



東京海上日動CTA償還時元本確保型ファンド2010-03 月次報告書

単位型投信 / 内外 / その他資産 / 特殊型 (条件付運用型)

ファンドの特色 (詳しくは、投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。)

主として、ドイツ銀行が公表するdbセレクトFive CTA Managersインデックスの騰落率に連動する性格を持ち、満期償還時には元本が確保されるユーロ円建債券に投資を行い、満期償還時の元本確保と信託財産の成長を目指します。

<dbセレクトFive CTA Managersインデックス> ドイツ銀行が選定した5つのCTA (Commodity Trading Advisor) ファンドのパフォーマンスを表すインデックスです。CTAとは、資金を商品市場や株式、債券、為替市場など、多くの先物市場などで運用を行う「商品投資顧問業者」を指します。

原則として、ユーロ円建債券の組入比率は高位とします。

資金動向や市況動向、信託財産の規模などの事情によっては、上記の運用ができない場合があります。

毎年5月15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、分配方針に基づいて分配を行います。

分配金額は、原則、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益の中から、委託会社が将来発生する経費等を勘案して決定します。また、分配対象額が少額の場合などは、分配を行わない場合があります。ただし、初回決算日(2010年5月17日)は分配を行いません。

設定日	2010年3月19日	信託期間	2023年4月17日まで
決算日	原則 5月15日(休業日の場合は翌営業日)	信託報酬	設定日の信託元本に対し 4.888% (税抜4.656%)

換金(解約)申込受付日: 原則、毎月15日(休日の場合は翌営業日)にご換金(解約)の申し込みの受け付けを行います。

換金(解約)申込受付期間: 換金(解約)申込受付日の7営業日前から換金(解約)申込受付日までです。

2012年	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
換金(解約)申込受付日	16日	15日	15日	16日	15日	15日	17日	15日	18日	15日	15日	17日
換金(解約)代金支払日	30日	29日	30日	5月1日	29日	29日	31日	29日	10月2日	29日	30日	1月7日

基準価額、パフォーマンスなどの状況

基準価額の推移



基準価額は信託報酬控除後のものです。前述の信託報酬に関する記載をご覧ください。上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。基準価額は1万口当たりで表示しています。

資産構成

資産	比率(%)
円元本確保型dbセレクト Five CTA Managers インデックス連動債券 期間13年	99.3
短期金融資産など	0.7
合計	100.0

短期金融資産などは、組入の有価証券以外のものです。

基準価額・純資産総額

基準価額	9,343円
前月末比	-34円
純資産総額	1,261百万円

騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	設定来
ファンド	-0.36	-1.61	-2.69	-5.67	-	-6.57

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

分配実績(1万口当たり、税引前)

第1期	2010年5月17日	-
第2期	2011年5月16日	0円
第3期	2012年5月15日	
第4期	2013年5月15日	
第5期	2014年5月15日	
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などには、分配を行わないことがあります。

dbセレクトFive CTA Managersインデックスの騰落率

1ヵ月	-0.91%
3ヵ月	-2.74%
6ヵ月	-5.34%
1年	-11.25%

dbセレクトFive CTA Managersインデックスおよび組入ユーロ円建債券の状況は、当ファンドの基準価額算定の基準となる期間に対応しています。また、ドイツ銀行グループのデータを基に、東京海上アセットマネジメント投信が作成しています。インデックス算出開始日は、2010年3月23日です。

組入ユーロ円建債券の状況

バッファ額	12.1%
インデックス算出開始日騰落率	-11.0%
クーポン累計額	0.0%
参照価額	1.1%

当資料は、当ファンドの運用状況をお知らせするために東京海上アセットマネジメント投信が作成した資料であり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。当資料の内容は作成日時点のものであり、将来予告なく変更されることがあります。当資料は信頼できると考えられる情報に基づき作成しておりますが、その正確性、完全性を保証するものではありません。当資料に記載された運用実績は、過去の実績を示したものであり、将来の運用成果を示唆・保証するものではありません。投資信託は、値動きのある証券など(外貨建資産に投資する場合には、この他に為替変動リスクもあります)に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元本が保証されているものではありません。投資信託は金融機関の預金とは異なり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、預金および保険契約ではありません。また、預金保険や保険契約者保護機構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。