



東京海上日動CTA償還時元本確保型ファンド2010-03

単位型投信／内外／その他資産／特殊型(条件付運用型)

投資信託説明書 (請求目論見書) 2010年3月

東京海上アセットマネジメント投信

この「投資信託説明書(請求目論見書)」は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づき、投資家の請求により交付される目論見書です。課税上は株式投資信託として取扱われます。

1. 本書は金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書です。
2. この投資信託説明書（請求目論見書）により行う「東京海上日動CTA償還時元本確保型ファンド2010-03」（以下「当ファンド」といいます。）の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を平成22年2月19日に関東財務局長に提出しており、平成22年3月7日にその効力が生じております。
3. 当ファンドは、主に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つユーロ円建債券を投資対象としています。当ファンドの基準価額は、組入れたユーロ円建債券の値動きや発行者の信用状況の変化などの影響により上下しますので、投資元本を割り込むことがあります。したがって、当ファンドは元本が保証されているものではありません。
委託会社の運用指図によって信託財産に生じた利益および損失は、全て投資家に帰属します。

発行者名	東京海上アセットマネジメント投信株式会社
代表者の役職氏名	取締役社長 大場 昭義
本店の所在の場所	東京都千代田区丸の内一丁目3番1号
募集内国証券投資信託受益証券に係るファンドの名称	東京海上日動CTA償還時元本確保型ファンド2010-03
募集内国投資信託受益証券の金額	上限 300億円
有価証券届出書・有価証券届出書の訂正届出書の写しを縦覧に供する場所	該当なし

目 次

	頁
第 三 部 ファンドの詳細情報	
第 1 ファンドの沿革	1
第 2 手続等	1
1 . 申込（販売）手続等	1
2 . 換金（解約）手続等	1
第 3 管理及び運営	3
1 . 資産管理等の概要	3
2 . 受益者の権利等	5
第 4 ファンドの経理状況	5
第 5 設定及び解約の実績	5

第三部 ファンドの詳細情報

第1 ファンドの沿革

平成22年2月19日	関東財務局長に有価証券届出書提出
平成22年3月8日	ファンドの募集開始（予定）
平成22年3月19日	ファンドの設定、運用開始（予定）

第2 手続等

1 申込（販売）手続等

- a. 申込期間：平成22年3月8日から平成22年3月17日まで
上記申込期間中の毎営業日にお申込みを受け付けます。
- b. 申込単位は、5,000万口以上5,000万口単位です。
- c. 受益権の取得申込価額は、1口当たり1円です。
- d. 取得申込にかかる手数料はありません。
- e. 取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

2 換金（解約）手続等

- a. 受益者は、自己に帰属する受益権につき、一部解約の実行請求（解約請求）の方法によりご換金の請求を行うことができます。
- b. ご換金のお申込みは販売会社で受け付けます。なお、販売会社の買取りによるご換金の請求については、販売会社にお問い合わせください。
- c. 解約請求による換金のお申込みは、信託設定日（平成22年3月19日）以降、原則として、信託期間中の毎月15日（当日が休業日の場合には翌営業日）を解約申込受付日として、行うことができます。お申込みは、解約申込受付日の7営業日前から解約申込受付日までの間に受け付けます。
- d. 上記c.にかかわらず、受益者（受益者死亡の場合はその相続人）は、次の事由による場合には、委託会社にその請求日を解約申込受付日とする解約請求をすることができます。
 - ・受益者が死亡したとき
 - ・受益者が天災地変その他不可抗力により財産の大部分を滅失したとき
 - ・受益者が破産宣告を受けたとき
 - ・受益者が疾病により生計の維持ができなくなったとき
 - ・その他前各号に準ずる事由があるものとして委託者が認めるとき
- e. 上記c.およびd.にかかわらず、翌営業日および翌々営業日が下記に該当する日には、解約申込受付は行わず、それ以降、下記に該当しない最初の営業日を解約申込受付日とします。
 - ・ロンドン、ニューヨーク、東京のいずれかにおいて商業銀行、外国為替取引所、証券取引所のいずれかが支払い決済または一般業務を行わない日
 - ・TARGET2（ユーロ決済システム）の休業日
 - ・市場の混乱その他やむを得ない事情によりインデックス・スポンサー（ドイツ銀行ロンドン支店）がインデックスに関連した取引を行えないと決定した日
- f. 解約単位は、5,000万口単位です。ただし、保有口数の全部をもって行うことを条件とします。
- g. 解約請求のお申込みの受付は、原則として午後3時までとします。
- h. 解約時の価額（解約価額）は、解約申込受付日から起算して4営業日目の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.5%の率を乗じて得た額）を差し引いた価額とします。
- i. 解約価額は、原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクにお問い合わせることにより知ることができます。
委託会社のお問い合わせ先（委託会社サービスデスク）
東京海上アセットマネジメント投信 サービスデスク

0120-712-016（土日祝日・年末年始を除く9時～17時）

- j. 解約にかかる手数料はありません。
- k. 解約代金は、原則として解約申込受付日から起算して11営業日目から、お支払いします。
- l. 委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、組入れたユーロ円建債券の換金ができなくなった場合、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよび既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にその請求を受け付けたものとして取扱います。
- m. 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口解約には制限を設ける場合があります。
- n. 受益者が解約の請求をするときは、振替受益権をもって行うものとし、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請が行われ、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- o. 信託財産の受益権にかかる最終受益者から解約請求があった場合には、その請求を受け付けず、信託を終了させます。

第3 管理及び運営

1 資産管理等の概要

(1) 資産の評価

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

< 主要投資対象資産の評価方法 >

対象	評価方法
公社債等	原則として、以下のいずれかの価額で評価します。 a. 日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値） b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く） c. 価格情報会社の提供する価額

- c. 基準価額は、信託設定日（平成22年3月19日）以降、原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクに問い合わせることにより知ることができます。

(2) 保管

該当事項はありません。

(3) 信託期間

原則として、平成22年3月19日から平成35年4月17日までとします。ただし、後記「(5)その他信託の終了（繰上償還）」に該当する場合には、信託を終了させることがあります。

信託財産の受益権にかかる最終受益者から一部解約の実行の請求があった場合には、信託を終了させます。

(4) 計算期間

原則として、毎年5月16日から翌年5月15日まで（第1計算期間は平成22年3月19日から平成22年5月17日まで）とします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日（ ）を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。

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

(5) その他

信託の終了（繰上償還）

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより受益権の総口数が10億口を下ることとなったとき、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社および信託の信託財産に信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下c.において同じ。）

は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- f. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。
- g. 上記f.の規定にかかわらず、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、信託は、「信託約款の変更」b.の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、「信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- i. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、信託約款は「信託約款の変更」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社および信託の信託財産に信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下c.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

関係会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間の募集・販売等の取扱いに関する契約は、当事者の別段の意思表示がない限り、1年ごとに自動更新されます。募集・販売等の取扱いに関する契約は、当事

者間の合意により変更することができます。

運用報告書

毎決算後、委託会社が、期間中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成します。運用報告書は、販売会社から、あらかじめお申し出いただいたご住所にお届けします。なお、期間中に行った信託約款の変更等のうち、委託会社が重要と判断した事項については、運用報告書に記載します。

2 受益者の権利等

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

収益分配金の請求権

収益分配金は、毎計算期間終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。）に、お支払いします。ただし、受益者が収益分配金について、上記に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社より交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

償還金の請求権

償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合には当該償還日の翌営業日）から起算して5営業日まで）から、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。）にお支払いします。ただし、受益者が償還金について、上記に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社より交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

換金（解約）請求権

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

買取請求権

信託契約の解約または重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。

第4 ファンドの経理状況

当ファンドの運用は、信託設定後、平成22年3月19日から開始する予定であり、当ファンドは有価証券届出書提出日現在、資産を有していません。

当ファンドの会計監査は、あらた監査法人が行います。監査証明を受けたファンドの財務諸表は、原則として毎年5月15日を基準日として作成される有価証券報告書に記載されます。

1 財務諸表

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

該当事項はありません。

第5 設定及び解約の実績

該当事項はありません。