

【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】	2022年3月18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】

2022年3月19日から2022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	グローバル (日本を含む)		
	年2回	日本		
	年4回	北米	ファミリーファン ド	あり ()
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)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
不動産投信	日々	オセアニア		
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 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
		アフリカ		
資産複合() 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)		
		エマージング		

(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めざします。

- 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。
- 各マザーファンドは、それぞれ以下の指数をベンチマークとし、当該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。

資産	マザーファンド	指数
日本株式	TMA日本株アクティブマザーファンド	TOPIX
日本債券	TMA日本債券マザーファンド	NOMURA-BPI(総合)
外国株式	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)
外国債券	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

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
バランス 30	20%	47%	10%	20%	3%
バランス 50	35%	27%	15%	20%	3%
バランス 70	50%	10%	20%	17%	3%

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めざします。

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めざします。

バランス 70

成長性を重視し、中長期的な資産の成長をめざします。

次ページへ続く

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。

3

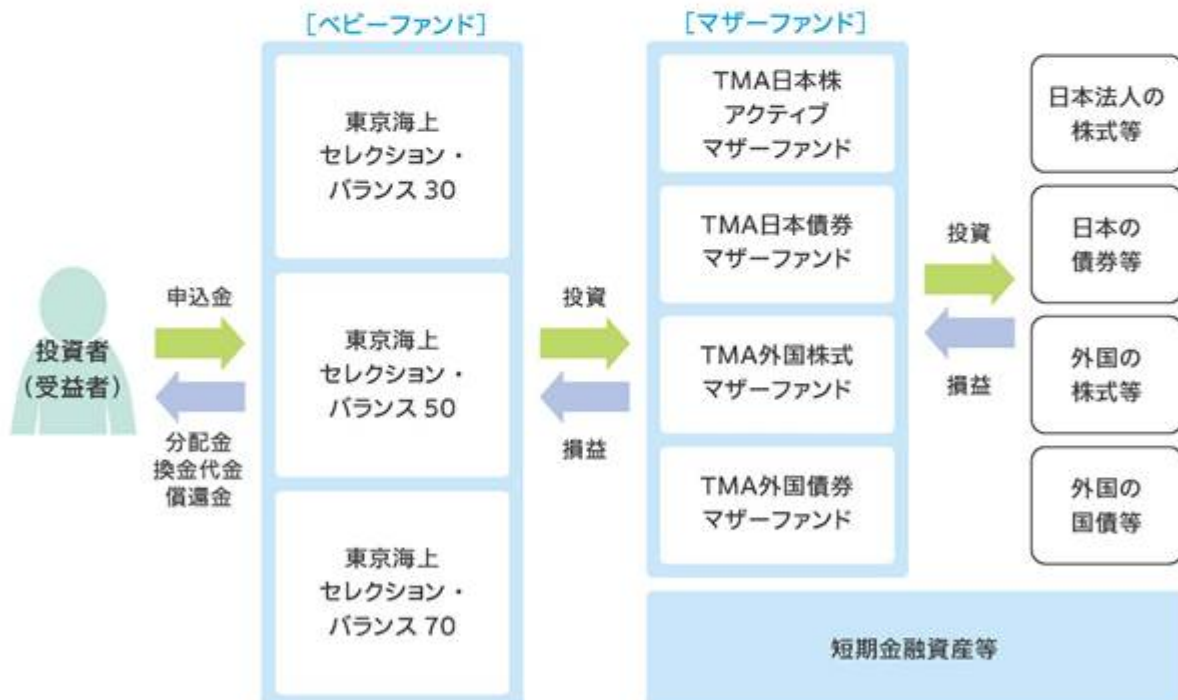
＜基本資産配分＞は、経済見通し、市況動向等の見通し、各資産のリターン予測等に基づいて、原則として年に1回見直し、委託会社が必要と判断した場合には、配分率を変更することがあります。

＜各マザーファンドが対象とする指数について＞

- T O P I Xは日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての適性を有するマーケット・ベンチマークです。T O P I X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、T O P I X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、T O P I Xの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、公表の停止、T O P I Xの商標の変更、使用の停止を行う場合があります。
- N O M U R A - B P I [野村ボンド・パフォーマンス・インデックス] (総合)とは、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。N O M U R A - B P Iは、野村證券の知的財産です。野村證券は、ファンドの運用成績等に関し、一切責任ありません。
- M S C I コクサイ指数 (円ヘッジなし・円ベース)とは、M S C I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M S C I社に帰属します。また、M S C I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。M S C I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。M S C I社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。
- F T S E 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。

ファンドの仕組み

- ファミリーファンド方式により運用を行います。



※「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際に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。

次ページへ続く

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。

主な投資制限

バランス 30

株 式	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%未満とします。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%未満とします。

バランス 50

株 式	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%未満とします。

バランス 70

株 式	株式への実質投資割合には制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の55%未満とします。

分配方針

◎年1回決算を行います。

- 6月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として次の方針に基づき分配を行います。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。)等の全額とします。収益分配金額は、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額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。

《イメージ図》

決算	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
分配												

①上図はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について、示唆・保証するものではありません。実際の分配金額は運用実績に応じて決定されます。

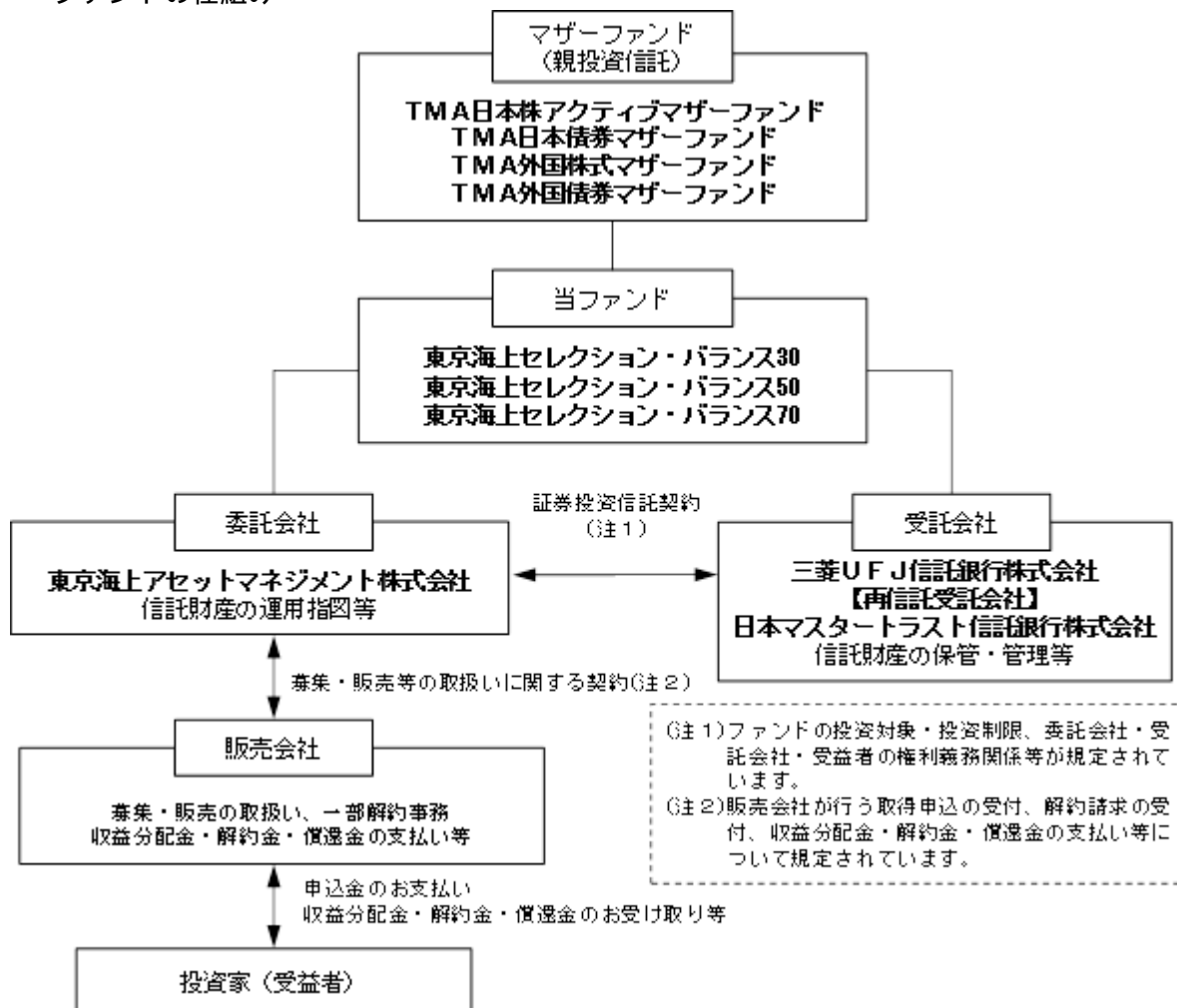
資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(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（2021年12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（2021年12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。
T O P I X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エ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 P E R、P B R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。

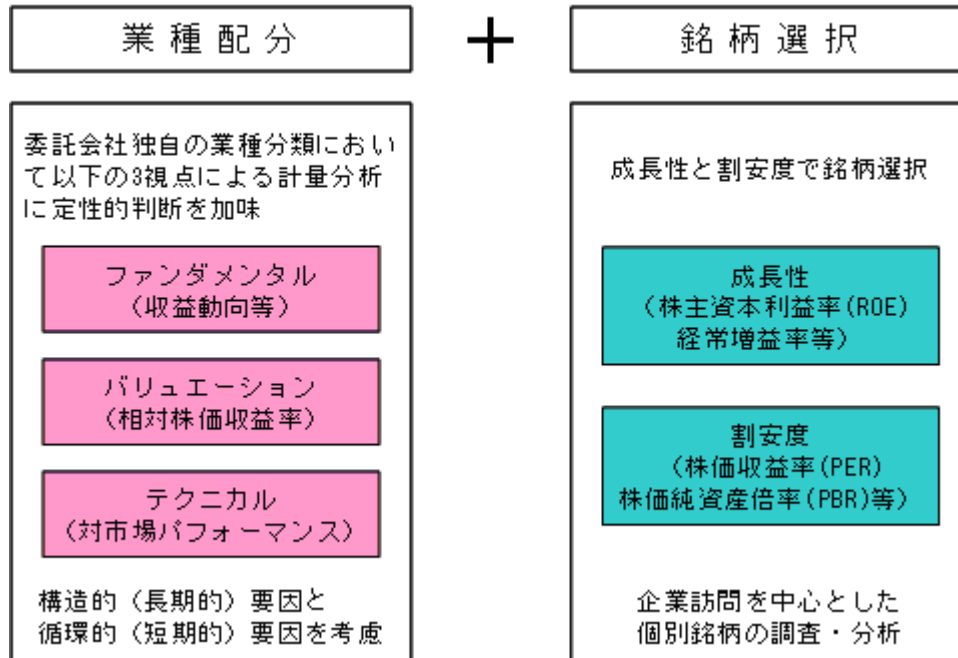
成長性、割安度双方の視点のミックス（G A R P : Growth at a Reasonable Price）

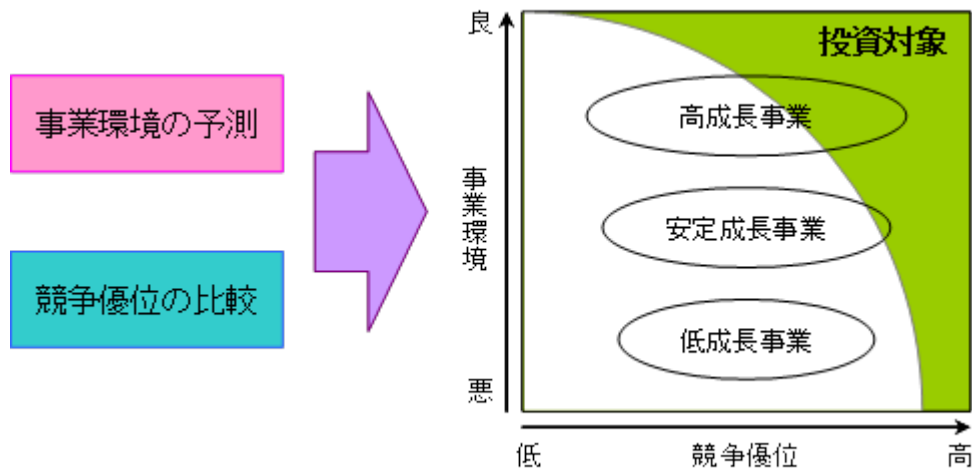
- ・成長性 - R O E、経常増益率、利益予想変化 など
- ・割安度 - 株価純資産倍率、株価収益率、キャッシュフロー倍率 など

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。

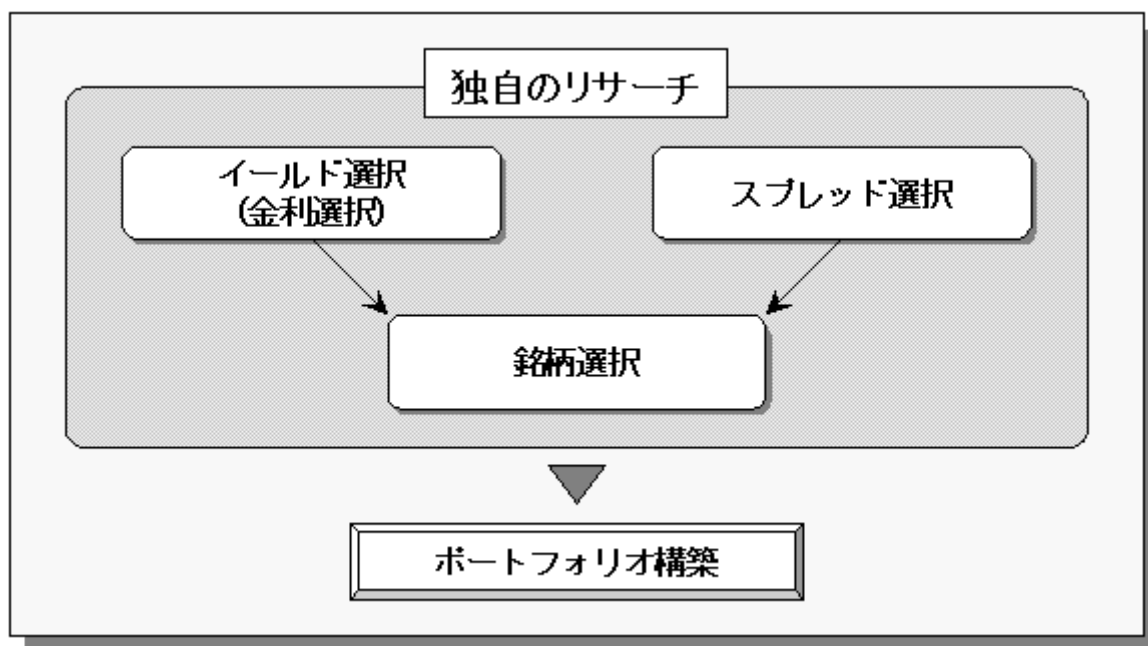
*デュレーションとは、金利の変化に対する債券価格の変動性を示す指標です。その値が大きいほど、金利の変化に対して価格の動きが大きいことを意味します。

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限り。）
- (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

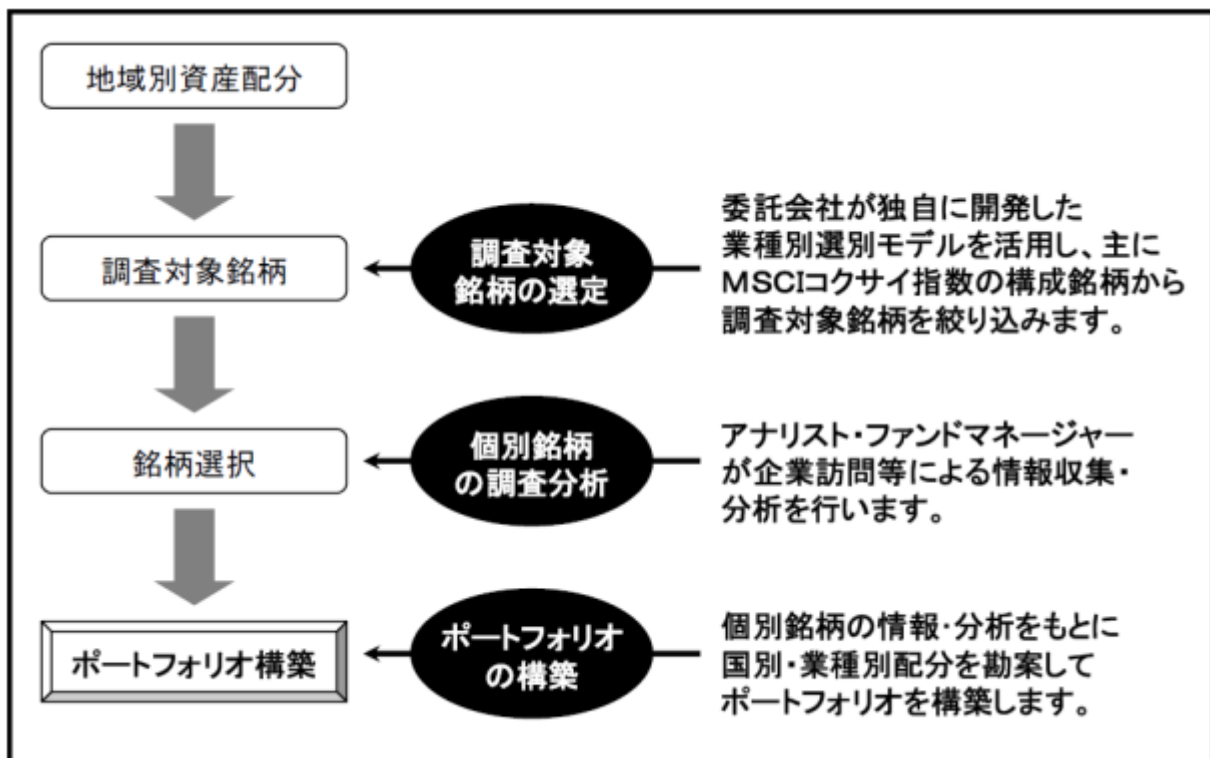
アナリスト・ファンドマネージャーが企業訪問等による情報収集・分析を行います。

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。
F T S E 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

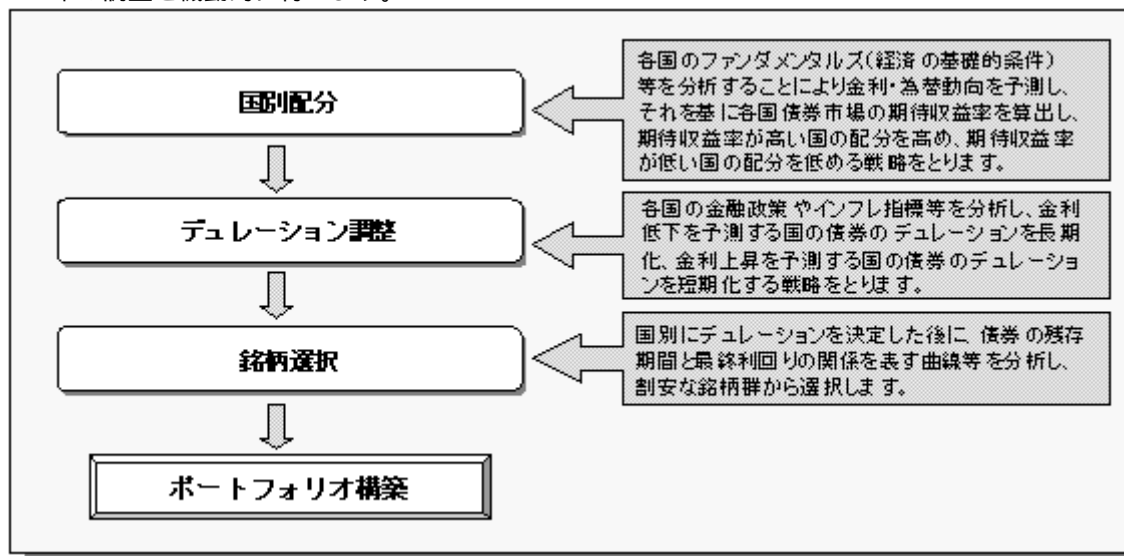
各国の金融政策やインフレ指標等进行分析し、金利低下を予測する国の債券のデュレーションを長期化、金利上昇を予測する国の債券のデュレーションを短期化する戦略をとります。

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ます。）

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ます。）
- (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書
- (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ます。）
- (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。

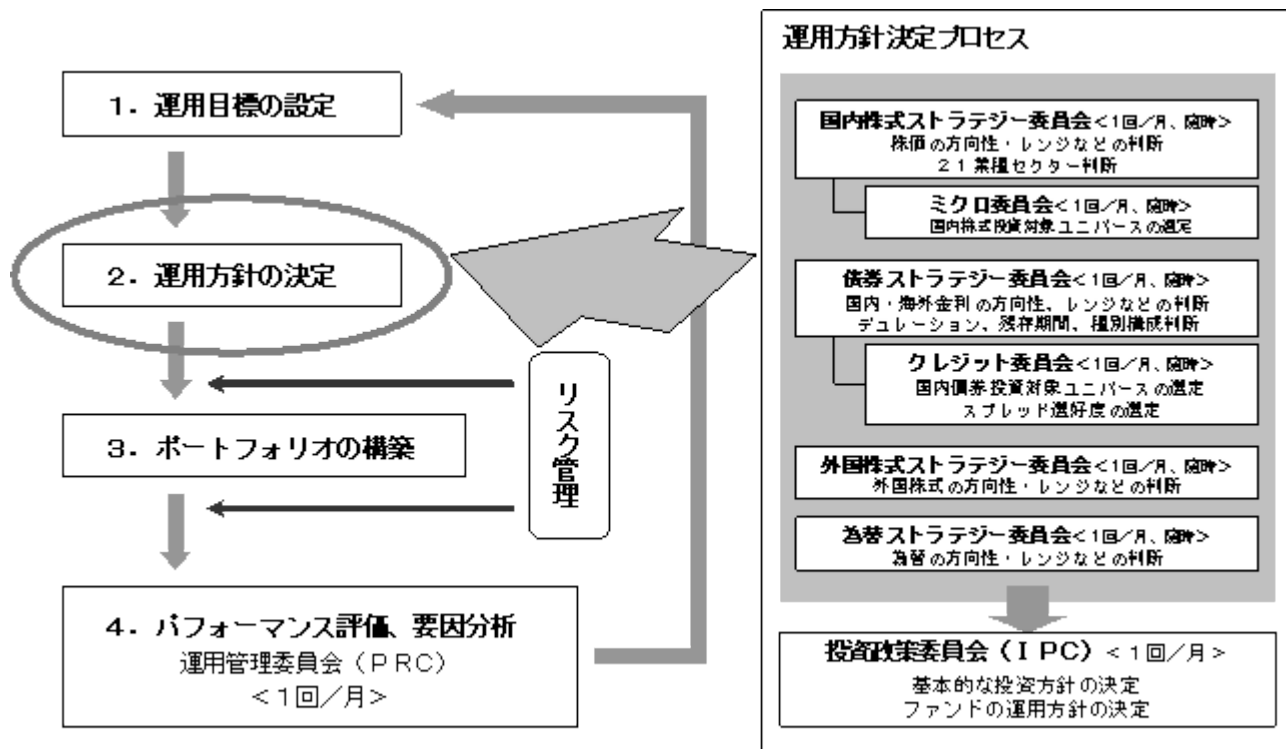
- (1) 預金
- (2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- (3) コール・ローン
- (4) 手形割引市場において売買される手形

- (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】

当ファンドの運用体制は以下の通りです。



ファンドの運用に関する社内規則として「投資運用業に係る業務運営規程」を設けております。

運用におけるリスク管理は、運用リスク管理部門（5～10名程度）による法令・運用ガイドライン等の遵守状況のチェックや運用リスク項目のチェック等が随時実施され、担当運用部へフィードバックされるとともに、原則として月1回開催される運用管理委員会（運用リスク管理部門担当役員を委員長に、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、2021年12月末日現在）

(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。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。

- 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。
- 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、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の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たが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、大量の解約申込が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額が下落する可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。
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が小さかった場合も同様です。

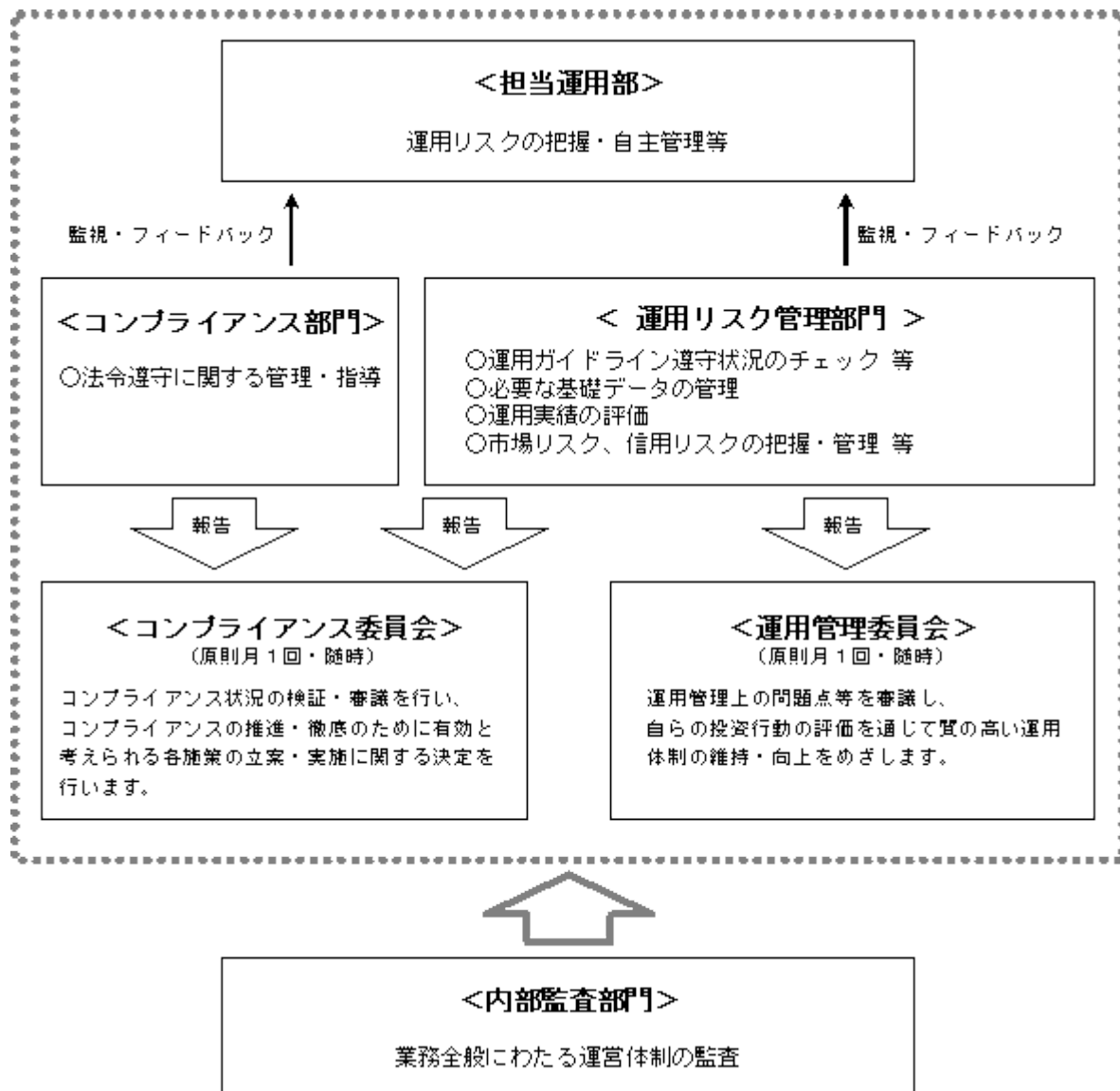
3. 管理体制

<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。



<流動性リスク管理>

委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。

取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

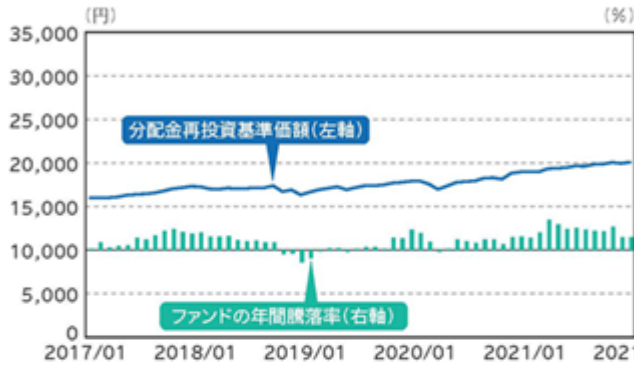
参考情報

2017年1月～2021年12月

ファンドの年間騰落率および
分配金再投資基準価額の推移

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

バランス 30

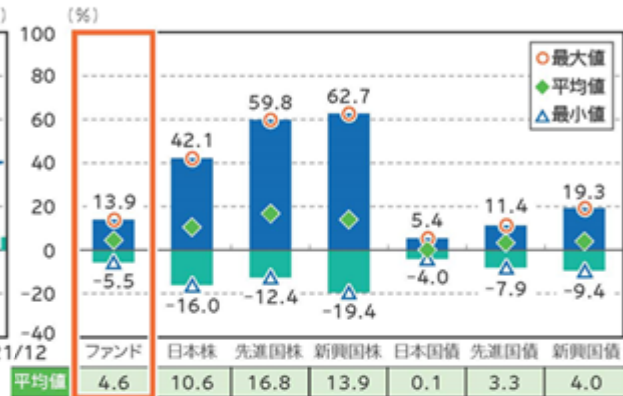


※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものと計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。

※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。過去5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものです。



※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

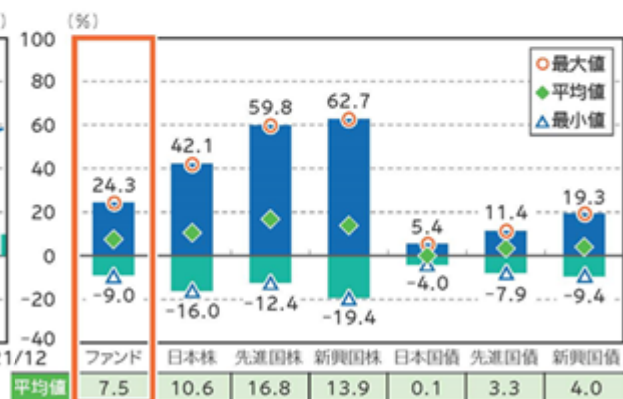
※ファンドは分配金再投資基準価額の年間騰落率です。税引前分配金を再投資したものと計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

バランス 50



※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。



※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

※ファンドは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。

次ページへ続く

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。

バランス 70



※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。

※年間総落率は、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総落率と
は異なる場合があります。

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

※ファンドは分配金再投資基準価額の年間総落率です。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総落率とは異なる場合がありま
す。

代表的な資産クラスと指数名

日本株	TOPIX (東証株価指数) (配当込み)
先進国株	MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ベース)
新興国株	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)
日本国債	NOMURA-BPI (国債)
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)

指数について

●TOPIXの指数値および商標は、東京証券取引所の知的財産であり、TOPIXに関するすべての権利およびノウハウは東京証券取引所が有します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、公表の停止、TOPIXの商標の変更、使用の停止を行う場合があります。●MSCIコクサイ指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。●MSCIエマージング・マーケット・インデックスの著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。●NOMURA-BPI (国債)に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券に帰属します。●FTSE世界国債インデックスは、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、改竄または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。●JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシ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、高替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

4【手数料等及び税金】

(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1.045% （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1.254% （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1.441% （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、運用報告書等各種書類の送付、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0.0055%（税抜0.005%）を乗じて得た金額（ただし、年49.5万円（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、復興特別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。

< 個人の受益者に対する課税 >

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315% および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。申告不要制度の適用がありますが、総合課税または申告分離課税を選択することも可能です。いずれの場合も配当控除の適用はありません。申告分離課税を選択した場合の税率は、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。収益分配金のうち課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）（ 2 ）は課税されません。

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

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

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

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

< 法人の受益者に対する課税 >

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の「各受益者の個別元本」（ 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。

（ 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、2021年12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2021年12月30日現在の運用状況です。

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

(1)【投資状況】

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	13,523,132,268	97.04
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		411,335,136	2.95
合計(純資産総額)		13,934,467,404	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	31,572,456,272	97.06
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		953,643,880	2.93
合計(純資産総額)		32,526,100,152	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	22,938,476,317	97.08
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		688,356,648	2.91
合計(純資産総額)		23,626,832,965	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	84,064,641,880	99.24
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		639,357,162	0.75
合計(純資産総額)		84,703,999,042	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	46,144,110,130	49.91
社債券	日本	43,874,246,321	47.45
	アメリカ	1,096,267,000	1.18
	フランス	498,562,000	0.53
	イギリス	300,462,000	0.32
	小計	45,769,537,321	49.50
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		540,681,002	0.58
合計(純資産総額)		92,454,328,453	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	40,562,617,601	72.56

カナダ	1,277,518,763	2.28
ドイツ	245,205,972	0.43
イタリア	132,195,145	0.23
フランス	229,184,225	0.41
オーストラリア	609,582,151	1.09
イギリス	4,202,834,234	7.51
スイス	2,947,242,192	5.27
オランダ	1,972,207,416	3.52
スペイン	93,960,674	0.16
ノルウェー	175,871,718	0.31
デンマーク	1,242,687,484	2.22
アイルランド	915,368,145	1.63
中華人民共和国	601,540,400	1.07
キュラソー	34,103,430	0.06
小計	55,242,119,550	98.82
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）	654,558,418	1.17
合計（純資産総額）	55,896,677,968	100.00

T M A 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	12,852,301,989	47.19
	カナダ	755,061,573	2.77
	ドイツ	1,613,679,932	5.92
	イタリア	2,546,413,237	9.35
	フランス	2,960,424,237	10.87
	オーストラリア	1,000,883,879	3.67
	イギリス	1,923,688,284	7.06
	シンガポール	17,939,402	0.06
	オランダ	373,205,090	1.37
	スペイン	1,332,888,841	4.89
	ベルギー	452,319,730	1.66
	スウェーデン	65,715,468	0.24
	オーストリア	337,928,237	1.24
	メキシコ	706,870,921	2.59
	ポーランド	64,279,632	0.23
	小計	27,003,600,452	99.15
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）	229,969,899	0.84	
合計（純資産総額）	27,233,570,351	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	4,582,371,906	1.4134	6,476,780,029	1.4160	6,488,638,618	46.56
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	1,206,151,759	2.1502	2,593,491,434	2.3496	2,833,974,172	20.33
3	TMA外国債券マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	1,095,788,884	2.5009	2,740,505,733	2.5438	2,787,467,763	20.00
4	TMA外国株式マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	298,982,632	4.2028	1,256,589,599	4.7262	1,413,051,715	10.14

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	4,902,307,198	2.1488	10,534,472,029	2.3496	11,518,460,992	35.41
2	TMA日本債券マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	6,113,816,671	1.4134	8,641,325,624	1.4160	8,657,164,406	26.61
3	TMA外国債券マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	2,544,971,408	2.5008	6,364,491,394	2.5438	6,473,898,267	19.90
4	TMA外国株式マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	1,041,625,959	4.2002	4,375,065,156	4.7262	4,922,932,607	15.13

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	5,063,210,961	2.1520	10,896,283,070	2.3496	11,896,520,473	50.35
2	TMA外国株式マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	1,004,081,976	4.2059	4,223,079,176	4.7262	4,745,492,234	20.08
3	TMA外国債券マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	1,563,943,459	2.5012	3,911,778,243	2.5438	3,978,359,371	16.83
4	TMA日本債券マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	1,637,079,265	1.4134	2,313,865,616	1.4160	2,318,104,239	9.81

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	97.04
合計	97.04

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	97.06
合計	97.06

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	97.08
合計	97.08

【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	ソニーグループ	日本	電気機器	株式	333,400	11,479.85	3,827,381,990	14,475.00	4,825,965,000	5.69
2	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	株式	1,744,100	1,683.01	2,935,337,741	2,105.50	3,672,202,550	4.33
3	東京エレクトロン	日本	電気機器	株式	44,000	41,944.96	1,845,578,240	66,280.00	2,916,320,000	3.44
4	信越化学工業	日本	化学	株式	145,200	18,301.35	2,657,356,020	19,920.00	2,892,384,000	3.41
5	第一三共	日本	医薬品	株式	881,300	3,065.71	2,701,810,223	2,925.00	2,577,802,500	3.04
6	ルネサスエレクトロニクス	日本	電気機器	株式	1,770,200	1,173.09	2,076,603,918	1,423.00	2,518,994,600	2.97
7	アステラス製薬	日本	医薬品	株式	1,304,300	1,785.11	2,328,318,973	1,870.50	2,439,693,150	2.88
8	村田製作所	日本	電気機器	株式	207,200	9,028.09	1,870,620,248	9,157.00	1,897,330,400	2.23
9	三井物産	日本	卸売業	株式	668,300	2,468.94	1,649,992,602	2,723.50	1,820,115,050	2.14
10	野村総合研究所	日本	情報・通信業	株式	359,100	3,427.32	1,230,750,612	4,935.00	1,772,158,500	2.09
11	富士通	日本	電気機器	株式	89,600	16,338.17	1,463,900,032	19,730.00	1,767,808,000	2.08
12	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	2,485,900	649.70	1,615,089,230	624.90	1,553,438,910	1.83
13	バンダイナムコホールディングス	日本	その他製品	株式	171,500	7,953.62	1,364,045,830	8,994.00	1,542,471,000	1.82
14	ダイキン工業	日本	機械	株式	58,200	22,773.79	1,325,434,578	26,090.00	1,518,438,000	1.79
15	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	204,800	5,245.56	1,074,290,688	6,972.00	1,427,865,600	1.68
16	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	262,500	9,748.89	2,559,083,625	5,434.00	1,426,425,000	1.68
17	新光電気工業	日本	電気機器	株式	257,800	3,312.68	854,008,904	5,490.00	1,415,322,000	1.67
18	GMOペイメントゲートウェイ	日本	情報・通信業	株式	97,200	14,298.00	1,389,765,600	14,350.00	1,394,820,000	1.64
19	デンソー	日本	輸送用機器	株式	144,900	7,649.57	1,108,422,693	9,529.00	1,380,752,100	1.63

20	セブン&アイ・ホールディングス	日本	小売業	株式	269,500	5,000.89	1,347,739,855	5,056.00	1,362,592,000	1.60
21	S M C	日本	機械	株式	17,100	63,299.50	1,082,421,516	77,590.00	1,326,789,000	1.56
22	日立製作所	日本	電気機器	株式	209,100	6,242.41	1,305,287,931	6,230.00	1,302,693,000	1.53
23	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	412,100	2,947.81	1,214,792,501	3,150.00	1,298,115,000	1.53
24	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	309,600	4,281.32	1,325,496,672	3,943.00	1,220,752,800	1.44
25	レーザーテック	日本	電気機器	株式	33,400	23,990.82	801,293,618	35,290.00	1,178,686,000	1.39
26	サイバーエージェント	日本	サービス業	株式	608,700	1,878.79	1,143,619,473	1,914.00	1,165,051,800	1.37
27	クボタ	日本	機械	株式	446,700	2,468.16	1,102,527,072	2,553.50	1,140,648,450	1.34
28	オリエンタルランド	日本	サービス業	株式	57,800	17,625.89	1,018,776,442	19,395.00	1,121,031,000	1.32
29	ミスミグループ本社	日本	卸売業	株式	227,800	3,329.77	758,521,606	4,720.00	1,075,216,000	1.26
30	J C R ファーマ	日本	医薬品	株式	458,900	3,337.54	1,531,597,106	2,224.00	1,020,593,600	1.20

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431回利付国債(2年)	日本	国債証券	0.005	2023/12/01	7,560,000,000	100.23	7,577,612,700	100.20	7,575,120,000	8.19
2	第430回利付国債(2年)	日本	国債証券	0.005	2023/11/01	7,291,000,000	100.23	7,308,145,920	100.19	7,304,925,810	7.90
3	第429回利付国債(2年)	日本	国債証券	0.005	2023/10/01	2,640,000,000	100.20	2,645,429,500	100.18	2,644,804,800	2.86
4	第14回利付国債(40年)	日本	国債証券	0.700	2061/03/20	2,346,000,000	99.08	2,324,464,100	98.63	2,313,953,640	2.50
5	第169回利付国債(20年)	日本	国債証券	0.300	2039/06/20	1,895,000,000	97.99	1,856,924,000	98.28	1,862,557,600	2.01
6	第162回利付国債(20年)	日本	国債証券	0.600	2037/09/20	1,750,000,000	104.89	1,835,667,820	104.11	1,821,925,000	1.97
7	第65回利付国債(30年)	日本	国債証券	0.400	2049/12/20	1,424,000,000	93.47	1,331,085,600	93.09	1,325,658,560	1.43
8	第364回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2031/09/20	1,051,000,000	100.38	1,055,081,700	100.28	1,054,037,390	1.14
9	第15回東京電力パワーグリッド株式会社社債	日本	社債券	0.890	2030/07/24	1,000,000,000	102.79	1,027,996,000	102.71	1,027,180,000	1.11
10	第33回利付国債(30年)	日本	国債証券	2.000	2040/09/20	794,000,000	128.70	1,021,909,760	127.85	1,015,136,940	1.09
11	第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	日本	社債券	0.400	2031/10/14	1,000,000,000	100.00	1,000,000,000	100.06	1,000,640,000	1.08
12	第72回利付国債(30年)	日本	国債証券	0.700	2051/09/20	995,000,000	100.65	1,001,467,500	100.24	997,447,700	1.07
13	第178回利付国債(20年)	日本	国債証券	0.500	2041/09/20	965,000,000	100.86	973,299,000	100.45	969,342,500	1.04
14	第163回利付国債(20年)	日本	国債証券	0.600	2037/12/20	880,000,000	103.87	914,073,600	104.01	915,323,200	0.99
15	第177回利付国債(20年)	日本	国債証券	0.400	2041/06/20	910,000,000	99.77	907,954,800	98.75	898,643,200	0.97
16	第38回利付国債(30年)	日本	国債証券	1.800	2043/03/20	710,000,000	126.88	900,904,800	125.88	893,811,900	0.96

17	第56回利付国債(30年)	日本	国債証券	0.800	2047/09/20	835,000,000	105.34	879,615,600	104.57	873,167,850	0.94
18	第52回利付国債(30年)	日本	国債証券	0.500	2046/09/20	790,000,000	98.44	777,676,000	98.16	775,495,600	0.83
19	第48回利付国債(30年)	日本	国債証券	1.400	2045/09/20	644,000,000	119.73	771,091,020	118.69	764,421,560	0.82
20	第40回利付国債(30年)	日本	国債証券	1.800	2043/09/20	561,000,000	127.31	714,209,100	126.32	708,677,640	0.76
21	第109回住友不動産株式会社無担保社債	日本	社債券	0.310	2031/05/09	700,000,000	100.10	700,711,000	99.83	698,852,000	0.75
22	第168回利付国債(20年)	日本	国債証券	0.400	2039/03/20	670,000,000	100.49	673,311,600	100.16	671,078,700	0.72
23	第57回利付国債(30年)	日本	国債証券	0.800	2047/12/20	636,000,000	105.46	670,725,600	104.49	664,569,120	0.71
24	第63回利付国債(30年)	日本	国債証券	0.400	2049/06/20	710,000,000	93.60	664,567,100	93.52	663,999,100	0.71
25	第64回利付国債(30年)	日本	国債証券	0.400	2049/09/20	700,000,000	92.99	650,993,000	93.36	653,534,000	0.70
26	第156回利付国債(20年)	日本	国債証券	0.400	2036/03/20	600,000,000	102.11	612,716,000	101.77	610,668,000	0.66
27	第10回みずほフィナンシャルグループ(劣後)	日本	社債券	1.232	2025/12/15	600,000,000	101.52	609,126,000	101.64	609,858,000	0.65
28	第1回パナソニック株式会社無担保社債(劣後)	日本	社債券	0.740	2081/10/14	600,000,000	100.00	600,000,000	100.89	605,346,000	0.65
29	第1回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債(劣後)	日本	社債券	0.630	2081/09/27	600,000,000	100.00	600,000,000	100.60	603,612,000	0.65
30	第538回関西電力株式会社社債	日本	社債券	0.390	2031/01/24	600,000,000	100.65	603,942,000	100.27	601,668,000	0.65

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	7,800	360,402.18	2,811,137,046	389,229.98	3,035,993,847	5.43
2	NVIDIA CORP	アメリカ	半導体・半導体製造装置	株式	70,500	14,774.31	1,041,589,489	34,507.15	2,432,754,089	4.35
3	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	ヘルスケア機器・サービス	株式	40,300	42,304.35	1,704,865,546	58,151.81	2,343,518,007	4.19
4	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	アメリカ	家庭用品・パーソナル用品	株式	49,600	32,911.08	1,632,389,805	42,566.60	2,111,303,439	3.77
5	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	63,500	24,707.23	1,568,909,547	29,277.19	1,859,101,615	3.32
6	TJX COMPANIES INC	アメリカ	小売	株式	210,800	7,681.61	1,619,283,778	8,679.40	1,829,619,459	3.27
7	META PLATFORMS INC-A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	46,100	33,368.45	1,538,285,646	39,444.95	1,818,412,600	3.25
8	S&P GLOBAL INC	アメリカ	各種金融	株式	33,000	40,038.46	1,321,269,246	54,582.74	1,801,230,453	3.22
9	MSCI INC	アメリカ	各種金融	株式	24,900	48,087.35	1,197,375,161	70,713.14	1,760,757,330	3.15
10	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	株式	5,000	235,008.86	1,175,044,320	337,018.95	1,685,094,759	3.01
11	MASTERCARD INC-CLASS A	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	39,000	40,952.35	1,597,141,908	41,555.57	1,620,667,456	2.89
12	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	4,800	233,140.93	1,119,076,508	337,365.16	1,619,352,777	2.89

13	FIRST REPUBLIC BANK/CA	アメリカ	銀行	株式	57,000	19,430.32	1,107,528,730	23,801.08	1,356,662,050	2.42
14	ADOBE INC	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	20,700	52,042.83	1,077,286,713	65,479.73	1,355,430,531	2.42
15	ASHTED GROUP PLC	イギリス	資本財	株式	140,500	6,653.58	934,828,889	9,500.68	1,334,846,664	2.38
16	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	97,800	7,738.69	756,844,077	12,706.41	1,242,687,484	2.22
17	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	90,000	11,683.77	1,051,539,504	13,437.57	1,209,381,696	2.16
18	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	24,900	39,288.29	978,278,573	47,901.98	1,192,759,401	2.13
19	AIRBUS SE	オランダ	資本財	株式	81,400	13,076.16	1,064,399,753	14,632.78	1,191,108,389	2.13
20	BOEING CO	アメリカ	資本財	株式	48,900	28,921.37	1,414,255,354	23,424.97	1,145,481,189	2.04
21	DOLLARAMA INC	カナダ	小売	株式	197,100	4,668.49	920,160,920	5,727.44	1,128,879,291	2.01
22	PAYPAL HOLDINGS INC	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	48,700	27,149.66	1,322,188,859	21,850.34	1,064,112,015	1.90
23	NESTLE SA-REGISTERED	スイス	食品・飲料・タバコ	株式	63,000	15,965.49	1,005,826,245	16,140.03	1,016,822,419	1.81
24	NIKE INC -CL B	アメリカ	耐久消費財・アパレル	株式	47,300	16,082.88	760,720,609	19,413.07	918,238,475	1.64
25	HDFC Bank Ltd	アメリカ	銀行	株式	116,100	8,839.77	1,026,297,938	7,347.47	853,042,149	1.52
26	BRIGHT HORIZONS FAMILY SOLUTIONS INC	アメリカ	消費者サービス	株式	56,206	18,425.16	1,035,604,724	14,401.65	809,459,375	1.44
27	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	30,800	23,797.63	732,967,250	25,093.91	772,892,532	1.38
28	ZOETIS INC	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	25,200	22,757.21	573,481,772	28,413.39	716,017,443	1.28
29	DIAGEO PLC	イギリス	食品・飲料・タバコ	株式	111,800	5,770.15	645,103,516	6,356.30	710,634,541	1.27
30	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	アメリカ	食品・飲料・タバコ	株式	89,600	6,682.66	598,766,515	7,633.87	683,995,415	1.22

T M A 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 1/2 01/15/23	アメリカ	国債証券	1.500	2023/01/15	15,600,000	11,683.73	1,822,662,129	11,631.39	1,814,498,010	6.66
2	T 0 1/8 02/28/23	アメリカ	国債証券	0.125	2023/02/28	10,900,000	11,491.82	1,252,609,137	11,457.07	1,248,820,663	4.58
3	T 3 1/8 11/15/28	アメリカ	国債証券	3.125	2028/11/15	8,200,000	12,889.40	1,056,930,912	12,778.00	1,047,796,256	3.84
4	T 2 5/8 02/15/29	アメリカ	国債証券	2.625	2029/02/15	4,700,000	12,469.13	586,049,293	12,427.55	584,094,922	2.14
5	T 3 5/8 02/15/44	アメリカ	国債証券	3.625	2044/02/15	3,900,000	14,157.77	552,153,061	14,859.14	579,506,703	2.12
6	T 0 1/2 10/31/27	アメリカ	国債証券	0.500	2027/10/31	5,100,000	10,908.43	556,330,176	10,929.59	557,409,386	2.04
7	T 2 3/8 04/30/26	アメリカ	国債証券	2.375	2026/04/30	4,300,000	12,343.08	530,752,601	12,048.34	518,078,835	1.90
8	T 2 1/2 02/15/45	アメリカ	国債証券	2.500	2045/02/15	4,100,000	11,830.68	485,058,211	12,552.45	514,650,699	1.88
9	T 0 5/8 11/30/27	アメリカ	国債証券	0.625	2027/11/30	4,600,000	11,016.90	506,777,671	10,999.68	505,985,562	1.85
10	FRTR 0 03/25/25	フランス	国債証券	-	2025/03/25	3,600,000	13,314.15	479,309,459	13,253.29	477,118,458	1.75

11	FRTR 0 02/25/26	フランス	国債証券	-	2026/02/25	2,900,000	13,339.66	386,850,302	13,250.02	384,250,804	1.41
12	T 0 5/8 12/31/27	アメリカ	国債証券	0.625	2027/12/31	3,300,000	11,044.04	364,453,449	10,988.90	362,633,795	1.33
13	T 2 1/4 05/15/41	アメリカ	国債証券	2.250	2041/05/15	3,000,000	12,369.89	371,096,789	11,976.45	359,293,725	1.31
14	T 1 5/8 11/30/26	アメリカ	国債証券	1.625	2026/11/30	2,900,000	11,852.81	343,731,519	11,688.00	338,952,259	1.24
15	FRTR4.5 04/25/41	フランス	国債証券	4.500	2041/04/25	1,500,000	23,081.79	346,226,977	22,306.76	334,601,538	1.22
16	T 1 1/4 03/31/28	アメリカ	国債証券	1.250	2028/03/31	2,600,000	11,491.73	298,785,117	11,386.98	296,061,480	1.08
17	T 3 5/8 08/15/43	アメリカ	国債証券	3.625	2043/08/15	1,900,000	14,018.25	266,346,780	14,809.72	281,384,748	1.03
18	OBL 0 10/09/26	ドイツ	国債証券	-	2026/10/09	2,000,000	13,408.57	268,171,425	13,339.94	266,798,982	0.97
19	T 3 3/4 11/15/43	アメリカ	国債証券	3.750	2043/11/15	1,700,000	14,294.68	243,009,655	15,099.07	256,684,203	0.94
20	FRTR 0 11/25/31	フランス	国債証券	-	2031/11/25	2,000,000	12,912.67	258,253,579	12,800.42	256,008,416	0.94
21	BTPS 0 04/15/24	イタリア	国債証券	-	2024/04/15	1,900,000	13,144.20	249,739,890	13,062.74	248,192,172	0.91
22	T 2 3/4 08/15/42	アメリカ	国債証券	2.750	2042/08/15	1,900,000	12,249.63	232,742,970	13,011.63	247,221,112	0.90
23	FRTR 1 1/2 05/25/31	フランス	国債証券	1.500	2031/05/25	1,600,000	15,085.65	241,370,414	14,728.05	235,648,856	0.86
24	FRTR 0 11/25/30	フランス	国債証券	-	2030/11/25	1,800,000	13,065.35	235,176,409	12,928.32	232,709,770	0.85
25	MBONO 5 1/2 03/04/27	メキシコ	国債証券	5.500	2027/03/04	44,000,000	515.88	226,991,220	515.11	226,651,139	0.83
26	T 0 1/2 05/31/27	アメリカ	国債証券	0.500	2027/05/31	2,000,000	11,013.16	220,263,300	10,999.68	219,993,723	0.80
27	FRTR 1 1/4 05/25/36	フランス	国債証券	1.250	2036/05/25	1,500,000	14,919.05	223,785,758	14,456.59	216,848,890	0.79
28	DBR 0 08/15/31	ドイツ	国債証券	-	2031/08/15	1,600,000	13,353.90	213,662,488	13,278.87	212,461,927	0.78
29	DBR 2 1/2 08/15/46	ドイツ	国債証券	2.500	2046/08/15	1,000,000	20,488.98	204,889,867	20,851.58	208,515,827	0.76
30	MBONO 8 1/2 05/31/29	メキシコ	国債証券	8.500	2029/05/31	35,000,000	595.65	208,479,992	594.06	207,922,349	0.76

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	0.31
		建設業	0.58
		食料品	1.61
		繊維製品	0.17
		化学	7.36
		医薬品	8.71
		鉄鋼	0.71
		非鉄金属	0.63
		機械	5.43
		電気機器	24.79
		輸送用機器	7.66
		精密機器	1.02
		その他製品	2.63
		陸運業	1.58
		海運業	0.81
		情報・通信業	12.54
卸売業	4.39		

	小売業	3.38
	銀行業	3.27
	証券、商品先物取引業	0.69
	保険業	1.12
	その他金融業	0.33
	不動産業	1.91
	サービス業	7.50
合 計		99.24

T M A 日本債券マザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	49.91
社債券	49.50
合 計	99.41

T M A 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	2.63
		素材	2.39
		資本財	6.81
		耐久消費財・アパレル	1.64
		消費者サービス	1.44
		メディア・娯楽	10.21
		小売	10.72
		食品・飲料・タバコ	4.73
		家庭用品・パーソナル用品	3.77
		ヘルスケア機器・サービス	5.53
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	11.05
		銀行	4.80
		各種金融	7.64
		保険	1.20
		ソフトウェア・サービス	13.58
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.13
		公益事業	1.86
半導体・半導体製造装置	7.62		
合 計			98.82

T M A 外国債券マザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	99.15
合 計	99.15

投資不動産物件

T M A 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。

T M A 日本債券マザーファンド
該当事項はありません。

T M A 外国株式マザーファンド
該当事項はありません。

T M A 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
T M A 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。

T M A 日本債券マザーファンド
該当事項はありません。

T M A 外国株式マザーファンド
該当事項はありません。

T M A 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
第18計算期間末	(2019年 6月20日)	10,199	10,199	1.7206	1.7206
第19計算期間末	(2020年 6月22日)	11,314	11,314	1.7862	1.7862
第20計算期間末	(2021年 6月21日)	13,159	13,159	1.9494	1.9494
2020年12月末日		12,566		1.8980	
2021年 1月末日		12,549		1.8970	
2月末日		12,549		1.8974	
3月末日		12,941		1.9349	
4月末日		13,002		1.9399	
5月末日		13,083		1.9477	
6月末日		13,320		1.9661	
7月末日		13,360		1.9632	
8月末日		13,549		1.9835	
9月末日		13,640		1.9863	
10月末日		13,830		2.0070	
11月末日		13,762		1.9954	

12月末日	13,934	2.0093
-------	--------	--------

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
第18計算期間末	(2019年 6月20日)	22,508	22,508	1.9034	1.9034
第19計算期間末	(2020年 6月22日)	25,172	25,172	2.0325	2.0325
第20計算期間末	(2021年 6月21日)	30,192	30,192	2.3362	2.3362
2020年12月末日		28,536		2.2399	
2021年 1月末日		28,556		2.2419	
2月末日		28,810		2.2561	
3月末日		29,797		2.3179	
4月末日		29,847		2.3227	
5月末日		30,050		2.3341	
6月末日		30,749		2.3705	
7月末日		30,666		2.3543	
8月末日		31,335		2.3978	
9月末日		31,687		2.4146	
10月末日		32,183		2.4482	
11月末日		31,902		2.4261	
12月末日		32,526		2.4550	

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
第18計算期間末	(2019年 6月20日)	14,556	14,556	2.0375	2.0375
第19計算期間末	(2020年 6月22日)	16,690	16,690	2.2289	2.2289
第20計算期間末	(2021年 6月21日)	21,396	21,396	2.6928	2.6928
2020年12月末日		19,649		2.5431	
2021年 1月末日		19,712		2.5490	

2月末日	20,067	2.5815
3月末日	21,008	2.6708
4月末日	21,114	2.6752
5月末日	21,283	2.6896
6月末日	21,937	2.7483
7月末日	21,820	2.7144
8月末日	22,397	2.7869
9月末日	22,830	2.8228
10月末日	23,243	2.8701
11月末日	23,059	2.8360
12月末日	23,626	2.8831

【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計算期間	2018年 6月21日～2019年 6月20日	0.4
第19計算期間	2019年 6月21日～2020年 6月22日	3.8
第20計算期間	2020年 6月23日～2021年 6月21日	9.1
第21中間計算期間	2021年 6月22日～2021年12月21日	2.2

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計算期間	2018年 6月21日～2019年 6月20日	1.3
第19計算期間	2019年 6月21日～2020年 6月22日	6.8

第20計算期間	2020年 6月23日 ~ 2021年 6月21日	14.9
第21中間計算期間	2021年 6月22日 ~ 2021年12月21日	3.5

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計算期間	2018年 6月21日 ~ 2019年 6月20日	3.1
第19計算期間	2019年 6月21日 ~ 2020年 6月22日	9.4
第20計算期間	2020年 6月23日 ~ 2021年 6月21日	20.8
第21中間計算期間	2021年 6月22日 ~ 2021年12月21日	4.9

(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計算期間	2018年 6月21日 ~ 2019年 6月20日	937,330,085	493,818,004	5,927,999,313
第19計算期間	2019年 6月21日 ~ 2020年 6月22日	1,157,893,992	751,369,637	6,334,523,668
第20計算期間	2020年 6月23日 ~ 2021年 6月21日	1,151,261,292	735,173,193	6,750,611,767
第21中間計算期間	2021年 6月22日 ~ 2021年12月21日	521,991,487	369,760,604	6,902,842,650

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計算期間	2018年 6月21日 ~ 2019年 6月20日	1,534,387,631	961,844,077	11,824,886,210
第19計算期間	2019年 6月21日 ~ 2020年 6月22日	1,845,128,151	1,285,174,994	12,384,839,367
第20計算期間	2020年 6月23日 ~ 2021年 6月21日	1,803,125,305	1,264,174,499	12,923,790,173
第21中間計算期間	2021年 6月22日 ~ 2021年12月21日	859,224,010	573,191,018	13,209,823,165

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計算期間	2018年 6月21日 ~ 2019年 6月20日	1,133,160,102	748,405,338	7,144,343,278
第19計算期間	2019年 6月21日 ~ 2020年 6月22日	1,429,368,793	1,085,435,128	7,488,276,943
第20計算期間	2020年 6月23日 ~ 2021年 6月21日	1,471,907,293	1,014,272,500	7,945,911,736
第21中間計算期間	2021年 6月22日 ~ 2021年12月21日	702,447,726	487,130,635	8,161,228,827

< 参考情報 >

基準日: 2021年12月30日

基準価額・純資産の推移

バランス 30



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
 ※基準価額は1万口当たりで表示しています。※設定日は2001年9月25日です。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第16期	2017/06/20	0円
第17期	2018/06/20	0円
第18期	2019/06/20	0円
第19期	2020/06/22	0円
第20期	2021/06/21	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。

バランス 50



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
 ※基準価額は1万口当たりで表示しています。※設定日は2001年9月25日です。

(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第16期	2017/06/20	0円
第17期	2018/06/20	0円
第18期	2019/06/20	0円
第19期	2020/06/22	0円
第20期	2021/06/21	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。

次ページへ続く

・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。

バランス 70



(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第16期	2017/06/20	0円
第17期	2018/06/20	0円
第18期	2019/06/20	0円
第19期	2020/06/22	0円
第20期	2021/06/21	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。

※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
 ※基準価額は1万口当たりで表示しています。※設定日は2001年9月25日です。

主要な資産の状況

資産構成

バランス 30

マザーファンド	組入比率	基本資産配分	差
TMA日本株アクティブマザーファンド	20.3%	20.0%	+0.3%
TMA日本債券マザーファンド	46.6%	47.0%	-0.4%
TMA外国株式マザーファンド	10.1%	10.0%	+0.1%
TMA外国債券マザーファンド	20.0%	20.0%	+0.0%
短期金融資産等	3.0%	3.0%	-0.0%

※組入比率は純資産総額に占める割合です。

バランス 50

マザーファンド	組入比率	基本資産配分	差
TMA日本株アクティブマザーファンド	35.4%	35.0%	+0.4%
TMA日本債券マザーファンド	26.6%	27.0%	-0.4%
TMA外国株式マザーファンド	15.1%	15.0%	+0.1%
TMA外国債券マザーファンド	19.9%	20.0%	-0.1%
短期金融資産等	2.9%	3.0%	-0.1%

※組入比率は純資産総額に占める割合です。

バランス 70

マザーファンド	組入比率	基本資産配分	差
TMA日本株アクティブマザーファンド	50.4%	50.0%	+0.4%
TMA日本債券マザーファンド	9.8%	10.0%	-0.2%
TMA外国株式マザーファンド	20.1%	20.0%	+0.1%
TMA外国債券マザーファンド	16.8%	17.0%	-0.2%
短期金融資産等	2.9%	3.0%	-0.1%

※組入比率は純資産総額に占める割合です。

次ページへ続く

・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

年間収益率の推移

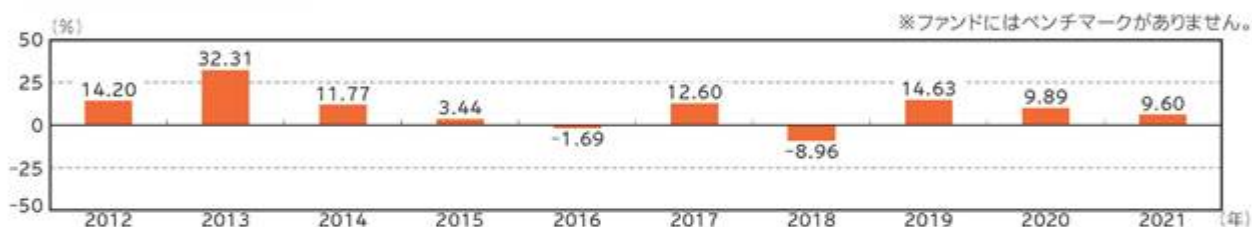
バランス 30



※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脱落率です。

バランス 50



※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脱落率です。

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脱落率です。

・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

- a. 毎営業日にお申込みを受け付けます。
- b. 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します。)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20期計算期間(2020年6月23日から2021年6月21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19期 [2020年 6月22日現在]	第20期 [2021年 6月21日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	340,001,528	396,702,925
親投資信託受益証券	10,977,613,829	12,765,220,799
未収入金	89,578,799	80,487,584
流動資産合計	11,407,194,156	13,242,411,308
資産合計		
	11,407,194,156	13,242,411,308
負債の部		
流動負債		
未払解約金	33,934,566	16,166,395
未払受託者報酬	4,898,301	5,605,517
未払委託者報酬	53,268,917	60,959,940
未払利息	598	377
その他未払費用	247,500	245,044
流動負債合計	92,349,882	82,977,273
負債合計		
	92,349,882	82,977,273
純資産の部		
元本等		
元本	1 6,334,523,668	1 6,750,611,767
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,980,320,606	6,408,822,268
（分配準備積立金）	1,704,154,103	2,521,657,159
元本等合計	11,314,844,274	13,159,434,035
純資産合計		
	11,314,844,274	13,159,434,035
負債純資産合計		
	11,407,194,156	13,242,411,308

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第19期 自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日	第20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
営業収益		
受取利息	1,180	1,578
有価証券売買等損益	513,643,043	1,196,542,697
営業収益合計	513,644,223	1,196,544,275
営業費用		
支払利息	176,035	114,536
受託者報酬	9,513,928	10,835,072
委託者報酬	103,463,806	117,831,314
その他費用	492,491	492,544
営業費用合計	113,646,260	129,273,466
営業利益又は営業損失()	399,997,963	1,067,270,809
経常利益又は経常損失()	399,997,963	1,067,270,809
当期純利益又は当期純損失()	399,997,963	1,067,270,809
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()	16,513,001	69,374,293
期首剰余金又は期首欠損金()	4,271,421,434	4,980,320,606
剰余金増加額又は欠損金減少額	869,050,853	1,012,795,362
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	869,050,853	1,012,795,362
剰余金減少額又は欠損金増加額	543,636,643	582,190,216
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	543,636,643	582,190,216
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()	4,980,320,606	6,408,822,268

(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20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 2020年6月20日及び2021年6月20日が休日のため、前計算期間末日を2020年6月22日とし、当計算期間末日を2021年6月21日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第19期 [2020年 6月22日現在]	第20期 [2021年 6月21日現在]
1. 1 期首元本額	5,927,999,313円	6,334,523,668円
期中追加設定元本額	1,157,893,992円	1,151,261,292円
期中一部解約元本額	751,369,637円	735,173,193円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	6,334,523,668口	6,750,611,767口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日	第20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21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(101,486,921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(281,998,041円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,403,133,937円)及び分配準備積立金(1,320,669,141円)より、分配対象額は5,107,288,040円(1万口当たり8,062.59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(116,121,574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(881,774,942円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,920,709,712円)及び分配準備積立金(1,523,760,643円)より、分配対象額は6,442,366,871円(1万口当たり9,543.36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)

. 金融商品の状況に関する事項

区 分	第19期 自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日	第20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21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19期 [2020年 6月22日現在]	第20期 [2021年 6月21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19期（自 2019年6月21日 至 2020年6月22日）

売買目的有価証券

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	502,700,588円
合計	502,700,588円

(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20期（自 2020年6月23日 至 2021年6月21日）

売買目的有価証券

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	1,033,397,706円
合計	1,033,397,706円

(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19期 [2020年 6月22日現在]		第20期 [2021年 6月21日現在]	
1口当たり純資産額	1.7862円	1口当たり純資産額	1.9494円
（1万口当たり純資産額	17,862円）	（1万口当たり純資産額	19,494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	1,227,217,193	2,623,667,636	
	T M A 日本債券マザーファンド	4,373,746,387	6,188,851,137	
	T M A 外国株式マザーファンド	319,412,788	1,335,943,985	
	T M A 外国債券マザーファンド	1,046,535,771	2,616,758,041	
親投資信託受益証券 合計		6,966,912,139	12,765,220,799	
合計		6,966,912,139	12,765,220,799	

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19期 [2020年 6月22日現在]	第20期 [2021年 6月21日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	751,507,054	910,560,930
親投資信託受益証券	24,425,648,138	29,288,603,258
未収入金	165,511,741	202,007,447
流動資産合計	25,342,666,933	30,401,171,635
資産合計	25,342,666,933	30,401,171,635
負債の部		
流動負債		
未払解約金	17,502,264	24,764,345
未払受託者報酬	10,728,491	12,859,348
未払委託者報酬	142,152,410	170,386,369
未払利息	1,322	865
その他未払費用	247,500	245,044
流動負債合計	170,631,987	208,255,971
負債合計	170,631,987	208,255,971
純資産の部		
元本等		
元本	12,384,839,367	12,923,790,173
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	12,787,195,579	17,269,125,491
(分配準備積立金)	5,525,865,940	8,624,627,210
元本等合計	25,172,034,946	30,192,915,664
純資産合計	25,172,034,946	30,192,915,664
負債純資産合計	25,342,666,933	30,401,171,635

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第19期 自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日	第20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
営業収益		
受取利息	2,568	3,512
有価証券売買等損益	1,858,583,566	4,196,254,723
営業収益合計	1,858,586,134	4,196,258,235
営業費用		
支払利息	386,294	257,837
受託者報酬	20,927,552	24,586,023
委託者報酬	277,289,924	325,764,761
その他費用	492,491	492,544
営業費用合計	299,096,261	351,101,165
営業利益又は営業損失()	1,559,489,873	3,845,157,070
経常利益又は経常損失()	1,559,489,873	3,845,157,070
当期純利益又は当期純損失()	1,559,489,873	3,845,157,070
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()	62,742,895	222,586,859
期首剰余金又は期首欠損金()	10,683,172,493	12,787,195,579
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,773,834,880	2,175,058,522
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	1,773,834,880	2,175,058,522
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,166,558,772	1,315,698,821
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,166,558,772	1,315,698,821
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()	12,787,195,579	17,269,125,491

(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20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 2020年6月20日及び2021年6月20日が休日のため、前計算期間末日を2020年6月22日とし、当計算期間末日を2021年6月21日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第19期 [2020年 6月22日現在]	第20期 [2021年 6月21日現在]
1. 1 期首元本額	11,824,886,210円	12,384,839,367円
期中追加設定元本額	1,845,128,151円	1,803,125,305円
期中一部解約元本額	1,285,174,994円	1,264,174,499円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	12,384,839,367口	12,923,790,173口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日	第20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21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（289,262,476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（925,802,853円）、投資信託約款に規定される収益調整金（8,719,072,332円）及び分配準備積立金（4,310,800,611円）より、分配対象額は14,244,938,272円（1万口当たり11,501.89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（318,240,074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（3,304,330,137円）、投資信託約款に規定される収益調整金（9,866,517,529円）及び分配準備積立金（5,002,056,999円）より、分配対象額は18,491,144,739円（1万口当たり14,307.82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)

. 金融商品の状況に関する事項

区 分	第19期 自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日	第20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21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19期 [2020年 6月22日現在]	第20期 [2021年 6月21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19期（自 2019年6月21日 至 2020年6月22日）

売買目的有価証券

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	1,738,411,784円
合計	1,738,411,784円

(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20期（自 2020年6月23日 至 2021年6月21日）

売買目的有価証券

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	3,673,092,353円
合計	3,673,092,353円

(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19期 [2020年 6月22日現在]		第20期 [2021年 6月21日現在]	
1口当たり純資産額	2.0325円	1口当たり純資産額	2.3362円
(1万口当たり純資産額)	20,325円)	(1万口当たり純資産額)	23,362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	4,926,819,009	10,533,046,359	
	T M A 日本債券マザーファンド	5,763,778,383	8,155,746,411	
	T M A 外国株式マザーファンド	1,099,123,562	4,597,084,298	
	T M A 外国債券マザーファンド	2,400,706,363	6,002,726,190	
親投資信託受益証券 合計		14,190,427,317	29,288,603,258	
合計		14,190,427,317	29,288,603,258	

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19期 [2020年 6月22日現在]	第20期 [2021年 6月21日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	496,592,375	646,223,210
親投資信託受益証券	16,198,171,579	20,755,766,289
未収入金	135,900,589	181,511,890
流動資産合計	16,830,664,543	21,583,501,389
資産合計	16,830,664,543	21,583,501,389
負債の部		
流動負債		
未払解約金	24,438,694	39,141,652
未払受託者報酬	7,048,398	9,022,235
未払委託者報酬	108,369,112	138,716,735
未払利息	873	614
その他未払費用	247,500	245,044
流動負債合計	140,104,577	187,126,280
負債合計	140,104,577	187,126,280
純資産の部		
元本等		
元本	17,488,276,943	17,945,911,736
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	9,202,283,023	13,450,463,373
(分配準備積立金)	3,846,293,646	6,672,247,820
元本等合計	16,690,559,966	21,396,375,109
純資産合計	16,690,559,966	21,396,375,109
負債純資産合計	16,830,664,543	21,583,501,389

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第19期 自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日	第20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
営業収益		
受取利息	1,670	2,336
有価証券売買等損益	1,626,913,726	3,842,960,681
営業収益合計	1,626,915,396	3,842,963,017
営業費用		
支払利息	252,419	175,326
受託者報酬	13,725,261	16,915,757
委託者報酬	211,025,834	260,079,518
その他費用	492,491	492,544
営業費用合計	225,496,005	277,663,145
営業利益又は営業損失()	1,401,419,391	3,565,299,872
経常利益又は経常損失()	1,401,419,391	3,565,299,872
当期純利益又は当期純損失()	1,401,419,391	3,565,299,872
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()	74,237,910	265,784,593
期首剰余金又は期首欠損金()	7,412,297,636	9,202,283,023
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,597,827,718	2,211,961,918
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	1,597,827,718	2,211,961,918
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,135,023,812	1,263,296,847
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,135,023,812	1,263,296,847
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()	9,202,283,023	13,450,463,373

(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20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日	
	1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 2020年6月20日及び2021年6月20日が休日のため、前計算期間末日を2020年6月22日とし、当計算期間末日を2021年6月21日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日	
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第19期 [2020年 6月22日現在]	第20期 [2021年 6月21日現在]
	1. 1 期首元本額	7,144,343,278円
期中追加設定元本額	1,429,368,793円	1,471,907,293円
期中一部解約元本額	1,085,435,128円	1,014,272,500円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	7,488,276,943口	7,945,911,736口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日	第20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
<p>1 分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（218,791,385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（723,193,799円）、投資信託約款に規定される収益調整金（7,064,137,560円）及び分配準備積立金（2,904,308,462円）より、分配対象額は10,910,431,206円（1万口当たり14,569.99円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>1 分配金の計算過程</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（246,501,878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（3,053,013,401円）、投資信託約款に規定される収益調整金（8,208,318,135円）及び分配準備積立金（3,372,732,541円）より、分配対象額は14,880,565,955円（1万口当たり18,727.30円）であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

区 分	第19期 自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日	第20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21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19期 [2020年 6月22日現在]	第20期 [2021年 6月21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19期（自 2019年6月21日 至 2020年6月22日）

売買目的有価証券

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	1,501,644,791円
合計	1,501,644,791円

(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20期（自 2020年6月23日 至 2021年6月21日）

売買目的有価証券

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	3,378,857,964円
合計	3,378,857,964円

(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19期 [2020年 6月22日現在]		第20期 [2021年 6月21日現在]	
1口当たり純資産額	2.2289円	1口当たり純資産額	2.6928円
(1万口当たり純資産額)	22,289円)	(1万口当たり純資産額)	26,928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	4,985,917,634	10,659,393,309	
	T M A日本債券マザーファンド	1,512,229,308	2,139,804,470	
	T M A外国株式マザーファンド	1,038,169,192	4,342,142,645	
	T M A外国債券マザーファンド	1,445,539,060	3,614,425,865	
親投資信託受益証券 合計		8,981,855,194	20,755,766,289	
合計		8,981,855,194	20,755,766,289	

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、「T M A日本株アクティブマザーファンド」、「T M A日本債券マザーファンド」、「T M A外国株式マザーファンド」、「T M A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。

「T M A日本株アクティブマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	[2020年 6月22日現在]	[2021年 6月21日現在]
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
金銭信託		548,944	113,101
コール・ローン		656,734,900	1,106,429,099
株式		46,491,434,650	76,090,407,290
未収入金		509,535,663	
未収配当金		228,679,918	338,860,108
流動資産合計		47,886,934,075	77,535,809,598
資産合計		47,886,934,075	77,535,809,598
負債の部			
流動負債			
未払金		436,143,112	

未払解約金		421,216,155	560,456,659
未払利息		1,155	1,051
流動負債合計		857,360,422	560,457,710
負債合計		857,360,422	560,457,710
純資産の部			
元本等			
元本	1	28,288,412,415	36,005,337,040
剰余金			
剰余金又は欠損金()		18,741,161,238	40,970,014,848
元本等合計		47,029,573,653	76,975,351,888
純資産合計		47,029,573,653	76,975,351,888
負債純資産合計		47,886,934,075	77,535,809,598

(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 2020年 6月23日 至 2021年 6月21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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[2020年 6月22日現在]	[2021年 6月21日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	29,757,074,280円	28,288,412,415円
同期中における追加設定元本額	8,450,186,961円	15,636,424,444円
同期中における一部解約元本額	9,918,848,826円	7,919,499,819円
同期末における元本額	28,288,412,415円	36,005,337,040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>	158,652,261円	179,785,858円
東京海上セレクション・日本株式	16,143,485,439円	15,761,379,419円
東京海上セレクション・バランス30	1,386,072,847円	1,227,217,193円
東京海上セレクション・バランス50	5,368,060,648円	4,926,819,009円
東京海上セレクション・バランス70	5,059,366,990円	4,985,917,634円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	104,131,963円	114,672,989円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	28,331,580円	14,669,103円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	30,997,193円	24,508,197円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	9,313,494円	9,005,361円
東京海上・日本株式GARP<適格機関投資家限定>	円	8,761,362,277円
計	28,288,412,415円	36,005,337,040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	28,288,412,415口	36,005,337,040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)

. 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日	自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21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	[2020年 6月22日現在]	[2021年 6月21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	<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。</p> <p>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。</p>	同左

（有価証券に関する注記）

（自 2019年6月21日 至 2020年6月22日）

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	10,273,735,457円
合計	10,273,735,457円

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

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年3月24日から2020年6月22日まで)を指しております。

(自 2020年6月23日 至 2021年6月21日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,017,575,677円
合計	1,017,575,677円

(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(2021年3月23日から2021年6月21日まで)を指しております。

(1口当たり情報に関する注記)

[2020年 6月22日現在]		[2021年 6月21日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6625円 16,625円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1379円 21,379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	81,100	3,690.00	299,259,000	
ショーボンドホールディングス	94,800	4,650.00	440,820,000	
アサヒグループホールディングス	152,900	5,280.00	807,312,000	
サントリー食品インターナショナル	104,600	4,115.00	430,429,000	
ニチレイ	100,700	2,841.00	286,088,700	
東レ	523,700	733.20	383,976,840	
日産化学	63,200	5,240.00	331,168,000	
信越化学工業	150,200	18,060.00	2,712,612,000	
エア・ウォーター	209,700	1,668.00	349,779,600	
三井化学	176,400	3,645.00	642,978,000	
ファンケル	154,800	3,540.00	547,992,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	181,300	2,903.00	526,313,900	
アステラス製薬	1,218,000	1,904.00	2,319,072,000	
エーザイ	77,400	12,150.00	940,410,000	
JCRファーマ	457,800	3,510.00	1,606,878,000	
第一三共	665,900	2,440.00	1,624,796,000	
日本製鉄	315,200	1,777.50	560,268,000	
住友金属鉱山	128,700	4,292.00	552,380,400	

D M G 森精機	313,600	1,913.00	599,916,800	
S M C	18,900	63,010.00	1,190,889,000	
住友重機械工業	66,800	3,005.00	200,734,000	
クボタ	445,600	2,235.50	996,138,800	
ダイキン工業	46,500	20,505.00	953,482,500	
日立製作所	151,200	5,887.00	890,114,400	
富士通	89,300	19,060.00	1,702,058,000	
ルネサスエレクトロニクス	1,765,600	1,144.00	2,019,846,400	
ソニーグループ	332,500	10,540.00	3,504,550,000	
T D K	50,100	13,120.00	657,312,000	
アドバンテスト	149,900	9,780.00	1,466,022,000	
キーエンス	21,200	55,110.00	1,168,332,000	
シスメックス	61,000	11,655.00	710,955,000	
フェローテックホールディングス	138,500	3,275.00	453,587,500	
カシオ計算機	168,800	1,812.00	305,865,600	
新光電気工業	220,200	3,845.00	846,669,000	
村田製作所	190,500	8,315.00	1,584,007,500	
S C R E E Nホールディングス	35,500	10,530.00	373,815,000	
東京エレクトロン	43,800	47,570.00	2,083,566,000	
デンソー	116,700	7,289.00	850,626,300	
日産自動車	908,000	523.10	474,974,800	
トヨタ自動車	373,900	9,638.00	3,603,648,200	
スズキ	119,100	4,343.00	517,251,300	
シマノ	20,500	25,075.00	514,037,500	
H O Y A	80,200	14,410.00	1,155,682,000	
バンダイナムコホールディングス	186,900	7,566.00	1,414,085,400	
ローランド	37,100	5,730.00	212,583,000	
任天堂	24,200	64,730.00	1,566,466,000	
西日本旅客鉄道	148,300	6,476.00	960,390,800	
ヤマトホールディングス	244,200	2,948.00	719,901,600	
商船三井	165,900	4,810.00	797,979,000	
N E C ネットスアイ	169,300	1,726.00	292,211,800	
G M O ペイメントゲートウェイ	96,900	13,950.00	1,351,755,000	
野村総合研究所	371,700	3,545.00	1,317,676,500	
J T O W E R	67,600	5,560.00	375,856,000	
Zホールディングス	1,387,500	524.60	727,882,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	167,300	3,325.00	556,272,500	
日本電信電話	411,000	2,824.00	1,160,664,000	
東宝	135,100	4,500.00	607,950,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	95,600	5,440.00	520,064,000	
ソフトバンクグループ	261,800	7,559.00	1,978,946,200	
神戸物産	118,500	3,205.00	379,792,500	
伊藤忠商事	146,000	3,154.00	460,484,000	
三井物産	386,700	2,418.50	935,233,950	

トラスコ中山	150,600	2,837.00	427,252,200	
ミスミグループ本社	227,200	3,640.00	827,008,000	
エービーシー・マート	35,900	6,190.00	222,221,000	
良品計画	372,300	2,032.00	756,513,600	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	236,800	2,275.00	538,720,000	
ニトリホールディングス	39,600	18,290.00	724,284,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,492,500	586.20	1,461,103,500	
三井住友フィナンシャルグループ	308,700	3,795.00	1,171,516,500	
第一生命ホールディングス	408,700	2,016.00	823,939,200	
アルヒ	252,000	1,453.00	366,156,000	
オリックス	234,700	1,865.00	437,715,500	
SREホールディングス	38,200	6,770.00	258,614,000	
オープンハウス	98,300	5,110.00	502,313,000	
東急不動産ホールディングス	1,169,500	696.00	813,972,000	
パーク24	61,700	2,040.00	125,868,000	
日本M&Aセンター	251,400	2,657.00	667,969,800	
カカクコム	194,600	3,280.00	638,288,000	
ベネフィット・ワン	196,000	3,445.00	675,220,000	
エムスリー	132,800	7,304.00	969,971,200	
サイバーエージェント	607,000	2,294.00	1,392,458,000	
エン・ジャパン	59,100	3,890.00	229,899,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	33,700	14,040.00	473,148,000	
リクルートホールディングス	197,300	5,390.00	1,063,447,000	
合 計	23,204,500	-	76,090,407,290	

(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

区 分	注記 番号	[2020年 6月22日現在]	[2021年 6月21日現在]
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		3,850,000	6,050,000
コール・ローン		404,824,004	1,239,157,336
国債証券		59,649,730,003	42,705,911,870
地方債証券		1,206,080,000	1,202,697,000
特殊債券		701,042,000	700,766,000

社債券		24,505,926,869	41,591,767,217
未収入金		2,409,373,700	5,331,713,000
未収利息		74,096,901	66,165,571
前払費用		6,026,003	9,130,883
流動資産合計		88,960,949,480	92,853,358,877
資産合計		88,960,949,480	92,853,358,877
負債の部			
流動負債			
未払金		1,896,479,950	5,974,592,200
未払解約金		616,438,428	270,583,637
未払利息		712	1,177
流動負債合計		2,512,919,090	6,245,177,014
負債合計		2,512,919,090	6,245,177,014
純資産の部			
元本等			
元本	1	61,270,505,828	61,207,975,564
剰余金			
剰余金又は欠損金()		25,177,524,562	25,400,206,299
元本等合計		86,448,030,390	86,608,181,863
純資産合計		86,448,030,390	86,608,181,863
負債純資産合計		88,960,949,480	92,853,358,877

(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 2020年 6月23日 至 2021年 6月21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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、 本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していな いため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[2020年 6月22日現在]	[2021年 6月21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	66,600,854,961円	61,270,505,828円
同期中における追加設定元本額	19,726,009,208円	17,182,426,212円
同期中における一部解約元本額	25,056,358,341円	17,244,956,476円
同期末における元本額	61,270,505,828円	61,207,975,564円

元本の内訳*		
東京海上セレクション・バランス30	3,736,815,370円	4,373,746,387円
東京海上セレクション・バランス50	4,751,307,321円	5,763,778,383円
東京海上セレクション・バランス70	1,160,898,128円	1,512,229,308円
東京海上セレクション・日本債券	12,295,996,791円	12,264,503,214円
東京海上・日本債券オープン(野村SMA向け)	6,126,862,733円	6,070,214,365円
東京海上・日本債券オープン(野村SMA・EW向け)	22,966,177,805円	25,509,917,385円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	119,377,258円	173,991,549円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	194,146,111円	133,398,338円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	71,147,230円	74,338,651円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	7,125,786円	9,105,073円
東京海上・日本債券オープンF(適格機関投資家専用)	9,840,651,295円	5,322,752,911円
計	61,270,505,828円	61,207,975,564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	61,270,505,828口	61,207,975,564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)

・金融商品の状況に関する事項

区分	自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日	自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21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	[2020年 6月22日現在]	[2021年 6月21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	<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。</p> <p>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。</p>	同左

（有価証券に関する注記）

（自 2019年6月21日 至 2020年6月22日）

売買目的有価証券

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

国債証券	208,355,015円
地方債証券	1,572,000円
特殊債券	1,000円
社債券	14,903,512円
合計	224,829,527円

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

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年3月24日から2020年6月22日まで)を指しております。

(自 2020年6月23日 至 2021年6月21日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	54,304,550円
地方債証券	333,000円
特殊債券	182,000円
社債券	100,203,032円
合計	153,992,582円

(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(2021年3月23日から2021年6月21日まで)を指しております。

(1口当たり情報に関する注記)

[2020年 6月22日現在]		[2021年 6月21日現在]	
1口当たり純資産額	1.4109円	1口当たり純資産額	1.4150円
(1万口当たり純資産額	14,109円)	(1万口当たり純資産額	14,150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4 2 3 回利付国債(2年)	3,304,000,000	3,311,632,240	
	第4 2 4 回利付国債(2年)	4,225,000,000	4,235,224,500	
	第4 2 5 回利付国債(2年)	1,630,000,000	1,633,960,900	
	第1 4 7 回利付国債(5年)	450,000,000	452,466,000	
	第7 回利付国債(40年)	10,000,000	12,921,800	
	第1 0 回利付国債(40年)	624,000,000	660,622,560	
	第1 1 回利付国債(40年)	127,000,000	130,329,940	
	第1 3 回利付国債(40年)	500,000,000	461,780,000	
	第1 4 回利付国債(40年)	1,724,000,000	1,702,812,040	
	第3 4 5 回利付国債(10年)	50,000,000	50,552,500	
	第3 4 6 回利付国債(10年)	339,000,000	342,915,450	
	第3 4 8 回利付国債(10年)	5,000,000	5,061,250	

第352回利付国債(10年)	2,360,000,000	2,390,939,600	
第353回利付国債(10年)	1,080,000,000	1,093,834,800	
第354回利付国債(10年)	1,149,000,000	1,163,293,560	
第361回利付国債(10年)	100,000,000	100,662,000	
第362回利付国債(10年)	1,213,000,000	1,220,059,660	
第15回利付国債(30年)	100,000,000	129,870,000	
第17回利付国債(30年)	160,000,000	207,072,000	
第23回利付国債(30年)	360,000,000	479,142,000	
第26回利付国債(30年)	75,000,000	99,498,750	
第27回利付国債(30年)	40,000,000	53,966,800	
第28回利付国債(30年)	50,000,000	67,751,500	
第33回利付国債(30年)	794,000,000	1,026,530,840	
第38回利付国債(30年)	710,000,000	903,404,000	
第40回利付国債(30年)	711,000,000	906,930,270	
第41回利付国債(30年)	250,000,000	314,157,500	
第44回利付国債(30年)	450,000,000	567,184,500	
第45回利付国債(30年)	30,000,000	36,499,500	
第48回利付国債(30年)	470,000,000	562,688,700	
第51回利付国債(30年)	600,000,000	565,176,000	
第52回利付国債(30年)	790,000,000	779,508,800	
第54回利付国債(30年)	5,000,000	5,275,900	
第56回利付国債(30年)	645,000,000	678,868,950	
第57回利付国債(30年)	636,000,000	668,900,280	
第58回利付国債(30年)	316,000,000	332,093,880	
第59回利付国債(30年)	134,000,000	137,272,280	
第60回利付国債(30年)	70,000,000	75,093,200	
第65回利付国債(30年)	110,000,000	103,016,100	
第67回利付国債(30年)	203,000,000	200,034,170	
第69回利付国債(30年)	110,000,000	110,949,300	
第70回利付国債(30年)	2,409,000,000	2,426,922,960	
第79回利付国債(20年)	40,000,000	43,412,000	
第104回利付国債(20年)	170,000,000	196,066,100	
第105回利付国債(20年)	230,000,000	266,544,700	
第112回利付国債(20年)	177,000,000	207,544,890	
第113回利付国債(20年)	248,000,000	291,789,360	
第117回利付国債(20年)	80,000,000	94,811,200	
第122回利付国債(20年)	255,000,000	297,029,100	
第129回利付国債(20年)	20,000,000	23,480,600	
第132回利付国債(20年)	140,000,000	163,776,200	
第133回利付国債(20年)	50,000,000	59,012,500	
第135回利付国債(20年)	315,000,000	369,545,400	
第136回利付国債(20年)	70,000,000	81,375,700	
第143回利付国債(20年)	751,000,000	880,209,550	
第144回利付国債(20年)	120,000,000	139,255,200	
第145回利付国債(20年)	477,000,000	566,113,140	

	第147回利付国債(20年)	30,000,000	35,379,000	
	第150回利付国債(20年)	310,000,000	359,395,400	
	第151回利付国債(20年)	388,000,000	440,143,320	
	第152回利付国債(20年)	773,000,000	877,555,980	
	第155回利付国債(20年)	62,000,000	68,841,700	
	第158回利付国債(20年)	110,000,000	113,954,500	
	第159回利付国債(20年)	490,000,000	514,813,600	
	第161回利付国債(20年)	450,000,000	472,041,000	
	第162回利付国債(20年)	40,000,000	41,923,600	
	第163回利付国債(20年)	880,000,000	921,492,000	
	第164回利付国債(20年)	260,000,000	267,649,200	
	第165回利付国債(20年)	110,000,000	113,099,800	
	第168回利付国債(20年)	170,000,000	171,133,900	
	第169回利付国債(20年)	1,895,000,000	1,871,028,250	
	第170回利付国債(20年)	1,358,000,000	1,338,309,000	
	第176回利付国債(20年)	900,000,000	912,294,000	
	第19回インドネシア共和国円貨債券(2021)	100,000,000	100,015,000	
国債証券	合計	40,587,000,000	42,705,911,870	
地方債証券	第69回神奈川県公募公債(5年)	800,000,000	799,976,000	
	平成27年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,229,000	
	令和2年度第3回長野県公募公債	200,000,000	200,044,000	
	平成23年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	100,448,000	
地方債証券	合計	1,200,000,000	1,202,697,000	
特殊債券	い第816号商工債	100,000,000	100,250,000	
	い第817号商工債	100,000,000	100,261,000	
	第331回信中金債(5年)	500,000,000	500,255,000	
特殊債券	合計	700,000,000	700,766,000	
社債券	第1回BPCE円貨社債(5年)	100,000,000	100,236,000	
	第5回BPCE円貨社債	200,000,000	200,214,000	
	第1回クレディ・アグリコル円貨社債(劣後)	100,000,000	104,115,000	
	第9回クレディ・アグリコル円貨社債	200,000,000	201,604,000	
	第1回ロイズ・バンキング・グループ円貨社債	100,000,000	100,131,000	
	第4回ロイズ・バンキング・グループ円貨社債	200,000,000	200,288,000	
	第1回バンコ・サントナール無担保社債	100,000,000	100,312,000	
	第48回韓国産業銀行円貨債券	400,000,000	400,036,000	
	第68回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,000,000	

第94回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,997,000	
第99回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	200,000,000	199,990,000	
第102回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	200,000,000	199,986,000	
第19回阪神高速道路株式会社社債	400,000,000	400,016,000	
第16回水資源債券	100,000,000	99,995,000	
第18回水資源債券	200,000,000	199,880,000	
第71回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,996,000	
第55回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,995,000	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,126,000	12,469,044	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	25,734,000	26,546,679	
第98回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,756,000	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,203,000	40,112,003	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	55,708,000	55,690,173	
第307回一般担保住宅金融支援機構債券	700,000,000	699,580,000	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	94,104,000	94,111,528	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,070,000	100,305,402	
第167回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,430,000	100,654,977	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,861,000	101,002,411	
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,182,000	
第62回日本学生支援債券	100,000,000	99,976,000	
ゴールドマン・サックスEMTN 2018	400,000,000	399,000,000	
第3回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債(2018)	100,000,000	99,739,000	
ソシエテ・ジェネラルEMTN 2021	300,000,000	298,341,000	
第81回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,274,000	
第72回中日本高速道路株式会社社債	300,000,000	300,102,000	
第86回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,068,000	
第87回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,070,000	

第88回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,024,000	
第89回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,024,000	
第56回西日本高速道路株式会社社債	500,000,000	500,335,000	
第59回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,023,000	
第144回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,976,000	
第145回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,274,000	
第1回国際石油開発帝石株式会社無担保社債	100,000,000	100,229,000	
第2回国際石油開発帝石株式会社無担保社債	100,000,000	100,888,000	
第2回株式会社高松コンストラクショングループ無担保社債	200,000,000	200,324,000	
第30回清水建設株式会社無担保社債	200,000,000	200,500,000	
第14回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	100,000,000	100,375,000	
第1回三井住友建設株式会社無担保社債	200,000,000	200,066,000	
第8回戸田建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,093,000	
第3回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,049,000	
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	200,000,000	200,186,000	
第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,323,000	
第3回協和エクシオ株式会社無担保社債	100,000,000	99,928,000	
第4回高砂熱学工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,991,000	
BNPパリバEMTN2021	200,000,000	200,080,000	
パークレイズEMTN2021	300,000,000	300,615,000	
パークシャー・ハサウェイEMTN2021	500,000,000	502,600,000	
アフラックEMTN2021	200,000,000	201,870,000	
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	99,899,000	
第14回日本ハム株式会社無担保社債	300,000,000	301,221,000	
第1回アサヒグループホールディングス無担保社債(劣後)	200,000,000	203,950,000	
第16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	100,000,000	100,016,000	
第18回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,035,000	

第19回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,186,000	
第20回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,510,000	
第4回サントリー食品インターナショナル株式会社無担保社債	300,000,000	299,493,000	
第35回双日株式会社無担保社債	100,000,000	101,418,000	
第2回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	100,404,000	
第9回J・フロントリテイリング株式会社無担保社債	200,000,000	200,086,000	
第15回野村不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,452,000	
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	300,000,000	301,383,000	
第1回三井不動産ロジスティクスパーク投資法人債	100,000,000	100,261,000	
第1回日本土地建物株式会社無担保社債	100,000,000	99,667,000	
第3回日本土地建物株式会社無担保社債	100,000,000	99,396,000	
第5回日本土地建物株式会社無担保社債	100,000,000	98,875,000	
第21回大王製紙株式会社無担保社債	200,000,000	199,644,000	
第2回住友化学株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	100,666,000	
第52回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,991,000	
第40回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,093,000	
第41回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,322,000	
第16回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,999,000	
第17回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	200,000,000	202,996,000	
第2回大日本住友製薬無担保社債(劣後)	100,000,000	104,459,000	
第12回株式会社資生堂無担保社債	400,000,000	399,964,000	
第1回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債(劣後)	200,000,000	200,604,000	
第2回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債(劣後)	400,000,000	403,852,000	
第67回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	100,093,000	
第1回共英製鋼株式会社無担保社債	100,000,000	100,093,000	
第35回三菱マテリアル株式会社無担保社債	200,000,000	200,138,000	

第47回古河電気工業株式会社無担保社債	200,000,000	200,068,000	
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	199,904,000	
第20回日立建機株式会社無担保社債	100,000,000	100,360,000	
第1回栗田工業株式会社無担保社債	200,000,000	200,026,000	
第15回THK株式会社無担保社債	100,000,000	99,613,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	100,116,000	
第1回株式会社明電舎無担保社債	100,000,000	100,032,000	
第19回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,789,000	
第22回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,555,000	
第6回TDK株式会社無担保社債	100,000,000	100,065,000	
第46回株式会社IHI無担保社債	200,000,000	200,040,000	
第5回A号富国生命保険相互会社無担保社債(劣後)	100,000,000	100,371,000	
第16回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,844,000	
第3回昭和リース株式会社無担保社債	300,000,000	299,364,000	
第2回株式会社かんぼ生命保険無担保社債(劣後)	500,000,000	508,895,000	
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	100,036,000	
第7回コンコルディア・フィナンシャルグループ(劣後)	200,000,000	200,032,000	
第1回大樹生命保険株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	100,116,000	
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	300,369,000	
第3回明治安田生命保険無担保社債(劣後特約付)	400,000,000	403,976,000	
第9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	100,096,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,107,000	
第31回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,271,000	
第26回トヨタ自動車株式会社無担保社債	300,000,000	300,282,000	
第1回愛三工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,843,000	
第1回日本生命第1回劣後ローン流動化株式会社無担保社債(劣後)	200,000,000	203,714,000	

第1回日本生命第2回劣後ローン流動化株式会社無担保社債(劣後)	300,000,000	305,133,000	
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,155,000	
第1回住友生命第1回劣後ローン流動化株式会社無担保(劣後)	100,000,000	99,983,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	300,000,000	300,120,000	
第23回株式会社ニコン無担保社債	200,000,000	199,878,000	
第3回兼松株式会社無担保社債	100,000,000	99,966,000	
第1回ニプロ株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	102,133,000	
第37回株式会社丸井グループ無担保社債	200,000,000	199,680,000	
第6回株式会社新生銀行無担保社債	200,000,000	200,466,000	
第28回株式会社あおぞら銀行無担保社債	200,000,000	200,024,000	
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	300,051,000	
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	199,852,000	
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	101,098,000	
第1回株式会社千葉銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	100,990,000	
第3回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	199,660,000	
第2回株式会社北國銀行無担保社債(劣後)	200,000,000	199,982,000	
第18回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	300,000,000	300,111,000	
第19回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	200,000,000	200,084,000	
第10回みずほフィナンシャルグループ(劣後)	600,000,000	611,202,000	
第28回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,850,000	
第30回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,936,000	
第7回みずほリース株式会社無担保社債	300,000,000	300,903,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	400,000,000	401,844,000	
第17回NTTファイナンス株式会社無担保社債	400,000,000	403,380,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	500,000,000	506,240,000	

第68回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	300,000,000	299,964,000	
第69回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	200,190,000	
第95回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,962,000	
第96回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,144,000	
第40回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,816,000	
第16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	100,028,000	
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	301,458,000	
第77回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,072,000	
第80回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,831,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,311,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,019,000	
第33回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,117,000	
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	200,000,000	203,148,000	
第27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	99,969,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,920,000	
第201回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,705,000	
第204回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,921,000	
第205回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,946,000	
第36回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,093,000	
第37回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,252,000	
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	100,280,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,280,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債(劣後)	300,000,000	301,782,000	
第1回アニコムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,156,000	
第1回第一生命ホールディングス無担保社債(劣後)	100,000,000	102,139,000	

第3回第一生命ホールディングス無担保社債(劣後)	300,000,000	304,617,000	
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	100,509,000	
第5回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	101,860,000	
第1回あいおいニッセイ同和損害保険株式会社無担保社債(劣後)	200,000,000	200,430,000	
第1回株式会社T&Dホールディングス無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	203,514,000	
第2回株式会社T&Dホールディングス無担保社債(劣後)	100,000,000	100,216,000	
第3回株式会社T&Dホールディングス無担保社債(劣後)	100,000,000	99,736,000	
第5回三菱地所株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	100,178,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	200,064,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	400,000,000	401,472,000	
第9回NTT都市開発リート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	99,786,000	
第10回NTT都市開発リート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	99,891,000	
第1回森トラスト・ホールディングス無担保社債	500,000,000	495,735,000	
第128回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,033,000	
第5回東急株式会社無担保社債	500,000,000	500,175,000	
第7回東急株式会社無担保社債	100,000,000	99,885,000	
第162回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	199,728,000	
第163回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	199,760,000	
第164回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	500,000,000	502,590,000	
第72回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	199,728,000	
第73回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,879,000	
第7回株式会社鴻池運輸無担保社債	200,000,000	200,454,000	
第2回西日本鉄道株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	100,191,000	
第58回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,969,000	
第59回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,060,000	
第64回名古屋鉄道株式会社無担保社債	400,000,000	399,312,000	

第8回ニッコンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,033,000	
第2回飯野海運株式会社無担保社債	100,000,000	100,067,000	
第8回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	201,022,000	
第10回日本航空株式会社無担保社債	100,000,000	100,068,000	
第4回株式会社ヤマタネ無担保社債	200,000,000	199,982,000	
第11回ソフトバンク無担保社債	100,000,000	100,092,000	
第12回ソフトバンク無担保社債	100,000,000	100,251,000	
第13回ソフトバンク無担保社債	200,000,000	200,634,000	
第32回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	100,020,000	
第1回GMOインターネット株式会社無担保社債	100,000,000	100,450,000	
第2回GMOインターネット株式会社無担保社債	100,000,000	101,724,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,153,000	
第537回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,068,000	
第538回関西電力株式会社社債	600,000,000	604,026,000	
第416回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,052,000	
第316回北陸電力株式会社社債	400,000,000	405,444,000	
第342回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,984,000	
第343回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,309,000	
第345回北陸電力株式会社社債	200,000,000	199,682,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,413,000	
第529回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,831,000	
第530回東北電力株式会社社債	200,000,000	201,022,000	
第531回東北電力株式会社社債	300,000,000	300,927,000	
第1回九州電力株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	101,638,000	
第3回九州電力株式会社無担保社債(劣後)	100,000,000	104,768,000	
第491回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,446,000	
第493回九州電力株式会社社債	500,000,000	500,365,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,260,000	
第369回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,968,000	
第370回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,405,000	
第72回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	201,084,000	
第73回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	200,642,000	
第8回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,131,000	

第35回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,622,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,215,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	103,576,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,427,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	103,896,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,952,000	
第46回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,789,000	
第2回株式会社JERA無担保社債	400,000,000	403,936,000	
第1回大阪瓦斯株式会社無担保社債（劣後）	100,000,000	99,987,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	100,306,000	
第2回大阪瓦斯株式会社無担保社債（劣後）	100,000,000	100,345,000	
第8回SCSK株式会社無担保社債	100,000,000	100,069,000	
第14回コナミホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,157,000	
第4回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	102,939,000	
社債券 合計	41,424,236,000	41,591,767,217	
合計	83,911,236,000	86,201,142,087	

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	[2020年 6月22日現在]	[2021年 6月21日現在]
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		94,443,873	172,815,324
コール・ローン		730,537,877	1,189,077,522
株式		35,018,551,041	48,253,144,475
未収配当金		27,384,672	18,266,857
流動資産合計		35,870,917,463	49,633,304,178
資産合計		35,870,917,463	49,633,304,178

負債の部		
流動負債		
未払解約金	320,356,810	472,937,723
未払利息	1,285	1,130
流動負債合計	320,358,095	472,938,853
負債合計	320,358,095	472,938,853
純資産の部		
元本等		
元本	1	11,759,741,648
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		23,790,817,720
元本等合計		35,550,559,368
純資産合計		35,550,559,368
負債純資産合計		35,870,917,463
		49,633,304,178

(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 2020年 6月23日 至 2021年 6月21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	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。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	[2020年 6月22日現在]	[2021年 6月21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	11,543,858,293円	11,759,741,648円
同期中における追加設定元本額	3,317,753,734円	3,038,340,140円
同期中における一部解約元本額	3,101,870,379円	3,044,132,569円
同期末における元本額	11,759,741,648円	11,753,949,219円
元本の内訳*		
東京海上セレクション・外国株式	8,911,739,783円	9,212,466,969円
東京海上セレクション・バランス30	380,349,879円	319,412,788円
東京海上セレクション・バランス50	1,262,548,084円	1,099,123,562円
東京海上セレクション・バランス70	1,110,365,081円	1,038,169,192円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型）	57,093,756円	59,699,737円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	15,523,265円	7,632,295円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	17,010,871円	12,757,153円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	5,110,929円	4,687,523円
計	11,759,741,648円	11,753,949,219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	11,759,741,648口	11,753,949,219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）

・金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日	自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21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	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	[2020年 6月22日現在]	[2021年 6月21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つた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
----------------------------	--	----

(有価証券に関する注記)

(自 2019年6月21日 至 2020年6月22日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	8,731,496,562円
合計	8,731,496,562円

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

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年3月24日から2020年6月22日まで)を指しております。

(自 2020年6月23日 至 2021年6月21日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,952,778,347円
合計	3,952,778,347円

(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(2021年3月23日から2021年6月21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

(2020年6月22日現在)

該当事項はありません。

(2021年6月21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)

[2020年 6月22日現在]		[2021年 6月21日現在]	
1口当たり純資産額	3.0231円	1口当たり純資産額	4.1825円
(1万口当たり純資産額)	30,231円)	(1万口当たり純資産額)	41,825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	
CHEVRONTEXACO CORP	15,600	103.03	1,607,268.00	
CONOCOPHILLIPS	14,100	57.53	811,173.00	
EOG RESOURCES INC	12,200	79.31	967,582.00	
EXXON MOBIL CORPORATION	33,100	60.40	1,999,240.00	
HALLIBURTON CO	12,000	21.99	263,880.00	
KINDER MORGAN INC	12,000	17.66	211,920.00	
PHILLIPS 66	4,700	84.17	395,599.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,000	154.84	464,520.00	
SCHLUMBERGER LTD	10,000	31.29	312,900.00	
BALL CORP	10,000	79.19	791,900.00	
CORTEVA INC	5,791	42.71	247,333.61	
DOW INC	5,791	61.98	358,926.18	
DUPONT DE NEMOURS INC	5,791	76.43	442,606.13	
ECOLAB INC	1,500	205.01	307,515.00	
INTERNATIONAL PAPER CO	5,000	59.23	296,150.00	
LINDE PLC	3,300	282.02	930,666.00	
PPG INDUSTRIES INC	2,200	168.12	369,864.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,800	268.16	482,688.00	
BOEING CO	40,900	237.35	9,707,615.00	
NIKE INC -CL B	41,000	128.41	5,264,810.00	
BRIGHT HORIZONS FAMILY SOLUTIONS INC	47,306	152.13	7,196,661.78	
DOMINO'S PIZZA INC	15,200	460.19	6,994,888.00	
ALPHABET INC-CL A	5,400	2,402.22	12,971,988.00	
ALPHABET INC-CL C	5,300	2,511.35	13,310,155.00	
FACEBOOK INC-A	48,600	329.66	16,021,476.00	
THE WALT DISNEY CO	32,900	172.42	5,672,618.00	
AMAZON.COM INC	6,900	3,486.90	24,059,610.00	
TJX COMPANIES INC	156,900	63.37	9,942,753.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	36,900	221.25	8,164,125.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	89,600	62.14	5,567,744.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	48,200	295.88	14,261,416.00	
MEDTRONIC PLC	24,600	123.23	3,031,458.00	
STRYKER CORP	28,800	254.91	7,341,408.00	
TELADOC HEALTH INC	13,600	156.31	2,125,816.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	39,900	389.37	15,535,863.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,200	180.69	3,288,558.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,300	81.90	1,007,370.00	
MERCK & CO. INC.	50,600	76.61	3,876,466.00	
ORGANON & CO-W/I	5,060	29.98	151,698.80	

SEAGEN INC	6,800	156.31	1,062,908.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	57,000	178.35	10,165,950.00	
HDFC Bank Ltd	91,300	74.42	6,794,546.00	
SIGNATURE BANK/NEW YORK NY	16,000	234.50	3,752,000.00	
MSCI INC	26,000	502.90	13,075,400.00	
S&P GLOBAL INC	35,100	390.71	13,713,921.00	
ADOBE INC	20,300	565.59	11,481,477.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	36,300	367.42	13,337,346.00	
MICROSOFT CORP	11,900	259.43	3,087,217.00	
OKTA INC	13,000	239.26	3,110,380.00	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	81,200	25.37	2,060,044.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	32,400	283.38	9,181,512.00	
SALESFORCE.COM INC	59,900	242.78	14,542,522.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	30,800	230.41	7,096,628.00	
APPLE INC	30,800	130.46	4,018,168.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	4,900	82.35	403,515.00	
DOMINION ENERGY INC	4,000	74.82	299,280.00	
DUKE ENERGY CORP	10,300	99.61	1,025,983.00	
EXELON CORP	8,500	44.55	378,675.00	
NEXTERA ENERGY INC	20,400	73.28	1,494,912.00	
PPL CORPORATION	30,600	27.61	844,866.00	
SOUTHERN CO	12,200	61.45	749,690.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	33,100	84.65	2,801,915.00	
NVIDIA CORP	20,900	745.55	15,581,995.00	
Taiwan Semiconductor Manufacturing	19,700	115.79	2,281,063.00	
米ドル小計	1,639,439		329,098,141.50 (36,283,070,100)	
	銘柄数	64		
	比率	73.8%	75.2%	
加ドル	株	加ドル	加ドル	
ENBRIDGE INC	13,000	49.43	642,590.00	
SUNCOR ENERGY INC	12,900	29.10	375,390.00	
TC ENERGY CORP	10,000	63.98	639,800.00	
DOLLARAMA INC	177,200	55.90	9,905,480.00	
加ドル小計	213,100		11,563,260.00 (1,025,082,999)	
	銘柄数	4		
	比率	2.1%	2.1%	
ユーロ	株	ユーロ	ユーロ	
ENI SPA	25,400	10.31	261,975.60	
TOTALENERGIES SE	17,400	39.53	687,909.00	
AIR LIQUIDE	5,710	144.60	825,666.00	
AKZO NOBEL	5,333	105.30	561,564.90	
BASF SE	13,200	64.56	852,192.00	

KONINKLIJKE DSM NV	3,800	152.40	579,120.00	
SYMRISE AG	3,500	114.60	401,100.00	
AIRBUS SE	67,500	112.72	7,608,600.00	
KERRY GROUP PLC-A	19,500	106.65	2,079,675.00	
E.ON SE	50,000	9.99	499,500.00	
ENEL SPA	100,000	8.05	805,400.00	
ENGIE	8,000	11.90	95,200.00	
IBERDROLA SA	70,000	10.73	751,100.00	
ASML HOLDING NV	5,400	563.80	3,044,520.00	
ユーロ小計	394,743		19,053,522.50 (2,494,487,165)	
	銘柄数	14		
	比率	5.1%	5.2%	
英ポンド	株	英ポンド	英ポンド	
BP PLC	140,000	3.15	441,560.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	34,500	14.18	489,279.00	
JOHNSON MATTHEY PLC	9,722	30.18	293,409.96	
ASHTREAD GROUP PLC	218,100	50.04	10,913,724.00	
ASTRAZENECA PLC	63,300	83.84	5,307,072.00	
ST JAMES'S PLACE PLC	230,300	14.53	3,346,259.00	
BEAZLEY PLC	179,400	3.07	551,655.00	
NATIONAL GRID PLC	47,941	9.24	443,406.30	
英ポンド小計	923,263		21,786,365.26 (3,321,331,383)	
	銘柄数	8		
	比率	6.8%	6.9%	
スイスフラン	株	スイスフラン	スイスフラン	
GIVAUDAN-REG	100	4,253.00	425,300.00	
LONZA GROUP AG-REG	5,500	652.00	3,586,000.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	22,300	348.25	7,765,975.00	
スイスフラン小計	27,900		11,777,275.00 (1,408,444,317)	
	銘柄数	3		
	比率	2.9%	2.9%	
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	173.56	7,810,200.00	
YARA INTERNATIONAL ASA	6,000	459.20	2,755,200.00	
ノルウェークローネ小計	51,000		10,565,400.00 (134,497,542)	
	銘柄数	2		
	比率	0.3%	0.3%	
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	
NOVO NORDISK A/S-B	97,800	514.50	50,318,100.00	
デンマーククローネ小計	97,800		50,318,100.00	

			(886,101,741)	
	銘柄数		1	
	比率		1.8%	1.8%
豪ドル	株	豪ドル	豪ドル	
BHP GROUP LIMITED	40,000	46.52	1,860,800.00	
RIO TINTO LIMITED	10,000	123.47	1,234,700.00	
CSL LIMITED	11,700	305.52	3,574,584.00	
HUB24 LTD	66,078	28.56	1,887,187.68	
豪ドル小計	127,778		8,557,271.68	(708,199,804)
	銘柄数		4	
	比率		1.4%	1.5%
香港ドル	株	香港ドル	香港ドル	
Sands China Ltd	864,400	34.05	29,432,820.00	
TENCENT HOLDINGS LIMITED	91,600	603.00	55,234,800.00	
Ping An Insurance Group Co	718,000	77.45	55,609,100.00	
香港ドル小計	1,674,000		140,276,720.00	(1,991,929,424)
	銘柄数		3	
	比率		4.1%	4.1%
合計	株		円	
	5,149,023		48,253,144,475	(48,253,144,475)

(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

		[2020年 6月22日現在]	[2021年 6月21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		28,713,364	42,756,367
コール・ローン		265,576,877	276,805,181
国債証券		22,180,203,605	25,470,207,282
未収入金			455,708,872
未収利息		109,703,552	106,328,668

前払費用		36,326,971	16,593,745
流動資産合計		22,620,524,369	26,368,400,115
資産合計		22,620,524,369	26,368,400,115
負債の部			
流動負債			
未払金			459,490,481
未払解約金		157,019,356	179,065,685
未払利息		467	263
流動負債合計		157,019,823	638,556,429
負債合計		157,019,823	638,556,429
純資産の部			
元本等			
元本	1	9,508,871,556	10,290,139,050
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		12,954,632,990	15,439,704,636
元本等合計		22,463,504,546	25,729,843,686
純資産合計		22,463,504,546	25,729,843,686
負債純資産合計		22,620,524,369	26,368,400,115

(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 2020年 6月23日 至 2021年 6月21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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

自 2020年 6月23日
至 2021年 6月21日

本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	[2020年 6月22日現在]	[2021年 6月21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	9,137,790,520円	9,508,871,556円
同期中における追加設定元本額	2,333,256,351円	2,262,979,339円
同期中における一部解約元本額	1,962,175,315円	1,481,711,845円
同期末における元本額	9,508,871,556円	10,290,139,050円
元本の内訳*		
東京海上セレクション・外国債券	5,194,081,114円	5,299,523,249円
東京海上セレクション・バランス30	952,911,953円	1,046,535,771円
東京海上セレクション・バランス50	2,108,372,291円	2,400,706,363円
東京海上セレクション・バランス70	1,181,983,625円	1,445,539,060円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型）	71,522,573円	97,834,607円
計	9,508,871,556円	10,290,139,050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	9,508,871,556口	10,290,139,050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）

・金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日	自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21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

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

・ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2020年 6月22日現在]	[2021年 6月21日現在]
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額</p>	<p>時価で計上しているため、その差額はありません。</p>	<p>同左</p>
<p>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>	<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つた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
----------------------------	--	----

(有価証券に関する注記)

(自 2019年6月21日 至 2020年6月22日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	451,915,176円
合計	451,915,176円

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

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年3月24日から2020年6月22日まで)を指しております。

(自 2020年6月23日 至 2021年6月21日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	136,225,024円
合計	136,225,024円

(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(2021年3月23日から2021年6月21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

(2020年6月22日現在)

該当事項はありません。

(2021年6月21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)

[2020年 6月22日現在]		[2021年 6月21日現在]	
1口当たり純資産額	2.3624円	1口当たり純資産額	2.5004円
(1万口当たり純資産額	23,624円)	(1万口当たり純資産額	25,004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 0 1/2 05/31/27	2,100,000	2,031,175.77	
		T 0 1/2 06/30/27	200,000	193,234.37	
		T 0 1/2 08/31/27	800,000	771,125.00	
		T 0 1/2 10/31/27	5,000,000	4,802,539.05	
		T 0 1/4 05/31/25	5,000,000	4,912,109.40	
		T 0 1/4 06/30/25	1,300,000	1,275,980.45	
		T 0 1/4 07/31/25	400,000	392,109.37	
		T 0 1/4 08/31/25	100,000	97,906.25	
		T 0 3/8 01/31/26	200,000	195,781.24	
		T 0 3/8 04/30/25	4,800,000	4,744,312.51	
		T 0 3/8 09/30/27	6,900,000	6,590,847.63	
		T 0 3/8 12/31/25	100,000	98,003.90	
		T 0 5/8 11/30/27	3,300,000	3,191,460.95	
		T 0 5/8 12/31/27	1,900,000	1,834,910.13	
		T 1 1/4 03/31/28	2,600,000	2,607,820.29	
		T 1 1/4 04/30/28	1,500,000	1,503,925.78	
		T 1 1/8 02/28/25	1,200,000	1,222,078.11	
		T 1 1/8 02/28/27	1,600,000	1,608,937.50	
		T 1 1/8 02/29/28	800,000	796,843.75	
		T 1 3/4 12/31/24	1,000,000	1,040,351.56	
		T 1 3/4 12/31/26	3,400,000	3,539,585.94	
		T 1 3/8 01/31/25	100,000	102,687.50	
		T 1 5/8 09/30/26	1,100,000	1,138,542.96	
		T 1 5/8 10/31/26	1,100,000	1,138,542.96	
		T 1 5/8 11/30/26	3,400,000	3,515,945.30	
		T 1 7/8 06/30/26	700,000	733,496.09	
		T 2 08/15/25	2,400,000	2,524,500.00	
		T 2 1/2 02/15/45	3,200,000	3,486,499.99	
		T 2 1/2 02/15/46	1,000,000	1,091,640.62	
		T 2 1/2 05/15/46	900,000	983,214.84	
		T 2 11/15/26	500,000	527,636.72	
		T 2 3/4 02/15/28	100,000	110,195.31	
		T 2 3/4 08/15/42	1,900,000	2,153,679.69	
		T 2 3/4 11/15/42	400,000	453,062.50	
		T 2 3/8 04/30/26	4,300,000	4,605,703.12	
		T 2 5/8 02/15/29	4,500,000	4,934,355.47	
		T 2 7/8 05/15/28	300,000	333,128.90	
		T 2 7/8 05/15/43	100,000	115,613.28	
		T 2 7/8 08/15/28	200,000	222,390.62	
T 2 7/8 11/15/46	100,000	117,027.34			
T 3 02/15/47	1,000,000	1,197,421.87			

	T 3 05/15/45	1,100,000	1,306,378.90	
	T 3 1/8 02/15/43	500,000	600,664.06	
	T 3 1/8 11/15/28	7,500,000	8,481,738.29	
	T 3 11/15/44	400,000	474,015.62	
	T 3 3/4 11/15/43	2,000,000	2,642,812.50	
	T 3 3/8 05/15/44	600,000	753,210.93	
	T 3 5/8 02/15/44	3,400,000	4,423,453.13	
	T 3 5/8 08/15/43	1,900,000	2,462,949.20	
	US TREASURY N/B	1,700,000	1,653,980.45	
米ドル小計		90,600,000	95,735,527.11 (10,554,841,863)	
	銘柄数	50		
	比率	41.0%	41.4%	
加ドル			加ドル	
	CAN 0 1/2 09/01/25	1,800,000	1,772,784.00	
	CAN 0 1/4 03/01/26	1,200,000	1,161,000.00	
	CAN 0 1/4 04/01/24	800,000	792,200.00	
	CAN 0 1/4 05/01/23	400,000	398,500.00	
	CAN 1 06/01/27	100,000	99,735.00	
	CAN 1 09/01/26	400,000	399,056.00	
	CAN 2 1/4 06/01/29	500,000	539,220.00	
	CAN 3 1/2 12/01/45	600,000	804,582.00	
	CAN 4 06/01/41	400,000	554,240.00	
	CAN 5 06/01/37	400,000	589,952.00	
	CAN 5 3/4 06/01/33	700,000	1,021,769.00	
	CAN 5.75 06/01/29	100,000	134,137.00	
加ドル小計		7,400,000	8,267,175.00 (732,885,063)	
	銘柄数	12		
	比率	2.8%	2.9%	
メキシコペソ			メキシコペソ	
	MBONO 10 11/20/36	9,000,000	11,393,437.50	
	MBONO 10 12/05/24	15,000,000	16,977,075.00	
	MBONO 7 1/2 06/03/27	23,000,000	24,185,937.50	
	MBONO 7 3/4 05/29/31	3,000,000	3,201,562.50	
	MBONO 8 09/05/24	24,000,000	25,520,424.00	
	MBONO 8 1/2 11/18/38	25,000,000	27,843,750.00	
	MBONO 8 12/07/23	16,000,000	16,915,000.00	
メキシコペソ小計		115,000,000	126,037,186.50 (674,210,721)	
	銘柄数	7		
	比率	2.6%	2.6%	
ユーロ			ユーロ	
	BGB 0 1/2 10/22/24	700,000	725,935.00	

BGB 0 10/22/31	100,000	98,740.00	
BGB 0.2 10/22/23	300,000	305,880.00	
BGB 0.8 06/22/25	100,000	105,380.00	
BGB 2.15 06/22/66	100,000	138,880.00	
BGB 3 06/22/34	200,000	269,380.00	
BGB 3 3/4 06/22/45	300,000	498,660.00	
BGB 4 1/4 03/28/41	500,000	835,500.00	
BGB 5 03/28/35	500,000	817,600.00	
BKO 0 03/10/23	200,000	202,308.00	
BKO 0 06/16/23	200,000	202,702.00	
BKO 0 09/16/22	200,000	201,694.00	
BKO 0 12/15/22	100,000	101,010.00	
BTPS 0 04/01/26	200,000	198,760.00	
BTPS 0 04/15/24	400,000	401,960.00	
BTPS 0.9 04/01/31	100,000	100,810.00	
BTPS 0.95 03/01/37	100,000	94,930.00	
BTPS 0.95 09/15/27	800,000	829,040.00	
BTPS 1 07/15/22	1,200,000	1,213,380.00	
BTPS 1 3/4 07/01/24	100,000	105,760.00	
BTPS 1.85 07/01/25	1,300,000	1,396,590.00	
BTPS 2 02/01/28	700,000	772,310.00	
BTPS 2.1 07/15/26	300,000	329,430.00	
BTPS 2.45 09/01/33	700,000	810,810.00	
BTPS 2.8 12/01/28	100,000	116,630.00	
BTPS 3 08/01/29	100,000	118,920.00	
BTPS 3 3/4 09/01/24	500,000	562,350.00	
BTPS 3.1 03/01/40	500,000	631,350.00	
BTPS 3.35 03/01/35	500,000	636,450.00	
BTPS 4 02/01/37	900,000	1,238,760.00	
BTPS 4 1/2 03/01/26	700,000	844,550.00	
BTPS 4 3/4 09/01/44	600,000	958,200.00	
BTPS 5 08/01/34	900,000	1,320,300.00	
BTPS 5 08/01/39	800,000	1,253,200.00	
BTPS 5 09/01/40	800,000	1,268,800.00	
BTPS 5 3/4 02/01/33	700,000	1,069,180.00	
BTPS 6 05/01/31	1,000,000	1,492,900.00	
BTPS 6 1/2 11/01/27	200,000	276,840.00	
DBR 0 02/15/31	600,000	614,688.00	
DBR 0 05/15/35	800,000	803,128.00	
DBR 0 05/15/36	300,000	298,599.00	
DBR 0 08/15/29	1,800,000	1,855,242.00	
DBR 0 08/15/30	1,700,000	1,747,039.00	
DBR 0 08/15/31	400,000	408,360.00	

DBR 0 11/15/27	800,000	825,096.00	
DBR 0 11/15/28	300,000	309,090.00	
DBR 1 1/4 08/15/48	300,000	382,227.00	
DBR 2 1/2 08/15/46	1,200,000	1,893,336.00	
DBR 4 01/04/37	1,000,000	1,632,850.00	
FRTR 0 02/25/24	1,900,000	1,929,450.00	
FRTR 0 02/25/26	1,300,000	1,324,895.00	
FRTR 0 02/25/27	300,000	304,980.00	
FRTR 0 03/25/25	1,700,000	1,732,640.00	
FRTR 0 1/2 05/25/25	200,000	207,900.00	
FRTR 0 1/2 05/25/29	100,000	104,600.00	
FRTR 0 11/25/29	2,700,000	2,708,910.00	
FRTR 0 11/25/30	2,500,000	2,486,500.00	
FRTR 0 11/25/31	500,000	492,150.00	
FRTR 1 1/2 05/25/31	1,900,000	2,166,380.00	
FRTR 1 1/4 05/25/34	1,400,000	1,565,480.00	
FRTR 2 1/2 05/25/30	1,400,000	1,714,860.00	
FRTR 3 1/4 05/25/45	800,000	1,239,840.00	
FRTR 4 04/25/55	800,000	1,514,400.00	
FRTR 4 04/25/60	700,000	1,383,480.00	
FRTR 5 3/4 10/25/32	300,000	489,360.00	
FRTR4.5 04/25/41	1,600,000	2,771,840.00	
NETHER 0 01/15/24	200,000	203,500.00	
NETHER 0 01/15/27	300,000	307,275.00	
NETHER 0 01/15/38	100,000	96,720.00	
NETHER 0 07/15/31	300,000	302,400.00	
NETHER 0 1/4 07/15/25	100,000	103,410.00	
NETHER 0 3/4 07/15/28	300,000	323,130.00	
NETHER 2 1/2 01/15/33	400,000	518,120.00	
NETHER 3 3/4 01/15/42	100,000	171,850.00	
NETHER 4 01/15/37	400,000	642,280.00	
OBL 0 04/10/26	400,000	411,552.00	
OBL 0 04/11/25	1,000,000	1,025,380.00	
OBL 0 10/10/25	500,000	513,800.00	
OBL 0 10/18/24	1,200,000	1,227,360.00	
RAGB 0 02/20/30	400,000	402,920.00	
RAGB 0 02/20/31	100,000	99,880.00	
RAGB 0 04/20/23	200,000	202,228.00	
RAGB 0 07/15/23	300,000	303,795.00	
RAGB 0 07/15/24	300,000	305,220.00	
RAGB 0 09/20/22	400,000	403,212.00	
RAGB 0 1/2 04/20/27	300,000	315,540.00	
RAGB 1 3/4 10/20/23	200,000	211,100.00	

RAGB 2.1 09/20/17	100,000	165,840.00	
RAGB 3.8 01/26/62	100,000	208,820.00	
SPGB 0 01/31/25	200,000	202,640.00	
SPGB 0 01/31/26	100,000	101,095.00	
SPGB 0 05/31/24	200,000	201,800.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,100,000	1,158,025.00	
SPGB 1.4 04/30/28	100,000	109,255.00	
SPGB 1.45 04/30/29	300,000	329,760.00	
SPGB 2.9 10/31/46	500,000	675,350.00	
SPGB 4.7 07/30/41	600,000	990,240.00	
SPGB 4.9 07/30/40	600,000	1,001,700.00	
SPGB 5 3/4 07/30/32	700,000	1,095,710.00	
SPGB 5.15 10/31/28	500,000	686,250.00	
SPGB 5.15 10/31/44	500,000	903,500.00	
SPGB 5.9 07/30/26	600,000	788,250.00	
SPGB 6 01/31/29	1,100,000	1,590,050.00	
ユーロ小計	61,800,000	75,752,156.00 (9,917,472,263)	
	銘柄数	103	
	比率	38.5%	38.9%
英ポンド			英ポンド
UKT 0 1/4 07/31/31	700,000	658,105.00	
UKT 0 1/8 01/30/26	900,000	889,695.00	
UKT 0 1/8 01/31/24	900,000	898,245.00	
UKT 0 1/8 01/31/28	1,100,000	1,068,155.00	
UKT 0 3/8 10/22/26	400,000	397,980.00	
UKT 0 3/8 10/22/30	800,000	770,040.00	
UKT 0 5/8 07/31/35	100,000	94,090.00	
UKT 1 1/4 07/22/27	100,000	104,540.00	
UKT 1 5/8 10/22/54	600,000	672,480.00	
UKT 2 1/2 07/22/65	300,000	447,270.00	
UKT 3 1/2 01/22/45	1,000,000	1,472,850.00	
UKT 3 1/2 07/22/68	100,000	189,520.00	
UKT 3 1/4 01/22/44	1,000,000	1,405,600.00	
UKT 4 1/2 12/07/42	900,000	1,466,910.00	
UKT 4 1/4 03/07/36	400,000	575,520.00	
UKT 4 1/4 12/07/40	400,000	615,860.00	
UKT 4 1/4 12/07/46	700,000	1,166,900.00	
UKT 4 1/4 12/07/49	300,000	521,310.00	
UKT 4 3/4 12/07/30	400,000	545,840.00	
UKT 4.25 06/07/32	1,100,000	1,488,135.00	
UKT 6 12/07/28	200,000	278,360.00	
英ポンド小計	12,400,000	15,727,405.00 (2,397,642,892)	

	銘柄数	21		
	比率	9.3%	9.4%	
スウェーデン クローネ	SGB 1 1/2 11/13/23	5,000,000	5,211,050.00	
スウェーデンクローネ小計		5,000,000	5,211,050.00 (66,753,550)	
	銘柄数	1		
	比率	0.3%	0.3%	
ポーランドズ ロチ	POLGB 3 1/4 07/25/25	2,300,000	2,506,770.00	
ポーランドズロチ小計		2,300,000	2,506,770.00 (72,078,411)	
	銘柄数	1		
	比率	0.3%	0.3%	
豪ドル	ACGB 2 1/2 05/21/30	1,800,000	1,964,340.00	
	ACGB 2 3/4 05/21/41	700,000	760,386.90	
	ACGB 2 3/4 06/21/35	100,000	110,690.00	
	ACGB 2 3/4 11/21/27	1,700,000	1,877,310.00	
	ACGB 2 3/4 11/21/28	1,500,000	1,663,800.00	
	ACGB 2 3/4 11/21/29	100,000	111,150.00	
	ACGB 3 1/4 04/21/25	1,700,000	1,872,040.00	
	ACGB 3 1/4 04/21/29	600,000	688,854.00	
	ACGB 3 1/4 06/21/39	700,000	819,210.00	
	ACGB 3 3/4 04/21/37	600,000	742,440.00	
	ACGB 4 1/4 04/21/26	600,000	699,000.00	
	ACGB 4 3/4 04/21/27	1,000,000	1,216,946.00	
豪ドル小計		11,100,000	12,526,166.90 (1,036,665,572)	
	銘柄数	12		
	比率	4.0%	4.1%	
シンガポール ドル	SIGB 3 09/01/24	200,000	215,460.00	
シンガポールドル小計		200,000	215,460.00 (17,656,947)	
	銘柄数	1		
	比率	0.1%	0.1%	
国債証券合計			円 25,470,207,282 (25,470,207,282)	
合計			円 25,470,207,282 (25,470,207,282)	

(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
該当事項はありません。

【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(2021年6月22日から2021年12月21日まで)の中間財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

中間財務諸表

【東京海上セレクション・バランス30】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2021年 6月21日現在	当中間計算期間末 2021年12月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	396,702,925	415,320,251
親投資信託受益証券	12,765,220,799	13,333,585,213
未収入金	80,487,584	76,156,305
流動資産合計	13,242,411,308	13,825,061,769
資産合計		
	13,242,411,308	13,825,061,769
負債の部		
流動負債		
未払解約金	16,166,395	6,909,264
未払受託者報酬	5,605,517	6,008,850
未払委託者報酬	60,959,940	65,346,131
未払利息	377	509
その他未払費用	245,044	247,416
流動負債合計	82,977,273	78,512,170
負債合計		
	82,977,273	78,512,170
純資産の部		
元本等		
元本	1 6,750,611,767	1 6,902,842,650
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,408,822,268	6,843,706,949
（分配準備積立金）	2,521,657,159	2,389,140,513
元本等合計	13,159,434,035	13,746,549,599
純資産合計		
	13,159,434,035	13,746,549,599
負債純資産合計		
	13,242,411,308	13,825,061,769

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前中間計算期間 自 2020年 6月23日 至 2020年12月22日	当中間計算期間 自 2021年 6月22日 至 2021年12月21日
営業収益		
受取利息	1,403	58
有価証券売買等損益	691,556,221	357,073,463
営業収益合計	691,557,624	357,073,521
営業費用		
支払利息	73,638	82,705
受託者報酬	5,229,555	6,008,850
委託者報酬	56,871,374	65,346,131
その他費用	247,500	247,416
営業費用合計	62,422,067	71,685,102
営業利益又は営業損失()	629,135,557	285,388,419
経常利益又は経常損失()	629,135,557	285,388,419
中間純利益又は中間純損失()	629,135,557	285,388,419
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()	16,970,056	15,327,587
期首剰余金又は期首欠損金()	4,980,320,606	6,408,822,268
剰余金増加額又は欠損金減少額	491,407,627	516,338,366
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	491,407,627	516,338,366
剰余金減少額又は欠損金増加額	269,200,124	351,514,517
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	269,200,124	351,514,517
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()	5,814,693,610	6,843,706,949

(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 2021年 6月22日 至 2021年12月21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 2021年 6月21日現在	当中間計算期間末 2021年12月21日現在
1. 1 期首元本額	6,334,523,668円	6,750,611,767円
期中追加設定元本額	1,151,261,292円	521,991,487円
期中一部解約元本額	735,173,193円	369,760,604円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数	6,750,611,767口	6,902,842,650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 2020年 6月23日 至 2020年12月22日	当中間計算期間 自 2021年 6月22日 至 2021年12月21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 2021年 6月21日現在	当中間計算期間末 2021年12月21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。	金融商品の時価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。
----------------------------	---	--

(1口当たり情報に関する注記)

前期 2021年 6月21日現在		当中間計算期間末 2021年12月21日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9494円 19,494円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9914円 19,914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 2021年 6月21日現在	当中間計算期間末 2021年12月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	910,560,930	967,072,094
親投資信託受益証券	29,288,603,258	30,986,250,358
未収入金	202,007,447	204,539,718
流動資産合計	30,401,171,635	32,157,862,170
資産合計	30,401,171,635	32,157,862,170
負債の部		
流動負債		
未払解約金	24,764,345	12,156,291
未払受託者報酬	12,859,348	13,927,155
未払委託者報酬	170,386,369	184,534,833
未払利息	865	1,187
その他未払費用	245,044	247,416
流動負債合計	208,255,971	210,866,882
負債合計	208,255,971	210,866,882
純資産の部		
元本等		
元本	12,923,790,173	13,209,823,165
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	17,269,125,491	18,737,172,123
（分配準備積立金）	8,624,627,210	8,254,821,691
元本等合計	30,192,915,664	31,946,995,288
純資産合計	30,192,915,664	31,946,995,288
負債純資産合計	30,401,171,635	32,157,862,170

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2020年 6月23日 至 2020年12月22日	当中間計算期間 自 2021年 6月22日 至 2021年12月21日
営業収益		
受取利息	3,114	134
有価証券売買等損益	2,402,314,062	1,265,853,139
営業収益合計	2,402,317,176	1,265,853,273
営業費用		
支払利息	164,259	191,351
受託者報酬	11,726,675	13,927,155
委託者報酬	155,378,392	184,534,833
その他費用	247,500	247,416
営業費用合計	167,516,826	198,900,755
営業利益又は営業損失()	2,234,800,350	1,066,952,518
経常利益又は経常損失()	2,234,800,350	1,066,952,518
中間純利益又は中間純損失()	2,234,800,350	1,066,952,518
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()	58,361,201	45,619,538
期首剰余金又は期首欠損金()	12,787,195,579	17,269,125,491
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,009,090,647	1,213,713,010
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,009,090,647	1,213,713,010
剰余金減少額又は欠損金増加額	644,742,331	766,999,358
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	644,742,331	766,999,358
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()	15,327,983,044	18,737,172,123

(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 2021年 6月22日 至 2021年12月21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 2021年 6月21日現在	当中間計算期間末 2021年12月21日現在
1. 1 期首元本額	12,384,839,367円	12,923,790,173円
期中追加設定元本額	1,803,125,305円	859,224,010円
期中一部解約元本額	1,264,174,499円	573,191,018円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数	12,923,790,173口	13,209,823,165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 2020年 6月23日 至 2020年12月22日	当中間計算期間 自 2021年 6月22日 至 2021年12月21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 2021年 6月21日現在	当中間計算期間末 2021年12月21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。	金融商品の時価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。
----------------------------	---	--

(1口当たり情報に関する注記)

前期 2021年 6月21日現在		当中間計算期間末 2021年12月21日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3362円 23,362円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4184円 24,184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 2021年 6月21日現在	当中間計算期間末 2021年12月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	646,223,210	698,841,663
親投資信託受益証券	20,755,766,289	22,350,218,804
未収入金	181,511,890	163,567,895
流動資産合計	21,583,501,389	23,212,628,362
資産合計	21,583,501,389	23,212,628,362
負債の部		
流動負債		
未払解約金	39,141,652	4,446,273
未払受託者報酬	9,022,235	10,011,181
未払委託者報酬	138,716,735	153,921,829
未払利息	614	858
その他未払費用	245,044	247,416
流動負債合計	187,126,280	168,627,557
負債合計	187,126,280	168,627,557
純資産の部		
元本等		
元本	17,945,911,736	18,161,228,827
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	13,450,463,373	14,882,771,978
(分配準備積立金)	6,672,247,820	6,280,901,811
元本等合計	21,396,375,109	23,044,000,805
純資産合計	21,396,375,109	23,044,000,805
負債純資産合計	21,583,501,389	23,212,628,362

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2020年 6月23日 至 2020年12月22日	当中間計算期間 自 2021年 6月22日 至 2021年12月21日
営業収益		
受取利息	2,064	95
有価証券売買等損益	2,161,202,068	1,204,010,769
営業収益合計	2,161,204,132	1,204,010,864
営業費用		
支払利息	109,851	137,296
受託者報酬	7,893,522	10,011,181
委託者報酬	121,362,783	153,921,829
その他費用	247,500	247,416
営業費用合計	129,613,656	164,317,722
営業利益又は営業損失()	2,031,590,476	1,039,693,142
経常利益又は経常損失()	2,031,590,476	1,039,693,142
中間純利益又は中間純損失()	2,031,590,476	1,039,693,142
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()	67,445,594	58,479,158
期首剰余金又は期首欠損金()	9,202,283,023	13,450,463,373
剰余金増加額又は欠損金減少額	961,682,639	1,277,634,168
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	961,682,639	1,277,634,168
剰余金減少額又は欠損金増加額	614,459,210	826,539,547
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	614,459,210	826,539,547
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	11,513,651,334	14,882,771,978

(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 2021年 6月22日 至 2021年12月21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 2021年 6月21日現在	当中間計算期間末 2021年12月21日現在
1. 1 期首元本額	7,488,276,943円	7,945,911,736円
期中追加設定元本額	1,471,907,293円	702,447,726円
期中一部解約元本額	1,014,272,500円	487,130,635円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数	7,945,911,736口	8,161,228,827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 2020年 6月23日 至 2020年12月22日	当中間計算期間 自 2021年 6月22日 至 2021年12月21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 2021年 6月21日現在	当中間計算期間末 2021年12月21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。	金融商品の時価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。
----------------------------	---	--

(1口当たり情報に関する注記)

前期 2021年 6月21日現在		当中間計算期間末 2021年12月21日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6928円 26,928円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8236円 28,236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

区 分	注記 番号	2021年 6月21日現在	2021年12月21日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
金銭信託		113,101	307,000
コール・ローン		1,106,429,099	1,001,557,450
株式		76,090,407,290	82,653,749,180
未収入金			82,723,996
未収配当金		338,860,108	8,514,400
流動資産合計		77,535,809,598	83,746,852,026
資産合計			
		77,535,809,598	83,746,852,026
負債の部			
流動負債			
未払金			124,704,413
未払解約金		560,456,659	598,457,893
未払利息		1,051	1,229
流動負債合計		560,457,710	723,163,535
負債合計			
		560,457,710	723,163,535
純資産の部			
元本等			
元本	1	36,005,337,040	35,990,815,703
剰余金			
剰余金又は欠損金()		40,970,014,848	47,032,872,788
元本等合計		76,975,351,888	83,023,688,491
純資産合計			
		76,975,351,888	83,023,688,491
負債純資産合計			
		77,535,809,598	83,746,852,026

(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 2021年 6月22日 至 2021年12月21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	2021年 6月21日現在	2021年12月21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 同期中における追加設定元本額 同期中における一部解約元本額 同中間期末における元本額	28,288,412,415円 15,636,424,444円 7,919,499,819円 36,005,337,040円	36,005,337,040円 3,583,179,753円 3,597,701,090円 35,990,815,703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 > 東京海上セレクション・日本株式 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 東京海上・年金運用型戦略ファンド (年1回決算型) TMAバランス25VA 適格機関投資家限定 TMAバランス50VA 適格機関投資家限定 TMAバランス75VA 適格機関投資家限定 東京海上・日本株式GARP < 適格機関投資家限定 > 計	179,785,858円 15,761,379,419円 1,227,217,193円 4,926,819,009円 4,985,917,634円 114,672,989円 14,669,103円 24,508,197円 9,005,361円 8,761,362,277円 36,005,337,040円	147,912,244円 15,954,267,801円 1,200,649,660円 4,887,990,975円 5,042,620,606円 143,765,502円 12,755,479円 22,887,847円 6,932,210円 8,571,033,379円 35,990,815,703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	36,005,337,040口	35,990,815,703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	2021年 6月21日現在	2021年12月21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つた場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年 6月21日現在		2021年12月21日現在	
1口当たり純資産額	2.1379円	1口当たり純資産額	2.3068円
(1万口当たり純資産額)	(21,379円)	(1万口当たり純資産額)	(23,068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	2021年 6月21日現在	2021年12月21日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		6,050,000	11,304,500
コール・ローン		1,239,157,336	688,580,768
国債証券		42,705,911,870	45,653,384,150
地方債証券		1,202,697,000	
特殊債券		700,766,000	
社債券		41,591,767,217	46,143,090,821
未収入金		5,331,713,000	2,459,804,142
未収利息		66,165,571	73,704,144
前払費用		9,130,883	15,277,803
流動資産合計		92,853,358,877	95,045,146,328
資産合計		92,853,358,877	95,045,146,328
負債の部			
流動負債			
未払金		5,974,592,200	2,456,114,000
未払解約金		270,583,637	269,323,967
未払利息		1,177	845
流動負債合計		6,245,177,014	2,725,438,812
負債合計		6,245,177,014	2,725,438,812

純資産の部			
元本等			
元本	1	61,207,975,564	65,035,119,701
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		25,400,206,299	27,284,587,815
元本等合計		86,608,181,863	92,319,707,516
純資産合計		86,608,181,863	92,319,707,516
負債純資産合計		92,853,358,877	95,045,146,328

(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 2021年 6月22日 至 2021年12月21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	2021年 6月21日現在	2021年12月21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	61,270,505,828円	61,207,975,564円
同期中における追加設定元本額	17,182,426,212円	10,475,903,940円
同期中における一部解約元本額	17,244,956,476円	6,648,759,803円
同中間期末における元本額	61,207,975,564円	65,035,119,701円
元本の内訳*		
東京海上セレクション・バランス30	4,373,746,387円	4,560,811,580円
東京海上セレクション・バランス50	5,763,778,383円	6,095,402,121円
東京海上セレクション・バランス70	1,512,229,308円	1,630,249,977円
東京海上セレクション・日本債券	12,264,503,214円	12,096,731,204円
東京海上・日本債券オープン （野村SMA向け）	6,070,214,365円	5,858,016,100円
東京海上・日本債券オープン （野村SMA・EW向け）	25,509,917,385円	29,142,548,044円
東京海上・年金運用型戦略ファンド （年1回決算型）	173,991,549円	232,491,622円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限 定	133,398,338円	123,636,249円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限 定	74,338,651円	73,989,305円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限 定	9,105,073円	7,469,703円
東京海上・日本債券オープンF （適格機関投資家専用）	5,322,752,911円	5,213,773,796円
計	61,207,975,564円	65,035,119,701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	61,207,975,564口	65,035,119,701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	2021年 6月21日現在	2021年12月21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つた場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年 6月21日現在		2021年12月21日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4150円 14,150円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4195円 14,195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	2021年 6月21日現在	2021年12月21日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		172,815,324	50,324,809
コール・ローン		1,189,077,522	1,003,771,629
株式		48,253,144,475	52,089,149,007

未収入金			371,990,625
未収配当金		18,266,857	14,697,677
流動資産合計		49,633,304,178	53,529,933,747
資産合計		49,633,304,178	53,529,933,747
負債の部			
流動負債			
未払金			369,699,028
未払解約金		472,937,723	472,958,821
未払利息		1,130	1,232
流動負債合計		472,938,853	842,659,081
負債合計		472,938,853	842,659,081
純資産の部			
元本等			
元本	1	11,753,949,219	11,817,328,848
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		37,406,416,106	40,869,945,818
元本等合計		49,160,365,325	52,687,274,666
純資産合計		49,160,365,325	52,687,274,666
負債純資産合計		49,633,304,178	53,529,933,747

(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 2021年 6月22日 至 2021年12月21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	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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	2021年 6月21日現在	2021年12月21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	11,759,741,648円	11,753,949,219円
同期中における追加設定元本額	3,038,340,140円	1,382,235,858円
同期中における一部解約元本額	3,044,132,569円	1,318,856,229円
同中間期末における元本額	11,753,949,219円	11,817,328,848円
元本の内訳*		
東京海上セレクション・外国株式	9,212,466,969円	9,388,696,217円
東京海上セレクション・バランス30	319,412,788円	297,615,777円
東京海上セレクション・バランス50	1,099,123,562円	1,038,576,170円
東京海上セレクション・バランス70	1,038,169,192円	999,968,075円
東京海上・年金運用型戦略ファンド (年1回決算型)	59,699,737円	71,370,704円
TMAバランス25VA 適格機関投資家限定	7,632,295円	6,317,232円
TMAバランス50VA 適格機関投資家限定	12,757,153円	11,347,815円
TMAバランス75VA 適格機関投資家限定	4,687,523円	3,436,858円
計	11,753,949,219円	11,817,328,848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	11,753,949,219口	11,817,328,848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	2021年 6月21日現在	2021年12月21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。	金融商品の時価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。
----------------------------	--	---

(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

(2021年6月21日現在)

該当事項はありません。

(2021年12月21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)

2021年 6月21日現在		2021年12月21日現在	
1口当たり純資産額	4,182,250円	1口当たり純資産額	4,458,500円
(1万口当たり純資産額)	(41,822,500円)	(1万口当たり純資産額)	(44,585,000円)

「TMA外国債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	2021年 6月21日現在	2021年12月21日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		42,756,367	50,694,233
コール・ローン		276,805,181	210,651,476
国債証券		25,470,207,282	26,891,572,311
派生商品評価勘定			98,520
未収入金		455,708,872	525,016,668
未収利息		106,328,668	102,260,035
前払費用		16,593,745	19,908,458
流動資産合計		26,368,400,115	27,800,201,701
資産合計		26,368,400,115	27,800,201,701
負債の部			
流動負債			
未払金		459,490,481	560,529,116
未払解約金		179,065,685	168,868,322

未払利息		263	258
流動負債合計		638,556,429	729,397,696
負債合計		638,556,429	729,397,696
純資産の部			
元本等			
元本	1	10,290,139,050	10,686,365,134
剰余金			
剰余金又は欠損金()		15,439,704,636	16,384,438,871
元本等合計		25,729,843,686	27,070,804,005
純資産合計		25,729,843,686	27,070,804,005
負債純資産合計		26,368,400,115	27,800,201,701

(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 2021年 6月22日 至 2021年12月21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礎となる事項	<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	2021年 6月21日現在	2021年12月21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	9,508,871,556円	10,290,139,050円
同期中における追加設定元本額	2,262,979,339円	1,163,123,285円
同期中における一部解約元本額	1,481,711,845円	766,897,201円
同中間期末における元本額	10,290,139,050円	10,686,365,134円
元本の内訳*		
東京海上セレクション・外国債券	5,299,523,249円	5,370,170,132円
東京海上セレクション・バランス30	1,046,535,771円	1,090,689,484円
東京海上セレクション・バランス50	2,400,706,363円	2,537,390,500円
東京海上セレクション・バランス70	1,445,539,060円	1,557,478,323円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型）	97,834,607円	130,636,695円
計	10,290,139,050円	10,686,365,134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	10,290,139,050口	10,686,365,134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	2021年 6月21日現在	2021年12月21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>	<p>金融商品の時価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>

（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

（2021年6月21日現在）

該当事項はありません。

（2021年12月21日現在）

（単位：円）

区 分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買建	25,529,800		25,628,320	98,520
	ユーロ	25,529,800		25,628,320	98,520
合 計		25,529,800		25,628,320	98,520

(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。

(3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額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）

2021年 6月21日現在		2021年12月21日現在	
1口当たり純資産額	2.5004円	1口当たり純資産額	2.5332円
（1万口当たり純資産額	25,004円）	（1万口当たり純資産額	25,332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

2021年12月30日 現在

種類	金額
資産総額	13,943,828,438 円
負債総額	9,361,034 円
純資産総額(-)	13,934,467,404 円
発行済数量	6,935,112,247 口
1 単位当たり純資産額(/)	2.0093 円

東京海上セレクション・バランス50

2021年12月30日 現在

種類	金額
資産総額	32,545,820,015 円
負債総額	19,719,863 円
純資産総額(-)	32,526,100,152 円
発行済数量	13,249,053,086 口
1 単位当たり純資産額(/)	2.4550 円

東京海上セレクション・バランス70

2021年12月30日 現在

種類	金額
資産総額	23,652,507,218 円
負債総額	25,674,253 円
純資産総額(-)	23,626,832,965 円
発行済数量	8,194,815,430 口
1 単位当たり純資産額(/)	2.8831 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

2021年12月30日 現在

種類	金額
資産総額	84,796,305,149 円
負債総額	92,306,107 円
純資産総額(-)	84,703,999,042 円
発行済数量	36,049,849,559 口
1 単位当たり純資産額(/)	2.3496 円

TMA日本債券マザーファンド

2021年12月30日 現在

種類	金額
資産総額	93,409,471,266 円
負債総額	955,142,813 円

純資産総額(-)	92,454,328,453 円
発行済数量	65,292,022,501 口
1 単位当たり純資産額(/)	1.4160 円

T M A 外国株式マザーファンド

2021年12月30日 現在

種類	金額
資産総額	55,902,185,874 円
負債総額	5,507,906 円
純資産総額(-)	55,896,677,968 円
発行済数量	11,826,972,876 口
1 単位当たり純資産額(/)	4.7262 円

T M A 外国債券マザーファンド

2021年12月30日 現在

種類	金額
資産総額	27,405,534,940 円
負債総額	171,964,589 円
純資産総額(-)	27,233,570,351 円
発行済数量	10,705,975,599 口
1 単位当たり純資産額(/)	2.5438 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、
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、）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】

2021年12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運用リスク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、運用リスク管理部門担当役員を委員長としリスク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。

2021年12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	172	2,911,704
単位型公社債投資信託	2	5,158
単位型株式投資信託	11	39,539
合計	185	2,956,401

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36期事業年度(2020年4月1日から2021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(2021年4月1日から2021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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	19,928,671	22,550,090
前払費用	207,883	235,902
未収委託者報酬	2,864,007	2,973,733
未収収益	2,126,212	2,375,688
未収入金	101,676	3,865
その他の流動資産	22,090	21,479
流動資産計	25,250,541	28,160,759
固定資産		
有形固定資産	* 1 576,200	* 1 530,601
建物	388,342	354,556
器具備品	187,858	176,045
無形固定資産	5,385	137,430
電話加入権	3,795	3,795
ソフトウェア	-	89,839
ソフトウェア仮勘定	1,590	43,795
投資その他の資産	2,987,389	3,057,965
投資有価証券	65,610	49,477
関係会社株式	1,673,049	1,673,049
その他の関係会社有価証券	31,200	71,200
長期前払費用	32,906	45,424
敷金	450,632	474,324
その他長期差入保証金	10,030	10,030
繰延税金資産	723,961	734,459
固定資産計	3,568,975	3,725,997
資産合計	28,819,517	31,886,757
負債の部		
流動負債		
未払金	2,555,940	2,979,963
未払手数料	1,315,027	1,349,326
その他未払金	1,240,912	1,630,636
未払費用	544,639	429,654
未払消費税等	367,506	468,610
未払法人税等	1,347,000	1,378,000
預り金	43,576	45,524
前受収益	3,128	2,329
賞与引当金	244,679	273,836
その他の流動負債	-	946
流動負債計	5,106,470	5,578,864
固定負債		
退職給付引当金	750,413	802,176
固定負債計	750,413	802,176
負債合計	5,856,883	6,381,041
純資産の部		
株主資本	22,965,811	25,499,322
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	20,565,811	23,099,322
利益準備金	500,000	500,000
その他利益剰余金	20,065,811	22,599,322
特別償却準備金	0	0
繰越利益剰余金	20,065,811	22,599,322

評価・換算差額等	3,177	6,393
その他有価証券評価差額金	3,177	6,393
純資産合計	22,962,634	25,505,715
負債・純資産合計	28,819,517	31,886,757

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	16,536,369	17,997,091
運用受託報酬	9,077,029	9,745,973
投資助言報酬	60,786	59,827
その他営業収益	412,354	453,173
営業収益計	26,086,540	28,256,066
営業費用		
支払手数料	7,818,291	8,444,858
広告宣伝費	254,153	233,667
調査費	5,425,141	6,150,198
調査費	2,525,312	2,540,308
委託調査費	2,899,828	3,609,889
委託計算費	122,584	118,443
営業雑経費	285,550	278,728
通信費	35,052	44,106
印刷費	205,117	189,670
協会費	24,696	26,080
諸会費	12,157	10,102
図書費	8,525	8,768
営業費用計	13,905,720	15,225,895
一般管理費		
給料	3,509,999	3,799,821
役員報酬	112,566	129,108
給料・手当	2,541,727	2,761,131
賞与	855,706	909,581
交際費	17,797	4,415
寄付金	5,833	3,449
旅費交通費	174,094	13,735
租税公課	164,117	170,294
不動産賃借料	375,694	375,691
退職給付費用	466,387	156,614
賞与引当金繰入	244,679	273,836
固定資産減価償却費	118,517	139,782
法定福利費	580,893	596,481
福利厚生費	9,971	10,114
諸経費	482,967	394,336
一般管理費計	6,150,953	5,938,574
営業利益	6,029,866	7,091,595
営業外収益		
受取利息	434	455
受取配当金	* 1 4,704	* 1 7,512
匿名組合投資利益	* 1 39,334	* 1 60,878
雑益	10,094	9,958
営業外収益計	54,568	78,804
営業外費用		
為替差損	15,577	44,450
雑損	5,174	5,811
営業外費用計	20,752	50,261
経常利益	6,063,682	7,120,138

特別損失		
器具備品除却損	545	0
特別損失計	545	0
税引前当期純利益	6,063,137	7,120,138
法人税、住民税及び事業税	2,044,481	2,197,641
法人税等調整額	188,875	14,721
法人税等合計	1,855,605	2,182,919
当期純利益	4,207,531	4,937,219

(3)【株主資本等変動計算書】

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益 剰余金	
					特別償却 準備金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	16	17,875,907
当期変動額						
剰余金の配当						2,017,644
特別償却準備金の取崩					16	16
当期純利益						4,207,531
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	-	16	2,189,903
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	0	20,065,811

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等 合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	18,375,924	20,775,924	2,096	2,096	20,778,021
当期変動額					
剰余金の配当	2,017,644	2,017,644			2,017,644
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	4,207,531	4,207,531			4,207,531
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)			5,273	5,273	5,273
当期変動額合計	2,189,887	2,189,887	5,273	5,273	2,184,613
当期末残高	20,565,811	22,965,811	3,177	3,177	22,962,634

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益 剰余金	
					特別償却 準備金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	0	20,065,811
当期変動額						
剰余金の配当						2,403,708
特別償却準備金の取崩					0	0
当期純利益						4,937,219
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	0	2,533,511
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	0	22,599,322

	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	20,565,811	22,965,811	3,177	3,177	22,962,634
当期変動額					
剰余金の配当	2,403,708	2,403,708			2,403,708
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	4,937,219	4,937,219			4,937,219
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			9,570	9,570	9,570
当期変動額合計	2,533,511	2,533,511	9,570	9,570	2,543,081
当期末残高	23,099,322	25,499,322	6,393	6,393	25,505,715

注記事項

（重要な会計方針）

第36期

自 2020年4月1日

至 2021年3月31日

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券

移動平均法による原価法

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価を把握することが極めて困難と認められるもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。また、取得価額が10万円以上20万円未満の少額減価償却資産については、一括償却資産として3年間で均等償却する方法を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当期負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

4. 消費税等の会計処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(重要な会計上の見積り)

第36期

自 2020年4月1日
至 2021年3月31日

当事業年度の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌事業年度の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

(未適用の会計基準等)

第36期

自 2020年4月1日
至 2021年3月31日

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(貸借対照表関係)

第35期 2020年3月31日現在	第36期 2021年3月31日現在
* 1. 有形固定資産の減価償却累計額は次のとおりであります。	* 1. 有形固定資産の減価償却累計額は次のとおりであります。
建物 114,303千円 器具備品 364,003千円	建物 148,089千円 器具備品 458,314千円

(損益計算書関係)

第35期 自 2019年4月1日 至 2020年3月31日	第36期 自 2020年4月1日 至 2021年3月31日
* 1. 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。	* 1. 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。
関係会社からの受取配当金 2,400千円 関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配 39,334千円	関係会社からの受取配当金 2,000千円 関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配 60,878千円

(株主資本等変動計算書関係)

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位:株)

株式の種類	2019年4月1日 現在	増加	減少	2020年3月31日 現在
普通株式	38,300	-	-	38,300

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

2019年6月28日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	2,017,644千円
(ロ) 1株当たり配当額	52,680円
(ハ) 基準日	2019年3月31日
(ニ) 効力発生日	2019年6月28日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2020年6月26日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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	2020年4月1日 現在	増加	減少	2021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

2020年6月26日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	2,403,708千円
(ロ) 1株当たり配当額	62,760円
(ハ) 基準日	2020年3月31日
(ニ) 効力発生日	2020年6月26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
2021年6月30日の定時株主総会において、次のとおり配当を提案する予定であります。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	4,937,214千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	128,909円
(ニ) 基準日	2021年3月31日
(ホ) 効力発生日	2021年6月30日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

第35期 自 2019年4月1日 至 2020年3月31日	第36期 自 2020年4月1日 至 2021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。 市場リスク 未収委託者報酬には、運用資産の悪化から回収できず当社が損失を被るリスクが存在しますが、過去の回収実績からリスクは僅少であると判断しております。 投資有価証券については、管理部門において定期的に時価を把握する体制としております。 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。	(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 同左 市場リスク 同左 流動性リスク 同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

第35期(2020年3月31日現在)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

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

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

第36期(2021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	22,550,090	22,550,090	-
(2)未収委託者報酬	2,973,733	2,973,733	-
(3)未収収益	2,375,688	2,375,688	-
(4)未収入金	3,865	3,865	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	49,477	49,477	-
(6)預り金	(45,524)	(45,524)	-
(7)未払金	(2,979,963)	(2,979,963)	-
(8)未払費用	(429,654)	(429,654)	-
(9)未払消費税等	(468,610)	(468,610)	-
(10)未払法人税等	(1,378,000)	(1,378,000)	-

(*)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35期 2020年3月31日現在	第36期 2021年3月31日現在
(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収収益、(4)未収入金、(6)預り金、(7)未払金、(8)未払費用、(9)未払消費税等及び(10)未払法人税等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。	(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収収益、(4)未収入金、(6)預り金、(7)未払金、(8)未払費用、(9)未払消費税等及び(10)未払法人税等 同左
(5)投資有価証券 時価の算定方法につきましては「重要な会計方針」の「1.有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(5)投資有価証券 同左

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

第35期 2020年3月31日現在	第36期 2021年3月31日現在

以下については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。		以下については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。	
(単位：千円)		(単位：千円)	
	貸借対照表計上額		貸借対照表計上額
子会社株式	1,640,302	子会社株式	1,640,302
関連会社株式	32,747	関連会社株式	32,747
その他の関係会社 有価証券	31,200	その他の関係会社 有価証券	71,200
敷金	450,632	敷金	474,324
その他長期差入保証金	10,030	その他長期差入保証金	10,030

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

第35期 2020年3月31日現在	第36期 2021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35期(2020年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	19,928,370	-	-	-
未収委託者報酬	2,864,007	-	-	-
未収収益	2,126,212	-	-	-
未収入金	101,676	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	2,247	21,678	22,121	-
合計	25,022,515	21,678	22,121	-

第36期(2021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	22,549,627	-	-	-
未収委託者報酬	2,973,733	-	-	-
未収収益	2,375,688	-	-	-
未収入金	3,865	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	8,474	16,416	5,279	-
合計	27,911,389	16,416	5,279	-

(有価証券関係)

第35期 2020年3月31日現在	第36期 2021年3月31日現在
----------------------	----------------------

<p>1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 子会社株式1,640,302千円、関連会社株式32,747千円)並びにその他の関係会社有価証券(貸借対照表計上額 31,200千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。</p> <p>2. その他有価証券 (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>32,071</td> <td>27,816</td> <td>4,254</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>33,538</td> <td>42,372</td> <td>8,834</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>65,610</td> <td>70,189</td> <td>4,579</td> </tr> </tbody> </table> <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>	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	32,071	27,816	4,254	貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの証券投資信託	33,538	42,372	8,834	合計	65,610	70,189	4,579	<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 71,200千円)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>37,407</td> <td>27,442</td> <td>9,964</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>12,070</td> <td>12,820</td> <td>749</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>49,477</td> <td>40,262</td> <td>9,214</td> </tr> </tbody> </table> <p>3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 同左</p>	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	37,407	27,442	9,964	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	12,070	12,820	749	合計	49,477	40,262	9,214
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	32,071	27,816	4,254																														
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの証券投資信託	33,538	42,372	8,834																														
合計	65,610	70,189	4,579																														
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	37,407	27,442	9,964																														
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	12,070	12,820	749																														
合計	49,477	40,262	9,214																														

(退職給付関係)

<p>第35期 自 2019年4月1日 至 2020年3月31日</p>
<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>当社は当事業年度より退職給付債務の計算方法を簡便法から原則法に変更しております。</p> <p>2. 確定給付制度</p>

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

割引率	0.4%
-----	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、66,184千円であります。

第36期

自 2020年4月1日
至 2021年3月31日

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	739,283千円
勤務費用	69,269千円
利息費用	2,907千円
数理計算上の差異の発生額	8,451千円
退職給付の支払額	19,300千円
退職給付債務の期末残高	800,611千円

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

積立型制度の退職給付債務	-
年金資産	-
	-
非積立型制度の退職給付債務	800,611千円
未積立退職給付債務	800,611千円
未認識数理計算上の差異	1,565千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	802,176千円
退職給付引当金	802,176千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	802,176千円

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	69,269千円
利息費用	2,907千円
数理計算上の差異の費用処理額	1,113千円
その他	12,353千円
確定給付制度に係る退職給付費用	83,417千円

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

割引率	0.4%
-----	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、73,196千円であります。

(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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
繰延税金資産		
退職給付引当金	229,776千円	245,626千円
未払金	3,802千円	3,859千円
賞与引当金	74,920千円	83,848千円
未払法定福利費	9,935千円	10,817千円
未払事業所税	3,672千円	3,840千円
未払事業税	70,737千円	81,915千円
未払調査費	82,822千円	79,792千円
減価償却超過額	124,870千円	86,208千円
繰延資産超過額	3,293千円	6,297千円
未払確定拠出年金	1,666千円	1,901千円

未収実績連動報酬	21,260千円	31,761千円
その他有価証券評価差額金	1,402千円	-
未払費用	95,799千円	101,413千円
繰延税金資産小計	723,961千円	737,281千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	723,961千円	737,281千円
繰延税金負債		
特別償却準備金	0千円	0千円
その他有価証券評価差額金	-	2,821千円
繰延税金負債合計	0千円	2,821千円
繰延税金資産の純額	723,961千円	734,459千円

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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021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35期 自 2019年4月1日 至 2020年3月31日	第36期 自 2020年4月1日 至 2021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 (単位：千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>日本</th> <th>その他</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>23,387,535</td> <td>2,699,004</td> <td>26,086,540</td> </tr> </tbody> </table> <p>(注) 営業収益は顧客の所在地を基準とし、国ごとに分類しております。</p> <p>(2) 有形固定資産 本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報 (1) 投資信託の名称 東京海上・円資産バランスファンド（毎月決算型）</p> <p>(2) 委託者報酬 5,339,902千円</p> <p>(3) 関連するセグメント名 投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメント</p>	日本	その他	合計	23,387,535	2,699,004	26,086,540	<p>1. 製品及びサービスごとの情報 同左</p> <p>2. 地域ごとの情報 (1) 営業収益 本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>(2) 有形固定資産 同左</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報 (1) 投資信託の名称 東京海上・円資産バランスファンド（毎月決算型）</p> <p>(2) 委託者報酬 5,399,003千円</p> <p>(3) 関連するセグメント名 投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメント</p>
日本	その他	合計					
23,387,535	2,699,004	26,086,540					

(関連当事者情報)

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 関連当事者との取引

- (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等
重要な取引はありません。
- (2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
重要な取引はありません。
- (3) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等
重要な取引はありません。
- (4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
重要な取引はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する情報

- (1) 親会社情報
東京海上ホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）
- (2) 重要な関連会社の要約財務情報
重要な関連会社はありません。

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 関連当事者との取引

- (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等
重要な取引はありません。

- (2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
重要な取引はありません。
- (3) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等
重要な取引はありません。
- (4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
重要な取引はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する情報

- (1) 親会社情報
東京海上ホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）
- (2) 重要な関連会社の要約財務情報
重要な関連会社はありません。

（1株当たり情報）

第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	599,546円59銭
1株当たり当期純利益金額	109,857円21銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
貸借対照表の純資産の部の合計額	22,962,634千円
純資産の部の合計額から控除する金額	-
普通株式に係る当期末の純資産額	22,962,634千円
1株当たり純資産額の算定に用いられた当期末の普通株式の数	38,300株
1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益金額	4,207,531千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る当期純利益金額	4,207,531千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
1株当たり純資産額	665,945円58銭
1株当たり当期純利益金額	128,909円11銭

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

(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
貸借対照表の純資産の部の合計額	25,505,715千円
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	25,505,715千円
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	4,937,219千円
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	4,937,219千円
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 (2021年9月30日現在)		
資産の部		
流動資産		
現金・預金		18,650,313
前払費用		181,371
未収委託者報酬		3,092,025
未収収益		3,209,267
未収入金		25,743
その他の流動資産		21,944
流動資産計		25,180,666
固定資産		
有形固定資産	* 1	471,105
建物		337,674
器具備品		133,430
無形固定資産		156,859
電話加入権		3,795
ソフトウェア		140,315
ソフトウェア仮勘定		12,748
投資その他の資産		3,287,429
投資有価証券		46,790
関係会社株式		1,673,049
その他の関係会社有価証券		71,200
長期前払費用		36,955
敷金		474,324
その他長期差入保証金		20,230
繰延税金資産		964,879
固定資産計		3,915,393
資産合計		29,096,059
負債の部		
流動負債		
未払金		2,741,875
未払手数料		1,400,568
その他未払金		1,341,306
未払費用		484,629
未払消費税等	* 2	247,866
未払法人税等		1,306,000
預り金		51,203
前受収益		13,273
賞与引当金		599,058
流動負債計		5,443,908
固定負債		
退職給付引当金		828,932
固定負債計		828,932
負債合計		6,272,841
純資産の部		
株主資本		22,817,163
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	20,417,163
利益準備金	500,000
その他利益剰余金	19,917,163
特別償却準備金	0
繰越利益剰余金	19,917,163
評価・換算差額等	6,054
その他有価証券評価差額金	6,054
純資産合計	22,823,218
負債・純資産合計	29,096,059

中間損益計算書

(単位：千円)

当中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	9,246,109
運用受託報酬	4,955,773
投資助言報酬	31,414
その他営業収益	258,494
営業収益計	14,491,792
営業費用	
支払手数料	4,296,414
広告宣伝費	114,331
調査費	3,418,391
調査費	1,425,657
委託調査費	1,992,734
委託計算費	57,490
営業雑経費	138,868
通信費	18,011
印刷費	91,047
協会費	14,604
諸会費	8,337
図書費	6,867
営業費用計	8,025,496
一般管理費	
給料	1,589,022
役員報酬	63,507
給料・手当	1,397,094
賞与	128,421
交際費	1,934
旅費交通費	5,113
租税公課	87,309
不動産賃借料	234,046
退職給付費用	82,426
賞与引当金繰入	599,058
固定資産減価償却費	* 1 74,067
法定福利費	313,891
福利厚生費	8,484
諸経費	199,635
一般管理費計	3,194,992
営業利益	3,271,303

営業外収益	
受取利息	79
受取配当金	3,240
雑益	7,390
営業外収益計	10,711
営業外費用	
為替差損	7,160
雑損	22,194
営業外費用計	29,355
経常利益	3,252,659
特別損失	
器具備品除却損	25
特別損失計	25
税引前中間純利益	3,252,634
法人税、住民税及び事業税	1,227,848
法人税等調整額	230,270
法人税等合計	997,578
中間純利益	2,255,055

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021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		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	0	22,599,322
当中間期変動額						
剰余金の配当						4,937,214
特別償却準備金の取崩					0	0
中間純利益						2,255,055
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	-	-	-	-	0	2,682,158
当中間期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	0	19,917,163

	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	23,099,322	25,499,322	6,393	6,393	25,505,715
当中間期変動額					
剰余金の配当	4,937,214	4,937,214			4,937,214
特別償却準備金の取崩	-	-			-
中間純利益	2,255,055	2,255,055			2,255,055
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			338	338	338

当中間期変動額合計	2,682,159	2,682,159	338	338	2,682,497
当中間期末残高	20,417,163	22,817,163	6,054	6,054	22,823,218

注記事項

(重要な会計方針)

当中間会計期間 自 2021年4月1日 至 2021年9月30日
<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</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 市場価格のない株式等以外のもの 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) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p> <p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。また、取得価額が10万円以上20万円未満の少額減価償却資産については、一括償却資産として3年間で均等償却する方法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p> <p>3. 引当金の計上基準</p> <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 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。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により費用処理しております。</p> <p>4. 収益及び費用の計上基準</p> <p>当社は、顧客への投資運用業及び投資助言・代理業に関するサービスから生じる委託者報酬、運用受託報酬等により収益を獲得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p> <p>(1) 運用報酬</p>

投資運用・助言サービスのうち運用資産残高等を基礎として算定される報酬(運用報酬)については、当該サービスに係る履行義務は日々充足されると判断し、運用期間にわたり収益として認識しております。確定した報酬は、月次、年4回、年2回もしくは年1回受け取ります。

(2) 成功報酬

成功報酬は、契約上定められる超過収益の達成等により履行義務を充足し、報酬額及び支払われることが確定した時点で収益として認識しております。確定した報酬は、履行義務充足時点から短期間で支払いを受けます。

5. 消費税等の会計処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(会計方針の変更)

当中間会計期間 自 2021年4月1日 至 2021年9月30日
<p>「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日)等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。なお、当該変更による影響額は軽微であります。</p>
<p>「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日)等を当中間会計期間の期首から適用するとともに、「時価の算定に関する会計基準の適用指針(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日改正)」を当中間会計期間の期首から早期適用しております。なお、当該変更による中間財務諸表に与える影響はございません。</p>

(中間貸借対照表関係)

	当中間会計期間 (2021年9月30日現在)
1 有形固定資産の減価償却累計額	建物 164,970千円 器具備品 452,358千円
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)

	当中間会計期間 自 2021年4月1日 至 2021年9月30日
1 減価償却実施額	有形固定資産 59,491千円 無形固定資産 14,575千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

	当中間会計期間 自 2021年4月1日 至 2021年9月30日			
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

2021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・・・・・・・・・・4,937,214千円
- (ロ) 1株当たり配当額・・・・・・・・・・128,909円
- (ハ) 基準日・・・・・・・・・・2021年3月31日
- (ニ) 効力発生日・・・・・・・・・・2021年6月30日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2021年9月30日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

2021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。

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
投資有価証券			
その他有価証券	46,790	46,790	-
敷金	474,324	476,269	1,945
資産計	521,114	523,060	1,945

(*1) 以下の金融商品については、現金であること、及び短期で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

- 現金・預金
- 未収委託者報酬
- 未収収益
- 未収入金
- 預り金
- 未払金
- 未払費用

(*2) 関係会社株式及びその他の関係会社有価証券(持分相当額を純額で計上する組合等への出資1,200千円を除く)については、市場価格のない株式等に該当することから、時価を注記しておりません。これらの中間貸借対照表計上額は、それぞれ以下のとおりです。

関係会社株式	
子会社株式	1,640,302千円
関連会社株式	32,747千円
その他の関係会社有価証券	70,000千円

(*3) その他の関係会社有価証券のうち1,200千円については、中間貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資に該当するため、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日改正)の第24-16項を適用し、時価に関する注記を省略しております。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

- レベル1の時価 : 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価 : 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価 : 観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

(1)時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
投資有価証券				
その他有価証券	-	46,790	-	46,790

資産計	-	46,790	-	46,790
-----	---	--------	---	--------

(2)時価で中間貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

(単位：千円)

	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
敷金	-	476,269	-	476,269
資産計	-	476,269	-	476,269

(注)時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

投資有価証券

投資信託は基準価額を用いて評価しており、活発な市場における相場価格とはいえないことから、レベル2の時価に分類しております。

敷金

敷金は、回収可能性を反映した将来キャッシュ・フローを残存期間に対応する国債の利回り等で割り引いた現在価値により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

(有価証券関係)

当中間会計期間(2021年9月30日現在)

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	43,583	34,357	9,226
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	3,206	3,706	499
合計		46,790	38,063	8,727

(収益認識関係)

1.顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位：千円)

	運用報酬	成功報酬	合計
委託者報酬	9,246,109	-	9,246,109
運用受託報酬	4,955,773	-	4,955,773
投資助言報酬	31,414	-	31,414
その他営業収益	258,494	-	258,494
合計	14,491,792	-	14,491,792

2.顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

顧客との契約から生じた債権等

(単位：千円)

	当中間会計期間 自 2021年4月1日 至 2021年9月30日
顧客との契約から生じた債権(期首残高)	5,349,421
顧客との契約から生じた債権(期末残高)	6,301,292

(*)なお、当中間会計期間の期首及び期末において、顧客との契約から生じた契約資産及び契約負債はありません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021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 2021年4月1日 至 2021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

（単位：千円）

日本	その他	合計
13,030,226	1,461,565	14,491,791

(注) 営業収益は顧客の所在地を基準とし、国ごとに分類しております。

(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)	2,554,248	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 2021年4月1日 至 2021年9月30日	
1株当たり純資産額	595,906円49銭
1株当たり中間純利益金額	58,878円73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いません。	
(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	22,823,218千円
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	22,823,218千円
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	2,255,055千円
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	2,255,055千円
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。)

通常取引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(2021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(2021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。

() 2021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

2021年6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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 奈良昌彦
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久保直毅
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年8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

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 久保 直毅

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上セレクション・バランス30の2020年6月23日から2021年6月21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。

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2021年6月21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、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年8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

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 久保 直毅

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上セレクション・バランス50の2020年6月23日から2021年6月21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。

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2021年6月21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、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年8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

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 久保 直毅

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上セレクション・バランス70の2020年6月23日から2021年6月21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。

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2021年6月21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、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 奈良 昌彦
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間(2021年4月1日から2021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。

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2021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(2021年4月1日から2021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。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

中間財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な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。

- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は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

2022年2月2日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 久保 直毅

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上セレクション・バランス30の2021年6月22日から2021年12月21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。

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2021年12月21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（2021年6月22日から2021年12月21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。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合

は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は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

2022年2月2日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 久保 直毅

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上セレクション・バランス50の2021年6月22日から2021年12月21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。

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2021年12月21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（2021年6月22日から2021年12月21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。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合

は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は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

2022年2月2日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 久保 直毅

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上セレクション・バランス70の2021年6月22日から2021年12月21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。

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2021年12月21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（2021年6月22日から2021年12月21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。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な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。
- 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合

は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は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。