

ロゲー
東京海上Rogge
世界ハイブリッド証券ファンド
(通貨選択型)

ロシア・ルーブルコース(毎月分配型)

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／内外／債券 (課税上は株式投資信託として取扱われます。)	
信託期間	2013年9月4日から2021年9月17日	
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。	
主要投資対象	東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ロシア・ルーブルコース(毎月分配型)	主に世界の金融機関が発行するハイブリッド証券(劣後債、優先出資証券など)等を投資対象とする外国投資信託「東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド」および「東京海上マネーマザーファンド」を主要投資対象とします。
	東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンドーロシア・ルーブルクラス	世界の金融機関が発行するハイブリッド証券等を主要投資対象とします。
	東京海上マネーマザーファンド	円建て短期公社債およびコマーシャル・ペーパーなどを主要投資対象とします。
投資制限	東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ロシア・ルーブルコース(毎月分配型)	・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。
	東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンドーロシア・ルーブルクラス	原則として、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。
	東京海上マネーマザーファンド	・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期および第2期の決算時には、分配を行いません。第3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。	

運用報告書(全体版)

第62期(決算日)	2018年10月17日)
第63期(決算日)	2018年11月19日)
第64期(決算日)	2018年12月17日)
第65期(決算日)	2019年1月17日)
第66期(決算日)	2019年2月18日)
第67期(決算日)	2019年3月18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Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ロシア・ルーブルコース(毎月分配型)」は、このたび、第67期の決算を行いましたので、第62期～第67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	基準 (分配落)	標準		価額		債 組 入 比	券 率	投 資 信 託 組 入 比	純 資 産 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金	期 騰 落					
	円			円			%	%	%	百万円
38期(2016年10月17日)	5,626			60			6.0	0.0	97.1	1,004
39期(2016年11月17日)	5,668			60			1.8	0.0	102.5	1,036
40期(2016年12月19日)	6,342			60			12.9	0.0	98.0	1,204
41期(2017年1月17日)	6,426			60			2.3	0.0	98.0	1,543
42期(2017年2月17日)	6,584			60			3.4	0.0	92.6	1,871
43期(2017年3月17日)	6,531			60			0.1	0.0	98.3	1,869
44期(2017年4月17日)	6,551			60			1.2	0.0	99.6	1,983
45期(2017年5月17日)	6,863			60			5.7	0.0	98.8	2,037
46期(2017年6月19日)	6,601			60			△ 2.9	0.0	99.0	1,806
47期(2017年7月18日)	6,525			60			△ 0.2	0.0	98.6	1,783
48期(2017年8月17日)	6,474			60			0.1	0.0	97.8	1,765
49期(2017年9月19日)	6,672			60			4.0	0.0	98.3	1,590
50期(2017年10月17日)	6,763			60			2.3	0.0	98.5	1,463
51期(2017年11月17日)	6,532			60			△ 2.5	0.0	99.0	1,335
52期(2017年12月18日)	6,641			60			2.6	0.0	99.0	1,291
53期(2018年1月17日)	6,773			60			2.9	0.0	98.3	1,317
54期(2018年2月19日)	6,360			60			△ 5.2	0.0	98.9	1,133
55期(2018年3月19日)	6,150			60			△ 2.4	0.0	97.0	1,060
56期(2018年4月17日)	5,740			60			△ 5.7	0.0	98.8	923
57期(2018年5月17日)	5,776			60			1.7	0.0	99.2	930
58期(2018年6月18日)	5,652			60			△ 1.1	0.0	97.0	1,003
59期(2018年7月17日)	5,819			60			4.0	0.0	98.5	1,020
60期(2018年8月17日)	5,318			60			△ 7.6	0.0	97.9	906
61期(2018年9月18日)	5,231			60			△ 0.5	0.0	97.3	899
62期(2018年10月17日)	5,346			60			3.3	0.0	97.9	922
63期(2018年11月19日)	5,266			60			△ 0.4	0.0	97.8	891
64期(2018年12月17日)	5,161			60			△ 0.9	0.0	98.1	875
65期(2019年1月17日)	4,995			60			△ 2.1	0.0	98.7	715
66期(2019年2月18日)	5,120			60			3.7	0.0	98.2	722
67期(2019年3月18日)	5,318			60			5.0	0.0	97.8	737

(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 組 入 比 率
		騰 落 率	率		
第62期	(期 首) 2018年9月18日	円	%	%	%
	9月末	5,231	—	0.0	97.3
	(期 末) 2018年10月17日	5,457	4.3	0.0	98.0
第63期	(期 首) 2018年10月17日	5,406	3.3	0.0	97.9
	10月末	5,346	—	0.0	97.9
	(期 末) 2018年11月19日	5,353	0.1	0.0	98.1
第64期	(期 首) 2018年11月19日	5,326	△0.4	0.0	97.8
	11月末	5,266	—	0.0	97.8
	(期 末) 2018年12月17日	5,247	△0.4	0.0	97.9
第65期	(期 首) 2018年12月17日	5,221	△0.9	0.0	98.1
	12月末	5,161	—	0.0	98.1
	(期 末) 2019年1月17日	4,849	△6.0	0.0	97.6
第66期	(期 首) 2019年1月17日	5,055	△2.1	0.0	98.7
	1月末	4,995	—	0.0	98.7
	(期 末) 2019年2月18日	5,148	3.1	0.0	98.5
第67期	(期 首) 2019年2月18日	5,180	3.7	0.0	98.2
	2月末	5,120	—	0.0	98.2
	(期 末) 2019年3月18日	5,226	2.1	0.0	97.8
		5,378	5.0	0.0	97.8

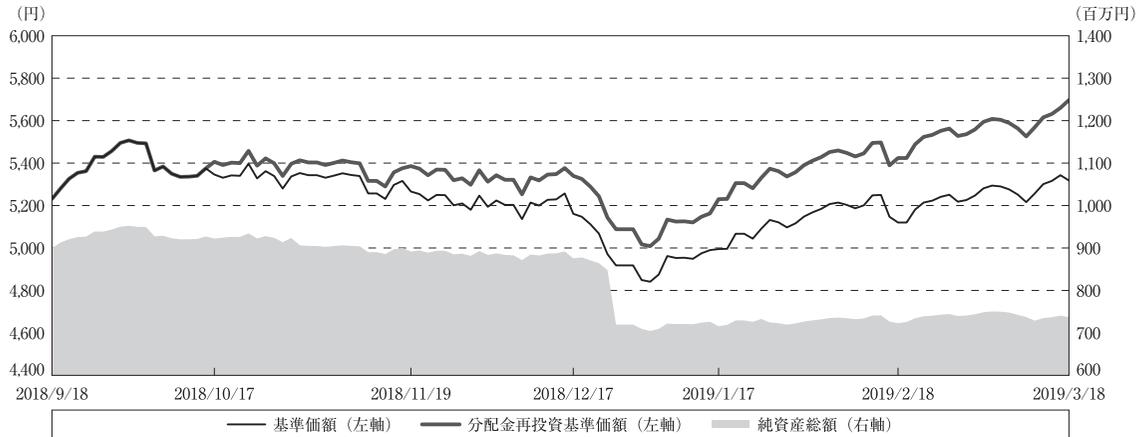
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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9月19日～2019年3月18日)

■作成期間中の基準価額等の推移



第62期首：5,231円

第67期末：5,318円 (既払分配金(税込み):360円)

騰落率：8.9% (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9月18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

- ・ハイブリッド証券の利息収入
- ・FRB(米連邦準備制度理事会)が利上げに慎重な姿勢を示したことなどによる米国債利回りの低下(債券価格の上昇)
- ・2019年の年初から当作成期末にかけて、原油価格や米国株式市場が安定的に推移したことなどを背景としたハイブリッド証券価格の上昇
- ・原資産通貨売り/ロシア・ルーブル買いの為替取引によるプレミアム(金利差相当分の収益)
- ・米国株式市場の反発などを受け、投資家のリスク回避姿勢が後退したことを背景とした円安ロシア・ルーブル高の進行

マイナス要因

- ・不安定な米国株式市場の動向やイタリアの財政に対する懸念などを背景とした、当作成期前半のハイブリッド証券価格の下落

■投資環境

【外国債券市場動向】

米国債利回りは、低下しました。

当作成期初、堅調な米国経済指標から米国の利上げ観測が一段と高まったことにより米国債利回りは上昇しましたが、その後、米国株式市場の下落などを背景に景気後退懸念が台頭したことから、米国債利回りは低下に転じました。2019年1月末にFRBが利上げに慎重な姿勢を示したことなどから米国債利回りの低下基調は継続し、前作成期末対比低下した水準で当作成期を終えました。

ドイツ国債利回りは、低下しました。

当作成期初、ドラギECB（欧州中央銀行）総裁によるユーロ圏のインフレ率上昇についての発言から、ドイツ国債利回りは上昇しましたが、イタリアの予算案を巡るイタリア政府とEU（欧州連合）間の対立を背景にイタリアの財政懸念が強まると、ドイツ国債利回りは低下に転じました。2019年に入ってから欧州の経済指標が低迷したことでドイツ国債利回りは低位で推移し、前作成期末対比低下した水準で当作成期を終えました。

【ハイブリッド証券市場動向】

ハイブリッド証券の価格は、一般的に上昇しました。

当作成期初、米中貿易摩擦やサウジアラビア情勢に対する懸念、米国株式市場の下落などから、投資家のリスク回避姿勢が強まり、ハイブリッド証券のスプレッド（国債との利回り格差）が拡大したことから、ハイブリッド証券市場は全般的に軟調な展開となりました。2018年末に米国株式市場が反発すると、スプレッドは縮小傾向に転じ、また、ベースとなる米国債利回りが低下したこともあり、ハイブリッド証券の価格は全般的に当作成期初から上昇した水準で当作成期を終えました。

【外国為替市場動向】

ロシア・ルーブル円為替レートは、米国株式市場の反発などを受け、投資家のリスク回避姿勢が後退したことを背景に、前作成期末対比で円安ロシア・ルーブル高となりました。



(注) 為替レートは、WMロイターを使用しています。

■ポートフォリオについて

<東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ロシア・ルーブルコース(毎月分配型)>

当ファンドは、「東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンドーロシア・ルーブルクラス」(以下、外国投資信託証券)および「東京海上マネーマザーファンド」(以下、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、外国投資信託証券の値動きを反映し、8.9%上昇しました。

<外国投資信託証券>

ハイブリッド証券等の組入比率は、当作成期を通じて高位を維持し、当作成期末は90%超となりました。

当作成期は、欧州の政治動向や金融環境および米国の経済動向などが相場変動の要因となるなか、発行体の財務状況を改めて精査し、また市場での流動性などを勘案して運用を行いました。

通貨比率は、原資産通貨売り/ロシア・ルーブル買いの為替取引を行い、ロシア・ルーブルの通貨比率を高位に保つ運用を行いました。

以上のような運用の結果、基準価額(分配金再投資)は上昇しました。

【組入銘柄の概要(2019年2月末現在)】

証券種別構成

証券種類	比率
	%
期限付劣後債	65.9
永久劣後債	14.9
優先出資証券	5.7
その他	13.4

格付別構成

格付	比率
	%
AAA格	-
AA格	1.8
A格	60.3
BBB格	37.4
BB格以下	0.5
無格付	-

組入上位5カ国

	国	比率
		%
1	アメリカ	32.4
2	イギリス	14.4
3	フランス	13.4
4	オランダ	7.9
5	日本	5.1

組入上位10銘柄

	銘柄	証券種類	国	通貨	比率
					%
1	BPCE SA	期限付劣後債	フランス	米ドル	4.3
2	CITIGROUP INC	期限付劣後債	アメリカ	米ドル	3.9
3	SANTANDER UK PLC	期限付劣後債	イギリス	米ドル	3.8
4	MORGAN STANLEY	期限付劣後債	アメリカ	米ドル	3.5
5	BANK OF AMERICA CORP	期限付劣後債	アメリカ	米ドル	3.4
6	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	期限付劣後債	アメリカ	米ドル	3.3
7	BNP PARIBAS	期限付劣後債	フランス	米ドル	2.7
8	TORONTO-DOMINION BANK	期限付劣後債	カナダ	米ドル	2.5
9	ING BANK NV	期限付劣後債	オランダ	米ドル	2.5
10	DAI-ICHI LIFE INSURANCE	永久劣後債	日本	米ドル	2.5
	組入銘柄数		65銘柄		

(注) 比率は保有するハイブリッド証券等の時価総額に占める割合です。

(注) 格付はMoody's社、S&P社、Fitch社のうち、原則として上位の格付を集計、記載しています。+・-等の符号は省略して表示しています。

(注) 国につきましてはBloomberg上のリスク所在国を表示しています。

(注) 基準価額算定の基準で記載しています。

<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で推移しました。

■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つ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62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期
	2018年9月19日～ 2018年10月17日	2018年10月18日～ 2018年11月19日	2018年11月20日～ 2018年12月17日	2018年12月18日～ 2019年1月17日	2019年1月18日～ 2019年2月18日	2019年2月19日～ 2019年3月18日
当期分配金 (対基準価額比率)	60 1.110%	60 1.127%	60 1.149%	60 1.187%	60 1.158%	60 1.116%
当期の収益	60	60	60	60	60	60
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	2,899	2,910	2,923	2,935	2,950	2,966

(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四捨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Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ロシア・ルーブルコース(毎月分配型)>

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保ちます。

<外国投資信託証券>

欧米経済は緩やかながらも着実な成長が続くことが予想され、欧米金利についてはおおむね横ばいで推移することを想定しています。

このような金利環境下、金融機関の経営環境は当面良好な状態が継続すると想定されることから、財務状況が健全と考える米国、英国、ユーロ圏、北欧などの金融機関を中心に、ハイブリッド証券等の組入比率については現在の水準を維持する方針です。

通貨比率については、原資産通貨売り/ロシア・ルーブル買いの為替取引を行い、ロシア・ルーブルの通貨比率を高位に保つ運用を行います。

<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9月19日～2019年3月18日)

項 目	第62期～第67期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 26	% 0.494	(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)	(8)	(0.150)	*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)	(17)	(0.332)	*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)	(0.012)	*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	26	0.499	
作成期間の平均基準価額は、5,213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9月19日～2019年3月18日)

投資信託証券

銘			第62期～第67期			
			買 付		売 付	
			口 数	金 額	口 数	金 額
外 国 (邦貨建)	ケイマン	東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Rogge グローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ ファンドーロシア・ループルクラス	千口 5	千円 25,000	千口 38	千円 172,600

(注) 金額は受渡代金です。

○利害関係人との取引状況等

(2018年9月19日～2019年3月18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

(2019年3月18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61期末		第67期末			
		口	数	口	数	評 価 額	比 率
			千口		千口	千円	%
東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Rogge グローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ ファンドーロシア・ルーブルクラス			185		152	720,659	97.8
合	計		185		152	720,659	97.8

(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61期末		第67期末		
		口	数	口	数	評 価 額
			千口		千口	千円
東京海上マネーマザーファンド			9		9	10

○投資信託財産の構成

(2019年3月18日現在)

項	目	第67期末	
		評 価 額	比 率
		千円	%
投資信託受益証券		720,659	96.6
東京海上マネーマザーファンド		10	0.0
コール・ローン等、その他		25,335	3.4
投資信託財産総額		746,004	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第62期末	第63期末	第64期末	第65期末	第66期末	第67期末
	2018年10月17日現在	2018年11月19日現在	2018年12月17日現在	2019年1月17日現在	2019年2月18日現在	2019年3月18日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	933,339,288	902,663,399	886,552,497	736,135,456	731,915,227	746,004,666
コール・ローン等	30,343,488	30,206,213	27,110,355	24,731,388	22,359,761	25,334,727
投資信託受益証券(評価額)	902,985,790	872,447,175	859,432,131	706,394,056	709,545,454	720,659,928
東京海上マネーマザーファンド(評価額)	10,010	10,011	10,011	10,012	10,012	10,011
未収入金	—	—	—	5,000,000	—	—
(B) 負債	11,094,320	10,989,048	10,866,018	20,336,300	9,114,023	8,889,360
未払収益分配金	10,349,915	10,159,027	10,180,148	8,598,913	8,470,598	8,317,135
未払解約金	—	—	—	11,093,493	—	—
未払信託報酬	736,372	821,059	678,461	636,951	636,491	566,062
未払利息	68	81	73	62	56	41
その他未払費用	7,965	8,881	7,336	6,881	6,878	6,122
(C) 純資産総額(A-B)	922,244,968	891,674,351	875,686,479	715,799,156	722,801,204	737,115,306
元本	1,724,985,861	1,693,171,280	1,696,691,455	1,433,152,182	1,411,766,446	1,386,189,276
次期繰越損益金	△ 802,740,893	△ 801,496,929	△ 821,004,976	△ 717,353,026	△ 688,965,242	△ 649,073,970
(D) 受益権総口数	1,724,985,861口	1,693,171,280口	1,696,691,455口	1,433,152,182口	1,411,766,446口	1,386,189,276口
1万口当たり基準価額(C/D)	5,346円	5,266円	5,161円	4,995円	5,120円	5,318円

(注) 当ファンドの第62期首元本額は1,719,766,836円、第62～67期中追加設定元本額は51,298,250円、第62～67期中一部解約元本額は384,875,810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62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期
	2018年9月19日～ 2018年10月17日	2018年10月18日～ 2018年11月19日	2018年11月20日～ 2018年12月17日	2018年12月18日～ 2019年1月17日	2019年1月18日～ 2019年2月18日	2019年2月19日～ 2019年3月18日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	13,146,690	12,927,258	13,003,737	11,028,545	10,910,158	10,677,422
受取配当金	13,148,156	12,929,382	13,005,339	11,030,098	10,911,288	10,678,223
受取利息	9	-	3	-	-	-
支払利息	△ 1,475	△ 2,124	△ 1,605	△ 1,553	△ 1,130	△ 801
(B) 有価証券売買損益	17,794,623	△ 15,499,550	△ 19,979,354	△ 25,612,455	15,882,153	25,619,489
売買益	17,850,036	31,833	34,869	4,618,458	16,147,344	25,710,907
売買損	△ 55,413	△ 15,531,383	△ 20,014,223	△ 30,230,913	△ 265,191	△ 91,418
(C) 信託報酬等	△ 744,337	△ 829,940	△ 685,797	△ 643,832	△ 643,369	△ 572,184
(D) 当期損益金(A+B+C)	30,196,976	△ 3,402,232	△ 7,661,414	△ 15,227,742	26,148,942	35,724,727
(E) 前期繰越損益金	△ 208,911,495	△ 184,616,523	△ 197,564,224	△ 180,648,177	△ 200,521,733	△ 178,782,529
(F) 追加信託差損益金	△ 613,676,459	△ 603,319,147	△ 605,599,190	△ 512,878,194	△ 506,121,853	△ 497,699,023
(配当等相当額)	(434,175,541)	(426,502,448)	(427,732,001)	(361,708,888)	(356,572,173)	(350,357,148)
(売買損益相当額)	(△1,047,852,000)	(△1,029,821,595)	(△1,033,331,191)	(△874,587,082)	(△862,694,026)	(△848,056,171)
(G) 計(D+E+F)	△ 792,390,978	△ 791,337,902	△ 810,824,828	△ 708,754,113	△ 680,494,644	△ 640,756,835
(H) 収益分配金	△ 10,349,915	△ 10,159,027	△ 10,180,148	△ 8,598,913	△ 8,470,598	△ 8,317,135
次期繰越損益金(G+H)	△ 802,740,893	△ 801,496,929	△ 821,004,976	△ 717,353,026	△ 688,965,242	△ 649,073,970
追加信託差損益金	△ 613,676,459	△ 603,319,147	△ 605,599,190	△ 512,878,194	△ 506,121,853	△ 497,699,023
(配当等相当額)	(434,175,541)	(426,502,448)	(427,732,001)	(361,708,888)	(356,572,173)	(350,357,148)
(売買損益相当額)	(△1,047,852,000)	(△1,029,821,595)	(△1,033,331,191)	(△874,587,082)	(△862,694,026)	(△848,056,171)
分配準備積立金	65,902,444	66,290,323	68,222,881	59,000,324	60,037,259	60,895,816
繰越損益金	△ 254,966,878	△ 264,468,105	△ 283,628,667	△ 263,475,156	△ 242,880,648	△ 212,270,763

(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62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期
	2018年9月19日～ 2018年10月17日	2018年10月18日～ 2018年11月19日	2018年11月20日～ 2018年12月17日	2018年12月18日～ 2019年1月17日	2019年1月18日～ 2019年2月18日	2019年2月19日～ 2019年3月18日
a. 配当等収益(費用控除後)	12,830,421円	12,097,319円	12,317,941円	10,384,715円	10,648,183円	10,509,087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	434,175,541円	426,502,448円	427,732,001円	361,708,888円	356,572,173円	350,357,148円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	63,421,938円	64,352,031円	66,085,088円	57,214,522円	57,859,674円	58,703,864円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	510,427,900円	502,951,798円	506,135,030円	429,308,125円	425,080,030円	419,570,099円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,959円	2,970円	2,983円	2,995円	3,010円	3,026円
g. 分配金	10,349,915円	10,159,027円	10,180,148円	8,598,913円	8,470,598円	8,317,135円
h. 分配金(1万口当たり)	60円	60円	60円	60円	60円	60円

○分配金のお知らせ

	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期
1万口当たり分配金(税込み)	60円	60円	60円	60円	60円	60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

(2019年3月18日現在)

<東京海上マネーマザーファンド>

下記は、東京海上マネーマザーファンド全体(10,677千口)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67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	8,000 (8,000)	8,002 (8,002)	74.1 (74.1)	— (—)	— (—)	— (—)	74.1 (74.1)	
合 計	8,000 (8,000)	8,002 (8,002)	74.1 (74.1)	— (—)	— (—)	— (—)	74.1 (74.1)	

(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67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	
第324回大阪府公募公債(10年)	1.64	5,000	5,002	2019/3/29
第39回川崎市公募公債(5年)	0.209	3,000	2,999	2019/3/20
合 計		8,000	8,002	

(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〉

東京海上ストラテジック・トラストー
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド
(日本円クラス/米ドルクラス/ユーロクラス/豪ドルクラス/
ブラジル・リアルクラス/メキシコ・ペソクラス/トルコ・リラクラス/
ロシア・ルーブルクラス/資源国通貨バスケットクラス)
(外国投資信託 ケイマン諸島籍) の運用状況

東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンドは、「東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）」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	世界の金融機関が発行するハイブリッド証券等を主要投資対象とし、安定したインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目指します。また、為替取引を用いて、各クラスで定められた通貨（日本円クラス=日本円、米ドルクラス=米ドル、ユーロクラス=ユーロ、豪ドルクラス=豪ドル、ブラジル・リアルクラス=ブラジル・リアル、メキシコ・ペソクラス=メキシコ・ペソ、トルコ・リラクラス=トルコ・リラ、ロシア・ルーブルクラス=ロシア・ルーブル、資源国通貨バスケットクラス=豪ドル/ブラジル・リアル/南アフリカ・ランド（比率は概ね3分の1ずつ））への投資効果を追求します。
主な投資制限	原則として、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。
収益分配	原則として、毎月分配を行います。
信託期間	原則として2021年9月10日まで
決算日	原則として毎年2月末日
信託報酬等	ファンドの純資産総額に対し年率0.667%を乗じて得た額が投資顧問会社、副投資顧問会社、管理会社、副管理会社、保管銀行ならびに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。またファンドの純資産総額に対し年率0.01%（ただし、年額10,000米ドルを下回らないものとします。）を乗じて得た額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、ファンドは、ファンドの設立に係る費用（ファンドの3会計期間にわたり償却）、組入有価証券の売買委託手数料等の取引に要する費用、組入有価証券の保管に要する費用、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	受託会社：CIBC Bank and Trust Company (Cayman) Limited 管理会社、保管銀行、事務代行会社：ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A. 副管理会社：MUFGLuxスマネジメントカンパニーS.A. 投資顧問会社：東京海上アセットマネジメント株式会社 副投資顧問会社：Tokio Marine Rogge Asset Management Ltd.

※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

2017年3月1日
～2018年2月28日

(円)

当期中における純資産額	61,883,525,951
収益	
債券に係る受取利息（純額）	2,202,810,843
銀行預金に係る受取利息	6,960,253
その他収益	6,040,818
収益合計	2,215,811,914
費用	
管理事務代行報酬、管理報酬および保管機関報酬	(65,471,120)
代行協会員報酬	(8,130,614)
販売報酬	(96,428,989)
投資顧問報酬	(317,243,796)
当座借越に係る支払利息	(1,209,503)
その他の費用	(15,352,235)
諸税金	(935,096)
専門家報酬	(2,254,256)
副保管機関報酬	(2,527,579)
副管理者報酬	(13,094,245)
受託報酬	(5,205,500)
費用合計	(527,852,933)
投資純利益／（損失）	1,687,958,981
投資に係る実現純利益／（損失）	1,600,793,683
為替予約および為替先渡取引に係る実現純利益／（損失）	1,519,644,192
当期実現純利益／（損失）	3,120,437,875
以下に係る未実現純利益（損失）の増減	
－投資	(1,504,966,244)
－為替予約および為替先渡取引	(2,080,886,922)
－その他の資産および負債の為替換算	382,764,130
	(3,203,089,036)
運用による純資産の増加／（減少）額	1,605,307,820

(ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S. A. 提供の監査財務諸表より作成)

(2) 組入有価証券の明細

2018年2月28日現在

国名	銘柄名	証券種類	償還年月日	利率 (%)	通貨	評価額 (邦貨建金額) (円)	組入比率 (%)
アメリカ	MORGAN STANLEY	期限付劣後債	2027/4/23	3.95	USD	1,419,370,175	3.3
アメリカ	CITIGROUP INC	期限付劣後債	2026/3/9	4.6	USD	1,392,064,283	3.3
アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	期限付劣後債	2025/4/21	3.95	USD	1,049,205,275	2.5
アメリカ	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	期限付劣後債	2023/6/15	5.625	USD	1,018,465,106	2.4
アメリカ	GOLDMAN SACHS CAPITAL I	優先出資証券	2034/2/15	6.345	USD	875,287,783	2.0
アメリカ	WELLS FARGO CAPITAL X	優先出資証券	2036/12/15	5.95	USD	749,812,039	1.8
アメリカ	MANUF & TRADERS TRUST CO	期限付劣後債	2027/8/17	3.4	USD	561,865,221	1.3
アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	期限付劣後債	2038/5/14	7.75	USD	451,444,531	1.1
アメリカ	BANK OF NY MELLON CORP	期限付劣後債	2028/7/30	3	USD	433,206,839	1.0
アメリカ	PRINCIPAL FINANCIAL GROU	期限付劣後債	2020/5/15	4.7	USD	428,830,328	1.0
アメリカ	ALLSTATE CORP	期限付劣後債	2018/4/2	3.77375	USD	418,283,603	1.0
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	期限付劣後債	2026/12/1	3.625	USD	309,570,418	0.7
アメリカ	HARTFORD FINL SVCS GRP	期限付劣後債	2018/4/2	3.96375	USD	261,365,890	0.6
アメリカ	METLIFE INC	期限付劣後債	2031/12/15	6.4	USD	240,692,329	0.6
アメリカ	VOYA FINANCIAL INC	期限付劣後債	2023/5/15	5.65	USD	215,269,977	0.5
アメリカ	VOYA FINANCIAL INC	期限付劣後債	2028/1/23	4.7	USD	199,751,761	0.5
アメリカ	CITIGROUP INC	その他	2039/7/15	8.125	USD	166,854,026	0.4
アメリカ	GOLDMAN SACHS GROUP INC	期限付劣後債	2038/1/18	6.875	GBP	138,643,215	0.3
小計 (金額・比率)						10,329,982,799	24.2
イギリス	SANTANDER UK PLC	期限付劣後債	2023/11/7	5	USD	1,190,884,159	2.8
イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	永久劣後債	2022/9/16	5.25	EUR	802,724,433	1.9
イギリス	HISCOX LTD	期限付劣後債	2025/11/24	6.125	GBP	796,885,422	1.9
イギリス	CYBG PLC	その他	2024/6/22	3.125	GBP	631,135,777	1.5
イギリス	STANDARD CHARTERED PLC	期限付劣後債	2027/2/19	4.3	USD	624,818,988	1.5
イギリス	NATIONWIDE BLDG SOCIETY	期限付劣後債	2024/7/25	2	EUR	526,547,182	1.2
イギリス	PRUDENTIAL PLC	永久劣後債	2023/1/20	4.875	USD	422,405,845	1.0
イギリス	TSB BANKING GROUP PLC	期限付劣後債	2021/5/6	5.75	GBP	411,542,344	1.0
イギリス	ROYAL BK SCOTLAND GRP PLC	期限付劣後債	2023/6/10	6.1	USD	393,533,384	0.9
イギリス	BARCLAYS PLC	期限付劣後債	2027/5/7	4.836	USD	363,537,958	0.9
イギリス	BEAZLEY INSUR DAC	期限付劣後債	2026/11/4	5.875	USD	352,225,205	0.8
イギリス	AVIVA PLC	期限付劣後債	2023/7/5	6.125	EUR	318,305,750	0.7
イギリス	BARCLAYS PLC	期限付劣後債	2020/11/11	2.625	EUR	311,442,141	0.7
イギリス	BARCLAYS PLC	期限付劣後債	2023/2/7	2	EUR	232,293,889	0.5
イギリス	LLOYDS BANK PLC	期限付劣後債	2025/4/22	7.625	GBP	177,188,637	0.4
小計 (金額・比率)						7,555,471,114	17.7
イタリア	GENERALI FINANCE BV	永久劣後債	2025/11/21	4.596	EUR	504,361,628	1.2
イタリア	UNICREDIT SPA	期限付劣後債	2022/1/3	4.375	EUR	446,631,961	1.0
イタリア	INTESA SANPAOLO SPA	期限付劣後債	2025/4/23	2.855	EUR	440,066,150	1.0
イタリア	INTESA SANPAOLO SPA	期限付劣後債	2024/6/26	5.017	USD	159,550,117	0.4
小計 (金額・比率)						1,550,609,856	3.6
オランダ	ING BANK NV	期限付劣後債	2023/9/25	5.8	USD	777,022,903	1.8
オランダ	COOPERATIEVE RABOBANK UA	永久劣後債	2020/6/29	5.5	EUR	767,938,829	1.8
オランダ	NN GROUP NV	永久劣後債	2026/1/15	4.5	EUR	240,463,202	0.6
オランダ	ASR NEDERLAND NV	期限付劣後債	2025/9/29	5.125	EUR	226,926,903	0.5
オランダ	ING GROEP NV	永久劣後債	2022/4/16	6.875	USD	210,715,213	0.5
小計 (金額・比率)						2,223,067,050	5.2
スイス	ZURICH FINANCE (UK) PLC	永久劣後債	2022/10/2	6.625	GBP	1,256,306,032	2.9
スイス	ELM BV (HELVETIA SCHWEIZ)	期限付劣後債	2027/9/29	3.375	EUR	546,505,873	1.3
スイス	UBS GROUP FUNDING SWITZE	その他	2025/9/24	4.125	USD	325,691,395	0.8
スイス	UBS GROUP FUNDING SWITZE	永久劣後債	2023/1/31	5	USD	206,081,506	0.5
小計 (金額・比率)						2,334,584,806	5.5
スウェーデン	NORDEA BANK AB	永久劣後債	2021/9/13	5.25	USD	710,516,241	1.7
スウェーデン	SKANDINAVISKA ENSKILDA	永久劣後債	2022/5/13	5.625	USD	566,373,911	1.3
スウェーデン	SWEDBANK AB	永久劣後債	2022/3/17	6	USD	198,929,703	0.5
小計 (金額・比率)						1,475,819,855	3.5

国名	銘柄名	証券種類	償還年月日	利率 (%)	通貨	評価額 (邦貨建金額) (円)	組入比率 (%)
スペイン	CAIXABANK SA	期限付劣後債	2023/7/14	2.75	EUR	726,433,140	1.7
スペイン	SANTANDER ISSUANCES	期限付劣後債	2027/1/19	3.125	EUR	617,602,305	1.4
スペイン	MAPPRE SA	期限付劣後債	2027/3/31	4.375	EUR	291,340,170	0.7
小計 (金額・比率)						1,635,375,615	3.8
ドイツ	LB BADEN-WUERTEMBERG	期限付劣後債	2025/6/16	3.625	EUR	916,532,708	2.1
小計 (金額・比率)						916,532,708	2.1
ノルウェー	DNB BANK ASA	永久劣後債	2020/3/26	5.75	USD	546,665,711	1.3
ノルウェー	DNB BANK ASA	期限付劣後債	2022/3/1	1.25	EUR	514,814,801	1.2
小計 (金額・比率)						1,061,480,512	2.5
フランス	BNP PARIBAS	期限付劣後債	2025/9/28	4.375	USD	1,422,028,023	3.3
フランス	BPCE SA	期限付劣後債	2025/3/15	4.5	USD	1,348,058,733	3.2
フランス	CREDIT AGRICOLE SA	期限付劣後債	2025/3/17	4.375	USD	1,346,923,910	3.2
フランス	AXA SA	永久劣後債	2026/3/4	5.453	GBP	1,147,919,684	2.7
フランス	CREDIT AGRICOLE ASSRNCES	期限付劣後債	2028/1/29	2.625	EUR	257,539,494	0.6
小計 (金額・比率)						5,522,469,844	12.9
ペルー	INTERCORP FIN SER INC	その他	2027/7/19	4.125	USD	151,195,113	0.4
小計 (金額・比率)						151,195,113	0.4
日本	DAI-ICHI LIFE INSURANCE	永久劣後債	2024/10/28	5.1	USD	775,908,759	1.8
日本	FUKOKU MUTUAL LIFE INSUR	永久劣後債	2025/7/28	5	USD	470,536,307	1.1
日本	MIZUHO FIN GRP CAYMAN 3	期限付劣後債	2024/3/27	4.6	USD	198,194,088	0.5
日本	SOMPO JAPAN NIPPONKOA	期限付劣後債	2023/3/28	5.325	USD	145,225,674	0.3
小計 (金額・比率)						1,589,864,828	3.7
カナダ	MANULIFE FINANCIAL CORP	期限付劣後債	2027/2/24	4.061	USD	983,457,385	2.3
カナダ	TORONTO-DOMINION BANK	期限付劣後債	2026/9/15	3.625	USD	885,434,673	2.1
カナダ	BANK OF MONTREAL	期限付劣後債	2027/12/15	3.803	USD	648,136,037	1.5
小計 (金額・比率)						2,517,028,095	5.9
ベルギー	KBC GROUP NV	期限付劣後債	2024/9/18	1.625	EUR	364,698,520	0.9
小計 (金額・比率)						364,698,520	0.9
バミューダ諸島	XLIT LTD	期限付劣後債	2027/6/29	3.25	EUR	333,933,296	0.8
小計 (金額・比率)						333,933,296	0.8
総計						39,562,114,011	92.6

(注) 管理会社である「ルクセンブルク三菱UFインベスターサービス銀行S.A.」からの情報提供を受け、その内容を記載しています。

(注) 本明細は、現地2018年2月28日現在のデータです。邦貨換算額は、2018年2月28日現在の為替レートで換算しています。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 償還年月日は、繰上償還条項が付与されている銘柄は基準日以降最初の繰上償還予定日を表示しています。

(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。

東京海上マネーマザーファンド

運用報告書 第11期 (決算日 2018年8月15日)

(計算期間 2017年8月16日~2018年8月15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、-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	純資産総額
	騰落	率		騰落	率		
	円	%		%		百万円	
7期(2014年8月15日)	10,110	0.1	100.82	0.07	89.7	111	
8期(2015年8月17日)	10,112	0.0	100.89	0.07	72.5	96	
9期(2016年8月15日)	10,113	0.0	100.91	0.02	87.8	79	
10期(2017年8月15日)	10,117	0.0	100.86	△0.05	83.5	10	
11期(2018年8月15日)	10,116	△0.0	100.81	△0.05	74.1	10	

○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	%		%	%	
2017年8月15日	10,117	-	100.86	-	83.5	
8月末	10,117	0.0	100.86	△0.00	83.5	
9月末	10,111	△0.1	100.85	△0.01	74.1	
10月末	10,113	△0.0	100.85	△0.01	74.1	
11月末	10,115	△0.0	100.85	△0.01	74.1	
12月末	10,117	0.0	100.84	△0.02	58.5	
2018年1月末	10,117	0.0	100.84	△0.02	58.4	
2月末	10,116	△0.0	100.84	△0.02	74.2	
3月末	10,116	△0.0	100.83	△0.03	74.2	
4月末	10,116	△0.0	100.83	△0.03	74.2	
5月末	10,115	△0.0	100.82	△0.04	63.9	
6月末	10,116	△0.0	100.82	△0.05	75.1	
7月末	10,116	△0.0	100.81	△0.05	74.2	
(期末)						
2018年8月15日	10,116	△0.0	100.81	△0.05	74.1	

(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8月16日～2018年8月15日)

■期中の基準価額等の推移

期首：10,117円

期末：10,116円

騰落率：△ 0.0%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

・安定した利息収入の獲得

マイナス要因

・債券の評価損など

■投資環境

当期の短期金融市場は、日銀が長短金利操作付き量的・質的金融緩和を継続するなど、金融緩和環境が維持されたことにより、非常に低い金利水準が継続しました。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、360兆円台から390兆円台へと拡大しており、短期金融市場の資金余剰感は一段と強くなりました。

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-0.02%程度で推移しました。また、3カ月物の短期国債利回りは、-0.25%程度から-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、短期の政府保証債や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横ばいに推移しました。

○今後の運用方針

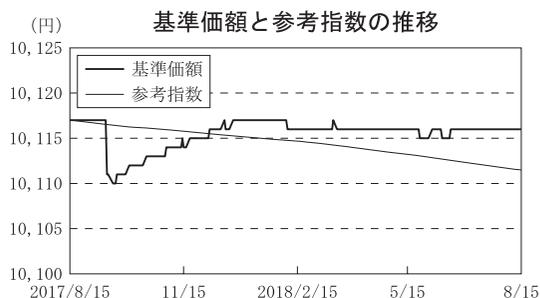
国内の短期金利は、日銀が当面は緩和的な政策を継続するとの見方から、マイナス水準にとどまると予想しています。

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

(2017年8月16日～2018年8月15日)

該当事項はございません。



(注) 参考指数は、期首(2017年8月15日)の値が基準価額と同ー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。



○売買及び取引の状況

(2017年8月16日～2018年8月15日)

公社債

		買付額	売付額
国	地方債証券	千円 37,327	千円 — (38,300)
	特殊債券	2,001	— (2,000)

(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す。

○利害関係人との取引状況等

(2017年8月16日～2018年8月15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8月15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	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
地方債証券	8,000 (8,000)	8,002 (8,002)	74.1 (74.1)	— (—)	— (—)	— (—)	74.1 (74.1)	
合 計	8,000 (8,000)	8,002 (8,002)	74.1 (74.1)	— (—)	— (—)	— (—)	74.1 (74.1)	

(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、価格情報会社など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6回京都府公募公債	0.29	5,000	5,001	2018/9/19
平成25年度第14回愛知県公募公債(5年)	0.199	3,000	3,000	2018/10/18
合 計		8,000	8,002	

(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8月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 8,002	% 74.1
コール・ローン等、その他	2,790	25.9
投資信託財産総額	10,792	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年8月15日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	10,792,178 円
コール・ローン等	2,782,205
公社債(評価額)	8,002,150
未収利息	2,190
前払費用	5,633
(B) 負債	6
未払利息	6
(C) 純資産総額(A-B)	10,792,172
元本	10,668,179
次期繰越損益金	123,993
(D) 受益権総口数	10,668,179口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,116円

(注) 当親ファンドの期首元本額は10,668,207円、期中追加設定元本額は0円、期中一部解約元本額は28円です。

<元本の内訳>

東京海上Rogee世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) マネー・プール・ファンド	1,454,905円
東京海上・アジア中小型成長株ファンド	1,100,000円
東京海上・東南アジア株式ファンド	1,100,000円
大和マイクロファイナンス・ファンド	992,261円
東京海上Rogee世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) 豪ドルコース(毎月分配型)	991,474円
東京海上Rogee世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) ブラジル・レアルコース(毎月分配型)	991,474円
東京海上Rogee世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) 円コース(毎月分配型)	991,474円
東京海上・米国優先リートファンド(為替プレミアム)	989,316円
東京海上Rogeeグローバルインフラ・ハイールド債ファンド(為替ヘッジあり)(年2回決算型)	494,511円
東京海上Rogeeグローバルインフラ・ハイールド債ファンド(為替ヘッジなし)(年2回決算型)	494,511円
東京海上Rogeeグローバルインフラ・ハイールド債ファンド(為替ヘッジなし)(毎月決算型)	494,511円
東京海上Rogeeグローバルインフラ・ハイールド債ファンド(為替ヘッジあり)(毎月決算型)	494,511円
東京海上Rogee世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) ユーロコース(毎月分配型)	9,915円
東京海上Rogee世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) 資源国通貨バスケットコース(毎月分配型)	9,915円
東京海上Rogee世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) 米ドルコース(毎月分配型)	9,915円
東京海上Rogee世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) トルコ・リラコース(毎月分配型)	9,898円
東京海上Rogee世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) ロシア・ルーブルコース(毎月分配型)	9,898円
東京海上Rogee世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) メキシコ・ペソコース(毎月分配型)	9,898円
東京海上Rogee世界ハイブリッド証券ファンド 円コース(年1回決算型)	9,896円
東京海上Rogee世界ハイブリッド証券ファンド 米ドルコース(年1回決算型)	9,896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8月16日～2018年8月15日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	41,545 円
受取利息	43,652
支払利息	△ 2,107
(B) 有価証券売買損益	△ 42,177
売買損	△ 42,177
(C) 当期損益金(A+B)	△ 632
(D) 前期繰越損益金	124,625
(E) 計(C+D)	123,993
次期繰越損益金(E)	123,993

(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。