス50	3,593,730,675円	3,778,082,193円
東京海上セレクション・バランス70	810,822,623円	868,765,300円
東京海上セレクション・日本債券	10,802,012,495円	10,870,285,184円
東京海上・日本債券オープン （野村SMA向け）	12,900,686,364円	11,692,323,748円
東京海上・日本債券オープン （野村SMA・EW向け）	24,752,091,427円	22,584,151,188円
東京海上・年金運用型戦略ファンド （年1回決算型）	79,498,030円	66,066,211円
TMAバランス25VA 〈適格機関投資家限定〉	1,785,468,239円	1,391,670,648円
TMAバランス50VA 〈適格機関投資家限定〉	102,257,510円	92,720,276円
TMAバランス75VA 〈適格機関投資家限定〉	15,854,363円	11,465,517円
東京海上・日本債券オープンF （適格機関投資家専用）	1,405,520円	23,124,845,868円
計	58,166,723,839円	77,892,062,792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	58,166,723,839口	77,892,062,792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29年 1月25日現在	平成29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、その差額はあります。	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29年 1月25日現在		平成29年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3731円	1口当たり純資産額	1.3770円
(1万口当たり純資産額	13,731円)	(1万口当たり純資産額	13,770円)

「TMA外国株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		平成29年 1月25日現在	平成29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		39,706,381	131,405,454
コール・ローン		469,028,292	590,718,634
株式		23,690,099,293	25,180,247,582
投資証券		130,282,345	107,901,820
未収配当金		20,008,393	30,219,580
流動資産合計		24,349,124,704	26,040,493,070
資産合計		24,349,124,704	26,040,493,070
負債の部			
流動負債			
未払解約金		64,025,722	29,463,262
未払利息		915	1,401
流動負債合計		64,026,637	29,464,663
負債合計		64,026,637	29,464,663
純資産の部			
元本等			
元本	※1	11,789,813,759	11,575,699,645
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		12,495,284,308	14,435,328,762
元本等合計		24,285,098,067	26,011,028,407
純資産合計		24,285,098,067	26,011,028,407
負債純資産合計		24,349,124,704	26,040,493,070

(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29年 1月26日 至 平成29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	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。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成29年 1月25日現在	平成29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	11,788,943,113円	11,789,813,759円
同期中における追加設定元本額	2,431,867,742円	931,971,063円
同期中における一部解約元本額	2,430,997,096円	1,146,085,177円
同中間期末における元本額	11,789,813,759円	11,575,699,645円
元本の内訳※		
東京海上・外国株式ファンド	21,503,605円	20,732,974円
東京海上・未来設計ファンド1	3,024,164円	2,636,623円
東京海上・未来設計ファンド2	8,523,215円	7,960,328円
東京海上・未来設計ファンド3	38,638,293円	35,118,105円
東京海上・未来設計ファンド4	18,238,638円	17,438,770円
東京海上・未来設計ファンド5	70,146,289円	62,245,772円
東京海上セレクション・外国株式	8,556,497,575円	8,440,333,104円
東京海上セレクション・バランス30	382,533,471円	378,944,459円
東京海上セレクション・バランス50	1,327,273,977円	1,310,947,606円
東京海上セレクション・バランス70	1,078,085,385円	1,085,191,397円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型）	37,693,883円	29,475,062円
TMAバランス25VA 〈適格機関投資家限定〉	197,855,514円	144,966,972円
TMAバランス50VA 〈適格機関投資家限定〉	33,990,323円	28,960,972円
TMAバランス75VA 〈適格機関投資家限定〉	15,809,427円	10,747,501円
計	11,789,813,759円	11,575,699,645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	11,789,813,759口	11,575,699,645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29年 1月25日現在	平成29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29年1月25日現在）

該当事項はありません。

（平成29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29年 1月25日現在	平成29年 7月25日現在
1口当たり純資産額 2.0598円	1口当たり純資産額 2.2470円

(1万口当たり純資産額	20,598円)	(1万口当たり純資産額	22,470円)
-------------	----------	-------------	----------

「TMA外国債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		平成29年 1月25日現在	平成29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		499,888,387	43,812,133
コール・ローン		127,332,312	87,959,440
国債証券		16,707,989,711	17,808,491,762
派生商品評価勘定		279,916	806,150
未収入金		358,067,987	1,353,478,917
未収利息		91,360,659	61,670,235
前払費用		12,682,366	51,931,159
流動資産合計		17,797,601,338	19,408,149,796
資産合計		17,797,601,338	19,408,149,796
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		326,589	1,242,084
未払金		634,705,067	1,360,332,815
未払解約金		30,687,804	25,672,746
未払利息		248	208
流動負債合計		665,719,708	1,387,247,853
負債合計		665,719,708	1,387,247,853
純資産の部			
元本等			
元本	※1	8,168,593,696	8,294,178,795
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		8,963,287,934	9,726,723,148
元本等合計		17,131,881,630	18,020,901,943
純資産合計		17,131,881,630	18,020,901,943
負債純資産合計		17,797,601,338	19,408,149,796

(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29年 1月26日 至 平成29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	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	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。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成29年 1月25日現在	平成29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	7,824,621,677円	8,168,593,696円
同期中における追加設定元本額	1,558,907,249円	721,732,740円
同期中における一部解約元本額	1,214,935,230円	596,147,641円
同中間期末における元本額	8,168,593,696円	8,294,178,795円
元本の内訳※		
東京海上・外国債券ファンド	19,225,014円	19,148,881円
東京海上・未来設計ファンド1	1,465,301円	1,343,382円
東京海上・未来設計ファンド2	5,506,179円	5,410,163円
東京海上・未来設計ファンド3	14,975,038円	14,314,418円
東京海上・未来設計ファンド4	5,049,159円	5,079,502円
東京海上・未来設計ファンド5	7,551,897円	7,050,435円
東京海上セレクション・外国債券	4,748,745,662円	4,728,497,358円
東京海上セレクション・バランス30	741,399,784円	772,703,243円
東京海上セレクション・バランス50	1,714,898,843円	1,782,114,575円
東京海上セレクション・バランス70	887,963,516円	940,484,656円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型）	21,813,303円	18,032,182円
計	8,168,593,696円	8,294,178,795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	8,168,593,696口	8,294,178,795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29年 1月25日現在	平成29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29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	63,154,884	—	63,434,800	279,916
	ユーロ	63,154,884	—	63,434,800	279,916
	売建	55,923,801	—	56,250,390	△326,589
	英ポンド	15,819,372	—	15,955,520	△136,148
	スウェーデンクローネ	894,478	—	898,800	△4,322
	ノルウェークローネ	1,945,999	—	1,958,400	△12,401
	デンマーククローネ	2,988,815	—	3,003,030	△14,215
	ポーランドズロチ	3,745,683	—	3,769,200	△23,517
	マレーシアリングgit	30,529,454	—	30,665,440	△135,986
合計		119,078,685	—	119,685,190	△46,673

(平成29年7月25日現在)

(単位：円)

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引 以外の 取引	為替予約取引				
	買建	237,734,050	—	237,105,000	△629,050
	米ドル	55,407,850	—	55,665,000	257,150
	ユーロ	182,326,200	—	181,440,000	△886,200
	売建	244,948,116	—	244,755,000	193,116
	米ドル	167,544,000	—	166,995,000	549,000
	ユーロ	77,404,116	—	77,760,000	△355,884
合計		482,682,166	—	481,860,000	△435,934

(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。

①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。

②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29年 1月25日現在		平成29年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	2.0973円	1口当たり純資産額	2.1727円
(1万口当たり純資産額	20,973円)	(1万口当たり純資産額	21,727円)

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

平成29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29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	168	1,792,654
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
合計	168	1,792,654

(3)【その他】

提出日現在、訴訟事件その他委託会社等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32期事業年度（平成28年4月1日から平成29年3月31日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任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PwCあらた監査法人は、平成28年7月1日に名称を変更し、PwCあらた有限責任監査法人となりました。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	6,701,500	13,325,797
前払費用	154,914	132,260
未収委託者報酬	1,571,495	1,578,384
未収収益	2,099,418	2,534,825
未収入金	166,601	1,207
繰延税金資産	173,700	287,816
1年内回収予定の敷金	315,033	-
その他の流動資産	12,650	28,360
流動資産計	11,195,315	17,888,652
固定資産		
有形固定資産	* 1	* 1
建物	74,211	552,561
器具備品	2,187	439,621
リース資産	72,024	111,633
無形固定資産	-	1,306
電話加入権	5,254	13,204
ソフトウェア仮勘定	3,144	3,795
投資その他の資産	2,110	9,409
投資有価証券	2,366,401	2,418,251
関係会社株式	43,761	54,270
その他の関係会社有価証券	1,669,990	1,672,490
長期前払費用	31,200	31,200
敷金	9,018	9,298
その他長期差入保証金	450,152	450,632
繰延税金資産	10,852	20,912
固定資産計	151,427	179,447
資産合計	2,445,867	2,984,017
負債の部		
流動負債		
リース債務	-	822
未払金	* 2	1,958,922
未払手数料	2,119,086	634,930
その他未払金	592,624	1,323,992
未払費用	1,526,461	445,613
未払消費税等	147,843	108,541
未払法人税等	93,340	735,000
預り金	736,000	41,371
前受収益	39,072	3,027
賞与引当金	3,021	274,382
流動負債計	196,236	3,567,681
固定負債		
リース債務	-	548
退職給付引当金	197,784	393,213
役員退職慰労引当金	21,270	24,180
固定負債計	219,054	417,941
負債合計	219,054	3,985,623
純資産の部		
株主資本	10,085,959	16,885,034
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	-	400,000
その他資本剰余金	-	400,000
利益剰余金	8,085,959	14,485,034

利益準備金	500,000	500,000
その他利益剰余金	7,585,959	13,985,034
特別償却準備金	-	79
繰越利益剰余金	7,585,959	13,984,954
評価・換算差額等	1,567	2,011
その他有価証券評価差額金	1,567	2,011
純資産合計	10,087,527	16,887,045
負債・純資産合計	13,641,183	20,872,669

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	9,967,549	11,342,811
運用受託報酬	8,310,269	9,089,602
投資助言報酬	90,084	74,767
その他営業収益	1,114	64,158
営業収益計	18,369,017	20,571,339
営業費用		
支払手数料	4,535,693	5,363,864
広告宣伝費	160,685	251,016
公告費	150	313
調査費	5,212,764	5,401,672
調査費	1,906,774	1,635,494
委託調査費	3,305,989	3,766,178
委託計算費	116,997	109,429
営業雑経費	202,379	239,192
通信費	30,626	33,787
印刷費	143,441	173,307
協会費	17,642	17,533
諸会費	4,682	7,478
図書費	5,986	7,084
営業費用計	10,228,671	11,365,489
一般管理費		
給料	2,468,628	2,670,059
役員報酬	57,936	119,133
給料・手当	1,761,103	1,897,712
賞与	649,589	653,214
交際費	21,912	16,226
寄付金	-	3,598
旅費交通費	97,774	136,737
租税公課	68,294	115,360
不動産賃借料	258,391	316,801
役員退職慰労引当金繰入	3,050	2,910
退職給付費用	86,602	87,275
賞与引当金繰入	196,236	209,007
固定資産減価償却費	98,697	63,467
法定福利費	419,863	424,721
福利厚生費	7,908	8,100
諸経費	416,706	469,957
一般管理費計	4,144,067	4,524,223
営業利益	3,996,279	4,681,627
営業外収益		
受取利息	1,844	459
受取配当金	* 1 145,859	* 1 45,776
匿名組合投資利益	* 1 164,645	* 1 77,298
為替差益	-	8,924

雑益	13,905	10,134
営業外収益計	326,255	142,593
営業外費用		
為替差損	13,297	-
雑損	19,880	6,661
営業外費用計	33,178	6,661
経常利益	4,289,355	4,817,559
特別損失		
器具備品除却損	-	4,685
本社移転費用	-	229,113
特別損失計	-	233,799
税引前当期純利益	4,289,355	4,583,760
法人税、住民税及び事業税	1,425,847	1,455,944
法人税等調整額	△25,250	△25,233
法人税等合計	1,400,596	1,430,711
当期純利益	2,888,759	3,153,048

(3) 【株主資本等変動計算書】

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

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益 剰余金	
					特別償却 準備金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	-	-	500,000	-	7,585,959
当期変動額						
剰余金の配当						△ 791,278
合併による増加		400,000	400,000		103	4,037,200
特別償却準備金の取崩					△ 24	24
当期純利益						3,153,048
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	400,000	400,000	-	79	6,398,995
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	79	13,984,954

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等 合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	8,085,959	10,085,959	1,567	1,567	10,087,527
当期変動額					
剰余金の配当	△ 791,278	△ 791,278			△ 791,278
合併による増加	4,037,304	4,437,304			4,437,304
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	3,153,048	3,153,048			3,153,048
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			443	443	443
当期変動額合計	6,399,074	6,799,074	443	443	6,799,518
当期末残高	14,485,034	16,885,034	2,011	2,011	16,887,045

注記事項

重要な会計方針

第32期 自 平成28年 4月 1日 至 平成29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（リース資産を除く）

定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。また、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) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リースに係る有形固定資産中のリース資産は、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

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。

（会計方針の変更）

第32期 自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日	
法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取り扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。 これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の減価償却費が19,582千円減少し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益がそれぞれ19,582千円増加しております。	

（貸借対照表関係）

第31期 平成28年3月31日現在	第32期 平成29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。 <table> <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> ＊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。 <table> <tr> <td>関係会社に対する未払金</td><td>732,363千円</td></tr> </table>	建物	226,926千円	器具備品	496,441千円	関係会社に対する未払金	732,363千円	＊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> <tr> <td>建物</td><td>20,366千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>453,412千円</td></tr> <tr> <td>リース資産</td><td>2,612千円</td></tr> </table>	建物	20,366千円	器具備品	453,412千円	リース資産	2,612千円
建物	226,926千円												
器具備品	496,441千円												
関係会社に対する未払金	732,363千円												
建物	20,366千円												
器具備品	453,412千円												
リース資産	2,612千円												

（損益計算書関係）

第31期 自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日	第32期 自 平成28年4月1日 至 平成29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。 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 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。	※ 1. 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。 関係会社からの受取配当金 45,377千円 関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配 77,298千円
--	--

(株主資本等変動計算書関係)

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
(ニ) 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	791,278千円
(ロ) 配当の原資	利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	20,660円
(ニ) 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

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29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28年4月1日 現在	増加	減少	平成29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28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	791,278千円
(ロ) 1株当たり配当額	20,660円

(ハ) 基準日	平成28年3月31日
(ニ) 効力発生日	平成28年6月28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29年6月30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	1,784,014千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	46,580円
(ニ) 基準日	平成29年3月31日
(ホ) 効力発生日	平成29年6月30日

(リース取引関係)

第31期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

所有権移転外ファイナンス・リース取引

1. リース資産の内容

事務機器の一部については、所有権移転外ファイナンス・リース契約により使用しております。

2. リース資産の減価償却の方法

「重要な会計方針」の「2. 固定資産の減価償却の方法」に記載の通りであります。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

第31期 自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日	第32期 自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日
(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。	(1) 金融商品に対する取組方針 同左
(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。	(2) 金融商品の内容及びそのリスク 同左
(3) 金融商品に係るリスク管理体制 ① 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。	(3) 金融商品に係るリスク管理体制 ① 信用リスク 同左

② 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。 ③ 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。	② 市場リスク 同左 ③ 流動性リスク 同左
--	--

2. 金融商品の時価等に関する事項

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）。

（単位：千円）

	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。

第32期（平成29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	13,325,797	13,325,797	-
(2)未収委託者報酬	1,578,384	1,578,384	-
(3)未収収益	2,534,825	2,534,825	-
(4)未収入金	1,207	1,207	-
(5)投資有価証券 其他有価証券	54,270	54,270	-
(6)預り金	(41,371)	(41,371)	-
(7)未払金	(1,958,922)	(1,958,922)	-
(8)未払費用	(445,613)	(445,613)	-
(9)未払消費税等	(108,541)	(108,541)	-
(10)未払法人税等	(735,000)	(735,000)	-

（※）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31期 平成28年3月31日現在	第32期 平成29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、(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 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。 (6) 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。	(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益、(4) 未収入金、(6) 預り金、(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払消費税等及び(10) 未払法人税等 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。 (5) 投資有価証券 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31期 平成28年3月31日現在		第32期 平成29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	1,637,243	子会社株式	1,639,743
関連会社株式	32,747	関連会社株式	32,747
その他の関係会社	31,200	その他の関係会社	31,200
有価証券		有価証券	
敷金	450,152	敷金	450,632
その他長期差入保証金	10,852	その他長期差入保証金	20,912

(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31期 平成28年3月31日現在	第32期 平成29年3月31日現在
該当事項はありません。	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	-

第32期（平成29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	13,325,573	-	-	-
未収委託者報酬	1,578,384	-	-	-
未収収益	2,534,825	-	-	-
未収入金	1,207	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	6,000	21,783	6,000	-
合計	17,445,990	21,783	6,000	-

(有価証券関係)

第31期 平成28年3月31日現在	第32期 平成29年3月31日現在																																
1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券 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、記載しておりません。 2. その他有価証券 (単位：千円) <table><tr><th>区分</th><th>貸借対照表計上額</th><th>取得原価</th><th>差額</th></tr><tr><td>①貸借対照表計上額が取得原価を超えるものの証券投資信託</td><td>26,436</td><td>21,324</td><td>5,111</td></tr><tr><td>②貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの証券投資信託</td><td>17,324</td><td>20,176</td><td>△2,851</td></tr><tr><td>合計</td><td>43,761</td><td>41,501</td><td>2,259</td></tr></table> 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 該当事項はありません。	区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額	①貸借対照表計上額が取得原価を超えるものの証券投資信託	26,436	21,324	5,111	②貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの証券投資信託	17,324	20,176	△2,851	合計	43,761	41,501	2,259	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 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1,639,743千円、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、記載しておりません。 2. その他有価証券 (単位：千円) <table><tr><th>区分</th><th>貸借対照表計上額</th><th>取得原価</th><th>差額</th></tr><tr><td>①貸借対照表計上額が取得原価を超えるものの証券投資信託</td><td>33,725</td><td>27,289</td><td>6,435</td></tr><tr><td>②貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの証券投資信託</td><td>20,545</td><td>24,081</td><td>△3,536</td></tr><tr><td>合計</td><td>54,270</td><td>51,371</td><td>2,899</td></tr></table> 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 同左	区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額	①貸借対照表計上額が取得原価を超えるものの証券投資信託	33,725	27,289	6,435	②貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの証券投資信託	20,545	24,081	△3,536	合計	54,270	51,371	2,899
区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額																														
①貸借対照表計上額が取得原価を超えるものの証券投資信託	26,436	21,324	5,111																														
②貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの証券投資信託	17,324	20,176	△2,851																														
合計	43,761	41,501	2,259																														
区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額																														
①貸借対照表計上額が取得原価を超えるものの証券投資信託	33,725	27,289	6,435																														
②貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの証券投資信託	20,545	24,081	△3,536																														
合計	54,270	51,371	2,899																														

(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31期	第32期
	自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日	自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日
退職給付引当金の期首残高	179,872千円	197,784千円
退職給付費用	33,702千円	31,281千円
退職給付の支払額	△15,789千円	△6,251千円
合併による増加	-	179,615千円
確定拠出年金制度への移管額	-	△9,217千円
退職給付引当金の期末残高	197,784千円	393,213千円

(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31期 平成28年3月31日現在	第32期 平成29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	197,784千円	393,213千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	197,784千円	393,213千円
退職給付引当金	197,784千円	393,213千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	197,784千円	393,213千円

(3) 退職給付費用

	第31期	第32期
	自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日	自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日
簡便法で計算した退職給付費用	33,702千円	22,064千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第31期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）43,203千円、第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）46,034千円であります。

(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的主要原因別の内訳

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)

繰延税金資産		
役員退職慰労引当金	6,512千円	7,403千円
退職給付引当金	60,561千円	120,401千円
未払金	2,992千円	3,507千円
賞与引当金	60,558千円	84,674千円
未払法定福利費	7,858千円	12,005千円
未払事業所税	2,632千円	3,291千円
未払事業税	45,510千円	35,145千円
未払調査費	45,270千円	45,734千円
減価償却超過額	85,044千円	52,565千円
未払確定拠出年金	1,112千円	1,236千円
未払費用	7,764千円	102,221千円
繰延税金資産小計	325,819千円	468,187千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	325,819千円	468,187千円
繰延税金負債		
特別償却準備金	-	35千円
其他有価証券評価差額金	691千円	887千円
繰延税金負債合計	691千円	923千円
繰延税金資産の純額	325,127千円	467,264千円

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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29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

（企業結合等関係）

第31期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

共通支配下の取引等

当社は、平成28年3月9日付け合併契約に基づき、東京海上不動産投資顧問株式会社と、平成28年10月1日付けで合併いたしました。

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、投資助言業等

(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. 実施した会計処理の概要

「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いたしました。

(セグメント情報等)

第31期 自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日	第32期 自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日
[セグメント情報] 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。 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。 [関連情報] 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。 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。 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。	[セグメント情報] 同左 [関連情報] 1. 製品及びサービスごとの情報 同左 2. 地域ごとの情報 (1) 営業収益 同左 (2) 有形固定資産 同左 3. 主要な顧客ごとの情報 同左

(関連当事者情報)

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	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
						役員の 兼任				

(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	増資の 引受	1,415,648	-	-
						役員の 兼任				
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	委託 調査費 の支払	1,250,497	未払金	255,308
						役員の 派遣			未払費用	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。

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29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	投資運用業 投資助言業	(所有) 直接50%	運用の 再委任	委託 調査費 の支払	917,507	未払金	200,874
						役員の 派遣			未払費用	14,636

(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。

(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

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)
同一の 親会社 をもつ 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 千円	損害保険業	なし	運用の 一任	運用受 託報酬 の受取	1,247,159	未収収益	285,970
						役員の 兼任				
同一の 親会社 をもつ 会社	Delphi Capital Management, Inc.	米国・ ニューヨーク	USD 1千	資産運用業	なし	運用の 再委託	委託 調査費 の支払	763,120	未払金	225,715

(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。

(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）

(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いません。	
(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

第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
1株当たり純資産額	440,915円03銭
1株当たり当期純利益金額	82,325円02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	16,887,045千円
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	16,887,045千円
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	3,153,048千円
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	3,153,048千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

独立監査人の監査報告書

平成29年6月5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 印
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28年4月1日から平成29年3月31日までの第32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29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) 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. 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29年9月6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
業務執行社員 公認会計士 荒川 進 ⑩指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 久保 直毅 ⑩

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29年1月26日から平成29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な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29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29年1月26日から平成29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データは中間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29年9月6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 ⑩
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅 ⑩
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29年1月26日から平成29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29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29年1月26日から平成29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データは中間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29年9月6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
業務執行社員 公認会計士 荒川 進 ⑩

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 久保 直毅 ⑩

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29年1月26日から平成29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な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29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29年1月26日から平成29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データは中間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29年9月6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
業務執行社員 公認会計士 荒川 進 ⑩

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 久保 直毅 ⑩

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29年1月26日から平成29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29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29年1月26日から平成29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データは中間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29年9月6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 ⑩
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅 ⑩
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29年1月26日から平成29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29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29年1月26日から平成29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データは中間監査の対象には含まれていません。