

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2020年9月10日

【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

【電話番号】 03 - 3212 - 8421

【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 東京海上・円資産バランスファンド(3倍型)(毎月決算型)

【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券の金額】 当初申込日 上限 50億円
継続申込期間 上限 1兆円

【縦覧に供する場所】 該当なし

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2019年12月6日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について、有価証券報告書の提出に伴う新たな情報の更新、および原届出書記載事項の一部に訂正すべき事項があるため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は、原届出書が更新されます。また<追加>の記載事項は原届出書に追加されます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(3)【ファンドの仕組み】

<更新後>

(略)

委託会社の概況

- ・名称 東京海上アセットマネジメント株式会社
- ・資本金の額 20億円（2020年6月末日現在）
- ・会社の沿革
 - 1985年12月 東京海上グループ（現：東京海上日動グループ）等の出資により、資産運用ビジネスの戦略的位置付けで、東京海上エム・シー投資顧問株式会社の社名にて資本金2億円で設立
 - 1987年2月 投資顧問業者として登録
 - 同年6月 投資一任業務認可取得
 - 1991年4月 国内および海外年金の運用受託を開始
 - 1998年5月 東京海上アセットマネジメント投信株式会社に変更し、投資信託法上の委託会社としての免許取得
 - 2007年9月 金融商品取引業者として登録
 - 2014年4月 東京海上アセットマネジメント株式会社に変更
 - 2016年10月 東京海上不動産投資顧問株式会社と合併
- ・大株主の状況（2020年6月末日現在）

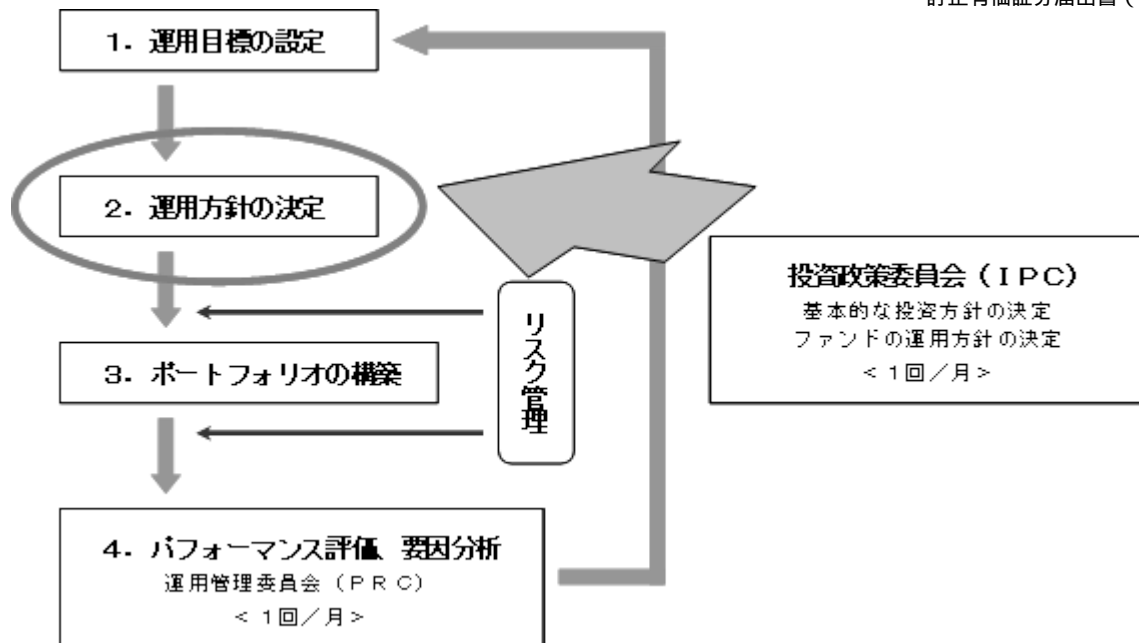
株主名	住所	所有株数	所有比率
東京海上ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目2番1号	38,300株	100.0%

2【投資方針】

(3)【運用体制】

<更新後>

当ファンドの運用体制は以下の通りです。



ファンドの運用に関する社内規則として「投資運用業に係る業務運営規程」を設けております。運用におけるリスク管理は、運用管理部（5～10名程度）による法令・運用ガイドライン等の遵守状況のチェックや運用リスク項目のチェック等が随時実施され、担当運用部へフィードバックされるとともに、原則として月1回開催される運用管理委員会（管理本部長を委員長に、運用・営業・商品企画などファンド運用に関係する各部長が参加）において投資行動の評価が行われます。（リスク管理についての詳細は、「3 投資リスク」の「3.管理体制」をご参照ください）

この運用管理委員会での評価もふまえて、投資政策委員会（運用本部長を委員長とし、各運用部長が参加）において運用方針を決定し、より質の高い運用体制の維持・向上を目指します。

また、受託銀行等の管理については、関連部署において、受託銀行業務等に関する「内部統制の整備及び運用状況報告書」の入手・検証、現地モニタリング等を通じて実施しております。

（上記の体制や人員等については、2020年7月1日現在）

3【投資リスク】

<更新後>

（略）

3.管理体制

（略）

参考情報

2015年7月～2020年6月

ファンドの年間騰落率および
分配金再投資基準価額の推移

過去5年間の各月末における分配金再投資基準価額と直近1年間の騰落率を表示したものです。

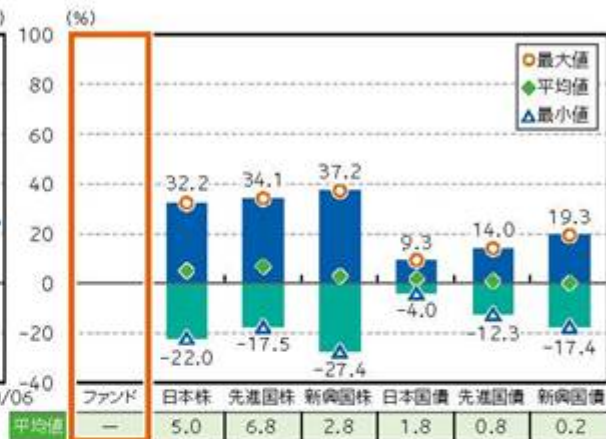


※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものと計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。

※ファンドは設定1年未満であるため、年間騰落率を表示できません。

ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較

ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。過去5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものです。



※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

※ファンドは設定1年未満であるため、年間騰落率を表示できません。

代表的な資産クラスと指数名

日本株 TOPIX (東証株価指数) (配当込み)

先進国株 MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ベース)

新興国株 MSCIEマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

日本国債 NOMURA-BPI (国債)

先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

新興国債 JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド (円ベース)

指数について

●TOPIXは東京証券取引所が発表している東証市場第一部全銘柄の動きを捉える株価指数です。TOPIXの指数値および商標は、東京証券取引所の知的財産であり、TOPIXに関するすべての権利およびノウハウは東京証券取引所が有します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、公表の停止、TOPIXの商標の変更、使用の停止を行う場合があります。 ●MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ベース) とは、MSCI社が発表している日本を除く主要先進国の株式市場の動きを捉える代表的な株価指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。 ●MSCIEマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース) は、MSCI社が発表している新興国の株式市場の動きを捉える代表的な指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。 ●NOMURA-BPI (国債) は、野村證券が公表する日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI (国債) に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券に帰属します。 ●FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース) は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、取替または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 ●JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド (円ベース) は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<更新後>

課税上は、株式投資信託として以下のような取扱いとなります。なお、税法が改正された場合は、以下の内容が変更になることがあります。また、以下は一般的な記載に過ぎませんので、課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認ください。

<個人の受益者に対する課税>

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315% および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。申告不要制度の適用がありますが、総合課税または申告分離課税を選択することも可能です。いずれの場合も配当控除の適用はありません。申告分離課税を選択した場合の税率は、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。収益分配金のうち課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）（1）は課税されません。

2037年12月31日までの間、復興特別所得税（所得税15%×2.1%）が付加されます。

解約時および償還時の差益（解約時および償還時の価額から取得費（申込手数料（税込）を含む）を控除した差額）は、その全額が譲渡所得等の金額とみなされ課税対象となります。譲渡所得等については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）での取扱いも可能です。）。

普通分配金（申告分離課税を選択したものに限り、）ならびに解約時および償還時の損益については、確定申告により、上場株式等（特定公社債および公募公社債投信を含みます。）の利子所得および配当所得（申告分離課税を選択したものに限り、）ならびに譲渡所得等との間で損益通算を行うことができます。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託や上場株式等から生じる配当所得および譲渡所得等が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記とは異なる場合があります。

< 法人の受益者に対する課税 >

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の「各受益者の個別元本」（2）超過額については、15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）の税率による源泉徴収が行われます。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）（1）は課税されません。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

- （1）「元本払戻金（特別分配金）」とは、収益分配金落ち後の基準価額が各受益者の個別元本を下回る場合、収益分配金のうち当該下回る部分に相当する額をさし、元本の一部払戻しに相当するものです。この場合、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- （2）「各受益者の個別元本」とは、原則として各受益者の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、元本払戻金（特別分配金）が支払われた際に調整されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数の支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

* 上記は、2020年6月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容等が変更される場合があります。

5【運用状況】

< 更新後 >

以下は2020年6月30日現在の運用状況です。

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

(1)【投資状況】

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	590,104,340	55.80
親投資信託受益証券	日本	160,734,391	15.20
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		306,621,314	28.99
合計（純資産総額）		1,057,460,045	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	地域	時価（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	日本	2,279,250,000	215.54

(注)時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(ご参考：親投資信託の投資状況)

当ファンド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。

東京海上・高配当低ボラティリティJPX日経400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	11,251,803,340	97.24
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		318,526,013	2.75
合計（純資産総額）		11,570,329,353	100.00

東京海上・東証REITマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	5,471,152,470	95.15
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		278,322,023	4.84
合計（純資産総額）		5,749,474,493	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	地域	時価（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	267,138,000	4.64

(注)時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a. 主要銘柄の明細

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	数量	帳簿価額		評価額		投資比率（％）
							単価（円）	金額（円）	単価（円）	金額（円）	
1	第917回国庫短期証券	日本	国債証券	0.0	2020/09/23	250,000,000	100.02	250,066,000	100.02	250,056,250	23.64
2	第918回国庫短期証券	日本	国債証券	0.0	2020/09/28	210,000,000	100.02	210,048,090	100.02	210,048,090	19.86
3	第390回利付国債（2年）	日本	国債証券	0.1	2020/07/01	130,000,000	100.01	130,016,900	100.00	130,000,000	12.29
4	東京海上・高配当低ボラティリティJPX日経400マザーファンド	日本	親投資信託受益証券			64,573,541	1.2959	83,687,169	1.2448	80,381,143	7.60
5	東京海上・東証REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券			70,952,096	1.1925	84,617,295	1.1325	80,353,248	7.59

b. 投資有価証券の種類

種類	投資比率（％）
----	---------

国債証券	55.80
親投資信託受益証券	15.20
合計	71.00

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

種類	地域	取引所	資産名	買建/ 売建	数量 (枚)	帳簿価額	評価額(円)	投資 比率(%)
債券先物 取引	日本	大阪取引所	長期国債標準物先物	買建	15	2,278,200,000.00	2,279,250,000	215.54

(注)時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(ご参考：親投資信託の投資資産)

投資有価証券の主要銘柄

a. 主要銘柄の明細

東京海上・高配当低ボラティリティJPX日経400マザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額(円)	単価 (円)	金額(円)	
1	ニトリホールディングス	日本	小売業	株式	11,400	17,566.35	200,256,390	21,125.00	240,825,000	2.08
2	日清食品ホールディングス	日本	食料品	株式	24,800	9,232.85	228,974,784	9,550.00	236,840,000	2.04
3	カルビー	日本	食料品	株式	79,100	3,072.86	243,063,764	2,983.00	235,955,300	2.03
4	東京瓦斯	日本	電気・ガス業	株式	91,100	2,477.89	225,736,064	2,580.00	235,038,000	2.03
5	KDDI	日本	情報・通信業	株式	72,400	3,388.50	245,327,742	3,234.00	234,141,600	2.02
6	明治ホールディングス	日本	食料品	株式	27,000	7,444.63	201,005,101	8,580.00	231,660,000	2.00
7	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	91,600	2,815.23	257,875,127	2,515.50	230,419,800	1.99
8	中外製薬	日本	医薬品	株式	39,900	4,187.27	167,072,152	5,765.00	230,023,500	1.98
9	協和エクシオ	日本	建設業	株式	88,800	2,561.09	227,424,920	2,575.00	228,660,000	1.97
10	花王	日本	化学	株式	26,600	8,677.95	230,833,482	8,540.00	227,164,000	1.96
11	積水ハウス	日本	建設業	株式	110,400	2,362.31	260,799,024	2,052.50	226,596,000	1.95
12	NTTドコモ	日本	情報・通信業	株式	78,500	3,074.67	241,361,713	2,882.00	226,237,000	1.95
13	みずほフィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	1,702,700	159.27	271,189,029	132.20	225,096,940	1.94
14	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	日本	保険業	株式	75,700	3,619.10	273,966,438	2,961.00	224,147,700	1.93
15	セコム	日本	サービス業	株式	23,700	9,734.73	230,713,101	9,423.00	223,325,100	1.93
16	ブリヂストン	日本	ゴム製品	株式	64,200	3,852.76	247,347,192	3,469.00	222,709,800	1.92
17	伊藤忠商事	日本	卸売業	株式	94,700	2,667.71	252,632,137	2,321.50	219,846,050	1.90
18	エービーシー・マート	日本	小売業	株式	34,800	7,160.20	249,174,960	6,310.00	219,588,000	1.89
19	日本マクドナルドホールディングス	日本	小売業	株式	37,700	5,226.92	197,054,884	5,820.00	219,414,000	1.89
20	サントリー食品インターナショナル	日本	食料品	株式	51,900	4,684.78	243,140,082	4,205.00	218,239,500	1.88

21	三菱商事	日本	卸売業	株式	94,900	2,852.53	270,705,164	2,270.00	215,423,000	1.86
22	セブン銀行	日本	銀行業	株式	724,000	322.75	233,671,000	295.00	213,580,000	1.84
23	キヤノン	日本	電気機器	株式	98,800	2,823.25	278,937,100	2,134.50	210,888,600	1.82
24	日本たばこ産業	日本	食料品	株式	104,000	2,292.21	238,390,642	2,001.50	208,156,000	1.79
25	オリエンタルランド	日本	サービス業	株式	14,200	14,609.01	207,447,942	14,240.00	202,208,000	1.74
26	江崎グリコ	日本	食料品	株式	39,000	4,852.49	189,247,110	5,140.00	200,460,000	1.73
27	大東建託	日本	建設業	株式	20,100	12,746.86	256,211,886	9,909.00	199,170,900	1.72
28	九州電力	日本	電気・ガス業	株式	207,100	918.48	190,217,208	905.00	187,425,500	1.61
29	中部電力	日本	電気・ガス業	株式	135,700	1,519.54	206,202,671	1,352.00	183,466,400	1.58
30	ケーズホールディングス	日本	小売業	株式	124,000	1,429.89	177,306,368	1,468.00	182,032,000	1.57

東京海上・東証REITマザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	614	837,564.75	514,264,756	614,000.00	376,996,000	6.55
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	634	760,930.81	482,430,133	553,000.00	350,602,000	6.09
3	日本プロロジスリート投資法人	日本	投資証券	954	296,075.92	282,456,427	328,000.00	312,912,000	5.44
4	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	投資証券	2,047	178,260.13	364,898,486	129,400.00	264,881,800	4.60
5	GLP投資法人	日本	投資証券	1,641	134,596.25	220,872,446	156,500.00	256,816,500	4.46
6	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	905	279,224.94	252,698,570	254,000.00	229,870,000	3.99
7	アドバンス・レジデンス投資法人	日本	投資証券	601	338,671.10	203,541,331	321,500.00	193,221,500	3.36
8	オリックス不動産投資法人	日本	投資証券	1,263	219,267.51	276,934,865	141,400.00	178,588,200	3.10
9	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	1,424	182,523.10	259,912,894	115,800.00	164,899,200	2.86
10	日本リテールファンド投資法人	日本	投資証券	1,198	215,476.28	258,140,583	134,500.00	161,131,000	2.80
11	産業ファンド投資法人	日本	投資証券	817	165,126.75	134,908,554	173,600.00	141,831,200	2.46
12	日本プライムリアルティ投資法人	日本	投資証券	417	462,865.83	193,015,051	316,000.00	131,772,000	2.29
13	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	211	682,247.30	143,954,180	624,000.00	131,664,000	2.29
14	積水ハウス・リート投資法人	日本	投資証券	1,854	87,922.60	163,008,500	69,200.00	128,296,800	2.23
15	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	414	283,669.80	117,439,297	292,800.00	121,219,200	2.10
16	アクティブ・プロパティーズ投資法人	日本	投資証券	318	534,837.02	170,078,172	371,500.00	118,137,000	2.05
17	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	196	815,884.45	159,913,352	601,000.00	117,796,000	2.04
18	森ヒルズリート投資法人	日本	投資証券	730	177,710.32	129,728,533	136,200.00	99,426,000	1.72
19	ラサールロジポート投資法人	日本	投資証券	590	164,356.67	96,970,435	166,200.00	98,058,000	1.70
20	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	2,043	66,826.18	136,525,885	44,500.00	90,913,500	1.58
21	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	276	349,999.27	96,599,798	322,000.00	88,872,000	1.54
22	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	146	822,174.46	120,037,471	597,000.00	87,162,000	1.51
23	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	日本	投資証券	180	519,020.32	93,423,657	480,500.00	86,490,000	1.50
24	イオンリート投資法人	日本	投資証券	684	143,521.25	98,168,535	114,400.00	78,249,600	1.36
25	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	776	103,652.66	80,434,464	100,400.00	77,910,400	1.35
26	インヴェンシブル投資法人	日本	投資証券	2,782	50,149.73	139,516,548	27,790.00	77,311,780	1.34

27	ケネディクス・レジデンシャル・ネットワーク投資法人	日本	投資証券	414	207,505.96	85,907,467	186,100.00	77,045,400	1.34
28	フロンティア不動産投資法人	日本	投資証券	225	427,773.27	96,248,985	340,500.00	76,612,500	1.33
29	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	587	183,850.56	107,920,278	125,200.00	73,492,400	1.27
30	ヒューリックリート投資法人	日本	投資証券	539	186,587.95	100,570,905	134,000.00	72,226,000	1.25

b. 投資有価証券の種類

東京海上・高配当低ボラティリティJPX日経400マザーファンド

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	建設業	7.79
		食料品	17.49
		繊維製品	0.31
		化学	3.10
		医薬品	4.44
		ゴム製品	1.92
		電気機器	4.44
		輸送用機器	1.56
		電気・ガス業	7.13
		陸運業	1.80
		空運業	1.04
		情報・通信業	11.82
		卸売業	9.44
		小売業	10.65
		銀行業	5.23
		証券、商品先物取引業	0.54
		保険業	1.93
その他金融業	0.88		
不動産業	1.27		
サービス業	4.36		
合計			97.24

東京海上・東証REITマザーファンド

種類	投資比率(%)
投資証券	95.15
合計	95.15

投資不動産物件

東京海上・高配当低ボラティリティJPX日経400マザーファンド
該当事項はありません。

東京海上・東証REITマザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

東京海上・高配当低ボラティリティJPX日経400マザーファンド
該当事項はありません。

東京海上・東証REITマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/ 売建	数量 (枚)	帳簿価額	評価額(円)	投資 比率(%)
株価指数 先物取引	日本	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	162	279,288,000.00	267,138,000	4.64

(注)時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

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1特定期間末	(2020年 6月10日)	1,064	1,064	0.8096	0.8096
	2019年12月末日	521	-	1.0083	-
	2020年 1月末日	866	-	1.0261	-
	2月末日	1,103	-	0.9553	-
	3月末日	1,040	-	0.8069	-
	4月末日	1,049	-	0.8083	-
	5月末日	1,050	-	0.8093	-
	6月末日	1,057	-	0.8040	-

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

【分配の推移】

該当事項はありません。

【収益率の推移】

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第1特定期間	2019年12月24日～2020年 6月10日	19.0

(注)収益率とは、特定期間末の基準価額(分配付)から、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額(分配落。以下、「前特定期間末基準価額」といいます。)を控除した額を前特定期間末基準価額で除した数値に100を乗じた数値です。

(4) 【設定及び解約の実績】

期	計算期間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第1特定期間	2019年12月24日～2020年 6月10日	1,317,694,320	3,411,294	1,314,283,026

< 参考情報 >

基準日：2020年6月30日

基準価額・純資産の推移



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2019年12月24日です。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金	決算期	分配金
2020/01	0円	2020/08	
2020/02	0円	2020/09	
2020/03	0円	2020/10	
2020/04	0円	2020/11	
2020/05	0円	2020/12	
2020/06	0円	設定来累計	分配実績なし
2020/07			

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

主要な資産の状況

資産構成

投資対象	基本資産配分	組入比率	差
日本債券	210.0%	215.5%	+5.5%
日本株式	45.0%	7.6%	-37.4%
日本REIT	45.0%	7.6%	-37.4%
短期金融資産等	-	84.8%	-
うち、短期国債等	-	55.8%	-

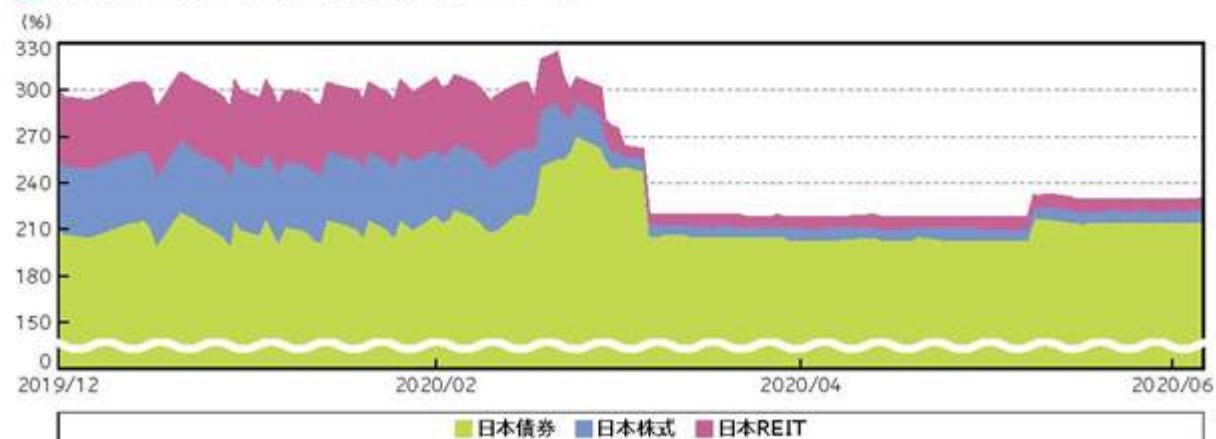
※比率は、純資産総額に占める割合です。

※日本REITには国内のREIT指数先物、日本株式には国内の株価指数先物が含まれる場合があります。

※短期金融資産等には未払金等が含まれるため、組入比率がマイナスとなる場合があります。

※短期金融資産等の一部に証拠金が含まれます。

資産構成の推移（短期金融資産等を除きます。）

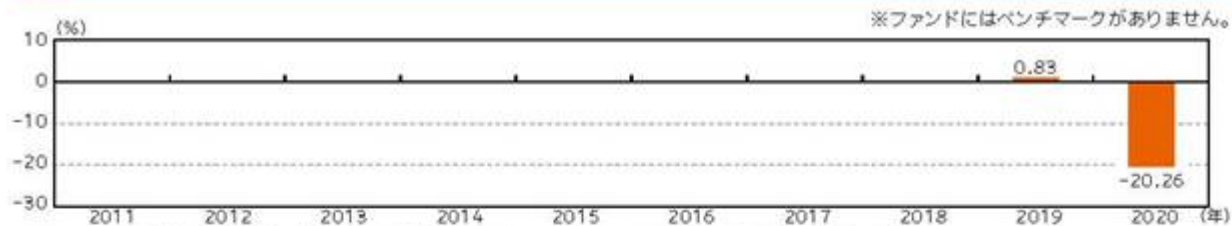


※比率は、純資産総額に占める割合です。

次ページへ続く

- ・最新の運用実績は、委託会社のホームページでご確認いただけます。
- ・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

年間収益率の推移



※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資したものと計算しており、設定日以降を表示しています。

※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

・最新の運用実績は、委託会社のホームページでご確認いただけます。
 ・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

第3【ファンドの経理状況】

< 更新後 >

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「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、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) 当ファンドの計算期間は、6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドの第1期計算期間は、投資信託約款第40条により、2019年12月24日から2020年1月10日までとなっております。
- (4) 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、当特定期間（2019年12月24日から2020年6月10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【財務諸表】

東京海上・円資産バランスファンド（3倍型）（毎月決算型）

(1)【貸借対照表】

		当期 [2020年 6月10日現在]
区 分	注記 番号	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		323,053,557
国債証券		560,040,740
親投資信託受益証券		168,199,575
派生商品評価勘定		425,250
未収入金		185,078
未収利息		57,202
前払金		37,860,000
前払費用		71,149
差入委託証拠金		13,950,000
流動資産合計		1,103,842,551
資産合計		1,103,842,551
負債の部		
流動負債		
未払金		38,659,500
未払受託者報酬		23,683
未払委託者報酬		1,136,935
未払利息		523
その他未払費用		9,458
流動負債合計		39,830,099
負債合計		39,830,099
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,314,283,026
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	250,270,574
(分配準備積立金)		23,721,010

元本等合計		1,064,012,452
純資産合計		1,064,012,452
負債純資産合計		1,103,842,551

(2) 【損益及び剰余金計算書】

		当期 自 2019年12月24日 至 2020年 6月10日
区 分	注記 番号	金額(円)
営業収益		
受取利息		58,071
有価証券売買等損益		230,627,107
派生商品取引等損益		7,686,950
営業収益合計		238,255,986
営業費用		
支払利息		54,524
受託者報酬		120,032
委託者報酬		5,761,590
その他費用		47,933
営業費用合計		5,984,079
営業利益又は営業損失()		244,240,065
経常利益又は経常損失()		244,240,065
当期純利益又は当期純損失()		244,240,065
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ()		12,809
期首剰余金又は期首欠損金()		
剰余金増加額又は欠損金減少額		8,448,810
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損 金減少額		298,444
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損 金減少額		8,150,366
剰余金減少額又は欠損金増加額		14,492,128
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損 金増加額		16,468
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損 金増加額		14,475,660
分配金	1	
期末剰余金又は期末欠損金()		250,270,574

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当期 自 2019年12月24日 至 2020年 6月10日

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)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）、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。</p> <p>(2)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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 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、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	当期 [2020年 6月10日現在]
1. 1 期首元本額	500,000,000円
期中追加設定元本額	817,694,320円
期中一部解約元本額	3,411,294円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	1,314,283,026口
3. 2 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は250,270,574円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

当期 自 2019年12月24日 至 2020年 6月10日
<p>1 分配金の計算過程</p> <p>(2019年12月24日から2020年1月10日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(1,330,150円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(746,568円)、投資信託約款に規定される収益調整金(669,355円)及び分配準備積立金(0円)より、分配対象額は2,746,073円(1万口当たり45.28円)であります。分配を行っておりません。</p>
<p>(2020年1月11日から2020年2月10日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(1,150,919円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(18,463,481円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,814,852円)及び分配準備積立金(2,076,718円)より、分配対象額は27,505,970円(1万口当たり304.42円)であります。分配を行っておりません。</p>
<p>(2020年2月11日から2020年3月10日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(1,791,681円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(10,149,275円)及び分配準備積立金(21,680,057円)より、分配対象額は33,621,013円(1万口当たり274.08円)であります。分配を行っておりません。</p>

<p>(2020年3月11日から2020年4月10日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(12,128,530円)及び分配準備積立金(23,426,375円)より、分配対象額は35,554,905円(1万口当たり274.54円)ですが、分配を行っておりません。</p>
<p>(2020年4月11日から2020年5月11日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(117,609円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(12,237,526円)及び分配準備積立金(23,426,375円)より、分配対象額は35,781,510円(1万口当たり275.44円)ですが、分配を行っておりません。</p>
<p>(2020年5月12日から2020年6月10日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(185,602円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(12,668,137円)及び分配準備積立金(23,535,408円)より、分配対象額は36,389,147円(1万口当たり276.86円)ですが、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	当 期 自 2019年12月24日 至 2020年 6月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、先物取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。

. 金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期 [2020年 6月10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。

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>
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>

（有価証券に関する注記）

当期（自 2019年12月24日 至 2020年6月10日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	95,920
親投資信託受益証券	9,414,007
合計	9,318,087

（注）時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

（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

債券関連

当期（2020年6月10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	債券先物取引				
	買建	2,277,750,000		2,278,200,000	450,000
	長期国債標準物先物	2,277,750,000		2,278,200,000	450,000
合計		2,277,750,000		2,278,200,000	450,000

（注）1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として特定期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同特定期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 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)

当期 [2020年 6月10日現在]	
1口当たり純資産額	0.8096円
(1万口当たり純資産額)	8,096円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第 3 9 0 回利付国債(2年)	130,000,000	130,016,900	
	第 1 2 4 回利付国債(5年)	150,000,000	150,009,000	
	第 8 3 9 回国庫短期証券	200,000,000	200,009,000	
	第 8 9 7 回国庫短期証券	80,000,000	80,005,840	
国債証券 合計		560,000,000	560,040,740	
親投資信託 受益証券	東京海上・高配当低ボラティリティJP X日経400マザーファンド	64,522,785	83,634,433	
	東京海上・東証REITマザーファンド	70,896,330	84,565,142	
親投資信託受益証券 合計		135,419,115	168,199,575	
合計		695,419,115	728,240,315	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

(ご参考)

当ファンドは、「東京海上・高配当低ボラティリティJPX日経400マザーファンド」、「東京海上・東証REITマザーファンド」を主要な投資対象としており、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。

「東京海上・高配当低ボラティリティJPX日経400マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

[2020年 6月10日現在]		
区 分	注記 番号	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		178,585,444
株式		11,749,583,150
未収配当金		118,085,850

流動資産合計		12,046,254,444
資産合計		12,046,254,444
負債の部		
流動負債		
未払解約金		92,279
未払利息		289
流動負債合計		92,568
負債合計		92,568
純資産の部		
元本等		
元本	1	9,293,567,130
剰余金		
剰余金又は欠損金()		2,752,594,746
元本等合計		12,046,161,876
純資産合計		12,046,161,876
負債純資産合計		12,046,254,444

(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 2019年12月24日 至 2020年 6月10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	[2020年 6月10日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	12,146,375,044円
同期中における追加設定元本額	1,045,890,876円
同期中における一部解約元本額	3,898,698,790円
同期末における元本額	9,293,567,130円
元本の内訳*	
東京海上・円資産バランスファンド(3倍型) (毎月決算型)	64,522,785円
東京海上・円資産バランスファンド(3倍型) (年1回決算型)	87,635,214円
東京海上・高配当低ボラティリティJPX日経400 <適格機関投資家限定>	9,141,409,131円
計	9,293,567,130円
2. 1 本書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	9,293,567,130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)

I. 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年12月24日 至 2020年 6月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。

. 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2020年 6月10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。
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。
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。

（有価証券に関する注記）
（自 2019年12月24日 至 2020年6月10日）
売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当期間の損益に含まれた評価差額
----	-----------------

株式	790,744,782
合計	790,744,782

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年2月8日から2020年6月10日まで)を指しております。

(1口当たり情報に関する注記)

[2020年 6月10日現在]	
1口当たり純資産額	1.2962円
(1万口当たり純資産額	12,962円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
安藤・間	172,300	690.00	118,887,000	
コムシホールディングス	44,100	3,035.00	133,843,500	
大東建託	20,100	11,650.00	234,165,000	
積水ハウス	113,700	2,162.50	245,876,250	
協和エクシオ	61,000	2,533.00	154,513,000	
江崎グリコ	39,000	5,280.00	205,920,000	
カルビー	64,000	3,010.00	192,640,000	
明治ホールディングス	25,300	8,260.00	208,978,000	
日本ハム	36,300	4,330.00	157,179,000	
アサヒグループホールディングス	47,000	4,416.00	207,552,000	
サントリー食品インターナショナル	51,900	4,425.00	229,657,500	
味の素	39,100	1,833.50	71,689,850	
キューピー	86,600	2,157.00	186,796,200	
東洋水産	26,600	5,570.00	148,162,000	
日清食品ホールディングス	16,100	8,850.00	142,485,000	
日本たばこ産業	103,600	2,206.00	228,541,600	
帝人	21,300	1,813.00	38,616,900	
花王	23,800	8,966.00	213,390,800	
小林製薬	4,700	9,700.00	45,590,000	
武田薬品工業	42,200	4,115.00	173,653,000	
中外製薬	12,800	15,810.00	202,368,000	
科研製薬	6,700	5,730.00	38,391,000	
沢井製薬	15,300	5,970.00	91,341,000	
ブリヂストン	64,200	3,703.00	237,732,600	
日本電気	33,100	5,040.00	166,824,000	
富士通	9,000	11,925.00	107,325,000	
セイコーエプソン	85,000	1,423.00	120,955,000	

キヤノン	98,800	2,347.50	231,933,000	
S U B A R U	80,700	2,593.50	209,295,450	
中部電力	108,900	1,411.50	153,712,350	
関西電力	42,800	1,126.50	48,214,200	
東北電力	23,500	1,094.00	25,709,000	
九州電力	207,100	925.00	191,567,500	
東京瓦斯	58,100	2,562.50	148,881,250	
大阪瓦斯	70,900	2,121.00	150,378,900	
西日本旅客鉄道	24,600	6,807.00	167,452,200	
近鉄グループホールディングス	17,700	5,240.00	92,748,000	
日本航空	73,900	2,403.00	177,581,700	
A N Aホールディングス	61,000	2,832.00	172,752,000	
T I S	74,400	2,259.00	168,069,600	
ティーガイア	35,800	2,165.00	77,507,000	
野村総合研究所	35,800	2,784.00	99,667,200	
伊藤忠テクノソリューションズ	32,000	3,760.00	120,320,000	
日本電信電話	83,000	2,512.00	208,496,000	
K D D I	67,400	3,191.00	215,073,400	
N T Tドコモ	56,900	2,890.00	164,441,000	
東宝	7,300	4,060.00	29,638,000	
カプコン	33,700	3,930.00	132,441,000	
S C S K	17,600	5,510.00	96,976,000	
シップヘルスケアホールディングス	12,200	4,510.00	55,022,000	
コメダホールディングス	62,500	1,924.00	120,250,000	
第一興商	35,200	3,970.00	139,744,000	
伊藤忠商事	94,700	2,353.00	222,829,100	
三井物産	111,500	1,748.00	194,902,000	
住友商事	45,200	1,333.00	60,251,600	
三菱商事	92,000	2,491.50	229,218,000	
岩谷産業	36,800	3,765.00	138,552,000	
日鉄物産	19,500	3,740.00	72,930,000	
ローソン	31,200	5,940.00	185,328,000	
エービーシー・マート	34,800	6,620.00	230,376,000	
日本マクドナルドホールディングス	39,000	5,970.00	232,830,000	
すかいらーくホールディングス	113,100	1,808.00	204,484,800	
セブン&アイ・ホールディングス	2,000	3,889.00	7,778,000	
しまむら	1,900	7,730.00	14,687,000	
ケーズホールディングス	89,700	1,457.00	130,692,900	
ニトリホールディングス	12,000	19,320.00	231,840,000	
あおぞら銀行	64,200	2,138.00	137,259,600	
三井住友フィナンシャルグループ	15,200	3,326.00	50,555,200	
セブン銀行	724,000	302.00	218,648,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,744,700	143.00	249,492,100	

松井証券	76,000	884.00	67,184,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	73,900	3,300.00	243,870,000
オリックス	77,400	1,550.00	119,970,000
ヒューリック	145,600	1,092.00	158,995,200
パーク24	7,900	2,263.00	17,877,700
カカクコム	34,900	2,823.00	98,522,700
オリエンタルランド	14,200	15,465.00	219,603,000
セコム	23,700	9,619.00	227,970,300
メイテック	14,800	5,540.00	81,992,000
合 計	6,426,500		11,749,583,150

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

「東京海上・東証REITマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

[2020年 6月10日現在]		
区 分	注記 番号	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		204,144,344
投資証券		7,337,973,300
派生商品評価勘定		2,349,000
未収配当金		51,316,315
前払金		11,453,400
差入委託証拠金		35,721,000
流動資産合計		7,642,957,359
資産合計		7,642,957,359
負債の部		
流動負債		
未払金		13,334,220
未払解約金		127,481
未払利息		331
流動負債合計		13,462,032
負債合計		13,462,032
純資産の部		
元本等		
元本	1	6,396,505,578

剰余金		
剰余金又は欠損金()		1,232,989,749
元本等合計		7,629,495,327
純資産合計		7,629,495,327
負債純資産合計		7,642,957,359

(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 2019年12月24日 至 2020年 6月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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	先物取引 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、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[2020年 6月10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	7,978,289,059円
同期中における追加設定元本額	2,222,038,356円
同期中における一部解約元本額	3,803,821,837円
同期末における元本額	6,396,505,578円
元本の内訳*	
円資産バランスファンド2018-09<適格機関投資家限定>	68,523,187円
円資産バランスファンド2019-05<適格機関投資家限定>	235,453,659円
円資産バランスファンド2019-09<適格機関投資家限定>	190,681,573円
円資産バランスファンド2019-12<適格機関投資家限定>	265,516,779円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	1,480,389円
東京海上・円資産バランスファンド(3倍型) (毎月決算型)	70,896,330円
東京海上・円資産バランスファンド(3倍型) (年1回決算型)	96,292,056円
東京海上・東証REITインデックスファンド<適格機関投資家限定>	5,428,963,550円
円資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	38,698,055円
計	6,396,505,578円
2. 1 本書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	6,396,505,578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)

Ⅰ. 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年12月24日 至 2020年 6月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、先物取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。

Ⅱ. 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2020年 6月10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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

(自 2019年12月24日 至 2020年6月10日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,415,288,554
合計	1,415,288,554

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年1月28日から2020年6月10日まで)を指しております。

(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

株式関連

(2020年6月10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	株価指数先物取引				
	買建	279,288,000		281,637,000	2,349,000
	東証REIT指数先物	279,288,000		281,637,000	2,349,000
	合計	279,288,000		281,637,000	2,349,000

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの特定期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同特定期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 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)

[2020年 6月10日現在]	
1口当たり純資産額	1.1928円
(1万口当たり純資産額)	11,928円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	------	-----	----

投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	98	10,858,400	
	サンケイリアルエステート投資法人	117	12,051,000	
	S O S i L A 物流リート投資法人	180	22,518,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	268	167,500,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	1,034	95,645,000	
	森ヒルズリート投資法人	927	134,136,900	
	産業ファンド投資法人	1,038	167,429,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人	764	237,986,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	526	95,469,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	404	170,892,000	
	G L P 投資法人	2,008	276,100,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	351	109,512,000	
	日本プロロジスリート投資法人	1,213	353,589,500	
	星野リゾート・リート投資法人	123	59,163,000	
	O n e リート投資法人	126	34,977,600	
	イオンリート投資法人	870	103,878,000	
	ヒューリックリート投資法人	685	103,983,000	
	日本リート投資法人	262	101,787,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	5,178	85,695,900	
	積水ハウス・リート投資法人	2,357	170,882,500	
	トーセイ・リート投資法人	175	19,285,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	311	66,149,700	
	ヘルスケア & メディカル投資法人	172	21,138,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	161	17,049,900	
	野村不動産マスターファンド投資法人	2,602	384,835,800	
	いちごホテルリート投資法人	134	10,679,800	
	ラサールロジポート投資法人	749	115,570,700	
	スターアジア不動産投資法人	267	25,979,100	
	マリモ地方創生リート投資法人	79	9,171,900	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	229	100,302,000	
	大江戸温泉リート投資法人	137	9,946,200	
	さくら総合リート投資法人	174	14,685,600	
	投資法人みらい	917	39,155,900	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	189	20,279,700	
	三菱地所物流リート投資法人	159	62,089,500	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	152	21,386,400		
ザイマックス・リート投資法人	117	11,980,800		
タカラレーベン不動産投資法人	229	22,235,900		
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	168	21,974,400		
日本ビルファンド投資法人	781	543,576,000		
ジャパンリアルエステイト投資法人	806	481,182,000		
日本リテールファンド投資法人	1,523	250,381,200		
オリックス不動産投資法人	1,606	263,062,800		

日本プライムリアルティ投資法人	530	194,245,000	
プレミア投資法人	728	90,490,400	
東急リアル・エステート投資法人	540	88,614,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	560	59,640,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	1,810	249,780,000	
森トラスト総合リート投資法人	576	83,347,200	
インヴィンシブル投資法人	3,536	122,522,400	
フロンティア不動産投資法人	286	109,824,000	
平和不動産リート投資法人	502	54,165,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	527	145,926,300	
福岡リート投資法人	417	58,630,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	249	160,854,000	
いちごオフィスリート投資法人	624	50,544,000	
大和証券オフィス投資法人	186	119,226,000	
阪急阪神リート投資法人	364	50,122,800	
スターツプロシード投資法人	126	24,872,400	
大和ハウスリート投資法人	1,150	295,435,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,597	134,005,200	
大和証券リビング投資法人	987	96,627,300	
ジャパンエクセレント投資法人	746	102,948,000	
投資証券 合計	47,407	7,337,973,300	
合計	47,407	7,337,973,300	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2020年6月30日現在

種類	金額
資産総額	1,059,228,761 円
負債総額	1,768,716 円
純資産総額(-)	1,057,460,045 円
発行済数量	1,315,316,527 口
1単位当たり純資産額(/)	0.8040 円

(ご参考：親投資信託の現況)

東京海上・高配当低ボラティリティJPX日経400マザーファンド

2020年6月30日現在

種類	金額
資産総額	11,570,405,992 円
負債総額	76,639 円

純資産総額(-)	11,570,329,353 円
発行済数量	9,295,030,294 口
1 単位当たり純資産額(/)	1.2448 円

東京海上・東証REITマザーファンド

2020年6月30日現在

種類	金額
資産総額	6,348,297,603 円
負債総額	598,823,110 円
純資産総額(-)	5,749,474,493 円
発行済数量	5,076,713,164 口
1 単位当たり純資産額(/)	1.1325 円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<更新後>

2020年6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。

委託会社業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役の選任は株主総会において、議決権を行使することができる株主の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもってこれを行い、累積投票によらないものとします。取締役の任期は、選任後1年内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役中より代表取締役を選任します。

投資信託の投資運用の意思決定プロセスは以下の通りです。

運用本部で運用計画案、収益分配方針案等の運用の基本方針案を作成します。

運用の基本方針は、運用本部長を委員長とする投資政策委員会で投資環境見通し等をふまえて決定されます。

決定された運用の基本方針に基づき、具体的運用計画を策定し、運用を行います。

売買の執行はトレーディング部が行います。

運用部門とは独立した管理部門にて運用評価、ガイドライン遵守状況のチェックを行い、管理本部長を委員長とし運用管理部を事務局とする運用管理委員会に結果報告します。

運用管理委員会から投資政策委員会へ運用評価、ガイドライン遵守状況がフィードバックされ次の基本方針決定に生かされます。

2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

「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。

2020年6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	175	2,879,864
単位型公社債投資信託	2	6,999
単位型株式投資信託	5	19,544
合計	182	2,906,409

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

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35期事業年度(2019年4月1日から2020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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	17,817,927	19,928,671
前払費用	208,412	207,883
未収委託者報酬	1,954,575	2,864,007
未収収益	1,951,601	2,126,212
未収入金	1,809	101,676
その他の流動資産	21,491	22,090
流動資産計	21,955,817	25,250,541
固定資産		
有形固定資産	* 1 509,917	* 1 576,200
建物	379,427	388,342
器具備品	130,490	187,858
無形固定資産	53,138	5,385
電話加入権	3,795	3,795
ソフトウェア仮勘定	49,343	1,590
投資その他の資産	2,769,418	2,987,389
投資有価証券	43,201	65,610
関係会社株式	1,673,049	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	28,546	32,906
敷金	450,632	450,632
その他長期差入保証金	10,030	10,030
繰延税金資産	532,758	723,961
固定資産計	3,332,475	3,568,975
資産合計	25,288,293	28,819,517
負債の部		
流動負債		
未払金	2,534,676	2,555,940
未払手数料	872,217	1,315,027
その他未払金	1,662,458	1,240,912
未払費用	455,110	544,639
未払消費税等	73,427	367,506
未払法人税等	698,000	1,347,000
預り金	54,312	43,576
前受収益	3,353	3,128
賞与引当金	313,291	244,679
流動負債計	4,132,173	5,106,470
固定負債		
退職給付引当金	378,099	750,413
固定負債計	378,099	750,413
負債合計	4,510,272	5,856,883
純資産の部		
株主資本		
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	18,375,924	20,565,811
利益準備金	500,000	500,000
その他利益剰余金	17,875,924	20,065,811
特別償却準備金	16	0
繰越利益剰余金	17,875,907	20,065,811
評価・換算差額等	2,096	3,177

その他有価証券評価差額金	2,096	3,177
純資産合計	20,778,021	22,962,634
負債・純資産合計	25,288,293	28,819,517

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	12,725,446	16,536,369
運用受託報酬	9,897,931	9,077,029
投資助言報酬	69,049	60,786
その他営業収益	328,576	412,354
営業収益計	23,021,003	26,086,540
営業費用		
支払手数料	5,892,133	7,818,291
広告宣伝費	212,070	254,153
調査費	5,956,517	5,425,141
調査費	3,009,203	2,525,312
委託調査費	2,947,314	2,899,828
委託計算費	119,436	122,584
営業雑経費	238,392	285,550
通信費	32,765	35,052
印刷費	167,851	205,117
協会費	20,903	24,696
諸会費	8,374	12,157
図書費	8,498	8,525
営業費用計	12,418,551	13,905,720
一般管理費		
給料	3,450,052	3,509,999
役員報酬	117,075	112,566
給料・手当	2,360,494	2,541,727
賞与	972,483	855,706
交際費	19,897	17,797
寄付金	131	5,833
旅費交通費	200,290	174,094
租税公課	139,043	164,117
不動産賃借料	377,671	375,694
退職給付費用	113,433	466,387
賞与引当金繰入	313,291	244,679
固定資産減価償却費	106,175	118,517
法定福利費	567,366	580,893
福利厚生費	10,913	9,971
諸経費	480,371	482,967
一般管理費計	5,778,637	6,150,953
営業利益	4,823,815	6,029,866
営業外収益		
受取利息	421	434
受取配当金	* 1 5,041	* 1 4,704
匿名組合投資利益	* 1 59,798	* 1 39,334
雑益	16,161	10,094
営業外収益計	81,422	54,568
営業外費用		
為替差損	33,574	15,577
雑損	2,395	5,174
営業外費用計	35,970	20,752
経常利益	4,869,267	6,063,682
特別損失		

器具備品除却損	0	545
特別損失計	0	545
税引前当期純利益	4,869,267	6,063,137
法人税、住民税及び事業税	1,551,497	2,044,481
法人税等調整額	45,612	188,875
法人税等合計	1,505,884	1,855,605
当期純利益	3,363,382	4,207,531

(3) 【株主資本等変動計算書】

第34期（自 2018年4月1日 至 2019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	400,000	400,000	500,000	38	16,414,098
当期変動額						
剰余金の配当						1,901,595
特別償却準備金の取崩					21	21
当期純利益						3,363,382
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	21	1,461,809
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	16	17,875,907

	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	16,914,136	19,314,136	2,577	2,577	19,316,713
当期変動額					
剰余金の配当	1,901,595	1,901,595			1,901,595
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	3,363,382	3,363,382			3,363,382
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			480	480	480
当期変動額合計	1,461,787	1,461,787	480	480	1,461,307
当期末残高	18,375,924	20,775,924	2,096	2,096	20,778,021

第35期（自 2019年4月1日 至 2020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	400,000	400,000	500,000	16	17,875,907
当期変動額						
剰余金の配当						2,017,644
特別償却準備金の取崩					16	16
当期純利益						4,207,531
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	16	2,189,903
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	0	20,065,811

	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	18,375,924	20,775,924	2,096	2,096	20,778,021
当期変動額					
剰余金の配当	2,017,644	2,017,644			2,017,644
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	4,207,531	4,207,531			4,207,531
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			5,273	5,273	5,273
当期変動額合計	2,189,887	2,189,887	5,273	5,273	2,184,613
当期末残高	20,565,811	22,965,811	3,177	3,177	22,962,634

注記事項

重要な会計方針

第35期 自 2019年4月1日 至 2020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	
	有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、2016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。

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。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により費用処理しております。

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35期

自 2019年4月1日

至 2020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

2022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。

(追加情報)

第35期

自 2019年4月1日

至 2020年3月31日

(退職給付債務の計算方法の変更)

当社は、退職給付債務の計算方法について、従来まで期末自己都合要支給額を退職給付債務とする簡便法によっておりましたが、従業員数の増加に伴い当事業年度より原則的な方法に変更しております。この変更に伴い、当事業年度末における退職給付引当金が319,413千円増加し、同額を退職給付費用として一般管理費に計上しております。

(貸借対照表関係)

第34期 2019年3月31日現在	第35期 2020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。
建物 81,793千円	建物 114,303千円
器具備品 498,485千円	器具備品 364,003千円
リース資産 3,918千円	

(損益計算書関係)

第34期 自 2018年4月1日 至 2019年3月31日	第35期 自 2019年4月1日 至 2020年3月31日
* 1. 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。	* 1. 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。
関係会社からの受取配当金 4,800千円	関係会社からの受取配当金 2,400千円
関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配 59,798千円	関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配 39,334千円

(株主資本等変動計算書関係)

第34期(自 2018年4月1日 至 2019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	2018年4月1日 現在	増加	減少	2019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

2018年6月29日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	1,901,595千円
(ロ) 1株当たり配当額	49,650円
(ハ) 基準日	2018年3月31日
(ニ) 効力発生日	2018年6月29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

2019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	2,017,644千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	52,680円
(二) 基準日	2019年3月31日
(ホ) 効力発生日	2019年6月28日

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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	2019年4月1日 現在	増加	減少	2020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

2019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	2,017,644千円
(ロ) 1株当たり配当額	52,680円
(ハ) 基準日	2019年3月31日
(ニ) 効力発生日	2019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
2020年6月26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	2,403,708千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	62,760円
(ニ) 基準日	2020年3月31日
(ホ) 効力発生日	2020年6月26日

(リース取引関係)

第34期(自 2018年4月1日 至 2019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いましたが、当事業年度においてリース契約が満了しております。

2. リース資産の減価償却の方法

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。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

第34期		第35期	
自	2018年4月1日	自	2019年4月1日
至	2019年3月31日	至	2020年3月31日

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

第34期(2019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	17,817,927	17,817,927	-
(2)未収委託者報酬	1,954,575	1,954,575	-
(3)未収収益	1,951,601	1,951,601	-
(4)未収入金	1,809	1,809	-
(5)投資有価証券 其他有価証券	43,201	43,201	-
(6)預り金	(54,312)	(54,312)	-
(7)未払金	(2,534,676)	(2,534,676)	-
(8)未払費用	(455,110)	(455,110)	-
(9)未払消費税等	(73,427)	(73,427)	-
(10)未払法人税等	(698,000)	(698,000)	-

(*)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35期(2020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	19,928,671	19,928,671	-
(2)未収委託者報酬	2,864,007	2,864,007	-
(3)未収収益	2,126,212	2,126,212	-
(4)未収入金	101,676	101,676	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	65,610	65,610	-
(6)預り金	(43,576)	(43,576)	-
(7)未払金	(2,555,940)	(2,555,940)	-
(8)未払費用	(544,639)	(544,639)	-
(9)未払消費税等	(367,506)	(367,506)	-
(10)未払法人税等	(1,347,000)	(1,347,000)	-

(＊)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34期 2019年3月31日現在	第35期 2020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 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。	(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益、(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 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34期 2019年3月31日現在		第35期 2020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	1,640,302	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	10,030	その他長期差入保証金	10,030

(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34期 2019年3月31日現在	第35期 2020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34期(2019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	17,817,465	-	-	-
未収委託者報酬	1,954,575	-	-	-
未収収益	1,951,601	-	-	-
未収入金	1,809	-	-	-
投資有価証券 其他有価証券のうち満期があるもの	8,308	13,426	5,810	-
合計	21,733,759	13,426	5,810	-

第35期(2020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	19,928,370	-	-	-
未収委託者報酬	2,864,007	-	-	-
未収収益	2,126,212	-	-	-
未収入金	101,676	-	-	-
投資有価証券 其他有価証券のうち満期があるもの	2,247	21,678	22,121	-
合計	25,022,515	21,678	22,121	-

(有価証券関係)

第34期 2019年3月31日現在	第35期 2020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1,640,302千円、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</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p>	<p>1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 子会社株式1,640,302千円、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</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p>

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額	区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照 表計上額が 取得原価を 超えるもの 証券投資 信託	27,344	22,052	5,292	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	32,071	27,816	4,254
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	15,856	18,126	2,269	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	33,538	42,372	8,834
合計	43,201	40,179	3,022	合計	65,610	70,189	4,579
3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 該当事項はありません。				3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 同左			

(退職給付関係)

第34期 自 2018年4月1日 至 2019年3月31日	
1. 採用している退職給付制度の概要	<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>
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

退職給付引当金の期首残高	386,552千円
退職給付費用	38,082千円
退職給付の支払額	37,318千円
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	378,099千円

(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

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	378,099千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	378,099千円
退職給付引当金	378,099千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	378,099千円

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	28,865千円
----------------	----------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、62,736千円であります。

第35期

自 2019年4月1日
至 2020年3月31日

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。

当社は当事業年度より退職給付債務の計算方法を簡便法から原則法に変更しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	378,099千円
簡便法から原則法への変更に伴う費用処理額	319,413千円
勤務費用	70,137千円
利息費用	1,378千円
数理計算上の差異の発生額	11,130千円
退職給付の支払額	9,404千円
確定拠出年金制度への移管額	9,212千円
退職給付債務の期末残高	739,283千円

(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

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	739,283千円
未積立退職給付債務	739,283千円
未認識数理計算上の差異	11,130千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	750,413千円
退職給付引当金	750,413千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	750,413千円

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	70,137千円
利息費用	1,378千円
簡便法から原則法への変更に伴う費用処理額	319,413千円
その他	9,272千円
確定給付制度に係る退職給付費用	400,202千円

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表しております。）

割引率	0.4%
-----	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、66,184千円であります。

(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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
繰延税金資産		
退職給付引当金	115,773千円	229,776千円
未払金	3,921千円	3,802千円
賞与引当金	95,929千円	74,920千円
未払法定福利費	10,904千円	9,935千円
未払事業所税	3,587千円	3,672千円
未払事業税	40,339千円	70,737千円
未払調査費	83,845千円	82,822千円

減価償却超過額	98,061千円	124,870千円
繰延資産超過額	1,733千円	3,293千円
未払確定拠出年金	1,664千円	1,666千円
未収実績連動報酬	3,881千円	21,260千円
過大確定拠出年金掛金	19千円	-
その他有価証券評価差額金	-	1,402千円
未払費用	74,029千円	95,799千円
繰延税金資産小計	533,691千円	723,961千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	533,691千円	723,961千円
繰延税金負債		
特別償却準備金	7千円	0千円
その他有価証券評価差額金	925千円	-
繰延税金負債合計	932千円	0千円
繰延税金資産の純額	532,758千円	723,961千円

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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020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34期 自 2018年4月1日 至 2019年3月31日	第35期 自 2019年4月1日 至 2020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>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 本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。</p>	<p>2. 地域ごとの情報 (1) 営業収益 (単位：千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>日本</th> <th>その他</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>23,387,535</td> <td>2,699,004</td> <td>26,086,540</td> </tr> </tbody> </table> <p>(注) 営業収益は顧客の所在地を基準とし、国ごとに分類しております。</p>	日本	その他	合計	23,387,535	2,699,004	26,086,540
日本	その他	合計					
23,387,535	2,699,004	26,086,540					
<p>(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>(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）</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）</p>						
<p>(2) 委託者報酬 3,641,416千円</p>	<p>(2) 委託者報酬 5,339,902千円</p>						
<p>(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>	<p>(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34期（自 2018年4月1日 至 2019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
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）
- (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35期（自 2019年4月1日 至 2020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
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）
- (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34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
1株当たり純資産額	542,507円07銭
1株当たり当期純利益金額	87,816円78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	20,778,021千円
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	20,778,021千円
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	3,363,382千円
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	3,363,382千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株
第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	599,546円59銭
1株当たり当期純利益金額	109,857円21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	22,962,634千円
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	22,962,634千円
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	4,207,531千円
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	4,207,531千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

(1) 受託会社

- ・ 名称 三菱UFJ信託銀行株式会社
(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)
- ・ 資本金の額 324,279百万円(2020年3月末日現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

<参考情報：再信託受託会社の概要>

- ・ 名称 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 10,000百万円(2020年3月末日現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額()	事業の内容
株式会社SBI証券	48,323百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
百五証券株式会社	3,000百万円	
ひろぎん証券株式会社	5,000百万円	
フィデリティ証券株式会社	10,007百万円	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社千葉銀行	145,069百万円	
株式会社中京銀行	31,844百万円	
株式会社中国銀行	15,149百万円	
株式会社百五銀行	20,000百万円	
株式会社福井銀行	17,965百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	

() 2020年3月末日現在。

独立監査人の監査報告書

2020年6月1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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 奈良 昌彦
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

監査意見

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第35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。

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2020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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事

項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年7月22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

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 久保 直毅

監査意見

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・円資産バランスファンド（3倍型）（毎月決算型）の2019年12月24日から2020年6月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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・円資産バランスファンド（3倍型）（毎月決算型）の2020年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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。