

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2019年3月20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】	東京海上セレクション・バランス30 東京海上セレクション・バランス50 東京海上セレクション・バランス70
【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】	上限 各1兆円
【縦覧に供する場所】	該当なし

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

東京海上セレクション・バランス30

東京海上セレクション・バランス50

東京海上セレクション・バランス70

（上記のそれぞれをまたは総称して、以下「当ファンド」ということがあります。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定に基づく投資信託の受益権であり、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である東京海上アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

当初の1口当たり元本は1円です。

委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。

委託会社のお問い合わせ先（以下「委託会社サービスデスク」といいます。）

東京海上アセットマネジメント サービスデスク

0120-712-016（土日祝日・年末年始を除く9時～17時）

(5)【申込手数料】

申込時の手数料はありません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位となります。

上記にかかわらず、自動けいぞく（累積）投資に基づく収益分配金の再投資に際しては、1口の整数倍をもって取得できます。

(7)【申込期間】

2019年3月21日から2019年9月20日まで

上記申込期間中の毎営業日にお申込みを受け付けます。

申込期間は、上記期間満了前に委託会社が有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(8)【申込取扱場所】

販売会社の本・支店のうち、確定拠出年金制度に基づいた受益権の取得申込を取扱う部店のみでの取扱いとなりますのでご注意ください。詳しくは販売会社の最寄りの本・支店等にお問い合わせください。なお、販売会社については、委託会社サービスデスクにお問い合わせください。

(9)【払込期日】

取得申込者は、申込金（発行価格に取得申込口数を乗じて得た申込時の支払総額をいいます。）を販売会社所定の期日までに販売会社に支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は各追加信託が行われる日に、販売会社から、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社である三菱UFJ信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）の指定する当ファンドの口座に振込まれます。

(10)【払込取扱場所】

申込金は、お申込みの販売会社にお支払いください。

(11)【振替機関に関する事項】

当ファンドの受益権の振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

申込の方法

- a. 当ファンドの取得申込者は、原則として確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得申込を行う資産管理機関および連合会等に限るものとします。ただし、ファンドの設定・維持のため委託会社またはその関係会社が自己の資金をもって取得する場合はこの限りではありません。
- b. 受益権の取得申込は、販売会社において申込期間中の毎営業日に受け付けます。
- c. 取得申込者は、申込金額相当額の申込金を販売会社に支払うものとします。ただし、当ファンドは上記「(9)払込期日」にしたがい受託会社に払込まれた時点で初めて設定がなされ、取得申込者はその時点から当ファンドの当該設定にかかる受益者となります。申込金には利息を付けません。
- d. 取得申込の受付は、原則として午後3時までの受付分を当日分とし、この受付時間を過ぎてからの申込分は翌営業日の受付分とします。
- e. 上記にかかわらず、証券取引所（ ）における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置を取った場合には、販売会社は、受益権の取得申込の受付を中止すること、および既に受け付けた取得申込の受付を取り消すことができます。
（ ）金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます（以下、本書において同じ。）。
- f. 取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込を行うものとします。（ただし、既に取引口座をお持ちの場合を除きます。）
- g. 当ファンドは、収益の分配がなされた場合、分配金を再投資する自動けいぞく（累積）投資専用ファンドです。このため申込の際、取得申込者と販売会社の間で、自動けいぞく（累積）投資に関する契約を締結する必要があります。
上記の契約について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約等が用いられることがあります。この場合、当該別の名称に読替えるものとします（以下同じ。）。
- h. 販売会社によっては、各ファンド間の乗換え（「スイッチング」といいます。）が可能な場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

日本以外の地域における発行

該当ありません。

振替受益権について

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

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】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を目標として、「TMA日本株アクティブマザーファンド受益証券」、「TMA日本債券マザーファンド受益証券」、「TMA外国株式マザーファンド受益証券」、「TMA外国債券マザーファンド受益証券」（それぞれをまたは総称して、以下「マザーファンド」ということがあります。）、および短期金融資産を主要投資対象として運用を行います。

「TMA」とは委託会社である「東京海上アセットマネジメント株式会社（TOKIO MARINE ASSET MANAGEMENT CO.,LTD.）」の略称です。

基本的性格

当ファンドは、追加型投信／内外／資産複合に属します。

当ファンドの商品分類表および属性区分表は、以下の通りです。

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信
	内外	その他資産 ()
		資産複合

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (日本を含む) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリーファン ド	あり ()
不動産投信	日々	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産(投資信託証券 (資産複合(株式・債券)資 産配分固定型))(注)	その他 ()			
資産複合() 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドは、組入比率を年に1回見直すものとしていますが、機動的に変更を行うものではないため、「資産配分固定型」としていません。

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

投資形態が、ファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資することとなりますので、商品分類表と属性区分表の投資対象資産が異なります。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型投信	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会の「MMF等の運営に関する規則」に定められるMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会の「MMF等の運営に関する規則」に定められるMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	特殊型	目論見書または投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

商品分類の定義は、一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」をもとに委託会社が作成しております。

属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	目論見書または投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	目論見書または投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。

債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
	公債	目論見書または投資信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	社債	目論見書または投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他債券	目論見書または投資信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	格付等クレジットによる属性	目論見書または投資信託約款において、上記債券の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記債券に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記します。
不動産投信		目論見書または投資信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
その他資産		目論見書または投資信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
資産複合	資産配分固定型	目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。
	資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
決算頻度	年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年4回	目論見書または投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年6回(隔月)	目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回(毎月)	目論見書または投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々	目論見書または投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

	中南米	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東(中東)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会の「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定されるファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	目論見書または投資信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	目論見書または投資信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	TOPIX	目論見書または投資信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記指数にあてはまらない全てのものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	目論見書または投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	目論見書または投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型 /絶対収益追求型	目論見書または投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他型	目論見書または投資信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

属性区分の定義は、一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」をもとに委託会社が作成しております。

信託金の限度額

当ファンドの信託金限度額は、信託約款の定めにより各1兆円となっています。ただし、受託会社と合意のうえ、変更することができます。

ファンドの特色

1. 主として国内外の複数の資産（日本株式、日本債券、外国株式、外国債券）のマザーファンド受益証券および短期金融資産へ分散投資し、中長期的な信託財産の成長を目指します。

当ファンドにはベンチマークはありませんが、各マザーファンドは、それぞれのベンチマークを上回る投資成果を目標として運用を行います。

マザーファンド受益証券	ベンチマーク
TMA日本株アクティブマザーファンド	TOPIX
TMA日本債券マザーファンド	NOMURA-BPI（総合）
TMA外国株式マザーファンド	MSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）
TMA外国債券マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

2. 当ファンドの運用は、ファミリーファンド方式により行います。したがって、実質的な運用は、主にマザーファンドで行うこととなります。
3. 資産配分は＜基本資産配分＞を基準に、原則として一定の範囲内（±5%）に変動幅を抑制します。

＜基本資産配分＞

	日本株式	日本債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
東京海上セレクション・バランス30	20%	47%	10%	20%	3%
東京海上セレクション・バランス50	35%	27%	15%	20%	3%
東京海上セレクション・バランス70	50%	10%	20%	17%	3%

＜東京海上セレクション・バランス30＞安定性に成長性を加味し、中長期的な資産の成長を目指します。

＜東京海上セレクション・バランス50＞安定性と成長性をバランスさせ、中長期的な資産の成長を目指します。

＜東京海上セレクション・バランス70＞成長性を重視し、中長期的な資産の成長を目指します。

4. ＜基本資産配分＞は、経済見通し、市況動向等の見通し、各資産のリターン予測等に基づいて、原則として年に1回見直し、委託会社が必要と判断した場合には、配分率を変更することがあります。

＜各マザーファンドが対象とするインデックスについて＞

・ TOPIX

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。

・ NOMURA-BPI（野村債券・パフォーマンス・インデックス）（総合）

野村證券が公表する日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表す代表的な指標です。NOMURA-BPIは、野村證券の知的財産です。野村證券は、当ファンドの運用成績等に関し、一切責任ありません。

・ MSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）

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社は当ファンドとは関係なく、当ファンドから生じるいかなる責任も負いません。

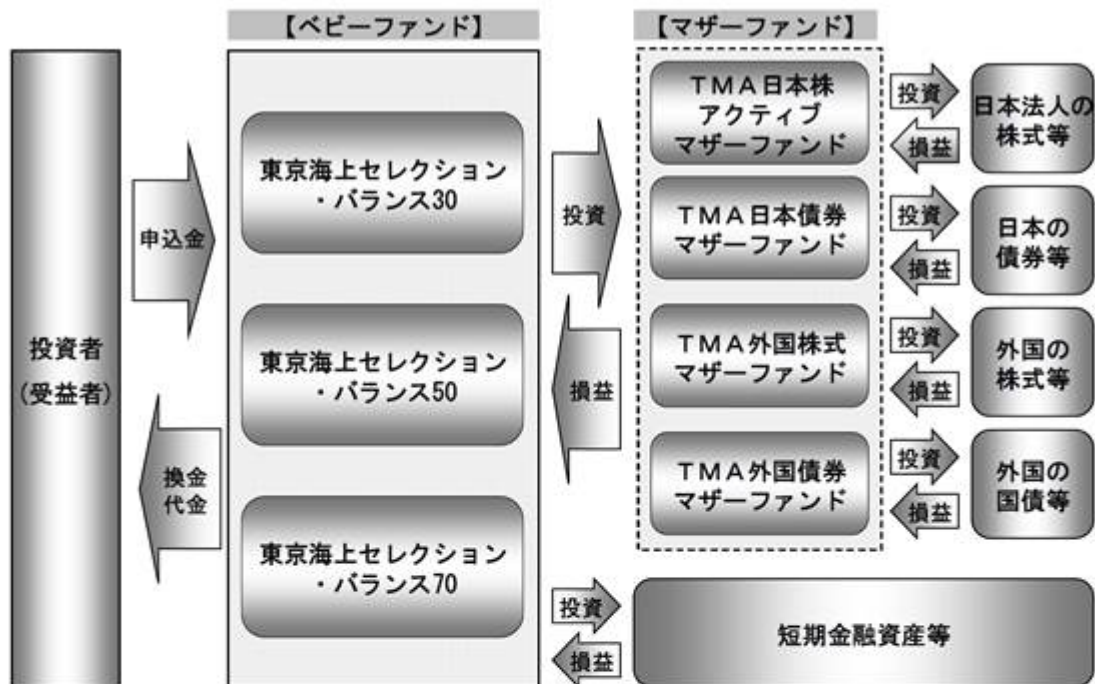
・ FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・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、脱漏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。

資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの仕組み

当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位に保ちます。ただし、投資環境等によっては弾力的に運用することがあります。



※「ファミリーファンド方式」とは、受益者の投資資金をベビーファンドとしてまとめ、その資金を主としてマザーファンド（親投資信託）に投資することにより、実質的な運用をマザーファンドにて行う方式です。ベビーファンドがマザーファンドに投資するに際しての投資コストはかかりません。また、他のベビーファンドが、マザーファンドへ投資することがあります。

分配方針

原則として、毎決算時に収益分配を行います。分配対象額は、経費控除後の、繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とし、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して収益分配金額を決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

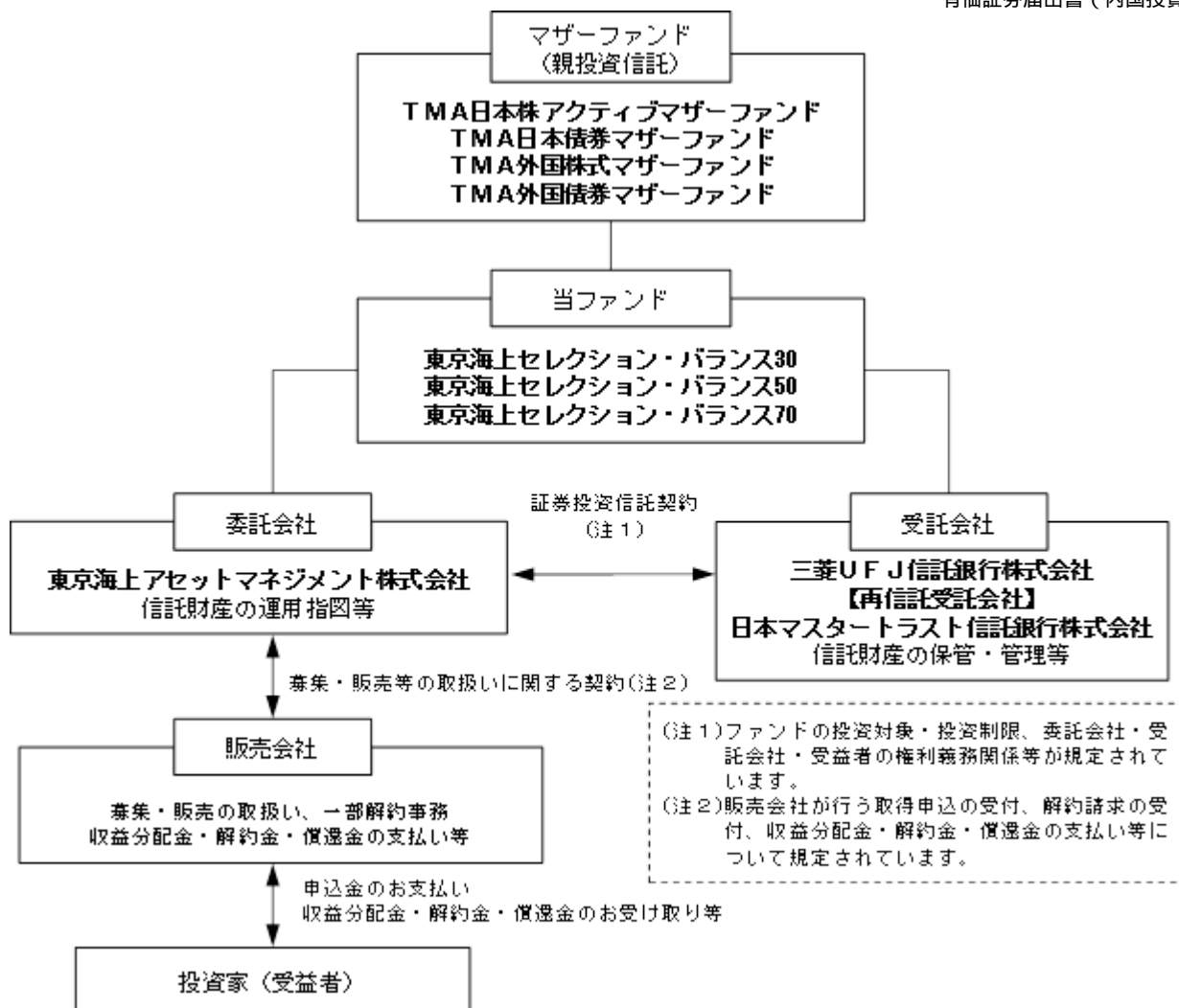
	株式への 実質投資割合	外貨建資産への 実質投資割合
東京海上セレクション・バランス30	45%未満	45%未満
東京海上セレクション・バランス50	70%未満	50%未満
東京海上セレクション・バランス70	制限なし	55%未満

(2) 【ファンドの沿革】

2001年9月25日 ファンドの設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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（2019年1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社名変更し、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社名変更
 - 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（2019年1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】

(1)【投資方針】

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 主要投資対象

主として以下のマザーファンド受益証券および短期金融資産に投資します。当ファンドにはベンチマークはありませんが、各マザーファンドは、それぞれのベンチマークを上回る投資成果を目標として運用を行います。

マザーファンド名	ベンチマーク
TMA日本株アクティブマザーファンド	TOPIX
TMA日本債券マザーファンド	NOMURA - BPI (総合)
TMA外国株式マザーファンド	MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)
TMA外国債券マザーファンド	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)

(2) 投資態度

主として国内外の複数の資産（日本株式、日本債券、外国株式、外国債券）のマザーファンド受益証券および短期金融資産へ分散投資し、中長期的な信託財産の成長を目指します。

当ファンドの運用は、ファミリーファンド方式により行います。したがって、実質的な運用は、主にマザーファンドで行うこととなります。

資産配分は「基本資産配分」を基準に、原則として一定の範囲内（±5%）に変動幅を抑制します。

<基本資産配分>

	日本株式	日本債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
東京海上セレクション ・バランス30	20%	47%	10%	20%	3%
東京海上セレクション ・バランス50	35%	27%	15%	20%	3%
東京海上セレクション ・バランス70	50%	10%	20%	17%	3%

基本資産配分は、経済見通し、市況動向等の見通し、各資産のリターン予測等に基づいて、原則として年に1回見直し、委託会社が必要と判断した場合には、配分率を変更することがあります。

実質組入れ外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジは行いません。

ただし、資金動向、市況動向、残存期間等の事情によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

<参考情報> マザーファンドの投資方針、主な投資対象と投資制限(要約)

TMA日本株アクティブマザーファンド

<基本方針> 信託財産の中長期的な成長を目標とし、日本法人の株式に投資します。
TOPIXをベンチマークとし、これを上回る投資成果を目標とします。

(1) 投資対象

証券取引所に上場あるいは店頭市場に登録している日本法人の株式（これらに準じるものも含まれます。）を主要投資対象とします。

(2) 運用方針

ポートフォリオは、セクター判断（業種配分）と銘柄選択を付加価値の源泉として構築します。

セクター判断は、ベンチマークに採用されている銘柄を委託会社独自の業種区分により分類し、各業種の株価時価総額ウェイトを算出したものをベースとし、以下の判断、要因を勘案の上、業種基準ポートフォリオを決定します。

ファンダメンタルズ、バリュエーション、テクニカルの以下3視点による計量分析に定性的判断を加味します。

- ・業種共通のマクロ指標と各業種ごとのセミマクロ指標によるファンダメンタルズ分析
- ・業種別PER、PBR等によるバリュエーション分析
- ・計量的アプローチを用いたテクニカル分析

構造的（長期的）要因と循環的（短期的）要因を考慮します。

当該企業の成長性と株価の割安度の双方をミックスした委託会社独自の分析システムの活用と、企業訪問などによる徹底した調査・分析を基に行います。

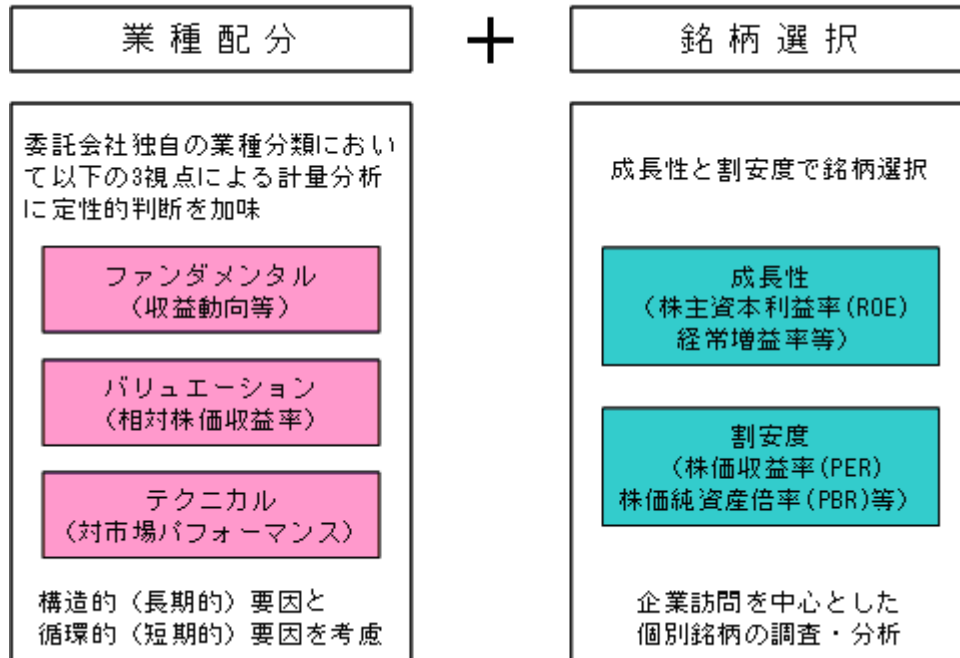
成長性、割安度双方の視点のミックス（GARP：Growth at a Reasonable Price）

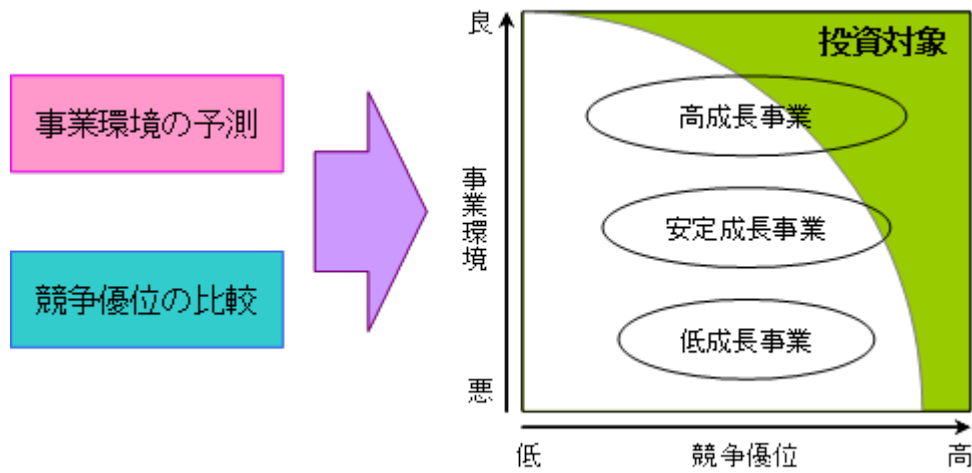
- ・成長性 - ROE、経常増益率、利益予想変化 など
- ・割安度 - 株価純資産倍率、株価収益率、キャッシュフロー倍率 など

アナリスト、ファンド・マネージャーによる企業訪問など調査・分析

銘柄選択の着眼点としては、市場動向分析や競合状態分析による「事業環境の予測」およびコスト分析、差異化分析や事業戦略分析による同業他社比較における「競争優位の評価」などが中心となります。

基本的には株式への組入比率を高位に保ちますが、資金動向、市況動向によっては実質株式組入比率の調整を機動的に行います。





< 投資制限 >

- (1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- (2) 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- (3) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- (4) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (5) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (6) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (7) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

TMA日本債券マザーファンド

<基本方針> 安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目標とし、日本の債券に投資します。
NOMURA - BPI (総合)をベンチマークとし、これを上回る投資成果を目標とします。

(1) 投資対象

日本の債券を主要投資対象とします。

(2) 運用方針

ポートフォリオは、イールド選択（金利選択）、スプレッド選択および銘柄選択を付加価値の源泉として構築します。

イールド選択（金利選択）

金融政策やインフレ指標等の分析から長短金利の方向性を予測し、たとえば金利低下を予測する場合はデュレーションを長期化、金利上昇を予測する場合はデュレーションを短期化する戦略をとります。

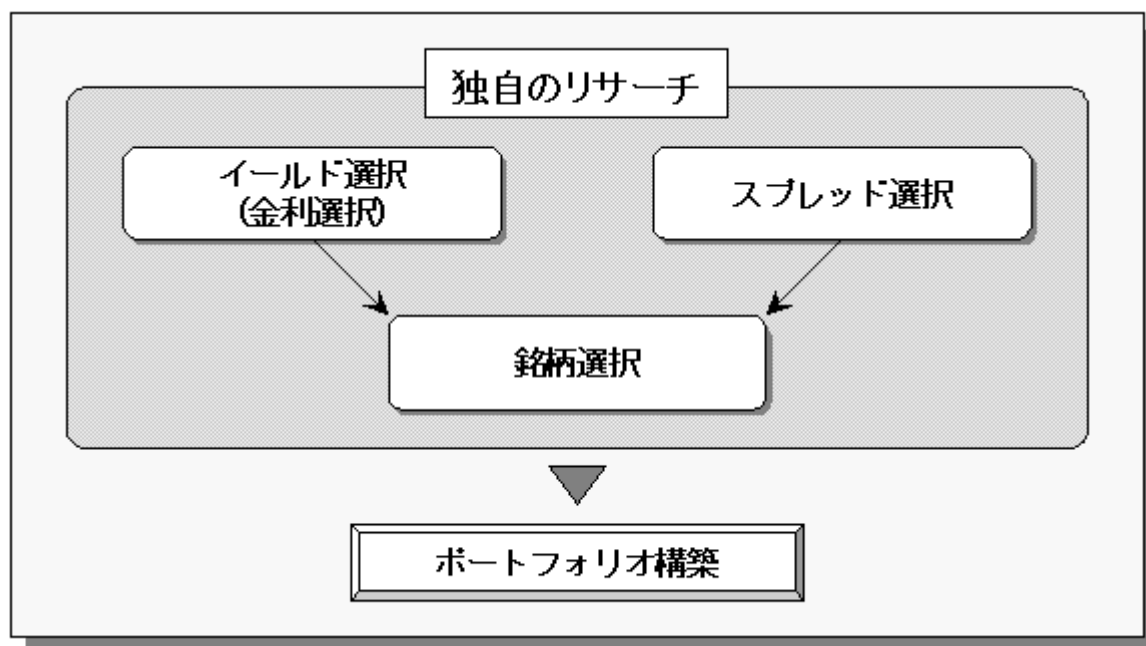
*デュレーションとは、金利の変化に対する債券価格の変動性を示す指標です。その値が大きいほど、金利の変化に対して価格の動きが大きいことを意味します。

スプレッド選択

債券の信用度や流動性等の分析によりスプレッド（国債との利回り較差。信用度が低い企業の発行する債券は国債に比べて、より利回りが高い）の妥当性や変化の方向性を見定め、スプレッド縮小を予測する場合は、スプレッド縮小の恩恵を得られる社債等の比率を高めるなどの戦略をとります。

銘柄選択

債券の残存期間と最終利回りの関係を分析し、相対的に高利回りな銘柄を選別します。社債等においては、ファンドマネージャーによる企業訪問で得た情報等を分析し銘柄を選択します。基本的には債券への組入比率を高位に保ちますが、資金動向、市況動向によっては実質債券組入比率の調整を機動的に行います。



<投資制限>

- (1) 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。（ただし、転換社債の転換、新株引受権の行使および新株予約権の行使により取得する場合には限りません。）
- (2) 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- (3) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- (4) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (5) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (6) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (7) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

TMA外国株式マザーファンド

<基本方針> 信託財産の中長期的な成長を目標とし、外国の株式に投資します。
MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)をベンチマークとし、これを上回る投資成果を目標とします。

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 運用方針

ポートフォリオは、個別銘柄の調査・分析に基づいた銘柄選択を付加価値の源泉として構築します。

調査対象銘柄の選定

委託会社が独自に開発した業種別銘柄選別モデルを活用し、主にMSCIコクサイ指数の構成銘柄から調査対象銘柄を絞り込みます。

個別銘柄の調査・分析

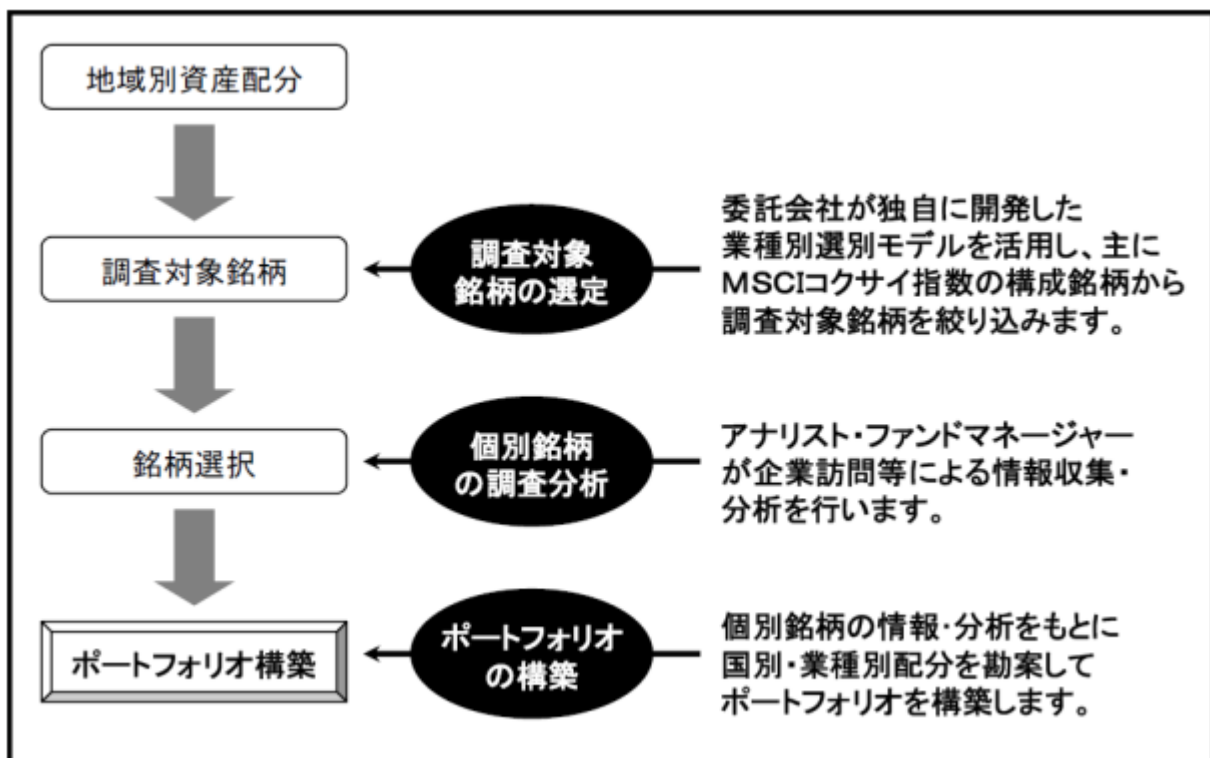
アナリスト・ファンドマネージャーが企業訪問等による情報収集・分析を行います。

ポートフォリオの構築

個別銘柄の情報・分析をもとに、国別配分・業種配分を勘案してポートフォリオを構築します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

基本的には株式への組入比率を高位に保ちますが、資金動向、市況動向によっては実質株式組入比率の調整を機動的に行います。



<投資制限>

- (1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- (2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (3) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- (4) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (5) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (6) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (7) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

TMA外国債券マザーファンド

<基本方針> 信託財産の中長期的な成長を目標とし、主に外国の国債に投資します。
 FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)をベンチマークとし、これを上回る投資成果を目標とします。

(1) 投資対象

外国の国債を主要投資対象とします。

(2) 運用方針

ポートフォリオは、国別配分、デュレーション調整、銘柄選択を付加価値の源泉として構築します。

国別配分

各国のファンダメンタルズ（経済の基礎的条件）等进行分析することにより金利・為替動向を予測し、それを基に各国債券市場の期待収益率を算出し、期待収益率が高い国の配分を高め、期待収益率が低い国の配分を低める戦略をとります。

デュレーション調整

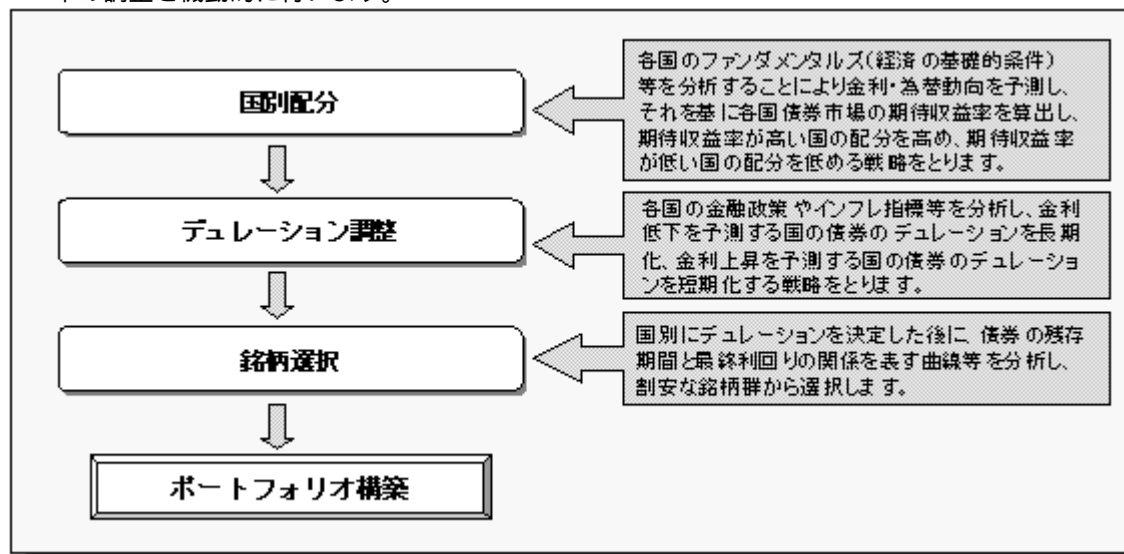
各国の金融政策やインフレ指標等进行分析し、金利低下を予測する国の債券のデュレーションを長期化、金利上昇を予測する国の債券のデュレーションを短期化する戦略をとります。

銘柄選択

国別にデュレーションを決定した後に、債券の残存期間と最終利回りの関係を表す曲線等进行分析し、割安な銘柄群から選択します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

基本的には債券への組入比率を高位に保ちますが、資金動向、市況動向によっては実質債券組入比率の調整を機動的に行います。



<投資制限>

- (1) 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。（ただし、転換社債の転換、新株引受権の行使および新株予約権の行使により取得する場合には限りません。）
- (2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (3) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- (4) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (5) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (6) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (7) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

大量の追加設定または解約が生じたとき、市況の急激な変化が予想されるとき、ならびに信託財産の規模によっては上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

1. 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- (1) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条で定めるものをいいます。以下同じ。）

有価証券

デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条（先物取引等の運用指図）、第23条（スワップ取引の運用指図）および第24条（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）に定めるものに限り、）

金銭債権（ に掲げるものに該当するものを除きます。 ）

約束手形（金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。 ）

- (2) 次に掲げる特定資産以外の資産
為替手形

2. 委託会社は、信託金を、主として東京海上アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社として締結された「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」および「TMA外国債券マザーファンド」の受益証券および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。 ）に投資することを指図します。

- (1) 株券または新株引受権証券
- (2) 国債証券
- (3) 地方債証券
- (4) 特別の法律により法人の発行する債券
- (5) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。 ）
- (6) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。 ）
- (7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。 ）
- (8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。 ）
- (9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。 ）
- (10) コマーシャル・ペーパー
- (11) 新株引受権証券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。 ）および新株予約権証券
- (12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(1)から(11)までの証券または証書の性質を有するもの
- (13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。 ）
- (14) 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。 ）
- (15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。 ）
- (16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限り、）
- (17) 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。 ）
- (18) 外国法人が発行する譲渡性預金証券
- (19) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、）
- (20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。 ）
- (21) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- (22) 外国の者に対する権利で上記(21)の有価証券の性質を有するもの

なお、(1)の証券または証書、(12)および(17)の証券または証書のうち(1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(2)から(6)までの証券、(12)および(17)の証券または証書のうち(2)から(6)までの証券の性質を有するものならびに(14)の投資法人債券を以下「公社債」といい、(13)の証券および(14)の証券（投資法人債券を除きます。 ）を以下「投資信託証券」といいます。

3. 委託会社は、信託金を、上記2. に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。 ）により運用することを指図することができます。

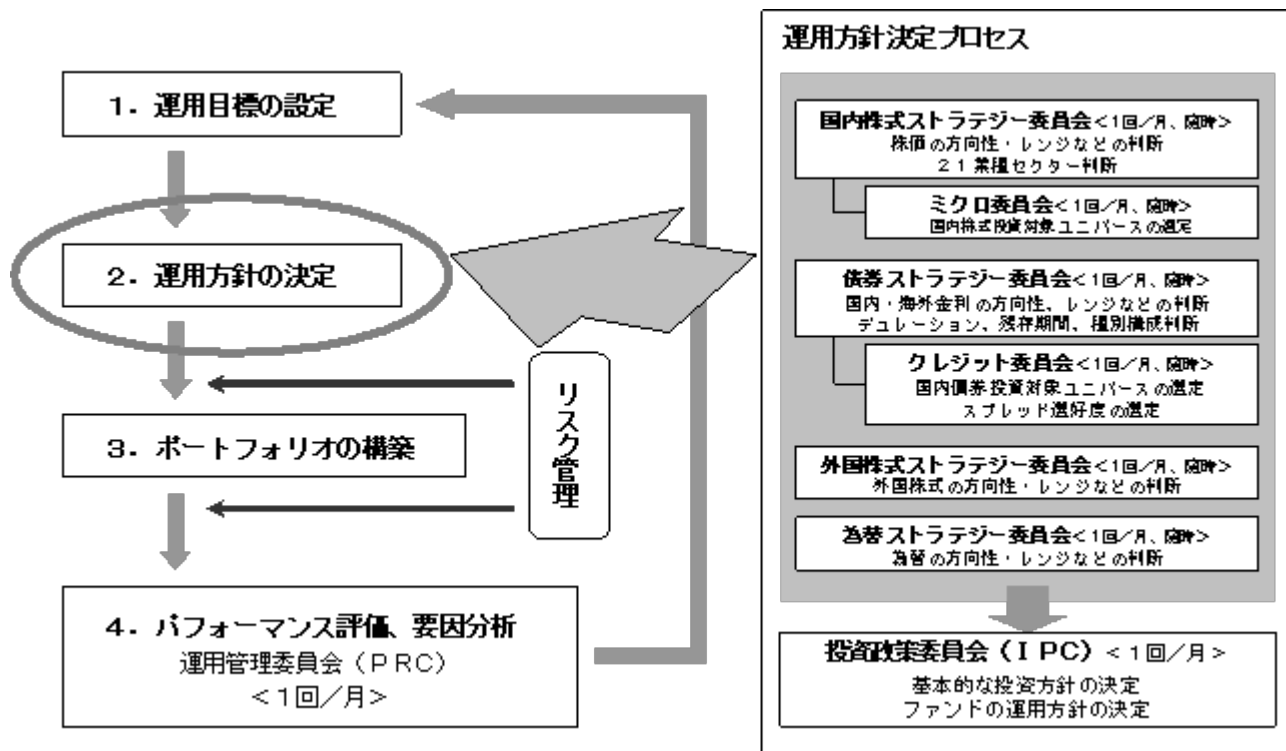
- (1) 預金
- (2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。 ）
- (3) コール・ローン
- (4) 手形割引市場において売買される手形

- (5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 (6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

4. 上記2.の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(3)【運用体制】

当ファンドの運用は、基本資産配分に基づき主に4資産（日本株式、日本債券、外国株式、外国債券）の各マザーファンド、および短期金融資産への投資を行います。各マザーファンドの運用方針は、毎月開催される投資政策委員会において決定します。



当ファンドは運用戦略部（15名）が社内規則である「投資運用業に係る業務運営規程」に基づき運用を担当します。各マザーファンドについては、日本株式および外国株式を株式運用部（15名）が、日本債券および外国債券を債券運用部（16名）が、同じく「投資運用業に係る業務運営規程」に基づき運用を担当します。

運用におけるリスク管理は、運用管理部（6名）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、2019年2月1日現在）

(4)【配分方針】

年1回（原則として6月20日、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、毎決算時に原則として以下の通り収益分配を行う方針です。

分配対象額は、経費控除後の、繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みません。）等の全額とし、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して収益分配金額を決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。なお、収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、投資方針に基づいて運用を行います。信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- a. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費（ ）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を控除した後、その残額

を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

- b. 売買損益に評価損益を加減した利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費()、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

() 諸経費とは、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用(消費税等相当額を含みます。)、信託財産の財務諸表の監査に要する費用(消費税等相当額を含みます。)ならびに受託会社の立替えた立替金の利息をいいます。

計算期末において信託財産に損失が生じた場合は、次期に繰越します。

分配金は、自動けいぞく(累積)投資に関する契約に基づき、自動的に無手数料で再投資されます。なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5)【投資制限】

運用の基本方針に基づく制限(約款別紙「運用の基本方針」)

- a. 「東京海上セレクション・バランス30」

委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドに属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、信託財産の純資産総額の100分の45以上となる投資の指図をしません。

「東京海上セレクション・バランス50」

委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドに属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、信託財産の純資産総額の100分の70以上となる投資の指図をしません。

「東京海上セレクション・バランス70」

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、

マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(以下同じ。)

- b. 「東京海上セレクション・バランス30」

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドに属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、信託財産の純資産総額の100分の45以上となる投資の指図をしません。

「東京海上セレクション・バランス50」

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドに属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、信託財産の純資産総額の100分の50以上となる投資の指図をしません。

「東京海上セレクション・バランス70」

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドに属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、信託財産の純資産総額の100分の55以上となる投資の指図をしません。

- c. 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

- d. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券(マザーファンド受益証券を除きます。)の時価総額とマザーファンドに属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- e. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- f. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- g. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

投資する株式等の範囲（約款第19条）

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

信用取引（約款第21条）

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡または買戻により行うことの指図をすることができるものとします。
- b. 上記a.の信用取引の指図は、当該売付にかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付にかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の売付にかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

先物取引等（約款第22条）

- a. 委託会社は、日本国内の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。本書において同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。本書において同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。本書において同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
- b. 委託会社は、日本国内の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- c. 委託会社は、日本国内の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引（約款第23条）

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入が必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引（約款第24条）

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入が必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。

デリバティブ取引等に係る投資制限（約款第24条の2）

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

有価証券の貸付（約款第25条）

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

b. 上記a. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。

公社債の空売(約款第26条)

a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けるとの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、公社債(信託財産において借入れた公社債を含みます。)の引渡または買戻により行うことの指図をすることができるものとします。

b. 上記a. の売付の指図は、当該売付にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b. の売付にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

公社債の借入(約款第27条)

a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入の指図をすることができます。なお、当該公社債の借入を行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

b. 上記a. の借入の指図は、当該借入にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行えるものとします。

c. 信託財産の一部解約等の事由により上記b. の借入にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

d. 上記a. の借入にかかる品借料は信託財産中から支弁します。

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第28条)

外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約取引(約款第29条)

a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

b. 上記a. の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

c. 信託財産の一部解約等の事由により上記b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内にその超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

信用リスク集中回避のための投資制限(約款第29条の2)

一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしがたい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

資金の借入(約款第37条)

a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

b. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

c. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

d. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

3【投資リスク】

1．投資リスク

以下の記載は、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドを組み入れることにより、当ファンドが間接的に受ける実質的なリスクを含みます。

(1) 価格変動リスク

当ファンドは、主に株式や公社債など値動きのある証券を実質的な投資対象としますので、基準価額は変動します。したがって、当ファンドは元本が保証されているものではありません。

委託会社の運用指図によって信託財産に生じた利益および損失は、全て投資家に帰属します。

投資信託は預貯金や保険と異なります。

当ファンドへの投資には主に以下のリスクが想定され、これらの影響により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

株価変動リスク

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。）。組入銘柄の株価が大きく下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

金利変動リスク

公社債は、一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、反対に金利が下落した場合には価格は上昇します。したがって、金利が上昇した場合、当ファンドの基準価額の下落要因となります。ただし、当ファンドのデュレーションがマイナスとなっている場合は金利の下落が基準価額の下落要因となります。

また、インフレによる資産価値の目減りを回避するため、物価連動国債に投資することがあります。物価連動国債の価格は物価変動の影響を受け、満期時に物価が下落した場合は債券の償還金額が元本を下回ることもあるため、ファンドの基準価額の動きが必ずしも金利動向と一致しない場合があります。

信用リスク

一般に公社債や短期金融商品等の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合、またはデフォルトが予想される場合には、当該公社債等の価格は大幅に下落することになります。したがって、当ファンドの組入公社債等にデフォルトが生じた場合、またデフォルトが予想される場合には、当ファンドの基準価額の下落要因となります。

為替変動リスク

外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動の他、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国・地域の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向にすすんだ場合には、基準価額が下落する要因となります。

カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想以上に下落したり、投資方針に沿った運用が困難となることがあります。

流動性リスク

受益者から短期間に相当金額の解約申込があった場合、ファンドは組入資産を売却することで解約金額の手当てを行いますが、組入資産の市場における流動性が低いときには直前の市場価格よりも大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。これに伴い基準価額が大きく下落することがあります。

(2) デリバティブ取引のリスク

当ファンドはデリバティブに投資することがあります。デリバティブの運用には、ヘッジする商品とヘッジされるべき資産との間の相関性を欠いてしまう可能性、流動性を欠く可能性、証拠金を積むことによるリスク等様々なリスクが伴います。これらの運用手法は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避する目的のみならず、効率的な運用に資する目的でも用いられることがあります。実際の価格変動が委託会社の見通しと異なった場合に当ファンドが損失を被るリスクを伴います。

2．その他の留意事項

(1) 一般的な留意事項

投資信託は、その商品性格から次の特徴をご理解のうえご購入ください。

- ・投資信託は株式・公社債などの値動きのある証券に投資しますので、基準価額は変動します。
- ・投資信託は金融機関の預金と異なり元金が保証されているものではありません。
- ・投資信託は保険契約および預金ではありません。

- ・投資信託は保険契約者保護機構の補償対象契約ではありません。
 - ・投資信託は預金保険の対象ではありません。
 - ・登録金融機関から購入した投資信託は投資者保護基金の補償対象ではありません。
 - ・当ファンドは、主に国内外の株式や公社債を実質的な投資対象としています。当ファンドの基準価額は、組入れた株式や公社債の値動きやそれらの株式や公社債の発行者の信用状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下しますので、投資元本を割り込むことがあります。したがって、当ファンドは元本が保証されているものではありません。
 - ・委託会社の運用指図によって信託財産に生じた利益および損失は、全て投資家に帰属します。
- (2) 法令・税制・会計等の変更可能性
法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。
- (3) その他の留意点
取得申込者から販売会社に申込代金が支払われた場合であっても、販売会社より委託会社に対して申込代金の払込が現実になされるまでは、当ファンドも委託会社もいかなる責任も負わず、かつその後、受託会社に払込がなされるまでは、取得申込者は受益権および受益権に付随するいかなる権利も取得しません。
一部解約金、収益分配金および償還金の支払は全て販売会社を通じて行われます。
委託会社は、販売会社とは別法人であり、委託会社は設定・運用を善良なる管理者の注意をもって行う責任を負担し、販売会社は販売（申込代金の預り等を含みます。）について責任を負担しており、互いに他について責任を負担しません。
受託会社は、委託会社に収益分配金、一部解約金および償還金を委託会社の指定する預金口座等へ払い込んだ後は、受益者に対し、それらを支払う責任を負いません。
当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等に伴う資金変動等があり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全額が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

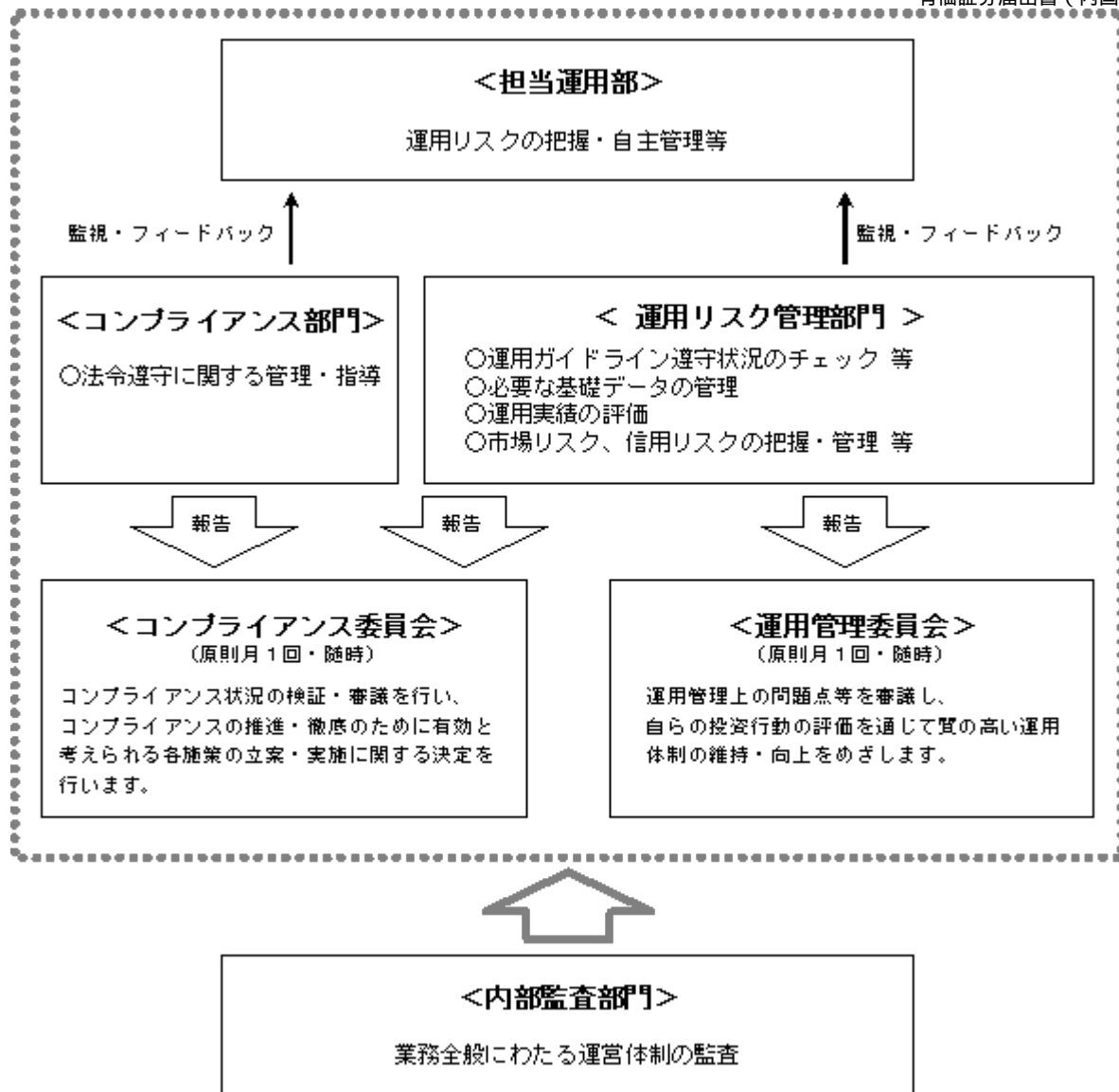
3. 管理体制

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。

< リスク管理体制 >



参考情報

東京海上セレクション・バランス30

●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

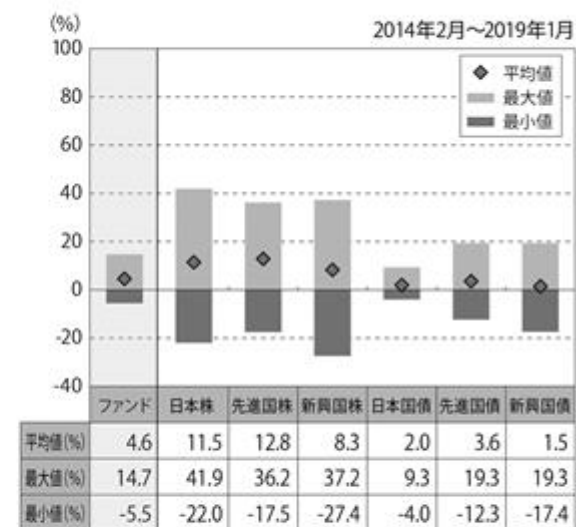


※過去5年間の各月末における分配金再投資基準価額と直近1年間の騰落率を表示したものです。

※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。

※年間騰落率は、税引前分配金を再投資したものと計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

●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。

なお、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。

※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。

※ファンドは分配金再投資基準価額の年間騰落率です。税引前分配金を再投資したものと計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

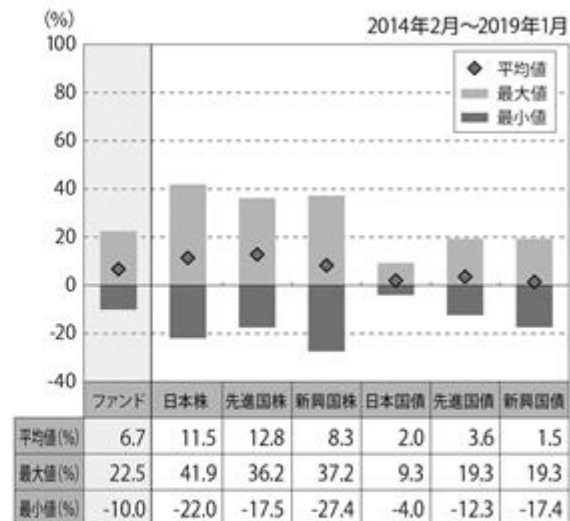
東京海上セレクション・バランス50

●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して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。
 ※年間騰落率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

●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。
 なお、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。
 ※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。
 ※ファンドは分配金再投資基準価額の年間騰落率です。税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

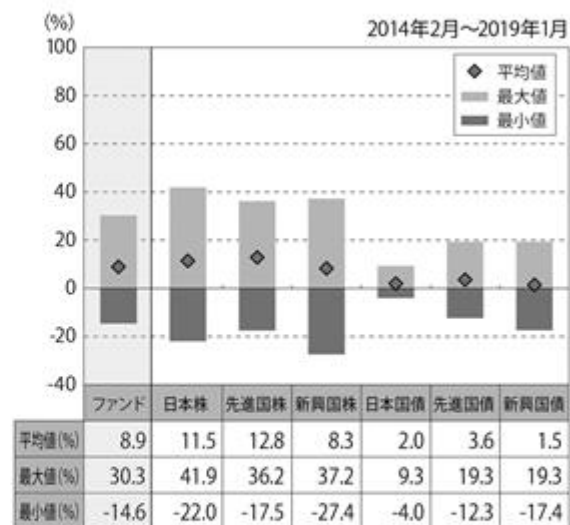
東京海上セレクション・バランス70

●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して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。
 ※年間騰落率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

●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。
 なお、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。
 ※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。
 ※ファンドは分配金再投資基準価額の年間騰落率です。税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

●代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

日本株：TOPIX(東証株価指数)(配当込み)

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。

先進国株：MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)

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社は当ファンドとは関係なく、当ファンドから生じるいかなる責任も負いません。

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

MSCIエマージング・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社は当ファンドとは関係なく、当ファンドから生じるいかなる責任も負いません。

日本国債：NOMURA-BPI(国債)

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。

先進国債：FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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、脱漏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。

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)

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、為替ヘッジなしの指数を採用しています。

騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに委託会社が計算しており、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

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】

(1)【申込手数料】

申込時の手数料はありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金時（解約時）の手数料はありません。

(3)【信託報酬等】

委託会社、販売会社および受託会社の信託報酬の総額は信託財産の純資産総額に対し、所定の信託報酬率を乗じて得た金額とし、計算期間を通じて、毎日計上します。

の信託報酬（消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬率およびその配分については以下の通りとします。

	信託報酬率	委託会社 ^{*1} (税抜)	販売会社 ^{*2} (税抜)	受託会社 ^{*3} (税抜)
東京海上セレクション ・バランス30	年率1.026% (税抜0.95%)	年率0.43%	年率0.44%	年率0.08%
東京海上セレクション ・バランス50	年率1.2312% (税抜1.14%)	年率0.52%	年率0.54%	年率0.08%
東京海上セレクション ・バランス70	年率1.4148% (税抜1.31%)	年率0.6%	年率0.63%	年率0.08%

*1 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価

*2 購入後の情報提供、運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価

*3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用であり、毎日、純資産総額に対し、年率0.0054%（税抜0.005%）を乗じて

得た金額(ただし、年48.6万円(税抜45万円)の1日分相当額を上限とします。)を計上し、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

信託財産に関する租税および信託事務等に要する諸費用(消費税等相当額を含みます。)ならびに受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、先物・オプション取引に要する費用、外国における資産の保管等に要する費用等(全て消費税等相当額を含みます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産の一部解約に伴う支払資金の手当て、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行った場合、借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

監査費用を除くその他の手数料等については実際の取引等により変動するため、事前に料率、上限額等を表示することができません。

上記(1)から(4)の手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、あらかじめ表示することができません。

(5)【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取扱われますが、受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、収益分配金および解約時・償還時の各受益者の個別元本(1)超過額に対する所得税および地方税はかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記によらない受益者(法人)に対する課税については、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、変更になることがあります。

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」

(1)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)(2)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。

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。

(1)「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。

(2)「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。

* 上記は、2019年1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】

以下は2019年1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】

東京海上セレクション・バランス30

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	9,352,043,980	97.17
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		272,313,634	2.82
合計（純資産総額）		9,624,357,614	100.00

東京海上セレクション・バランス50

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	20,829,129,655	97.22
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		594,472,394	2.77
合計（純資産総額）		21,423,602,049	100.00

東京海上セレクション・バランス70

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	13,375,690,489	97.27
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		374,319,430	2.72
合計（純資産総額）		13,750,009,919	100.00

（ご参考：親投資信託の投資状況）

東京海上セレクション・バランス30、東京海上セレクション・バランス50、東京海上セレクション・バランス70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	41,837,179,120	98.91
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		457,077,099	1.08
合計（純資産総額）		42,294,256,219	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	74,864,961,016	57.63
地方債証券	日本	2,468,890,898	1.90
特殊債券	日本	2,703,809,000	2.08
社債券	日本	48,925,352,466	37.66
	アメリカ	400,222,000	0.30
	小計	49,325,574,466	37.97
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		542,890,908	0.41
合計（純資産総額）		129,906,126,288	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	20,394,290,099	70.63
	カナダ	538,427,100	1.86
	ドイツ	450,148,529	1.55
	イタリア	65,503,510	0.22
	フランス	139,841,108	0.48
	オーストラリア	297,739,778	1.03
	イギリス	1,820,340,155	6.30
	スイス	816,742,964	2.82
	オランダ	171,264,520	0.59
	スペイン	378,742,696	1.31
	スウェーデン	563,082,606	1.95
	ノルウェー	138,309,885	0.47
	デンマーク	537,623,080	1.86
	アイルランド	370,495,900	1.28
	中華人民共和国	555,696,535	1.92
	ケイマン	396,753,960	1.37
	キュラソー	49,032,000	0.16
	小計	27,684,034,425	95.87
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		1,189,920,973	4.12
合計(純資産総額)		28,873,955,398	100.00

TMA外国債券マザーファンド

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	8,237,826,283	42.98
	カナダ	424,863,718	2.21
	ドイツ	1,331,783,466	6.94
	イタリア	2,095,840,742	10.93
	フランス	1,742,943,398	9.09
	オーストラリア	537,471,186	2.80
	イギリス	1,784,565,050	9.31
	シンガポール	16,942,078	0.08
	オランダ	478,576,103	2.49
	スペイン	1,153,593,901	6.01
	ベルギー	467,819,460	2.44
	スウェーデン	64,810,440	0.33
	オーストリア	323,072,221	1.68
	メキシコ	141,494,064	0.73
	ポーランド	70,406,571	0.36
	小計	18,872,008,681	98.47
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		292,932,579	1.52
合計(純資産総額)		19,164,941,260	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a. 主要銘柄の明細

東京海上セレクション・バランス30

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	TMA日本債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,182,318,345	1.3828	4,400,537,448	1.4013	4,459,382,696	46.33
2	TMA日本株アクティブマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,430,227,663	1.5338	2,193,722,234	1.3994	2,001,460,591	20.79
3	TMA外国債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	872,376,208	2.1397	1,866,631,266	2.1556	1,880,494,153	19.53
4	TMA外国株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	416,082,722	2.5350	1,054,786,221	2.4291	1,010,706,540	10.50

東京海上セレクション・バランス50

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	TMA日本株アクティブマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	5,511,388,754	1.5412	8,494,350,666	1.3994	7,712,637,422	36.00
2	TMA日本債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,024,051,783	1.3826	5,563,683,697	1.4013	5,638,903,763	26.32
3	TMA外国債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,920,195,598	2.1401	4,109,424,875	2.1556	4,139,173,631	19.32
4	TMA外国株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,374,342,283	2.5426	3,494,466,411	2.4291	3,338,414,839	15.58

東京海上セレクション・バランス70

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	TMA日本株アクティブマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,997,150,182	1.5475	7,733,223,662	1.3994	6,993,011,964	50.85
2	TMA外国株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,163,072,334	2.5497	2,965,529,596	2.4291	2,825,219,006	20.54
3	TMA外国債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,035,627,217	2.1406	2,216,871,858	2.1556	2,232,398,028	16.23
4	TMA日本債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	945,594,442	1.3826	1,307,386,559	1.4013	1,325,061,491	9.63

b. 投資有価証券の種類

東京海上セレクション・バランス30

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.17
合計	97.17

東京海上セレクション・バランス50

種類	投資比率 (%)
----	----------

親投資信託受益証券	97.22
合 計	97.22

東京海上セレクション・バランス70

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.27
合 計	97.27

【投資不動産物件】

東京海上セレクション・バランス30

該当事項はありません。

東京海上セレクション・バランス50

該当事項はありません。

東京海上セレクション・バランス70

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

東京海上セレクション・バランス30

該当事項はありません。

東京海上セレクション・バランス50

該当事項はありません。

東京海上セレクション・バランス70

該当事項はありません。

(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

TMA日本株アクティブマザーファンド

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	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	198,400	8,537.28	1,693,797,086	8,526.00	1,691,558,400	3.99
2	ソニー	日本	電気機器	株式	304,900	5,200.52	1,585,640,700	5,467.00	1,666,888,300	3.94
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	2,425,800	704.79	1,709,691,786	583.60	1,415,696,880	3.34
4	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	295,800	4,596.71	1,359,708,554	4,389.00	1,298,266,200	3.06
5	信越化学工業	日本	化学	株式	141,300	10,073.11	1,423,331,076	9,176.00	1,296,568,800	3.06
6	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	株式	192,100	7,396.45	1,420,859,410	6,675.00	1,282,267,500	3.03
7	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	305,100	4,526.56	1,381,056,009	4,045.00	1,234,129,500	2.91
8	東京エレクトロン	日本	電気機器	株式	66,900	20,479.73	1,370,093,949	15,635.00	1,045,981,500	2.47
9	スズキ	日本	輸送用機器	株式	179,000	5,838.81	1,045,148,749	5,674.00	1,015,646,000	2.40
10	三菱商事	日本	卸売業	株式	284,300	3,138.21	892,195,725	3,181.00	904,358,300	2.13
11	バンダイナムコホールディングス	日本	その他製品	株式	184,700	3,644.01	673,049,532	4,795.00	885,636,500	2.09

12	第一生命ホールディングス	日本	保険業	株式	472,300	2,030.43	958,975,331	1,759.50	831,011,850	1.96
13	HOYA	日本	精密機器	株式	126,700	6,489.63	822,236,645	6,298.00	797,956,600	1.88
14	デンソー	日本	輸送用機器	株式	154,200	5,866.91	904,678,614	4,988.00	769,149,600	1.81
15	アドバンテスト	日本	電気機器	株式	309,600	2,350.36	727,672,658	2,473.00	765,640,800	1.81
16	S M C	日本	機械	株式	20,600	39,637.02	816,522,716	35,730.00	736,038,000	1.74
17	リログループ	日本	サービス業	株式	255,400	2,853.14	728,693,008	2,862.00	730,954,800	1.72
18	村田製作所	日本	電気機器	株式	46,000	19,094.28	878,337,057	15,420.00	709,320,000	1.67
19	アサヒグループホールディングス	日本	食料品	株式	143,700	5,257.65	755,525,400	4,545.00	653,116,500	1.54
20	オリックス	日本	その他金融業	株式	390,500	1,870.39	730,391,015	1,640.00	640,420,000	1.51
21	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	193,600	3,621.05	701,035,361	3,249.00	629,006,400	1.48
22	GMOペイメントゲートウェイ	日本	情報・通信業	株式	111,900	5,210.81	583,090,227	5,620.00	628,878,000	1.48
23	キーエンス	日本	電気機器	株式	11,100	64,039.36	710,836,913	55,860.00	620,046,000	1.46
24	第一三共	日本	医薬品	株式	163,100	4,183.20	682,280,587	3,767.00	614,397,700	1.45
25	日本電産	日本	電気機器	株式	46,900	16,336.36	766,175,373	13,030.00	611,107,000	1.44
26	J C R ファーマ	日本	医薬品	株式	106,800	5,151.49	550,180,135	5,640.00	602,352,000	1.42
27	山九	日本	陸運業	株式	107,700	5,251.72	565,610,532	5,300.00	570,810,000	1.34
28	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	195,900	2,980.79	583,938,497	2,912.50	570,558,750	1.34
29	大和ハウス工業	日本	建設業	株式	155,600	3,920.73	610,066,509	3,527.00	548,801,200	1.29
30	いすゞ自動車	日本	輸送用機器	株式	338,500	1,629.06	551,437,983	1,616.00	547,016,000	1.29

T M A 日本債券マザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	額面	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166回利付国債(20年)	日本	国債証券	0.70	2038/09/20	6,890,000,000	102.69	7,075,704,400	104.88	7,226,783,200	5.56
2	第145回利付国債(20年)	日本	国債証券	1.70	2033/06/20	4,324,000,000	121.05	5,234,289,930	121.05	5,234,288,480	4.02
3	第394回利付国債(2年)	日本	国債証券	0.10	2020/11/01	4,700,000,000	100.47	4,722,093,300	100.48	4,722,654,000	3.63
4	第392回利付国債(2年)	日本	国債証券	0.10	2020/09/01	3,640,000,000	100.45	3,656,565,600	100.44	3,656,125,200	2.81
5	第150回利付国債(20年)	日本	国債証券	1.40	2034/09/20	2,770,000,000	116.64	3,230,979,750	117.30	3,249,237,700	2.50
6	第58回利付国債(30年)	日本	国債証券	0.80	2048/03/20	3,051,000,000	99.44	3,034,071,000	104.31	3,182,559,120	2.44
7	第44回利付国債(30年)	日本	国債証券	1.70	2044/09/20	2,290,000,000	122.39	2,802,731,000	126.83	2,904,452,800	2.23
8	第10回利付国債(40年)	日本	国債証券	0.90	2057/03/20	2,366,000,000	100.27	2,372,388,200	105.54	2,497,123,720	1.92
9	第344回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.10	2026/09/20	2,450,000,000	100.34	2,458,400,000	101.85	2,495,349,500	1.92
10	第134回利付国債(20年)	日本	国債証券	1.80	2032/03/20	1,872,000,000	121.78	2,279,731,200	121.40	2,272,608,000	1.74

11	第113回利付国債 (20年)	日本	国債証券	2.10	2029/09/20	1,675,000,000	122.87	2,058,072,500	121.94	2,042,495,000	1.57
12	第156回利付国債 (20年)	日本	国債証券	0.40	2036/03/20	1,990,000,000	99.41	1,978,259,000	101.05	2,010,934,800	1.54
13	第23回利付国債 (物価連動・10年)	日本	国債証券	0.10	2028/03/10	1,889,000,000	103.77	1,974,051,540	103.40	1,970,687,837	1.51
14	第126回利付国債 (20年)	日本	国債証券	2.00	2031/03/20	1,510,000,000	123.57	1,865,907,000	122.84	1,854,914,200	1.42
15	第336回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.50	2024/12/20	1,697,000,000	103.29	1,752,831,300	103.91	1,763,505,430	1.35
16	第38回利付国債 (30年)	日本	国債証券	1.80	2043/03/20	1,320,000,000	126.35	1,667,872,800	128.26	1,693,111,200	1.30
17	第154回利付国債 (20年)	日本	国債証券	1.20	2035/09/20	1,480,000,000	113.83	1,684,820,530	114.34	1,692,350,400	1.30
18	第22回利付国債 (物価連動・10年)	日本	国債証券	0.10	2027/03/10	1,593,000,000	106.05	1,702,975,980	103.55	1,679,309,409	1.29
19	第127回利付国債 (20年)	日本	国債証券	1.90	2031/03/20	1,320,000,000	122.30	1,614,360,000	121.64	1,605,687,600	1.23
20	第57回利付国債 (30年)	日本	国債証券	0.80	2047/12/20	1,306,000,000	101.33	1,323,448,100	104.40	1,363,581,540	1.04
21	第40回利付国債 (30年)	日本	国債証券	1.80	2043/09/20	971,000,000	126.53	1,228,606,300	128.65	1,249,210,920	0.96
22	第389回利付国債 (2年)	日本	国債証券	0.10	2020/06/01	1,214,000,000	100.39	1,218,734,600	100.37	1,218,601,060	0.93
23	第141回利付国債 (20年)	日本	国債証券	1.70	2032/12/20	1,004,000,000	120.64	1,211,225,600	120.75	1,212,330,000	0.93
24	第104回利付国債 (20年)	日本	国債証券	2.10	2028/06/20	930,000,000	121.01	1,125,393,000	120.09	1,116,874,200	0.85
25	第133回利付国債 (20年)	日本	国債証券	1.80	2031/12/20	910,000,000	121.15	1,102,483,200	121.15	1,102,537,800	0.84
26	第351回利付国債 (10年)	日本	国債証券	0.10	2028/06/20	1,036,000,000	99.78	1,033,720,800	101.31	1,049,654,480	0.80
27	第11回利付国債 (40年)	日本	国債証券	0.80	2058/03/20	1,029,000,000	97.82	1,006,617,900	101.97	1,049,322,750	0.80
28	第33回利付国債 (30年)	日本	国債証券	2.00	2040/09/20	794,000,000	127.67	1,013,699,800	130.81	1,038,663,160	0.79
29	第164回利付国債 (20年)	日本	国債証券	0.50	2038/03/20	880,000,000	99.17	872,757,600	101.50	893,252,800	0.68
30	第12回YKK株式会社無担保社債	日本	社債券	0.08	2023/06/16	800,000,000	100.00	800,000,000	100.18	801,496,000	0.61

TMA外国株式マザーファンド

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	AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	株式	7,000	168,868.40	1,182,078,812	182,010.05	1,274,070,369	4.41
2	MASTERCARD INC-CLASS A	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	48,100	19,798.94	952,329,313	22,230.01	1,069,263,923	3.70

3	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	ヘルスケア機器・サービス	株式	34,600	24,596.42	851,036,166	29,459.51	1,019,299,225	3.53
4	MSCI INC	アメリカ	各種金融	株式	48,200	16,919.18	815,504,705	17,735.41	854,847,205	2.96
5	FACEBOOK INC-A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	46,100	18,698.83	862,016,348	16,389.76	755,568,083	2.61
6	ADOBE INC	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	27,600	28,896.99	797,556,952	26,441.32	729,780,520	2.52
7	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	43,500	16,701.36	726,509,279	16,252.47	706,982,601	2.44
8	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	アメリカ	家庭用品・パーソナル用品	株式	46,500	15,832.43	736,208,408	14,642.04	680,855,083	2.35
9	LOCKHEED MARTIN CORP	アメリカ	資本財	株式	21,400	35,378.77	757,105,863	31,780.36	680,099,772	2.35
10	VERISK ANALYTICS INC	アメリカ	商業・専門サービス	株式	52,700	11,371.71	599,289,303	12,802.80	674,707,560	2.33
11	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	アメリカ	資本財	株式	43,200	15,684.63	677,576,302	15,611.78	674,429,276	2.33
12	CELGENE CORP	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	67,600	9,608.40	649,527,972	9,595.01	648,623,189	2.24
13	THE WALT DISNEY CO	アメリカ	メディア・娯楽	株式	52,700	11,515.87	606,886,542	11,999.76	632,387,604	2.19
14	HDFC Bank Ltd	アメリカ	銀行	株式	58,300	10,655.32	621,205,462	10,431.83	608,175,712	2.10
15	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	アメリカ	食品・飲料・タバコ	株式	125,700	4,614.91	580,094,244	4,773.53	600,033,676	2.07
16	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	4,800	119,538.77	573,786,113	119,636.99	574,257,553	1.98
17	BRIGHT HORIZONS FAMILY SOLUTIONS INC	アメリカ	消費者サービス	株式	46,106	11,020.21	508,098,005	12,430.15	573,104,809	1.98
18	FIRST REPUBLIC BANK/CA	アメリカ	銀行	株式	53,900	10,526.77	567,393,397	10,574.56	569,969,215	1.97
19	ASSA ABLOY AB-B	スウェーデン	資本財	株式	278,000	2,168.58	602,865,886	2,025.47	563,082,606	1.95
20	Ping An Insurance Group Co	中華人民共和国	保険	株式	541,000	1,198.91	648,611,302	1,027.16	555,696,535	1.92
21	ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	スイス	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	18,800	24,167.58	454,350,527	28,234.20	530,803,072	1.83
22	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	22,800	22,240.63	507,086,507	22,076.38	503,341,591	1.74
23	STARBUCKS CORP	アメリカ	消費者サービス	株式	67,500	6,303.33	425,475,180	7,425.62	501,229,620	1.73
24	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	株式	4,100	119,666.40	490,632,279	118,663.97	486,522,308	1.68
25	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	イギリス	家庭用品・パーソナル用品	株式	57,400	8,139.83	467,226,415	8,379.91	481,006,948	1.66

26	TJX COMPANIES INC	アメリカ	小売	株式	84,200	4,593.47	386,770,351	5,328.14	448,629,724	1.55
27	CONSTELLATION BRANDS INC-A	アメリカ	食品・飲料・タバコ	株式	23,400	24,650.54	576,822,843	18,589.66	434,998,175	1.50
28	DOLLARAMA INC	カナダ	小売	株式	135,600	3,577.36	485,090,738	2,932.29	397,619,120	1.37
29	Sands China Ltd	ケイマン	消費者サービス	株式	772,000	572.69	442,118,369	513.93	396,753,960	1.37
30	ASTRAZENECA PLC	イギリス	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	44,800	8,249.29	369,568,265	7,806.96	349,751,951	1.21

TMA外国債券マザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	額面	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
							単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	T 1 7/8 02/28/22	アメリカ	国債証券	1.875	2022/02/28	5,400,000	10,535.61	568,923,150	10,694.25	577,489,701	3.01
2	T 2 1/8 09/30/21	アメリカ	国債証券	2.125	2021/09/30	5,300,000	10,709.67	567,612,955	10,786.18	571,668,006	2.98
3	T 4 1/4 11/15/40	アメリカ	国債証券	4.250	2040/11/15	3,800,000	13,054.58	496,074,416	13,133.08	499,057,230	2.60
4	T 1 7/8 01/31/22	アメリカ	国債証券	1.875	2022/01/31	4,100,000	10,566.26	433,216,686	10,696.80	438,569,105	2.28
5	T 2 5/8 07/31/20	アメリカ	国債証券	2.625	2020/07/31	4,000,000	10,899.83	435,993,225	10,905.36	436,214,552	2.27
6	T 1 3/4 09/30/22	アメリカ	国債証券	1.750	2022/09/30	3,700,000	10,461.40	387,071,889	10,612.53	392,663,749	2.04
7	T 2 1/4 08/15/27	アメリカ	国債証券	2.250	2027/08/15	3,700,000	10,362.93	383,428,674	10,552.94	390,459,010	2.03
8	T 2 3/4 08/15/42	アメリカ	国債証券	2.750	2042/08/15	3,700,000	10,244.30	379,039,441	10,394.61	384,600,707	2.00
9	T 3 3/4 11/15/43	アメリカ	国債証券	3.750	2043/11/15	2,900,000	12,297.22	356,619,542	12,253.74	355,358,570	1.85
10	T 1 3/4 01/31/23	アメリカ	国債証券	1.750	2023/01/31	2,900,000	10,467.87	303,568,519	10,585.29	306,973,519	1.60
11	T 2 5/8 07/15/21	アメリカ	国債証券	2.625	2021/07/15	2,700,000	10,809.31	291,851,487	10,923.24	294,927,480	1.53
12	T 4 3/4 02/15/41	アメリカ	国債証券	4.750	2041/02/15	2,100,000	14,190.95	298,009,958	14,025.19	294,529,095	1.53
13	FRTR 1 05/25/27	フランス	国債証券	1.000	2027/05/25	2,000,000	12,914.88	258,297,710	13,133.24	262,664,820	1.37
14	T 2 1/8 08/15/21	アメリカ	国債証券	2.125	2021/08/15	2,300,000	10,737.83	246,970,184	10,786.18	248,082,342	1.29
15	BTPS 3 3/4 05/01/21	イタリア	国債証券	3.750	2021/05/01	1,800,000	13,337.23	240,070,239	13,407.31	241,331,751	1.25
16	T 2 3/4 02/15/28	アメリカ	国債証券	2.750	2028/02/15	2,200,000	10,703.61	235,479,432	10,956.43	241,041,647	1.25
17	T 1 3/8 04/30/20	アメリカ	国債証券	1.375	2020/04/30	2,200,000	10,723.19	235,910,318	10,732.56	236,116,320	1.23
18	T 3 5/8 02/15/44	アメリカ	国債証券	3.625	2044/02/15	1,900,000	11,904.78	226,190,882	12,022.20	228,421,869	1.19

19	DBR 0 1/4 08/15/28	ドイツ	国債証券	0.250	2028/08/15	1,800,000	12,299.18	221,385,344	12,649.91	227,698,410	1.18
20	T 1 7/8 08/31/22	アメリカ	国債証券	1.875	2022/08/31	2,100,000	10,510.24	220,715,080	10,663.60	223,935,784	1.16
21	T 2 08/15/25	アメリカ	国債証券	2.000	2025/08/15	2,100,000	10,323.96	216,803,160	10,514.64	220,807,440	1.15
22	BTPS 5 1/2 11/01/22	イタリア	国債証券	5.500	2022/11/01	1,400,000	14,438.91	202,144,783	14,466.08	202,525,239	1.05
23	T 1 5/8 08/15/22	アメリカ	国債証券	1.625	2022/08/15	1,900,000	10,455.80	198,660,230	10,571.67	200,861,802	1.04
24	BTPS 6 05/01/31	イタリア	国債証券	6.000	2031/05/01	1,200,000	16,042.20	192,506,480	16,567.35	198,808,284	1.03
25	UKT 4.25 06/07/32	イギリス	国債証券	4.250	2032/06/07	1,000,000	18,940.12	189,401,299	19,124.48	191,244,880	0.99
26	SPGB 3.8 04/30/24	スペイン	国債証券	3.800	2024/04/30	1,300,000	14,860.65	193,188,548	14,708.25	191,207,298	0.99
27	FRTR 5 1/2 04/25/29	フランス	国債証券	5.500	2029/04/25	1,000,000	18,702.27	187,022,783	18,621.06	186,210,685	0.97
28	T 2 3/8 08/15/24	アメリカ	国債証券	2.375	2024/08/15	1,700,000	10,621.02	180,557,463	10,800.66	183,611,220	0.95
29	UKT 4.5 09/07/34	イギリス	国債証券	4.500	2034/09/07	900,000	19,925.53	179,329,831	20,117.50	181,057,536	0.94
30	UKT 4 1/4 03/07/36	イギリス	国債証券	4.250	2036/03/07	900,000	19,809.70	178,287,378	19,936.04	179,424,417	0.93

b. 投資有価証券の種類

T M A日本株アクティブマザーファンド

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.47
		建設業	2.81
		食料品	2.86
		化学	7.10
		医薬品	7.95
		石油・石炭製品	0.47
		鉄鋼	0.48
		非鉄金属	0.75
		機械	3.81
		電気機器	16.90
		輸送用機器	11.35
		精密機器	2.52
		その他製品	4.46
		陸運業	4.31
		空運業	0.78
		情報・通信業	8.94
		卸売業	2.68
		小売業	2.62
		銀行業	6.26
証券、商品先物取引業	0.67		

	保険業	1.96
	その他金融業	1.51
	不動産業	0.86
	サービス業	6.27
合 計		98.91

TMA日本債券マザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	57.63
地方債証券	1.90
特殊債券	2.08
社債券	37.97
合 計	99.58

TMA外国株式マザーファンド

種類	国内 / 国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	5.27
		素材	3.07
		資本財	7.36
		商業・専門サービス	2.83
		運輸	1.09
		耐久消費財・アパレル	1.11
		消費者サービス	5.09
		メディア・娯楽	8.48
		小売	8.09
		食品・飲料・タバコ	4.12
		家庭用品・パーソナル用品	4.02
		ヘルスケア機器・サービス	5.21
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.97
		銀行	5.52
		各種金融	4.60
		保険	3.21
		ソフトウェア・サービス	11.13
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.83
		電気通信サービス	0.40
公益事業	2.18		
半導体・半導体製造装置	1.19		
合 計			95.87

TMA外国債券マザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	98.47

合 計	98.47
-----	-------

投資不動産物件

TMA日本株アクティブマザーファンド
該当事項はありません。

TMA日本債券マザーファンド
該当事項はありません。

TMA外国株式マザーファンド
該当事項はありません。

TMA外国債券マザーファンド
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

TMA日本株アクティブマザーファンド
該当事項はありません。

TMA日本債券マザーファンド
該当事項はありません。

TMA外国株式マザーファンド
該当事項はありません。

TMA外国債券マザーファンド
該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

東京海上セレクション・バランス30

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 6月22日)	2,910	2,910	1.1068	1.1068
第9計算期間末	(2010年 6月21日)	3,331	3,331	1.1349	1.1349
第10計算期間末	(2011年 6月20日)	3,797	3,797	1.1254	1.1254
第11計算期間末	(2012年 6月20日)	4,118	4,118	1.1154	1.1154
第12計算期間末	(2013年 6月20日)	5,191	5,191	1.3252	1.3252
第13計算期間末	(2014年 6月20日)	6,037	6,037	1.4549	1.4549
第14計算期間末	(2015年 6月22日)	7,261	7,261	1.6397	1.6397
第15計算期間末	(2016年 6月20日)	7,375	7,375	1.5556	1.5556
第16計算期間末	(2017年 6月20日)	8,345	8,345	1.6445	1.6445
第17計算期間末	(2018年 6月20日)	9,395	9,395	1.7132	1.7132
	2018年 1月末日	9,223	-	1.7284	-
	2月末日	9,111	-	1.7044	-
	3月末日	9,191	-	1.6988	-
	4月末日	9,296	-	1.7124	-
	5月末日	9,351	-	1.7049	-
	6月末日	9,393	-	1.7071	-
	7月末日	9,510	-	1.7164	-
	8月末日	9,591	-	1.7142	-

9月末日	9,757	-	1.7382	-
10月末日	9,478	-	1.6721	-
11月末日	9,631	-	1.6899	-
12月末日	9,363	-	1.6352	-
2019年 1月末日	9,624	-	1.6657	-

東京海上セレクション・バランス50

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 6月22日)	6,555	6,555	1.0651	1.0651
第9計算期間末	(2010年 6月21日)	7,732	7,732	1.0963	1.0963
第10計算期間末	(2011年 6月20日)	8,535	8,535	1.0732	1.0732
第11計算期間末	(2012年 6月20日)	8,975	8,975	1.0400	1.0400
第12計算期間末	(2013年 6月20日)	11,959	11,959	1.3372	1.3372
第13計算期間末	(2014年 6月20日)	14,176	14,176	1.5185	1.5185
第14計算期間末	(2015年 6月22日)	17,460	17,460	1.8073	1.8073
第15計算期間末	(2016年 6月20日)	16,691	16,691	1.6257	1.6257
第16計算期間末	(2017年 6月20日)	19,299	19,299	1.8001	1.8001
第17計算期間末	(2018年 6月20日)	21,692	21,692	1.9278	1.9278
2018年 1月末日		21,422	-	1.9578	-
2月末日		21,047	-	1.9158	-
3月末日		21,067	-	1.9026	-
4月末日		21,451	-	1.9256	-
5月末日		21,587	-	1.9163	-
6月末日		21,605	-	1.9154	-
7月末日		21,892	-	1.9333	-
8月末日		22,075	-	1.9347	-
9月末日		22,642	-	1.9799	-
10月末日		21,406	-	1.8582	-
11月末日		21,789	-	1.8856	-
12月末日		20,631	-	1.7782	-
2019年 1月末日		21,423	-	1.8320	-

東京海上セレクション・バランス70

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 6月22日)	3,415	3,415	1.0054	1.0054
第9計算期間末	(2010年 6月21日)	4,177	4,177	1.0404	1.0404
第10計算期間末	(2011年 6月20日)	4,624	4,624	1.0061	1.0061
第11計算期間末	(2012年 6月20日)	4,889	4,889	0.9520	0.9520
第12計算期間末	(2013年 6月20日)	7,035	7,035	1.3139	1.3139
第13計算期間末	(2014年 6月20日)	8,566	8,566	1.5385	1.5385
第14計算期間末	(2015年 6月22日)	11,178	11,178	1.9268	1.9268

第15計算期間末	(2016年 6月20日)	10,016	10,016	1.6496	1.6496
第16計算期間末	(2017年 6月20日)	11,981	11,981	1.9093	1.9093
第17計算期間末	(2018年 6月20日)	14,209	14,209	2.1022	2.1022
2018年 1月末日		14,110	-	2.1473	-
2月末日		13,793	-	2.0872	-
3月末日		13,743	-	2.0647	-
4月末日		14,026	-	2.0972	-
5月末日		14,120	-	2.0879	-
6月末日		14,136	-	2.0822	-
7月末日		14,357	-	2.1093	-
8月末日		14,526	-	2.1147	-
9月末日		14,991	-	2.1829	-
10月末日		13,814	-	1.9988	-
11月末日		14,161	-	2.0366	-
12月末日		13,038	-	1.8712	-
2019年 1月末日		13,750	-	1.9504	-

【分配の推移】

東京海上セレクション・バランス30
該当事項はありません。

東京海上セレクション・バランス50
該当事項はありません。

東京海上セレクション・バランス70
該当事項はありません。

【収益率の推移】

東京海上セレクション・バランス30

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第8計算期間	2008年 6月21日～2009年 6月22日	13.3
第9計算期間	2009年 6月23日～2010年 6月21日	2.5
第10計算期間	2010年 6月22日～2011年 6月20日	0.8
第11計算期間	2011年 6月21日～2012年 6月20日	0.9
第12計算期間	2012年 6月21日～2013年 6月20日	18.8
第13計算期間	2013年 6月21日～2014年 6月20日	9.8
第14計算期間	2014年 6月21日～2015年 6月22日	12.7
第15計算期間	2015年 6月23日～2016年 6月20日	5.1
第16計算期間	2016年 6月21日～2017年 6月20日	5.7
第17計算期間	2017年 6月21日～2018年 6月20日	4.2
第18中間計算期間	2018年 6月21日～2018年12月20日	3.9

東京海上セレクション・バランス50

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第8計算期間	2008年 6月21日～2009年 6月22日	22.4
第9計算期間	2009年 6月23日～2010年 6月21日	2.9
第10計算期間	2010年 6月22日～2011年 6月20日	2.1

第11計算期間	2011年 6月21日～2012年 6月20日	3.1
第12計算期間	2012年 6月21日～2013年 6月20日	28.6
第13計算期間	2013年 6月21日～2014年 6月20日	13.6
第14計算期間	2014年 6月21日～2015年 6月22日	19.0
第15計算期間	2015年 6月23日～2016年 6月20日	10.0
第16計算期間	2016年 6月21日～2017年 6月20日	10.7
第17計算期間	2017年 6月21日～2018年 6月20日	7.1
第18中間計算期間	2018年 6月21日～2018年12月20日	6.7

東京海上セレクション・バランス70

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第8計算期間	2008年 6月21日～2009年 6月22日	30.6
第9計算期間	2009年 6月23日～2010年 6月21日	3.5
第10計算期間	2010年 6月22日～2011年 6月20日	3.3
第11計算期間	2011年 6月21日～2012年 6月20日	5.4
第12計算期間	2012年 6月21日～2013年 6月20日	38.0
第13計算期間	2013年 6月21日～2014年 6月20日	17.1
第14計算期間	2014年 6月21日～2015年 6月22日	25.2
第15計算期間	2015年 6月23日～2016年 6月20日	14.4
第16計算期間	2016年 6月21日～2017年 6月20日	15.7
第17計算期間	2017年 6月21日～2018年 6月20日	10.1
第18中間計算期間	2018年 6月21日～2018年12月20日	9.6

(4)【設定及び解約の実績】

東京海上セレクション・バランス30

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 6月21日～2009年 6月22日	551,655,185	227,832,027	2,629,506,749
第9計算期間	2009年 6月23日～2010年 6月21日	563,906,153	257,764,973	2,935,647,929
第10計算期間	2010年 6月22日～2011年 6月20日	667,288,167	228,039,884	3,374,896,212
第11計算期間	2011年 6月21日～2012年 6月20日	583,030,145	265,822,012	3,692,104,345
第12計算期間	2012年 6月21日～2013年 6月20日	604,372,681	378,774,386	3,917,702,640
第13計算期間	2013年 6月21日～2014年 6月20日	644,852,346	413,005,179	4,149,549,807
第14計算期間	2014年 6月21日～2015年 6月22日	752,812,130	473,743,068	4,428,618,869
第15計算期間	2015年 6月23日～2016年 6月20日	737,353,659	424,952,766	4,741,019,762
第16計算期間	2016年 6月21日～2017年 6月20日	851,848,846	517,917,376	5,074,951,232
第17計算期間	2017年 6月21日～2018年 6月20日	995,848,750	586,312,750	5,484,487,232
第18中間計算期間	2018年 6月21日～2018年12月20日	454,625,598	223,695,271	5,715,417,559

東京海上セレクション・バランス50

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 6月21日～2009年 6月22日	1,386,530,322	467,263,886	6,155,091,020
第9計算期間	2009年 6月23日～2010年 6月21日	1,365,076,327	467,132,881	7,053,034,466
第10計算期間	2010年 6月22日～2011年 6月20日	1,387,325,330	487,515,196	7,952,844,600

第11計算期間	2011年 6月21日～2012年 6月20日	1,308,937,185	631,494,804	8,630,286,981
第12計算期間	2012年 6月21日～2013年 6月20日	1,260,629,889	947,669,124	8,943,247,746
第13計算期間	2013年 6月21日～2014年 6月20日	1,252,810,473	860,582,156	9,335,476,063
第14計算期間	2014年 6月21日～2015年 6月22日	1,402,715,708	1,077,220,104	9,660,971,667
第15計算期間	2015年 6月23日～2016年 6月20日	1,414,327,085	807,809,379	10,267,489,373
第16計算期間	2016年 6月21日～2017年 6月20日	1,395,263,568	941,550,860	10,721,202,081
第17計算期間	2017年 6月21日～2018年 6月20日	1,537,635,326	1,006,494,751	11,252,342,656
第18中間計算期間	2018年 6月21日～2018年12月20日	785,140,660	446,490,737	11,590,992,579

東京海上セレクション・バランス70

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 6月21日～2009年 6月22日	992,136,500	295,154,466	3,397,470,997
第9計算期間	2009年 6月23日～2010年 6月21日	924,474,821	306,393,299	4,015,552,519
第10計算期間	2010年 6月22日～2011年 6月20日	901,448,460	320,899,631	4,596,101,348
第11計算期間	2011年 6月21日～2012年 6月20日	896,741,555	356,890,286	5,135,952,617
第12計算期間	2012年 6月21日～2013年 6月20日	967,319,674	748,554,630	5,354,717,661
第13計算期間	2013年 6月21日～2014年 6月20日	865,491,902	652,205,383	5,568,004,180
第14計算期間	2014年 6月21日～2015年 6月22日	1,062,555,794	828,850,382	5,801,709,592
第15計算期間	2015年 6月23日～2016年 6月20日	977,656,753	707,580,926	6,071,785,419
第16計算期間	2016年 6月21日～2017年 6月20日	977,047,955	773,282,465	6,275,550,909
第17計算期間	2017年 6月21日～2018年 6月20日	1,236,700,333	752,662,728	6,759,588,514
第18中間計算期間	2018年 6月21日～2018年12月20日	593,801,666	379,228,191	6,974,161,989

< 参考情報 >

(2019年 1月31日現在)

東京海上セレクション・バランス30

基準価額・純資産総額の推移



※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。

※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

※基準価額は1万口当たりで表示しています。

※設定日は2001年9月25日です。

騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1か月	3か月	6か月	1年	3年	設定来
ファンド	+1.87	-0.38	-2.95	-3.63	+4.73	+66.57

※ファンドの騰落率は、税引前分配金を再投資したものと計算しているため、実際の投資家利回りとは異なります。

基準価額・純資産総額

基準価額	16,657円
純資産総額	9,624百万円

分配の推移(1万口当たり、税引前)

第13期	2014年6月20日	0円
第14期	2015年6月22日	0円
第15期	2016年6月20日	0円
第16期	2017年6月20日	0円
第17期	2018年6月20日	0円
設定来累計		分配実績なし

※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(%)

ファンド名	比率	基本資産 配分	差
TMA日本株アクティブマザーファンド	20.8	20.0	+0.8
TMA日本債券マザーファンド	46.3	47.0	-0.7
TMA外国株式マザーファンド	10.5	10.0	+0.5
TMA外国債券マザーファンド	19.5	20.0	-0.5
短期金融資産等	2.8	3.0	-0.2

※組入比率は純資産総額に占める割合です。

東京海上セレクション・バランス50

基準価額・純資産総額の推移



※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。

※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

※基準価額は1万口当たりで表示しています。

※設定日は2001年9月25日です。

騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1か月	3か月	6か月	1年	3年	設定来
ファンド	+3.03	-1.41	-5.24	-6.43	+7.85	+83.20

※ファンドの騰落率は、税引前分配金を再投資したものと計算しているため、実際の投資家利回りとは異なります。

基準価額・純資産総額

基準価額	18,320円
純資産総額	21,424百万円

分配の推移(1万口当たり、税引前)

第13期	2014年6月20日	0円
第14期	2015年6月22日	0円
第15期	2016年6月20日	0円
第16期	2017年6月20日	0円
第17期	2018年6月20日	0円
設定来累計		分配実績なし

※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(%)

ファンド名	比率	基本資産 配分	差
TMA日本株アクティブマザーファンド	36.0	35.0	+1.0
TMA日本債券マザーファンド	26.3	27.0	-0.7
TMA外国株式マザーファンド	15.6	15.0	+0.6
TMA外国債券マザーファンド	19.3	20.0	-0.7
短期金融資産等	2.8	3.0	-0.2

※組入比率は純資産総額に占める割合です。

東京海上セレクション・バランス70

基準価額・純資産総額の推移



※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。

※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

※基準価額は1万口当たりで表示しています。

※設定日は2001年9月25日です。

騰落率（税引前分配金再投資、%）

	1か月	3か月	6か月	1年	3年	設定来
ファンド	+4.23	-2.42	-7.53	-9.17	+11.15	+95.04

※ファンドの騰落率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の投資家利回りとは異なります。

基準価額・純資産総額

基準価額	19,504円
純資産総額	13,750百万円

分配の推移（1万口当たり、税引前）

第13期	2014年6月20日	0円
第14期	2015年6月22日	0円
第15期	2016年6月20日	0円
第16期	2017年6月20日	0円
第17期	2018年6月20日	0円
設定来累計		分配実績なし

※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（%）

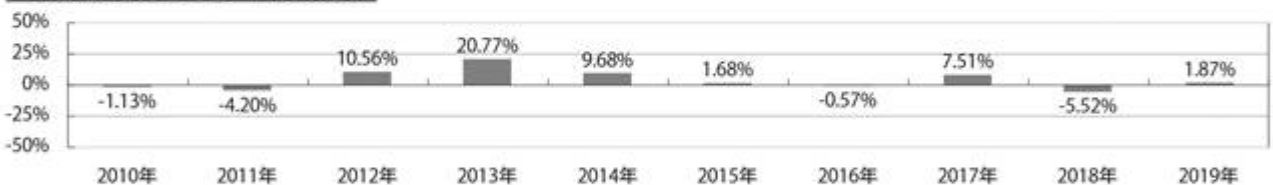
ファンド名	比率	基本資産配分	差
TMA日本株アクティブマザーファンド	50.9	50.0	+0.9
TMA日本債券マザーファンド	9.6	10.0	-0.4
TMA外国株式マザーファンド	20.5	20.0	+0.5
TMA外国債券マザーファンド	16.2	17.0	-0.8
短期金融資産等	2.7	3.0	-0.3

※組入比率は純資産総額に占める割合です。

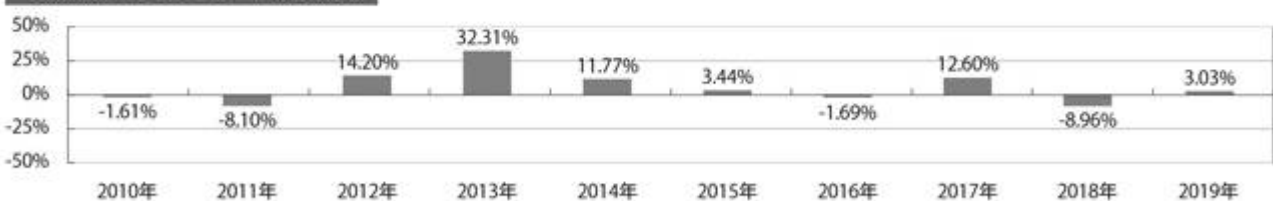
年間収益率の推移

※当ファンドにはベンチマークがありません。

東京海上セレクション・バランス30



東京海上セレクション・バランス50



東京海上セレクション・バランス70



※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しています。

※当年は昨年末と基準日の騰落率です。

※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。

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2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- 毎営業日にお申込みを受け付けます。
- 当ファンドは、収益の分配がなされた場合、分配金を自動的に無手数料で再投資する自動けいぞく（累積）投資専用ファンドです。このため、取得申込者と販売会社の間で、自動けいぞく（累積）投資に関する契約を締結する必要があります。

- c. 申込単位は1円以上1円単位です。
なお、自動けいぞく（累積）投資に基づく収益分配金の再投資に際しては、1口の整数倍をもって取得できます。
- d. 取得申込の受付は、原則として午後3時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みについては翌営業日受付の取扱いとなります。
- e. 受益権の取得申込価額は以下の通りです。
取得申込受付日の翌営業日の基準価額
基準価額は原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクに問い合わせることにより知ることができます。
委託会社のお問い合わせ先（委託会社サービスデスク）
東京海上アセットマネジメント サービスデスク
0120-712-016（土日祝日・年末年始を除く9時～17時）
- f. 取得申込にかかる手数料はありません。
- g. 上記にかかわらず、証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置を取った場合には、販売会社は、受益権の取得申込の受付を中止すること、および既に受け付けた取得申込の受付を取り消すことができます。
- h. 取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関等への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関等への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関等の定める方法により、振替機関等へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。
- i. 販売会社によっては、各ファンド間の乗換え（「スイッチング」といいます。）が可能な場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

- a. 受益者は、自己に帰属する受益権につき、一部解約の実行請求（解約請求）の方法によりご換金の請求を行うことができます。
- b. ご換金のお申込みは販売会社で受け付けます。なお、販売会社の買取りによるご換金の請求については、販売会社にお問い合わせください。
- c. 解約請求による換金のお申込みは、毎営業日に行うことができます。
- d. 解約請求は、1口単位で行うことができます。
- e. 解約請求のお申込みの受付は、原則として午後3時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みは翌営業日受付としてお取扱いします。
- f. 解約時の価額（解約価額）は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
信託財産留保額ははありません。
確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、収益分配金および解約時・償還時の個別元本超過額に対する所得税、地方税はかかりません。
その他の受益者（法人）の場合は、収益分配金および解約時・償還時の個別元本超過額について、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。
- g. 解約価額は、原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクに問い合わせることにより知ることができます。
- h. 解約にかかる手数料はありません。
- i. 解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から、お支払いします。
- j. 委託会社は、証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することができます。その場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日を解約請求受付日とする解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にその請求を受け付けたものとして取扱います。
- k. 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口解約には制限を設ける場合があります。ただし、確定拠出年金制度に基づく受益者である場合には制限はありません。
- l. 受益者が解約の請求をするときは、振替受益権をもって行うものとし、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請が行われ、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

- a. 基準価額とは、受益権1口当たりの純資産価額（純資産総額を計算日における受益権総口数で除した金額）をいいます。ただし、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示されることがあります。
- b. 純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、外国為替予約に基づく予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

< 主要投資対象資産の評価方法 >

対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	原則として、当ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。
株式	原則として、上場されている取引所における計算日（外国株式の場合は、計算時に知り得る直近の日）の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、以下のいずれかの価額で評価します。 a. 日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値） b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く） c. 価格情報会社の提供する価額

- c. 基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクに問い合わせることにより知ることができます。

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

原則として、2001年9月25日から無期限とします。ただし、後記「(5)その他 信託の終了（繰上償還）」に該当する場合には、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

原則として、毎年6月21日から翌年6月20日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日（ ）を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。

（ ）法令により、これと異なる日を計算期間の末日と定めている場合には、法令にしたがいます。

(5)【その他】

信託の終了（繰上償還）

- a. 委託会社は、信託契約の一部を解約することにより受益権の総口数が10億口を下ることとなったとき、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は、1ヵ月以上の一定の期間内に委託会社に対し異議を述べるべき旨を付記します。
- d. 上記c.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記a.の信託契約の解約をしません。
- e. 委託会社は、信託契約を解約しないこととしたときは、解約をしない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 上記c.からe.の規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記c.の一定の期間が1ヵ月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合は適用しません。
- g. 信託契約を解約する場合において、上記c.の一定の期間内に異議を申し出た受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

- h. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「信託約款の変更」d.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- j. 委託会社は、受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した後、あるいは裁判所が受託会社を解任した後、委託会社が新受託会社を選任できないときは、あらかじめ、監督官庁に届出のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、あらかじめ監督官庁に届出ることにより、信託約款を変更することができます。
- b. 変更事項のうち、その内容が重大なものとして内閣府令で定めるものに該当するときは、内閣府令で定めるところにより、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつこれらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は、1ヵ月以上の一定の期間内に委託会社に対し異議を述べるべき旨を付記します。
- d. 上記c.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記a.の約款変更を行いません。その場合には、委託会社は、内閣府令で定めるところにより、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- e. その内容が重大なものとして内閣府令で定めるものに該当する信託約款の変更を行う場合において、上記c.の一定の期間内に異議を申し出た受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記b.からd.の規定にしたがいます。

関係会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間の募集・販売等の取扱いに関する契約は、当事者の別段の意思表示がない限り、1年ごとに自動更新されます。募集・販売等の取扱いに関する契約は、当事者間の合意により変更することができます。

運用報告書

- a. 毎決算時および償還時に、委託会社が、期間中の運用経過のほか、信託財産の内容などを記載した交付運用報告書を作成します。交付運用報告書は、知っている受益者に対して、販売会社から、あらかじめお申し出いただいたご住所にお届けします。
- b. 委託会社は、運用報告書(全体版)を作成し、委託会社のホームページ(<https://www.tokiomarineam.co.jp/>)に掲載します。
- c. 上記b.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合は、交付します。

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、原則として電子公告の方法により行い、委託会社のホームページ(<https://www.tokiomarineam.co.jp/>)に掲載します。

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

当ファンドの受益者の有する主な権利は以下の通りです。なお、議決権、受益者集会に関する権利は有しません。

収益分配金の請求権

収益分配金は、自動けいぞく(累積)投資に関する契約に基づき、自動的に無手数料で当ファンドに再投資されます。なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金の請求権

償還金(信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額をいいます。以下同じ。)は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日(償還日が休業日の場合には当該償還日の翌営業日)から起算して5営業日まで)から、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)にお支払

いします。ただし、受益者が償還金について、上記に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社より交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

換金(解約)請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行請求の方法により、換金を請求することができます。詳細は上記「2 換金(解約)手続等」をご参照ください。

買取請求権

信託契約を解約して信託を終了させるとき、および信託約款の変更を行う場合において、その内容が重大なものとして内閣府令で定めるものに該当するときは、委託会社によって定められた期間内に異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

- (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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、第17期計算期間(平成29年6月21日から平成30年6月20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】

【東京海上セレクション・バランス30】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 [平成29年 6月20日現在]	第17期 [平成30年 6月20日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	249,282,482	281,864,360
親投資信託受益証券	8,097,679,940	9,115,506,194
未収入金	40,559,764	48,807,854
流動資産合計	8,387,522,186	9,446,178,408
資産合計		
	8,387,522,186	9,446,178,408
負債の部		
流動負債		
未払解約金	583,977	2,908,679
未払受託者報酬	3,453,850	3,971,919
未払委託者報酬	37,560,591	43,194,547
未払利息	615	745
その他未払費用	215,774	242,236
流動負債合計	41,814,807	50,318,126
負債合計		
	41,814,807	50,318,126
純資産の部		
元本等		
元本	1 5,074,951,232	1 5,484,487,232
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,270,756,147	3,911,373,050
（分配準備積立金）	1,397,532,712	1,561,153,856
元本等合計	8,345,707,379	9,395,860,282
純資産合計		
	8,345,707,379	9,395,860,282
負債純資産合計		
	8,387,522,186	9,446,178,408

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第16期	第17期
	自 平成28年 6月21日 至 平成29年 6月20日	自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20日
営業収益		
受取利息	4,456	3,921
有価証券売買等損益	522,025,687	448,097,019
営業収益合計	522,030,143	448,100,940
営業費用		
支払利息	162,543	202,601
受託者報酬	6,723,224	7,721,703
委託者報酬	73,114,866	83,973,393
その他費用	420,433	476,308
営業費用合計	80,421,066	92,374,005
営業利益又は営業損失()	441,609,077	355,726,935
経常利益又は経常損失()	441,609,077	355,726,935
当期純利益又は当期純損失()	441,609,077	355,726,935
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()	15,697,037	29,069,619
期首剰余金又は期首欠損金()	2,634,343,193	3,270,756,147
剰余金増加額又は欠損金減少額	498,837,439	693,953,244
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	498,837,439	693,953,244
剰余金減少額又は欠損金増加額	288,336,525	379,993,657
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	288,336,525	379,993,657
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	3,270,756,147	3,911,373,050

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第17期 自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20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。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第16期 [平成29年 6月20日現在]	第17期 [平成30年 6月20日現在]
1. 1 期首元本額	4,741,019,762円	5,074,951,232円
期中追加設定元本額	851,848,846円	995,848,750円
期中一部解約元本額	517,917,376円	586,312,750円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	5,074,951,232口	5,484,487,232口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自 平成28年 6月21日 至 平成29年 6月20日	第17期 自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20日
1 分配金の計算過程 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（89,786,707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（2,045,424,898円）及び分配準備積立金（1,307,746,005円）より、分配対象額は3,442,957,610円（1万口当たり6,784.20円）であります。分配を行っておりません。	1 分配金の計算過程 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（93,376,875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（217,366,488円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,471,856,184円）及び分配準備積立金（1,250,410,493円）より、分配対象額は4,033,010,040円（1万口当たり7,353.45円）であります。分配を行っておりません。

(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	第16期 自 平成28年 6月21日 至 平成29年 6月20日	第17期 自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20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。	同左

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。	同左
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。	同左

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	第16期 [平成29年 6月20日現在]	第17期 [平成30年 6月20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
----------------------------	---	----

(有価証券に関する注記)

第16期(自平成28年6月21日 至平成29年6月20日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	528,361,115
合計	528,361,115

(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。

第17期(自平成29年6月21日 至平成30年6月20日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	402,750,801
合計	402,750,801

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

第16期 [平成29年 6月20日現在]		第17期 [平成30年 6月20日現在]	
1口当たり純資産額	1.6445円	1口当たり純資産額	1.7132円
(1万口当たり純資産額)	16,445円)	(1万口当たり純資産額)	17,132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
親投資信託 受益証券	T M A 日本株アクティブマザーファンド	1,182,856,918	1,864,892,216	
	T M A 日本債券マザーファンド	3,158,215,764	4,393,709,770	
	T M A 外国株式マザーファンド	376,156,294	965,781,284	
	T M A 外国債券マザーファンド	883,042,083	1,891,122,924	
親投資信託受益証券 合計		5,600,271,059	9,115,506,194	
合計		5,600,271,059	9,115,506,194	

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。

【東京海上セレクション・バランス50】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 [平成29年 6月20日現在]	第17期 [平成30年 6月20日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	574,342,307	650,485,262
親投資信託受益証券	18,728,169,196	21,046,010,576
未収入金	112,773,666	131,206,042
流動資産合計	19,415,285,169	21,827,701,880
資産合計	19,415,285,169	21,827,701,880
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,087,706	4,122,403
未払受託者報酬	7,995,144	9,185,868
未払委託者報酬	105,935,667	121,712,695
未払利息	1,417	1,721
その他未払費用	243,000	243,000
流動負債合計	116,262,934	135,265,687
負債合計	116,262,934	135,265,687
純資産の部		
元本等		
元本	10,721,202,081	11,252,342,656
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,577,820,154	10,440,093,537
（分配準備積立金）	4,315,370,639	5,119,328,822
元本等合計	19,299,022,235	21,692,436,193
純資産合計	19,299,022,235	21,692,436,193
負債純資産合計	19,415,285,169	21,827,701,880

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第16期	第17期
	自 平成28年 6月21日 至 平成29年 6月20日	自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20日
営業収益		
受取利息	10,215	9,022
有価証券売買等損益	2,066,599,281	1,635,349,336
営業収益合計	2,066,609,496	1,635,358,358
営業費用		
支払利息	372,114	467,789
受託者報酬	15,414,923	17,856,354
委託者報酬	204,247,686	236,596,572
その他費用	486,970	486,000
営業費用合計	220,521,693	255,406,715
営業利益又は営業損失（ ）	1,846,087,803	1,379,951,643
経常利益又は経常損失（ ）	1,846,087,803	1,379,951,643
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,846,087,803	1,379,951,643
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（ ）	68,444,439	86,573,892
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,424,060,355	8,577,820,154
剰余金増加額又は欠損金減少額	967,613,354	1,378,299,734
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	967,613,354	1,378,299,734
剰余金減少額又は欠損金増加額	591,496,919	809,404,102
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	591,496,919	809,404,102
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,577,820,154	10,440,093,537

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第17期 自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20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。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第16期 [平成29年 6月20日現在]	第17期 [平成30年 6月20日現在]
1. 1 期首元本額	10,267,489,373円	10,721,202,081円
期中追加設定元本額	1,395,263,568円	1,537,635,326円
期中一部解約元本額	941,550,860円	1,006,494,751円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	10,721,202,081口	11,252,342,656口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自 平成28年 6月21日 至 平成29年 6月20日	第17期 自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20日
1 分配金の計算過程 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(249,836,971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(5,753,799,865円)及び分配準備積立金(4,065,533,668円)より、分配対象額は10,069,170,504円(1万口当たり9,391.81円)であります。分配を行っておりません。	1 分配金の計算過程 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(266,003,177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(918,789,930円)、投資信託約款に規定される収益調整金(6,636,281,209円)及び分配準備積立金(3,934,535,715円)より、分配対象額は11,755,610,031円(1万口当たり10,447.23円)であります。分配を行っておりません。

(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	第16期 自 平成28年 6月21日 至 平成29年 6月20日	第17期 自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20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。	同左

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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	同左

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	第16期 [平成29年 6月20日現在]	第17期 [平成30年 6月20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 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(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	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
----------------------------	---	----

(有価証券に関する注記)

第16期(自平成28年6月21日 至平成29年6月20日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,999,609,012
合計	1,999,609,012

(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。

第17期(自平成29年6月21日 至平成30年6月20日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,490,431,205
合計	1,490,431,205

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

第16期 [平成29年 6月20日現在]		第17期 [平成30年 6月20日現在]	
1口当たり純資産額	1.8001円	1口当たり純資産額	1.9278円
(1万口当たり純資産額)	18,001円)	(1万口当たり純資産額)	19,278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
親投資信託 受益証券	TMA日本株アクティブマザーファンド	4,772,940,914	7,525,018,645	
	TMA日本債券マザーファンド	4,183,304,627	5,819,813,397	
	TMA外国株式マザーファンド	1,301,095,714	3,340,563,245	
	TMA外国債券マザーファンド	2,036,148,342	4,360,615,289	
親投資信託受益証券 合計		12,293,489,597	21,046,010,576	
合計		12,293,489,597	21,046,010,576	

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。

【東京海上セレクション・バランス70】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 [平成29年 6月20日現在]	第17期 [平成30年 6月20日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	355,277,488	426,083,864
親投資信託受益証券	11,628,752,073	13,786,727,719
未収入金	78,250,397	98,047,630
流動資産合計	12,062,279,958	14,310,859,213
資産合計	12,062,279,958	14,310,859,213
負債の部		
流動負債		
未払解約金	80,194	2,437,175
未払受託者報酬	4,906,709	6,009,152
未払委託者報酬	75,440,614	92,390,708
未払利息	876	1,127
その他未払費用	243,000	243,000
流動負債合計	80,671,393	101,081,162
負債合計	80,671,393	101,081,162
純資産の部		
元本等		
元本	1 6,275,550,909	1 6,759,588,514
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,706,057,656	7,450,189,537
（分配準備積立金）	2,922,699,244	3,685,815,877
元本等合計	11,981,608,565	14,209,778,051
純資産合計	11,981,608,565	14,209,778,051
負債純資産合計	12,062,279,958	14,310,859,213

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第16期		第17期	
	自 平成28年 6月21日 至 平成29年 6月20日		自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20日	
営業収益				
受取利息		6,193		5,695
有価証券売買等損益		1,767,976,781		1,410,406,090
営業収益合計		1,767,982,974		1,410,411,785
営業費用				
支払利息		225,982		300,667
受託者報酬		9,377,709		11,482,331
委託者報酬		144,182,181		176,540,789
その他費用		486,589		486,000
営業費用合計		154,272,461		188,809,787
営業利益又は営業損失()		1,613,710,513		1,221,601,998
経常利益又は経常損失()		1,613,710,513		1,221,601,998
当期純利益又は当期純損失()		1,613,710,513		1,221,601,998
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()		88,151,902		96,562,861
期首剰余金又は期首欠損金()		3,944,403,625		5,706,057,656
剰余金増加額又は欠損金減少額		742,070,665		1,310,882,141
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		742,070,665		1,310,882,141
剰余金減少額又は欠損金増加額		505,975,245		691,789,397
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		505,975,245		691,789,397
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		5,706,057,656		7,450,189,537

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第17期	
	自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第16期	第17期
	[平成29年 6月20日現在]	[平成30年 6月20日現在]
1. 1 期首元本額	6,071,785,419円	6,275,550,909円
期中追加設定元本額	977,047,955円	1,236,700,333円
期中一部解約元本額	773,282,465円	752,662,728円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	6,275,550,909口	6,759,588,514口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期	第17期
自 平成28年 6月21日 至 平成29年 6月20日	自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20日
1 分配金の計算過程 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（171,986,694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（4,370,113,911円）及び分配準備積立金（2,750,712,550円）より、分配対象額は7,292,813,155円（1万口当たり11,620.97円）であります。分配を行っておりません。	1 分配金の計算過程 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（192,112,739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（891,463,304円）、投資信託約款に規定される収益調整金（5,255,498,616円）及び分配準備積立金（2,602,239,834円）より、分配対象額は8,941,314,493円（1万口当たり13,227.57円）であります。分配を行っておりません。

(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	第16期	第17期
	自 平成28年 6月21日 至 平成29年 6月20日	自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20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。	同左

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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	同左

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	第16期 [平成29年 6月20日現在]	第17期 [平成30年 6月20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 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(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	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
----------------------------	---	----

(有価証券に関する注記)

第16期(自平成28年6月21日 至平成29年6月20日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,663,841,781
合計	1,663,841,781

(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。

第17期(自平成29年6月21日 至平成30年6月20日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,284,270,346
合計	1,284,270,346

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

第16期 [平成29年 6月20日現在]		第17期 [平成30年 6月20日現在]	
1口当たり純資産額	1.9093円	1口当たり純資産額	2.1022円
(1万口当たり純資産額)	19,093円)	(1万口当たり純資産額)	21,022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
親投資信託 受益証券	TMA日本株アクティブマザーファンド	4,462,288,000	7,035,243,260	
	TMA日本債券マザーファンド	1,013,982,188	1,410,652,019	
	TMA外国株式マザーファンド	1,135,387,780	2,915,108,125	
	TMA外国債券マザーファンド	1,132,669,180	2,425,724,315	
親投資信託受益証券 合計		7,744,327,148	13,786,727,719	
合計		7,744,327,148	13,786,727,719	

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。

（ご参考）

東京海上セレクション・バランス30、東京海上セレクション・バランス50、東京海上セレクション・バランス70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、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同ファンドの受益証券です。なお、同ファンドの状況は次のとおりです。

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

「TMA日本株アクティブマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		[平成29年 6月20日現在]	[平成30年 6月20日現在]
区 分	注記 番号	金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
金銭信託		203,539	31,319
コール・ローン		405,152,496	434,209,854
株式		37,826,253,620	43,964,367,420
未収入金		980,392,982	1,319,775,104
未収配当金		246,747,066	276,379,750
流動資産合計		39,458,749,703	45,994,763,447
資産合計		39,458,749,703	45,994,763,447
負債の部			
流動負債			
未払金		987,400,943	992,824,757
未払解約金		312,484,287	424,584,269
未払利息		1,000	1,148
流動負債合計		1,299,886,230	1,417,410,174
負債合計		1,299,886,230	1,417,410,174
純資産の部			
元本等			
元本	1	28,397,944,734	28,273,729,749
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		9,760,918,739	16,303,623,524
元本等合計		38,158,863,473	44,577,353,273
純資産合計		38,158,863,473	44,577,353,273
負債純資産合計		39,458,749,703	45,994,763,447

(2) 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[平成29年 6月20日現在]	[平成30年 6月20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	31,758,187,953円	28,397,944,734円
同期中における追加設定元本額	6,930,554,330円	8,160,178,604円
同期中における一部解約元本額	10,290,797,549円	8,284,393,589円
同期末における元本額	28,397,944,734円	28,273,729,749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>	391,222,541円	272,459,341円
東京海上日本株アクティブファンド	244,427,114円	202,435,594円
東京海上・未来設計ファンド1	4,488,172円	3,704,685円
東京海上・未来設計ファンド2	17,816,557円	15,183,551円
東京海上・未来設計ファンド3	72,328,707円	65,734,809円
東京海上・未来設計ファンド4	33,389,644円	29,748,739円
東京海上・未来設計ファンド5	117,116,316円	102,311,405円
東京海上セレクション・日本株式	16,306,442,713円	16,896,749,899円
東京海上セレクション・バランス30	1,262,240,134円	1,182,856,918円
東京海上セレクション・バランス50	5,084,091,982円	4,772,940,914円
東京海上セレクション・バランス70	4,489,516,266円	4,462,288,000円
東京海上・年金運用型戦略ファンド (年1回決算型)	48,236,178円	55,589,708円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	259,309,974円	158,742,803円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	49,052,200円	38,567,973円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	18,266,236円	14,415,410円
計	28,397,944,734円	28,273,729,749円
2. 1 本書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	28,397,944,734口	28,273,729,749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)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成28年 6月21日 至 平成29年 6月20日	自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20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。	同左
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。	同左
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。	同左

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成29年 6月20日現在]	[平成30年 6月20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。	(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 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)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

(有価証券に関する注記)

(自平成28年6月21日 至 平成29年6月20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	2,028,586,936
合計	2,028,586,936

(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(平成29年3月22日から平成29年6月20日まで)を指しております。

(自平成29年6月21日 至 平成30年6月20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	520,715,259
合計	520,715,259

(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(平成30年3月21日から平成30年6月20日まで)を指しております。

(1口当たり情報に関する注記)

[平成29年 6月20日現在]		[平成30年 6月20日現在]	
1口当たり純資産額	1.3437円	1口当たり純資産額	1.5766円
(1万口当たり純資産額)	13,437円)	(1万口当たり純資産額)	15,766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	

サカタのタネ	52,800	4,075.00	215,160,000	
ショーボンドホールディングス	32,600	7,530.00	245,478,000	
大成建設	78,300	6,130.00	479,979,000	
大和ハウス工業	197,400	3,834.00	756,831,600	
ヤクルト本社	46,200	7,250.00	334,950,000	
アサヒグループホールディングス	121,600	5,728.00	696,524,800	
不二製油グループ本社	68,000	4,000.00	272,000,000	
東レ	304,000	872.20	265,148,800	
レンゴー	233,400	978.00	228,265,200	
昭和電工	72,600	4,500.00	326,700,000	
信越化学工業	69,400	9,922.00	688,586,800	
宇部興産	64,600	2,914.00	188,244,400	
日立化成	101,800	2,224.00	226,403,200	
花王	55,500	8,464.00	469,752,000	
富士フイルムホールディングス	72,500	4,278.00	310,155,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	46,300	4,980.00	230,574,000	
武田薬品工業	192,500	4,302.00	828,135,000	
日本新薬	58,100	6,470.00	375,907,000	
エーザイ	72,200	8,169.00	589,801,800	
小野薬品工業	207,500	2,688.00	557,760,000	
JCRファーマ	100,100	6,990.00	699,699,000	
JXTGホールディングス	596,200	740.20	441,307,240	
住友金属鉱山	129,900	4,287.00	556,881,300	
ディスコ	29,100	19,230.00	559,593,000	
SMC	11,300	40,500.00	457,650,000	
小松製作所	177,400	3,159.00	560,406,600	
住友重機械工業	52,600	3,625.00	190,675,000	
ダイキン工業	34,000	13,135.00	446,590,000	
THK	58,700	3,355.00	196,938,500	
マキタ	43,900	5,040.00	221,256,000	
安川電機	139,300	4,065.00	566,254,500	
日本電産	51,700	16,960.00	876,832,000	
ソニー	273,000	5,404.00	1,475,292,000	
アドバンテスト	173,600	2,322.00	403,099,200	
キーエンス	9,200	65,510.00	602,692,000	
シスメックス	45,400	10,630.00	482,602,000	
メガチップス	69,600	3,050.00	212,280,000	
ローム	46,600	9,410.00	438,506,000	
太陽誘電	121,900	2,810.00	342,539,000	
東京エレクトロン	62,500	18,980.00	1,186,250,000	
デンソー	144,500	5,504.00	795,328,000	
いすゞ自動車	273,200	1,506.00	411,439,200	
トヨタ自動車	172,500	7,448.00	1,284,780,000	

本田技研工業	185,800	3,421.00	635,621,800	
スズキ	137,800	6,314.00	870,069,200	
島津製作所	101,200	3,175.00	321,310,000	
HOYA	83,900	6,277.00	526,640,300	
バンダイナムコホールディングス	173,100	4,645.00	804,049,500	
パイロットコーポレーション	40,100	6,410.00	257,041,000	
ヤマハ	53,500	5,870.00	314,045,000	
任天堂	11,200	36,650.00	410,480,000	
東京急行電鉄	253,000	1,977.00	500,181,000	
南海電気鉄道	78,000	3,165.00	246,870,000	
ヤマトホールディングス	26,100	3,392.00	88,531,200	
山九	100,900	6,140.00	619,526,000	
セイノーホールディングス	105,100	2,082.00	218,818,200	
日立物流	142,600	3,065.00	437,069,000	
GMOペイメントゲートウェイ	52,400	12,020.00	629,848,000	
野村総合研究所	114,100	5,650.00	644,665,000	
メルカリ	8,200	4,910.00	40,262,000	
KDDI	269,800	3,060.00	825,588,000	
GMOインターネット	114,500	2,789.00	319,340,500	
東宝	57,700	3,840.00	221,568,000	
ソフトバンクグループ	186,000	8,259.00	1,536,174,000	
三井物産	305,000	1,847.00	563,335,000	
三菱商事	171,000	3,105.00	530,955,000	
トラスコ中山	75,800	2,849.00	215,954,200	
ビックカメラ	242,000	1,738.00	420,596,000	
コスモス薬品	15,600	23,260.00	362,856,000	
ドンキホーテホールディングス	62,100	5,570.00	345,897,000	
イズミ	8,700	6,970.00	60,639,000	
ファーストリテイリング	8,200	51,790.00	424,678,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,180,300	637.10	1,389,069,130	
三井住友フィナンシャルグループ	266,300	4,416.00	1,175,980,800	
マネックスグループ	109,700	626.00	68,672,200	
カブドットコム証券	714,000	376.00	268,464,000	
第一生命ホールディングス	473,900	1,987.00	941,639,300	
オリックス	384,500	1,810.50	696,137,250	
住友不動産	113,000	4,224.00	477,312,000	
日本M&Aセンター	170,800	3,455.00	590,114,000	
カカクコム	197,400	2,489.00	491,328,600	
エムスリー	209,200	4,565.00	954,998,000	
サイバーエージェント	76,700	6,680.00	512,356,000	
リクルートホールディングス	183,500	3,132.00	574,722,000	
リログループ	251,700	2,923.00	735,719,100	
合計	13,477,900		43,964,367,420	

(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。

「TMA日本債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		[平成29年 6月20日現在]	[平成30年 6月20日現在]
区 分	注記 番号	金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,389,569,278	683,481,296
国債証券		77,595,675,842	116,977,260,539
地方債証券		3,741,609,728	1,573,853,043
特殊債券		1,204,133,000	2,402,362,000
社債券		25,494,907,504	39,854,594,724
未収入金		6,847,546,820	1,521,478,665
未収利息		149,639,144	157,995,112
前払費用		21,921,389	44,038,047
流動資産合計		116,445,002,705	163,215,063,426
資産合計		116,445,002,705	163,215,063,426
負債の部			
流動負債			
未払金		6,843,036,400	506,012,000
未払解約金		442,562,510	672,414,976
未払利息		3,429	1,808
流動負債合計		7,285,602,339	1,178,428,784
負債合計		7,285,602,339	1,178,428,784
純資産の部			
元本等			
元本	1	79,122,009,130	116,473,325,198
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		30,037,391,236	45,563,309,444
元本等合計		109,159,400,366	162,036,634,642
純資産合計		109,159,400,366	162,036,634,642
負債純資産合計		116,445,002,705	163,215,063,426

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20日

有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。
-----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[平成29年 6月20日現在]	[平成30年 6月20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	55,745,402,842円	79,122,009,130円
同期中における追加設定元本額	46,689,229,806円	64,415,915,490円
同期中における一部解約元本額	23,312,623,518円	27,064,599,422円
同期末における元本額	79,122,009,130円	116,473,325,198円
元本の内訳*		
東京海上・国内債券ファンド	445,841,014円	273,490,830円
東京海上・未来設計ファンド1	19,184,945円	18,941,438円
東京海上・未来設計ファンド2	33,849,417円	34,501,647円
東京海上・未来設計ファンド3	68,708,648円	74,686,052円
東京海上・未来設計ファンド4	7,929,853円	8,450,067円
東京海上セレクション・バランス30	2,817,712,765円	3,158,215,764円
東京海上セレクション・バランス50	3,725,521,539円	4,183,304,627円
東京海上セレクション・バランス70	852,898,005円	1,013,982,188円
東京海上セレクション・日本債券	10,849,054,941円	10,965,413,971円
東京海上・日本債券オープン(野村SMA向け)	12,205,928,434円	9,913,429,049円
東京海上・日本債券オープン(野村SMA・EW向け)	23,080,286,831円	22,043,156,765円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	64,098,232円	88,452,522円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	1,477,500,754円	1,081,724,048円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	93,190,473円	87,613,294円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	11,568,199円	10,918,742円
東京海上・日本債券オープンF(適格機関投資家専用)	23,368,735,080円	63,517,044,194円
計	79,122,009,130円	116,473,325,198円
2. 1 本書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	79,122,009,130口	116,473,325,198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)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成28年 6月21日 至 平成29年 6月20日	自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20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。	同左
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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	同左

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成29年 6月20日現在]	[平成30年 6月20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 該当事項はありません。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</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。	(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

（有価証券に関する注記）
（自 平成28年6月21日 至 平成29年6月20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
国債証券	161,680,634
地方債証券	11,790,588
特殊債券	1,381,000
社債券	29,402,181
合計	119,106,865

(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(平成29年3月22日から平成29年6月20日まで)を指しております。

（自 平成29年6月21日 至 平成30年6月20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
国債証券	69,302,299
地方債証券	4,567,381
特殊債券	1,486,000
社債券	6,801,267
合計	56,447,651

(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(平成30年3月21日から平成30年6月20日まで)を指しております。

（1口当たり情報に関する注記）

[平成29年 6月20日現在]		[平成30年 6月20日現在]	
1口当たり純資産額	1.3796円	1口当たり純資産額	1.3912円

(1万口当たり純資産額	13,796円)	(1万口当たり純資産額	13,912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
国債証券	第384回利付国債(2年)	2,676,000,000	2,686,088,520	
	第385回利付国債(2年)	1,910,000,000	1,917,601,800	
	第386回利付国債(2年)	560,000,000	562,329,600	
	第387回利付国債(2年)	1,630,000,000	1,637,123,100	
	第388回利付国債(2年)	2,690,000,000	2,702,266,400	
	第389回利付国債(2年)	2,610,000,000	2,622,214,800	
	第133回利付国債(5年)	1,526,000,000	1,540,329,140	
	第134回利付国債(5年)	60,000,000	60,597,000	
	第7回利付国債(40年)	10,000,000	12,786,000	
	第10回利付国債(40年)	2,563,000,000	2,611,748,260	
	第331回利付国債(10年)	30,000,000	31,107,900	
	第333回利付国債(10年)	920,000,000	956,376,800	
	第334回利付国債(10年)	359,000,000	373,708,230	
	第335回利付国債(10年)	11,840,000,000	12,267,424,000	
	第345回利付国債(10年)	664,000,000	670,493,920	
	第347回利付国債(10年)	360,000,000	363,074,400	
	第350回利付国債(10年)	13,980,000,000	14,075,064,000	
	第1回利付国債(30年)	20,000,000	26,050,400	
	第15回利付国債(30年)	100,000,000	133,888,000	
	第17回利付国債(30年)	160,000,000	212,652,800	
	第23回利付国債(30年)	360,000,000	489,798,000	
	第27回利付国債(30年)	40,000,000	54,866,000	
	第28回利付国債(30年)	50,000,000	68,774,000	
	第33回利付国債(30年)	284,000,000	368,921,680	
	第38回利付国債(30年)	1,320,000,000	1,675,726,800	
	第40回利付国債(30年)	1,030,000,000	1,309,634,700	
	第45回利付国債(30年)	30,000,000	36,090,600	
	第54回利付国債(30年)	5,000,000	5,131,900	
	第57回利付国債(30年)	1,306,000,000	1,336,286,140	
	第58回利付国債(30年)	2,510,000,000	2,565,471,000	
	第70回利付国債(20年)	100,000,000	114,944,000	
	第76回利付国債(20年)	60,000,000	67,987,200	
	第79回利付国債(20年)	40,000,000	45,773,600	
第81回利付国債(20年)	60,000,000	68,949,000		
第82回利付国債(20年)	70,000,000	80,949,400		
第96回利付国債(20年)	100,000,000	118,840,000		

第 9 9 回利付国債(2 0 年)	100,000,000	119,719,000	
第 1 0 0 回利付国債(2 0 年)	90,000,000	108,976,500	
第 1 0 2 回利付国債(2 0 年)	100,000,000	123,499,000	
第 1 0 4 回利付国債(2 0 年)	1,330,000,000	1,602,809,600	
第 1 0 5 回利付国債(2 0 年)	2,820,000,000	3,409,464,600	
第 1 1 3 回利付国債(2 0 年)	1,675,000,000	2,048,793,000	
第 1 2 0 回利付国債(2 0 年)	480,000,000	563,683,200	
第 1 2 5 回利付国債(2 0 年)	1,770,000,000	2,223,774,900	
第 1 2 6 回利付国債(2 0 年)	1,610,000,000	1,981,249,900	
第 1 2 7 回利付国債(2 0 年)	1,740,000,000	2,119,476,600	
第 1 2 8 回利付国債(2 0 年)	1,270,000,000	1,550,365,200	
第 1 2 9 回利付国債(2 0 年)	10,000,000	12,080,400	
第 1 3 2 回利付国債(2 0 年)	610,000,000	731,707,200	
第 1 3 4 回利付国債(2 0 年)	1,872,000,000	2,274,199,200	
第 1 3 5 回利付国債(2 0 年)	90,000,000	108,131,400	
第 1 3 6 回利付国債(2 0 年)	70,000,000	83,164,900	
第 1 4 1 回利付国債(2 0 年)	1,758,000,000	2,120,587,500	
第 1 4 3 回利付国債(2 0 年)	3,070,000,000	3,661,988,100	
第 1 4 4 回利付国債(2 0 年)	1,340,000,000	1,579,324,000	
第 1 4 5 回利付国債(2 0 年)	3,375,000,000	4,082,400,000	
第 1 4 6 回利付国債(2 0 年)	3,050,000,000	3,691,476,000	
第 1 4 7 回利付国債(2 0 年)	600,000,000	718,176,000	
第 1 4 8 回利付国債(2 0 年)	4,840,000,000	5,726,107,200	
第 1 5 0 回利付国債(2 0 年)	20,000,000	23,372,400	
第 1 5 1 回利付国債(2 0 年)	288,000,000	327,458,880	
第 1 5 4 回利付国債(2 0 年)	1,350,000,000	1,534,167,000	
第 1 5 6 回利付国債(2 0 年)	2,040,000,000	2,038,306,800	
第 1 5 7 回利付国債(2 0 年)	9,500,000,000	9,142,610,000	
第 1 5 8 回利付国債(2 0 年)	40,000,000	40,508,000	
第 1 5 9 回利付国債(2 0 年)	1,400,000,000	1,439,536,000	
第 1 6 0 回利付国債(2 0 年)	40,000,000	41,764,400	
第 1 6 1 回利付国債(2 0 年)	3,560,000,000	3,647,042,000	
第 1 6 3 回利付国債(2 0 年)	1,000,000,000	1,020,480,000	
第 1 6 4 回利付国債(2 0 年)	1,510,000,000	1,510,000,000	
第 2 2 回利付国債(物価連動・ 1 0 年)	1,593,000,000	1,699,792,569	
国債証券 合計	108,044,000,000	116,977,260,539	

地方債証券	第690回東京都公募公債	100,000,000	103,142,000	
	平成21年度第4回北海道公募公債	110,000,000	111,865,600	
	第163回神奈川県公募公債	120,000,000	121,641,600	
	第173回神奈川県公募公債	100,000,000	102,536,000	
	第180回神奈川県公募公債	107,900,000	111,371,143	
	第69回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	99,905,000	
	第326回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,526,000	
	第99回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,076,000	
	第116回大阪府公募公債(5年)	110,000,000	110,249,700	
	平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	102,604,000	
	平成22年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,239,000	
	第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,219,000	
	平成21年度第6回横浜市公募公債	100,000,000	101,996,000	
	第7回東京都住宅供給公社債券	100,000,000	100,785,000	
	第10回東京都住宅供給公社債券	100,000,000	101,697,000	
地方債証券 合計		1,547,900,000	1,573,853,043	
特殊債券	い第763号農林債	100,000,000	100,142,000	
	い第777号農林債	500,000,000	501,770,000	
	い第778号農林債	100,000,000	100,362,000	
	第296回信金中金債(5年)	200,000,000	200,338,000	
	第300回信金中金債(5年)	100,000,000	100,258,000	
	第307回信金中金債(5年)	100,000,000	100,373,000	
	第309回信金中金債(5年)	100,000,000	100,400,000	
	第331回信金中金債(5年)	500,000,000	499,390,000	
	第197号商工債(3年)	100,000,000	99,917,000	
	第210号商工債(3年)	100,000,000	99,872,000	
	第211号商工債(3年)	500,000,000	499,540,000	
特殊債券 合計		2,400,000,000	2,402,362,000	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	300,000,000	301,740,000	
	第1回BPCE円貨社債(5年)	100,000,000	100,644,000	
	第1回クレディ・アグリコル円貨社債(劣後)	100,000,000	107,274,000	
	第1回ロイズ・バンキング・グループ円貨社債	100,000,000	100,648,000	
	第4回ロイズ・バンキング・グループ円貨社債	200,000,000	198,334,000	
	第1回パンコ・サンタンデル無担保社債	100,000,000	98,967,000	
	第8回新関西国際空港株式会社社債	300,000,000	300,402,000	
	第68回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,886,000	
	第13回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,229,000	
	第14回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	200,194,000	
	第15回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,924,000	
	第68回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,984,000	

第95回都市再生債券	100,000,000	100,222,000	
第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	100,429,000	
第53回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	199,974,000	
第2回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	17,235,000	18,329,767	
第4回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	36,924,000	39,116,916	
第98回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,703,000	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,020,000	55,568,141	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,401,000	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,000,000	
第5回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	100,285,000	
第6回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	101,194,000	
第7回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	101,807,000	
第44回日本学生支援債券	200,000,000	199,990,000	
第51回日本学生支援債券	200,000,000	200,004,000	
第3回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債 (2018)	100,000,000	98,884,000	
第1回ソシエテ ジェネラル円貨社債 (劣後)	100,000,000	107,802,000	
第41回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	500,015,000	
第49回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,999,000	
第51回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,999,000	
第72回中日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,880,000	
第40回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	300,000,000	
第56回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,079,000	
第24清水建設株式会社無担保社債	200,000,000	200,200,000	
第45回鹿島建設株式会社無担保社債	200,000,000	199,708,000	
第6回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,101,000	
第3回戸田建設株式会社無担保社債	400,000,000	399,768,000	
第2回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,088,000	
第3回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,804,000	
第4回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,918,000	
第4回住友林業株式会社無担保社債	300,000,000	299,922,000	
第3回協和エクシオ株式会社無担保社債	100,000,000	100,099,000	
第5回日揮株式会社無担保社債	100,000,000	100,115,000	
第1回三井製糖株式会社無担保社債	200,000,000	200,368,000	
第1回パーソルホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,021,000	
第2回パーソルホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,034,000	

第12回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,156,000	
第1回サントリーホールディングス株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	100,230,000	
第11回日清オイリオグループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,944,000	
第12回日清オイリオグループ株式会社無担保社債	100,000,000	100,146,000	
第27回双日株式会社無担保社債	200,000,000	202,008,000	
第35回双日株式会社無担保社債	100,000,000	100,331,000	
第3回J・フロントリテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	100,202,000	
第10回野村不動産ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,806,000	
第22回森ビル株式会社無担保社債	400,000,000	400,224,000	
第16回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,588,000	
第31回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	100,239,000	
第6回株式会社クラレ無担保社債	100,000,000	99,937,000	
第7回株式会社クラレ無担保社債	100,000,000	99,940,000	
第1回日本土地建物株式会社無担保社債	300,000,000	300,477,000	
第19回大王製紙株式会社無担保社債	200,000,000	200,150,000	
第18回レンゴー株式会社無担保社債	100,000,000	100,934,000	
第23回レンゴー株式会社無担保社債	200,000,000	199,888,000	
第27回昭和電工株式会社無担保社債	100,000,000	101,787,000	
第59回住友化学株式会社無担保社債	300,000,000	299,175,000	
第7回セントラル硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,895,000	
第21回デンカ株式会社無担保社債	100,000,000	100,074,000	
第13回大陽日酸株式会社無担保社債	100,000,000	99,903,000	
第45回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,979,000	
第11回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,903,000	
第5回花王株式会社無担保社債	200,000,000	199,970,000	
第37回D I C株式会社無担保社債	100,000,000	104,935,000	
第42回D I C株式会社無担保社債	400,000,000	399,844,000	
第6回コニカミノルタホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,405,000	
第5回出光興産株式会社無担保社債	300,000,000	299,826,000	
第8回J Xホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,015,000	
第3回バンドー化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,228,000	
第23回太平洋セメント株式会社無担保社債	200,000,000	200,276,000	
第8回日本特殊陶業株式会社無担保社債	100,000,000	99,985,000	
第9回日本特殊陶業株式会社無担保社債	200,000,000	200,212,000	
第7回新日鐵住金株式会社無担保社債	200,000,000	200,070,000	

第9回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	100,058,000	
第23回日新製鋼株式会社無担保社債	100,000,000	100,356,000	
第24回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	500,000,000	498,645,000	
第25回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,939,000	
第12回大同特殊鋼株式会社無担保社債	200,000,000	199,830,000	
第17回三井金属鉱業株式会社無担保社債	200,000,000	199,884,000	
第32回三菱マテリアル株式会社無担保社債	200,000,000	199,392,000	
第33回三菱マテリアル株式会社無担保社債	200,000,000	195,924,000	
第47回古河電気工業株式会社無担保社債	200,000,000	200,276,000	
第27回住友電気工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,610,000	
第12回YKK株式会社無担保社債	800,000,000	799,480,000	
第1回株式会社リクルートホールディングス無担保社債	200,000,000	199,828,000	
第8回株式会社荏原製作所無担保社債	100,000,000	100,202,000	
第9回株式会社荏原製作所無担保社債	100,000,000	100,116,000	
第3回セガサミーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,205,000	
第45回日本精工株式会社無担保社債	200,000,000	200,948,000	
第31回富士電機株式会社無担保社債	100,000,000	100,201,000	
第1回株式会社明電舎無担保社債	100,000,000	100,391,000	
第49回日本電気株式会社無担保社債	100,000,000	99,971,000	
第51回日本電気株式会社無担保社債	100,000,000	100,293,000	
第16回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,999,000	
第19回三井造船株式会社無担保社債	300,000,000	299,874,000	
第39回株式会社IHI無担保社債	100,000,000	100,225,000	
第5回住友生命基金流動化特定目的会社 第1回特定社債	300,000,000	300,378,000	
第1回日本生命2015基金特定目的会社 特定社債	100,000,000	100,230,000	
第2回昭和リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,832,000	
第2回コンコルディア・フィナンシャルグループ(劣後)	100,000,000	100,170,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社 特定社債	200,000,000	200,190,000	
第1回明治安田生命2017基金特定目的 会社特定社債	300,000,000	300,942,000	
第3回明治安田生命保険無担保社債 (劣後特約付)	400,000,000	402,926,000	
第2回三井住友トラスト・パナソニックフ ァイナンス無担保社債	100,000,000	100,160,000	
第1回愛三工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,009,000	
第1回日本生命劣後ローン流動化株式会 社期限前償還条項付無担保	200,000,000	200,987,000	

第2回株式会社第一興商無担保社債	100,000,000	100,547,000	
第22回オリンパス株式会社無担保社債	200,000,000	199,890,000	
第5回株式会社ニフコ無担保社債	300,000,000	300,456,000	
第16回豊田通商株式会社無担保社債	200,000,000	207,900,000	
第3回兼松株式会社無担保社債	100,000,000	99,986,000	
第1回ユニ・ファミリーマートホールディングス	300,000,000	300,294,000	
第29回阪和興業株式会社無担保社債	200,000,000	200,054,000	
第30回阪和興業株式会社無担保社債	100,000,000	100,034,000	
第53回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	100,519,000	
第69回株式会社クレディセゾン無担保社債	200,000,000	199,970,000	
第2回株式会社新生銀行無担保社債	200,000,000	200,620,000	
第2回株式会社あおぞら銀行無担保社債	100,000,000	100,038,000	
第7回株式会社あおぞら銀行無担保社債	200,000,000	199,960,000	
第9回株式会社あおぞら銀行無担保社債	200,000,000	200,040,000	
第19回株式会社あおぞら銀行無担保社債	100,000,000	99,991,000	
第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	200,000,000	200,112,000	
第12回株式会社りそなホールディングス無担保社債	300,000,000	299,538,000	
第9回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	400,000,000	400,068,000	
第10回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	100,000,000	100,104,000	
第11回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	200,000,000	200,007,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,606,000	
第11回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	105,629,000	
第1回株式会社千葉銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,910,000	
第3回株式会社群馬銀行期限前償還条項付無担保社債	200,000,000	200,033,000	
第1回みずほフィナンシャルグループ(劣後特約付)	200,000,000	206,232,000	
第15回みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	300,000,000	298,896,000	
第16回みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	200,000,000	200,026,000	
第13回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	300,000,000	300,183,000	
第15回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,976,000	
第1回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,014,000	

第42回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	200,000,000	199,258,000	
第46回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	99,957,000	
第48回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	99,979,000	
第21回東京センチュリー株式会社無担保社債	200,000,000	199,520,000	
第23回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	100,009,000	
第24回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	100,007,000	
第47回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	400,000,000	400,084,000	
第48回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	300,000,000	300,105,000	
第82回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,985,000	
第83回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,998,000	
第19回ポケットカード株式会社無担保社債	100,000,000	99,888,000	
第3回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,270,000	
第1回イオンプロダクトファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	301,938,000	
第75回アコム株式会社無担保社債	200,000,000	200,008,000	
第19回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,034,000	
第20回株式会社ジャックス無担保社債	200,000,000	200,150,000	
第21回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,104,000	
第13回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	100,000,000	100,008,000	
第15回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	100,000,000	100,518,000	
第18回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	100,000,000	100,503,000	
第71回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,979,000	
第72回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,880,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,550,000	
第18回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,970,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,798,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,378,000	
第1回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,961,000	

第16回株式会社大和証券グループ本社 無担保社債	100,000,000	101,345,000	
第46回野村ホールディングス株式会社 無担保社債	200,000,000	200,756,000	
第51回野村ホールディングス株式会社 無担保社債	100,000,000	100,219,000	
第3回三井住友海上火災保険株式会社 無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	100,724,500	
第4回三井住友海上火災保険株式会社 無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	204,003,000	
第6回NECキャピタルソリューション 株式会社無担保社債	100,000,000	101,351,000	
第10回NECキャピタルソリューション 株式会社無担保社債	100,000,000	99,952,000	
第12回NECキャピタルソリューション 株式会社無担保社債	100,000,000	99,986,000	
第43回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,274,000	
第60回三井不動産株式会社無担保社債	400,000,000	400,804,000	
第125回三菱地所株式会社無担保社債	300,000,000	299,523,000	
第6回イオンモール株式会社無担保社債	100,000,000	100,023,000	
第16回日本ビルファンド投資法人無担保 投資法人債	400,000,000	400,028,000	
第8回森トラスト総合リート投資法人 無担保投資法人債	400,000,000	399,228,000	
第28回相鉄ホールディングス株式会社 無担保社債	200,000,000	202,478,000	
第29回相鉄ホールディングス株式会社 無担保社債	100,000,000	101,574,000	
第37回相鉄ホールディングス株式会社 無担保社債	200,000,000	200,560,000	
第87回東京急行電鉄株式会社無担保社債	400,000,000	400,232,000	
第2回株式会社鴻池運輸無担保社債	200,000,000	199,978,000	
第90回近畿日本鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,488,000	
第106回近鉄グループホールディングス 株式会社無担保社債	200,000,000	201,122,000	
第44回南海電気鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,301,000	
第48回名古屋鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,015,000	
第1回ヤマトホールディングス株式会社 無担保社債	100,000,000	99,966,000	
第35回日本郵船株式会社無担保社債	100,000,000	103,426,000	
第40回日本郵船株式会社無担保社債	200,000,000	200,068,000	
第500回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,740,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,209,000	
第467回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,410,000	
第499回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,493,000	
第515回関西電力株式会社社債	400,000,000	400,180,000	
第517回関西電力株式会社社債	200,000,000	200,098,000	
第404回中国電力株式会社社債	400,000,000	399,228,000	

第307回北陸電力株式会社社債	400,000,000	423,304,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,217,000	
第501回東北電力株式会社社債	300,000,000	299,841,000	
第299回四国電力株式会社社債	400,000,000	400,560,000	
第437回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,644,000	
第444回九州電力株式会社社債	210,000,000	209,147,400	
第308回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,367,000	
第319回北海道電力株式会社社債	500,000,000	502,930,000	
第320回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,503,000	
第349回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,997,000	
第54回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,918,000	
第4回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,115,000	
第11回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,818,000	
第12回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	300,597,000	
第5回SCK株式会社無担保社債	300,000,000	300,123,000	
第2回日鉄住金物産株式会社無担保社債	200,000,000	200,298,000	
第3回日鉄住金物産株式会社無担保社債	100,000,000	100,075,000	
第5回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	199,920,000	
第6回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	199,876,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	300,000,000	299,883,000	
社債券 合計	39,717,179,000	39,854,594,724	
合計	151,709,079,000	160,808,070,306	

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。

「TMA外国株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	[平成29年 6月20日現在]	[平成30年 6月20日現在]
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		157,483,126	335,208,767
コール・ローン		522,654,912	461,087,858
株式		25,203,932,776	29,175,858,623
投資証券		105,045,916	
未収入金		2,242,441	

未収配当金		29,778,510	40,512,474
流動資産合計		26,021,137,681	30,012,667,722
資産合計		26,021,137,681	30,012,667,722
負債の部			
流動負債			
未払解約金		207,624,957	230,717,679
未払利息		1,290	1,220
流動負債合計		207,626,247	230,718,899
負債合計		207,626,247	230,718,899
純資産の部			
元本等			
元本	1	11,578,492,501	11,599,728,358
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		14,235,018,933	18,182,220,465
元本等合計		25,813,511,434	29,781,948,823
純資産合計		25,813,511,434	29,781,948,823
負債純資産合計		26,021,137,681	30,012,667,722

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[平成29年 6月20日現在]	[平成30年 6月20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	11,945,979,009円	11,578,492,501円
同期中における追加設定元本額	2,222,432,006円	2,041,299,727円
同期中における一部解約元本額	2,589,918,514円	2,020,063,870円
同期末における元本額	11,578,492,501円	11,599,728,358円
元本の内訳*		
東京海上・外国株式ファンド	20,665,269円	20,538,321円
東京海上・未来設計ファンド1	2,689,105円	2,355,947円
東京海上・未来設計ファンド2	8,006,650円	7,241,979円
東京海上・未来設計ファンド3	36,115,250円	34,836,894円
東京海上・未来設計ファンド4	17,505,566円	16,554,491円
東京海上・未来設計ファンド5	63,149,522円	58,562,874円
東京海上セレクション・外国株式	8,446,156,628円	8,476,943,285円
東京海上セレクション・バランス30	378,171,904円	376,156,294円
東京海上セレクション・バランス50	1,305,545,566円	1,301,095,714円
東京海上セレクション・バランス70	1,075,924,791円	1,135,387,780円
東京海上・年金運用型戦略ファンド (年1回決算型)	28,883,363円	35,351,340円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	155,343,462円	100,993,284円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	29,390,622円	24,541,428円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	10,944,803円	9,168,727円
計	11,578,492,501円	11,599,728,358円
2. 1 本書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	11,578,492,501口	11,599,728,358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)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成28年 6月21日 至 平成29年 6月20日	自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20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。	同左

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、為替予約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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	同左

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成29年 6月20日現在]	[平成30年 6月20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>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</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。	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

（自 平成28年6月21日 至 平成29年6月20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	991,550,347
投資証券	12,035,394
合計	979,514,953

（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（平成29年3月22日から平成29年6月20日まで）を指しております。

（自 平成29年6月21日 至 平成30年6月20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	1,304,678,905
合計	1,304,678,905

（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（平成30年3月21日から平成30年6月20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

（平成29年6月20日現在）

該当事項はありません。

（平成30年6月20日現在）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

[平成29年 6月20日現在]		[平成30年 6月20日現在]	
1口当たり純資産額	2.2294円	1口当たり純資産額	2.5675円
（1万口当たり純資産額	22,294円）	（1万口当たり純資産額	25,675円）

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
米ドル	株	米ドル	米ドル	
APACHE CORP	10,000	43.26	432,600.00	
CHEVRONTEXACO CORP	15,200	125.54	1,908,208.00	
CONOCOPHILLIPS	10,000	66.26	662,600.00	
EOG RESOURCES INC	12,200	117.08	1,428,376.00	
EQT CORPORATION	6,000	56.45	338,700.00	
EXXON MOBIL CORPORATION	24,000	80.70	1,936,800.00	
HALLIBURTON CO	12,000	46.11	553,320.00	
HOLLYFRONTIER CORP	8,600	74.70	642,420.00	
KINDER MORGAN INC	12,000	17.35	208,200.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	8,000	82.58	660,640.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,000	180.14	540,420.00	
SCHLUMBERGER LTD	10,000	65.70	657,000.00	
BALL CORP	10,000	35.97	359,700.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,000	45.20	226,000.00	
DOWDUPONT INC	17,374	66.36	1,152,938.64	
INTERNATIONAL PAPER CO	5,000	54.78	273,900.00	
PPG INDUSTRIES INC	3,000	104.13	312,390.00	
PRAXAIR INC	3,300	155.31	512,523.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	42,300	147.28	6,229,944.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	16,400	302.52	4,961,328.00	
CINTAS CORP	4,300	190.55	819,365.00	
VERISK ANALYTICS INC	51,200	109.21	5,591,552.00	
NIKE INC -CL B	59,300	74.26	4,403,618.00	
BRIGHT HORIZONS FAMILY SOLUTIONS INC	59,306	106.00	6,286,436.00	
STARBUCKS CORP	101,400	57.43	5,823,402.00	
THE WALT DISNEY CO	37,800	106.10	4,010,580.00	
AMAZON.COM INC	6,900	1,734.78	11,969,982.00	
BOOKING HOLDINGS INC	1,100	2,139.26	2,353,186.00	
TJX COMPANIES INC	45,800	95.75	4,385,350.00	

CONSTELLATION BRANDS INC-A	23,400	231.85	5,425,290.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	123,200	40.34	4,969,888.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	43,600	155.00	6,758,000.00	
MEDTRONIC PLC	16,200	86.61	1,403,082.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	33,800	253.02	8,552,076.00	
ACADIA PHARMACEUTICALS INC	19,800	16.33	323,334.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	7,000	121.91	853,370.00	
BIOGEN INC	5,800	292.04	1,693,832.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,000	95.62	1,147,440.00	
BLUEBIRD BIO INC	8,000	177.80	1,422,400.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	24,500	53.64	1,314,180.00	
CELGENE CORP	58,800	79.44	4,671,072.00	
GILEAD SCIENCES INC	32,600	70.94	2,312,644.00	
INCYTE CORP	36,700	72.98	2,678,366.00	
SEATTLE GENETICS INC	14,000	65.78	920,920.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	52,800	100.67	5,315,376.00	
HDFC Bank Ltd	57,100	103.44	5,906,424.00	
SIGNATURE BANK/NEW YORK NY	15,600	129.73	2,023,788.00	
SVB FINANCIAL GROUP	14,000	316.78	4,434,920.00	
MSCI INC	47,200	171.76	8,107,072.00	
SCHWAB (CHARLES) CORP	35,700	55.27	1,973,139.00	
MARSH & MCLENNAN COS	71,200	82.30	5,859,760.00	
ALPHABET INC-CL A	4,500	1,178.69	5,304,105.00	
ALPHABET INC-CL C	4,500	1,168.06	5,256,270.00	
FACEBOOK INC-A	45,000	197.49	8,887,050.00	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	33,600	220.08	7,394,688.00	
INTUIT INC	36,300	210.61	7,645,143.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	44,500	199.69	8,886,205.00	
MICROSOFT CORP	9,300	100.86	937,998.00	
AT&T INC	28,000	32.39	906,920.00	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	19,700	48.50	955,450.00	
DOMINION ENERGY INC	4,000	66.94	267,760.00	
DUKE ENERGY CORP	7,000	75.67	529,690.00	
NEXTERA ENERGY INC	5,000	163.00	815,000.00	
PPL CORPORATION	30,600	27.26	834,156.00	
SOUTHERN CO	7,800	45.06	351,468.00	
NVIDIA CORP	17,100	260.17	4,448,907.00	
Taiwan Semiconductor Manufacturing	32,400	37.56	1,216,944.00	
米ドル小計	1,682,780		202,345,605.64 (22,276,227,724)	
	銘柄数	67		
	比率	74.8%	76.4%	

加ドル	株	加ドル	加ドル	
ENBRIDGE INC	13,000	42.02	546,260.00	
TRANSCANADA CORP	10,000	56.62	566,200.00	
GOLDCORP INC	35,800	18.22	652,276.00	
DOLLARAMA INC	19,900	153.49	3,054,451.00	
加ドル小計	78,700		4,819,187.00 (399,366,026)	
	銘柄数	4		
	比率	1.3%	1.4%	
ユーロ	株	ユーロ	ユーロ	
TOTAL SA	21,400	51.79	1,108,306.00	
AKZO NOBEL	6,000	74.60	447,600.00	
BASF SE	13,200	84.96	1,121,472.00	
KONINKLIJKE DSM NV	5,000	89.16	445,800.00	
SYMRISE AG	7,000	74.14	518,980.00	
AENA SME SA	16,400	155.45	2,549,380.00	
KERRY GROUP PLC-A	18,500	90.90	1,681,650.00	
FLOW TRADERS	20,300	34.10	692,230.00	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	30,000	13.50	405,000.00	
TELEFONICA SA	60,000	7.36	442,140.00	
E.ON SE	50,000	9.24	462,250.00	
ENEL SPA	100,000	4.83	483,100.00	
ENGIE	8,000	13.20	105,600.00	
IBERDROLA SA	70,000	6.56	459,620.00	
ユーロ小計	425,800		10,923,128.00 (1,392,152,663)	
	銘柄数	14		
	比率	4.7%	4.8%	
英ポンド	株	英ポンド	英ポンド	
BP PLC	140,000	5.70	798,980.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	50,800	25.61	1,301,242.00	
JOHNSON MATTHEY PLC	9,722	37.25	362,144.50	
ASHTREAD GROUP PLC	75,100	22.67	1,702,517.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	61,100	61.75	3,772,925.00	
ST JAMES'S PLACE PLC	180,100	11.89	2,142,289.50	
VODAFONE GROUP PLC	300,000	1.85	557,520.00	
NATIONAL GRID PLC	73,241	8.27	605,703.07	
英ポンド小計	890,063		11,243,321.07 (1,629,606,955)	
	銘柄数	8		
	比率	5.5%	5.6%	
スイスフラン	株	スイスフラン	スイスフラン	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	18,300	211.05	3,862,215.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	8,300	722.00	5,992,600.00	

スイスフラン小計	26,600		9,854,815.00 (1,090,238,183)	
	銘柄数	2		
	比率	3.7%	3.7%	
スウェーデンクローネ	株	スウェーデン クローネ	スウェーデン クローネ	
ASSA ABLOY AB-B	272,000	188.80	51,353,600.00	
スウェーデンクローネ小計	272,000		51,353,600.00 (634,730,496)	
	銘柄数	1		
	比率	2.1%	2.2%	
ノルウェークローネ	株	ノルウェー クローネ	ノルウェー クローネ	
EQUINOR ASA	45,000	214.40	9,648,000.00	
YARA INTERNATIONAL ASA	6,000	345.20	2,071,200.00	
ノルウェークローネ小計	51,000		11,719,200.00 (157,506,048)	
	銘柄数	2		
	比率	0.5%	0.5%	
デンマーククローネ	株	デンマーク クローネ	デンマーク クローネ	
GENMAB A/S	7,100	960.20	6,817,420.00	
H LUNDBECK A/S	43,495	465.80	20,259,971.00	
デンマーククローネ小計	50,595		27,077,391.00 (463,023,386)	
	銘柄数	2		
	比率	1.6%	1.6%	
豪ドル	株	豪ドル	豪ドル	
BHP BILLITON LTD	40,000	32.36	1,294,400.00	
RIO TINTO LIMITED	10,000	82.14	821,400.00	
HUB24 LTD	65,078	13.45	875,299.10	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	45,000	23.22	1,044,900.00	
豪ドル小計	160,078		4,035,999.10 (328,126,726)	
	銘柄数	4		
	比率	1.1%	1.1%	
香港ドル	株	香港ドル	香港ドル	
Sands China Ltd	453,600	43.30	19,640,880.00	
Ping An Insurance Group Co	390,000	77.10	30,069,000.00	
HKT Trust / HKT Ltd	400,000	9.95	3,980,000.00	
香港ドル小計	1,243,600		53,689,880.00 (753,269,016)	
	銘柄数	3		
	比率	2.5%	2.6%	
シンガポールドル	株	シンガポールドル	シンガポールドル	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	200,000	3.18	636,000.00	

シンガポールドル小計	200,000		636,000.00 (51,611,400)	
	銘柄数	1		
	比率	0.2%	0.2%	
合計	株 5,081,216		円 29,175,858,623 (29,175,858,623)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(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。

「TMA外国債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		[平成29年 6月20日現在]	[平成30年 6月20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		116,195,457	32,264,527
コール・ローン		187,467,694	184,697,237
国債証券		17,694,625,596	18,934,835,806
派生商品評価勘定		703,535	192,000
未収入金		179,139,457	393,786,574
未収利息		47,930,148	76,215,981
前払費用		33,443,735	64,148,365
流動資産合計		18,259,505,622	19,686,140,490
資産合計		18,259,505,622	19,686,140,490
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		158,448	80,000
未払金		305,417,136	400,417,768
未払解約金		106,694,817	116,450,241
未払利息		462	488
流動負債合計		412,270,863	516,948,497
負債合計		412,270,863	516,948,497
純資産の部			
元本等			
元本	1	8,318,589,517	8,950,848,357

剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		9,528,645,242	10,218,343,636
元本等合計		17,847,234,759	19,169,191,993
純資産合計		17,847,234,759	19,169,191,993
負債純資産合計		18,259,505,622	19,686,140,490

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[平成29年 6月20日現在]	[平成30年 6月20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	7,947,482,138円	8,318,589,517円
同期中における追加設定元本額	1,530,735,521円	1,779,533,003円
同期中における一部解約元本額	1,159,628,142円	1,147,274,163円
同期末における元本額	8,318,589,517円	8,950,848,357円
元本の内訳*		
東京海上・外国債券ファンド	19,410,217円	17,466,473円
東京海上・未来設計ファンド1	1,384,682円	1,382,703円
東京海上・未来設計ファンド2	5,497,090円	5,666,947円
東京海上・未来設計ファンド3	14,877,550円	16,356,120円
東京海上・未来設計ファンド4	5,151,220円	5,551,600円
東京海上・未来設計ファンド5	7,226,686円	7,637,308円

東京海上セレクション・外国債券	4,733,600,351円	4,820,029,385円
東京海上セレクション・バランス30	778,930,273円	883,042,083円
東京海上セレクション・バランス50	1,792,757,866円	2,036,148,342円
東京海上セレクション・バランス70	941,908,297円	1,132,669,180円
東京海上・年金運用型戦略ファンド (年1回決算型)	17,845,285円	24,898,216円
計	8,318,589,517円	8,950,848,357円
2. 1 本書における開示対象ファンドの計 算期間末日における当該親投資信託 の受益権の総数	8,318,589,517口	8,950,848,357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)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成28年 6月21日 至 平成29年 6月20日	自 平成29年 6月21日 至 平成30年 6月20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。	同左
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、為替予約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。	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	同左
-------------------	---	----

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成29年 6月20日現在]	[平成30年 6月20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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
----------------------------	--	----

（有価証券に関する注記）

（自 平成28年6月21日 至 平成29年6月20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
国債証券	235,976,258
合計	235,976,258

（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（平成29年3月22日から平成29年6月20日まで）を指しております。

（自 平成29年6月21日 至 平成30年6月20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
国債証券	82,132,530
合計	82,132,530

（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（平成30年3月21日から平成30年6月20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

通貨関連

（平成29年6月20日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益

市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買建	169,599,065		170,302,600	703,535
	米ドル	111,136,000		111,750,000	614,000
	ユーロ	58,463,065		58,552,600	89,535
	売建	201,807,952		201,966,400	158,448
	米ドル	55,834,200		55,875,000	40,800
	メキシコペソ	8,071,440		8,073,000	1,560
	ユーロ	9,964,872		9,966,400	1,528
	英ポンド	127,937,440		128,052,000	114,560
	合計	371,407,017		372,269,000	545,087

(平成30年6月20日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買建	48,582,000		48,774,000	192,000
	豪ドル	48,582,000		48,774,000	192,000
	売建	50,900,000		50,980,000	80,000
	ユーロ	50,900,000		50,980,000	80,000
	合計	99,482,000		99,754,000	112,000

(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計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報に関する注記)

[平成29年 6月20日現在]		[平成30年 6月20日現在]	
1口当たり純資産額	2.1455円	1口当たり純資産額	2.1416円
(1万口当たり純資産額	21,455円)	(1万口当たり純資産額	21,416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

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル			米ドル	
		T 1 1/2 01/31/22	1,100,000	1,053,851.56	
		T 1 1/2 04/15/20	100,000	98,148.43	
		T 1 1/2 05/31/20	1,500,000	1,469,882.82	
		T 1 1/2 07/15/20	4,200,000	4,109,765.64	
		T 1 1/2 08/15/26	3,100,000	2,787,820.32	
		T 1 1/4 10/31/21	1,000,000	953,593.75	
		T 1 1/8 08/31/21	200,000	190,453.12	
		T 1 1/8 09/30/21	500,000	475,468.75	
		T 1 3/4 02/28/22	800,000	772,624.99	
		T 1 3/4 11/15/20	6,600,000	6,468,515.65	
		T 1 3/4 11/30/21	1,000,000	968,593.75	
		T 1 3/8 05/31/21	400,000	385,437.50	
		T 1 3/8 12/15/19	900,000	885,234.37	
		T 1 5/8 08/15/22	2,300,000	2,198,656.25	
		T 1 5/8 11/30/20	400,000	390,656.24	
		T 1 7/8 01/31/22	4,500,000	4,369,218.75	
		T 1 7/8 04/30/22	100,000	96,851.56	
		T 1 7/8 11/30/21	2,100,000	2,043,070.32	
		T 2 02/28/21	1,000,000	983,437.50	
		T 2 08/15/25	100,000	94,406.25	
		T 2 08/31/21	1,700,000	1,664,539.07	
		T 2 1/4 02/15/27	500,000	475,351.56	
		T 2 1/4 07/31/21	1,000,000	987,343.75	
		T 2 1/4 08/15/27	4,000,000	3,791,562.50	
		T 2 1/4 11/15/27	1,400,000	1,325,406.25	
		T 2 1/8 08/15/21	2,300,000	2,261,726.53	
		T 2 1/8 09/30/21	4,700,000	4,616,648.45	
		T 2 11/15/21	1,000,000	977,421.88	
		T 2 11/15/26	300,000	280,078.11	
		T 2 11/30/20	1,400,000	1,379,546.85	
		T 2 12/31/21	4,100,000	4,001,023.45	
		T 2 3/4 02/15/28	2,300,000	2,271,070.28	
		T 2 3/4 08/15/42	1,200,000	1,144,875.00	
T 3 05/15/42	300,000	299,343.75			
T 3 1/8 02/15/42	100,000	101,898.43			
T 3 3/4 08/15/41	1,000,000	1,123,437.50			
T 3 5/8 02/15/21	6,100,000	6,253,453.12			
T 3 5/8 08/15/43	1,100,000	1,216,187.50			

	T 4 1/2 08/15/39	600,000	742,875.00	
	T 4 1/4 11/15/40	4,600,000	5,536,171.88	
	T 4 3/4 02/15/41	3,500,000	4,503,789.05	
	T 4 3/8 05/15/40	100,000	122,195.31	
	T 4 3/8 05/15/41	100,000	122,656.25	
	T 4 3/8 11/15/39	2,500,000	3,049,218.75	
	T 5 1/4 02/15/29	600,000	727,875.00	
	T 5 3/8 02/15/31	400,000	503,687.50	
	T 6 1/4 05/15/30	500,000	667,070.31	
米ドル小計		79,300,000	80,942,140.55 (8,910,920,253)	
	銘柄数	47		
	比率	46.5%	47.1%	
加ドル			加ドル	
	CAN 1 1/2 03/01/20	1,000,000	994,530.00	
	CAN 2 1/2 06/01/24	1,350,000	1,381,225.50	
	CAN 3 1/2 12/01/45	400,000	505,344.00	
	CAN 3 1/4 06/01/21	2,000,000	2,074,560.00	
加ドル小計		4,750,000	4,955,659.50 (410,675,502)	
	銘柄数	4		
	比率	2.1%	2.2%	
メキシコペソ			メキシコペソ	
	MBONO 6 1/2 06/10/21	4,000,000	3,849,741.60	
	MBONO 8 1/2 05/31/29	11,000,000	11,455,400.00	
	MBONO 8 12/07/23	10,000,000	9,995,000.00	
メキシコペソ 小計		25,000,000	25,300,141.60 (135,608,758)	
	銘柄数	3		
	比率	0.7%	0.7%	
ユーロ			ユーロ	
	BGB 0 1/2 10/22/24	300,000	304,950.00	
	BGB 0.8 06/22/25	500,000	516,650.00	
	BGB 0.8 06/22/27	500,000	506,700.00	
	BGB 0.8 06/22/28	300,000	300,510.00	
	BGB 1 06/22/26	500,000	520,750.00	
	BGB 1 06/22/31	100,000	99,800.00	
	BGB 1 1/4 04/22/33	200,000	202,220.00	
	BGB 2 1/4 06/22/57	100,000	108,740.00	
	BGB 3 06/22/34	200,000	252,260.00	
	BGB 3 3/4 06/22/45	300,000	437,910.00	
	BGB 5 03/28/35	500,000	784,750.00	
	BTPS 0.95 03/01/23	1,100,000	1,072,830.00	
	BTPS 1.45 05/15/25	700,000	672,070.00	

BTPS 1.6 06/01/26	1,100,000	1,050,500.00	
BTPS 2 02/01/28	500,000	477,650.00	
BTPS 2.05 08/01/27	900,000	868,410.00	
BTPS 2.15 12/15/21	400,000	415,040.00	
BTPS 3 3/4 05/01/21	1,400,000	1,511,860.00	
BTPS 3.45 03/01/48	300,000	300,150.00	
BTPS 4 09/01/20	800,000	857,120.00	
BTPS 4 3/4 08/01/23	400,000	462,000.00	
BTPS 4 3/4 09/01/21	400,000	447,280.00	
BTPS 4 3/4 09/01/28	200,000	236,920.00	
BTPS 4 3/4 09/01/44	600,000	736,860.00	
BTPS 5 03/01/22	2,100,000	2,387,490.00	
BTPS 5 03/01/25	100,000	118,490.00	
BTPS 5 08/01/39	500,000	628,250.00	
BTPS 5 09/01/40	700,000	874,300.00	
BTPS 5 1/2 11/01/22	200,000	234,280.00	
BTPS 5.25 11/01/29	100,000	123,830.00	
BTPS 6 05/01/31	100,000	133,010.00	
DBR 0 1/2 02/15/28	100,000	101,380.00	
DBR 2 1/2 08/15/46	600,000	804,060.00	
DBR 3 07/04/20	100,000	107,482.00	
DBR 4 3/4 07/04/34	600,000	963,060.00	
DBR 4 3/4 07/04/40	300,000	527,760.00	
DBR 5 5/8 01/04/28	1,300,000	1,952,860.00	
DBR 5.5 01/04/31	500,000	801,550.00	
DBR 6 1/4 01/04/30	300,000	495,987.00	
DBR 6.25 01/04/24	1,000,000	1,357,520.00	
DBR 6.5 07/04/27	300,000	468,363.00	
FRTR 0 02/25/21	500,000	504,300.00	
FRTR 0 03/25/23	1,200,000	1,203,840.00	
FRTR 0 05/25/22	1,000,000	1,010,900.00	
FRTR 0 3/4 05/25/28	1,000,000	1,007,200.00	
FRTR 1 05/25/27	2,400,000	2,502,720.00	
FRTR 1 1/2 05/25/31	1,200,000	1,284,120.00	
FRTR 1 11/25/25	600,000	632,160.00	
FRTR 1 3/4 11/25/24	1,200,000	1,325,460.00	
FRTR 2 05/25/48	100,000	107,670.00	
FRTR 2 1/2 05/25/30	1,100,000	1,309,660.00	
FRTR 2 1/4 05/25/24	100,000	113,120.00	
FRTR 3 1/4 05/25/45	500,000	688,950.00	
FRTR 3 1/4 10/25/21	600,000	673,770.00	
FRTR 4 04/25/55	500,000	807,150.00	

	FRTR 5 1/2 04/25/29	1,000,000	1,503,700.00	
	FRTR 5 3/4 10/25/32	200,000	329,040.00	
	FRTR4.5 04/25/41	900,000	1,448,280.00	
	NETHER 0 01/15/22	500,000	507,075.00	
	NETHER 0 01/15/24	300,000	299,760.00	
	NETHER 0 3/4 07/15/27	500,000	515,050.00	
	NETHER 0 3/4 07/15/28	700,000	712,600.00	
	NETHER 1 3/4 07/15/23	500,000	549,325.00	
	NETHER 2 3/4 01/15/47	400,000	558,560.00	
	OBL 0 04/14/23	1,000,000	1,012,360.00	
	OBL 0 10/07/22	1,400,000	1,420,846.00	
	OBL 0 10/08/21	400,000	406,548.00	
	SPGB 0.05 01/31/21	400,000	402,380.00	
	SPGB 1.3 10/31/26	1,300,000	1,330,550.00	
	SPGB 2.7 10/31/48	100,000	105,350.00	
	SPGB 3.8 04/30/24	1,200,000	1,427,520.00	
	SPGB 4 04/30/20	500,000	539,675.00	
	SPGB 4.4 10/31/23	800,000	972,200.00	
	SPGB 4.65 07/30/25	1,400,000	1,778,840.00	
	SPGB 4.7 07/30/41	200,000	291,360.00	
	SPGB 5.15 10/31/28	600,000	821,340.00	
	SPGB 5.15 10/31/44	400,000	623,000.00	
	SPGB 6 01/31/29	300,000	438,690.00	
ユーロ小計		48,200,000	56,388,671.00 (7,186,736,118)	
	銘柄数	78		
	比率	37.5%	38.0%	
英ポンド			英ポンド	
	UKT 0 1/2 07/22/22	1,300,000	1,279,590.00	
	UKT 0 3/4 07/22/23	600,000	589,500.00	
	UKT 1 1/2 01/22/21	600,000	611,850.00	
	UKT 1 1/4 07/22/27	500,000	495,000.00	
	UKT 1 5/8 10/22/28	100,000	101,520.00	
	UKT 1 5/8 10/22/71	100,000	102,170.00	
	UKT 2 07/22/20	300,000	307,800.00	
	UKT 2 1/2 07/22/65	200,000	261,340.00	
	UKT 3 1/2 07/22/68	500,000	830,000.00	
	UKT 4 1/4 03/07/36	100,000	138,740.00	
	UKT 4 1/4 09/07/39	500,000	720,450.00	
	UKT 4 1/4 12/07/40	600,000	873,000.00	
	UKT 4 1/4 12/07/46	100,000	155,110.00	
	UKT 4 3/4 12/07/30	800,000	1,088,000.00	
	UKT 4 3/4 12/07/38	400,000	607,480.00	

	UKT 4.25 06/07/32	800,000	1,063,680.00	
	UKT 4.5 09/07/34	800,000	1,119,200.00	
	UKT 6 12/07/28	100,000	144,760.00	
英ポンド小計		8,400,000	10,489,190.00 (1,520,303,198)	
	銘柄数	18		
	比率	7.9%	8.0%	
スウェーデン クローネ	SGB 1 1/2 11/13/23	15,000,000	スウェーデン クローネ 16,325,400.00	
スウェーデン クローネ小計		15,000,000	16,325,400.00 (201,781,944)	
	銘柄数	1		
	比率	1.1%	1.1%	
ポーランド ズロチ	POLGB 3 1/4 07/25/25	2,300,000	ポーランドズロチ 2,342,090.00	
ポーランド ズロチ小計		2,300,000	2,342,090.00 (69,208,759)	
	銘柄数	1		
	比率	0.4%	0.4%	
豪ドル	ACGB 1 3/4 11/21/20	900,000	豪ドル 893,610.00	
	ACGB 2 3/4 06/21/35	300,000	292,800.00	
	ACGB 2 3/4 11/21/27	100,000	101,020.00	
	ACGB 3 1/4 04/21/25	1,100,000	1,151,810.00	
	ACGB 3 1/4 06/21/39	300,000	309,720.00	
	ACGB 3 3/4 04/21/37	400,000	445,160.00	
	ACGB 4 1/2 04/21/33	100,000	120,200.00	
	ACGB 4 1/4 04/21/26	1,200,000	1,343,520.00	
	ACGB 4 3/4 04/21/27	1,000,000	1,165,600.00	
	ACGB 5 1/2 04/21/23	100,000	114,580.00	
豪ドル小計		5,500,000	5,938,020.00 (482,761,026)	
	銘柄数	10		
	比率	2.5%	2.5%	
シンガポール ドル	SIGB 3 09/01/24	200,000	シンガポールドル 207,520.00	
シンガポール ドル小計		200,000	207,520.00 (16,840,248)	
	銘柄数	1		
	比率	0.1%	0.1%	
国債証券合計			円 18,934,835,806 (18,934,835,806)	
合計			円 18,934,835,806 (18,934,835,806)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

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。

【中間財務諸表】

- (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6月21日から2018年12月20日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

中間財務諸表

【東京海上セレクション・バランス30】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2018年 6月20日現在	当中間計算期間末 2018年12月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	281,864,360	291,376,487
親投資信託受益証券	9,115,506,194	9,123,067,670
未収入金	48,807,854	58,571,699
流動資産合計	9,446,178,408	9,473,015,856
資産合計		
	9,446,178,408	9,473,015,856
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,908,679	11,122,515
未払受託者報酬	3,971,919	4,127,808
未払委託者報酬	43,194,547	44,889,875
未払利息	745	786
その他未払費用	242,236	243,000
流動負債合計	50,318,126	60,383,984
負債合計		
	50,318,126	60,383,984
純資産の部		
元本等		
元本	1 5,484,487,232	1 5,715,417,559
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	3,911,373,050	3,697,214,313
(分配準備積立金)	1,561,153,856	1,500,101,231
元本等合計	9,395,860,282	9,412,631,872
純資産合計		
	9,395,860,282	9,412,631,872
負債純資産合計		
	9,446,178,408	9,473,015,856

(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 6月21日 至 2017年12月20日	当中間計算期間 自 2018年 6月21日 至 2018年12月20日
営業収益		
受取利息	3,244	1,020
有価証券売買等損益	482,529,669	326,969,919
営業収益合計	482,532,913	326,968,899
営業費用		
支払利息	91,641	127,328
受託者報酬	3,749,784	4,127,808
委託者報酬	40,778,846	44,889,875
その他費用	234,072	243,000
営業費用合計	44,854,343	49,388,011
営業利益又は営業損失()	437,678,570	376,356,910
経常利益又は経常損失()	437,678,570	376,356,910
中間純利益又は中間純損失()	437,678,570	376,356,910
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()	9,954,258	2,537,690
期首剰余金又は期首欠損金()	3,270,756,147	3,911,373,050
剰余金増加額又は欠損金減少額	338,665,343	319,174,329
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	338,665,343	319,174,329
剰余金減少額又は欠損金増加額	186,838,707	159,513,846
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	186,838,707	159,513,846
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()	3,850,307,095	3,697,214,313

(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 6月21日 至 2018年12月20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 6月20日現在	当中間計算期間末 2018年12月20日現在
1. 1 期首元本額	5,074,951,232円	5,484,487,232円
期中追加設定元本額	995,848,750円	454,625,598円
期中一部解約元本額	586,312,750円	223,695,271円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の 総数	5,484,487,232口	5,715,417,559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 6月21日 至 2017年12月20日	当中間計算期間 自 2018年 6月21日 至 2018年12月20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 6月20日現在	当中間計算期間末 2018年12月20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 6月20日現在		当中間計算期間末 2018年12月20日現在	
1口当たり純資産額	1.7132円	1口当たり純資産額	1.6469円
(1万口当たり純資産額	17,132円)	(1万口当たり純資産額	16,469円)

【東京海上セレクション・バランス50】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2018年 6月20日現在	当中間計算期間末 2018年12月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	650,485,262	659,482,097
親投資信託受益証券	21,046,010,576	20,187,356,984
未収入金	131,206,042	139,318,204
流動資産合計	21,827,701,880	20,986,157,285
資産合計	21,827,701,880	20,986,157,285
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,122,403	8,937,787
未払受託者報酬	9,185,868	9,434,833
未払委託者報酬	121,712,695	125,011,401
未払利息	1,721	1,779
その他未払費用	243,000	243,000
流動負債合計	135,265,687	143,628,800
負債合計	135,265,687	143,628,800
純資産の部		
元本等		
元本	11,252,342,656	11,590,992,579
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	10,440,093,537	9,251,535,906
(分配準備積立金)	5,119,328,822	4,922,933,752
元本等合計	21,692,436,193	20,842,528,485
純資産合計	21,692,436,193	20,842,528,485
負債純資産合計	21,827,701,880	20,986,157,285

(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 6月21日 至 2017年12月20日	当中間計算期間 自 2018年 6月21日 至 2018年12月20日
営業収益		
受取利息	7,459	2,342
有価証券売買等損益	1,750,564,993	1,359,771,933
営業収益合計	1,750,572,452	1,359,769,591
営業費用		
支払利息	211,290	291,916
受託者報酬	8,670,486	9,434,833
委託者報酬	114,883,877	125,011,401
その他費用	243,000	243,000
営業費用合計	124,008,653	134,981,150
営業利益又は営業損失()	1,626,563,799	1,494,750,741
経常利益又は経常損失()	1,626,563,799	1,494,750,741
中間純利益又は中間純損失()	1,626,563,799	1,494,750,741
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()	33,573,768	5,420,804
期首剰余金又は期首欠損金()	8,577,820,154	10,440,093,537
剰余金増加額又は欠損金減少額	628,156,257	715,010,991
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	628,156,257	715,010,991
剰余金減少額又は欠損金増加額	463,480,210	414,238,685
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	463,480,210	414,238,685
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	10,335,486,232	9,251,535,906

(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 6月21日 至 2018年12月20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 6月20日現在	当中間計算期間末 2018年12月20日現在
1. 1 期首元本額	10,721,202,081円	11,252,342,656円
期中追加設定元本額	1,537,635,326円	785,140,660円
期中一部解約元本額	1,006,494,751円	446,490,737円
2. 1 中間計算期間末日における受益権 の総数	11,252,342,656口	11,590,992,579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 6月21日 至 2017年12月20日	当中間計算期間 自 2018年 6月21日 至 2018年12月20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 6月20日現在	当中間計算期間末 2018年12月20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 6月20日現在		当中間計算期間末 2018年12月20日現在	
1口当たり純資産額	1.9278円	1口当たり純資産額	1.7982円
(1万口当たり純資産額	19,278円)	(1万口当たり純資産額	17,982円)

【東京海上セレクション・バランス70】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2018年 6月20日現在	当中間計算期間末 2018年12月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	426,083,864	428,843,067
親投資信託受益証券	13,786,727,719	12,821,498,804
未収入金	98,047,630	101,226,896
流動資産合計	14,310,859,213	13,351,568,767
資産合計	14,310,859,213	13,351,568,767
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,437,175	3,215,467
未払受託者報酬	6,009,152	6,161,780
未払委託者報酬	92,390,708	94,737,384
未払利息	1,127	1,156
その他未払費用	243,000	243,000
流動負債合計	101,081,162	104,358,787
負債合計	101,081,162	104,358,787
純資産の部		
元本等		
元本	1 6,759,588,514	1 6,974,161,989
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	7,450,189,537	6,273,047,991
(分配準備積立金)	3,685,815,877	3,487,577,932
元本等合計	14,209,778,051	13,247,209,980
純資産合計	14,209,778,051	13,247,209,980
負債純資産合計	14,310,859,213	13,351,568,767

(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 6月21日 至 2017年12月20日	当中間計算期間 自 2018年 6月21日 至 2018年12月20日
営業収益		
受取利息	4,672	1,535
有価証券売買等損益	1,492,405,107	1,299,633,628
営業収益合計	1,492,409,779	1,299,632,093
営業費用		
支払利息	132,866	191,201
受託者報酬	5,473,179	6,161,780
委託者報酬	84,150,081	94,737,384
その他費用	243,000	243,000
営業費用合計	89,999,126	101,333,365
営業利益又は営業損失()	1,402,410,653	1,400,965,458
経常利益又は経常損失()	1,402,410,653	1,400,965,458
中間純利益又は中間純損失()	1,402,410,653	1,400,965,458
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()	31,046,465	3,504,161
期首剰余金又は期首欠損金()	5,706,057,656	7,450,189,537
剰余金増加額又は欠損金減少額	571,625,410	638,258,530
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	571,625,410	638,258,530
剰余金減少額又は欠損金増加額	352,926,738	417,938,779
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	352,926,738	417,938,779
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()	7,296,120,516	6,273,047,991

(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 6月21日 至 2018年12月20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 6月20日現在	当中間計算期間末 2018年12月20日現在
1. 1 期首元本額	6,275,550,909円	6,759,588,514円
期中追加設定元本額	1,236,700,333円	593,801,666円
期中一部解約元本額	752,662,728円	379,228,191円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の 総数	6,759,588,514口	6,974,161,989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 6月21日 至 2017年12月20日	当中間計算期間 自 2018年 6月21日 至 2018年12月20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 6月20日現在	当中間計算期間末 2018年12月20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 6月20日現在		当中間計算期間末 2018年12月20日現在	
1口当たり純資産額	2.1022円	1口当たり純資産額	1.8995円
(1万口当たり純資産額	21,022円)	(1万口当たり純資産額	18,995円)

(ご参考)

東京海上セレクション・バランス30、東京海上セレクション・バランス50、東京海上セレクション・バランス70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

		2018年 6月20日現在	2018年12月20日現在
区 分	注記 番号	金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
金銭信託		31,319	704,059
コール・ローン		434,209,854	561,293,883
株式		43,964,367,420	39,044,261,320
未収入金		1,319,775,104	236,219,567
未収配当金		276,379,750	1,651,500
流動資産合計		45,994,763,447	39,844,130,329
資産合計		45,994,763,447	39,844,130,329
負債の部			
流動負債			
未払金		992,824,757	240,582,234
未払解約金		424,584,269	383,814,912
未払利息		1,148	1,514
流動負債合計		1,417,410,174	624,398,660
負債合計		1,417,410,174	624,398,660
純資産の部			
元本等			

元本	1	28,273,729,749	29,248,042,712
剰余金			
剰余金又は欠損金()		16,303,623,524	9,971,688,957
元本等合計		44,577,353,273	39,219,731,669
純資産合計		44,577,353,273	39,219,731,669
負債純資産合計		45,994,763,447	39,844,130,329

(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 6月21日 至 2018年12月20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 6月20日現在	2018年12月20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	28,397,944,734円	28,273,729,749円
同期中における追加設定元本額	8,160,178,604円	5,113,439,447円
同期中における一部解約元本額	8,284,393,589円	4,139,126,484円
同中間期末における元本額	28,273,729,749円	29,248,042,712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>	272,459,341円	277,245,119円
東京海上日本株アクティブファンド	202,435,594円	201,120,169円
東京海上・未来設計ファンド1	3,704,685円	3,845,089円
東京海上・未来設計ファンド2	15,183,551円	15,930,973円
東京海上・未来設計ファンド3	65,734,809円	67,855,529円
東京海上・未来設計ファンド4	29,748,739円	29,729,571円
東京海上・未来設計ファンド5	102,311,405円	105,045,794円
東京海上セレクション・日本株式	16,896,749,899円	17,138,522,700円
東京海上セレクション・バランス30	1,182,856,918円	1,289,651,074円
東京海上セレクション・バランス50	4,772,940,914円	5,105,629,919円
東京海上セレクション・バランス70	4,462,288,000円	4,739,065,964円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	55,589,708円	71,022,585円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	158,742,803円	151,099,596円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	38,567,973円	38,245,529円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	14,415,410円	14,033,101円
計	28,273,729,749円	29,248,042,712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	28,273,729,749口	29,248,042,712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 6月20日現在	2018年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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 6月20日現在		2018年12月20日現在	
1口当たり純資産額	1.5766円	1口当たり純資産額	1.3409円
(1万口当たり純資産額	15,766円)	(1万口当たり純資産額	13,409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 6月20日現在	2018年12月20日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金			550,000
コール・ローン		683,481,296	1,008,048,523
国債証券		116,977,260,539	79,113,329,795
地方債証券		1,573,853,043	2,270,328,178

特殊債券		2,402,362,000	2,803,262,000
社債券		39,854,594,724	48,073,905,937
未収入金		1,521,478,665	101,897,700
未収利息		157,995,112	128,235,741
前払費用		44,038,047	17,275,016
流動資産合計		163,215,063,426	133,516,832,890
資産合計		163,215,063,426	133,516,832,890
負債の部			
流動負債			
未払金		506,012,000	500,976,000
未払解約金		672,414,976	351,663,837
未払利息		1,808	2,719
流動負債合計		1,178,428,784	852,642,556
負債合計		1,178,428,784	852,642,556
純資産の部			
元本等			
元本	1	116,473,325,198	95,188,028,959
剰余金			
剰余金又は欠損金()		45,563,309,444	37,476,161,375
元本等合計		162,036,634,642	132,664,190,334
純資産合計		162,036,634,642	132,664,190,334
負債純資産合計		163,215,063,426	133,516,832,890

(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 6月21日 至 2018年12月20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 6月20日現在	2018年12月20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	79,122,009,130円	116,473,325,198円
同期中における追加設定元本額	64,415,915,490円	8,676,925,515円
同期中における一部解約元本額	27,064,599,422円	29,962,221,754円
同中間期末における元本額	116,473,325,198円	95,188,028,959円
元本の内訳*		
東京海上・国内債券ファンド	273,490,830円	253,685,891円
東京海上・未来設計ファンド1	18,941,438円	18,688,050円
東京海上・未来設計ファンド2	34,501,647円	34,406,041円
東京海上・未来設計ファンド3	74,686,052円	73,267,475円

東京海上・未来設計ファンド4	8,450,067円	8,028,422円
東京海上セレクション・バランス30	3,158,215,764円	3,273,493,220円
東京海上セレクション・バランス50	4,183,304,627円	4,254,882,573円
東京海上セレクション・バランス70	1,013,982,188円	1,023,958,352円
東京海上セレクション・日本債券	10,965,413,971円	11,333,429,943円
東京海上・日本債券オープン (野村SMA向け)	9,913,429,049円	7,703,169,692円
東京海上・日本債券オープン (野村SMA・EW向け)	22,043,156,765円	21,745,304,926円
東京海上・年金運用型戦略ファンド (年1回決算型)	88,452,522円	107,327,168円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	1,081,724,048円	979,004,380円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	87,613,294円	82,599,404円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	10,918,742円	10,102,226円
東京海上・日本債券オープンF (適格機関投資家専用)	63,517,044,194円	44,286,681,196円
計	116,473,325,198円	95,188,028,959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	116,473,325,198口	95,188,028,959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 6月20日現在	2018年12月20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 6月20日現在		2018年12月20日現在	
1口当たり純資産額	1.3912円	1口当たり純資産額	1.3937円
(1万口当たり純資産額	13,912円)	(1万口当たり純資産額	13,937円)

「TMA外国株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	2018年 6月20日現在	2018年12月20日現在
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		335,208,767	202,321,689
コール・ローン		461,087,858	1,083,897,602
株式		29,175,858,623	26,060,261,215
未収配当金		40,512,474	20,868,214
流動資産合計		30,012,667,722	27,367,348,720
資産合計		30,012,667,722	27,367,348,720
負債の部			
流動負債			
未払解約金		230,717,679	252,002,818
未払利息		1,220	2,924
流動負債合計		230,718,899	252,005,742
負債合計		230,718,899	252,005,742
純資産の部			
元本等			
元本	1	11,599,728,358	11,652,742,994
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		18,182,220,465	15,462,599,984
元本等合計		29,781,948,823	27,115,342,978
純資産合計		29,781,948,823	27,115,342,978
負債純資産合計		30,012,667,722	27,367,348,720

(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 6月21日 至 2018年12月20日
1. 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。

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 6月20日現在	2018年12月20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	11,578,492,501円	11,599,728,358円
同期中における追加設定元本額	2,041,299,727円	1,113,728,309円
同期中における一部解約元本額	2,020,063,870円	1,060,713,673円
同中間期末における元本額	11,599,728,358円	11,652,742,994円
元本の内訳*		
東京海上・外国株式ファンド	20,538,321円	20,035,988円
東京海上・未来設計ファンド1	2,355,947円	2,276,401円
東京海上・未来設計ファンド2	7,241,979円	7,073,452円
東京海上・未来設計ファンド3	34,836,894円	33,475,245円
東京海上・未来設計ファンド4	16,554,491円	15,401,346円
東京海上・未来設計ファンド5	58,562,874円	55,969,166円
東京海上セレクション・外国株式	8,476,943,285円	8,556,737,165円
東京海上セレクション・バランス30	376,156,294円	381,718,455円
東京海上セレクション・バランス50	1,301,095,714円	1,295,372,737円
東京海上セレクション・バランス70	1,135,387,780円	1,122,224,146円
東京海上・年金運用型戦略ファンド (年1回決算型)	35,351,340円	42,057,199円
TMA バランス25V A 適格機関投資家限定	100,993,284円	89,452,395円
TMA バランス50V A 適格機関投資家限定	24,541,428円	22,641,716円
TMA バランス75V A 適格機関投資家限定	9,168,727円	8,307,583円
計	11,599,728,358円	11,652,742,994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	11,599,728,358口	11,652,742,994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 6月20日現在	2018年12月20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

（2018年6月20日現在）

該当事項はありません。

（2018年12月20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 6月20日現在		2018年12月20日現在	
1口当たり純資産額	2.5675円	1口当たり純資産額	2.3269円
（1万口当たり純資産額	25,675円）	（1万口当たり純資産額	23,269円）

「TMA外国債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		2018年 6月20日現在	2018年12月20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		32,264,527	44,752,407
コール・ローン		184,697,237	188,036,569
国債証券		18,934,835,806	19,479,584,479
派生商品評価勘定		192,000	
未収入金		393,786,574	16,350,712
未収利息		76,215,981	118,622,144
前払費用		64,148,365	39,287,261
流動資産合計		19,686,140,490	19,886,633,572
資産合計		19,686,140,490	19,886,633,572
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		80,000	
未払金		400,417,768	21,855,620
未払解約金		116,450,241	123,537,303
未払利息		488	507
流動負債合計		516,948,497	145,393,430
負債合計		516,948,497	145,393,430
純資産の部			
元本等			
元本	1	8,950,848,357	9,014,449,158
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		10,218,343,636	10,726,790,984
元本等合計		19,169,191,993	19,741,240,142
純資産合計		19,169,191,993	19,741,240,142
負債純資産合計		19,686,140,490	19,886,633,572

(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 6月21日 至 2018年12月20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</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 6月20日現在	2018年12月20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	8,318,589,517円	8,950,848,357円
同期中における追加設定元本額	1,779,533,003円	751,854,230円
同期中における一部解約元本額	1,147,274,163円	688,253,429円
同中間期末における元本額	8,950,848,357円	9,014,449,158円
元本の内訳*		
東京海上・外国債券ファンド	17,466,473円	19,882,346円
東京海上・未来設計ファンド1	1,382,703円	1,322,747円
東京海上・未来設計ファンド2	5,666,947円	5,479,410円
東京海上・未来設計ファンド3	16,356,120円	15,557,982円
東京海上・未来設計ファンド4	5,551,600円	5,114,441円
東京海上・未来設計ファンド5	7,637,308円	7,226,121円
東京海上セレクション・外国債券	4,820,029,385円	4,926,563,797円
東京海上セレクション・バランス30	883,042,083円	887,345,376円
東京海上セレクション・バランス50	2,036,148,342円	2,007,755,783円
東京海上セレクション・バランス70	1,132,669,180円	1,108,900,061円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	24,898,216円	29,301,094円
計	8,950,848,357円	9,014,449,158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	8,950,848,357口	9,014,449,158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 6月20日現在	2018年12月20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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)
取引の時価等に関する事項

通貨関連

(2018年6月20日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買建	48,582,000		48,774,000	192,000
	豪ドル	48,582,000		48,774,000	192,000
	売建	50,900,000		50,980,000	80,000
	ユーロ	50,900,000		50,980,000	80,000
	合計	99,482,000		99,754,000	112,000

(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。

(2018年12月20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 6月20日現在		2018年12月20日現在	
1口当たり純資産額	2.1416円	1口当たり純資産額	2.1900円
(1万口当たり純資産額	21,416円)	(1万口当たり純資産額	21,900円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

東京海上セレクション・バランス30

2019年1月31日現在

種類	金額
資産総額	9,637,503,042 円
負債総額	13,145,428 円
純資産総額(-)	9,624,357,614 円
発行済数量	5,777,800,186 口
1単位当たり純資産額(/)	1.6657 円

東京海上セレクション・バランス50

2019年1月31日現在

種類	金額
資産総額	21,462,476,504 円
負債総額	38,874,455 円
純資産総額(-)	21,423,602,049 円
発行済数量	11,693,944,765 口
1単位当たり純資産額(/)	1.8320 円

東京海上セレクション・バランス70

2019年1月31日現在

種類	金額
資産総額	13,778,169,624 円
負債総額	28,159,705 円
純資産総額(-)	13,750,009,919 円
発行済数量	7,049,797,924 口
1単位当たり純資産額(/)	1.9504 円

(ご参考:親投資信託の現況)

TMA日本株アクティブマザーファンド

2019年1月31日現在

種類	金額
資産総額	42,797,188,808 円
負債総額	502,932,589 円
純資産総額(-)	42,294,256,219 円
発行済数量	30,222,873,106 口
1単位当たり純資産額(/)	1.3994 円

TMA日本債券マザーファンド

2019年1月31日現在

種類	金額
----	----

資産総額	130,992,817,899 円
負債総額	1,086,691,611 円
純資産総額(-)	129,906,126,288 円
発行済数量	92,702,072,531 口
1 単位当たり純資産額(/)	1.4013 円

TMA 外国株式マザーファンド

2019年1月31日現在

種類	金額
資産総額	28,885,499,407 円
負債総額	11,544,009 円
純資産総額(-)	28,873,955,398 円
発行済数量	11,886,517,535 口
1 単位当たり純資産額(/)	2.4291 円

TMA 外国債券マザーファンド

2019年1月31日現在

種類	金額
資産総額	19,634,827,086 円
負債総額	469,885,826 円
純資産総額(-)	19,164,941,260 円
発行済数量	8,890,820,964 口
1 単位当たり純資産額(/)	2.1556 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、振替受益権となり、委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

1. 名義書換
該当事項はありません。
2. 受益者に対する特典
特典はありません。
3. 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

4. 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとし、

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとし、ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等(当該他の振替機関等の上位機関を含みます。)に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとし、

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等

において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

5. 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

6. 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

7. 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)にお支払いします。

8. 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

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】

2019年1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】

「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。

2019年1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	179	2,545,855
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	2	5,690
合計	181	2,551,545

3【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。
また、当社の中間財務諸表は、「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条及び第57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。
また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間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
------------	-------------

(口) 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 (平成29年3月31日現在)		第33期 (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
						役員の兼任				
同一の親会社をもつ会社	Delphi Capital Management, Inc.	米国・ニューヨーク	USD 1千	資産運用業	なし	運用の再委託	委託調査費の支払	763,120	未払金	225,715

(注) * 取引価格については、市場実勢等を勘案し、交渉の上決定しております。

* 取引金額には、消費税等は含まれておりません。

- (4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主(個人の場合に限る。)等重要な取引はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する情報

(1) 親会社情報

東京海上ホールディングス株式会社(東京証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

重要な関連会社はありません。

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
						役員の兼任				
同一の親会社をもつ会社	Delphi Capital Management, Inc.	米国・ニューヨーク	USD 1千	資産運用業	なし	運用の再委託	委託調査費の支払	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

中間財務諸表
中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間		
(平成30年9月30日現在)		
資産の部		
流動資産		
現金・預金		15,126,277
前払費用		154,617
未収委託者報酬		1,680,394
未収収益		2,651,942
未収入金		5,094
その他の流動資産		16,835
流動資産計		19,635,161
固定資産		
有形固定資産	* 1	519,494
建物		394,786
器具備品		124,577
リース資産		130
無形固定資産		19,884
電話加入権		3,795
ソフトウェア仮勘定		16,089
投資その他の資産		2,957,084
投資有価証券		45,761
関係会社株式		1,673,049
その他の関係会社有価証券		31,200
長期前払費用		10,974
敷金		450,632
その他長期差入保証金		10,041
繰延税金資産		735,425
固定資産計		3,496,463
資産合計		23,131,625
負債の部		
流動負債		
リース債務		137
未払金		1,762,594
未払手数料		720,029
その他未払金		1,042,565
未払費用		545,708
未払消費税等	* 2	89,361
未払法人税等		930,000
預り金		50,351
前受収益		14,126
賞与引当金		563,759
流動負債計		3,956,039
固定負債		
退職給付引当金		396,749
固定負債計		396,749
負債合計		4,352,788
純資産の部		
株主資本		18,774,855
資本金		2,000,000

資本剰余金	400,000
その他資本剰余金	400,000
利益剰余金	16,374,855
利益準備金	500,000
その他利益剰余金	15,874,855
特別償却準備金	27
繰越利益剰余金	15,874,827
評価・換算差額等	3,981
その他有価証券評価差額金	3,981
純資産合計	18,778,836
負債・純資産合計	23,131,625

中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	6,132,231
運用受託報酬	4,641,565
投資助言報酬	34,631
その他営業収益	152,377
営業収益計	10,960,805
営業費用	
支払手数料	2,827,682
広告宣伝費	98,650
調査費	2,925,394
調査費	1,292,525
委託調査費	1,632,868
委託計算費	58,436
営業雑経費	123,684
通信費	16,674
印刷費	81,768
協会費	12,247
諸会費	6,347
図書費	6,647
営業費用計	6,033,848
一般管理費	
給料	1,372,499
役員報酬	63,057
給料・手当	1,168,770
賞与	140,672
交際費	8,371
寄付金	32
旅費交通費	100,092
租税公課	70,448
不動産賃借料	189,825
退職給付費用	53,821
賞与引当金繰入	563,759
固定資産減価償却費	* 1 44,351
法定福利費	281,061
福利厚生費	9,108
諸経費	234,474

一般管理費計	2,927,845
営業利益	1,999,110
営業外収益	
受取利息	55
受取配当金	89
雑益	6,427
営業外収益計	6,571
営業外費用	
為替差損	23,262
雑損	975
営業外費用計	24,237
経常利益	1,981,444
税引前中間純利益	1,981,444
法人税、住民税及び事業税	868,241
法人税等調整額	249,110
法人税等合計	619,130
中間純利益	1,362,313

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30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
当中間期変動額						
剰余金の配当						1,901,595
特別償却準備金の取崩					10	10
中間純利益						1,362,313
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）						
当中間期変動額合計	-	-	-	-	10	539,270
当中間期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	27	15,874,827

	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
当中間期変動額					
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	-	-			-
中間純利益	1,362,313	1,362,313			1,362,313
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			1,404	1,404	1,404
当中間期変動額合計	539,281	539,281	1,404	1,404	537,877

当中間期末残高	16,374,855	18,774,855	3,981	3,981	18,778,836
---------	------------	------------	-------	-------	------------

注記事項

重要な会計方針

	当中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)
1. 資産の評価基準及び 評価方法	<p>有価証券</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 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの 中間会計期間末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</p>
2. 固定資産の減価償却 の方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金</p>

	<p>従業員の退職給付に備えるため、当中間会計期間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。</p> <p>退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間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。</p>
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。

(表示方法の変更)

<p>当中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)</p>
<p>(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)</p> <p>「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。</p>

(中間貸借対照表関係)

	<p>当中間会計期間 (平成30年9月30日現在)</p>
1 有形固定資産の減価償却累計額	<p>建物 66,435千円</p> <p>器具備品 452,836千円</p> <p>リース資産 3,787千円</p>
2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。

(中間損益計算書関係)

	<p>当中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)</p>
1 減価償却実施額	有形固定資産 44,351千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

	<p>当中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)</p>			
1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項				
株式の種類	当事業年度期首 (株)	当中間会計期間 増加 (株)	当中間会計期間 減少 (株)	当中間会計期間末 (株)
普通株式	38,300	-	-	38,300
2. 配当に関する事項				

配当金支払額

平成30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・・・・・・・・・・平成30年3月31日
- (ニ) 効力発生日・・・・・・・・・・平成30年6月29日

(リース取引関係)

当中間会計期間(自平成30年4月1日 至平成30年9月30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)

当中間会計期間(平成30年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成30年9月30日現在における中間貸借対照表計上額、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まれておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

	中間貸借対照表計上額(＊)	時価(＊)	差額
(1)現金・預金	15,126,277	15,126,277	-
(2)未収委託者報酬	1,680,394	1,680,394	-
(3)未収収益	2,651,942	2,651,942	-
(4)未収入金	5,094	5,094	-
(5)投資有価証券			
その他有価証券	45,761	45,761	-
(6)預り金	(50,351)	(50,351)	-
(7)未払金	(1,762,594)	(1,762,594)	-
(8)未払費用	(545,708)	(545,708)	-
(9)未払消費税等	(89,361)	(89,361)	-
(10)未払法人税等	(930,000)	(930,000)	-

(＊)負債で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及び有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

- (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)未払消費税等並びに(10)未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5)投資有価証券

時価の算定方法につきましては「重要な会計方針」の「1. 資産の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(注2)子会社株式(中間貸借対照表計上額 1,640,302千円)及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 32,747千円)及びその他の関係会社有価証券(中間貸借対照表計上額 31,200千円)及び敷金(中間貸借対照表計上額 450,632千円)並びにその他長期差入保証金(中間貸借対照表計上額 10,041千円)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ため、上表には含めておりません。

(有価証券関係)

当中間会計期間(平成30年9月30日現在)

1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券

子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 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(中間貸借対照表計上額 31,200千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	証券投資信託	37,371	30,297	7,074
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えないもの	証券投資信託	8,390	9,726	1,335
合計		45,761	40,023	5,738

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

当社は「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として運用（投資運用業）を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

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中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が中間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中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の名称	委託者報酬 （単位：千円）	関連するセグメント名
東京海上・円資産バランスファンド（毎月決算型）	1,652,029	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

（1株当たり情報）

当中間会計期間 （自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）	
1株当たり純資産額	490,309円04銭
1株当たり中間純利益金額	35,569円54銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎

中間貸借対照表の純資産の部の合計額	18,778,836千円
純資産の部の合計額から控除する金額	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額	18,778,836千円
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数	38,300株

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎

中間損益計算書上の中間純利益金額	1,362,313千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	1,362,313千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

通常の利用の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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、及び重要な影響を与えることが予想される事実はありません。

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】

(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(2018年9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(2018年9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
株式会社八十二銀行	52,243百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

() 2018年9月末日現在。

2【関係業務の概要】

受託会社は、信託財産の保管・管理等を行います。また、当ファンドにかかる信託事務の一部につき日本マスタートラスト信託銀行株式会社に委託することがあります。

販売会社は、募集・販売の取扱い、一部解約事務および収益分配金・解約金・償還金の支払い等を行います。

3【資本関係】

資本関係はありません。

第3【その他】

- 1．目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案を使用し、委託会社の名称、ファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- 2．目論見書の表紙に委託会社の金融商品取引業者登録番号および目論見書の使用を開始する日を記載する場合があります。
- 3．請求目論見書に当ファンドの約款を添付します。
- 4．目論見書の別称として「投資信託説明書（目論見書）」、「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用することがあります。
- 5．目論見書は電子媒体として使用されたり、インターネット等に掲載されることがあります。

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。

独立監査人の監査報告書

平成30年8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

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セレクション・バランス30の平成29年6月21日から平成30年6月20日までの計算期間の財務諸表、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。

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、東京海上セレクション・バランス30の平成30年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算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。

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。

独立監査人の監査報告書

平成30年8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

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セレクション・バランス50の平成29年6月21日から平成30年6月20日までの計算期間の財務諸表、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。

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、東京海上セレクション・バランス50の平成30年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算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。

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。

独立監査人の監査報告書

平成30年8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

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セレクション・バランス70の平成29年6月21日から平成30年6月20日までの計算期間の財務諸表、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。

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、東京海上セレクション・バランス70の平成30年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算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。

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。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年12月3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、「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30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、東京海上アセットマネジメント株式会社の平成30年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）の経営成績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

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

2019年2月6日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 荒川 進
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セレクション・バランス30の2018年6月21日から2018年12月20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、東京海上セレクション・バランス30の2018年12月20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6月21日から2018年12月20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

2019年2月6日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 荒川 進
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セレクション・バランス50の2018年6月21日から2018年12月20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、東京海上セレクション・バランス50の2018年12月20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6月21日から2018年12月20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

2019年2月6日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 荒川 進
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セレクション・バランス70の2018年6月21日から2018年12月20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、東京海上セレクション・バランス70の2018年12月20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6月21日から2018年12月20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。