

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-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-ロシア・ルーブルクラス」と、主に円建て短期公社債およびコマーシャル・ペーパー等に投資する親投資信託「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-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 -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)	<ul style="list-style-type: none"> 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-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 -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	<ul style="list-style-type: none"> 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74期	(決算日	2019年10月17日)
第75期	(決算日	2019年11月18日)
第76期	(決算日	2019年12月17日)
第77期	(決算日	2020年1月17日)
第78期	(決算日	2020年2月17日)
第79期	(決算日	2020年3月17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79期の決算を行いましたので、第74期～第79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などを示しています。

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配額)	基準価額				債券組入比率	投資信託組入比率	純資産額
		税分	込配	み金	期騰落率			
50期(2017年10月17日)	円 6,763			円 60	% 2.3	% 0.0	% 98.5	百万円 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
68期(2019年4月17日)	5,443			60	3.5	0.0	98.0	752
69期(2019年5月17日)	5,312			60	△ 1.3	0.0	98.1	728
70期(2019年6月17日)	5,287			60	0.7	0.0	98.4	699
71期(2019年7月17日)	5,445			60	4.1	0.0	98.1	721
72期(2019年8月19日)	5,125			60	△ 4.8	0.0	98.2	650
73期(2019年9月17日)	5,311			60	4.8	0.0	98.3	658
74期(2019年10月17日)	5,360			60	2.1	0.0	98.3	662
75期(2019年11月18日)	5,368			60	1.3	0.0	98.2	664
76期(2019年12月17日)	5,532			60	4.2	0.0	98.8	688
77期(2020年1月17日)	5,627			60	2.8	0.0	98.5	667
78期(2020年2月17日)	5,479			60	△ 1.6	0.0	98.8	639
79期(2020年3月17日)	4,226			60	△21.8	0.0	98.1	488

(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		債組入比率	券率	投 資 信 託 組 入 比	託券率
		騰	落				
第74期	(期 首) 2019年9月17日	円 5,311	% —		% 0.0		% 98.3
	9月末	5,353	0.8		0.0		98.6
	(期 末) 2019年10月17日	5,420	2.1		0.0		98.3
第75期	(期 首) 2019年10月17日	5,360	—		0.0		98.3
	10月末	5,399	0.7		0.0		98.4
	(期 末) 2019年11月18日	5,428	1.3		0.0		98.2
第76期	(期 首) 2019年11月18日	5,368	—		0.0		98.2
	11月末	5,407	0.7		0.0		98.4
	(期 末) 2019年12月17日	5,592	4.2		0.0		98.8
第77期	(期 首) 2019年12月17日	5,532	—		0.0		98.8
	12月末	5,578	0.8		0.0		98.9
	(期 末) 2020年1月17日	5,687	2.8		0.0		98.5
第78期	(期 首) 2020年1月17日	5,627	—		0.0		98.5
	1月末	5,453	△ 3.1		0.0		98.6
	(期 末) 2020年2月17日	5,539	△ 1.6		0.0		98.8
第79期	(期 首) 2020年2月17日	5,479	—		0.0		98.8
	2月末	5,271	△ 3.8		0.0		97.6
	(期 末) 2020年3月17日	4,286	△21.8		0.0		98.1

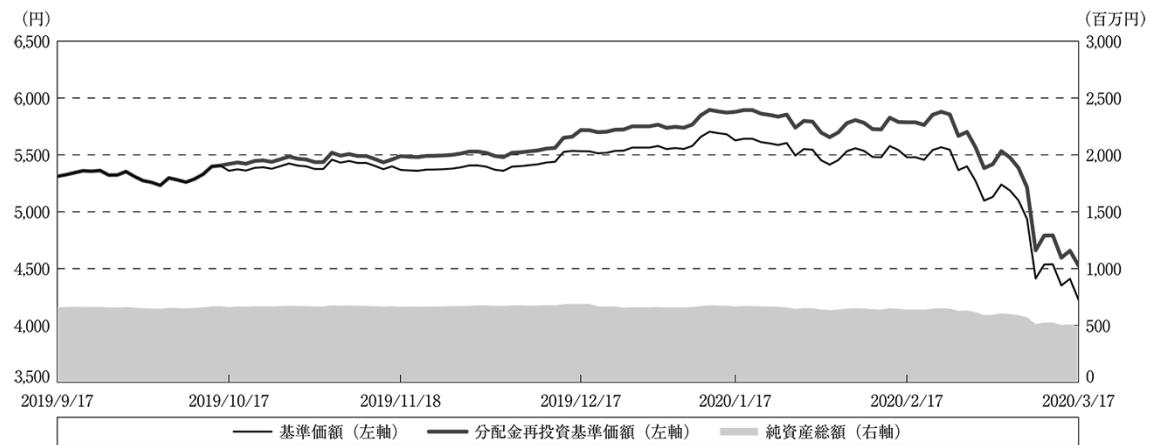
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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

(2019年9月18日～2020年3月17日)

■作成期間中の基準価額等の推移



第74期首： 5,311円

第79期末： 4,226円 (既払分配金(税込み):360円)

騰落率：△ 14.8% (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(2019年9月17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
- ・新型肺炎の感染拡大への懸念による米国債利回りの低下(債券価格の上昇)
- ・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)

マイナス要因

- ・新型肺炎の感染拡大を背景としたハイブリッド証券のスプレッド(国債との利回り格差)の拡大によるハイブリッド証券価格の下落
- ・新型肺炎の感染拡大への懸念から、円高ロシア・ルーブル安となったこと

■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。作成期初から2019年末にかけて、FRB（米連邦準備制度理事会）による予防的金融緩和への期待と米中貿易協議の第1段階の合意成立により、米国債利回りはおおむねレンジ内の動きとなりました。2020年初以降は、新型肺炎の世界的な感染拡大を受けて、FRBによる追加利下げへの期待感が高まり、米国債利回りは低下しました。

ドイツ債利回りは、おおむね横ばいとなりました。作成期初から2019年末にかけては、ECB（欧州中央銀行）による追加利下げ余地が限定的との見方から、ドイツ債利回りは上昇しました。2020年初以降は新型肺炎の感染拡大への懸念からドイツ債利回りは急低下した後、欧州の財政拡大の思惑から反転上昇して、前作成期末対比ほぼ同水準で当作成期を終えました。

英国債利回りは、英国のEU（欧州連合）離脱問題に関して、EUとの合意が成立し、移行期間が設定されるとの思惑等から、2019年末にかけて上昇しました。その後は、新型肺炎の感染拡大への懸念から英国債利回りは低下に転じ、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、全般的に下落しました。

作成期初から2019年末までは、株式などのリスク資産が堅調に推移したことから、ハイブリッド証券のスプレッドは縮小傾向となり、ハイブリッド証券市場は全般的に堅調な展開となりました。しかし、2020年初以降は新型肺炎の感染拡大への懸念からスプレッドは急拡大し、ハイブリッド証券の価格は前作成期末対比下落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、2020年1月まではロシア市場への資金流入を背景に、円安ロシア・ルーブル高が進行しましたが、その後は新型肺炎の感染拡大への懸念から円高が進行し、前作成期末対比円高ロシア・ルーブル安の水準で当作成期を終えました。



(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－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－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、14.8%下落しました。

＜外国投資信託証券＞

当成期を通じて、ハイブリッド証券等の組入比率を高位に維持しました。

当成期は、米中貿易協議の動向や新型肺炎の感染拡大への懸念、それに対応するための各国中央銀行の金融政策などが相場の変動要因となるなか、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)は下落しました。

【組入銘柄の概要(2020年2月末現在)】

証券種別構成

証券種類	比率
期限付劣後債	69.8
永久劣後債	10.8
優先出資証券	5.5
その他	13.9

格付別構成

格付	比率
AAA格	—
AA格	2.4
A格	56.2
BBB格	40.5
BB格以下	1.0
無格付	—

組入上位5カ国

	国	比率
1	アメリカ	29.8
2	イギリス	14.8
3	フランス	12.0
4	オランダ	7.3
5	日本	5.8

組入上位10銘柄

	銘柄	証券種類	国	通貨	比率
1	CITIGROUP INC	期限付劣後債	アメリカ	米ドル	2.8
2	BNP PARIBAS	期限付劣後債	フランス	米ドル	2.4
3	WELLS FARGO CAPITAL X	優先出資証券	アメリカ	米ドル	2.4
4	TORONTO-DOMINION BANK	期限付劣後債	カナダ	米ドル	2.3
5	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	期限付劣後債	アメリカ	米ドル	2.3
6	DAI-ICHI LIFE INSURANCE	永久劣後債	日本	米ドル	2.2
7	ING BANK NV	期限付劣後債	オランダ	米ドル	2.2
8	GOLDMAN SACHS CAPITAL I	優先出資証券	アメリカ	米ドル	2.1
9	CREDIT AGRICOLE SA	期限付劣後債	フランス	米ドル	2.0
10	AXA SA	永久劣後債	フランス	英ポンド	2.0
組入銘柄数		96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74期	第75期	第76期	第77期	第78期	第79期
	2019年9月18日～ 2019年10月17日	2019年10月18日～ 2019年11月18日	2019年11月19日～ 2019年12月17日	2019年12月18日～ 2020年1月17日	2020年1月18日～ 2020年2月17日	2020年2月18日～ 2020年3月17日
当期分配金 (対基準価額比率)	60 1. 107%	60 1. 105%	60 1. 073%	60 1. 055%	60 1. 083%	60 1. 400%
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	3,071	3,085	3,103	3,120	3,135	3,151

(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＞

欧米経済は新型肺炎の感染拡大による経済活動の停滞を受けて、当面は潜在成長率を大きく下回る水準となることが予想され、欧米金利は低位で推移すると想定しています。

このような環境下、ハイブリッド証券のような相対的に利回りが高い商品は変動性が高い値動きとなる可能性はありますが、各国において財政および金融政策による景気対策が積極的に行われて市場の動搖が収まれば、再び資金が流入しやすい状態になると予想します。

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し、相対的に財務状況が健全であると考える米国、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を選別して投資する方針です。

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努める方針です。

○ 1万口当たりの費用明細

(2019年9月18日～2020年3月17日)

項目	第74期～第79期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 27	% 0.505	(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)	(0.153)	*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)	(18)	(0.339)	*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)	(0.013)	*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) その他の費用	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	27	0.510	
作成期間の平均基準価額は、5,410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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(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。

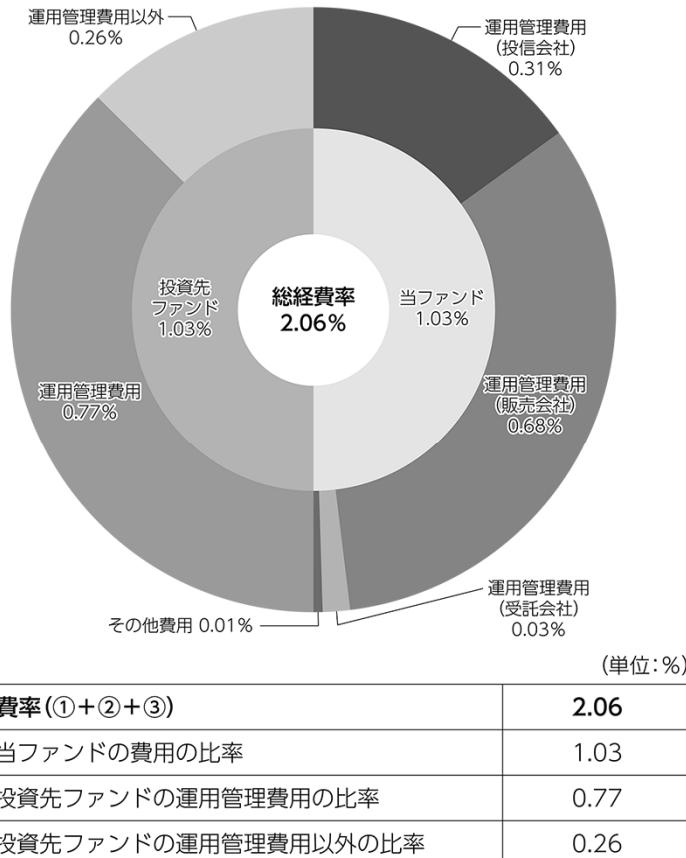
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）が支払った費用を含みません。

(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。

(参考情報)

○総経費率

作成期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は2.06%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当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。）です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

(注) 投資先ファンドの費用は、「東京海上ストラテジック・トラスト－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」の費用を基に算出しています。

○売買及び取引の状況

(2019年9月18日～2020年3月17日)

投資信託証券

銘柄			第74期～第79期			
			買付		売付	
			口数	金額	口数	金額
外國(邦貨建)	ケイマン	東京海上ストラテジック・トラスト－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－ロシア・ルーブルクラス	千口	千円	千口	千円
			2	11,000	9	44,000

(注) 金額は受渡代金です。

○利害関係人との取引状況等

(2019年9月18日～2020年3月17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

(2020年3月17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	口数	第73期末			第79期末			
		口数	評価額	比率	口数	評価額	比率	
東京海上ストラテジック・トラスト－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－ロシア・ルーブルクラス	千口	千口	千円	%	139	132	479,268	98.1
合計	139	132	479,268	98.1				

(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73期末		第79期末	
	口数	評価額	口数	評価額
東京海上マネーマザーファンド	千口	千円	9	10

○投資信託財産の構成

(2020年3月17日現在)

項目	第79期末	
	評価額	比率
投資信託受益証券	千円 479,268	% 96.2
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	18,697	3.8
投資信託財産総額	497,975	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	第74期末	第75期末	第76期末	第77期末	第78期末	第79期末
	2019年10月17日現在	2019年11月18日現在	2019年12月17日現在	2020年1月17日現在	2020年2月17日現在	2020年3月17日現在
(A) 資産	円 670,920,500	円 672,841,945	円 696,834,694	円 675,227,718	円 647,173,119	円 497,975,231
コール・ローン等	19,405,136	20,027,249	16,492,544	17,423,403	15,534,009	18,696,603
投資信託受益証券(評価額)	651,505,353	652,804,685	680,332,143	657,794,306	631,629,100	479,268,617
東京海上マネーマザーファンド(評価額)	10,011	10,011	10,007	10,009	10,010	10,011
(B) 負債	円 7,971,003	円 8,031,285	円 8,019,099	円 7,697,039	円 7,571,463	円 9,365,086
未払収益分配金	7,421,649	7,430,799	7,470,671	7,118,005	7,003,823	6,937,121
未払解約金	—	—	—	—	—	1,943,971
未払信託報酬	543,448	594,026	542,534	572,831	561,556	478,780
未払利息	31	38	29	15	13	44
その他未払費用	5,875	6,422	5,865	6,188	6,071	5,170
(C) 純資産額(A-B)	円 662,949,497	円 664,810,660	円 688,815,595	円 667,530,679	円 639,601,656	円 488,610,145
元本	1,236,941,535	1,238,466,507	1,245,111,973	1,186,334,187	1,167,303,891	1,156,186,981
次期繰越損益金	△ 573,992,038	△ 573,655,847	△ 556,296,378	△ 518,803,508	△ 527,702,235	△ 667,576,836
(D) 受益権総口数	1,236,941,535口	1,238,466,507口	1,245,111,973口	1,186,334,187口	1,167,303,891口	1,156,186,981口
1万口当たり基準価額(C/D)	5,360円	5,368円	5,532円	5,627円	5,479円	4,226円

(注) 当ファンドの第74期首元本額は1,239,776,178円、第74～79期中追加設定元本額は40,171,004円、第74～79期中一部解約元本額は123,760,201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74期	第75期	第76期	第77期	第78期	第79期
	2019年9月18日～ 2019年10月17日	2019年10月18日～ 2019年11月18日	2019年11月19日～ 2019年12月17日	2019年12月18日～ 2020年1月17日	2020年1月18日～ 2020年2月17日	2020年2月18日～ 2020年3月17日
(A) 配当等収益	円 9,760,938	円 9,776,598	円 9,865,956	円 9,458,247	円 9,305,171	円 9,245,871
受取配当金	9,761,424	9,777,237	9,866,339	9,458,833	9,305,400	9,246,357
受取利息	3	—	4	—	3	—
支払利息	△ 489	△ 639	△ 387	△ 586	△ 232	△ 486
(B) 有価証券売買損益	円 4,161,483	円 701,675	円 18,556,043	円 9,468,857	円 18,917,966	円 146,503,714
売買益	4,183,115	1,062	18,555,438	9,479,049	243,404	851,777
売買損	△ 21,632	△ 702,737	605	△ 10,192	△ 19,161,370	△147,355,491
(C) 信託報酬等	円 549,323	円 600,448	円 548,399	円 579,019	円 567,627	円 483,950
(D) 当期損益金(A+B+C)	13,373,098	8,474,475	27,873,600	18,348,085	△ 10,180,422	△137,741,793
(E) 前期繰越損益金	△129,240,198	△123,056,784	△121,085,939	△ 95,613,056	△ 82,614,821	△ 98,334,537
(F) 追加信託差損益金	△450,703,289	△451,642,739	△455,613,368	△434,420,532	△427,903,169	△424,563,385
(G) (配当等相当額)	(315,635,303)	(316,224,912)	(318,776,625)	(303,940,539)	(299,397,517)	(296,909,928)
(H) (売買損益相当額)	(△766,338,592)	(△767,867,651)	(△774,389,993)	(△738,361,071)	(△727,300,686)	(△721,473,313)
(G) 計(D+E+F)	△566,570,389	△566,225,048	△548,825,707	△511,685,503	△520,698,412	△660,639,715
(H) 収益分配金	△ 7,421,649	△ 7,430,799	△ 7,470,671	△ 7,118,005	△ 7,003,823	△ 6,937,121
次期繰越損益金(G+H)	△573,992,038	△573,655,847	△556,296,378	△518,803,508	△527,702,235	△667,576,836
追加信託差損益金	△450,703,289	△451,642,739	△455,613,368	△434,420,532	△427,903,169	△424,563,385
(配当等相当額)	(315,635,303)	(316,224,912)	(318,776,625)	(303,940,539)	(299,397,517)	(296,909,928)
(売買損益相当額)	(△766,338,592)	(△767,867,651)	(△774,389,993)	(△738,361,071)	(△727,300,686)	(△721,473,313)
分配準備積立金	64,297,107	65,921,484	67,625,488	66,271,073	66,616,152	67,463,376
繰越損益金	△187,585,856	△187,934,592	△168,308,498	△150,654,049	△166,415,218	△310,476,827

(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74期	第75期	第76期	第77期	第78期	第79期
	2019年9月18日～ 2019年10月17日	2019年10月18日～ 2019年11月18日	2019年11月19日～ 2019年12月17日	2019年12月18日～ 2020年1月17日	2020年1月18日～ 2020年2月17日	2020年2月18日～ 2020年3月17日
a. 配当等収益(費用控除後)	9,375,808円	9,176,150円	9,675,607円	9,168,911円	8,737,544円	8,761,921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	315,635,303円	316,224,912円	318,776,625円	303,940,539円	299,397,517円	296,909,928円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	62,342,948円	64,176,133円	65,420,552円	64,220,167円	64,882,431円	65,638,576円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	387,354,059円	389,577,195円	393,872,784円	377,329,617円	373,017,492円	371,310,425円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,131円	3,145円	3,163円	3,180円	3,195円	3,211円
g. 分配金	7,421,649円	7,430,799円	7,470,671円	7,118,005円	7,003,823円	6,937,121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74期	第75期	第76期	第77期	第78期	第79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。

○お知らせ

弊社ホームページアドレスを一部変更したことに伴い、2019年10月1日付で所要の約款変更を行いました。

○(参考情報)親投資信託の組入資産の明細

(2020年3月17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(10,900千口)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79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 8,000 (8,000)	千円 7,999 (7,999)	% 72.6 (72.6)	% — (—)	% — (—)	% — (—)	% 72.6 (72.6)
合計	8,000 (8,000)	7,999 (7,999)	72.6 (72.6)	— (—)	— (—)	— (—)	72.6 (72.6)

(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79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26年度第3回堺市公募公債	0.32	2,000	2,000	2020/3/26	
平成26年度第4回横浜市公債「ハマ債5」	0.14	6,000	5,999	2020/3/24	
合計		8,000	7,999		

(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－
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・レアルクラス／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－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（通貨選択性）」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めざします。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・レアルクラス＝ブラジル・レアル、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・レアル／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：MUFGルク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.

※資金動向および市況動向等によっては、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

2018年3月1日
～2019年2月28日

(円)

当期初における純資産額 42,714,633,045

収益

債券に係る受取利息（純額）	1,544,001,890
銀行預金に係る受取利息	17,672,843
収益合計	1,561,674,733

費用

管理事務代行報酬、管理報酬および保管機関報酬	(45,503,525)
代行協会員報酬	(6,395,380)
販売報酬	(75,782,830)
投資顧問報酬	(224,215,029)
当座借越に係る支払利息	(1,165,397)
その他の費用	(9,133,560)
諸税金	(3,067,278)
専門家報酬	(2,152,074)
副保管機関報酬	(1,920,846)
副管理者報酬	(9,100,690)
受託報酬	(3,679,843)
費用合計	(382,116,452)

投資純利益／（損失） 1,179,558,281

投資に係る実現純利益／（損失）	(137,625,157)
為替予約および為替先渡取引に係る実現純利益／（損失）	(1,633,277,934)
当期実現純利益／（損失）	(1,770,903,091)

以下に係る未実現純利益（損失）の増減

－投資	311,765,903
－為替予約および為替先渡取引	79,832,961
－その他の資産および負債の為替換算	60,592,908
	452,191,772

運用による純資産の増加／（減少）額 (139,153,038)

(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

2019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	CITIGROUP INC	期限付劣後債	2026/3/9	4.6	USD	1,253,222,736	3.7
アメリカ	MORGAN STANLEY	期限付劣後債	2027/4/23	3.95	USD	1,102,958,150	3.2
アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	期限付劣後債	2025/4/21	3.95	USD	1,093,490,305	3.2
アメリカ	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	期限付劣後債	2023/6/15	5.625	USD	1,040,993,359	3.1
アメリカ	WELLS FARGO CAPITAL X	優先出資証券	2036/12/15	5.95	USD	775,141,490	2.3
アメリカ	GOLDMAN SACHS CAPITAL I	優先出資証券	2034/2/15	6.345	USD	677,890,487	2.0
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	その他	2028/7/23	4.203	USD	581,573,310	1.7
アメリカ	DIGITAL REALTY TRUST LP	その他	2028/4/15	4.45	USD	575,861,902	1.7
アメリカ	BANK OF NY MELLON CORP	期限付劣後債	2028/7/30	3	USD	457,816,898	1.3
アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	期限付劣後債	2038/5/14	7.75	USD	445,719,328	1.3
アメリカ	HSBC BANK USA NA	期限付劣後債	2039/1/15	7	USD	431,068,887	1.3
アメリカ	CHUBB INA HOLDINGS INC	その他	2037/9/15	2.5	EUR	336,026,027	1.0
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	期限付劣後債	2026/12/1	3.625	USD	322,748,946	1.0
アメリカ	HARTFORD FINL SVCS GRP	期限付劣後債	2019/4/1	4.80875	USD	237,337,851	0.7
アメリカ	METLIFE INC	期限付劣後債	2031/12/15	6.4	USD	235,163,493	0.7
アメリカ	PRINCIPAL FINANCIAL GROU	期限付劣後債	2020/5/15	4.7	USD	219,006,501	0.6
アメリカ	VOYA FINANCIAL INC	期限付劣後債	2028/1/23	4.7	USD	185,685,096	0.5
アメリカ	CITIGROUP INC	その他	2039/7/15	8.125	USD	167,006,297	0.5
アメリカ	SUNTRUST BANKS INC	優先出資証券	2027/12/15	5.125	USD	166,702,144	0.5
小計(金額・比率)						10,305,413,207	30.4
イギリス	SANTANDER UK PLC	期限付劣後債	2023/11/7	5	USD	1,203,606,905	3.5
イギリス	STANDARD CHARTERED PLC	期限付劣後債	2027/2/19	4.3	USD	649,464,579	1.9
イギリス	ROYAL BK SCOTLND GRP PLC	その他	2028/5/18	4.892	USD	620,286,693	1.8
イギリス	PRUDENTIAL PLC	永久劣後債	2023/1/20	4.875	USD	414,836,921	1.2
イギリス	ROYAL BK SCOTLND GRP PLC	期限付劣後債	2023/6/10	6.1	USD	403,394,960	1.2
イギリス	HISCOX LTD	期限付劣後債	2025/11/24	6.125	GBP	387,066,041	1.1
イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	期限付劣後債	2026/11/23	4.375	USD	357,962,359	1.1
イギリス	AVIVA PLC	期限付劣後債	2023/7/5	6.125	EUR	291,986,774	0.9
イギリス	PHOENIX GRP HLD PLC	永久劣後債	2028/4/26	5.75	GBP	242,249,021	0.7
小計(金額・比率)						4,570,854,253	13.5
イタリア	INTESA SANPAOLO SPA	期限付劣後債	2024/6/26	5.017	USD	154,376,351	0.5
小計(金額・比率)						154,376,351	0.5
オランダ	ING BANK NV	期限付劣後債	2023/9/25	5.8	USD	790,863,693	2.3
オランダ	COOPERATIEVE RABOBANK UA	永久劣後債	2020/6/29	5.5	EUR	612,694,338	1.8
オランダ	ABN AMRO BANK NV	期限付劣後債	2023/3/27	4.4	USD	420,084,484	1.2
オランダ	DE VOLKSBANK NV	期限付劣後債	2020/11/5	3.75	EUR	245,000,302	0.7
オランダ	NN GROUP NV	永久劣後債	2026/1/15	4.5	EUR	225,730,701	0.7
オランダ	ING GROEP NV	永久劣後債	2022/4/16	6.875	USD	214,678,047	0.6
小計(金額・比率)						2,509,051,565	7.4
スイス	ZURICH FINANCE (UK) PLC	永久劣後債	2022/10/2	6.625	GBP	668,794,500	2.0
スイス	ELM BV (HELVETIA SCHWEIZ)	期限付劣後債	2027/9/29	3.375	EUR	349,107,533	1.0
スイス	UBS GROUP FUNDING SWITZE	その他	2025/9/24	4.125	USD	339,500,376	1.0
スイス	UBS GROUP FUNDING SWITZE	優先出資証券	2023/1/31	5	USD	194,297,915	0.6
小計(金額・比率)						1,551,700,324	4.6
スペイン	BANCO SANTANDER SA	期限付劣後債	2027/1/19	3.125	EUR	399,552,858	1.2
スペイン	MAPFRE SA	期限付劣後債	2027/3/31	4.375	EUR	269,758,132	0.8
スペイン	CAIXABANK SA	期限付劣後債	2023/7/14	2.75	EUR	140,064,944	0.4
小計(金額・比率)						809,375,934	2.4
ドイツ	LB BADEN-WUERTTEMBERG	期限付劣後債	2025/6/16	3.625	EUR	687,315,243	2.0
ドイツ	MUNICH RE	期限付劣後債	2029/5/26	3.25	EUR	162,397,923	0.5
小計(金額・比率)						849,713,166	2.5
ノルウェー	DNB BANK ASA	期限付劣後債	2022/3/1	1.25	EUR	496,584,011	1.5
ノルウェー	DNB BANK ASA	永久劣後債	2020/3/26	5.75	USD	234,587,855	0.7
小計(金額・比率)						731,171,866	2.2

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 (%)
フランス	BPCE SA	期限付劣後債	2025/3/15	4.5	USD	1,380,362,063	4.1
フランス	BNP PARIBAS	期限付劣後債	2025/9/28	4.375	USD	856,290,302	2.5
フランス	AXA SA	永久劣後債	2026/3/4	5.453	GBP	746,109,873	2.2
フランス	CREDIT AGRICOLE SA	期限付劣後債	2025/3/17	4.375	USD	712,362,479	2.1
フランス	CNP ASSURANCES	期限付劣後債	2029/2/5	2.75	EUR	335,396,531	1.0
フランス	CREDIT AGRICOLE ASSRNCE	期限付劣後債	2028/1/29	2.625	EUR	234,663,329	0.7
小計 (金額・比率)						4,265,184,577	12.6
日本	DAI-ICHI LIFE INSURANCE	永久劣後債	2024/10/28	5.1	USD	788,974,785	2.3
日本	FUKOKU MUTUAL LIFE INSUR	永久劣後債	2025/7/28	5	USD	480,590,698	1.4
日本	MIZUHO FIN GRP CAYMAN 3	期限付劣後債	2024/3/27	4.6	USD	204,517,769	0.6
日本	SOMPO JAPAN NIPPONKOA	期限付劣後債	2023/3/28	5.325	USD	148,452,261	0.4
小計 (金額・比率)						1,622,535,513	4.8
カナダ	TORONTO-DOMINION BANK	期限付劣後債	2026/9/15	3.625	USD	797,283,867	2.3
カナダ	BANK OF MONTREAL	期限付劣後債	2027/12/15	3.803	USD	673,715,068	2.0
小計 (金額・比率)						1,470,998,935	4.3
アイルランド	BANK OF IRELAND GROUP	その他	2023/8/29	1.375	EUR	730,062,050	2.2
アイルランド	AIB GROUP PLC	その他	2023/3/29	1.5	EUR	672,621,177	2.0
小計 (金額・比率)						1,402,683,227	4.1
シンガポール	DBS GROUP HOLDINGS LTD	期限付劣後債	2023/4/11	1.5	EUR	692,948,561	2.0
小計 (金額・比率)						692,948,561	2.0
ベルギー	KBC GROUP NV	期限付劣後債	2024/9/18	1.625	EUR	352,983,241	1.0
ベルギー	BELFIUS BANK SA/NV	その他	2024/10/26	1	EUR	249,522,146	0.7
小計 (金額・比率)						602,505,387	1.8
バミューダ諸島	XLIT LTD	期限付劣後債	2027/6/29	3.25	EUR	156,854,950	0.5
小計 (金額・比率)						156,854,950	0.5
総計						31,695,367,816	93.4

(注) 管理会社である「ルクセンブルク三義UFJ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2019年2月28日現在のデータです。邦貨換算額は、2019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) 債還年月日は、線上償還条項が付与されている銘柄は基準日以降最初の線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12期（決算日 2019年8月15日）

(計算期間 2018年8月16日～2019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、一印は組み入れまたは売買がないことなどを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	参考指數		債組入比率	純資産額
		期騰	期落		
8期(2015年8月17日)	円 10,112	% 0.0	100.89	% 0.07	% 72.5 百万円 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
12期(2019年8月15日)	10,113	△0.0	100.75	△0.06	69.4 10

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	参考指數		債組入比率	券率
		騰	落		
(期首) 2018年8月15日	円 10,116	% —	100.81	% —	% 74.1
8月末	10,116	0.0	100.80	△0.00	74.1
9月末	10,113	△0.0	100.80	△0.01	74.1
10月末	10,114	△0.0	100.79	△0.01	74.2
11月末	10,115	△0.0	100.79	△0.02	74.1
12月末	10,116	0.0	100.78	△0.02	74.3
2019年1月末	10,116	0.0	100.78	△0.03	74.3
2月末	10,115	△0.0	100.77	△0.03	74.2
3月末	10,115	△0.0	100.77	△0.04	74.0
4月末	10,115	△0.0	100.76	△0.04	73.1
5月末	10,116	0.0	100.76	△0.05	72.5
6月末	10,116	0.0	100.75	△0.05	78.3
7月末	10,112	△0.0	100.75	△0.06	69.4
(期末) 2019年8月15日	10,113	△0.0	100.75	△0.06	69.4

(注) 謄落率は期首比です。

参考指數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

(2018年8月16日～2019年8月15日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：10,116円
期 末：10,113円
騰落率：△ 0.0%

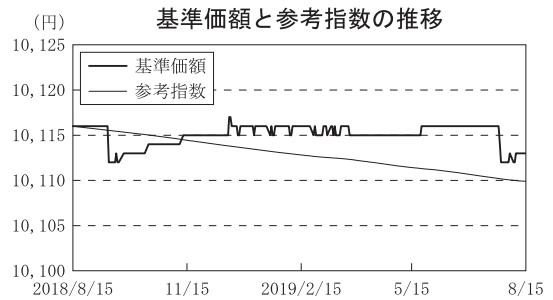
◇基準価額の主な変動要因

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



(注) 参考指標は、期首(2018年8月15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) 参考指標は、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、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目する日銀の当座預金残高は、370兆円台から410兆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、-0.35%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努める方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2018年8月16日～2019年8月15日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2018年8月16日～2019年8月15日)

公社債

		買付額	売付額
国 内	地方債証券	千円 36,033	千円 — (36,500)
	特殊債券	6,017	— (6,000)

(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

(2018年8月16日～2019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

(2019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						残存期間別組入比率
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	5年以上	2年以上	2年未満
地方債証券	千円 7,500 (7,500)	千円 7,498 (7,498)	% 69.4 (69.4)	% — (—)	% — (—)	% — (—)	% 69.4 (69.4)
合計	7,500 (7,500)	7,498 (7,498)	69.4 (69.4)	— (—)	— (—)	— (—)	69.4 (69.4)

(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	
第30回兵庫県民債	0.2	5,000	4,998	2019/10/16
平成26年度第2回横浜市公債「ハマ債5」	0.18	1,500	1,499	2019/9/24
第41回川崎市公募公債(5年)	0.163	1,000	1,000	2019/9/20
合計		7,500	7,498	

(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

(2019年8月15日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
千円	%	
公社債	7,498	69.4
コール・ローン等、その他	3,310	30.6
投資信託財産総額	10,808	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年8月15日現在)

項目	当期末
(A) 資産	円
コール・ローン等	10,808,779
公社債(評価額)	3,305,139
未収利息	7,498,650
前払費用	703
	4,287
(B) 負債	2
未払利息	2
(C) 純資産総額(A-B)	10,808,777
元本	10,687,958
次期繰越損益金	120,819
(D) 受益権総口数	10,687,958口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,113円

(注) 当親ファンドの期首元本額は10,668,179円、期中追加設定元本額は267,979円、期中一部解約元本額は248,200円です。

<元本の内訳>

東京海上Rogge世界ハイリッジ証券ファンド(通貨選択型) マネーブール・ファンド	1,454,904円
東京海上・東南アジア株式ファンド	1,100,000円
東京海上・アジア中小型成長株ファンド	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Rogge世界ハイリッジ証券ファンド(通貨選択型) 円コース(毎月分配型)	991,474円
東京海上Rogge世界ハイリッジ証券ファンド(通貨選択型) 豪ドルコース(毎月分配型)	991,474円
東京海上Rogge世界ハイリッジ証券ファンド(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・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Roggeグローバルインフラ・ハイ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Roggeグローバルインフラ・ハイ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Roggeグローバルインフラ・ハイ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Roggeグローバルインフラ・ハイ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Rogge世界ハイリッジ証券ファンド(通貨選択型) 米ドルコース(毎月分配型)	9,915円
東京海上Rogge世界ハイリッジ証券ファンド(通貨選択型) ユーロコース(毎月分配型)	9,915円
東京海上Rogge世界ハイリッジ証券ファンド(通貨選択型) 資源国通貨パケットコース(毎月分配型)	9,915円
東京海上Rogge世界ハイリッジ証券ファンド(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Rogge世界ハイリッジ証券ファンド(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Rogge世界ハイリッジ証券ファンド(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Rogge世界ハイリッジ証券ファンド(年1回決算型)	9,896円
東京海上Rogge世界ハイリッジ証券ファンド(年1回決算型)	9,896円
東京海上・がんとたかう投信(為替ヘッジなし)(年1回決算型)	9,890円
東京海上・がんとたかう投信(為替ヘッジあり)(年1回決算型)	9,890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 (2018年8月16日～2019年8月15日)

項目	当期
(A) 配当等収益	円
受取利息	50,762
支払利息	52,889
(B) 有価証券売買損益	△ 2,127
売買損	△ 54,120
(C) 当期損益金(A+B)	△ 54,120
(D) 前期繰越損益金	△ 3,358
(E) 追加信託差損益金	123,993
(F) 解約差損益金	3,061
(G) 計(C+D+E+F)	120,819
次期繰越損益金(G)	120,819

(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。