

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式 (課税上は株式投資信託として取扱われま す。)	
信託期間	2015年6月19日から2020年6月12日	
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行います。	
主要投資 対象	東京海上・ 米国高配当 成長株式ファンド (Wプレミアムコース) (毎月決算型)	外国投資信託「ノース・ア メリカン・エクイティ・イ ンカム・カバード・コ ール・ストラテジー・ファン ド(Wプレミアムクラス)」および親投資信託 「東京海上マネーパ ーファンド」を主要投資 対象とします。
	ノース・アメリカン・ エクイティ・インカム・ カバード・コール・ ストラテジー・ファンド (Wプレミアムクラス)	米国の金融商品取引所に上 場されている株式(DR (預託証券)を含みます。) を主要投資対象とします。
	東京海上 マネーパ ーファンド	円建て短期公社債およびコ マーシャル・ペーパーを主 要投資対象とします。
投資制限	東京海上・ 米国高配当 成長株式ファンド (Wプレミアムコース) (毎月決算型)	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への直接投資は行い ません。</li> <li>外貨建資産への実質投資 割合には制限を設けませ ん。</li> <li>投資信託証券への投資割 合には制限を設けませ ん。</li> </ul>
	ノース・アメリカン・ エクイティ・インカム・ カバード・コール・ ストラテジー・ファンド (Wプレミアムクラス)	<ul style="list-style-type: none"> <li>純資産総額の10%を超え る借入れは行わないもの とします。</li> <li>同一発行体への投資割合 は、原則として純資産総 額の10%以下とします。</li> </ul>
	東京海上 マネーパ ーファンド	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への投資は行いませ ん。</li> <li>外貨建資産への投資は、 円貨で約定し円貨で決済 するもの(為替リスクの 生じないもの)に限りま す。</li> </ul>
分配方針	第1期決算時には、分配を行いません。第2 期以降の毎決算時に、原則として、経費控除 後の繰越分を含めた配当等収益および売買益 (評価益を含みます。)等から、基準価額の水 準、市況動向等を勘案して分配を行う方針で す。ただし、分配対象額が少額の場合等に は、収益分配を行わないことがあります。 収益の分配に充当せず、信託財産内に留保し た利益については、運用の基本方針に基づ いて運用を行います。	

## 東京海上・米国高配当成長株式ファンド (Wプレミアムコース)(毎月決算型) 〈愛称 イーグルハイ〉

### 運用報告書(全体版)

- 第13期(決算日2016年7月14日)
- 第14期(決算日2016年8月15日)
- 第15期(決算日2016年9月14日)
- 第16期(決算日2016年10月14日)
- 第17期(決算日2016年11月14日)
- 第18期(決算日2016年12月14日)

### 受益者のみなさまへ

毎々格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し  
上げます。  
さて、ご投資いただいております「東  
京海上・米国高配当成長株式ファンド  
(Wプレミアムコース)(毎月決算型)  
〈愛称 イーグルハイ〉」は、2016年  
12月14日に第18期の決算を行いました  
ので第13期～第18期の運用状況をま  
とめてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引き立てを賜りま  
すようお願い申し上げます。

### 東京海上アセットマネジメント

東京都千代田区丸の内1-8-2 鉄鋼ビルディング

お問い合わせ窓口

東京海上アセットマネジメント サービスデスク 0120-712-016

※土日祝日・年末年始を除く9時～17時

<http://www.tokiomarineam.co.jp/>

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。  
また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

## ○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	税 分 達 配		期 騰 落 中 率		債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		分	配	金	騰 落			
(設定日)	円			円		%	%	百万円
2015年6月19日	10,000			—		—	—	3,371
1期(2015年7月14日)	9,917			—	△0.8	0.0	96.9	4,745
2期(2015年8月14日)	9,842			85	0.1	0.0	98.5	5,364
3期(2015年9月14日)	8,930			85	△8.4	0.0	98.5	5,342
4期(2015年10月14日)	9,093			85	2.8	0.0	98.6	5,570
5期(2015年11月16日)	9,246			85	2.6	0.0	99.1	5,767
6期(2015年12月14日)	9,001			85	△1.7	0.0	99.2	5,849
7期(2016年1月14日)	8,306			85	△6.8	0.0	99.1	5,427
8期(2016年2月15日)	7,803			85	△5.0	0.0	98.7	4,968
9期(2016年3月14日)	8,354			85	8.2	0.0	98.9	5,196
10期(2016年4月14日)	8,174			85	△1.1	0.0	98.4	4,816
11期(2016年5月16日)	8,056			85	△0.4	0.0	98.6	4,728
12期(2016年6月14日)	7,907			85	△0.8	0.0	98.5	4,415
13期(2016年7月14日)	7,933			85	1.4	0.0	98.3	4,263
14期(2016年8月15日)	7,716			85	△1.7	0.0	98.4	4,008
15期(2016年9月14日)	7,552			85	△1.0	0.0	98.4	3,732
16期(2016年10月14日)	7,589			85	1.6	0.0	98.5	3,570
17期(2016年11月14日)	7,859			85	4.7	0.0	97.9	3,597
18期(2016年12月14日)	8,541			85	9.8	0.0	98.2	3,894

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しています。

当ファンドにベンチマークはなく、また当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる指数もないため、ベンチマーク、参考指数を記載していません。

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 組 入 比 率	投 資 信 託 券 率	証 組 入 比 率
			騰 落 率	騰 落 率			
第13期	(期 首) 2016年6月14日	円 7,907	% —		% 0.0	% 98.5	
	6月末	7,724	△2.3		0.0	98.6	
	(期 末) 2016年7月14日	8,018	1.4		0.0	98.3	
第14期	(期 首) 2016年7月14日	7,933	—		0.0	98.3	
	7月末	8,020	1.1		0.0	98.6	
	(期 末) 2016年8月15日	7,801	△1.7		0.0	98.4	
第15期	(期 首) 2016年8月15日	7,716	—		0.0	98.4	
	8月末	7,838	1.6		0.0	98.3	
	(期 末) 2016年9月14日	7,637	△1.0		0.0	98.4	
第16期	(期 首) 2016年9月14日	7,552	—		0.0	98.4	
	9月末	7,594	0.6		0.0	98.0	
	(期 末) 2016年10月14日	7,674	1.6		0.0	98.5	
第17期	(期 首) 2016年10月14日	7,589	—		0.0	98.5	
	10月末	7,697	1.4		0.0	98.6	
	(期 末) 2016年11月14日	7,944	4.7		0.0	97.9	
第18期	(期 首) 2016年11月14日	7,859	—		0.0	97.9	
	11月末	8,278	5.3		0.0	98.0	
	(期 末) 2016年12月14日	8,626	9.8		0.0	98.2	

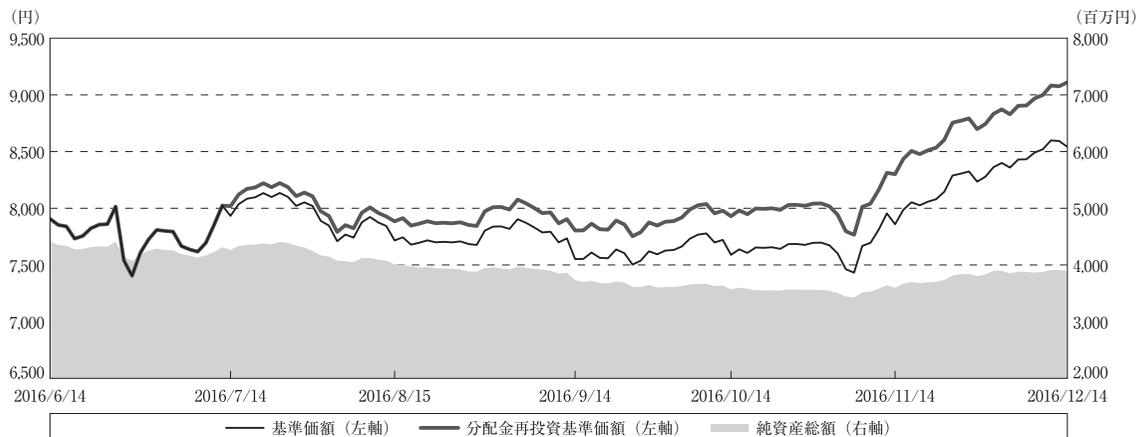
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み合わせますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

## ○運用経過

(2016年6月15日～2016年12月14日)

## ■作成期間中の基準価額等の推移



第13期首：7,907円

第18期末：8,541円（既払分配金（税込み）：510円）

騰落率：15.2%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額は、作成期首（2016年6月14日）の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

## ◇基準価額の主な変動要因

## プラス要因

- ・堅調なマクロ経済と適度に緩和的な金融環境を背景とする米国株式市場の上昇
- ・米国のトランプ次期政権によるインフラ投資の拡大など、需要増加への期待を背景とした円安米ドル高の進行
- ・オプション・プレミアムの獲得

## マイナス要因

- ・米国株式市場の上昇および円安米ドル高に伴うコール・オプションの評価損
- ・作成期初、英国のEU（欧州連合）離脱を受けて、米国株式市場が急落する局面があったこと

## ■投資環境

### 【米国株式市場】

当作成期の米国株式市場は上昇しました。作成期前半、英国の国民投票の結果、予想に反してEU（欧州連合）離脱が決定し、投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、米国株式市場は下落して始まりましたが、ECB（欧州中央銀行）やFRB（米連邦準備制度理事会）の金融緩和姿勢が確認されたことで景気の先行きに対する不透明感が後退し、株式市場は反発に転じました。その後は、ECBによる追加金融緩和の見送りや米国の堅調なマクロ経済指標を背景に米国の2016年中の利上げ観測が台頭したことから上値が抑えられ、横ばい圏で推移しました。作成期後半、米大統領選の先行き不透明感から米国株式市場は一時調整しましたが、共和党のトランプ候補が勝利すると、同氏の公約であるインフラ投資の拡大や大規模減税により米国景気が加速するとの期待などから、株式市場は一転して上昇基調となりました。

### 【為替市況】

当作成期の米ドル円為替レートは、1米ドル＝106円台から115円台まで円安米ドル高が進行しました。作成期前半は、英国の国民投票でEU離脱が決定したことを受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり、一時1米ドル＝100円を下回る水準まで円高米ドル安が進行しました。しかし、その後は徐々に円安基調となり、2016年11月初旬に米大統領選でトランプ候補が勝利すると、米国長期金利の上昇とともに、さらに円安米ドル高が進行し、1米ドル＝115円台で当作成期を終えました。

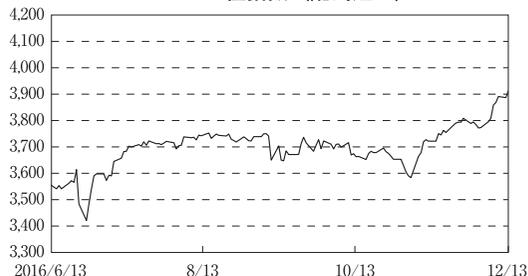
## ■ポートフォリオについて

### <東京海上・米国高配当成長株式ファンド(Wプレミアムコース)(毎月決算型)>

「ノース・アメリカン・エクイティ・インカム・カバード・コール・ストラテジー・ファンド(Wプレミアムクラス)」(以下、外国投資信託証券)および「東京海上マネープールマザーファンド」(以下、親投資信託)を主要投資対象とし、外国投資信託証券の組入比率を高位に保ちました。

当ファンドの基準価額(税引前分配金再投資)は、主に外国投資信託証券の値動きを反映し、15.2%上昇しました。

S&P500種指数(配当込み)



(注) 基準価額算定の基準に記載しています。

為替の推移



(注) 為替レートはWMロイターを使用しており、基準価額算定の基準に記載しています。

### 〈外国投資信託証券〉

株価の上昇と配当収入の獲得の双方をバランス良くねらいつつ、投資を行いました。当作成期は、米国長期金利が上昇基調となるなか、食品や飲料、生活必需品などのディフェンシブ（景気変動にあまり影響されない）銘柄や相対的に配当利回りが高い銘柄のパフォーマンスが振るわなかった一方、バランスシートの改善や収益性の向上に加え、トランプ次期米政権での規制緩和期待から銀行を中心とした金融セクターが相対的に高いパフォーマンスを示しました。

当作成期の主な売買としては、収益性の改善期待に加えてバリュエーション（投資価値を測るための指標）面で割安感があると考えたKEYCORPを新規購入したほか、BANK OF AMERICA CORPを買い増すなど金融セクターのウェイトを引き上げました。またバリュエーションに着目してヘルスケアやエネルギーセクターについてもウェイトを引き上げました。一方、情報技術セクターでは株価上昇が著しいNVIDIA CORPを売却したほか、QUALCOMM INCについてもウェイトを引き下げました。またREYNOLDS AMERICAN INCなどの生活必需品やMCDONALD'S CORPなどの一般消費財・サービスセクターのウェイトを引き下げました。

なお、株式および通貨のコール・オプションのカバー率はおおむね50%で運用を行いました。

当作成期は、保有する米国株式がおおむね上昇したことに加え、円安米ドル高が進行したことがプラスに寄与し、基準価額（分配金再投資）は上昇しました。

### 【組入銘柄の概要（2016年11月末現在）】

#### 組入上位5カ国

	国名	比率 (%)
1	アメリカ	88.7
2	イギリス	3.0
3	韓国	1.9
4	フランス	1.9
5	カナダ	1.7

#### 組入上位5業種

	業種名	比率 (%)
1	金融	27.1
2	ヘルスケア	14.9
3	エネルギー	11.6
4	資本財・サービス	11.4
5	情報技術	9.1

#### 組入上位10銘柄

	銘柄名	国名	業種名	比率
				%
1	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	金融	4.3
2	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	金融	3.7
3	PFIZER INC	アメリカ	ヘルスケア	3.5
4	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	資本財・サービス	3.0
5	WELLS FARGO & CO	アメリカ	金融	2.9
6	CITIGROUP INC	アメリカ	金融	2.7
7	MICROSOFT CORP	アメリカ	情報技術	2.2
8	MERCK & CO. INC.	アメリカ	ヘルスケア	2.2
9	AETNA INC	アメリカ	ヘルスケア	2.0
10	ORACLE CORP	アメリカ	情報技術	1.9
	組入銘柄数		90銘柄	

(注) 基準価額算定の基準で記載しています。

(注) 比率は、純資産総額に占める保有する現物株式の割合です。

(注) 業種名はMSCIセクター分類です。

(注) 国につきましてはBloomberg上の法人所在国を表示しています。

### 〈親投資信託〉

元本の安全性と流動性を重視して政府保証債や地方債を中心とする円建て公社債に投資し、プラスの収益の確保に努めました。その結果、基準価額はおおむね横ばいに推移しました。

## ■当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けていません。

また、当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる参考指数もないため、記載する事項はありません。

## ■分配金

当ファンドの収益分配方針に基づき、基準価額の水準や市況動向などを勘案して、次表の通りとしました。なお、収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

## ◇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期
	2016年6月15日～ 2016年7月14日	2016年7月15日～ 2016年8月15日	2016年8月16日～ 2016年9月14日	2016年9月15日～ 2016年10月14日	2016年10月15日～ 2016年11月14日	2016年11月15日～ 2016年12月14日
当期分配金	85	85	85	85	85	85
(対基準価額比率)	1.060%	1.090%	1.113%	1.108%	1.070%	0.985%
当期の収益	85	85	85	85	85	85
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	210	229	250	270	296	322

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ○今後の運用方針

### <東京海上・米国高配当成長株式ファンド(Wプレミアムコース)(毎月決算型)>

外国投資信託証券および親投資信託を投資対象とし、外国投資信託証券の組入比率を高位に維持します。

### <外国投資信託証券>

2016年の米国株式市場は、世界経済の成長に対する懸念やFRBの利上げペースに対する思惑などを背景に値動きの荒い展開となりましたが、足元の米国株式市場は上昇基調にあります。米国経済は、労働市場が完全雇用に近い水準にあるなか、賃金の緩やかな上昇が見込まれ、また、住宅や製造業関連の経済指標も底堅く推移していることから、今後も堅調な経済成長が継続すると考えています。ただし、米国や欧州など主要各国の金融政策の方向性の相違は、引き続き世界経済における投資家の主要な関心事であり、各国の政策動向を受けて一時的に市場の変動性が高まることも想定されます。

引き続き、株価の上昇と配当収入の獲得の双方をバランス良くねらいつつ、米国の景気循環上、現在は成熟期にあると判断し、低成長環境下で恩恵を受けると考えられる銘柄を組み入れる方針です。

なお、株式および通貨のコール・オプションのカバー率はおおむね50%とする方針です。

### <親投資信託>

国内の短期金利は、日銀が当面は緩和的な政策を継続するとの見方から、マイナス水準にとどまると予想しています。

このような環境下、政府保証債や地方債を中心とする円建て公社債およびコマーシャル・ペーパーを主要投資対象として運用することにより、プラスの収益の確保もしくはマイナス幅を極力最小化するように努める方針です。

## ○1万口当たりの費用明細

(2016年6月15日～2016年12月14日)

項 目	第13期～第18期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 40	% 0.514	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	(14)	(0.179)	*委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価
( 販 売 会 社 )	(26)	(0.325)	*購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
( 受 託 会 社 )	( 1 )	(0.011)	*運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	0	0.005	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
( 監 査 費 用 )	( 0 )	(0.005)	*監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
( そ の 他 )	( 0 )	(0.000)	*その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	40	0.519	
作成期間の平均基準価額は、7,858円です。			

(注) 作成期間の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) その他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券(親投資信託を除く。)が支払った費用を含みません。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## ○売買及び取引の状況

(2016年6月15日～2016年12月14日)

## 投資信託証券

銘 柄			第13期～第18期			
			買 付		売 付	
			口 数	金 額	口 数	金 額
			千口	千円	千口	千円
外 国 (邦貨建)	ケイマン	ノース・アメリカン・エクイティ・インカム・カバード・ コール・ストラテジー・ファンド(Wプレミアムクラス)	5	40,000	103	775,000

(注) 金額は受渡代金です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2016年6月15日～2016年12月14日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ○組入資産の明細

(2016年12月14日現在)

## ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	第12期末		第18期末			
		口	数	口	数	評 価 額	比 率
			千口		千口	千円	%
			563		465	3,825,984	98.2
			563		465	3,825,984	98.2

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

## 親投資信託残高

銘	柄	第12期末		第18期末		
		口	数	口	数	評 価 額
			千口		千口	千円
			996		996	1,000

## ○投資信託財産の構成

(2016年12月14日現在)

項	目	第18期末	
		評 価 額	比 率
		千円	%
		3,825,984	96.3
		1,000	0.0
		144,663	3.7
		3,971,647	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第13期末	第14期末	第15期末	第16期末	第17期末	第18期末
	2016年7月14日現在	2016年8月15日現在	2016年9月14日現在	2016年10月14日現在	2016年11月14日現在	2016年12月14日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	4,346,988,819	4,063,069,366	3,821,645,715	3,620,876,941	3,647,346,993	3,971,647,786
コール・ローン等	155,986,533	116,526,276	86,566,199	101,767,037	74,346,561	104,663,406
投資信託受益証券(評価額)	4,190,002,087	3,945,542,791	3,674,079,217	3,518,109,805	3,522,000,432	3,825,984,181
東京海上マネープールマザーファンド(評価額)	1,000,199	1,000,299	1,000,299	1,000,099	1,000,000	1,000,199
未収入金	—	—	60,000,000	—	50,000,000	40,000,000
(B) 負債	83,292,422	54,209,764	89,582,413	50,460,140	49,809,216	77,223,940
未払収益分配金	45,682,641	44,163,857	42,007,859	39,990,285	38,910,760	38,757,385
未払解約金	33,976,265	6,204,266	44,225,710	7,346,592	7,773,416	35,222,171
未払信託報酬	3,595,305	3,801,415	3,313,744	3,090,556	3,092,309	3,210,462
未払利息	264	225	235	190	196	142
その他未払費用	37,947	40,001	34,865	32,517	32,535	33,780
(C) 純資産総額(A－B)	4,263,696,397	4,008,859,602	3,732,063,302	3,570,416,801	3,597,537,777	3,894,423,846
元本	5,374,428,404	5,195,747,943	4,942,101,168	4,704,739,491	4,577,736,542	4,559,692,369
次期繰越損益金	△1,110,732,007	△1,186,888,341	△1,210,037,866	△1,134,322,690	△ 980,198,765	△ 665,268,523
(D) 受益権総口数	5,374,428,404口	5,195,747,943口	4,942,101,168口	4,704,739,491口	4,577,736,542口	4,559,692,369口
1万口当たり基準価額(C/D)	7.933円	7.716円	7.552円	7.589円	7.859円	8.541円

(注) 当ファンドの第13期首元本額は5,584,973,431円、第13～18期中追加設定元本額は356,350,901円、第13～18期中一部解約元本額は1,381,631,963円です。

(注) 各期末の元本の欠損は、第13期1,110,732,007円、第14期1,186,888,341円、第15期1,210,037,866円、第16期1,134,322,690円、第17期980,198,765円、第18期665,268,523円です。

(注) 各期末の1口当たり純資産額は、第13期0.7933円、第14期0.7716円、第15期0.7552円、第16期0.7589円、第17期0.7859円、第18期0.8541円です。

## ○損益の状況

項 目	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期
	2016年6月15日～ 2016年7月14日	2016年7月15日～ 2016年8月15日	2016年8月16日～ 2016年9月14日	2016年9月15日～ 2016年10月14日	2016年10月15日～ 2016年11月14日	2016年11月15日～ 2016年12月14日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	59,446,536	57,985,285	55,201,032	52,472,761	51,505,841	50,642,604
受取配当金	59,452,721	57,990,814	55,205,467	52,478,171	51,509,932	50,647,757
受取利息	54	227	—	230	48	—
支払利息	△ 6,239	△ 5,756	△ 4,435	△ 5,640	△ 4,139	△ 5,153
(B) 有価証券売買損益	4,367,739	△ 123,680,523	△ 91,153,808	8,193,530	114,033,159	294,909,239
売買益	7,075,589	3,097,232	797,905	9,159,420	114,548,070	303,963,454
売買損	△ 2,707,850	△ 126,777,755	△ 91,951,713	△ 965,890	△ 514,911	△ 9,054,215
(C) 信託報酬等	△ 3,633,252	△ 3,841,416	△ 3,348,609	△ 3,123,073	△ 3,124,844	△ 3,244,242
(D) 当期損益金(A+B+C)	60,181,023	△ 69,536,654	△ 39,301,385	57,543,218	162,414,156	342,307,601
(E) 前期繰越損益金	△ 982,242,906	△ 925,255,052	△ 981,268,317	△ 1,003,645,474	△ 956,125,967	△ 798,444,008
(F) 追加信託差損益金	△ 142,987,483	△ 147,932,778	△ 147,460,305	△ 148,230,149	△ 147,576,194	△ 170,374,731
(配当等相当額)	( 10,110,857)	( 10,874,800)	( 11,201,752)	( 11,499,164)	( 11,582,571)	( 16,701,429)
(売買損益相当額)	(△ 153,098,340)	(△ 158,807,578)	(△ 158,662,057)	(△ 159,729,313)	(△ 159,158,765)	(△ 187,076,160)
(G) 計(D+E+F)	△ 1,065,049,366	△ 1,142,724,484	△ 1,168,030,007	△ 1,094,332,405	△ 941,288,005	△ 626,511,138
(H) 収益分配金	△ 45,682,641	△ 44,163,857	△ 42,007,859	△ 39,990,285	△ 38,910,760	△ 38,757,385
次期繰越損益金(G+H)	△ 1,110,732,007	△ 1,186,888,341	△ 1,210,037,866	△ 1,134,322,690	△ 980,198,765	△ 665,268,523
追加信託差損益金	△ 142,987,483	△ 147,932,778	△ 147,460,305	△ 148,230,149	△ 147,576,194	△ 170,374,731
(配当等相当額)	( 10,110,860)	( 10,874,804)	( 11,201,754)	( 11,499,165)	( 11,582,571)	( 16,701,435)
(売買損益相当額)	(△ 153,098,343)	(△ 158,807,582)	(△ 158,662,059)	(△ 159,729,314)	(△ 159,158,765)	(△ 187,076,166)
分配準備積立金	103,141,619	108,594,265	112,410,073	115,957,258	124,056,837	130,374,444
繰越損益金	△ 1,070,886,143	△ 1,147,549,828	△ 1,174,987,634	△ 1,102,049,799	△ 956,679,408	△ 625,268,236

(注) (B) 有価証券売買損益は、各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (C) 信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (F) 追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) 第13期計算期間末における費用控除後の配当等収益(56,063,379円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(10,110,860円)および分配準備積立金(92,760,881円)より分配対象収益は158,935,120円(1万口当たり295円)であり、うち45,682,641円(1万口当たり85円)を分配金額としました。

(注) 第14期計算期間末における費用控除後の配当等収益(54,145,005円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(10,874,804円)および分配準備積立金(98,613,117円)より分配対象収益は163,632,926円(1万口当たり314円)であり、うち44,163,857円(1万口当たり85円)を分配金額としました。

(注) 第15期計算期間末における費用控除後の配当等収益(51,853,283円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(11,201,754円)および分配準備積立金(102,564,649円)より分配対象収益は165,619,686円(1万口当たり335円)であり、うち42,007,859円(1万口当たり85円)を分配金額としました。

(注) 第16期計算期間末における費用控除後の配当等収益(49,771,894円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(11,499,165円)および分配準備積立金(106,175,649円)より分配対象収益は167,446,708円(1万口当たり355円)であり、うち39,990,285円(1万口当たり85円)を分配金額としました。

(注) 第17期計算期間末における費用控除後の配当等収益(50,534,188円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(11,582,571円)および分配準備積立金(112,433,409円)より分配対象収益は174,550,168円(1万口当たり381円)であり、うち38,910,760円(1万口当たり85円)を分配金額としました。

(注) 第18期計算期間末における費用控除後の配当等収益(50,167,434円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(16,701,435円)および分配準備積立金(118,964,395円)より分配対象収益は185,833,264円(1万口当たり407円)であり、うち38,757,385円(1万口当たり85円)を分配金額としました。

## ○分配金のお知らせ

	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期
1万口当たり分配金(税込み)	85円	85円	85円	85円	85円	85円

◇分配金をお支払いする場合：分配金は、各決算日より起算して5営業日までにお支払いを開始しました。

◇分配金を再投資する場合：お手取り分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資しました。

◇課税上の取扱いについて

- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、分配金は全額普通分配金となります。
  - ・分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。
  - ・分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合は、分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。
  - ・元本払戻金(特別分配金)が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
  - ・個人の受益者に対する課税は以下のとおりです。(法人の受益者の場合は取扱いが異なります。)
- 収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315% (所得税15.315%、地方税5%)の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。収益分配金のうち課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金(特別分配金)は課税されません。

税制改正等により、課税上の取扱い内容が変更になる場合があります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家にご確認ください。

## ○ (参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2016年12月14日現在)

## 〈東京海上マネープールマザーファンド〉

下記は、東京海上マネープールマザーファンド全体(75,632千口)の内容です。

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	第18期末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	65,780 (65,780)	65,865 (65,865)	86.8 (86.8)	— (—)	— (—)	— (—)	86.8 (86.8)
合 計	65,780 (65,780)	65,865 (65,865)	86.8 (86.8)	— (—)	— (—)	— (—)	86.8 (86.8)

(注) ( )内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

## (B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	第18期末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
平成25年度第11回北海道公募公債(3年)	0.18	20,000	19,999	2016/12/27
平成18年度第8回静岡県公募公債	1.79	10,000	10,051	2017/3/28
平成18年度第2回広島県公募公債	1.9	14,000	14,034	2017/1/30
平成23年度第3回千葉市公募公債	0.44	21,780	21,780	2016/12/26
合 計		65,780	65,865	

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

〈参考情報〉

ノース・アメリカン・エクイティ・インカム・カバード・コール・ストラテジー・ファンド (Wプレミアムクラス)  
(外国投資信託 ケイマン諸島籍) の運用状況

ノース・アメリカン・エクイティ・インカム・カバード・コール・ストラテジー・ファンド (Wプレミアムクラス) は、「東京海上・米国高配当成長株式ファンド (Wプレミアムコース) (毎月決算型)」が投資対象とする外国投資信託証券です。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

形態	ケイマン諸島籍契約型外国投資信託／円建て
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として米国の金融商品取引所に上場されている株式 (DR (預託証券) を含みます。以下同じ。) の中から、継続的に高い配当成長が見込めると考える米国企業の株式に投資し、インカムゲインの確保と信託財産の成長をめざして運用を行います。</li> <li>・運用目的を達成するために、米国以外の株式に投資する場合があります。</li> <li>・個別銘柄ごとに保有株数 (または保有口数) の全部または一部にかかるコール・オプションおよび円に対する米ドルのコール・オプションを売却するカバード・コール戦略を活用することにより、プレミアム収入の獲得をめざします。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・純資産総額の10%を超える借入れは行わないものとします。</li> <li>・同一発行体への投資割合は、原則として純資産総額の10%以下とします。</li> </ul>
収益分配	原則として、毎月分配を行います。
決算日	毎年10月31日
信託報酬等	<p>ファンドの純資産総額に対し年率0.9%を乗じて得た額が管理会社、投資顧問会社および副投資顧問会社への報酬の合計額としてファンドから支払われます。またファンドの純資産総額に対し年率0.01%を乗じて得た額 (ただし、その額が年額10,000米ドルに満たない場合は、10,000米ドルとします。) が受託会社への報酬としてファンドから支払われます。この他、ファンドの純資産総額に対し年率0.09%を乗じて得た額 (ただし、その額が年額50,000米ドルに満たない場合は、50,000米ドルとします。) が組入有価証券の保管に要する費用および信託事務等に要する費用として保管銀行および事務代行会社への報酬の合計額としてファンドから支払われます。またこの他に、ファンドは、ファンドの設立に係る費用 (ファンドの設定後3年間にわたり償却)、組入有価証券の売買委託手数料等の取引に要する費用、オプション取引に要する費用、信託財産に関する租税、監査報酬、法的費用等を負担します。</p>
関係法人	<p>管理会社、投資顧問会社：シティグループ・ファースト・インベストメント・マネジメント・リミテッド                      受託会社：CIBC・バンク・アンド・トラスト・カンパニー (ケイマン) リミテッド                      副投資顧問会社：ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エル・エル・シー                      保管銀行、事務代行会社：シティバンク・エヌ・エイ 香港支店</p>

※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。

## (1) 損益計算書

2015年5月27日  
～2015年10月31日

	(千円)
受取利息	2
配当金	41,860
評価損益	(100,741)
外国為替差損	(7,758)
<b>収益合計</b>	<b>(66,637)</b>
投資顧問料	(16,476)
事務管理報酬、名義書換代行報酬および保管費用	(4,933)
監査報酬	(4,869)
設立費用	(4,875)
受託費用	(438)
仲介手数料	(114)
支払利息	(22)
雑費用	(16)
<b>費用合計</b>	<b>(31,743)</b>
<b>投資純損失</b>	<b>(98,380)</b>
源泉徴収税	(11,841)
<b>税引き後損失</b>	<b>(110,221)</b>
分配金	(183,257)
<b>運用の結果による純資産の増減額</b>	<b>(293,478)</b>

(2) 組入有価証券の明細

2015年10月31日現在

国名	銘柄	評価額 (邦貨換算金額)	組入比率
アメリカ		円	%
	JPMORGAN CHASE & CO	225,610,891	3.9
	WELLS FARGO & CO	208,616,860	3.6
	PFIZER INC	186,003,627	3.2
	GENERAL ELECTRIC CO	177,925,671	3.1
	CITIGROUP INC	173,234,960	3.0
	EXXON MOBIL CORP	145,634,852	2.5
	INTEL CORP	134,596,198	2.3
	HOME DEPOT INC	132,242,859	2.3
	MICROSOFT CORP	131,930,887	2.3
	UNITEDHEALTH GROUP INC	121,814,048	2.1
	RAYTHEON COMPANY	116,694,888	2.0
	MERCK & CO. INC.	115,258,168	2.0
	SUNTRUST BANKS INC	101,672,084	1.8
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	100,859,513	1.7
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	98,084,655	1.7
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	96,985,188	1.7
	TRAVELERS COS INC/THE	95,849,582	1.7
	JOHNSON & JOHNSON	95,783,721	1.6
	US BANCORP	91,209,959	1.6
	DOLLAR GENERAL CORP	88,036,332	1.5
	NORTHROP GRUMMAN CORP	87,679,522	1.5
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	87,432,086	1.5
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	83,979,996	1.4
	BANK OF AMERICA CORP	83,867,165	1.4
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	83,175,928	1.4
	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	77,574,123	1.3
	LOCKHEED MARTIN CORP	76,936,938	1.3
	METLIFE INC	75,976,237	1.3
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	75,479,042	1.3
	KROGER CO	74,114,981	1.3
	QUALCOMM INC	73,265,487	1.3
	NEXTERA ENERGY INC	64,730,566	1.1
	MARATHON PETROLEUM CORP	64,617,107	1.1
	MORGAN STANLEY	63,058,325	1.1
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	62,797,135	1.1
	DOMINION RESOURCES INC/VA	60,276,563	1.0
	COCA-COLA CO/THE	59,922,204	1.0
	CHEVRON CORP	59,455,451	1.0
	DOW CHEMICAL CO/THE	56,690,455	1.0
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	56,588,067	1.0
	ORACLE CORP	56,442,941	1.0
	CME GROUP INC	52,516,502	0.9
	QUEST DIAGNOSTICS INC	51,643,398	0.9
	MCDONALD'S CORP	51,024,033	0.9
	GAP INC/THE	50,887,423	0.9
	INTERNATIONAL PAPER CO	49,410,617	0.9
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	48,515,914	0.8
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	47,365,507	0.8
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	46,215,792	0.8
	REYNOLDS AMERICAN INC	42,914,241	0.7

国名	銘柄	評価額 (邦貨換算金額)	組入比率
アメリカ		円	%
	ANHEM INC	42,633,608	0.7
	ALTRIA GROUP INC	40,995,601	0.7
	BECTON DICKINSON AND CO	34,528,263	0.6
	UNION PACIFIC CORP	33,774,033	0.6
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	33,469,971	0.6
	PRAXAIR INC	32,452,686	0.6
	CMS ENERGY CORP	31,181,442	0.5
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	28,329,952	0.5
	NIELSEN HOLDINGS PLC	28,172,021	0.5
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	27,610,234	0.5
	SCHLUMBERGER LTD	26,691,024	0.5
	ABBVIE INC	26,476,848	0.5
	WEC ENERGY GROUP INC	26,411,554	0.5
	EXELON CORP	25,975,450	0.4
	3M CO	25,889,944	0.4
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	24,549,789	0.4
	WEYERHAEUSER CO	23,286,783	0.4
	TYCO INTERNATIONAL PLC	23,023,970	0.4
	CONOCOPHILLIPS	22,539,483	0.4
	ABBOTT LABORATORIES	22,140,714	0.4
	MARATHON OIL CORP	21,685,276	0.4
	AMERICAN EXPRESS CO	21,605,403	0.4
	ROCKWELL AUTOMATION INC	20,647,009	0.4
	SPECTRA ENERGY CORP	19,913,882	0.3
	ITC HOLDINGS CORP	14,291,494	0.2
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	12,088,624	0.2
	NVIDIA CORP	2,903,833	0.1
小計 (金額・比率)		5,255,867,580	90.5
イギリス			
	DIAGEO PLC-SPONSORED ADR	44,027,979	0.8
	ASTRAZENECA PLC	27,993,375	0.5
	UNILEVER N V -NY SHARES	12,437,664	0.2
小計 (金額・比率)		84,459,018	1.5
フランス			
	TOTAL SA-SPON ADR	80,173,739	1.4
小計 (金額・比率)		80,173,739	1.4
韓国			
	SAMSUNG ELECTR-GDR	50,413,633	0.9
	SK TELECOM CO LTD-SPON ADR	27,085,298	0.5
小計 (金額・比率)		77,498,931	1.3
オーストラリア			
	BHP BILLITON LTD-SPON ADR	17,479,924	0.3
小計 (金額・比率)		17,479,924	0.3
カナダ			
	BCE INC	16,388,307	0.3
小計 (金額・比率)		16,388,307	0.3
中国			
	LENOVO GROUP LTD	14,386,494	0.2
小計 (金額・比率)		14,386,494	0.2
合計 (金額・比率)		5,546,253,993	95.5

(注) シティグループ・ファースト・インベストメント・マネジメント・リミテッドが提供する情報を基に作成しています。

(注) 組入比率は、保有する現物株式の純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 国名は、Bloomberg上の法人所在国を表示しています。

## 東京海上マネープールマザーファンド

## 運用報告書 第6期(決算日 2016年10月25日)

(計算期間 2015年10月27日～2016年10月25日)

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド(親投資信託)の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

## 東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		参考	指数		債組入比率	純資産額
	騰落	中率		騰落	中率		
	円	%		%	%	百万円	
2期(2012年10月25日)	10,018	0.1	100.15	0.1	91.6	10	
3期(2013年10月25日)	10,027	0.1	100.23	0.1	84.3	59	
4期(2014年10月27日)	10,032	0.0	100.30	0.1	83.2	72	
5期(2015年10月26日)	10,034	0.0	100.37	0.1	85.5	128	
6期(2016年10月25日)	10,035	0.0	100.37	△0.0	107.0	69	

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考	指数		債組入比率
	騰落	率		騰落	率	
(期首)	円	%		%	%	
2015年10月26日	10,034	—	100.37	—	85.5	
10月末	10,034	0.0	100.37	0.0	119.8	
11月末	10,034	0.0	100.38	0.0	53.1	
12月末	10,034	0.0	100.38	0.0	57.9	
2016年1月末	10,034	0.0	100.39	0.0	77.0	
2月末	10,034	0.0	100.39	0.0	77.9	
3月末	10,035	0.0	100.39	0.0	60.6	
4月末	10,035	0.0	100.39	0.0	65.8	
5月末	10,034	0.0	100.38	0.0	77.8	
6月末	10,036	0.0	100.38	0.0	97.7	
7月末	10,035	0.0	100.38	0.0	90.5	
8月末	10,036	0.0	100.37	0.0	86.8	
9月末	10,035	0.0	100.37	△0.0	86.7	
(期末)						
2016年10月25日	10,035	0.0	100.37	△0.0	107.0	

(注) 騰落率は期首比です。

参考指数は、無担保コール翌日物金利です。無担保コール翌日物金利は、設定日を100として指数化したものです。

## ○運用経過

(2015年10月27日～2016年10月25日)

## ■期中の基準価額等の推移

期首：10,034円

期末：10,035円

騰落率：0.0%

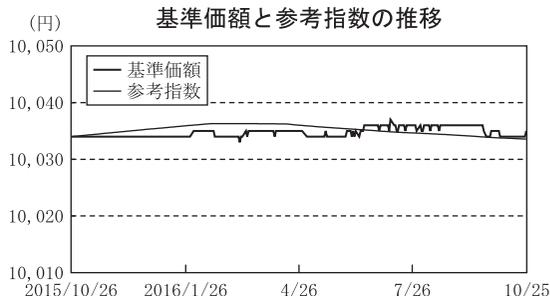
## ◇基準価額の変動要因

プラス要因

安定した利息収入の獲得

マイナス要因

保有していた地方債の一時的な評価損



## ■投資環境

2016年1月末に日銀が当座預金残高の一部にマイナス金利を適用したことを主因に、短期金融市場の金利はマイナス金利となりました。

また、9月21日以降は日銀が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を導入しましたが、短期金融市場の金利への影響は限定的で、引き続きマイナス圏で推移しました。金融緩和の度合いを知る上で着目する日銀の当座預金残高は、240兆円台半ばから310兆円程度へ大きく拡大しており、短期金融市場の資金余剰感は非常に強くなりました。

このような状況下、無担保コール翌日物金利は0.08%程度から-0.08%程度へと低下し、期末は-0.04%程度となりました。また、3カ月物の短期国債利回りは、0%程度から-0.4%程度へと低下し、期末は-0.3%程度となりました。

## ■ポートフォリオについて

元本の安全性と流動性を重視し、短期の国債や政府保証債、地方債等に投資して安定的な収益の確保に努めました。その結果、基準価額はおおむね安定的に推移しました。

## ○今後の運用方針

国内の短期金利は、日銀が当面は緩和的な政策を継続するとの見方から、マイナス水準にとどまると予想しています。

このような環境下、政府保証債や地方債を中心とする円建て公社債およびコマーシャル・ペーパーを主要投資対象として運用することにより、プラスの収益の確保もしくはマイナス幅を極力最小化するように努める方針です。

## ○1万口当たりの費用明細

(2015年10月27日～2016年10月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 ( そ の 他 )	円 0 (0)	% 0.001 (0.001)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 *その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、10,034円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## ○売買及び取引の状況

(2015年10月27日～2016年10月25日)

公社債
-----

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	356,145	26,006 (440,000)
	地方債証券	313,432	68,040 (170,750)
	特殊債券	53,219	— ( 53,000)

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれていません)

(注) ( ) 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

## ○利害関係人との取引状況等

(2015年10月27日～2016年10月25日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。
-----------------------------------------------

## ○組入資産の明細

(2016年10月25日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
地方債証券	千円 74,000 (74,000)	千円 74,073 (74,073)	% 107.0 (107.0)	% — (—)	% — (—)	% — (—)	% 107.0 (107.0)
合 計	74,000 (74,000)	74,073 (74,073)	107.0 (107.0)	— (—)	— (—)	— (—)	107.0 (107.0)

(注) ( ) 内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

## (B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期			末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
地方債証券	%	千円	千円		
平成25年度第11回北海道公募公債(3年)	0.18	20,000	19,997	2016/12/27	
第295回大阪府公募公債(10年)	1.9	20,000	20,003	2016/10/28	
第77回大阪府公募公債(5年)	0.42	20,000	20,000	2016/10/28	
平成18年度第2回広島県公募公債	1.9	14,000	14,072	2017/1/30	
合 計		74,000	74,073		

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

## ○投資信託財産の構成

(2016年10月25日現在)

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比	率	
公社債	千円 74,073	% 88.9		
コール・ローン等、その他	9,218	11.1		
投資信託財産総額	83,291	100.0		

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年10月25日現在)

項 目	当 期 末 円
(A) 資産	83,291,660
コール・ローン等	8,979,481
公社債(評価額)	74,073,640
未収利息	80,141
前払費用	158,398
(B) 負債	14,067,356
未払金	14,067,340
未払利息	16
(C) 純資産総額(A-B)	69,224,304
元本	68,982,638
次期繰越損益金	241,666
(D) 受益権総口数	68,982,638口
1万円当たり基準価額(C/D)	10,035円

(注) 当親ファンドの期首元本額は128,283,891円、期中追加設定元本額は316,360,381円、期中一部解約元本額は375,661,634円です。

(元本の内訳)

東京海上J-REIT投信(通貨選択型) マナープール・ファンド(年2回決算型)	56,950,035円
東京海上J-REIT投信(通貨選択型) ブラジルリアルコース(毎月分配型)	2,999,301円
東京海上J-REIT投信(通貨選択型) 円コース(毎月分配型)	1,000,000円
東京海上J-REIT投信(通貨選択型) 円コース(年2回決算型)	1,000,000円
東京海上J-REIT投信(通貨選択型) 豪ドルコース(毎月分配型)	1,000,000円
東京海上J-REIT投信(通貨選択型) 豪ドルコース(年2回決算型)	1,000,000円
東京海上J-REIT投信(通貨選択型) ブラジルリアルコース(年2回決算型)	1,000,000円
東京海上J-REIT投信(通貨選択型) インドネシアルピアコース(毎月分配型)	1,000,000円
東京海上J-REIT投信(通貨選択型) インドネシアルピアコース(年2回決算型)	1,000,000円
東京海上・米国高配当成長株式ファンド(Wプレミアムコース)(毎月決算型)	996,711円
東京海上・米国高配当成長株式ファンド(プレーンコース)(年2回決算型)	996,711円
東京海上J-REIT投信(通貨選択型) 米ドルコース(毎月分配型)	9,970円
東京海上J-REIT投信(通貨選択型) 米ドルコース(年2回決算型)	9,970円
東京海上J-REIT投信(通貨選択型) メキシコペソコース(毎月分配型)	9,970円
東京海上J-REIT投信(通貨選択型) メキシコペソコース(年2回決算型)	9,970円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.0035円です。

## ○損益の状況 (2015年10月27日～2016年10月25日)

項 目	当 期 円
(A) 配当等収益	937,813
受取利息	946,677
支払利息	△ 8,864
(B) 有価証券売買損益	△ 928,212
売買益	5,160
売買損	△ 933,372
(C) 保管費用等	△ 1,340
(D) 当期損益金(A+B+C)	8,261
(E) 前期繰越損益金	431,057
(F) 追加信託差損益金	1,099,579
(G) 解約差損益金	△ 1,297,231
(H) 計(D+E+F+G)	241,666
次期繰越損益金(H)	241,666

(注) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (F)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) (G)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。

## ○お知らせ

2016年1月26日付で、信用リスクを適正に管理するため、所要の約款変更を行いました。