

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2023年8月15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 横田 靖博

【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)東京海上・物価対応バランスファンド(毎月決算型)  
内国投資信託受益証券に係るファ  
ンドの名称】

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

【縦覧に供する場所】 該当なし

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2022年10月31日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について、有価証券報告書の提出に伴う新たな情報の更新、および原届出書記載事項の一部に訂正すべき事項があるため、本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (3)【ファンドの仕組み】

<更新後>

(略)

委託会社の概況

- ・名称 東京海上アセットマネジメント株式会社
- ・資本金の額 20億円（2023年5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（2023年5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】

### (2)【投資対象】

<訂正前>

(略)

<参考情報>当ファンドが投資対象とする投資信託証券について

以下は、当ファンドが投資対象とする投資信託証券の概要について記載したものであり、これら投資信託の関係法人等により内容が変更となる場合があります。

東京海上・米国短期国債マザーファンド	
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・米国の国債および上場投資信託証券を主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。</li> <li>・米国の国債の投資にあたっては、原則として、残存期間が3ヵ月以下の国債に投資を行います。</li> <li>・外貨建資産については、原則として、為替ヘッジを行いません。</li> <li>・米国の国債の組入比率は、高位を保つことを基本とします。ただし、資金動向等によっては、残存期間が3ヵ月以下の米国国債の指数を対象とする上場投資信託証券に投資する場合があります。</li> </ul>

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>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 合に限ります。)</li> <li>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>上場投資信託証券等を除く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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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10%、合計で20% 以内とすることとし、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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行いません。
決算日	11月15日(休業日の場合は翌営業日)
信託報酬等	信託報酬はかかりません。有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等が信 託財産から支払われます。
委託会社	東京海上アセットマネジメント株式会社
受託銀行	三菱UFJ信託銀行株式会社

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できない場合があります。

東京海上・グローバル物価連動国債マザーファンド	
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>海外の物価連動国債および上場投資信託証券を主要投資対象とし、信託財産の 着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。</li> <li>海外の物価連動国債市場の中長期的な値動きを概ね捉える投資成果をめざして 運用を行います。</li> <li>外貨建資産については、原則として、為替ヘッジを行いません。</li> <li>物価連動国債の組入比率は、高位を保つことを基本とします。ただし、資金動 向等によっては、世界 の物価連動国債の指数を対象とする上場投資信託証券に 投資する場合があります。 日本を含む場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>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 合に限ります。)</li> <li>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>上場投資信託証券等を除く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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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10%、合計で20% 以内とすることとし、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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行いません。
決算日	11月15日(休業日の場合は翌営業日)

信託報酬等	信託報酬はかかりません。有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等が信託財産から支払われます。
委託会社	東京海上アセットマネジメント株式会社
受託銀行	三菱UFJ信託銀行株式会社

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できない場合があります。

TMA物価連動国債マザーファンド	
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>国内の物価連動国債を主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を図ることを目標として運用を行います。</li> <li>国内の物価連動国債を主要投資対象とし、将来のインフレリスクをヘッジすることにより実質的な資産価値の保全を図りつつ、安定した収益の確保をめざします。</li> <li>物価連動国債の組入比率は、高位を保つことを基本とします。</li> <li>信託財産に組入れる物価連動国債の加重平均残存期間は、平成25年10月以降に発行された物価連動国債全体の加重平均残存期間±3年の範囲内とすることを基本とします。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式、新株引受権証券および新株予約権証券への投資は行いません。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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10%、合計で20%以内とすることとし、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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行いません。
決算日	2月26日(休業日の場合は翌営業日)
信託報酬等	信託報酬はかかりません。有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等が信託財産から支払われます。
委託会社	東京海上アセットマネジメント株式会社
受託銀行	三菱UFJ信託銀行株式会社

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できない場合があります。

世界モノポリー戦略株式ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	
形態	追加型株式投資信託

運用方針	<p>&lt;基本方針&gt; 信託財産の成長をめざして運用を行います。</p>	
	<p>(1) 投資対象 アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド（以下、「マザーファンド」） &lt;マザーファンドの投資対象&gt; 海外の金融商品取引所に上場している企業の株式等 リート（不動産投資信託証券）やDR（預託証券）、その他の証券を含みます。</p>	
	<p>(2) 投資態度</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>主として、マザーファンドの受益証券に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行うことを基本とします。</li> <li>マザーファンドの受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。</li> <li>実質組入外貨建資産については、為替変動リスクを低減するために、為替ヘッジを行います。ただし、為替ヘッジの手段がない、あるいは、ヘッジコストが過大と判断される際には、一部の通貨について、為替ヘッジを行わない場合があります。</li> <li>当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。</li> <li>外国為替取引の指図に関する権限の一部をノーザン・トラスト・カンパニー・オブ・ホンコンに委託します。</li> </ol>	
主な投資制限	<p>(3) マザーファンドの投資態度</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>主として日本を除く世界の株式等の中から、モノポリー企業（モノやサービス等を独占・寡占（地域独占含む）していると判断する企業）の株式等を投資対象とします。</li> <li>銘柄選定に関しては、持続可能な競争優位性を持つと判断される銘柄を選別します。</li> <li>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。</li> <li>モノポリー企業の株式等の運用は、マゼラン・アセット・マネジメント・リミテッドに運用指図に関する権限を一部委託します。</li> </ol>	
	<ol style="list-style-type: none"> <li>マザーファンドの受益証券への投資割合には制限を設けません。</li> <li>株式等への直接投資は、原則として行いません。 リート（不動産投資信託証券）やDR（預託証券）、その他の証券を含みます。以下同じ。</li> <li>マザーファンドを通じて行う一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係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10%、合計で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、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行います。</li> <li>マザーファンドを通じて行う投資信託証券（上場投資信託は除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</li> </ol>	
	<ol style="list-style-type: none"> <li>マザーファンドの受益証券への投資割合には制限を設けません。</li> <li>株式等への直接投資は、原則として行いません。 リート（不動産投資信託証券）やDR（預託証券）、その他の証券を含みます。以下同じ。</li> <li>マザーファンドを通じて行う一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係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10%、合計で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、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行います。</li> <li>マザーファンドを通じて行う投資信託証券（上場投資信託は除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</li> </ol>	
収益分配	<p>収益分配金額は、分配対象額の範囲（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含む）等の全額）内で委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。但し、必ず分配を行うものではありません。</p>	
信託設定日	2022年11月18日	
信託期間	無期限	
決算日	<p>年4回 毎年3月、6月、9月、12月の月末日（休業日の場合は翌営業日） 初回決算日：2023年1月4日</p>	
信託報酬等	<p>委託者報酬：年0.6600%（税抜 年0.6000%） 受託・販売報酬：年0.033%（税抜 受託者報酬 年0.020%、販社報酬 年0.010%） 計：年0.693%（税抜 年0.630%）</p>	
ファンドの関係法人	委託会社	ノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社
	受託会社	三井住友信託銀行株式会社
	マザーファンドの投資顧問会社	マゼラン・アセット・マネジメント・リミテッド
	為替ヘッジの運用委託先	ノーザン・トラスト・カンパニー・オブ・ホンコン
ベンチマーク	特になし。	

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できない場合があります。

東京海上・日米住宅REITマザーファンド（為替ヘッジあり）	
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・日本および米国の取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されているREIT」を主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。</li> <li>・日本および米国の取引所に上場されているREITの中から、住宅や居住用施設等の不動産を主な投資対象とする銘柄へ投資を行います。</li> <li>・運用にあたっては、流動性を考慮の上、主に物価および資産価格との価格連動性の高さ、証券価格における金利上昇リスクへの抵抗力等で銘柄評価を行い、国別配分を勘案してポートフォリオを構築します。</li> <li>・原則として、REITの組入比率を高位に維持します。</li> <li>・外貨建資産については、原則として、為替ヘッジを行うことにより為替変動リスクの低減を図ります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・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。</li> <li>・上場投資信託証券等を除く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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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10%、合計で20%以内とすることとし、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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行いません。
決算日	11月15日（休業日の場合は翌営業日）
信託報酬等	信託報酬はかかりません。有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等が信託財産から支払われます。
委託会社	東京海上アセットマネジメント株式会社
受託銀行	三菱UFJ信託銀行株式会社

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できない場合があります。

東京海上・ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・日本を含む世界の取引所に上場されている投資信託証券であって、金現物価格（米ドル建て）への連動をめざす投資信託証券を主要投資対象とし、信託財産の成長をめざして運用を行います。</li> <li>・原則として、上場投資信託証券の組入比率を高位に維持します。</li> <li>・外貨建資産については、原則として、為替ヘッジを行うことにより為替変動リスクの低減を図ります。</li> </ul>

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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 合に限ります。)</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・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。</li> <li>・上場投資信託証券等を除く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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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10%、合計で20% 以内とすることとし、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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行いません。
決算日	11月15日(休業日の場合は翌営業日)
信託報酬等	信託報酬はかかりません。有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等が信 託財産から支払われます。
委託会社	東京海上アセットマネジメント株式会社
受託銀行	三菱UFJ信託銀行株式会社

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できない場合があります。

<訂正後>

(略)

<参考情報> 当ファンドが投資対象とする投資信託証券について

以下は、当ファンドが投資対象とする投資信託証券の概要について記載したものであり、これら投資信託の関係法人等により内容が変更となる場合があります。

東京海上・米国短期国債マザーファンド	
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・米国の国債および上場投資信託証券を主要投資対象とし、信託財産の着実な成 長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。</li> <li>・米国の国債の投資にあたっては、原則として、残存期間が3ヵ月以下の国債に 投資を行います。</li> <li>・外貨建資産については、原則として、為替ヘッジを行いません。</li> <li>・米国の国債の組入比率は、高位を保つことを基本とします。ただし、資金動向 等によっては、残存期間が3ヵ月以下の米国国債の指数を対象とする上場投資 信託証券に投資する場合があります。</li> </ul>

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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 合に限ります。)</li> <li>・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・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。</li> <li>・上場投資信託証券等を除く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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格 変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資 の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用し ません。</li> <li>・外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外に は利用しません。</li> <li>・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10%、合計で20% 以内とすることとし、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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行いません。
決算日	11月15日(休業日の場合は翌営業日)
信託報酬等	信託報酬はかかりません。有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等が信託財産から支払われます。
委託会社	東京海上アセットマネジメント株式会社
受託銀行	三菱UFJ信託銀行株式会社

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できない場合があります。

東京海上・グローバル物価連動国債マザーファンド	
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・海外の物価連動国債および上場投資信託証券を主要投資対象とし、信託財産の 着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。</li> <li>・海外の物価連動国債市場の中長期的な値動きを概ね捉える投資成果をめざして 運用を行います。</li> <li>・外貨建資産については、原則として、為替ヘッジを行いません。</li> <li>・物価連動国債の組入比率は、高位を保つことを基本とします。ただし、資金動 向等によっては、世界 の物価連動国債の指数を対象とする上場投資信託証券に 投資する場合があります。 日本を含む場合があります。</li> </ul>



主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>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 合に限ります。)</li> <li>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>上場投資信託証券等を除く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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格 変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資 の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用し ません。</li> <li>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外に は利用しません。</li> <li>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10%、合計で20% 以内とすることとし、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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行いません。
決算日	11月15日(休業日の場合は翌営業日)
信託報酬等	信託報酬はかかりません。有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等が信 託財産から支払われます。
委託会社	東京海上アセットマネジメント株式会社
受託銀行	三菱UFJ信託銀行株式会社

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できない場合があります。

TMA物価連動国債マザーファンド	
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>国内の物価連動国債を主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の着 実な成長を図ることを目標として運用を行います。</li> <li>国内の物価連動国債を主要投資対象とし、将来のインフレリスクをヘッジする ことにより実質的な資産価値の保全を図りつつ、安定した収益の確保をめざし ます。</li> <li>物価連動国債の組入比率は、高位を保つことを基本とします。</li> <li>信託財産に組入れる物価連動国債の加重平均残存期間は、平成25年10月以降に 発行された物価連動国債全体の加重平均残存期間±3年の範囲内とすることを 基本とします。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式、新株引受権証券および新株予約権証券への投資は行いません。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格 変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とす る資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>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10%、合計で20% 以内とすることとし、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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行いません。
決算日	2月26日(休業日の場合は翌営業日)

信託報酬等	信託報酬はかかりません。有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等が信託財産から支払われます。
委託会社	東京海上アセットマネジメント株式会社
受託銀行	三菱UFJ信託銀行株式会社

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できない場合があります。

世界モノポリー戦略株式ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)		
形態	追加型株式投資信託	
運用方針	<p>&lt;基本方針&gt; 信託財産の成長をめざして運用を行います。</p> <p>(1) 投資対象 アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド(以下、「マザーファンド」) &lt;マザーファンドの投資対象&gt; 海外の金融商品取引所に上場している企業の株式等 リート(不動産投資信託証券)やDR(預託証券)、その他の証券を含みます。</p> <p>(2) 投資態度 1. 主として、マザーファンドの受益証券に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行うことを基本とします。 2. マザーファンドの受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。 3. 実質組入外貨建資産については、為替変動リスクを低減するために、為替ヘッジを行います。ただし、為替ヘッジの手段がない、あるいは、ヘッジコストが過大と判断される際には、一部の通貨について、為替ヘッジを行わない場合があります。 4. 当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。 5. 外国為替取引の指図に関する権限の一部をノーザン・トラスト・カンパニー・オブ・ホンコンに委託します。</p> <p>(3) マザーファンドの投資態度 1. 主として日本を除く世界の株式等の中から、モノポリー企業(モノやサービス等を独占・寡占(地域独占含む)していると判断する企業)の株式等を投資対象とします。 2. 銘柄選定に関しては、持続可能な競争優位性を持つと判断される銘柄を選別します。 3. 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。 4. モノポリー企業の株式等の運用は、マゼラン・アセット・マネジメント・リミテッドに運用指図に関する権限を一部委託します。</p>	
	主な投資制限	<p>1. マザーファンドの受益証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>2. 株式等への直接投資は、原則として行いません。 リート(不動産投資信託証券)やDR(預託証券)、その他の証券を含みます。以下同じ。</p> <p>3. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>4. マザーファンドを通じて行う一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係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10%、合計で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、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行います。</p> <p>5. マザーファンドを通じて行う投資信託証券(上場投資信託は除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p>
	収益分配	収益分配金額は、分配対象額の範囲(経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含む)等の全額)内で委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。但し、必ず分配を行うものではありません。
信託設定日	2022年11月18日	
信託期間	無期限	
決算日	年4回 毎年3月、6月、9月、12月の月末日(休業日の場合は翌営業日) 初回決算日:2023年1月4日	

信託報酬等	委託者報酬：年0.6600%（税抜 年0.6000%） 受託・販売報酬：年0.033%（税抜 受託者報酬 年0.020%、販社報酬 年0.010%） 計：年0.693%（税抜 年0.630%）	
ファンドの 関係法人	委託会社	ノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社
	受託会社	三井住友信託銀行株式会社
	マザーファンド の投資顧問会社	マゼラン・アセット・マネジメント・リミテッド
	為替ヘッジの運用 委託先	ノーザン・トラスト・カンパニー・オブ・ホンコン
ベンチマーク	特になし。	

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できない場合があります。

東京海上・日米住宅REITマザーファンド（為替ヘッジあり）	
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>日本および米国の取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されているREITを主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。</li> <li>日本および米国の取引所に上場されているREITの中から、住宅や居住用施設等の不動産を主な投資対象とする銘柄へ投資を行います。</li> <li>運用にあたっては、流動性を考慮の上、主に物価および資産価格との価格連動性の高さ、証券価格における金利上昇リスクへの抵抗力等で銘柄評価を行い、国別配分を勘案してポートフォリオを構築します。</li> <li>原則として、REITの組入比率を高位に維持します。</li> <li>外貨建資産については、原則として、為替ヘッジを行うことにより為替変動リスクの低減を図ります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への投資割合には制限を設けません。</li> <li>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>上場投資信託証券等を除く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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>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10%、合計で20%以内とすることとし、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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行いません。
決算日	11月15日（休業日の場合は翌営業日）
信託報酬等	信託報酬はかかりません。有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等が信託財産から支払われます。
委託会社	東京海上アセットマネジメント株式会社
受託銀行	三菱UFJ信託銀行株式会社

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できない場合があります。

東京海上・ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	
形態	親投資信託

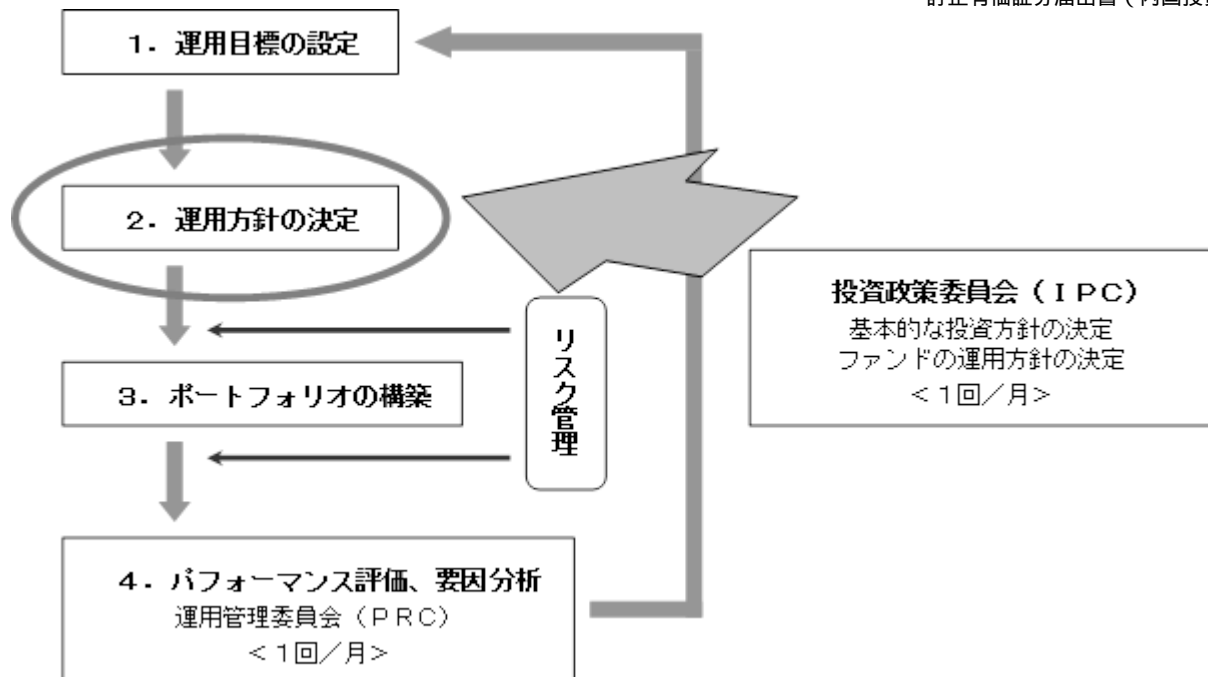
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>日本を含む世界の取引所に上場されている投資信託証券であって、金現物価格（米ドル建て）への連動をめざす投資信託証券を主要投資対象とし、信託財産の成長をめざして運用を行います。</li> <li>原則として、上場投資信託証券の組入比率を高位に維持します。</li> <li>外貨建資産については、原則として、為替ヘッジを行うことにより為替変動リスクの低減を図ります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の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。）</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>上場投資信託証券等を除く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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>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10%、合計で20%以内とすることとし、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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行いません。
決算日	11月15日（休業日の場合は翌営業日）
信託報酬等	信託報酬はかかりません。有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等が信託財産から支払われます。
委託会社	東京海上アセットマネジメント株式会社
受託銀行	三菱UFJ信託銀行株式会社

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できない場合があります。

### (3)【運用体制】

<更新後>

当ファンドの運用体制は以下の通りです。



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

運用におけるリスク管理は、運用リスク管理部門（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、2023年5月末日現在）

### 3【投資リスク】

<更新後>

（略）

3．管理体制

（略）

## 参考情報

2018年6月～2023年5月

ファンドの年間騰落率および  
分配金再投資基準価額の推移

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

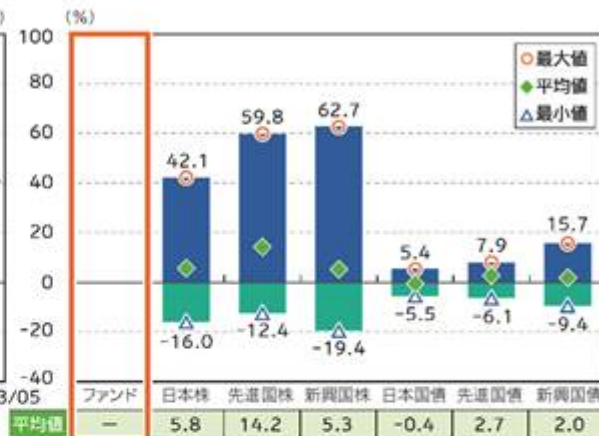


※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものと  
して計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場  
合があります。

※ファンドは設定1年未満であるため、年間騰落率を表示できま  
せん。

ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

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



※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

※ファンドは設定1年未満であるため、年間騰落率を表示できま  
せん。

## 代表的な資産クラスと指数名

日本株	TOPIX (東証株価指数) (配当込み)
先進国株	MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ベース)
新興国株	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・ディバシファイド (円ベース)

## 指数について

●TOPIXの指数値およびTOPIXにかかる標準または商標は、株式会社J P X 総研または株式会社J P X 総研の関連会社（以下、J P X といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXにかかる標準または商標に関するすべての権利はJ P X が有します。J P X は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J P X により提供、保護または販売されるものではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P X は責任を負いません。●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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。●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、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。●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、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

## 4 【手数料等及び税金】

## (5) 【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

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

(略)

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

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

(略)

\* 上記は、2022年7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。

<訂正後>

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

(略)

少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得等が一定期間非課税となりますが、2024年1月1日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。

また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。

当ファンドは、2024年1月1日以降は、「NISA」の対象とはなりません。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(略)

\* 上記は、2023年5月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容等が変更される場合があります。

## 5【運用状況】

<更新後>

以下は2023年5月31日現在の運用状況です。

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

### (1)【投資状況】

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	111,516,284	18.18
親投資信託受益証券	日本	495,611,503	80.82
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		6,040,045	0.98
合計(純資産総額)		613,167,832	100.00

(ご参考：親投資信託の投資状況)

当ファンドが主要投資対象とする親投資信託の投資状況は以下の通りです。

#### 東京海上・米国短期国債マザーファンド

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	513,453,925	96.11
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		20,772,716	3.88
合計(純資産総額)		534,226,641	100.00

#### 東京海上・グローバル物価連動国債マザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	457,423,734	49.45
	カナダ	18,256,699	1.97
	ドイツ	36,597,951	3.95
	イタリア	69,948,460	7.56
	フランス	102,464,691	11.07
	イギリス	220,926,694	23.88
	小計	905,618,229	97.91
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		19,264,379	2.08
合計（純資産総額）		924,882,608	100.00

## 東京海上・ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	169,679,661	103.18
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		5,239,555	3.18
合計（純資産総額）		164,440,106	100.00

## 東京海上・日米住宅REITマザーファンド（為替ヘッジあり）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	48,517,700	29.32
	アメリカ	112,413,943	67.93
	小計	160,931,643	97.25
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		4,539,934	2.74
合計（純資産総額）		165,471,577	100.00

## TMA物価連動国債マザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	10,817,658,640	99.69
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		33,588,398	0.30
合計（純資産総額）		10,851,247,038	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

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	東京海上・米国短期国債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	124,751,400	0.9899	123,494,340	1.0186	127,071,776	20.72
2	TMA物価連動国債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	98,466,870	1.2514	123,222,330	1.2589	123,959,942	20.21
3	東京海上・グローバル物価連動国債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	123,874,822	0.9856	122,102,967	0.9900	122,636,073	20.00
4	世界モノポリー戦略株式ファンド（為替ヘッジあり）（適格）	日本	投資信託受益証券	112,619,960	1.0418	117,327,474	0.9902	111,516,284	18.18



5	東京海上・日米住宅REITマザーファンド(為替ヘッジあり)	日本	親投資信託受益証券	60,958,280	1.0219	62,297,278	1.0036	61,177,729	9.97
6	東京海上・ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	日本	親投資信託受益証券	56,579,128	1.1040	62,467,067	1.0740	60,765,983	9.91

## b. 投資有価証券の種類

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	18.18
親投資信託受益証券	80.82
合計	99.01

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

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

## 東京海上・米国短期国債マザーファンド

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	B 07/05/23	アメリカ	国債証券	-	2023/07/05	400,000	13,847.29	55,389,172	13,910.00	55,640,032	10.41
2	B 07/13/23	アメリカ	国債証券	-	2023/07/13	400,000	13,825.69	55,302,780	13,892.09	55,568,370	10.40
3	B 07/25/23	アメリカ	国債証券	-	2023/07/25	400,000	13,817.52	55,270,105	13,867.72	55,470,894	10.38
4	B 08/01/23	アメリカ	国債証券	-	2023/08/01	400,000	13,812.52	55,250,087	13,853.03	55,412,123	10.37
5	B 08/10/23	アメリカ	国債証券	-	2023/08/10	400,000	13,805.27	55,221,093	13,834.47	55,337,917	10.35
6	B 08/15/23	アメリカ	国債証券	-	2023/08/15	400,000	13,808.52	55,234,114	13,823.48	55,293,951	10.35
7	B 08/22/23	アメリカ	国債証券	-	2023/08/22	400,000	13,800.31	55,201,268	13,809.72	55,238,909	10.33
8	B 06/08/23	アメリカ	国債証券	-	2023/06/08	300,000	13,854.85	41,564,574	13,960.93	41,882,817	7.83
9	B 06/15/23	アメリカ	国債証券	-	2023/06/15	300,000	13,834.46	41,503,407	13,946.63	41,839,904	7.83
10	B 06/27/23	アメリカ	国債証券	-	2023/06/27	300,000	13,822.58	41,467,767	13,923.00	41,769,003	7.81

## 東京海上・グローバル物価連動国債マザーファンド

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	UKTI 0 5/8 03/22/40	イギリス	国債証券	0.625	2040/03/22	100,000	19,531.44	31,284,202	16,332.93	27,685,800	2.99
2	UKTI 0 5/8 11/22/42	イギリス	国債証券	0.625	2042/11/22	100,000	19,795.44	32,312,311	15,998.58	27,637,076	2.98
3	T11 0 5/8 07/15/32	アメリカ	国債証券	0.625	2032/07/15	200,000	13,092.64	26,788,737	13,001.88	27,008,296	2.92
4	FRTR 3.4 07/25/29	フランス	国債証券	3.400	2029/07/25	100,000	19,020.57	26,727,237	18,103.82	26,267,745	2.84
5	FRTR 1.8 07/25/40	フランス	国債証券	1.800	2040/07/25	100,000	18,613.96	25,216,355	17,973.29	25,050,274	2.70
6	UKTI 0 1/8 03/22/26	イギリス	国債証券	0.125	2026/03/22	100,000	17,306.47	24,153,050	17,042.46	24,221,600	2.61

7	BTPS 2.35 09/15/35	イタリア	国債証券	2.350	2035/09/15	100,000	15,983.76	22,602,999	15,608.66	22,707,635	2.45
8	UKTI 0 1/8 11/22/36	イギリス	国債証券	0.125	2036/11/22	100,000	18,326.03	24,443,386	15,810.13	22,316,474	2.41
9	TII 2 3/8 01/15/25	アメリカ	国債証券	2.375	2025/01/15	100,000	14,044.08	22,098,753	13,939.32	22,316,026	2.41
10	UKTI 0 3/8 03/22/62	イギリス	国債証券	0.375	2062/03/22	100,000	20,778.53	30,557,894	13,848.30	21,552,391	2.33
11	UKTI 0 1/8 08/10/31	イギリス	国債証券	0.125	2031/08/10	100,000	18,645.62	22,026,011	16,916.53	21,146,854	2.28
12	TII 2 1/8 02/15/40	アメリカ	国債証券	2.125	2040/02/15	100,000	15,466.94	21,422,188	15,080.96	21,055,892	2.27
13	TII 2 1/8 02/15/41	アメリカ	国債証券	2.125	2041/02/15	100,000	14,786.26	20,027,402	15,090.79	20,795,261	2.24
14	UKTI 0 1/4 03/22/52	イギリス	国債証券	0.250	2052/03/22	100,000	18,845.36	27,002,104	13,514.81	20,492,788	2.21
15	UKTI 0 1/8 08/10/41	イギリス	国債証券	0.125	2041/08/10	100,000	16,828.82	21,535,216	14,726.30	19,299,560	2.08
16	DBRI 0 1/2 04/15/30	ドイツ	国債証券	0.500	2030/04/15	100,000	15,923.74	19,032,797	15,454.12	19,003,931	2.05
17	UKTI 0 1/8 03/22/39	イギリス	国債証券	0.125	2039/03/22	100,000	16,319.91	20,085,732	15,178.76	18,774,921	2.02
18	FRTR 0 1/4 07/25/24	フランス	国債証券	0.250	2024/07/25	100,000	15,499.13	18,624,442	15,002.64	18,546,875	2.00
19	CANRRB 3 12/01/36	カナダ	国債証券	3.000	2036/12/01	100,000	12,363.87	18,327,220	12,111.46	18,256,699	1.97
20	UKTI 0 1/8 08/10/48	イギリス	国債証券	0.125	2048/08/10	100,000	17,754.59	22,407,071	13,326.36	17,799,224	1.92
21	DBRI 0.1 04/15/33	ドイツ	国債証券	0.100	2033/04/15	100,000	15,506.63	17,590,442	15,075.11	17,594,020	1.90
22	TII 0 1/8 07/15/24	アメリカ	国債証券	0.125	2024/07/15	100,000	13,521.34	16,891,049	13,571.33	17,247,950	1.86
23	TII 0 1/4 01/15/25	アメリカ	国債証券	0.250	2025/01/15	100,000	13,434.69	16,824,900	13,471.97	17,164,369	1.85
24	TII 0 3/8 07/15/25	アメリカ	国債証券	0.375	2025/07/15	100,000	13,429.10	16,796,476	13,479.61	17,153,214	1.85
25	TII 0 5/8 01/15/26	アメリカ	国債証券	0.625	2026/01/15	100,000	13,431.89	16,767,626	13,472.51	17,110,366	1.85
26	TII 1 3/8 02/15/44	アメリカ	国債証券	1.375	2044/02/15	100,000	12,963.66	16,498,534	13,183.69	17,070,644	1.84
27	BTPS 0.65 05/15/26	イタリア	国債証券	0.650	2026/05/15	100,000	14,991.99	16,915,707	14,682.91	17,043,925	1.84
28	FRTR 0.1 03/01/32	フランス	国債証券	0.100	2032/03/01	100,000	14,838.95	16,172,248	14,909.47	16,596,033	1.79
29	TII 0 3/8 01/15/27	アメリカ	国債証券	0.375	2027/01/15	100,000	13,205.46	16,214,889	13,254.12	16,557,983	1.79
30	TII 0 1/2 01/15/28	アメリカ	国債証券	0.500	2028/01/15	100,000	13,486.40	16,407,000	13,222.46	16,176,357	1.74

東京海上・ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

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	SPDR GOLD MINISHARES TRUST	アメリカ	投資信託受益証券	31,200	5,050.4120	157,572,857	5,438.4506	169,679,661	103.18

## 東京海上・日米住宅REITマザーファンド(為替ヘッジあり)

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	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	92	115,326.98	10,610,083	119,100.00	10,957,200	6.62
2	アドバンス・レジデンス投資法人	日本	投資証券	28	337,811.25	9,458,715	358,000.00	10,024,000	6.05
3	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	405	23,245.14	9,414,285	24,142.47	9,777,701	5.90
4	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	1,087	8,537.15	9,279,883	8,388.99	9,118,837	5.51
5	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	438	21,606.38	9,463,598	20,562.96	9,006,577	5.44
6	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	284	29,209.40	8,295,471	29,982.05	8,514,905	5.14
7	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	1,768	4,276.96	7,561,668	4,694.87	8,300,537	5.01
8	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	12	616,697.50	7,400,370	678,000.00	8,136,000	4.91
9	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	406	19,400.98	7,876,801	17,809.49	7,230,654	4.36
10	UDR INC	アメリカ	投資証券	1,243	5,629.93	6,998,009	5,478.98	6,810,377	4.11
11	APARTMENT INCOME REIT CO	アメリカ	投資証券	1,366	5,012.59	6,847,202	4,812.28	6,573,575	3.97
12	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	アメリカ	投資証券	2,705	2,353.51	6,366,259	2,385.87	6,453,788	3.90
13	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	713	8,963.44	6,390,939	8,901.95	6,347,091	3.83
14	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	409	15,638.75	6,396,252	14,559.83	5,954,974	3.59
15	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	17	309,329.35	5,258,599	338,500.00	5,754,500	3.47
16	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	アメリカ	投資証券	1,148	4,370.60	5,017,457	4,792.71	5,502,034	3.32
17	サムティ・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	43	117,774.55	5,064,305	120,000.00	5,160,000	3.11
18	CENTERSPACE	アメリカ	投資証券	588	8,729.30	5,132,832	8,254.81	4,853,831	2.93
19	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	22	211,007.86	4,642,172	213,800.00	4,703,600	2.84
20	BRT APARTMENTS CORP	アメリカ	投資証券	1,832	2,800.19	5,129,951	2,566.17	4,701,236	2.84
21	UMH PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	2,168	2,226.53	4,827,130	2,111.92	4,578,652	2.76
22	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	アメリカ	投資証券	3,894	1,066.44	4,152,737	1,137.72	4,430,312	2.67
23	NEXPOINT RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	743	6,142.13	4,563,605	5,731.96	4,258,852	2.57
24	スタートプロシード投資法人	日本	投資証券	16	231,059.31	3,696,949	236,400.00	3,782,400	2.28

## TMA物価連動国債マザーファンド

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20回利付国債(物価連動・10年)	日本	国債証券	0.100	2025/03/10	1,574,000,000	102.55	1,715,884,230	102.80	1,718,392,464	15.83
2	第22回利付国債(物価連動・10年)	日本	国債証券	0.100	2027/03/10	1,400,000,000	104.77	1,562,211,782	106.05	1,580,463,148	14.56
3	第21回利付国債(物価連動・10年)	日本	国債証券	0.100	2026/03/10	1,340,000,000	103.61	1,474,249,141	104.00	1,479,180,976	13.63
4	第24回利付国債(物価連動・10年)	日本	国債証券	0.100	2029/03/10	1,285,000,000	103.27	1,390,969,431	105.40	1,418,994,403	13.07
5	第23回利付国債(物価連動・10年)	日本	国債証券	0.100	2028/03/10	1,275,000,000	102.89	1,384,653,829	105.00	1,412,367,862	13.01
6	第19回利付国債(物価連動・10年)	日本	国債証券	0.100	2024/09/10	770,000,000	102.45	836,985,765	102.40	835,788,800	7.70
7	第26回利付国債(物価連動・10年)	日本	国債証券	0.005	2031/03/10	720,000,000	102.16	773,310,997	106.50	805,761,108	7.42
8	第25回利付国債(物価連動・10年)	日本	国債証券	0.200	2030/03/10	625,000,000	108.59	705,792,845	110.85	720,178,593	6.63
9	第27回利付国債(物価連動・10年)	日本	国債証券	0.005	2032/03/10	645,000,000	101.59	681,571,523	105.40	706,608,503	6.51
10	第28回利付国債(物価連動・10年)	日本	国債証券	0.005	2033/03/10	130,000,000	107.79	139,966,226	107.80	139,922,783	1.28

## b. 投資有価証券の種類

## 東京海上・米国短期国債マザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	96.11
合計	96.11

## 東京海上・グローバル物価連動国債マザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	97.91
合計	97.91

## 東京海上・ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	103.18
合計	103.18

## 東京海上・日米住宅REITマザーファンド(為替ヘッジあり)

種類	投資比率(%)
投資証券	97.25
合計	97.25

## TMA物価連動国債マザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	99.69
合計	99.69

## 投資不動産物件

東京海上・米国短期国債マザーファンド  
該当事項はありません。

東京海上・グローバル物価連動国債マザーファンド  
該当事項はありません。

東京海上・ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）  
該当事項はありません。

東京海上・日米住宅REITマザーファンド（為替ヘッジあり）  
該当事項はありません。

TMA物価連動国債マザーファンド  
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの  
東京海上・米国短期国債マザーファンド  
該当事項はありません。

東京海上・グローバル物価連動国債マザーファンド  
該当事項はありません。

東京海上・ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）  
該当事項はありません。

東京海上・日米住宅REITマザーファンド（為替ヘッジあり）  
該当事項はありません。

TMA物価連動国債マザーファンド  
該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1特定期間末	(2023年 5月15日)	620	620	1.0148	1.0148
	2022年11月末日	501		1.0022	
	12月末日	521		0.9774	
	2023年 1月末日	541		0.9886	
	2月末日	568		0.9910	
	3月末日	582		0.9986	
	4月末日	606		1.0088	
	5月末日	613		1.0080	

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

## 【分配の推移】

該当事項はありません。

## 【収益率の推移】

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第1特定期間	2022年11月17日～2023年 5月15日	1.5

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

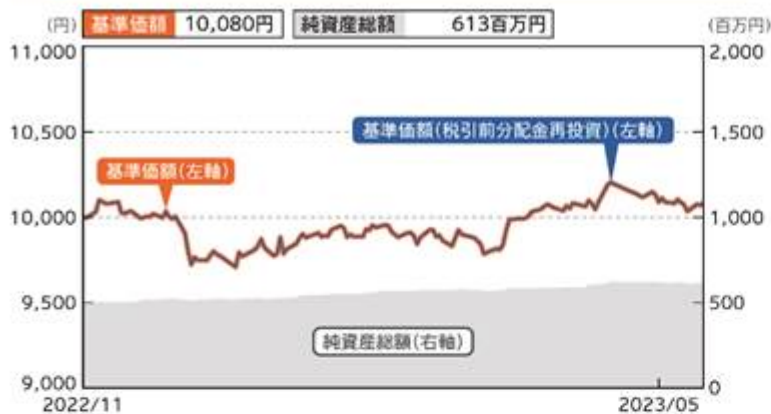
#### (4)【設定及び解約の実績】

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1特定期間	2022年11月17日～2023年 5月15日	614,221,310	2,797,431	611,423,879

#### <参考情報>

基準日：2023年5月31日

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。

※基準価額は1万口当たりで表示しています。※設定日は2022年11月17日です。

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金	決算期	分配金
2022/12	0円	2023/07	
2023/01	0円	2023/08	
2023/02	0円	2023/09	
2023/03	0円	2023/10	
2023/04	0円	2023/11	
2023/05	0円		
2023/06		設定未累計	分配実績なし

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

## 主要な資産の状況

### 各投資信託証券の組入比率、騰落率

投資信託証券	基本投資比率	比率	差	騰落率				
				1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年
東京海上・米国短期国債マザーファンド	20.0%*	20.7%	+0.7%	+4.58%	+3.60%	+2.73%	-	-
東京海上・グローバル物価連動国債マザーファンド	20.0%*	20.0%	+0.0%	+1.40%	+3.71%	-0.10%	-	-
TMA物価連動国債マザーファンド	20.0%	20.2%	+0.2%	+0.06%	+1.44%	+1.08%	+2.40%	+9.27%
世界モノポリー戦略株式ファンド(為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	20.0%	18.2%	-1.8%	-5.04%	-1.32%	-1.94%	-	-
東京海上・日米住宅REITマザーファンド (為替ヘッジあり)	10.0%	10.0%	-0.0%	-0.21%	-1.40%	-1.62%	-	-
東京海上・ゴールドマザーファンド (為替ヘッジあり)	10.0%	9.9%	-0.1%	-1.87%	+6.11%	+8.24%	-	-
短期金融資産等	-	1.0%	+1.0%					

\*各投資比率は20%を基本としますが、金利動向等により、各10%~30%、合計40%の範囲内で比率を変更します。

※比率は純資産総額に占める割合です。

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

[次ページへ続く](#)

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

基準日:2023年5月31日

## 各投資信託証券の組入上位銘柄

※比率は、各投資信託証券の純資産総額に占める割合です。

### 東京海上・米国短期国債マザーファンド 組入銘柄数:10銘柄

	銘柄	償還日	比率
1	米国短期国債	2023/07/05	10.42%
2	米国短期国債	2023/07/13	10.40%
3	米国短期国債	2023/07/25	10.38%

### 東京海上・グローバル物価連動国債マザーファンド 組入銘柄数:50銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	イギリス物価連動国債	2040/03/22	0.625%	2.99%
2	イギリス物価連動国債	2042/11/22	0.625%	2.99%
3	アメリカ物価連動国債	2032/07/15	0.625%	2.92%

### TMA物価連動国債マザーファンド 組入銘柄数:10銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第20回利付国債(物価連動・10年)	2025/03/10	0.1%	15.84%
2	第22回利付国債(物価連動・10年)	2027/03/10	0.1%	14.56%
3	第21回利付国債(物価連動・10年)	2026/03/10	0.1%	13.63%

### 世界モノポリー戦略株式ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定) 組入銘柄数:89銘柄

	銘柄	国・地域	産業	比率
1	セルネックス・テレコム	スペイン	通信	3.0%
2	ナショナル・グリッド	イギリス	送配電	3.0%
3	トランスアーバン・グループ	オーストラリア	有料道路	3.0%

※「アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド」の資産の状況を記載しています。

※業種は、マゼラン社による分類です。

※ノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社の提供するデータを基に作成しています。

### 東京海上・日米住宅REITマザーファンド(為替ヘッジあり) 組入銘柄数:24銘柄

	銘柄	国	比率
1	大和証券リビング投資法人	日本	6.62%
2	アドバンス・レジデンス投資法人	日本	6.06%
3	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	5.91%

### 東京海上・ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり) 組入銘柄数:1銘柄

	銘柄	国	比率
1	SPDR GOLD MINISHARES TRUST	アメリカ	103.2%
2			
3			

## 年間収益率の推移



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

※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

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



### 第3【ファンドの経理状況】

<更新後>

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドの第1期計算期間は、投資信託約款第31条により、2022年11月17日から2022年12月15日までとなっております。
- (4) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、当特定期間(2022年11月17日から2023年5月15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・物価対応バランスファンド（毎月決算型）】

## (1)【貸借対照表】

		当期 [2023年 5月15日現在]	
区 分	注記 番号	金額（円）	
<b>資産の部</b>			
流動資産			
コール・ローン		6,488,063	
投資信託受益証券		117,927,589	
親投資信託受益証券		496,152,747	
未収入金		457,777	
流動資産合計		621,026,176	
資産合計		621,026,176	
<b>負債の部</b>			
流動負債			
未払解約金		101,360	
未払受託者報酬		15,354	
未払委託者報酬		450,399	
未払利息		6	
その他未払費用		5,108	
流動負債合計		572,227	
負債合計		572,227	
<b>純資産の部</b>			
元本等			
元本	1	611,423,879	
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,030,070	
（分配準備積立金）		9,545,988	
元本等合計		620,453,949	
純資産合計		620,453,949	
負債純資産合計		621,026,176	

## (2)【損益及び剰余金計算書】

		当期 自 2022年11月17日 至 2023年 5月15日	
区 分	注記 番号	金額（円）	
<b>営業収益</b>			
受取配当金		414,586	
受取利息		26	
有価証券売買等損益		11,888,657	
営業収益合計		12,303,269	
<b>営業費用</b>			
支払利息		1,365	

受託者報酬		89,986
委託者報酬		2,639,626
その他費用		29,914
営業費用合計		2,760,891
営業利益又は営業損失( )		9,542,378
経常利益又は経常損失( )		9,542,378
当期純利益又は当期純損失( )		9,542,378
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額 又は一部解約に伴う当期純損失金額の分 配額( )		12,604
期首剰余金又は期首欠損金( )		
剰余金増加額又は欠損金減少額		375,324
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額		22,654
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額		352,670
剰余金減少額又は欠損金増加額		875,028
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額		3,276
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額		871,752
分配金	1	
期末剰余金又は期末欠損金( )		9,030,070

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当期
	自 2022年11月17日 至 2023年 5月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び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、投資信託受益証券及び親投資 信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

当期
自 2022年11月17日 至 2023年 5月15日
当特定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、翌特定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	当期
	[2023年 5月15日現在]
1. 1 期首元本額	500,000,000円
期中追加設定元本額	114,221,310円
期中一部解約元本額	2,797,431円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	611,423,879口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

当期
自 2022年11月17日 至 2023年 5月15日
1 分配金の計算過程 (2022年11月17日から2022年12月15日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(7,643円)及び分配準備積立金(0円)より、分配対象額は7,643円(1万口当たり0.14円)であります。分配を行っておりません。
(2022年12月16日から2023年1月16日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(299,297円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(14,136円)及び分配準備積立金(0円)より、分配対象額は313,433円(1万口当たり5.86円)であります。分配を行っておりません。
(2023年1月17日から2023年2月15日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(639,238円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(47,862円)及び分配準備積立金(299,021円)より、分配対象額は986,121円(1万口当たり17.56円)であります。分配を行っておりません。

(2023年2月16日から2023年3月15日までの分配金計算期間)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（105,000円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（94,571円）及び分配準備積立金（936,415円）より、分配対象額は1,135,986円（1万口当たり19.53円）ですが、分配を行っておりません。

(2023年3月16日から2023年4月17日までの分配金計算期間)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（950,305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（1,080,568円）、投資信託約款に規定される収益調整金（105,800円）及び分配準備積立金（1,040,768円）より、分配対象額は3,177,441円（1万口当たり54.27円）ですが、分配を行っておりません。

(2023年4月18日から2023年5月15日までの分配金計算期間)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（508,245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（5,970,195円）、投資信託約款に規定される収益調整金（261,067円）及び分配準備積立金（3,067,548円）より、分配対象額は9,807,055円（1万口当たり160.37円）ですが、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	当 期 自 2022年11月17日 至 2023年 5月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期 [2023年 5月15日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

	(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。
	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

当期（自 2022年11月17日 至 2023年5月15日）

売買目的有価証券

種 類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	457,198円
親投資信託受益証券	6,635,677円
合計	7,092,875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)

当期 [2023年 5月15日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0148円 10,148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
投資信託 受益証券	世界モノポリー戦略株式ファンド (為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	113,195,997	117,927,589	
投資信託受益証券 合計		113,195,997	117,927,589	
親投資信託 受益証券	T M A 物価連動国債マザーファンド	98,966,429	123,846,589	
	東京海上・米国短期国債マザーファンド	125,372,779	124,106,513	
	東京海上・グローバル物価連動国債マザーファンド	124,513,986	122,758,338	
	東京海上・ゴールドマザーファンド (為替ヘッジあり)	56,871,908	62,803,648	
	東京海上・日米住宅R E I Tマザー ファンド(為替ヘッジあり)	61,277,303	62,637,659	
親投資信託受益証券 合計		467,002,405	496,152,747	
合計		580,198,402	614,080,336	

## 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）

当ファンドは、「東京海上・米国短期国債マザーファンド」、「東京海上・グローバル物価連動国債マザーファンド」、「東京海上・ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」、「東京海上・日米住宅REITマザーファンド（為替ヘッジあり）」、「TMA物価連動国債マザーファンド」を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同ファンドの受益証券です。なお、同ファンドの状況は次のとおりです。

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

#### 「東京海上・米国短期国債マザーファンド」の状況

#### （1）貸借対照表

[2023年 5月15日現在]

区 分	注記 番号	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金		69,314,259
コール・ローン		18,544,920
国債証券		459,418,845
派生商品評価勘定		147,710
流動資産合計		547,425,734
資産合計		547,425,734
負債の部		
流動負債		
未払金		40,319,499
未払解約金		2,608,549
未払利息		18
流動負債合計		42,928,066
負債合計		42,928,066
純資産の部		
元本等		
元本	1	509,639,524
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2	5,141,856
元本等合計		504,497,668
純資産合計		504,497,668
負債純資産合計		547,425,734

#### （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 2022年11月17日 至 2023年 5月15日

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。</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 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特定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 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 2022年11月17日  
至 2023年 5月15日

本書における開示対象ファンドの当特定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特定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	[2023年 5月15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	200,000,000円
同期中における追加設定元本額	340,091,239円
同期中における一部解約元本額	30,451,715円
同期末における元本額	509,639,524円
元本の内訳*	
東京海上・物価対応バランスファンド（毎月決算型）	125,372,779円
東京海上・物価対応バランスファンド（年1回決算型）	219,343,660円
東京海上・米国短期国債ファンド（毎月決算型）	11,743,791円
東京海上・米国短期国債ファンド（年1回決算型）	39,799,580円
米国短期国債（適格機関投資家専用）	113,379,714円
計	509,639,524円



2. 1 本書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	509,639,524口
3. 2 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,141,856円であります。

(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 2022年11月17日 至 2023年 5月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2023年 5月15日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

(自 2022年11月17日 至 2023年5月15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	76,022円
合計	76,022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(2022年11月17日から2023年5月15日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

(2023年5月15日現在)

(単位：円)

区 分	種 類	契約額等	うち	時 価	評価損益
			1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買建	13,455,230		13,602,940	147,710
	米ドル	13,455,230		13,602,940	147,710
	合 計	13,455,230		13,602,940	147,710

## (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特定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。

同特定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。

同特定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。

- ・ 同特定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。
- ・ 同特定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特定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特定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られ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)

[2023年 5月15日現在]	
1口当たり純資産額	0.9899円
(1万口当たり純資産額)	9,899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	
		B 05/18/23	300,000.00	299,893.44	
		B 05/30/23	300,000.00	299,593.32	
		B 06/08/23	300,000.00	298,933.47	
		B 06/15/23	300,000.00	298,656.63	
		B 06/27/23	300,000.00	298,175.64	
		B 07/05/23	300,000.00	298,015.32	
		B 07/13/23	400,000.00	396,753.60	
		B 07/25/23	400,000.00	396,120.24	
		B 08/01/23	400,000.00	395,603.72	
		B 08/10/23	400,000.00	395,092.88	
	米ドル小計		3,400,000.00	3,376,838.26 (459,418,845)	
		銘柄数	10		
		比率	91.1%	100.0%	
国債証券合計				円 459,418,845 (459,418,845)	
合計				円 459,418,845 (459,418,845)	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

「東京海上・グローバル物価連動国債マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

[2023年 5月15日現在]

区分	注記 番号	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		8,562,173
コール・ローン		18,100,816
国債証券		902,368,113
未収利息		1,859,578
前払費用		488,865
流動資産合計		931,379,545

資産合計		931,379,545
負債の部		
流動負債		
未払解約金		2,308,548
未払利息		17
流動負債合計		2,308,565
負債合計		2,308,565
純資産の部		
元本等		
元本	1	942,359,065
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2	13,288,085
元本等合計		929,070,980
純資産合計		929,070,980
負債純資産合計		931,379,545

## (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 2022年11月17日 至 2023年 5月15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特定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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

自 2022年11月17日  
至 2023年 5月15日

本書における開示対象ファンドの当特定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特定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	[2023年 5月15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	800,000,000円
同期中における追加設定元本額	159,260,453円
同期中における一部解約元本額	16,901,388円
同期末における元本額	942,359,065円
元本の内訳*	
東京海上・物価対応バランスファンド（毎月決算型）	124,513,986円
東京海上・物価対応バランスファンド（年1回決算型）	217,845,079円
東京海上・グローバル物価連動国債ファンド <適格機関投資家限定>	600,000,000円
計	942,359,065円
2. 1 本書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	942,359,065口
3. 2 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は13,288,085円であります。

（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 2022年11月17日 至 2023年 5月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。

## ・ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2023年 5月15日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載していません。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

（自 2022年11月17日 至 2023年5月15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	7,192,274円
合計	7,192,274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(2022年11月17日から2023年5月15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

（2023年5月15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）

[2023年 5月15日現在]	
1口当たり純資産額	0.9859円
(1万口当たり純資産額)	9,859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	

	TII 0 1/2 01/15/28	100,000.00	117,422.09	
	TII 0 1/4 01/15/25	100,000.00	123,155.35	
	TII 0 1/4 07/15/29	100,000.00	110,955.43	
	TII 0 1/8 01/15/30	100,000.00	108,479.03	
	TII 0 1/8 01/15/31	100,000.00	106,216.25	
	TII 0 1/8 01/15/32	100,000.00	98,617.14	
	TII 0 1/8 02/15/52	100,000.00	72,999.16	
	TII 0 1/8 04/15/26	100,000.00	109,816.34	
	TII 0 1/8 04/15/27	100,000.00	101,257.91	
	TII 0 1/8 07/15/24	100,000.00	123,576.72	
	TII 0 1/8 07/15/30	100,000.00	108,608.38	
	TII 0 1/8 07/15/31	100,000.00	102,662.53	
	TII 0 1/8 10/15/24	100,000.00	113,955.69	
	TII 0 1/8 10/15/25	100,000.00	111,826.75	
	TII 0 1/8 10/15/26	100,000.00	105,340.46	
	TII 0 3/4 07/15/28	100,000.00	117,111.13	
	TII 0 3/8 01/15/27	100,000.00	119,782.31	
	TII 0 3/8 07/15/25	100,000.00	123,263.22	
	TII 0 5/8 01/15/26	100,000.00	123,387.01	
	TII 0 5/8 02/15/43	100,000.00	109,628.85	
	TII 0 5/8 07/15/32	200,000.00	196,410.88	
	TII 0 7/8 01/15/29	100,000.00	116,571.17	
	TII 1 1/8 01/15/33	100,000.00	99,731.58	
	TII 1 3/8 02/15/44	100,000.00	124,075.69	
	TII 1 5/8 10/15/27	100,000.00	103,054.18	
	TII 2 1/8 02/15/40	100,000.00	152,426.04	
	TII 2 1/8 02/15/41	100,000.00	150,844.77	
	TII 2 3/8 01/15/25	100,000.00	160,173.98	
米ドル小計		2,900,000.00	3,311,350.04 (450,509,172)	
	銘柄数	28		
	比率	48.5%	49.9%	
加ドル	CANRRB 3 12/01/36	100,000.00	加ドル 181,740.27	
加ドル小計		100,000.00	181,740.27 (18,226,731)	
	銘柄数	1		
	比率	2.0%	2.0%	

ユーロ	BTPS 0.1 05/15/33	100,000.00	ユーロ 92,532.28
	BTPS 0.4 05/15/30	100,000.00	106,486.00
	BTPS 0.65 05/15/26	100,000.00	113,357.36
	BTPS 2.35 09/15/35	100,000.00	150,102.63
	DBRI 0 1/2 04/15/30	100,000.00	126,322.89
	DBRI 0.1 04/15/33	100,000.00	117,326.48
	FRTR 0 1/4 07/25/24	100,000.00	123,573.18
	FRTR 0.1 03/01/32	100,000.00	110,532.75
	FRTR 0.1 07/25/38	100,000.00	106,011.14
	FRTR 1.8 07/25/40	100,000.00	164,354.05
	FRTR 3.4 07/25/29	100,000.00	175,624.95
	ユーロ小計	1,100,000.00	1,386,223.71 (204,689,793)
	銘柄数	11	
	比率	22.0%	22.7%
英ポンド	UKTI 0 1/4 03/22/52	100,000.00	英ポンド 129,960.33
	UKTI 0 1/8 03/22/26	100,000.00	140,640.58
	UKTI 0 1/8 03/22/39	100,000.00	114,099.12
	UKTI 0 1/8 08/10/31	100,000.00	124,921.10
	UKTI 0 1/8 08/10/41	100,000.00	118,450.31
	UKTI 0 1/8 08/10/48	100,000.00	111,834.65
	UKTI 0 1/8 11/22/36	100,000.00	134,611.76
	UKTI 0 3/8 03/22/62	100,000.00	139,036.39
	UKTI 0 5/8 03/22/40	100,000.00	168,430.55
	UKTI 0 5/8 11/22/42	100,000.00	169,824.48
英ポンド小計	1,000,000.00	1,351,809.27 (228,942,417)	
	銘柄数	10	
	比率	24.6%	25.4%
国債証券合計			円 902,368,113 (902,368,113)
合計			円 902,368,113 (902,368,113)

(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。

「東京海上・ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」の状況



## (1) 貸借対照表

[2023年 5月15日現在]

区 分	注記 番号	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		7,165,553
投資信託受益証券		171,537,282
未収入金		148,921
流動資産合計		178,851,756
資産合計		178,851,756
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		2,506,201
未払金		2,523,212
未払解約金		1,154,273
未払利息		7
流動負債合計		6,183,693
負債合計		6,183,693
純資産の部		
元本等		
元本	1	156,366,171
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		16,301,892
元本等合計		172,668,063
純資産合計		172,668,063
負債純資産合計		178,851,756

## (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 2022年11月17日 至 2023年 5月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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、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特定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	<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 2022年11月17日  
至 2023年 5月15日

本書における開示対象ファンドの当特定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特定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	[2023年 5月15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	100,000,000円
同期中における追加設定元本額	76,621,975円
同期中における一部解約元本額	20,255,804円
同期末における元本額	156,366,171円
元本の内訳*	
東京海上・物価対応バランスファンド(毎月決算型)	56,871,908円
東京海上・物価対応バランスファンド(年1回決算型)	99,494,263円
計	156,366,171円
2. 1 本書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	156,366,171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 2022年11月17日 至 2023年 5月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>

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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。

## ・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2023年 5月15日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

(自 2022年11月17日 至 2023年5月15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
投資信託受益証券	16,516,095円
合計	16,516,095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(2022年11月17日から2023年5月15日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項  
通貨関連  
(2023年5月15日現在)

(単位：円)

区 分	種 類	契約額等	うち	時 価	評価損益
			1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	売建	169,845,944		172,352,145	2,506,201
	米ドル	169,845,944		172,352,145	2,506,201
合 計		169,845,944		172,352,145	2,506,201

## (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特定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。

同特定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。

同特定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。

- ・ 同特定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。
- ・ 同特定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特定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特定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られ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)

[2023年 5月15日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1043円 11,043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
投資信託 受益証券	米ドル	SPDR GOLD MINISHARES TRUST	31,600	米ドル 1,260,840.00	
		米ドル小計	31,600	1,260,840.00 (171,537,282)	
		銘柄数	1		
		比 率	99.3%	100.0%	
投資信託受益証券合計				円 171,537,282 (171,537,282)	

合 計	円 171,537,282 (171,537,282)
-----	-----------------------------------

(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  
「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

「東京海上・日米住宅REITマザーファンド(為替ヘッジあり)」の状況

(1) 貸借対照表

[2023年 5月15日現在]

区 分	注記 番号	金額(円)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金		1,574,273
コール・ローン		9,206,839
投資証券		164,834,318
派生商品評価勘定		32,383
未収配当金		369,522
流動資産合計		176,017,335
資産合計		176,017,335
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定		2,645,172
未払解約金		1,154,273
未払利息		9
流動負債合計		3,799,454
負債合計		3,799,454
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1	168,484,297
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		3,733,584
元本等合計		172,217,881
純資産合計		172,217,881
負債純資産合計		176,017,335

(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 2022年11月17日 至 2023年 5月15日
-----	--------------------------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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特定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。

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

自 2022年11月17日  
至 2023年 5月15日

本書における開示対象ファンドの当特定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特定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	[2023年 5月15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 同期末における元本額  元本の内訳* 東京海上・物価対応バランスファンド（毎月決算型） 東京海上・物価対応バランスファンド（年1回決算型） 計	100,000,000円 80,594,035円 12,109,738円 168,484,297円  61,277,303円 107,206,994円 168,484,297円
2. 1 本書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	168,484,297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 2022年11月17日 至 2023年 5月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。

## ・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2023年 5月15日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載してあります。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載してあります。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

（自 2022年11月17日 至 2023年5月15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
-----	-----------------

投資証券	4,166,419円
合計	4,166,419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(2022年11月17日から2023年5月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

(2023年5月15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				
	売建	113,164,007		115,776,796	2,612,789
	米ドル	113,164,007		115,776,796	2,612,789
	合 計	113,164,007		115,776,796	2,612,789

(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特定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。

同特定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。

同特定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。

- ・ 同特定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。

- ・ 同特定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特定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特定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られ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)

[2023年 5月15日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0222円 10,222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
-----	-----	-----	------	-----	-----



投資証券	日本円	日本アコモデーションファンド投資法人	12	日本円 7,896,000		
		アドバンス・レジデンス投資法人	28	9,912,000		
		ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	22	4,708,000		
		コンフォリア・レジデンシャル投資法人	17	5,822,500		
		サムティ・レジデンシャル投資法人	43	5,074,000		
		スターツプロシード投資法人	16	3,731,200		
		大和証券リビング投資法人	92	10,598,400		
	日本円小計		230	47,742,100		
		銘柄数	7			
		比率	27.7%	29.0%		
	米ドル				米ドル	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	1,258	44,067.74		
		APARTMENT INCOME REIT CO	1,366	48,725.22		
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	4,338	36,916.38		
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	426	76,756.68		
		BRT APARTMENTS CORP	1,832	31,730.24		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	409	45,194.50		
		CENTERSPACE	588	35,044.80		
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	713	49,068.66		
		EQUITY RESIDENTIAL	1,147	72,031.60		
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	284	61,150.88		
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	2,705	46,363.70		
		INVITATION HOMES INC	1,931	65,673.31		
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC		438	67,184.82			
NEXPOINT RESIDENTIAL		743	30,856.79			
SUN COMMUNITIES INC		406	54,684.14			
UDR INC	1,379	57,063.02				
UMH PROPERTIES INC	2,405	38,143.30				
米ドル小計		22,368	860,655.78 (117,092,218)			
	銘柄数	17				
	比率	68.0%	71.0%			
投資証券合計			円 164,834,318 (117,092,218)			
合計			円 164,834,318 (117,092,218)			

(注1) 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

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

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

「TMA物価連動国債マザーファンド」の状況

（1）貸借対照表

[2023年 5月15日現在]

区 分	注記 番号	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		92,786,333
国債証券		10,668,617,499
未収利息		1,676,254
前払費用		36,456
流動資産合計		10,763,116,542
資産合計		
負債の部		
流動負債		
未払金		16,852,664
未払解約金		29,255,807
未払利息		91
流動負債合計		46,108,562
負債合計		
純資産の部		
元本等		
元本	1	8,563,938,793
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		2,153,069,187
元本等合計		10,717,007,980
純資産合計		
負債純資産合計		
		10,763,116,542

（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 2022年11月17日 至 2023年 5月15日
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）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

自 2022年11月17日 至 2023年 5月15日
本書における開示対象ファンドの当特定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特定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	[2023年 5月15日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	8,960,187,667円
同期中における追加設定元本額	1,987,907,051円
同期中における一部解約元本額	2,384,155,925円
同期末における元本額	8,563,938,793円
元本の内訳*	
東京海上セレクション・物価連動国債	3,015,027,635円
東京海上・物価対応バランスファンド（毎月決算型）	98,966,429円
東京海上・物価対応バランスファンド（年1回決算型）	173,141,307円
TMA物価連動国債ファンド 適格機関投資家限定	3,643,227,659円
年金国内物価連動国債ファンド<適格機関投資家限定>	1,553,763,726円
TMA債券バランスファンド<適格機関投資家限定>	79,812,037円
計	8,563,938,793円
2. 1 本書における開示対象ファンドの特定期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	8,563,938,793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 2022年11月17日 至 2023年 5月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2023年 5月15日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 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>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

(自 2022年11月17日 至 2023年5月15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	89,159,946円
合計	89,159,946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(2023年2月28日から2023年5月15日まで)を指しております。

(1口当たり情報に関する注記)

[2023年 5月15日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2514円 12,514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19回利付国債(物価連動・10年)	810,000,000	876,690,540	
	第20回利付国債(物価連動・10年)	1,584,000,000	1,723,534,560	
	第21回利付国債(物価連動・10年)	1,340,000,000	1,471,245,613	
	第22回利付国債(物価連動・10年)	1,400,000,000	1,571,340,427	
	第23回利付国債(物価連動・10年)	1,295,000,000	1,422,783,191	
	第24回利付国債(物価連動・10年)	1,265,000,000	1,390,798,178	
	第25回利付国債(物価連動・10年)	625,000,000	720,983,436	
	第26回利付国債(物価連動・10年)	720,000,000	795,080,664	
	第27回利付国債(物価連動・10年)	645,000,000	696,160,890	
国債証券 合計		9,684,000,000	10,668,617,499	
	合計	9,684,000,000	10,668,617,499	

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。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2023年5月31日 現在

種類	金額
資産総額	616,457,115 円
負債総額	3,289,283 円
純資産総額( - )	613,167,832 円
発行済数量	608,297,896 口
1単位当たり純資産額( / )	1.0080 円

(ご参考:親投資信託の現況)  
東京海上・米国短期国債マザーファンド

2023年5月31日 現在

種類	金額
資産総額	550,845,240 円
負債総額	16,618,599 円
純資産総額( - )	534,226,641 円
発行済数量	524,472,233 口
1単位当たり純資産額( / )	1.0186 円

東京海上・グローバル物価連動国債マザーファンド

2023年5月31日 現在

種類	金額
資産総額	926,385,219 円
負債総額	1,502,611 円

純資産総額( - )	924,882,608 円
発行済数量	934,241,186 口
1 単位当たり純資産額( / )	0.9900 円

## 東京海上・ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

2023年5月31日 現在

種類	金額
資産総額	177,451,144 円
負債総額	13,011,038 円
純資産総額( - )	164,440,106 円
発行済数量	153,113,541 口
1 単位当たり純資産額( / )	1.0740 円

## 東京海上・日米住宅REITマザーファンド(為替ヘッジあり)

2023年5月31日 現在

種類	金額
資産総額	168,319,951 円
負債総額	2,848,374 円
純資産総額( - )	165,471,577 円
発行済数量	164,880,609 口
1 単位当たり純資産額( / )	1.0036 円

## TMA物価連動国債マザーファンド

2023年5月31日 現在

種類	金額
資産総額	11,078,111,134 円
負債総額	226,864,096 円
純資産総額( - )	10,851,247,038 円
発行済数量	8,619,783,666 口
1 単位当たり純資産額( / )	1.2589 円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

<更新後>

2023年5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】

<更新後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

2023年5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	170	3,767,773
単位型公社債投資信託	2	3,238
単位型株式投資信託	11	39,143
合計	183	3,810,155





### 3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

1. 当社の財務諸表は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第38期事業年度(2022年4月1日から2023年3月31日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金	21,389,756	20,784,858
前払費用	319,734	427,401
未収委託者報酬	2,902,834	3,200,726
未収収益	2,610,213	3,021,468
未収入金	1,692	4
その他の流動資産	22,412	18,592
<b>流動資産計</b>	<b>27,246,644</b>	<b>27,453,052</b>
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	* 1 459,081	* 1 433,750
建物	342,403	307,934
器具備品	116,678	125,816
無形固定資産	228,727	348,422
電話加入権	3,795	3,795
ソフトウェア	188,720	314,954
ソフトウェア仮勘定	36,211	29,672
投資その他の資産	3,576,825	3,508,324
投資有価証券	42,253	48,291
関係会社株式	1,673,049	1,668,529
その他の関係会社有価証券	521,200	520,000
長期前払費用	40,588	30,700
敷金	474,324	474,324
その他長期差入保証金	21,230	21,230
繰延税金資産	804,178	954,048
投資損失引当金	-	208,800
<b>固定資産計</b>	<b>4,264,634</b>	<b>4,290,497</b>
<b>資産合計</b>	<b>31,511,279</b>	<b>31,743,550</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払金	3,183,398	3,477,655
未払手数料	1,306,204	1,464,843
その他未払金	1,877,194	2,012,811
未払費用	398,447	335,471
未払消費税等	277,096	266,103
未払法人税等	1,152,000	1,210,000
預り金	46,775	60,297
前受収益	2,286	2,579
賞与引当金	287,955	288,706
その他の流動負債	7	8
<b>流動負債計</b>	<b>5,347,968</b>	<b>5,640,822</b>
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	845,039	886,720
<b>固定負債計</b>	<b>845,039</b>	<b>886,720</b>
<b>負債合計</b>	<b>6,193,007</b>	<b>6,527,543</b>
<b>純資産の部</b>		
株主資本	25,312,741	25,210,382
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	22,912,741	22,810,382
利益準備金	500,000	500,000
その他利益剰余金	22,412,741	22,310,382
繰越利益剰余金	22,412,741	22,310,382

評価・換算差額等	5,529	5,624
その他有価証券評価差額金	5,529	5,624
純資産合計	25,318,271	25,216,006
負債・純資産合計	31,511,279	31,743,550

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	18,065,913	16,696,838
運用受託報酬	10,405,866	11,663,951
投資助言報酬	66,255	92,682
その他営業収益	532,829	661,029
営業収益計	29,070,864	29,114,502
営業費用		
支払手数料	8,365,057	7,669,451
広告宣伝費	216,312	206,908
調査費	6,860,898	7,435,066
調査費	2,728,988	2,823,854
委託調査費	4,131,910	4,611,211
委託計算費	115,017	119,180
営業雑経費	259,680	265,287
通信費	38,574	60,267
印刷費	175,527	160,147
協会費	24,866	23,883
諸会費	11,208	12,732
図書費	9,504	8,256
営業費用計	15,816,967	15,695,895
一般管理費		
給料	3,925,627	3,883,418
役員報酬	128,277	83,430
給料・手当	2,779,798	2,848,648
賞与	1,017,551	951,339
交際費	4,546	13,259
寄付金	2,632	4,696
旅費交通費	17,590	140,480
租税公課	167,411	174,372
不動産賃借料	468,092	468,091
退職給付費用	161,994	163,194
賞与引当金繰入	287,955	288,706
固定資産減価償却費	165,703	165,502
法定福利費	630,892	629,504
福利厚生費	12,315	10,617
諸経費	487,975	503,320
一般管理費計	6,332,736	6,445,164
営業利益	6,921,159	6,973,442
営業外収益		
受取利息	206	189
受取配当金	* 1 5,672	* 1 4,304
雑益	13,622	13,722
営業外収益計	19,500	18,216
営業外費用		
為替差損	66,106	54,263
雑損	23,333	9,120
営業外費用計	89,440	63,383
経常利益	6,851,219	6,928,275
特別利益		

投資有価証券売却益	-	480
特別利益計	-	480
特別損失		
固定資産除却損	610	190
投資有価証券評価損	-	501
投資損失引当金繰入額	-	208,800
その他特別損失	-	392
特別損失計	610	209,884
税引前当期純利益	6,850,609	6,718,870
法人税、住民税及び事業税	2,169,313	2,220,524
法人税等調整額	69,337	149,911
法人税等合計	2,099,975	2,070,612
当期純利益	4,750,633	4,648,257

**(3)【株主資本等変動計算書】**

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計		特別償却準備金	その他利益剰余金 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
当期純利益						4,750,633
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	186,580
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	-	22,412,741

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金 利益剰余金 合計	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	
当期首残高	23,099,322	25,499,322	6,393	6,393	25,505,715
当期変動額					
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	-	-			-
当期純利益	4,750,633	4,750,633			4,750,633
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			863	863	863
当期変動額合計	186,580	186,580	863	863	187,444
当期末残高	22,912,741	25,312,741	5,529	5,529	25,318,271

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	22,412,741
当期変動額					
剰余金の配当					4,750,617
当期純利益					4,648,257
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	-	102,359
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	22,310,382

	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	22,912,741	25,312,741	5,529	5,529	25,318,271
当期変動額					
剰余金の配当	4,750,617	4,750,617			4,750,617
当期純利益	4,648,257	4,648,257			4,648,257
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			94	94	94
当期変動額合計	102,359	102,359	94	94	102,264
当期末残高	22,810,382	25,210,382	5,624	5,624	25,216,006

## 注記事項

(重要な会計方針)

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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

市場価格のない株式等以外のもの

当事業年度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

## 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。

##### 投資損失引当金

関係会社等への投資に係る損失に備えるため、当該会社の財政状態等を勘案して必要と認められる額を計上しております。

### 4. 収益及び費用の計上基準

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。

#### (1) 運用報酬

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。

#### （重要な会計上の見積り）

第37期 2022年3月31日現在	第38期 2023年3月31日現在
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。	同左

#### （貸借対照表関係）

第37期 2022年3月31日現在	第38期 2023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 182,121千円	建物 217,486千円
器具備品 501,021千円	器具備品 477,945千円

#### （損益計算書関係）

第37期 自 2021年4月1日 至 2022年3月31日	第38期 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日
<p>* 1 . 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。</p> <p style="text-align: center;">関係会社からの受取配当金 2,000千円</p> <p>上記のほか、関係会社に対する営業外収益のうち、雑益の合計額は営業外収益の総額の100分の10を超えており、その金額は8,520千円であります。</p>	<p>* 1 . 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。</p> <p style="text-align: center;">関係会社からの受取配当金 3,605千円</p> <p>上記のほか、関係会社に対する営業外収益のうち、雑益の合計額は営業外収益の総額の100分の10を超えており、その金額は9,067千円であります。</p>

## (株主資本等変動計算書関係)

第37期(自 2021年4月1日 至 2022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	2021年4月1日 現在	増加	減少	2022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

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

## (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

2022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	4,750,617千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	124,037円
(ニ) 基準日	2022年3月31日
(ホ) 効力発生日	2022年6月30日

第38期(自 2022年4月1日 至 2023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	2022年4月1日 現在	増加	減少	2023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

2022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	4,750,617千円
(ロ) 1株当たり配当額	124,037円
(ハ) 基準日	2022年3月31日
(ニ) 効力発生日	2022年6月30日

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

2023年6月29日の定時株主総会において、次のとおり配当を提案する予定であります。

## ・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	4,648,241千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	121,364円
(ニ) 基準日	2023年3月31日
(ホ) 効力発生日	2023年6月29日

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

第37期 自 2021年4月1日 至 2022年3月31日	第38期 自 2022年4月1日 至 2023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37期（2022年3月31日現在）

2022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。

(単位：千円)

	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	42,253	42,253	-
敷金	474,324	474,362	37
資産計	516,578	516,616	37



(注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

(注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。これらの貸借対照表計上額は、それぞれ以下のとおりです。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額
関係会社株式	
子会社株式	1,640,302
関連会社株式	32,747
その他の関係会社有価証券	520,000

(注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、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。

(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

(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
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	-	21,628	538	-
合計	-	21,628	538	-

第38期(2023年3月31日現在)

2023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。

(単位：千円)

	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	48,291	48,291	-
敷金	474,324	475,064	739
資産計	522,615	523,355	739

(注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

(注2) 関係会社株式及びその他の関係会社有価証券については、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。これらの貸借対照表計上額は、それぞれ以下のとおりです。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額
関係会社株式	
子会社株式	1,640,302
関連会社株式	28,227
その他の関係会社有価証券	520,000

(注3) 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

(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
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	1,679	18,855	995	995
合計	1,679	18,855	995	995

## 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

第37期（2022年3月31日現在）

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 其他有価証券	-	42,253	-	42,253
資産計	-	42,253	-	42,253

## (2)時価で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			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
敷金	-	474,362	-	474,362
資産計	-	474,362	-	474,362

(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。

第38期（2023年3月31日現在）

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 其他有価証券	-	48,291	-	48,291
資産計	-	48,291	-	48,291

## (2)時価で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			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
敷金	-	475,064	-	475,064

資産計	-	475,064	-	475,064
-----	---	---------	---	---------

(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)

第37期 2022年3月31日現在				第38期 2023年3月31日現在			
1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券				1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券			
子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 子会社株式1,640,302千円、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 521,200千円)は、市場価格のない株式等又は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ことから、記載しておりません。				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28,227千円)並びにその他の関係会社有価証券(貸借対照表計上額 520,000千円)は、市場価格のない株式等に該当することから、記載しておりません。			
2. その他有価証券 (単位:千円)				2. その他有価証券 (単位:千円)			
	貸借対照表計上額	取得原価	差額		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	37,421	28,638	8,783	貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの証券投資信託	27,605	18,645	8,960
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	4,832	5,645	813	貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの証券投資信託	20,685	21,539	853
合計	42,253	34,283	7,970	合計	48,291	40,184	8,106
3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 該当事項はありません。				3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 同左			
				4. 減損処理を行った有価証券 当事業年度において、有価証券について501千円(その他有価証券の証券投資信託501千円)減損処理を行っております。			

(収益認識関係)

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

(単位:千円)

	運用報酬	成功報酬	合計
--	------	------	----

委託者報酬	18,065,913	-	18,065,913
運用受託報酬	10,155,263	250,602	10,405,866
投資助言報酬	66,255	-	66,255
その他営業収益	532,829	-	532,829
合計	28,820,261	250,602	29,070,864

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事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度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

顧客との契約から生じた債権（期首残高） 5,349,421千円

顧客との契約から生じた債権（期末残高） 5,513,048千円

（\*）なお、当事業年度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。

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

（単位：千円）

	運用報酬	成功報酬	合計
委託者報酬	16,696,838	-	16,696,838
運用受託報酬	11,529,748	134,202	11,663,951
投資助言報酬	92,682	-	92,682
その他営業収益	661,029	-	661,029
合計	28,980,299	134,202	29,114,502

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事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度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

顧客との契約から生じた債権（期首残高） 5,513,048千円

顧客との契約から生じた債権（期末残高） 6,222,195千円

（\*）なお、当事業年度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。

（退職給付関係）

第37期（自 2021年4月1日 至 2022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	800,611千円
勤務費用	69,820千円

利息費用	3,143千円
数理計算上の差異の発生額	9,121千円
退職給付の支払額	29,833千円
退職給付債務の期末残高	852,862千円

(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	852,862千円
未積立退職給付債務	852,862千円
未認識数理計算上の差異	7,823千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	845,039千円
退職給付引当金	845,039千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	845,039千円

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	69,820千円
利息費用	3,143千円
数理計算上の差異の費用処理額	267千円
その他	10,130千円
確定給付制度に係る退職給付費用	82,826千円

(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、79,167千円であります。

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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	852,862千円
勤務費用	70,929千円
利息費用	3,351千円
数理計算上の差異の発生額	24,231千円
退職給付の支払額	33,244千円

退職給付債務の期末残高	869,667千円
-------------	-----------

(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	869,667千円
未積立退職給付債務	869,667千円
未認識数理計算上の差異	17,052千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	886,720千円
退職給付引当金	886,720千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	886,720千円

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	70,929千円
利息費用	3,351千円
数理計算上の差異の費用処理額	644千円
その他	6,556千円
確定給付制度に係る退職給付費用	81,482千円

(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	0.8%
-----	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、81,712千円であります。

(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の主な原因別の内訳

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
繰延税金資産		
退職給付引当金	258,750千円	271,513千円
未払金	3,366千円	2,092千円
賞与引当金	88,171千円	88,401千円
未払法定福利費	11,424千円	11,663千円
未払事業所税	3,958千円	3,929千円
未払事業税	61,773千円	64,984千円
未払調査費	90,375千円	102,531千円
減価償却超過額	53,430千円	24,211千円
繰延資産超過額	8,569千円	9,605千円
未払確定拠出年金	2,038千円	2,120千円
未収実績連動報酬	31,195千円	48,549千円
投資損失引当金	-	63,934千円
未払費用	195,620千円	267,102千円
繰延税金資産小計	808,674千円	960,642千円

評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	808,674千円	960,642千円
繰延税金負債		
前払費用	2,055千円	4,110千円
その他有価証券評価差額金	2,440千円	2,482千円
繰延税金負債合計	4,495千円	6,593千円
繰延税金資産の純額	804,178千円	954,048千円



## 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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023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

## 3. 法人税及び地方法人税に関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度からグループ通算制度を適用しているため、法人税及び地方法人税の会計処理またはこれらに関する税効果会計の会計処理および開示については、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月12日)を当事業年度の期首から適用しています。

## (セグメント情報等)

第37期 自 2021年4月1日 至 2022年3月31日	第38期 自 2022年4月1日 至 2023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]

## 1. 製品及びサービスごとの情報

単一のサービス区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

(単位：千円)

日本	その他	合計
26,067,627	3,003,236	29,070,864

(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

同左

## 3. 主要な顧客ごとの情報

## (1) 投資信託の名称

東京海上・円資産バランスファンド（毎月決算型）

## (2) 委託者報酬

4,883,617千円

## (3) 関連するセグメント名

投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメント

## [関連情報]

## 1. 製品及びサービスごとの情報

同左

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

(単位：千円)

日本	その他	合計
25,542,522	3,571,980	29,114,502

(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

同左

## 3. 主要な顧客ごとの情報

## (1) 投資信託の名称

東京海上・円資産バランスファンド（毎月決算型）

## (2) 委託者報酬

3,989,751千円

## (3) 関連するセグメント名

投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメント

## (関連当事者情報)

第37期（自 2021年4月1日 至 2022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38期（自 2022年4月1日 至 2023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37期	
自 2021年4月1日 至 2022年3月31日	
1株当たり純資産額	661,051円47銭
1株当たり当期純利益金額	124,037円43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	25,318,271千円
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	25,318,271千円
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	4,750,633千円
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	4,750,633千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

第38期	
自 2022年4月1日 至 2023年3月31日	
1株当たり純資産額	658,381円38銭
1株当たり当期純利益金額	121,364円43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	25,216,006千円
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	25,216,006千円
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	4,648,257千円
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	4,648,257千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

(略)

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額( )	事業の内容
株式会社SBI証券	48,323百万円	金融商品取引法に定める第一種 金融商品取引業を営んでいま す。
南都まほろば証券株式会社	3,000百万円	
八十二証券株式会社	3,000百万円	
株式会社愛知銀行	18,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んで います。
株式会社十六銀行	36,839百万円	
株式会社大東銀行	14,743百万円	
株式会社中京銀行	31,879百万円	
株式会社北海道銀行	93,524百万円	

( ) 2022年3月末日現在。

# 独立監査人の監査報告書

2023年6月5日

東京海上アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

PwC あらた有限責任監査法人

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2022年4月1日から2023年3月31日までの第38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2023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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

## 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、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. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

2023年7月28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・物価対応バランスファンド（毎月決算型）の2022年11月17日から2023年5月15日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上・物価対応バランスファンド（毎月決算型）の2023年5月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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. 上記の監査報告書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。