

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「東京海上マネープールマザーファンド」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(預託証書)を含みます。)を主要投資対象とします。
	東京海上マネープールマザーファンド	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)	・株式への直接投資は行いません。 ・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ・投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
	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)	・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。 ・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。
	東京海上マネープールマザーファンド	・株式への投資は行いません。 ・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。
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37期	(決算日	2018年7月17日)
第38期	(決算日	2018年8月14日)
第39期	(決算日	2018年9月14日)
第40期	(決算日	2018年10月15日)
第41期	(決算日	2018年11月14日)
第42期	(決算日	2018年12月14日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。
さて、「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)＜愛称 イーグルハイ＞」は、このたび、第42期の決算を行いましたので、第37期～第42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
受付時間：営業日の9時～17時
<https://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。

○最近30期の運用実績

決 算 期	基 (分配落)	準 税 分	価 達 配	額 み 金	期 騰 落	中 率	債 組 入 比	券 率	投 証 組	資 入 比	信 託 券 率	純 資 産 額
	円			円		%		%			%	百万円
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
19期(2017年1月16日)	8,412			85		△0.5		0.0			98.9	3,553
20期(2017年2月14日)	8,375			85		0.6		0.0			98.8	3,490
21期(2017年3月14日)	8,452			85		1.9		0.0			98.0	3,216
22期(2017年4月14日)	7,912			85		△5.4		0.0			97.7	2,840
23期(2017年5月15日)	8,248			85		5.3		0.0			98.1	2,915
24期(2017年6月14日)	8,146			85		△0.2		0.0			96.2	2,782
25期(2017年7月14日)	8,283			85		2.7		0.0			98.7	2,507
26期(2017年8月14日)	7,949			85		△3.0		0.0			98.7	2,260
27期(2017年9月14日)	8,090			85		2.8		0.0			98.4	2,210
28期(2017年10月16日)	8,196			85		2.4		0.0			98.0	1,947
29期(2017年11月14日)	8,212			85		1.2		0.0			98.8	1,711
30期(2017年12月14日)	8,265			85		1.7		0.0			98.9	1,531
31期(2018年1月15日)	8,259			85		1.0		0.1			95.3	1,512
32期(2018年2月14日)	7,604			85		△6.9		0.1			96.6	1,296
33期(2018年3月14日)	7,577			85		0.8		0.1			98.7	1,260
34期(2018年4月16日)	7,387			85		△1.4		0.1			96.1	1,185
35期(2018年5月14日)	7,488			85		2.5		0.1			97.2	1,184
36期(2018年6月14日)	7,449			85		0.6		0.1			97.6	1,149
37期(2018年7月17日)	7,489			85		1.7		0.1			98.6	1,100
38期(2018年8月14日)	7,358			85		△0.6		0.1			99.1	1,053
39期(2018年9月14日)	7,447			85		2.4		0.1			97.1	1,047
40期(2018年10月15日)	7,115			85		△3.3		0.1			97.1	999
41期(2018年11月14日)	7,032			85		0.0		0.1			97.2	986
42期(2018年12月14日)	6,811			85		△1.9		0.1			97.2	954

(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。

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	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 証 書 組 入 比 率
			騰 落 率		
第37期	(期 首) 2018年 6 月14日	円 7,449	% —	% 0.1	% 97.6
	6 月末	7,331	△1.6	0.1	99.2
	(期 末) 2018年 7 月17日	7,574	1.7	0.1	98.6
第38期	(期 首) 2018年 7 月17日	7,489	—	0.1	98.6
	7 月末	7,516	0.4	0.1	99.0
	(期 末) 2018年 8 月14日	7,443	△0.6	0.1	99.1
第39期	(期 首) 2018年 8 月14日	7,358	—	0.1	99.1
	8 月末	7,545	2.5	0.1	97.8
	(期 末) 2018年 9 月14日	7,532	2.4	0.1	97.1
第40期	(期 首) 2018年 9 月14日	7,447	—	0.1	97.1
	9 月末	7,579	1.8	0.1	97.2
	(期 末) 2018年10月15日	7,200	△3.3	0.1	97.1
第41期	(期 首) 2018年10月15日	7,115	—	0.1	97.1
	10月末	6,994	△1.7	0.1	97.2
	(期 末) 2018年11月14日	7,117	0.0	0.1	97.2
第42期	(期 首) 2018年11月14日	7,032	—	0.1	97.2
	11月末	7,135	1.5	0.1	96.6
	(期 末) 2018年12月14日	6,896	△1.9	0.1	97.2

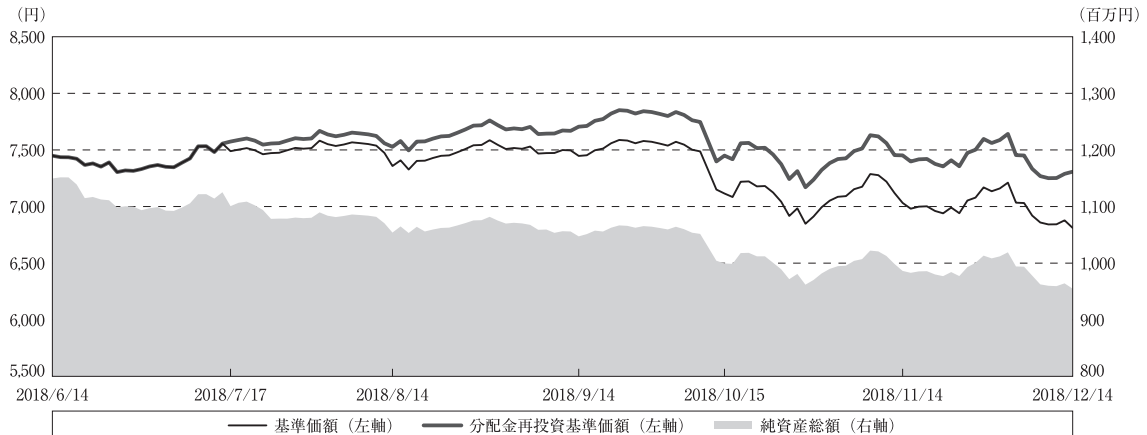
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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。

○運用経過

(2018年6月15日～2018年12月14日)

■作成期間中の基準価額等の推移



第37期首：7,449円

第42期末：6,811円 (既払分配金(税込み):510円)

騰落率：△ 1.9% (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す。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、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(2018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

- ・FRB(米連邦準備制度理事会)の利上げ姿勢を背景に米国の長期金利が上昇し、円安米ドル高が進行したこと
- ・株式および通貨オプション・プレミアムの獲得

マイナス要因

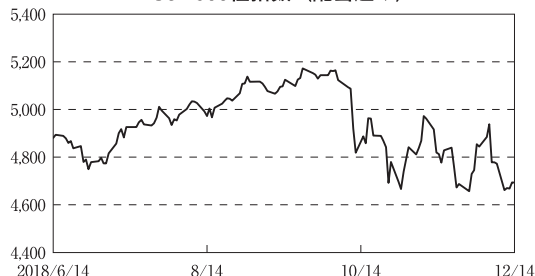
- ・米中貿易摩擦や世界的な景気減速懸念による米国株式市場の下落
- ・円安米ドル高の進行による通貨オプションの評価損

■投資環境

【米国株式市場】

当作成期の米国株式市場は下落しました。当作成期の前半は、堅調な米国の経済指標や企業業績を背景に米国株式市場は上昇基調を維持しました。しかし、当作成期の後半は欧州の政治的な不透明感や中東情勢の緊張に加えて、米中貿易摩擦や世界的な景気減速により投資家の警戒感が強まったことから、米国株式市場は前作成期末対比で下落して当作成期を終えました。

S&P500種指数（配当込み）



【為替市況】

当作成期の為替市場は円安米ドル高となりました。当作成期の前半は、米中貿易摩擦やトランプ米大統領の米ドル高を懸念する発言が米ドル安要因となりましたが、米国の主要経済指標や株式市場が堅調に推移したことにより、円安米ドル高が進行しました。その後は、トルコ・リラの急落などを背景に投資家のリスク回避姿勢が強まり、一時的に円高となる局面はあったものの、FRBの利上げ姿勢の継続を背景に米国の長期金利は上昇基調となったことから、円安米ドル高となりました。

(円／米ドル) 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で記載しています。

■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「東京海上マネーブルマザーファンド」(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、1.9%下落しました。

<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狙いつつ、投資を行いました。当作成期は、ヘルスケアや電気通信・サービスセクターの銘柄がプラス寄与した一方、利ざや縮小が嫌気された金融セクターや、原油価格の下落に伴い、資本財サービスやエネルギーセクターの銘柄がマイナス寄与しました。

当作成期の主な売買としては、バリュエーション(投資価値を測るための指標)が魅力的で、長期的な成長と利益率の拡大が見込まれると考えたNOVARTIS AG-SPONSORED ADRを新規購入しました。

一方、2017年から2018年にかけて良好なパフォーマンスであったAETNA INCは、バリュエーションが適正と考える水準に到達したことから全売却しました。

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%で運用しました。

当作成期は、為替市場で円安米ドル高が進行したことがプラスに寄与したものの、保有する米国株式が下落したことがマイナス寄与し、基準価額(分配金再投資)は下落しました。

【組入銘柄の概要（2018年11月末現在）】

組入上位 5 カ国

	国 名	比率 (%)
1	アメリカ	71.7
2	イギリス	5.9
3	カナダ	2.8
4	アイルランド	2.0
5	オランダ	1.9

組入上位 5 業種

	業種名	比率 (%)
1	金融	23.9
2	ヘルスケア	19.9
3	エネルギー	10.5
4	情報技術	10.3
5	生活必需品	6.0

組入上位10銘柄

	銘柄名	国名	業種名	比率 %
1	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	コミュニケーション・サービス	4.0
2	PFIZER INC	アメリカ	ヘルスケア	4.0
3	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	金融	3.8
4	WELLS FARGO & CO	アメリカ	金融	3.4
5	CITIGROUP INC	アメリカ	金融	3.0
6	ANTHEM INC	アメリカ	ヘルスケア	2.9
7	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	金融	2.8
8	ORACLE CORP	アメリカ	情報技術	2.4
9	MICROSOFT CORP	アメリカ	情報技術	2.3
10	SUNCOR ENERGY INC	カナダ	エネルギー	2.1
組入銘柄数		86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GICS（世界産業分類基準）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37期	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期
	2018年6月15日～ 2018年7月17日	2018年7月18日～ 2018年8月14日	2018年8月15日～ 2018年9月14日	2018年9月15日～ 2018年10月15日	2018年10月16日～ 2018年11月14日	2018年11月15日～ 2018年12月14日
当期分配金 (対基準価額比率)	85 1.122%	85 1.142%	85 1.129%	85 1.181%	85 1.194%	85 1.233%
当期の収益	85	85	85	84	84	84
当期の収益以外	—	—	—	0	0	0
翌期繰越分配対象額	755	773	776	775	775	774

(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＞

2019年の米国経済について緩やかな拡大が継続するとの見方を維持しますが、米中貿易摩擦や世界的な景気後退懸念などのリスク要因が投資家心理に与える影響度は従前より高まっていると考えます。このような環境下、米国株式市場においては、米国の堅調な経済指標と企業業績が株価の上昇要因となる一方、貿易摩擦や金融引き締めなどがマイナス要因になると想定します。

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

(2018年 6 月15日～2018年12月14日)

項 目	第37期～第42期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 38	% 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)	(13)	(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)	(24)	(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
合 計	38	0.519	
作成期間の平均基準価額は、7,350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

(2018年 6 月15日～2018年12月14日)

投資信託証券

銘 柄			第37期～第42期			
			買 付		売 付	
			口 数	金 額	口 数	金 額
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)	千口 —	千円 —	千口 14	千円 100,000

(注) 金額は受渡代金です。

○利害関係人との取引状況等

(2018年6月15日～2018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

(2018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36期末	第42期末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
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)	千口 165	千口 150	千円 927,732	% 97.2
合 計	165	150	927,732	97.2

(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36期末	第42期末	
	口 数	口 数	評 価 額
東京海上マネープールマザーファンド	千口 996	千口 996	千円 1,000

○投資信託財産の構成

(2018年12月14日現在)

項 目	第42期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 927,732	% 95.8
東京海上マネープールマザーファンド	1,000	0.1
コール・ローン等、その他	39,721	4.1
投資信託財産総額	968,453	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第37期末	第38期末	第39期末	第40期末	第41期末	第42期末
	2018年7月17日現在	2018年8月14日現在	2018年9月14日現在	2018年10月15日現在	2018年11月14日現在	2018年12月14日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	1,128,916,011	1,069,099,333	1,062,805,021	1,012,322,014	999,056,982	968,453,371
コール・ローン等	42,334,645	23,820,925	44,858,758	40,784,907	39,234,807	39,720,825
投資信託受益証券(評価額)	1,085,581,067	1,044,278,109	1,016,946,263	970,537,107	958,822,175	927,732,546
東京海上マネープールマザーファンド(評価額)	1,000,299	1,000,299	1,000,000	1,000,000	1,000,000	1,000,000
(B) 負債	28,216,036	15,124,090	15,500,805	12,866,472	12,773,922	13,584,159
未払収益分配金	12,493,433	12,175,484	11,954,321	11,939,480	11,922,346	11,916,559
未払解約金	14,677,366	2,084,361	2,608,581	—	—	826,344
未払信託報酬	1,034,252	855,206	928,021	917,266	842,616	832,398
未払利息	118	49	129	86	102	109
その他未払費用	10,867	8,990	9,753	9,640	8,858	8,749
(C) 純資産総額(A－B)	1,100,699,975	1,053,975,243	1,047,304,216	999,455,542	986,283,060	954,869,212
元本	1,469,815,648	1,432,409,964	1,406,390,821	1,404,644,804	1,402,629,023	1,401,948,227
次期繰越損益金	△ 369,115,673	△ 378,434,721	△ 359,086,605	△ 405,189,262	△ 416,345,963	△ 447,079,015
(D) 受益権総口数	1,469,815,648口	1,432,409,964口	1,406,390,821口	1,404,644,804口	1,402,629,023口	1,401,948,227口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,489円	7,358円	7,447円	7,115円	7,032円	6,811円

(注) 当ファンドの第37期首元本額は1,543,310,526円、第37～42期中追加設定元本額は43,572,600円、第37～42期中一部解約元本額は184,934,899円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況

項 目	第37期	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期
	2018年6月15日～ 2018年7月17日	2018年7月18日～ 2018年8月14日	2018年8月15日～ 2018年9月14日	2018年9月15日～ 2018年10月15日	2018年10月16日～ 2018年11月14日	2018年11月15日～ 2018年12月14日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	15,901,372	15,584,264	12,857,023	12,755,190	12,754,889	12,665,711
受取配当金	15,903,886	15,585,550	12,858,766	12,757,618	12,757,369	12,668,521
受取利息	—	8	79	109	—	20
支払利息	△ 2,514	△ 1,294	△ 1,822	△ 2,537	△ 2,480	△ 2,830
(B) 有価証券売買損益	3,575,753	△ 21,257,266	12,508,920	△ 46,437,411	△ 11,718,499	△ 30,855,005
売買益	4,163,775	77,061	12,665,624	△ 57	29,754	234,624
売買損	△ 588,022	△ 21,334,327	△ 156,704	△ 46,437,354	△ 11,748,253	△ 31,089,629
(C) 信託報酬等	△ 1,045,119	△ 864,196	△ 937,774	△ 926,906	△ 851,474	△ 841,147
(D) 当期損益金(A+B+C)	18,432,006	△ 6,537,198	24,428,169	△ 34,609,127	184,916	△ 19,030,441
(E) 前期繰越損益金	△297,603,299	△283,236,609	△295,419,777	△281,773,741	△326,643,793	△335,648,870
(F) 追加信託差損益金	△ 77,450,947	△ 76,485,430	△ 76,140,676	△ 76,866,914	△ 77,964,740	△ 80,483,145
(配当等相当額)	(12,101,887)	(12,135,100)	(12,255,882)	(12,521,885)	(12,858,467)	(13,580,111)
(売買損益相当額)	(△ 89,552,834)	(△ 88,620,530)	(△ 88,396,558)	(△ 89,388,799)	(△ 90,823,207)	(△ 94,063,256)
(G) 計(D+E+F)	△356,622,240	△366,259,237	△347,132,284	△393,249,782	△404,423,617	△435,162,456
(H) 収益分配金	△ 12,493,433	△ 12,175,484	△ 11,954,321	△ 11,939,480	△ 11,922,346	△ 11,916,559
次期繰越損益金(G+H)	△369,115,673	△378,434,721	△359,086,605	△405,189,262	△416,345,963	△447,079,015
追加信託差損益金	△ 77,450,947	△ 76,485,430	△ 76,140,676	△ 76,866,914	△ 77,964,740	△ 80,483,145
(配当等相当額)	(12,101,887)	(12,135,100)	(12,255,882)	(12,521,885)	(12,858,467)	(13,580,111)
(売買損益相当額)	(△ 89,552,834)	(△ 88,620,530)	(△ 88,396,558)	(△ 89,388,799)	(△ 90,823,207)	(△ 94,063,256)
分配準備積立金	98,948,876	98,634,229	96,929,094	96,416,620	95,905,041	95,038,925
繰越損益金	△390,613,602	△400,583,520	△379,875,023	△424,738,968	△434,286,264	△461,634,795

(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) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	第37期	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期
	2018年6月15日～ 2018年7月17日	2018年7月18日～ 2018年8月14日	2018年8月15日～ 2018年9月14日	2018年9月15日～ 2018年10月15日	2018年10月16日～ 2018年11月14日	2018年11月15日～ 2018年12月14日
a. 配当等収益(費用控除後)	15,048,253円	14,720,124円	12,382,107円	11,828,563円	11,903,699円	11,824,854円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	12,101,887円	12,135,100円	12,255,882円	12,521,885円	12,858,467円	13,580,111円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	96,394,056円	96,089,589円	96,501,308円	96,527,537円	95,923,688円	95,130,630円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	123,544,196円	122,944,813円	121,139,297円	120,877,985円	120,685,854円	120,535,595円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	840円	858円	861円	860円	860円	859円
g. 分配金	12,493,433円	12,175,484円	11,954,321円	11,939,480円	11,922,346円	11,916,559円
h. 分配金(1万口当たり)	85円	85円	85円	85円	85円	85円

○分配金のお知らせ

	第37期	第38期	第39期	第40期	第41期	第42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

- (注) 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。
- (注) 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。
- (注) 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。
- (注) 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。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2018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(126,718千円)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42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	千円	%	%	%	%	%
	82,000	82,014	64.5	—	—	—	64.5
	(82,000)	(82,014)	(64.5)	(—)	(—)	(—)	(64.5)
特殊債券 (除く金融債)	27,000	27,002	21.2	—	—	—	21.2
	(27,000)	(27,002)	(21.2)	(—)	(—)	(—)	(21.2)
合 計	109,000	109,017	85.7	—	—	—	85.7
	(109,000)	(109,017)	(85.7)	(—)	(—)	(—)	(85.7)

(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42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27年度第11回北海道公募公債 (3年)	0.12	15,000	14,998	2018/12/25	
第103回大阪府公募公債 (5年)	0.184	40,000	40,013	2019/2/27	
平成25年度第8回福岡県公募公債	0.27	20,000	19,999	2018/12/25	
第39回川崎市公募公債 (5年)	0.209	7,000	7,003	2019/3/20	
小 計		82,000	82,014		
特殊債券(除く金融債)					
第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	1.4	27,000	27,002	2018/12/17	
小 計		27,000	27,002		
合 計		109,000	109,017		

(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	・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。 ・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。 ・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。
主な投資制限	・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。 ・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。
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	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。
関 係 法 人	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

※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

	2016年11月1日 ～2017年10月31日
	(千円)
受取利息	3
配当金	77,720
評価益	665,857
外国為替差益	13,209
利益合計	756,789
投資顧問料	(25,786)
事務管理報酬、名義書換代行報酬および保管費用	(20,735)
監査報酬	(4,522)
受託費用	(1,265)
支払利息	(14)
財務諸表作成費用	(801)
雑費用	(372)
費用合計	(53,495)
税引前投資純利益	703,294
源泉徴収税	(20,583)
運用の結果による純資産の増減額	682,711

(2) 組入有価証券の明細

2017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	68,255,925	3.8
	BANK OF AMERICA CORP	66,665,489	3.7
	CITIGROUP INC	64,262,660	3.6
	PFIZER INC	63,325,158	3.5
	ORACLE CORP	51,907,002	2.9
	WELLS FARGO & CO	49,600,513	2.8
	ANTHEM INC	42,503,028	2.4
	DOWDUPONT INC	39,106,195	2.2
	AETNA INC	37,149,770	2.1
	MICROSOFT CORP	36,980,721	2.1
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	31,754,794	1.8
	MORGAN STANLEY	30,637,606	1.7
	CHEVRON CORP	29,610,453	1.7
	MERCK & CO. INC.	28,169,066	1.6
	NORTHROP GRUMMAN CORP	27,518,760	1.5
	METLIFE INC	27,409,154	1.5
	NEXTERA ENERGY INC	27,021,609	1.5
	COMCAST CORP-CLASS A	25,563,089	1.4
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	25,298,281	1.4
	US BANCORP	24,422,926	1.4
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	23,273,584	1.3
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	22,230,905	1.2
	FIRSTENERGY CORP	19,795,426	1.1
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	19,211,363	1.1
	LOCKHEED MARTIN CORP	19,046,510	1.1
	P G & E CORP	18,754,533	1.1
	QUALCOMM INC	17,949,336	1.0
	SUNTRUST BANKS INC	17,159,505	1.0
	TRAVELERS COS INC/THE	16,503,934	0.9
	UNITEDHEALTH GROUP INC	16,478,646	0.9
	HESS CORP	15,553,324	0.9
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	15,307,687	0.9
	GENERAL ELECTRIC CO	13,746,582	0.8
	3M CO	13,132,097	0.7
	MARSH & MCLENNAN COS	13,036,223	0.7
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,975,506	0.7
	MARATHON OIL CORP	12,476,117	0.7
	MCKESSON CORP	11,650,212	0.7
	MARATHON PETROLEUM CORP	11,268,708	0.6
	KROGER CO	11,176,351	0.6
	NIELSEN HOLDINGS PLC	10,379,625	0.6
	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	9,803,990	0.5
	EXELON CORP	9,687,283	0.5
	QUEST DIAGNOSTICS INC	9,461,690	0.5
	UNION PACIFIC CORP	9,303,075	0.5
	KEYCORP	9,080,743	0.5

国名	銘柄	評価額 (邦貨換算金額)	組入比率
アメリカ		円	%
	JOHNSON & JOHNSON	8,750,803	0.5
	LOWE'S COS INC	8,452,474	0.5
	SCHWAB (CHARLES) CORP	8,450,775	0.5
	MATTEL INC	8,394,071	0.5
	INVESCO LTD	8,088,523	0.5
	DOLLAR GENERAL CORP	8,020,727	0.4
	INTERNATIONAL PAPER CO	7,719,286	0.4
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	7,113,007	0.4
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	6,672,351	0.4
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	6,578,987	0.4
	ALTRIA GROUP INC	6,498,422	0.4
	HALLIBURTON CO	6,373,006	0.4
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6,127,849	0.3
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	6,117,545	0.3
	KELLOGG CO	5,752,884	0.3
	CDW CORP/DE	5,572,307	0.3
	PRAXAIR INC	5,125,827	0.3
	GENERAL MILLS INC	3,866,392	0.2
	BECTON DICKINSON AND CO	3,496,720	0.2
	CARDINAL HEALTH INC	2,780,667	0.2
	BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	2,348,123	0.1
	EQUIFAX INC	2,271,250	0.1
小計 (金額・比率)		1,310,177,150	73.4
イギリス	ASTRAZENECA PLC	31,880,226	1.8
	DIAGEO PLC-SPONSORED ADR	22,174,479	1.2
	UNILEVER N V -NY SHARES	14,182,234	0.8
	EXPERIAN PLC	8,445,290	0.5
	PENTAIR PLC	7,429,757	0.4
	SMITH & NEPHEW PLC	6,945,004	0.4
小計 (金額・比率)		91,056,990	5.1
オランダ	ROYAL DUTCH SHELL-SPON ADR-A	32,893,584	1.8
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	27,187,814	1.5
小計 (金額・比率)		60,081,398	3.4
カナダ	SUNCOR ENERGY INC	32,663,020	1.8
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	8,215,175	0.5
	ENBRIDGE INC	6,172,842	0.3
	BCE INC	4,904,213	0.3
小計 (金額・比率)		51,955,250	2.9
フランス	TOTAL SA-SPON ADR	26,883,837	1.5
	PUBLICIS GROUPE	11,079,528	0.6
小計 (金額・比率)		37,963,365	2.1

国名	銘柄	評価額 (邦貨換算金額)	組入比率
アイルランド		円	%
	MEDTRONIC PLC	17,170,731	1.0
	CRH PLC	8,791,874	0.5
小計 (金額・比率)		25,962,605	1.5
韓国			
	SAMSUNG ELECTR-GDR	16,674,310	0.9
	SK TELECOM CO LTD-SPON ADR	8,882,523	0.5
小計 (金額・比率)		25,556,833	1.4
台湾			
	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	20,895,191	1.2
小計 (金額・比率)		20,895,191	1.2
デンマーク			
	NOVO-NORDISK A/S-SPONS ADR	13,098,484	0.7
小計 (金額・比率)		13,098,484	0.7
中国			
	LENOVO GROUP LTD	6,501,666	0.4
		6,501,666	0.4
合計 (金額・比率)		1,643,248,932	92.1

(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8期（決算日 2018年10月25日）

（計算期間 2017年10月26日～2018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	純 資 産 額
		騰 落 率		騰 落 率		
	円	%		%	%	百万円
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
7期(2017年10月25日)	10,033	△0.0	100.32	△0.0	115.3	36
8期(2018年10月25日)	10,033	0.0	100.26	△0.1	57.6	125

○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	券 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首)	円	%		%		%
2017年10月25日	10,033	—	100.32	—		115.3
10月末	10,033	0.0	100.32	△0.0		85.1
11月末	10,035	0.0	100.31	△0.0		82.9
12月末	10,037	0.0	100.31	△0.0		82.4
2018年1月末	10,037	0.0	100.31	△0.0		84.5
2月末	10,037	0.0	100.30	△0.0		90.9
3月末	10,036	0.0	100.30	△0.0		93.4
4月末	10,037	0.0	100.29	△0.0		93.4
5月末	10,037	0.0	100.29	△0.0		52.1
6月末	10,036	0.0	100.28	△0.0		96.6
7月末	10,036	0.0	100.28	△0.0		59.7
8月末	10,037	0.0	100.27	△0.0		86.4
9月末	10,033	0.0	100.27	△0.1		86.3
(期 末)						
2018年10月25日	10,033	0.0	100.26	△0.1		57.6

(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

(2017年10月26日～2018年10月25日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：10,033円

期 末：10,033円

騰落率： 0.0%

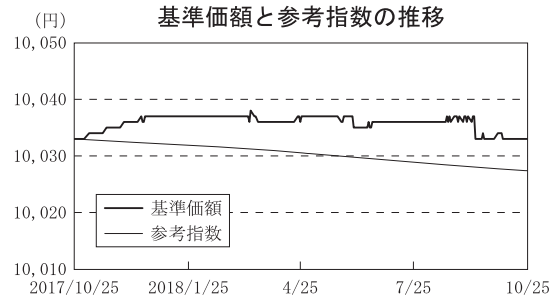
◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・安定した金利収入の獲得

マイナス要因

- ・保有する債券の評価損



(注) 参考指数は、期首(2017年10月25日)の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) 参考指数は、無担保コール翌日物金利です。

■投資環境

当期の短期金融市場は、「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を維持したことで、短期金融市場金利は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、350兆円台から390兆円台へと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-0.07%程度から-0.03%程度で推移しました。また、3カ月物の短期国債利回りは、-0.30%台半ばから-0.10%程度で推移しました。

■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で推移しました。

○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

(2017年10月26日～2018年10月25日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2017年10月26日～2018年10月25日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国	地方債証券	千円 193,393	千円 40,012 (160,270)
	特殊債券	52,121	— (15,000)

(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

(2017年10月26日～2018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

(2018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B B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
地方債証券	35,000	34,993	28.0	—	—	—	28.0
	(35,000)	(34,993)	(28.0)	(—)	(—)	(—)	(28.0)
特殊債券	37,000	37,067	29.6	—	—	—	29.6
(除く金融債)	(37,000)	(37,067)	(29.6)	(—)	(—)	(—)	(29.6)
合 計	72,000	72,060	57.6	—	—	—	57.6
	(72,000)	(72,060)	(57.6)	(—)	(—)	(—)	(57.6)

(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27年度第11回北海道公募公債 (3年)	0.12	15,000	14,995	2018/12/25
平成25年度第8回福岡県公募公債	0.27	20,000	19,998	2018/12/25
小 計		35,000	34,993	
特殊債券(除く金融債)				
第1回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	1.6	10,000	10,011	2018/11/19
第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	1.4	27,000	27,056	2018/12/17
小 計		37,000	37,067	
合 計		72,000	72,060	

(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

(2018年10月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 72,060	% 57.6
コール・ローン等、その他	53,032	42.4
投資信託財産総額	125,092	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年10月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	125,092,828
コール・ローン等	52,803,773
公社債(評価額)	72,060,710
未収利息	37,294
前払費用	191,051
(B) 負債	148
未払利息	148
(C) 純資産総額(A－B)	125,092,680
元本	124,680,834
次期繰越損益金	411,846
(D) 受益権総口数	124,680,834口
1万口当たり基準価額(C／D)	10,033円

(注) 当親ファンドの期首元本額は36,292,274円、期中追加設定元本額は191,457,775円、期中一部解約元本額は103,069,215円です。(元本の内訳)

東京海上J-REIT投信(通貨選択型) マネーブル・ファンド(年2回決算型)

112,648,231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) インドネシアリアルコース(毎月分配型)

1,000,000円

東京海上J-REIT投信(通貨選択型) インドネシアリアルコース(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(ブレンコース)(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) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2017年10月26日～2018年10月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	162,319
受取利息	175,644
支払利息	△ 13,325
(B) 有価証券売買損益	△166,075
売買益	6,560
売買損	△172,635
(C) 当期損益金(A+B)	△ 3,756
(D) 前期繰越損益金	118,412
(E) 追加信託差損益金	668,832
(F) 解約差損益金	△371,642
(G) 計(C+D+E+F)	411,846
次期繰越損益金(G)	411,846

(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) (E)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) (F)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。