

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2018年10月25日
【計算期間】	第18期中(自 2018年1月26日 至 2018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】	代表取締役社長 後藤 俊夫
【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2018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	41,284,371	70.06
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		17,636,989	29.93
合計（純資産総額）		58,921,360	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	102,345,697	85.12
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		17,883,807	14.87
合計（純資産総額）		120,229,504	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	330,135,034	95.16
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		16,758,662	4.83
合計（純資産総額）		346,893,696	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	111,869,811	95.21
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		5,621,180	4.78
合計（純資産総額）		117,490,991	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	331,726,677	100.20
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		683,497	0.20
合計（純資産総額）		331,043,180	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	44,667,592,450	99.16
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		374,396,310	0.83
合計（純資産総額）		45,041,988,760	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	106,353,093,131	66.80
地方債証券	日本	1,776,692,877	1.11
特殊債券	日本	2,804,000,000	1.76
社債券	日本	46,663,394,743	29.31
	アメリカ	400,138,000	0.25
	小計	47,063,532,743	29.56
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		1,207,692,516	0.75
合計(純資産総額)		159,205,011,267	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	22,511,510,608	72.56
	カナダ	461,433,469	1.48
	ドイツ	608,824,982	1.96
	イタリア	55,827,404	0.17
	フランス	164,980,407	0.53
	オーストラリア	300,653,325	0.96
	イギリス	2,128,697,146	6.86
	スイス	507,330,717	1.63
	香港	57,505,600	0.18
	シンガポール	52,942,400	0.17
	オランダ	188,596,345	0.60
	スペイン	439,814,740	1.41
	スウェーデン	620,186,112	1.99
	ノルウェー	161,946,120	0.52
	デンマーク	632,338,042	2.03
	アイルランド	407,512,162	1.31
	中華人民共和国	572,915,812	1.84
	ケイマン	309,287,304	0.99
キュラソー	71,456,004	0.23	
小計	30,253,758,699	97.52	
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		766,994,935	2.47
合計(純資産総額)		31,020,753,634	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	9,265,812,121	47.40
	カナダ	413,309,291	2.11
	ドイツ	1,221,833,970	6.25
	イタリア	1,707,570,216	8.73
	フランス	1,826,740,284	9.34
	オーストラリア	532,795,886	2.72

	イギリス	1,303,031,308	6.66
	シンガポール	16,975,672	0.08
	オランダ	413,705,160	2.11
	スペイン	1,506,437,518	7.70
	ベルギー	490,879,516	2.51
	スウェーデン	65,784,180	0.33
	オーストリア	270,522,571	1.38
	メキシコ	147,595,961	0.75
	ポーランド	70,844,367	0.36
	小計	19,253,838,021	98.49
	コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)	294,126,410	1.50
	合計(純資産総額)	19,547,964,431	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8計算期間末	(2009年 1月26日)	97	97	0.9252	0.9252
第9計算期間末	(2010年 1月25日)	125	125	0.9968	0.9968
第10計算期間末	(2011年 1月25日)	148	148	1.0116	1.0116
第11計算期間末	(2012年 1月25日)	159	159	0.9912	0.9912
第12計算期間末	(2013年 1月25日)	166	166	1.0589	1.0589
第13計算期間末	(2014年 1月27日)	93	93	1.1491	1.1491
第14計算期間末	(2015年 1月26日)	52	52	1.2191	1.2191
第15計算期間末	(2016年 1月25日)	60	60	1.2130	1.2130
第16計算期間末	(2017年 1月25日)	62	62	1.2404	1.2404
第17計算期間末	(2018年 1月25日)	58	58	1.3014	1.3014
	2017年 8月末日	58	-	1.2624	-
	9月末日	58	-	1.2720	-
	10月末日	59	-	1.2822	-
	11月末日	58	-	1.2878	-
	12月末日	58	-	1.2943	-
	2018年 1月末日	58	-	1.2957	-
	2月末日	57	-	1.2872	-
	3月末日	57	-	1.2827	-
	4月末日	58	-	1.2891	-
	5月末日	58	-	1.2895	-
	6月末日	58	-	1.2898	-
	7月末日	58	-	1.2940	-
	8月末日	58	-	1.2933	-

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8計算期間末	(2009年 1月26日)	163	163	0.8594	0.8594
第9計算期間末	(2010年 1月25日)	236	236	0.9724	0.9724
第10計算期間末	(2011年 1月25日)	281	281	0.9868	0.9868
第11計算期間末	(2012年 1月25日)	289	289	0.9410	0.9410
第12計算期間末	(2013年 1月25日)	339	339	1.0473	1.0473
第13計算期間末	(2014年 1月27日)	190	190	1.2030	1.2030
第14計算期間末	(2015年 1月26日)	115	115	1.3178	1.3178
第15計算期間末	(2016年 1月25日)	113	113	1.3045	1.3045
第16計算期間末	(2017年 1月25日)	117	117	1.3465	1.3465
第17計算期間末	(2018年 1月25日)	121	121	1.4706	1.4706
2017年 8月末日		117	-	1.3886	-
9月末日		119	-	1.4097	-
10月末日		121	-	1.4320	-
11月末日		121	-	1.4424	-
12月末日		120	-	1.4550	-
2018年 1月末日		120	-	1.4584	-
2月末日		119	-	1.4391	-
3月末日		118	-	1.4306	-
4月末日		119	-	1.4431	-
5月末日		119	-	1.4417	-
6月末日		119	-	1.4416	-
7月末日		120	-	1.4509	-
8月末日		120	-	1.4519	-

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8計算期間末	(2009年 1月26日)	469	469	0.7701	0.7701
第9計算期間末	(2010年 1月25日)	715	715	0.9240	0.9240
第10計算期間末	(2011年 1月25日)	832	832	0.9438	0.9438
第11計算期間末	(2012年 1月25日)	803	803	0.8695	0.8695
第12計算期間末	(2013年 1月25日)	963	963	1.0092	1.0092
第13計算期間末	(2014年 1月27日)	598	598	1.2338	1.2338
第14計算期間末	(2015年 1月26日)	348	348	1.3984	1.3984
第15計算期間末	(2016年 1月25日)	319	319	1.3710	1.3710
第16計算期間末	(2017年 1月25日)	319	319	1.4388	1.4388
第17計算期間末	(2018年 1月25日)	346	346	1.6474	1.6474
2017年 8月末日		312	-	1.5052	-
9月末日		317	-	1.5419	-
10月末日		328	-	1.5796	-

11月末日	332	-	1.5966	-
12月末日	337	-	1.6175	-
2018年 1月末日	342	-	1.6273	-
2月末日	349	-	1.5942	-
3月末日	346	-	1.5772	-
4月末日	344	-	1.5994	-
5月末日	344	-	1.5993	-
6月末日	344	-	1.5982	-
7月末日	348	-	1.6159	-
8月末日	346	-	1.6218	-

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8計算期間末	(2009年 1月26日)	189	189	0.6516	0.6516
第9計算期間末	(2010年 1月25日)	309	309	0.8266	0.8266
第10計算期間末	(2011年 1月25日)	363	363	0.8466	0.8466
第11計算期間末	(2012年 1月25日)	345	345	0.7502	0.7502
第12計算期間末	(2013年 1月25日)	430	430	0.9044	0.9044
第13計算期間末	(2014年 1月27日)	240	240	1.1727	1.1727
第14計算期間末	(2015年 1月26日)	136	136	1.3695	1.3695
第15計算期間末	(2016年 1月25日)	104	104	1.3263	1.3263
第16計算期間末	(2017年 1月25日)	108	108	1.4112	1.4112
第17計算期間末	(2018年 1月25日)	123	123	1.6931	1.6931
	2017年 8月末日	110	-	1.4967	-
	9月末日	113	-	1.5476	-
	10月末日	116	-	1.5988	-
	11月末日	118	-	1.6212	-
	12月末日	120	-	1.6495	-
	2018年 1月末日	121	-	1.6659	-
	2月末日	118	-	1.6195	-
	3月末日	116	-	1.5944	-
	4月末日	119	-	1.6253	-
	5月末日	116	-	1.6264	-
	6月末日	116	-	1.6243	-
	7月末日	117	-	1.6501	-
	8月末日	117	-	1.6621	-

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8計算期間末	(2009年 1月26日)	257	257	0.5602	0.5602
第9計算期間末	(2010年 1月25日)	475	475	0.7473	0.7473

第10計算期間末	(2011年 1月25日)	571	571	0.7711	0.7711
第11計算期間末	(2012年 1月25日)	536	536	0.6588	0.6588
第12計算期間末	(2013年 1月25日)	691	691	0.8168	0.8168
第13計算期間末	(2014年 1月27日)	496	496	1.1184	1.1184
第14計算期間末	(2015年 1月26日)	342	342	1.3412	1.3412
第15計算期間末	(2016年 1月25日)	328	328	1.2842	1.2842
第16計算期間末	(2017年 1月25日)	323	323	1.3920	1.3920
第17計算期間末	(2018年 1月25日)	344	344	1.7461	1.7461
2017年 8月末日		306	-	1.4946	-
9月末日		315	-	1.5584	-
10月末日		326	-	1.6235	-
11月末日		325	-	1.6519	-
12月末日		332	-	1.6870	-
2018年 1月末日		336	-	1.7124	-
2月末日		324	-	1.6549	-
3月末日		315	-	1.6206	-
4月末日		319	-	1.6596	-
5月末日		320	-	1.6645	-
6月末日		320	-	1.6600	-
7月末日		327	-	1.6936	-
8月末日		331	-	1.7112	-

【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8計算期間	2008年 1月26日～2009年 1月26日	12.4
第9計算期間	2009年 1月27日～2010年 1月25日	7.7
第10計算期間	2010年 1月26日～2011年 1月25日	1.5
第11計算期間	2011年 1月26日～2012年 1月25日	2.0
第12計算期間	2012年 1月26日～2013年 1月25日	6.8
第13計算期間	2013年 1月26日～2014年 1月27日	8.5
第14計算期間	2014年 1月28日～2015年 1月26日	6.1

第15計算期間	2015年 1月27日～2016年 1月25日	0.5
第16計算期間	2016年 1月26日～2017年 1月25日	2.3
第17計算期間	2017年 1月26日～2018年 1月25日	4.9
第18中間計算期間	2018年 1月26日～2018年 7月25日	0.3

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8計算期間	2008年 1月26日～2009年 1月26日	21.8
第9計算期間	2009年 1月27日～2010年 1月25日	13.1
第10計算期間	2010年 1月26日～2011年 1月25日	1.5
第11計算期間	2011年 1月26日～2012年 1月25日	4.6
第12計算期間	2012年 1月26日～2013年 1月25日	11.3
第13計算期間	2013年 1月26日～2014年 1月27日	14.9
第14計算期間	2014年 1月28日～2015年 1月26日	9.5
第15計算期間	2015年 1月27日～2016年 1月25日	1.0
第16計算期間	2016年 1月26日～2017年 1月25日	3.2
第17計算期間	2017年 1月26日～2018年 1月25日	9.2
第18中間計算期間	2018年 1月26日～2018年 7月25日	0.8

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8計算期間	2008年 1月26日～2009年 1月26日	31.5
第9計算期間	2009年 1月27日～2010年 1月25日	20.0
第10計算期間	2010年 1月26日～2011年 1月25日	2.1
第11計算期間	2011年 1月26日～2012年 1月25日	7.9
第12計算期間	2012年 1月26日～2013年 1月25日	16.1
第13計算期間	2013年 1月26日～2014年 1月27日	22.3
第14計算期間	2014年 1月28日～2015年 1月26日	13.3
第15計算期間	2015年 1月27日～2016年 1月25日	2.0
第16計算期間	2016年 1月26日～2017年 1月25日	4.9
第17計算期間	2017年 1月26日～2018年 1月25日	14.5
第18中間計算期間	2018年 1月26日～2018年 7月25日	1.0

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8計算期間	2008年 1月26日～2009年 1月26日	41.6
第9計算期間	2009年 1月27日～2010年 1月25日	26.9
第10計算期間	2010年 1月26日～2011年 1月25日	2.4
第11計算期間	2011年 1月26日～2012年 1月25日	11.4
第12計算期間	2012年 1月26日～2013年 1月25日	20.6
第13計算期間	2013年 1月26日～2014年 1月27日	29.7
第14計算期間	2014年 1月28日～2015年 1月26日	16.8
第15計算期間	2015年 1月27日～2016年 1月25日	3.2
第16計算期間	2016年 1月26日～2017年 1月25日	6.4

第17計算期間	2017年 1月26日～2018年 1月25日	20.0
第18中間計算期間	2018年 1月26日～2018年 7月25日	1.3

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8計算期間	2008年 1月26日～2009年 1月26日	49.3
第9計算期間	2009年 1月27日～2010年 1月25日	33.4
第10計算期間	2010年 1月26日～2011年 1月25日	3.2
第11計算期間	2011年 1月26日～2012年 1月25日	14.6
第12計算期間	2012年 1月26日～2013年 1月25日	24.0
第13計算期間	2013年 1月26日～2014年 1月27日	36.9
第14計算期間	2014年 1月28日～2015年 1月26日	19.9
第15計算期間	2015年 1月27日～2016年 1月25日	4.2
第16計算期間	2016年 1月26日～2017年 1月25日	8.4
第17計算期間	2017年 1月26日～2018年 1月25日	25.4
第18中間計算期間	2018年 1月26日～2018年 7月25日	1.5

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8計算期間	2008年 1月26日～2009年 1月26日	37,332,571	10,206,491	104,920,239
第9計算期間	2009年 1月27日～2010年 1月25日	36,705,403	15,345,850	126,279,792
第10計算期間	2010年 1月26日～2011年 1月25日	37,871,070	17,505,959	146,644,903
第11計算期間	2011年 1月26日～2012年 1月25日	34,496,983	20,370,872	160,771,014
第12計算期間	2012年 1月26日～2013年 1月25日	28,698,960	32,010,990	157,458,984
第13計算期間	2013年 1月26日～2014年 1月27日	23,163,207	99,509,232	81,112,959
第14計算期間	2014年 1月28日～2015年 1月26日	5,841,745	44,072,766	42,881,938
第15計算期間	2015年 1月27日～2016年 1月25日	9,233,966	2,101,106	50,014,798
第16計算期間	2016年 1月26日～2017年 1月25日	7,777,192	7,358,401	50,433,589
第17計算期間	2017年 1月26日～2018年 1月25日	7,932,196	13,608,702	44,757,083
第18中間計算期間	2018年 1月26日～2018年 7月25日	843,314	184,716	45,415,681

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8計算期間	2008年 1月26日～2009年 1月26日	73,073,035	11,173,463	190,760,520
第9計算期間	2009年 1月27日～2010年 1月25日	63,854,449	11,356,270	243,258,699
第10計算期間	2010年 1月26日～2011年 1月25日	56,319,653	13,954,679	285,623,673
第11計算期間	2011年 1月26日～2012年 1月25日	45,395,643	23,285,133	307,734,183
第12計算期間	2012年 1月26日～2013年 1月25日	39,374,423	23,261,477	323,847,129
第13計算期間	2013年 1月26日～2014年 1月27日	28,888,841	194,749,571	157,986,399
第14計算期間	2014年 1月28日～2015年 1月26日	4,050,521	74,407,868	87,629,052
第15計算期間	2015年 1月27日～2016年 1月25日	4,864,370	5,540,376	86,953,046
第16計算期間	2016年 1月26日～2017年 1月25日	1,867,806	1,532,429	87,288,423

第17計算期間	2017年 1月26日～2018年 1月25日	1,541,606	5,947,314	82,882,715
第18中間計算期間	2018年 1月26日～2018年 7月25日	777,087	641,524	83,018,278

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8計算期間	2008年 1月26日～2009年 1月26日	205,431,322	29,707,283	609,839,116
第9計算期間	2009年 1月27日～2010年 1月25日	192,952,697	27,921,373	774,870,440
第10計算期間	2010年 1月26日～2011年 1月25日	161,275,362	54,304,533	881,841,269
第11計算期間	2011年 1月26日～2012年 1月25日	144,653,233	102,609,800	923,884,702
第12計算期間	2012年 1月26日～2013年 1月25日	119,278,758	88,215,089	954,948,371
第13計算期間	2013年 1月26日～2014年 1月27日	73,752,393	543,734,066	484,966,698
第14計算期間	2014年 1月28日～2015年 1月26日	10,117,954	246,106,886	248,977,766
第15計算期間	2015年 1月27日～2016年 1月25日	4,033,614	20,039,131	232,972,249
第16計算期間	2016年 1月26日～2017年 1月25日	8,292,043	18,863,516	222,400,776
第17計算期間	2017年 1月26日～2018年 1月25日	13,698,207	25,892,584	210,206,399
第18中間計算期間	2018年 1月26日～2018年 7月25日	10,222,106	4,827,534	215,600,971

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8計算期間	2008年 1月26日～2009年 1月26日	100,935,972	14,469,791	291,355,425
第9計算期間	2009年 1月27日～2010年 1月25日	105,614,259	22,073,427	374,896,257
第10計算期間	2010年 1月26日～2011年 1月25日	84,747,601	30,570,372	429,073,486
第11計算期間	2011年 1月26日～2012年 1月25日	72,681,839	41,619,006	460,136,319
第12計算期間	2012年 1月26日～2013年 1月25日	62,801,120	46,806,200	476,131,239
第13計算期間	2013年 1月26日～2014年 1月27日	37,880,019	309,141,420	204,869,838
第14計算期間	2014年 1月28日～2015年 1月26日	4,298,706	109,687,582	99,480,962
第15計算期間	2015年 1月27日～2016年 1月25日	1,135,264	21,964,108	78,652,118
第16計算期間	2016年 1月26日～2017年 1月25日	1,992,543	4,107,191	76,537,470
第17計算期間	2017年 1月26日～2018年 1月25日	921,540	4,301,535	73,157,475
第18中間計算期間	2018年 1月26日～2018年 7月25日	341,053	2,016,327	71,482,201

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8計算期間	2008年 1月26日～2009年 1月26日	218,839,977	32,880,910	459,310,214
第9計算期間	2009年 1月27日～2010年 1月25日	221,172,635	43,904,096	636,578,753
第10計算期間	2010年 1月26日～2011年 1月25日	173,566,000	69,302,560	740,842,193
第11計算期間	2011年 1月26日～2012年 1月25日	149,544,019	76,510,744	813,875,468
第12計算期間	2012年 1月26日～2013年 1月25日	120,609,591	87,693,752	846,791,307
第13計算期間	2013年 1月26日～2014年 1月27日	88,682,467	491,732,457	443,741,317
第14計算期間	2014年 1月28日～2015年 1月26日	10,925,591	199,210,501	255,456,407
第15計算期間	2015年 1月27日～2016年 1月25日	29,717,308	29,116,870	256,056,845
第16計算期間	2016年 1月26日～2017年 1月25日	13,546,978	37,128,753	232,475,070

第17計算期間	2017年 1月26日 ~ 2018年 1月25日	18,096,360	53,440,099	197,131,331
第18中間計算期間	2018年 1月26日 ~ 2018年 7月25日	2,074,167	5,948,367	193,257,131

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(2018年1月26日から2018年7月25日まで)の中間財務諸表について、P w C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 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	17,440,468	17,633,593
親投資信託受益証券	40,881,787	41,380,426
未収入金	171,720	167,658
流動資産合計	58,493,975	59,181,677
資産合計	58,493,975	59,181,677
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	22,317	21,786
未払委託者報酬	210,349	205,364
未払利息	37	49
その他未払費用	12,653	12,365
流動負債合計	245,356	239,564
負債合計	245,356	239,564
純資産の部		
元本等		
元本	1 44,757,083	1 45,415,681
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	13,491,536	13,526,432
(分配準備積立金)	7,847,934	7,815,804
元本等合計	58,248,619	58,942,113
純資産合計	58,248,619	58,942,113
負債純資産合計	58,493,975	59,181,677

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2017年 1月26日 至 2017年 7月25日	当中間計算期間 自 2018年 1月26日 至 2018年 7月25日
営業収益		
受取利息	199	47
有価証券売買等損益	1,224,683	90,368
営業収益合計	1,224,882	90,415
営業費用		
支払利息	6,285	7,439
受託者報酬	22,350	21,786
委託者報酬	210,746	205,364
その他費用	12,682	12,365
営業費用合計	252,063	246,954
営業利益又は営業損失()	972,819	156,539
経常利益又は経常損失()	972,819	156,539
中間純利益又は中間純損失()	972,819	156,539
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()	95,276	1,758
期首剰余金又は期首欠損金()	12,126,186	13,491,536
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,236,446	245,340
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	1,236,446	245,340
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,192,171	55,663
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,192,171	55,663
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()	12,048,004	13,526,432

(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 2018年 1月26日 至 2018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 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	50,433,589円	44,757,083円
期中追加設定元本額	7,932,196円	843,314円
期中一部解約元本額	13,608,702円	184,716円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の 総数	44,757,083口	45,415,681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 2017年 1月26日 至 2017年 7月25日	当中間計算期間 自 2018年 1月26日 至 2018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 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018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 2018年 1月25日現在		当中間計算期間末 2018年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3014円	1口当たり純資産額	1.2978円
(1万口当たり純資産額	13,014円)	(1万口当たり純資産額	12,978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 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	18,178,813	18,039,945
親投資信託受益証券	103,812,702	103,186,637
未収入金	599,711	588,273
流動資産合計	122,591,226	121,814,855
資産合計	122,591,226	121,814,855
負債の部		
流動負債		
未払解約金	103	-
未払受託者報酬	45,731	44,859
未払委託者報酬	633,672	621,680
未払利息	38	50
その他未払費用	26,041	25,550
流動負債合計	705,585	692,139
負債合計	705,585	692,139
純資産の部		
元本等		
元本	1 82,882,715	1 83,018,278
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	39,002,926	38,104,438
(分配準備積立金)	34,417,754	34,152,530
元本等合計	121,885,641	121,122,716
純資産合計	121,885,641	121,122,716
負債純資産合計	122,591,226	121,814,855

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前中間計算期間 自 2017年 1月26日 至 2017年 7月25日	当中間計算期間 自 2018年 1月26日 至 2018年 7月25日
営業収益		
受取利息	192	49
有価証券売買等損益	4,084,669	263,800
営業収益合計	4,084,861	263,751
営業費用		
支払利息	6,169	7,657
受託者報酬	43,958	44,859
委託者報酬	609,078	621,680
その他費用	25,024	25,550
営業費用合計	684,229	699,746
営業利益又は営業損失()	3,400,632	963,497
経常利益又は経常損失()	3,400,632	963,497
中間純利益又は中間純損失()	3,400,632	963,497
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()	38,884	22,598
期首剰余金又は期首欠損金()	30,247,414	39,002,926
剰余金増加額又は欠損金減少額	262,074	344,224
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	262,074	344,224
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,083,365	301,813
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,083,365	301,813
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()	32,787,871	38,104,438

(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 2018年 1月26日 至 2018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 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	87,288,423円	82,882,715円
期中追加設定元本額	1,541,606円	777,087円
期中一部解約元本額	5,947,314円	641,524円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の 総数	82,882,715口	83,018,278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 2017年 1月26日 至 2017年 7月25日	当中間計算期間 自 2018年 1月26日 至 2018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 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018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 2018年 1月25日現在		当中間計算期間末 2018年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.4706円	1口当たり純資産額	1.4590円
(1万口当たり純資産額	14,706円)	(1万口当たり純資産額	14,590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 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	17,106,829	17,337,942
親投資信託受益証券	329,301,952	334,305,402
未収入金	2,343,137	2,441,601
流動資産合計	348,751,918	354,084,945
資産合計	348,751,918	354,084,945
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	141,969	147,924
未払委託者報酬	2,253,613	2,348,306
未払利息	36	48
その他未払費用	70,880	73,879
流動負債合計	2,466,498	2,570,157
負債合計	2,466,498	2,570,157
純資産の部		
元本等		
元本	1 210,206,399	1 215,600,971
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	136,079,021	135,913,817
(分配準備積立金)	122,877,151	120,177,843
元本等合計	346,285,420	351,514,788
純資産合計	346,285,420	351,514,788
負債純資産合計	348,751,918	354,084,945

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2017年 1月26日 至 2017年 7月25日	当中間計算期間 自 2018年 1月26日 至 2018年 7月25日
営業収益		
受取利息	173	47
有価証券売買等損益	16,406,933	821,100
営業収益合計	16,407,106	821,053
営業費用		
支払利息	5,543	7,372
受託者報酬	135,787	147,924
委託者報酬	2,155,635	2,348,306
その他費用	67,808	73,879
営業費用合計	2,364,773	2,577,481
営業利益又は営業損失()	14,042,333	3,398,534
経常利益又は経常損失()	14,042,333	3,398,534
中間純利益又は中間純損失()	14,042,333	3,398,534
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()	693,077	324,433
期首剰余金又は期首欠損金()	97,591,535	136,079,021
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,509,704	6,021,601
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	2,509,704	6,021,601
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,742,091	3,112,704
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,742,091	3,112,704
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()	104,708,404	135,913,817

(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 2018年 1月26日 至 2018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 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	222,400,776円	210,206,399円
期中追加設定元本額	13,698,207円	10,222,106円
期中一部解約元本額	25,892,584円	4,827,534円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の 総数	210,206,399口	215,600,971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 2017年 1月26日 至 2017年 7月25日	当中間計算期間 自 2018年 1月26日 至 2018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 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018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 2018年 1月25日現在		当中間計算期間末 2018年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.6474円	1口当たり純資産額	1.6304円
(1万口当たり純資産額	16,474円)	(1万口当たり純資産額	16,304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 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,077,773	5,848,938
親投資信託受益証券	117,838,733	113,631,511
未収入金	995,358	998,275
流動資産合計	124,911,864	120,478,724
資産合計	124,911,864	120,478,724
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	304
未払受託者報酬	50,500	50,637
未払委託者報酬	972,087	974,654
未払利息	12	16
その他未払費用	25,161	25,225
流動負債合計	1,047,760	1,050,836
負債合計	1,047,760	1,050,836
純資産の部		
元本等		
元本	173,157,475	171,482,201
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	50,706,629	47,945,687
(分配準備積立金)	53,935,335	52,453,099
元本等合計	123,864,104	119,427,888
純資産合計	123,864,104	119,427,888
負債純資産合計	124,911,864	120,478,724

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前中間計算期間 自 2017年 1月26日 至 2017年 7月25日	当中間計算期間 自 2018年 1月26日 至 2018年 7月25日
営業収益		
受取利息	56	16
有価証券売買等損益	7,399,347	645,714
営業収益合計	7,399,403	645,698
営業費用		
支払利息	1,836	2,472
受託者報酬	46,140	50,637
委託者報酬	888,298	974,654
その他費用	22,990	25,225
営業費用合計	959,264	1,052,988
営業利益又は営業損失()	6,440,139	1,698,686
経常利益又は経常損失()	6,440,139	1,698,686
中間純利益又は中間純損失()	6,440,139	1,698,686
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()	31,160	115,137
期首剰余金又は期首欠損金()	31,472,726	50,706,629
剰余金増加額又は欠損金減少額	180,480	219,836
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	180,480	219,836
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,103,579	1,397,229
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,103,579	1,397,229
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()	36,958,606	47,945,687

(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 2018年 1月26日 至 2018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 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	76,537,470円	73,157,475円
期中追加設定元本額	921,540円	341,053円
期中一部解約元本額	4,301,535円	2,016,327円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の 総数	73,157,475口	71,482,201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 2017年 1月26日 至 2017年 7月25日	当中間計算期間 自 2018年 1月26日 至 2018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 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018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 2018年 1月25日現在		当中間計算期間末 2018年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.6931円	1口当たり純資産額	1.6707円
(1万口当たり純資産額	16,931円)	(1万口当たり純資産額	16,707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 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018年 7月25日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	344,202,816	332,409,956
未収入金	3,347,320	3,302,465
流動資産合計	347,550,136	335,712,421
資産合計	347,550,136	335,712,421
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	140,206	138,336
未払委託者報酬	3,137,099	3,095,057
その他未払費用	70,015	69,072
流動負債合計	3,347,320	3,302,465
負債合計	3,347,320	3,302,465
純資産の部		
元本等		
元本	197,131,331	193,257,131
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	147,071,485	139,152,825
(分配準備積立金)	148,462,001	143,998,631
元本等合計	344,202,816	332,409,956
純資産合計	344,202,816	332,409,956
負債純資産合計	347,550,136	335,712,421

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前中間計算期間 自 2017年 1月26日 至 2017年 7月25日	当中間計算期間 自 2018年 1月26日 至 2018年 7月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	26,151,859	2,119,851
営業収益合計	26,151,859	2,119,851
営業費用		
受託者報酬	133,259	138,336
委託者報酬	2,981,735	3,095,057
その他費用	66,546	69,072
営業費用合計	3,181,540	3,302,465
営業利益又は営業損失()	22,970,319	5,422,316
経常利益又は経常損失()	22,970,319	5,422,316
中間純利益又は中間純損失()	22,970,319	5,422,316
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()	1,577,080	574,670
期首剰余金又は期首欠損金()	91,120,597	147,071,485
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,512,058	1,364,969
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	3,512,058	1,364,969
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,119,297	4,435,983
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,119,297	4,435,983
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()	102,906,597	139,152,825

(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 2018年 1月26日 至 2018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 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	232,475,070円	197,131,331円
期中追加設定元本額	18,096,360円	2,074,167円
期中一部解約元本額	53,440,099円	5,948,367円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の 総数	197,131,331口	193,257,131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 2017年 1月26日 至 2017年 7月25日	当中間計算期間 自 2018年 1月26日 至 2018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 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018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 2018年 1月25日現在		当中間計算期間末 2018年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.7461円	1口当たり純資産額	1.7200円
(1万口当たり純資産額	17,461円)	(1万口当たり純資産額	17,200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

区 分	注記 番号	2018年 1月25日現在	2018年 7月25日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
金銭信託		452,075	544,843
コール・ローン		642,527,289	182,773,575
株式		45,975,730,370	45,383,441,880
未収入金		155,393,111	463,173,915
未収配当金		37,136,600	27,210,600
流動資産合計		46,811,239,445	46,057,144,813
資産合計		46,811,239,445	46,057,144,813
負債の部			
流動負債			
未払金		233,931,540	435,978,513
未払解約金		182,193,852	94,342,109
未払利息		1,371	510
流動負債合計		416,126,763	530,321,132
負債合計		416,126,763	530,321,132
純資産の部			
元本等			
元本	1	27,600,565,846	28,480,262,175

剰余金			
剰余金又は欠損金()		18,794,546,836	17,046,561,506
元本等合計		46,395,112,682	45,526,823,681
純資産合計		46,395,112,682	45,526,823,681
負債純資産合計		46,811,239,445	46,057,144,813

(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 2018年 1月26日 至 2018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	2018年 1月25日現在	2018年 7月25日現在
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	29,303,653,096円	27,600,565,846円
同期中における追加設定元本額	6,945,407,463円	4,504,021,041円
同期中における一部解約元本額	8,648,494,713円	3,624,324,712円
同中間期末における元本額	27,600,565,846円	28,480,262,175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>	318,956,027円	269,816,777円
東京海上日本株アクティブファンド	208,361,985円	201,788,471円
東京海上・未来設計ファンド1	3,598,949円	3,757,093円
東京海上・未来設計ファンド2	14,974,799円	15,349,589円
東京海上・未来設計ファンド3	63,308,866円	66,275,695円
東京海上・未来設計ファンド4	29,959,187円	29,768,217円
東京海上・未来設計ファンド5	103,184,220円	102,800,777円
東京海上セレクション・日本株式	16,485,445,517円	16,901,394,912円
東京海上セレクション・バランス30	1,140,552,929円	1,211,236,999円
東京海上セレクション・バランス50	4,632,652,079円	4,866,390,821円
東京海上セレクション・バランス70	4,330,239,263円	4,545,413,416円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	43,992,474円	56,529,624円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	171,338,213円	156,166,931円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	39,849,275円	39,875,599円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	14,152,063円	13,697,254円
計	27,600,565,846円	28,480,262,175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	27,600,565,846口	28,480,262,175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	2018年 1月25日現在	2018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ぬ。 (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)

2018年 1月25日現在		2018年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.6809円	1口当たり純資産額	1.5985円
(1万口当たり純資産額)	16,809円)	(1万口当たり純資産額)	15,985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	2018年 1月25日現在	2018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		847,610,793	8,205,263,604
国債証券		113,569,896,824	111,990,191,832
地方債証券		1,900,769,743	1,572,347,922
特殊債券		300,453,000	2,804,388,000
社債券		25,899,082,807	44,321,053,775
未収入金		4,208,264,444	5,895,963,640
未収利息		179,193,512	216,337,997

前払費用		100,927,876	56,080,326
流動資産合計		147,006,198,999	175,061,627,096
資産合計		147,006,198,999	175,061,627,096
負債の部			
流動負債			
未払金		4,077,182,700	12,577,054,200
未払解約金		533,958,460	485,936,869
未払利息		1,808	22,900
流動負債合計		4,611,142,968	13,063,013,969
負債合計		4,611,142,968	13,063,013,969
純資産の部			
元本等			
元本	1	103,169,609,959	116,817,238,941
剰余金			
剰余金又は欠損金()		39,225,446,072	45,181,374,186
元本等合計		142,395,056,031	161,998,613,127
純資産合計		142,395,056,031	161,998,613,127
負債純資産合計		147,006,198,999	175,061,627,096

(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 2018年 1月26日 至 2018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	2018年 1月25日現在	2018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	58,166,723,839円	103,169,609,959円
同期中における追加設定元本額	69,164,399,374円	28,550,529,231円
同期中における一部解約元本額	24,161,513,254円	14,902,900,249円
同中間期末における元本額	103,169,609,959円	116,817,238,941円
元本の内訳*		
東京海上・国内債券ファンド	403,945,291円	272,141,640円
東京海上・未来設計ファンド1	18,837,636円	18,926,368円
東京海上・未来設計ファンド2	34,852,044円	34,363,949円
東京海上・未来設計ファンド3	73,690,894円	74,185,551円
東京海上・未来設計ファンド4	8,714,599円	8,328,974円
東京海上セレクション・バランス30	3,119,728,567円	3,186,918,624円
東京海上セレクション・バランス50	4,159,891,438円	4,203,374,983円
東京海上セレクション・バランス70	1,008,458,317円	1,017,872,923円

東京海上セレクション・日本債券	10,813,588,735円	11,286,612,605円
東京海上・日本債券オープン(野村SMA向け)	10,756,646,905円	9,793,299,828円
東京海上・日本債券オープン(野村SMA・EW向け)	20,961,358,578円	23,268,587,893円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	71,656,496円	88,575,946円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	1,195,811,209円	1,047,869,069円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	92,694,396円	89,244,299円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	10,968,815円	10,218,567円
東京海上・日本債券オープンF(適格機関投資家専用)	50,438,766,039円	62,416,717,722円
計	103,169,609,959円	116,817,238,941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	103,169,609,959口	116,817,238,941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	2018年 1月25日現在	2018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)

2018年 1月25日現在		2018年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3802円	1口当たり純資産額	1.3868円

(1万口当たり純資産額	13,802円)	(1万口当たり純資産額	13,868円)
-------------	----------	-------------	----------

「TMA外国株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		2018年 1月25日現在	2018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		185,183,722	380,445,343
コール・ローン		483,744,159	321,124,778
株式		28,471,051,149	29,759,006,419
未収入金		187,757,233	296,538,416
未収配当金		12,810,515	22,627,915
流動資産合計		29,340,546,778	30,779,742,871
資産合計		29,340,546,778	30,779,742,871
負債の部			
流動負債			
未払金		117,877,802	
未払解約金		24,010,351	63,616,482
未払利息		1,032	896
流動負債合計		141,889,185	63,617,378
負債合計		141,889,185	63,617,378
純資産の部			
元本等			
元本	1	11,545,833,109	11,610,988,986
剰余金			
剰余金又は欠損金()		17,652,824,484	19,105,136,507
元本等合計		29,198,657,593	30,716,125,493
純資産合計		29,198,657,593	30,716,125,493
負債純資産合計		29,340,546,778	30,779,742,871

(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 2018年 1月26日 至 2018年 7月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>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。</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2018年 1月25日現在	2018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	11,789,813,759円	11,545,833,109円
同期中における追加設定元本額	1,917,474,846円	1,067,584,106円
同期中における一部解約元本額	2,161,455,496円	1,002,428,229円
同中間期末における元本額	11,545,833,109円	11,610,988,986円
元本の内訳*		
東京海上・外国株式ファンド	20,704,152円	20,053,391円
東京海上・未来設計ファンド1	2,365,809円	2,330,869円
東京海上・未来設計ファンド2	7,384,780円	7,142,629円
東京海上・未来設計ファンド3	34,691,933円	34,268,992円
東京海上・未来設計ファンド4	17,235,847円	16,165,327円
東京海上・未来設計ファンド5	61,060,643円	57,411,696円
東京海上セレクション・外国株式	8,405,680,492円	8,510,752,670円
東京海上セレクション・バランス30	375,000,595円	375,697,459円
東京海上セレクション・バランス50	1,305,514,605円	1,293,907,360円
東京海上セレクション・バランス70	1,139,140,416円	1,128,057,012円
東京海上・年金運用型戦略ファンド (年1回決算型)	28,927,644円	35,076,354円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	112,629,738円	96,905,296円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	26,195,748円	24,726,589円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	9,300,707円	8,493,342円
計	11,545,833,109円	11,610,988,986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	11,545,833,109口	11,610,988,986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	2018年 1月25日現在	2018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 (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つた場合、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

(2018年1月25日現在)

該当事項はありません。

(2018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)

	2018年 1月25日現在		2018年 7月25日現在
1口当たり純資産額	2.5289円	1口当たり純資産額	2.6454円

(1万口当たり純資産額	25,289円)	(1万口当たり純資産額	26,454円)
-------------	----------	-------------	----------

「TMA外国債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	2018年 1月25日現在	2018年 7月25日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		41,623,196	34,520,597
コール・ローン		118,601,022	75,864,889
国債証券		18,782,127,471	19,173,853,984
派生商品評価勘定			4,000
未収入金			146,813,063
未収利息		66,233,298	103,222,448
前払費用		87,700,798	65,060,785
流動資産合計		19,096,285,785	19,599,339,766
資産合計		19,096,285,785	19,599,339,766
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定			15,000
未払金			134,376,838
未払解約金		16,056,064	10,805,125
未払利息		253	211
流動負債合計		16,056,317	145,197,174
負債合計		16,056,317	145,197,174
純資産の部			
元本等			
元本	1	8,627,503,564	8,935,979,864
剰余金			
剰余金又は欠損金()		10,452,725,904	10,518,162,728
元本等合計		19,080,229,468	19,454,142,592
純資産合計		19,080,229,468	19,454,142,592
負債純資産合計		19,096,285,785	19,599,339,766

(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 2018年 1月26日 至 2018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	2018年 1月25日現在	2018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	8,168,593,696円	8,627,503,564円
同期中における追加設定元本額	1,599,100,273円	918,576,322円
同期中における一部解約元本額	1,140,190,405円	610,100,022円
同中間期末における元本額	8,627,503,564円	8,935,979,864円
元本の内訳*		
東京海上・外国債券ファンド	27,722,616円	17,558,694円
東京海上・未来設計ファンド1	1,288,531円	1,360,317円
東京海上・未来設計ファンド2	5,364,172円	5,557,524円
東京海上・未来設計ファンド3	15,122,753円	15,997,424円
東京海上・未来設計ファンド4	5,364,765円	5,389,114円
東京海上・未来設計ファンド5	7,390,216円	7,443,854円
東京海上セレクション・外国債券	4,776,271,744円	4,847,621,180円
東京海上セレクション・バランス30	817,349,235円	877,181,405円
東京海上セレクション・バランス50	1,897,152,170円	2,014,004,186円
東京海上セレクション・バランス70	1,055,570,174円	1,119,305,861円
東京海上・年金運用型戦略ファンド (年1回決算型)	18,907,188円	24,560,305円
計	8,627,503,564円	8,935,979,864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	8,627,503,564口	8,935,979,864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	2018年 1月25日現在	2018年 7月25日現在
-----	---------------	---------------

1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)
取引の時価等に関する事項

通貨関連

(2018年1月25日現在)
該当事項はありません。

(2018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				
	買建	26,024,000		26,028,000	4,000
	ユーロ	26,024,000		26,028,000	4,000
	売建	33,372,000		33,387,000	15,000
	米ドル	33,372,000		33,387,000	15,000

合計	59,396,000		59,415,000	11,000
----	------------	--	------------	--------

(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)

2018年 1月25日現在		2018年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	2.2116円	1口当たり純資産額	2.1771円
(1万口当たり純資産額	22,116円)	(1万口当たり純資産額	21,771円)

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

2018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。

2018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	176	2,539,898
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	176	2,539,898

(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33期事業年度(平成29年4月1日から平成30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。

(1)【貸借対照表】

（単位：千円）

	第32期 （平成29年 3月31日現在）	第33期 （平成30年 3月31日現在）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	13,325,797	16,828,496
前払費用	132,260	150,894
未収委託者報酬	1,578,384	1,524,731
未収収益	2,534,825	2,530,730
未収入金	1,207	1,919
繰延税金資産	287,816	291,045
その他の流動資産	28,360	23,613
流動資産計	17,888,652	21,351,430
固定資産		
有形固定資産	* 1 552,561	* 1 547,215
建物	439,621	409,858
器具備品	111,633	136,834
リース資産	1,306	522
無形固定資産	13,204	34,467
電話加入権	3,795	3,795
ソフトウェア仮勘定	9,409	30,672
投資その他の資産	2,418,251	2,415,723
投資有価証券	54,270	43,545
関係会社株式	1,672,490	1,673,049
その他の関係会社有価証券	31,200	31,200
長期前払費用	9,298	10,541
敷金	450,632	450,632
その他長期差入保証金	20,912	10,865
繰延税金資産	179,447	195,889
固定資産計	2,984,017	2,997,406
資産合計	20,872,669	24,348,837
負債の部		
流動負債		
リース債務	822	548
未払金	1,958,922	2,563,951
未払手数料	634,930	634,789
その他未払金	1,323,992	1,929,162
未払費用	445,613	530,106
未払消費税等	108,541	262,100
未払法人税等	735,000	960,000
預り金	41,371	43,264
前受収益	3,027	3,156
賞与引当金	274,382	282,443
流動負債計	3,567,681	4,645,570
固定負債		
リース債務	548	-
退職給付引当金	393,213	386,552
役員退職慰労引当金	24,180	-
固定負債計	417,941	386,552
負債合計	3,985,623	5,032,123
純資産の部		
株主資本	16,885,034	19,314,136
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	400,000	400,000
その他資本剰余金	400,000	400,000
利益剰余金	14,485,034	16,914,136
利益準備金	500,000	500,000

その他利益剰余金	13,985,034	16,414,136
特別償却準備金	79	38
繰越利益剰余金	13,984,954	16,414,098
評価・換算差額等	2,011	2,577
その他有価証券評価差額金	2,011	2,577
純資産合計	16,887,045	19,316,713
負債・純資産合計	20,872,669	24,348,837

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第32期 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)	第33期 (自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	11,342,811	11,741,085
運用受託報酬	9,089,602	11,384,860
投資助言報酬	74,767	68,541
その他営業収益	64,158	215,481
営業収益計	20,571,339	23,409,968
営業費用		
支払手数料	5,363,864	5,463,460
広告宣伝費	251,016	176,289
公告費	313	-
調査費	5,401,672	6,331,477
調査費	1,635,494	2,359,989
委託調査費	3,766,178	3,971,487
委託計算費	109,429	110,708
営業雑経費	239,192	226,401
通信費	33,787	30,555
印刷費	173,307	160,440
協会費	17,533	21,276
諸会費	7,478	6,349
図書費	7,084	7,778
営業費用計	11,365,489	12,308,336
一般管理費		
給料	2,670,059	3,103,124
役員報酬	119,133	132,792
給料・手当	1,897,712	2,139,811
賞与	653,214	830,521
交際費	16,226	16,511
寄付金	3,598	3,384
旅費交通費	136,737	181,123
租税公課	115,360	142,241
不動産賃借料	316,801	375,691
役員退職慰労引当金繰入	2,910	-
役員退職慰労金	-	6,710
退職給付費用	87,275	114,711
賞与引当金繰入	209,007	282,443
固定資産減価償却費	63,467	76,622
法定福利費	424,721	499,149
福利厚生費	8,100	8,917
諸経費	469,957	437,854
一般管理費計	4,524,223	5,248,487
営業利益	4,681,627	5,853,144
営業外収益		
受取利息	459	472
受取配当金	* 1 45,776	* 1 107,891
匿名組合投資利益	* 1 77,298	* 1 50,146
為替差益	8,924	-

雑益	10,134	11,209
営業外収益計	142,593	169,720
営業外費用		
為替差損	-	19,974
雑損	6,661	2,653
営業外費用計	6,661	22,628
経常利益	4,817,559	6,000,236
特別損失		
器具備品除却損	4,685	257
本社移転費用	229,113	-
特別損失計	233,799	257
税引前当期純利益	4,583,760	5,999,979
法人税、住民税及び事業税	1,455,944	1,806,783
法人税等調整額	25,233	19,919
法人税等合計	1,430,711	1,786,863
当期純利益	3,153,048	4,213,116

(3) 【株主資本等変動計算書】

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		利益準備金	利益剰余金	
		その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		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

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計		特別償却準備金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	79	13,984,954
当期変動額						
剰余金の配当						1,784,014
特別償却準備金の取崩					41	41
当期純利益						4,213,116
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	41	2,429,143
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	38	16,414,098

	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	14,485,034	16,885,034	2,011	2,011	16,887,045
当期変動額					
剰余金の配当	1,784,014	1,784,014			1,784,014
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	4,213,116	4,213,116			4,213,116
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			565	565	565
当期変動額合計	2,429,102	2,429,102	565	565	2,429,667
当期末残高	16,914,136	19,314,136	2,577	2,577	19,316,713

注記事項

重要な会計方針

第33期

自 平成29年4月1日

至 平成30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。

（未適用の会計基準等）

第33期

自 平成29年4月1日
至 平成30年3月31日

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

- ステップ1：顧客との契約を識別する。
- ステップ2：契約における履行義務を識別する。
- ステップ3：取引価格を算定する。
- ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。
- ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

平成34年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（貸借対照表関係）

第32期 平成29年3月31日現在	第33期 平成30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> <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	<table> <tr><td>建物</td><td>51,080千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>424,930千円</td></tr> <tr><td>リース資産</td><td>3,395千円</td></tr> </table>	建物	51,080千円	器具備品	424,930千円	リース資産	3,395千円
建物	20,366千円												
器具備品	453,412千円												
リース資産	2,612千円												
建物	51,080千円												
器具備品	424,930千円												
リース資産	3,395千円												

(損益計算書関係)

<p style="text-align: center;">第32期</p> <p style="text-align: center;">自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日</p>	<p style="text-align: center;">第33期</p> <p style="text-align: center;">自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日</p>								
* 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> <tr><td>関係会社からの受取配当金</td><td>45,377千円</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>77,298千円</td></tr> </table>	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	<table> <tr><td>関係会社からの受取配当金</td><td>104,224千円</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>50,146千円</td></tr> </table>	関係会社からの受取配当金	104,224千円	関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配	50,146千円
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								
関係会社からの受取配当金	104,224千円								
関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配	50,146千円								

(株主資本等変動計算書関係)

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	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

第33期(自 平成29年 4月 1日 至 平成30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29年 4月 1日 現在	増加	減少	平成30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29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	1,784,014千円
------------	-------------

(ロ) 1株当たり配当額	46,580円
(ハ) 基準日	平成29年3月31日
(ニ) 効力発生日	平成29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30年6月29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	1,901,595千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	49,650円
(ニ) 基準日	平成30年3月31日
(ホ) 効力発生日	平成30年6月29日

(リース取引関係)

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。

第33期(自平成29年4月1日至平成30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32期 自平成28年4月1日 至平成29年3月31日	第33期 自平成29年4月1日 至平成30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 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 信用リスク 同左

<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>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。

第33期（平成30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	16,828,496	16,828,496	-
(2)未収委託者報酬	1,524,731	1,524,731	-
(3)未収収益	2,530,730	2,530,730	-
(4)未収入金	1,919	1,919	-
(5)投資有価証券 其他有価証券	43,545	43,545	-
(6)預り金	(43,264)	(43,264)	-
(7)未払金	(2,563,951)	(2,563,951)	-
(8)未払費用	(530,106)	(530,106)	-
(9)未払消費税等	(262,100)	(262,100)	-
(10)未払法人税等	(960,000)	(960,000)	-

（*）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32期 平成29年3月31日現在	第33期 平成30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、(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	(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。	同左
(5) 投資有価証券 時価の算定方法につきましては「重要な会計方針」の「1. 有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(5) 投資有価証券 同左

(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32期 平成29年3月31日現在		第33期 平成30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	1,639,743	子会社株式	1,640,302
関連会社株式	32,747	関連会社株式	32,747
その他の関係会社 有価証券	31,200	その他の関係会社 有価証券	31,200
敷金	450,632	敷金	450,632
その他長期差入保証金	20,912	その他長期差入保証金	10,865

(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32期 平成29年3月31日現在	第33期 平成30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	-

第33期(平成30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	16,827,976	-	-	-
未収委託者報酬	1,524,731	-	-	-
未収収益	2,530,730	-	-	-
未収入金	1,919	-	-	-

投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	-	19,743	5,000	-
合計	20,885,358	19,743	5,000	-

(有価証券関係)

第32期 平成29年3月31日現在	第33期 平成30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。</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1,640,302千円、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。</p>																																
<p>2. その他有価証券 (単位：千円)</p> <table border="1"> <thead> <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> </thead> <tbody> <tr> <td>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</td> <td>33,725</td> <td>27,289</td> <td>6,435</td> </tr> <tr> <td>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</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> </tbody> </table>	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	33,725	27,289	6,435	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	20,545	24,081	3,536	合計	54,270	51,371	2,899	<p>2. その他有価証券 (単位：千円)</p> <table border="1"> <thead> <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> </thead> <tbody> <tr> <td>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</td> <td>27,151</td> <td>21,652</td> <td>5,498</td> </tr> <tr> <td>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</td> <td>16,394</td> <td>18,178</td> <td>1,783</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>43,545</td> <td>39,831</td> <td>3,714</td> </tr> </tbody> </table>	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	27,151	21,652	5,498	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	16,394	18,178	1,783	合計	43,545	39,831	3,714
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	33,725	27,289	6,435																														
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	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																														
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	27,151	21,652	5,498																														
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	16,394	18,178	1,783																														
合計	43,545	39,831	3,714																														
<p>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。</p>	<p>3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 同左</p>																																

(退職給付関係)

<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
<p>2. 確定給付制度</p>

(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32期		第33期	
	自	平成28年4月1日 至 平成29年3月31日	自	平成29年4月1日 至 平成30年3月31日
退職給付引当金の期首残高		197,784千円		393,213千円
退職給付費用		31,281千円		46,223千円
退職給付の支払額		6,251千円		43,667千円
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		9,217千円
退職給付引当金の期末残高		393,213千円		386,552千円

(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32期		第33期	
	平成29年3月31日現在		平成30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		393,213千円		386,552千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額		393,213千円		386,552千円
退職給付引当金		393,213千円		386,552千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額		393,213千円		386,552千円

(3) 退職給付費用

	第32期		第33期	
	自	平成28年4月1日 至 平成29年3月31日	自	平成29年4月1日 至 平成30年3月31日
簡便法で計算した退職給付費用		22,064千円		37,006千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)46,034千円、第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)54,764千円であります。

(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32期	第33期
	(平成29年3月31日現在)	(平成30年3月31日現在)
繰延税金資産		
役員退職慰労引当金	7,403千円	-
退職給付引当金	120,401千円	118,362千円
未払金	3,507千円	4,251千円
賞与引当金	84,674千円	86,484千円
未払法定福利費	12,005千円	10,538千円
未払事業所税	3,291千円	3,288千円
未払事業税	35,145千円	50,364千円
未払調査費	45,734千円	44,622千円
減価償却超過額	52,565千円	78,443千円
繰延資産超過額	-	237千円

未払確定拠出年金	1,236千円	1,519千円
未払費用	102,221千円	89,977千円
繰延税金資産小計	468,187千円	488,088千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	468,187千円	488,088千円
繰延税金負債		
特別償却準備金	35千円	16千円
その他有価証券評価差額金	887千円	1,137千円
繰延税金負債合計	923千円	1,154千円
繰延税金資産の純額	467,264千円	486,934千円

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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30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

(セグメント情報等)

第32期 自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日	第33期 自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日
<p>[セグメント情報]</p> <p>当社は「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として運用(投資運用業)を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。</p> <p>当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。</p>	<p>[セグメント情報]</p> <p>同左</p>

[関連情報]	[関連情報]
<p>1. 製品及びサービスごとの情報 単一のサービス区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>2. 地域ごとの情報 (1) 営業収益 本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。 (2) 有形固定資産 本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報 当社は、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>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 (1) 投資信託の名称 東京海上・円資産バランスファンド（毎月決算型） (2) 委託者報酬 2,915,606千円 (3) 関連するセグメント名 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</p>

(関連当事者情報)

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。

第33期(自平成29年4月1日至平成30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重要な取引はありません。

(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	1,518,481	未収収益	386,279
						役員兼任				
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	936,716	未払金	288,919

(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	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

第33期 (自 平成29年 4 月 1 日 至 平成30年 3 月31日)	
1 株当たり純資産額	504,352円83銭
1 株当たり当期純利益金額	110,003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	19,316,713千円
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	19,316,713千円
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	4,213,116千円
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	4,213,116千円
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30年6月4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
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
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29年4月1日から平成30年3月31日までの第33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30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

2018年9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
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
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2018年1月26日から2018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2018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(2018年1月26日から2018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

2018年9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
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
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2018年1月26日から2018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2018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(2018年1月26日から2018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

2018年9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
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
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2018年1月26日から2018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2018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(2018年1月26日から2018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

2018年9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
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
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2018年1月26日から2018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2018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（2018年1月26日から2018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

2018年9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
業務執行社員 公認会計士 荒川 進

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 久保 直毅

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2018年1月26日から2018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2018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（2018年1月26日から2018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。