

**【表紙】**

**【提出書類】** 有価証券報告書

**【提出先】** 関東財務局長

**【提出日】** 平成25年6月17日

**【計算期間】** 第3特定期間(自平成24年9月19日至平成25年3月18日)  
(注1)  
第3期(自平成24年9月19日至平成25年3月18日)(注2)

**【ファンド名】** 東京海上Rogge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)  
東京海上Rogge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)  
東京海上Rogge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)  
東京海上Rogge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)  
東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド  
(通貨選択型)ブラジル・リアルコース(毎月分配型)  
東京海上Rogge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)  
東京海上Rogge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

**【発行者名】** 東京海上アセットマネジメント投信株式会社

**【代表者の役職氏名】** 取締役社長 大場 昭義

**【本店の所在の場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目3番1号

**【事務連絡者氏名】** 尾崎 正幸

**【連絡場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目3番1号

**【電話番号】** 03-3212-8421

**【縦覧に供する場所】** 該当なし

(注1)「円コース(毎月分配型)」、「米ドルコース(毎月分配型)」、「ユーロコース(毎月分配型)」、「豪ドルコース(毎月分配型)」、「ブラジル・リアルコース(毎月分配型)」、「資源国通貨バスケットコース(毎月分配型)」についての計算期間です。

(注2)「マネープール・ファンド」についての計算期間です。

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

各コース

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。

マネープール・ファンド

安定した収益の確保を目指して安定運用を行います。

基本的性格

当ファンドの商品分類表および属性区分表は、以下の通りです。

東京海上Rogge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）

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信
	内外	その他資産 ( ) 資産複合

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)		
	年2回	日本		
	年4回	北米	ファミリーファン ド	あり (フルヘッジ)
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
不動産投信	その他	中南米	ファンド・オブ ・ファンズ	なし
その他資産(投資信託証券 (債券(その他債券)))	( )	アフリカ		
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東) エマージング		

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

投資形態が、ファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資することとなりますので、商品分類表と属性区分表の投資対象資産が異なります。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

東京海上Rogge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)  
 東京海上Rogge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)  
 東京海上Rogge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)  
 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアルコース(毎月分配型)  
 東京海上Rogge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)

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
		債券
追加型投信	海外	不動産投信
	内外	その他資産 ( )
		資産複合

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)		
	年2回	日本		
	年4回	北米	ファミリーファン ド	あり
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
不動産投信	その他	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産(投資信託証券 (債券(その他債券)))	( )	アフリカ		
		中近東 (中東)		
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

投資形態が、ファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資することとなりますので、商品分類表と属性区分表の投資対象資産が異なります。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

東京海上Rogge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

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)

単位型投信	国内	株式
		債券
追加型投信	海外	不動産投信
	内外	その他資産 ( )
		資産複合

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル	
	年2回	日本	
	年4回	北米	
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	欧州	ファミリーファンド
	年12回 (毎月)	アジア	
	日々	オセアニア	
不動産投信	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ファンズ
その他資産(投資信託証券 (債券(一般)))		アフリカ	
		中近東 (中東)	
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング	

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。  
投資形態が、ファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資することとなりますので、商品分類表と属性区分表の投資対象資産が異なります。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型投信	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

	不動産投信(リート)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF(マネー・マネージメント・ファンド)	一般社団法人投資信託協会の「MMF等の運営に関する規則」に定められるMMFをいいます。
	MRF(マネー・リザーブ・ファンド)	一般社団法人投資信託協会の「MMF等の運営に関する規則」に定められるMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	特殊型	目論見書または投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

商品分類の定義は、一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」をもとに委託会社が作成しております。

#### 属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	目論見書または投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	目論見書または投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	目論見書または投資信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	目論見書または投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	目論見書または投資信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		格付等クレジットによる属性	目論見書または投資信託約款において、上記債券の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記債券に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記します。
	不動産投信		目論見書または投資信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産		目論見書または投資信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
資産複合	資産配分固定型	目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。	
	資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。	
決算頻度	年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年4回	目論見書または投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。	

	年6回(隔月)	目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回(毎月)	目論見書または投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々	目論見書または投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東(中東)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会の「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定されるファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	目論見書または投資信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	目論見書または投資信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	TOPIX	目論見書または投資信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記指数にあてはまらない全てのものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	目論見書または投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	目論見書または投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。

ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	目論見書または投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
その他型	目論見書または投資信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

属性区分の定義は、一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」をもとに委託会社が作成しております。

#### 信託金の限度額

各コースの信託金限度額は、信託約款の定めにより各2,000億円となっています。また、「マネーパブル・ファンド」の信託金限度額は、信託約款の定めにより1兆円となっています。上記の各限度額は、受託会社と合意のうえ、変更することができます。

#### ファンドの特色

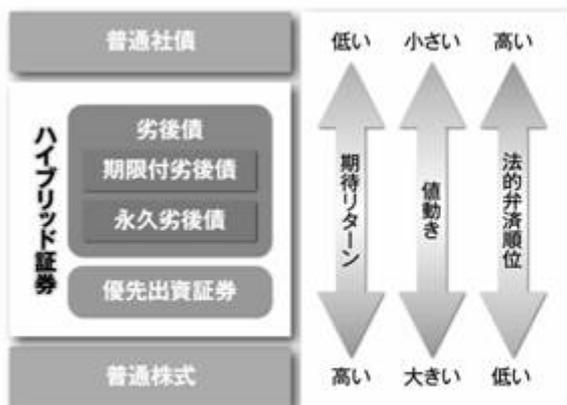
### 1 世界の金融機関が発行するハイブリッド証券等を主要投資対象とします ('マネーパブル・ファンド'を除く)。

- 各コースは、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する円建ての外国投資信託「東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Rogge<sup>SP</sup>グローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド」(以下「外国投資信託」といいます)と、円建ての国内籍の投資信託である「東京海上マネーマザーファンド」を投資対象とするファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。
- 「マネーパブル・ファンド」は、円建ての短期公社債等を実質的な投資対象とし、安定した収益の確保を図ることを目的として運用を行います。

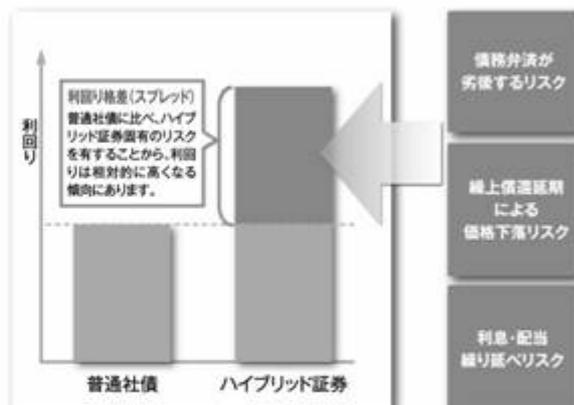
#### ハイブリッド証券とは

- ◆ハイブリッド証券とは「資本」と「負債」の性格を併せ持った証券で、具体的には、劣後債(期限付劣後債、永久劣後債)、優先出資証券等があります。
- ◆ハイブリッド証券は「満期償還」「繰上償還」「利息(または配当)」等が定められていることから債券(発行体にとっての「負債」)に類似した性格を持つ一方で、普通社債と比較して債務不履行(デフォルト)時の支払い順位が劣後する点や発行体を取り巻く経済状況等により利息(または配当)の支払いの繰り延べまたは停止や繰上償還が延期されることがある点等から、発行体にとっては「資本」としての性格を併せ持っており、株式と債券の中間に位置すると考えられます。

#### ハイブリッド証券のイメージ図



#### ハイブリッド証券のスプレッド(イメージ図)



※上記以外にも、流動性リスクや信用リスク等があります。

**劣後債**：発行体の経営破たん時に、借入金や普通社債等よりも債務弁済の順位が劣る債券のこと。その分、普通社債等比べて利率が高くなります。償還期限に定めのない「永久劣後債」と、償還期限がある「期限付劣後債」があります。

**優先出資証券**：配当や残余財産請求権(企業が解散する際に、負債<他人資本>を返済し、なお財産が残る場合、株主はその持ち株数に応じて残った財産の分配を受けることができるという権利)が普通株に対して優先される優先株に類似した性質を持つ有価証券です。

※上記は、ハイブリッド証券に関する一般的な内容を示したものであり、必ずしもすべてを表すものではありません。また、上記に当てはまらない場合があります。

## 2 投資対象は取得時において投資適格(BBB格)相当以上を有するものとします。

- 外国投資信託が投資対象とするハイブリッド証券等は、取得時において、ムーディーズ社、S&P社、フィッチ社（2013年4月末時点）のいずれかより投資適格相当以上の格付けを取得しているハイブリッド証券等に限ります。  
※取得後に格付けが投資適格相当未満に下がった場合においても、個別銘柄分析等による投資判断に基づいて当該銘柄の保有を継続する場合があります。

格付け(S&P社)と信用力	
投資適格格付	AAA
	AA
	A
投資適格格付	BBB
	BB
	B
	CCC
	CC
	C
	D

## 3 「東京海上Rogge<sup>ローグ</sup>世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)」は、投資対象とする外国投資信託における為替取引手法の異なる6本のコースおよび「マネーブル・ファンド」から構成されます。

- 「円コース(毎月分配型)」においては、投資対象である外国投資信託の組入資産について、原則として対日本円での為替ヘッジを行います。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。
- 「円コース(毎月分配型)」以外の各コースにおいては、投資対象である外国投資信託の組入資産について、原則として当該通貨での為替取引を行います。(例えば「豪ドルコース(毎月分配型)」においては、「原資産通貨売り/豪ドル買い」等)
- 「資源国通貨バスケットコース(毎月分配型)」においては、豪ドル、ブラジル・リアル、南アフリカ・ランドで概ね3分の1ずつ為替取引を行います。
- 「円コース(毎月分配型)」の対日本円での為替ヘッジおよび「円コース(毎月分配型)」以外の各コースの当該通貨での為替取引は外国投資信託において行います。
- 各コース間および各コースと「マネーブル・ファンド」間でスイッチングが可能です。  
※販売会社によっては、一部のファンドのみの取扱いとなる場合やスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

## ● ファンドの仕組み



※各コースは、ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。

※「マネーブル・ファンド」は、ファミリーファンド方式で運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、受益者の投資資金をペーパーファンドとしてまとめ、その資金を主としてマザーファンド(親投資信託)に投資することにより、実質的な運用をマザーファンドにて行う方式です。ペーパーファンドがマザーファンドに投資するに際しての投資コストはかかりません。また、他のペーパーファンドが、マザーファンドへ投資することがあります。

○外国投資信託において、米ドル建以外のハイブリッド証券等に関しては、原則として原資産通貨売り/米ドル買いの為替取引を行った後、米ドル売り/各コースの通貨買いの為替取引を行います。

○各コースは、「東京海上ストラテジック・トラスト-東京海上Rogge<sup>ローグ</sup>グローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド」の他に、「東京海上マネーマザーファンド」にも投資します。

○「マネーブル・ファンド」の購入は、各コースからのスイッチングの場合のみとします。

## 4 ハイブリッド証券等の実質的な運用は「東京海上Rogge社」が行います。

- 外国投資信託におけるハイブリッド証券等の運用の指図(米ドル以外の通貨建資産の対米ドルでの為替取引を含みます)は「東京海上Rogge社」(英国ロンドン)が行います。
  - 外国投資信託における各クラスの対日本円での為替ヘッジおよび日本円を除く当該通貨での為替取引は、「東京海上アセットマネジメント投信」が行います。
- 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。

## 外国投資信託の副投資顧問会社「東京海上Rogge社」について

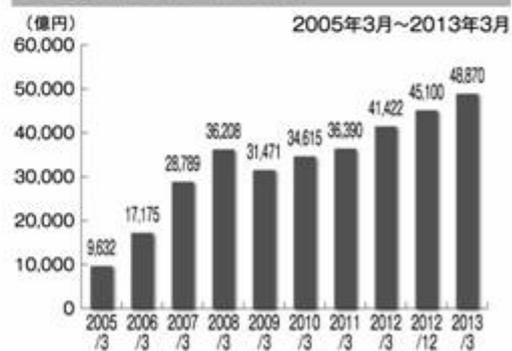
社名	東京海上Rogge社 (Tokio Marine Rogge Asset Management Limited)	
所在地	英国ロンドン	
設立	2003年9月	
設立母体(出資比率)	東京海上アセットマネジメント投信	50%
	Rogge社(Rogge Global Partners PLC)	50%
受託残高	投資一任契約受託残高	1兆1,667億円
	投資信託受託残高	1,710億円
		(2013年3月末現在)

東京海上Rogge社は、英国のグローバル債券運用のスペシャリストであるRogge社の運用ノウハウを活用し、運用を行います。

グローバル債券運用に特化する  
少数精鋭のプロフェッショナル集団、Rogge社の横顔。

- 設立当初からグローバル債券運用に特化  
国際債券市場の中心である英国ロンドンで1984年に設立されたRogge社は、当初からグローバル債券の運用に特化した会社です。
- 約4.9兆円の受託残高(2013年3月末現在)  
欧米やアジアに多くの顧客を抱えています。
- 経験豊富な運用チームが信頼感を醸成  
平均20年以上の経験を有するシニアファンドマネージャーを中心にチーム運用を行っています。

### Rogge社 受託残高の推移



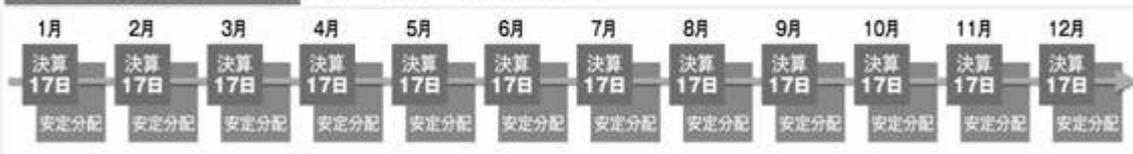
※ 受託残高は、東京海上Rogge社受託分を含みます。  
出所：東京海上Rogge社のデータを基に東京海上アセットマネジメント投信作成。

## 5 年12回の毎決算時に、原則として毎月分配を行います(「マネーボール・ファンド」を除く)。

- 毎月17日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とし、原則として毎決算時に安定分配を継続的に行うことを目指します。収益分配金額は、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。

(注)「安定分配を継続的に行う」としていますが、これは、運用による収益が安定したものになることや基準価額が安定的に推移すること等を示唆するものではありません。また、基準価額の水準、運用の状況等によっては安定分配とならない場合があることにご留意ください。

(各コース)分配のイメージ図 (決算日が休業日の場合は翌営業日)



- 「マネーボール・ファンド」は、年2回決算を行い、収益分配金額は、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。

※ 分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

※ 上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について、示唆・保証するものではありません。

## 収益分配金に関する留意事項

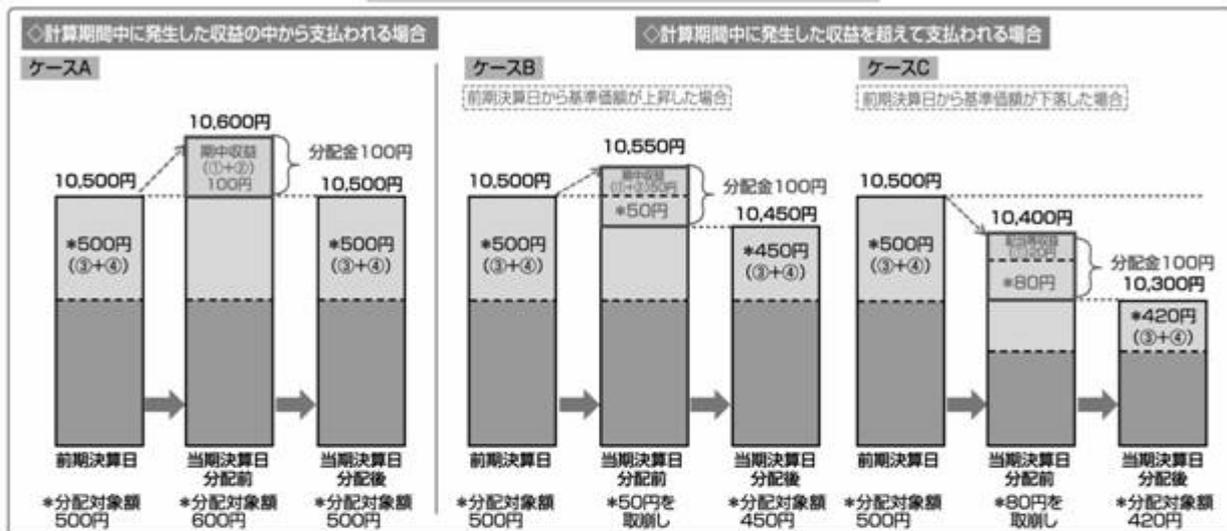
■投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

投資信託で分配金が支払われるイメージ



■分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

### 分配金と基準価額の関係(イメージ)



分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

①配当等収益(経費控除後)、②有価証券売買益・評価益(経費控除後)、③分配準備積立金、④収益調整金

上記はイメージ図であり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。上図のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

ケースA: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円

ケースB: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円

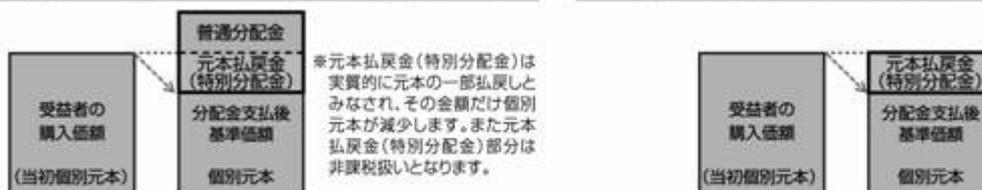
ケースC: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

■受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全額が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

◇分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

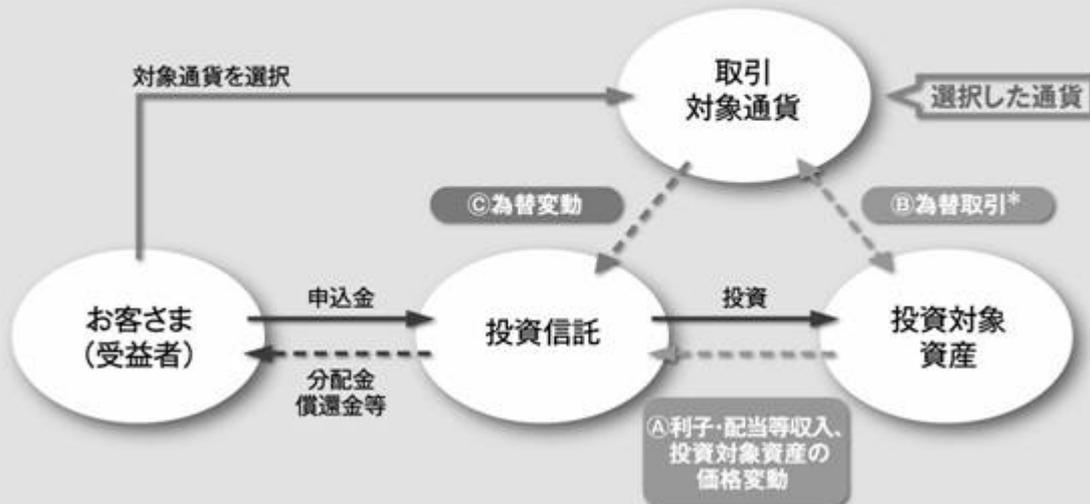
◇分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金：個別元本(受益者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の受益者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の(特別分配金) 額だけ減少します。

## 通貨選択型の投資信託の収益のイメージ図



\*取引対象通貨が円以外の場合には、当該取引対象通貨の対円での為替リスクが発生することに留意が必要です。

■ 通貨選択型の投資信託は、株式や債券等といった投資対象資産に加えて、為替取引の対象となる円以外の通貨も選択することができるよう設計された投資信託です。

■ 通貨選択型の投資信託の収益源としては、以下の3つの要素が挙げられます。これらの収益源に相応してリスクが内在していることに注意が必要です。

## ① 投資対象資産による収益(上図A部分)

- ・投資対象資産が値上がりした場合や利子・配当が支払われた場合は、基準価額の上昇要因となります。
- ・逆に、投資対象資産が値下がった場合には、基準価額の下落要因となります。

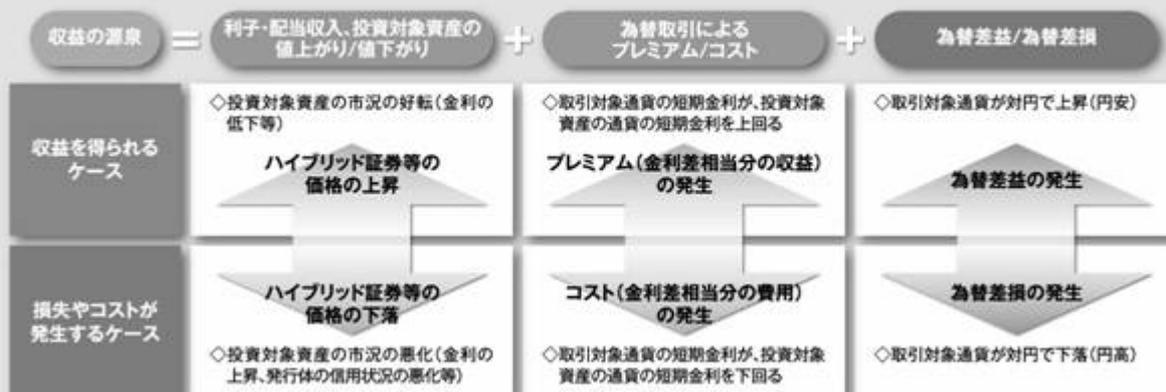
## ② 為替取引によるプレミアム収益(金利差相当分の収益)(上図B部分)

- ・「選択した通貨」(コース)の短期金利が、投資信託の「投資対象資産の通貨」の短期金利よりも高い場合は、その金利差による「為替取引によるプレミアム(金利差相当分の収益)」が期待できます。
- ・逆に、「選択した通貨」(コース)の短期金利のほうが低い場合には、「為替取引によるコスト(金利差相当分の費用)」が生じます。
- ・なお、「選択した通貨」と「投資対象資産の通貨」が同一通貨の場合、為替取引によるプレミアム(金利差相当分の収益)や為替取引によるコスト(金利差相当分の費用)は発生しません。
- ※新興国通貨の場合等は、金利差がそのまま反映されない場合があります。

## ③ 為替変動による収益(上図C部分)

- ・上図B部分とは異なり、上図C部分については為替取引を行っていないため、「選択した通貨」(円を除く、以下同じ)の円に対する為替変動の影響を受けることとなります。
- ・「選択した通貨」の対円レートが上昇(円安)した場合は、為替差益を得ることができます。
- ・逆に、「選択した通貨」の対円レートが下落(円高)した場合は、為替差損が発生します。

■ これまで説明しました内容についてまとめますと、以下のようになります。



## 主な投資制限

### 各コース

- 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。

### マネーボール・ファンド

- 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。(ただし、転換社債の転換、新株引受権の行使および新株予約権の行使により取得する場面に限ります。)
- 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。



投資信託／総合部門  
**最優秀賞**  
R&I Fund Award 2013

投資信託／外国債券総合部門 **最優秀賞**  
東京海上アセットマネジメント投信株式会社

東京海上アセットマネジメント投信株式会社は、格付投資情報センター(R&I)主催の「R&Iファンド大賞 2013」において、投資信託／外国債券総合部門の最優秀賞を受賞しました。

「R&Iファンド大賞」は、過去のデータに基づいたものであり、将来のパフォーマンスを保証するものではありません。当大賞は、投資の参考となる情報を提供することのみを目的としており、投資家に当該ファンドの購入、売却、保有を推奨するものではありません。また、R&Iの顧客に対して提供している定性評価情報とは関係ありません。当大賞は信頼すべき情報に基づいてR&Iが算出したものであり、その正確性及び完全性は必ずしも保証されていません。当大賞は、信用格付業ではなく、金融商品取引業等に関する内閣府令第299条第1項第28号に規定されるその他業務(信用格付業以外の業務であり、かつ、関連業務以外の業務)です。当該業務に関しては、信用格付行為に不当な影響を及ぼさないための措置が法令上要請されています。当大賞に関する著作権その他の権利は、R&Iに帰属します。R&Iの許諾無く、これらの情報を使用(複製、改変、送信、頒布、切除を含む)することを禁じます。「投資信託／総合部門」の各カテゴリーについては、受賞運用会社の該当ファンドの平均的な運用実績を評価したもので、必ずしも受賞運用会社の全ての個別ファンドそれぞれについて運用実績が優れていることを示すものではありません。

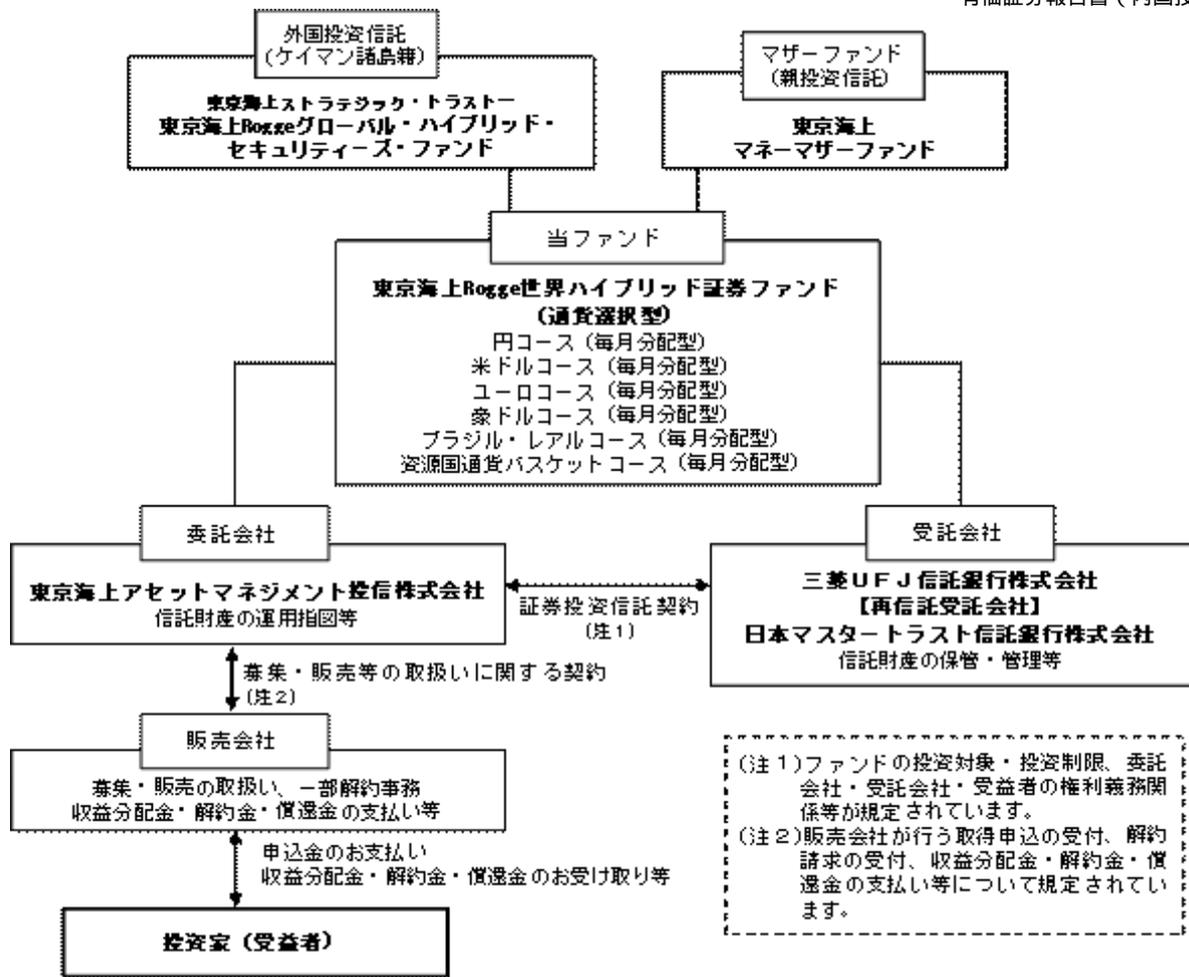
## (2) 【ファンドの沿革】

平成23年11月8日 ファンドの設定、運用開始

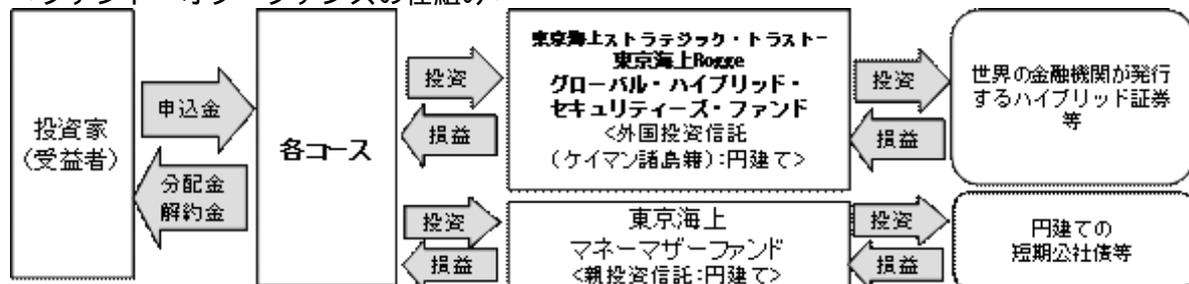
## (3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み

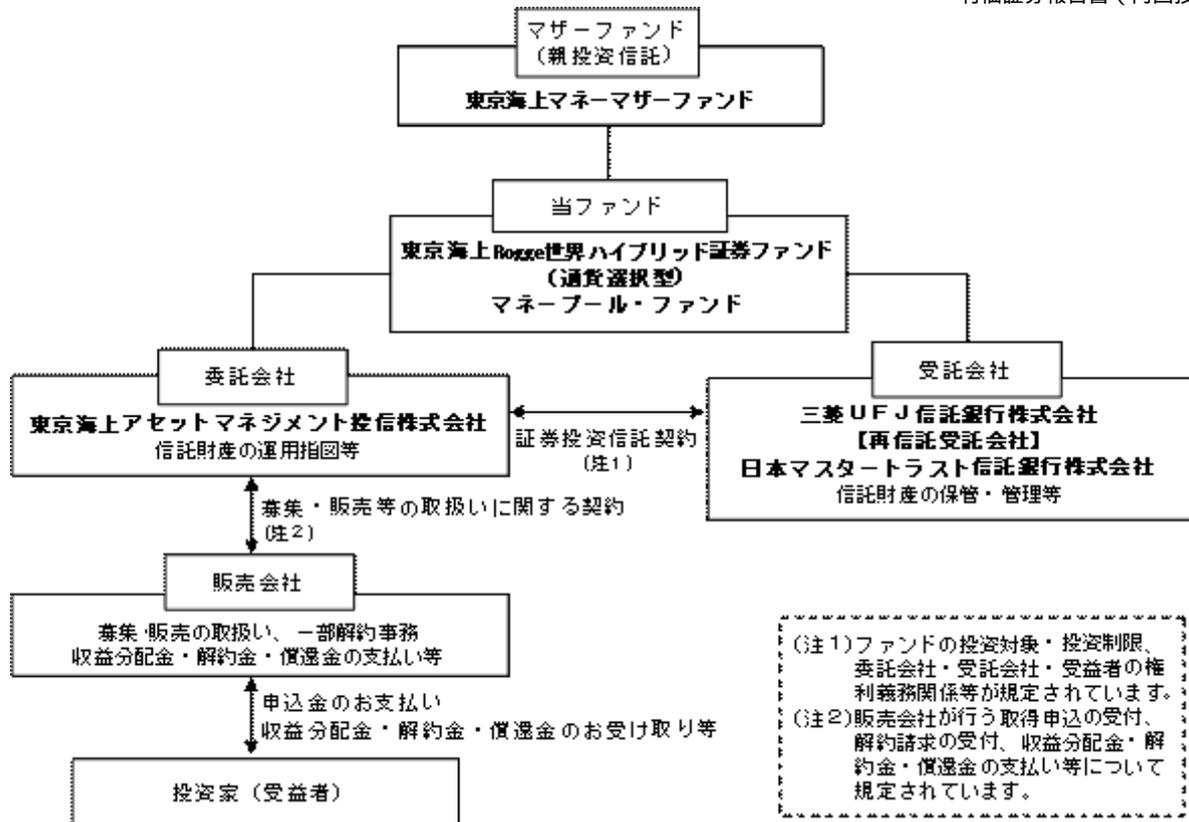
各コース



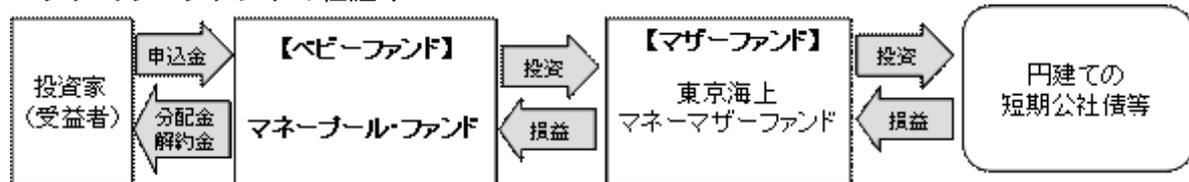
### <ファンド・オブ・ファンズの仕組み>



### マネープール・ファンド



### <ファミリーファンドの仕組み>



「ファミリーファンド方式」とは、受益者の投資資金をベビーファンドとしてまとめ、その資金を主としてマザーファンド（親投資信託）に投資することにより、実質的な運用をマザーファンドにて行う方式です。ベビーファンドがマザーファンドに投資するに際しての投資コストはかかりません。また、他のベビーファンドが、マザーファンドへ投資することがあります。

### 委託会社の概況

- ・名称 東京海上アセットマネジメント投信株式会社
- ・資本金の額 20億円（平成25年4月末日現在）
- ・会社の沿革

昭和60年12月	東京海上グループ（現：東京海上日動グループ）等の出資により、資産運用ビジネスの戦略的位置付けで、東京海上エム・シー投資顧問株式会社の社名にて資本金2億円で設立
昭和62年2月	投資顧問業者として登録
同年6月	投資一任業務認可取得
平成3年4月	国内および海外年金の運用受託を開始
平成10年5月	東京海上アセットマネジメント投信株式会社に社名変更し、投資信託法上の委託会社としての免許取得
平成19年9月	金融商品取引業者として登録

- ・大株主の状況（平成25年4月末日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
東京海上日動火災保険株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目2番1号	38,300株	100.0%

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

各コース

#### 1. 基本方針

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。

## 2. 運用方法

## (1) 主要投資対象

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」の受益証券と、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」の受益証券を主要投資対象とします。

## (2) 投資態度

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」の受益証券および親投資信託「東京海上マネーマザーファンド」の受益証券への投資を通じて、世界の金融機関が発行するハイブリッド証券等に実質的に投資します。

運用にあたっては、上記の投資信託証券（投資信託および外国投資信託の受益証券を含みます。以下同じ。）のうち、「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」の組入比率を高位に保つことを基本とします。

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。

## マネープール・ファンド

## 1. 基本方針

主として「東京海上マネーマザーファンド」（以下「マザーファンド」ということがあります。）受益証券に投資を行い、安定した収益の確保を目指して安定運用を行います。

## 2. 運用方法

## (1) 主要投資対象

主としてマザーファンド受益証券に投資し、高位の組入比率を維持します。なお、有価証券等の資産に直接投資することがあります。

## (2) 投資態度

主として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するマザーファンド受益証券に投資します。

当ファンドの運用は、ファミリーファンド方式により行います。したがって、実質的な運用は、マザーファンドで行うこととなります。

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出来ない場合があります。

## (2) 【投資対象】

## 各コース

1. 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

(1) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条で定めるものをいいます。以下同じ。）

有価証券

金銭債権（ に掲げるものに該当するものを除きます。）

約束手形（金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。）

(2) 次に掲げる特定資産以外の資産

為替手形

2. 委託会社は、信託金を、主として次の(1)および(2)に掲げる投資信託証券ならびに(3)から(6)に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

(1)

コース名	投資対象（外国投資信託）
円コース （毎月分配型）	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
米ドルコース （毎月分配型）	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 - 米ドルクラス
ユーロコース （毎月分配型）	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 - ユーロクラス
豪ドルコース （毎月分配型）	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 - 豪ドルクラス
ブラジル・リアルコース （毎月分配型）	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 - ブラジル・リアルクラス

資源国通貨バスケット コース(毎月分配型)	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 - 資源国通貨バスケットクラス
--------------------------	---

- (2) 「東京海上マネーマザーファンド」の受益証券  
(3) コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等  
(4) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(3)の証券の性質を有するもの  
(5) 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。)  
(6) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

なお、上記(5)の証券を「公社債」といい、公社債にかかる運用の指図は買い現先取引(売戻し条件付の買い入れ)および債券貸借取引(現金担保付き債券借入れ)に限り行うことができるものとします。

3. 委託会社は、信託金を、上記2.に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

- (1) 預金  
(2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)  
(3) コール・ローン  
(4) 手形割引市場において売買される手形

4. 上記2.の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

#### <参考情報> 当ファンドが投資対象とする投資信託証券について

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/資源国通貨バスケットクラス) 正式名称:Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund	
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・レアルクラス=ブラジル・レアル、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	毎月、投資顧問会社との協議の上、受託会社の判断により分配を行うことができます。
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、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)、組入る有価証券の売買委託手数料等の取引に要する費用、組入る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: Mitsubishi UFJ Global Custody S.A. 投資顧問会社: 東京海上アセットマネジメント投信株式会社 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出来ない場合があります。

東京海上マネーマザーファンド	
形態	親投資信託
運用方針	内外の公社債およびコマーシャル・ペーパーを中心に投資し、安定した収益の確保をはかります。
主な投資制限	・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。

収益分配	無分配
信託設定日	2008年3月28日
信託期間	無期限
決算日	原則として毎年8月15日
信託報酬等	信託報酬はかかりません。有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等が信託財産から支払われます。
委託会社	東京海上アセットマネジメント投信株式会社
受託銀行	三菱UFJ信託銀行株式会社
ベンチマーク	なし

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出来ない場合があります。

## マネープール・ファンド

1. 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- (1) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - 有価証券
  - デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限りません。）
  - 金銭債権（ に掲げるものに該当するものを除きます。）
  - 約束手形（金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。）
- (2) 次に掲げる特定資産以外の資産

為替手形

2. 委託会社は、信託金を、主として東京海上アセットマネジメント投信株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社として締結された「東京海上マネーマザーファンド」の受益証券および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

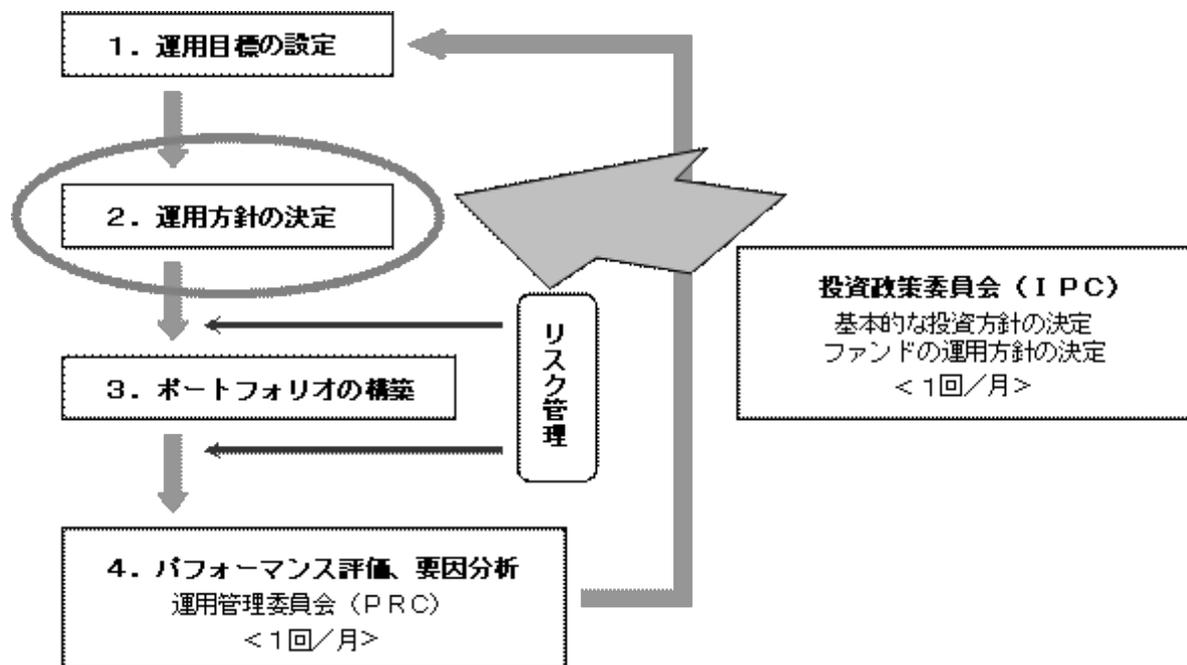
- (1) 転換社債の転換、新株引受権の行使および新株予約権の行使により取得した株券および新株引受権証券
  - (2) 国債証券
  - (3) 地方債証券
  - (4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - (5) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
  - (6) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  - (7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
  - (8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
  - (9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
  - (10) コマーシャル・ペーパー
  - (11) 新株引受権証券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）および新株予約権証券
  - (12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(1)から(11)までの証券または証書の性質を有するもの
  - (13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  - (14) 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
  - (15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  - (16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。）
  - (17) 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  - (18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - (19) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
  - (20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  - (21) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - (22) 外国の者に対する権利で上記(21)の有価証券の性質を有するもの
- なお、(1)の証券または証書、(12)および(17)の証券または証書のうち(1)の証券または証書の性質を有するものを「株式」といい、(2)から(6)までの証券、(12)および(17)の証券または証書のうち(2)から(6)までの証券の性質を有するものならびに(14)の投資法人債券を「公社債」といい、(13)の証券

および(14)の証券（投資法人債券を除きます。）を「投資信託証券」といいます。

3. 委託会社は、信託金を、上記2. に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
- (1) 預金
  - (2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  - (3) コール・ローン
  - (4) 手形割引市場において売買される手形
  - (5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  - (6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの
4. 上記2. の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3. に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

### (3) 【運用体制】

当ファンドの各コースの運用は、投資方針に基づき投資信託証券への投資を通じて実質的に世界の金融機関が発行するハイブリッド証券等に投資します。また、「マネープール・ファンド」の運用は、投資方針に基づき国内の債券等に投資します。「マネープール・ファンド」の実質的な運用は、マザーファンドで行います。各コースおよびマザーファンドの運用方針は、毎月開催される投資政策委員会において決定します。



当ファンドの各コースは債券運用部グローバル債券運用グループ（12名）が社内規則である「投資運用に係る業務運営規程」に基づき運用を担当します。また、「東京海上マネーマザーファンド」は、債券運用部日本債券運用グループ（13名）が、「投資運用に係る業務運営規程」に基づき運用を担当します。

運用におけるリスク管理は、運用管理室（5名）による法令・運用ガイドライン等の遵守状況のチェックや運用リスク項目のチェック等が随時実施され、担当運用部へフィードバックされるとともに、原則として月1回開催される運用管理委員会（管理本部長を委員長に、運用・営業・商品企画などファンド運用に関係する各部長が参加）において投資行動の評価が行われます。（リスク管理についての詳細は、「3 投資リスク」の「3. 管理体制」をご参照ください）

この運用管理委員会での評価もふまえて、投資政策委員会（運用本部長を委員長とし、各運用部長が参加）において運用方針を決定し、より質の高い運用体制の維持・向上を目指します。

また、受託銀行等の管理については、関連部署において、受託銀行業務等に関する「内部統制の整備及び運用状況報告書（SAS70）」の入手・検証、現地モニタリング等を通じて実施しております。

（上記の体制や人員等については、平成25年4月末日現在）

### (4) 【分配方針】

各コース

月1回（原則として毎月17日、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、毎決算時に原則として以下の通り収益分配を行う方針です。

分配対象額は、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。）等の全額とします。収益分配にあたっては、原則として毎決算時に安定分配を継続的に行うことを目指します。収益分配金額は、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。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。なお、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、投資方針に基づいて運用を行います。

#### マネープール・ファンド

年2回(原則として、3月、9月の17日、休業日の場合は翌営業日)決算を行い、毎決算時に原則として以下の通り収益分配を行う方針です。

分配対象額は、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。)等の全額とし、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して収益分配金額を決定します。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。なお、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、投資方針に基づいて運用を行います。

#### 各コース/マネープール・ファンド 共通

信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- a. 配当金、利子、およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額(「配当等収益」といいます。)は、諸経費( )、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
  - b. 売買損益に評価損益を加減した利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費( )、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
- ( ) 諸経費とは、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用(消費税等相当額を含みます。)、信託財産の財務諸表の監査に要する費用(消費税等相当額を含みます。)ならびに受託会社の立替えた立替金の利息をいいます。(「マネープール・ファンド」は、監査費用がかかりません。)

計算期末において信託財産に損失が生じた場合は、次期に繰越します。

分配金は、毎計算期間終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日まで)から、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。)に、お支払いします。なお、分配金を再投資する場合は、分配金は税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

### (5)【投資制限】

#### 各コース

運用の基本方針に基づく制限(約款別紙「運用の基本方針」)

- a. 株式への直接投資は行いません。
- b. 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- c. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- d. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

#### 公社債の借入(約款第19条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入の指図をすることができます。なお、当該公社債の借入を行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. 上記a.の借入の指図は、当該借入にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うことができるものとします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の借入にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- d. 上記a.の借入にかかる品借料は信託財産中から支弁します。

#### 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第20条)

外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### 外国為替予約取引(約款第21条)

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

#### 資金の借入(約款第27条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始

日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

- c. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### マネーブル・ファンド

運用の基本方針に基づく制限(約款別紙「運用の基本方針」)

- a. 委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。(ただし、転換社債の転換、新株引受権の行使および新株予約権の行使により取得する場合に限ります。)
- b. 外貨建資産への投資は、円貨で約定し、円貨で決済する取引により取得した、外国において発行された有価証券について、円貨での決済が困難になる事態が発生した場合に限り、当該外貨建資産の為替リスクのヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。ただしこの場合においては、可能な限り速やかに当該外貨建資産を売却することとします。
- c. 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- d. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券(マザーファンド受益証券ならびに取引所に上場し、かつ当該取引所において常時売却可能な投資信託証券、また既に組入れている株式等が転換等により投資信託証券に該当することとなった投資信託証券を除きます。)の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- e. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- f. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- g. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

投資する株式等の範囲(約款第19条)

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

信用取引(約款第21条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡または買戻により行うことの指図をすることができるものとします。
- b. 上記a.の信用取引の指図は、当該売付にかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の売付にかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

先物取引等(約款第22条)

- a. 委託会社は、日本国内の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)
- b. 委託会社は、日本国内の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- c. 委託会社は、日本国内の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引(約款第23条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入が必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。
- 金利先渡取引および為替先渡取引(約款第24条)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入が必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。
- 有価証券の貸付(約款第25条)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- ・株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - ・公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. 上記a.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。
- 有価証券の空売(約款第26条)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または下記「有価証券の借入」の規定により借入れた有価証券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売付けた有価証券の引渡または買戻により行うことの指図をすることができるものとします。
- b. 上記a.の売付の指図は、当該売付にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うことができるものとします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の売付にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その額を超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。
- 有価証券の借入(約款第27条)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入の指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入を行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. 上記a.の借入の指図は、当該借入にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うことができるものとします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の借入にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- d. 上記a.の借入にかかる品借料は信託財産中から支弁します。
- 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第28条)
- 外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 資金の借入(約款第35条)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

### 3【投資リスク】

#### 1. 投資リスク

以下の記載は、当ファンドが主要投資対象とする投資信託証券およびマザーファンドを組み入れることにより、当ファンドが間接的に受ける実質的なリスクを含みます。

各コース（「マネープール・ファンド」を除きます。）は、主に投資信託証券への投資を通じてハイブリッド証券等値動きのある証券を実質的な投資対象としますので、基準価額は変動します。また、「マネープール・ファンド」は、主に公社債等値動きのある証券を実質的な投資対象としますので、基準価額は変動します。したがって、当ファンドは元本が保証されているものではありません。

委託会社の運用指図によって信託財産に生じた利益および損失は、全て投資家に帰属します。

投資信託は預貯金や保険と異なります。

当ファンドへの投資には主に以下のリスクが想定され、これらの影響により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

#### 各コース

ハイブリッド証券への投資に伴うリスク

ハイブリッド証券への投資には次のような特有のリスクがあり、信用リスクや流動性リスクは普通社債への投資と比較して相対的に大きいものとなります。

##### ・ 弁済の劣後リスク

一般的にハイブリッド証券の法的弁済順位は株式に優先し、普通社債に劣後します。したがって、発行体が経営破たん等に陥り、普通社債等が全額支払われない場合、ハイブリッド証券は元利金の支払いを受けられないことがあります。また、ハイブリッド証券は、一般的に普通社債と比較して低い格付が格付機関により付与されていますが、その格付がさらに下落する場合には、ハイブリッド証券の価格が普通社債以上に大きく下落する場合があります。

##### ・ 繰上償還延期リスク

一般的にハイブリッド証券には、繰上償還（コール）条項が付与されており、この繰上償還の実施は発行体が決定することとなっています。市場環境等の要因によって予定された期日に繰上償還が実施されない場合、あるいは実施されないと見込まれる場合には、当該証券の価格が大きく下落することがあります。

##### ・ 利息・配当繰り延べリスク

利息または配当の支払い繰り延べ条項を有するハイブリッド証券は、発行体の財務状況や収益動向等の要因によって、利息または配当の支払いが繰り延べまたは停止される可能性があります。この場合、期待されるインカムゲインが得られないこととなり、ハイブリッド証券の価格が下落する可能性があります。

##### ・ 制度変更等に関わるリスク

将来、ハイブリッド証券にかかる税制の変更や、当該証券市場にとって不利益な制度上の重大な変更等があった場合には、税制上・財務上のメリットがなくなるか、もしくは著しく低下する等の事由により、投資成果に悪影響を及ぼす可能性があります。

#### 為替変動リスク

##### < 円コース >

主要投資対象である外国投資信託は、原資産通貨売り／円買いの為替ヘッジにより、為替変動リスクの低減を図ります。ただし、追加設定・解約の影響等により、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。また、原資産通貨の金利が円金利より高い場合、これらの金利差相当分のヘッジコストがかかります。

##### < 円コース以外の各コース >

主要投資対象である外国投資信託は、原資産通貨売り／各コースの通貨買い（資源国通貨バスケットコースは豪ドル、ブラジル・リアル、南アフリカ・ランドを概ね3分の1ずつ）の為替取引を行います。これにより、各コース通貨の為替レートの変動の影響を受け、各コースの通貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となります。当該為替取引は、追加設定・解約の影響等により、原資産通貨売りの額と各コースの通貨買いの額を完全に一致させることができません。また、原資産通貨の金利が各コース通貨の金利より高い場合、これらの金利差相当分のコストがかかります。

各コースの主要投資対象である外国投資信託の組入資産は、米ドルやユーロ等複数の通貨（原資産通貨）で構成されています。外国投資信託における米ドル建以外の組入資産に関しては、原則として原資産通貨売り／米ドル買いの為替取引を行った上で、米ドル売り／各コースの通貨買いの為替取引を行います。その際、両取引のタイミングや金額のずれが生じる場合があります。必ずしも完全な為替取引の効果が得られない場合があります。

外国為替予約取引と類似する直物為替先渡取引（NDF）を利用することにより、為替取引を行うことがあります。NDFの取引価格は、需給や当該対象通貨に対する期待等により、当該通貨の金利差から理論上期待される水準とは大きく異なる場合があります。この結果、当ファンドの基準価額の値動きは、実際の当該対象通貨の為替市場の値動きから想定されるものと大きく乖離する場合があります。

す。

#### カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想以上に下落したり、投資方針に沿った運用が困難となることがあります。

また、投資対象国・地域には新興国が含まれています。新興国を取巻く社会的・経済的環境は不透明な場合もあり、金融危機、デフォルト（債務不履行）、重大な政策変更や様々な規制の新たな導入等による投資環境の変化が、先進国への投資に比べてより大きなリスク要因となることがあります。さらに、新興国においては市場規模が小さく流動性が低い場合があり、そのため証券価格の変動が大きくなることがあります。

#### 特定の業種への集中投資リスク

投資対象とする投資信託証券を通じて、金融機関が発行するハイブリッド証券に集中的に投資するため、幅広い業種に分散投資を行うファンドと比較して、基準価額の変動が大きくなる場合があります。

#### 各コース、マネープール・ファンド共通

##### 金利変動リスク

ハイブリッド証券や公社債は、一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、反対に金利が下落した場合には価格は上昇します。したがって、金利が上昇した場合、基準価額が下落する要因となります。

##### 信用リスク

一般に、ハイブリッド証券や公社債、短期金融商品等の発行体にデフォルトが生じた場合、またはデフォルトが予想される場合には、当該公社債等の価格は大幅に下落することになります。したがって、組入公社債等にデフォルトが生じた場合、またデフォルトが予想される場合には、基準価額が下落する要因となります。

##### 流動性リスク

受益者から解約申込があった場合、組入資産を売却することで解約資金の手当てを行うことがあります。その際、組入資産の市場における流動性が低いときには直前の市場価格よりも大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

なお、各コースが実質的に投資対象とするハイブリッド証券は、比較的流動性が低いため、より流動性の高い資産への投資を行うファンドと比べて、基準価額への影響度合いが大きくなる可能性があります。

## 2. その他の留意事項

### (1) 一般的な留意事項

投資信託は、その商品性格から次の特徴をご理解のうえご購入ください。

- ・投資信託は株式・公社債などの値動きのある証券に投資しますので、基準価額は変動します。
- ・投資信託は金融機関の預金と異なり元金が保証されているものではありません。
- ・投資信託は保険契約および預金ではありません。
- ・投資信託は保険契約者保護機構の補償対象契約ではありません。
- ・投資信託は預金保険の対象ではありません。
- ・登録金融機関から購入した投資信託は投資者保護基金の補償対象ではありません。
- ・当ファンドの各コースは、主に投資信託証券への投資を通じてハイブリッド証券等を実質的な投資対象としています。また、「マネープール・ファンド」は、主に国内の公社債を実質的な投資対象としています。当ファンドの基準価額は、組入れたハイブリッド証券や公社債の値動きやそれらハイブリッド証券や公社債の発行者の信用状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下しますので、投資元本を割り込むことがあります。したがって、当ファンドは元本が保証されているものではありません。
- ・委託会社の運用指図によって信託財産に生じた利益および損失は、全て投資家に帰属します。

### (2) 法令・税制・会計等の変更可能性

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

### (3) その他の留意点

取得申込者から販売会社に申込代金が支払われた場合であっても、販売会社より委託会社に対して申込代金の払込が現実になされるまでは、当ファンドも委託会社もいかなる責任も負わず、かつその後、受託会社に払込がなされるまでは、取得申込者は受益権および受益権に付随するいかなる権利も取得しません。

一部解約金、収益分配金および償還金の支払は全て販売会社を通じて行われます。

委託会社は、販売会社とは別法人であり、委託会社は設定・運用を善良なる管理者の注意をもって行う責任を負担し、販売会社は販売（申込代金の預り等を含みます。）について責任を負担しており、互いに他について責任を負担しません。

受託会社は、委託会社に収益分配金、一部解約金および償還金を委託会社の指定する預金口座等へ払い込んだ後は、受益者に対し、それらを支払う責任を負いません。

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

「マネープール・ファンド」は、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、「マネープール・ファンド」が投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等に伴う資金変動等があり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合には、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

各コースが投資対象とする外国投資信託受益証券が存続しないこととなる場合は、当該ファンドを繰上償還させます。

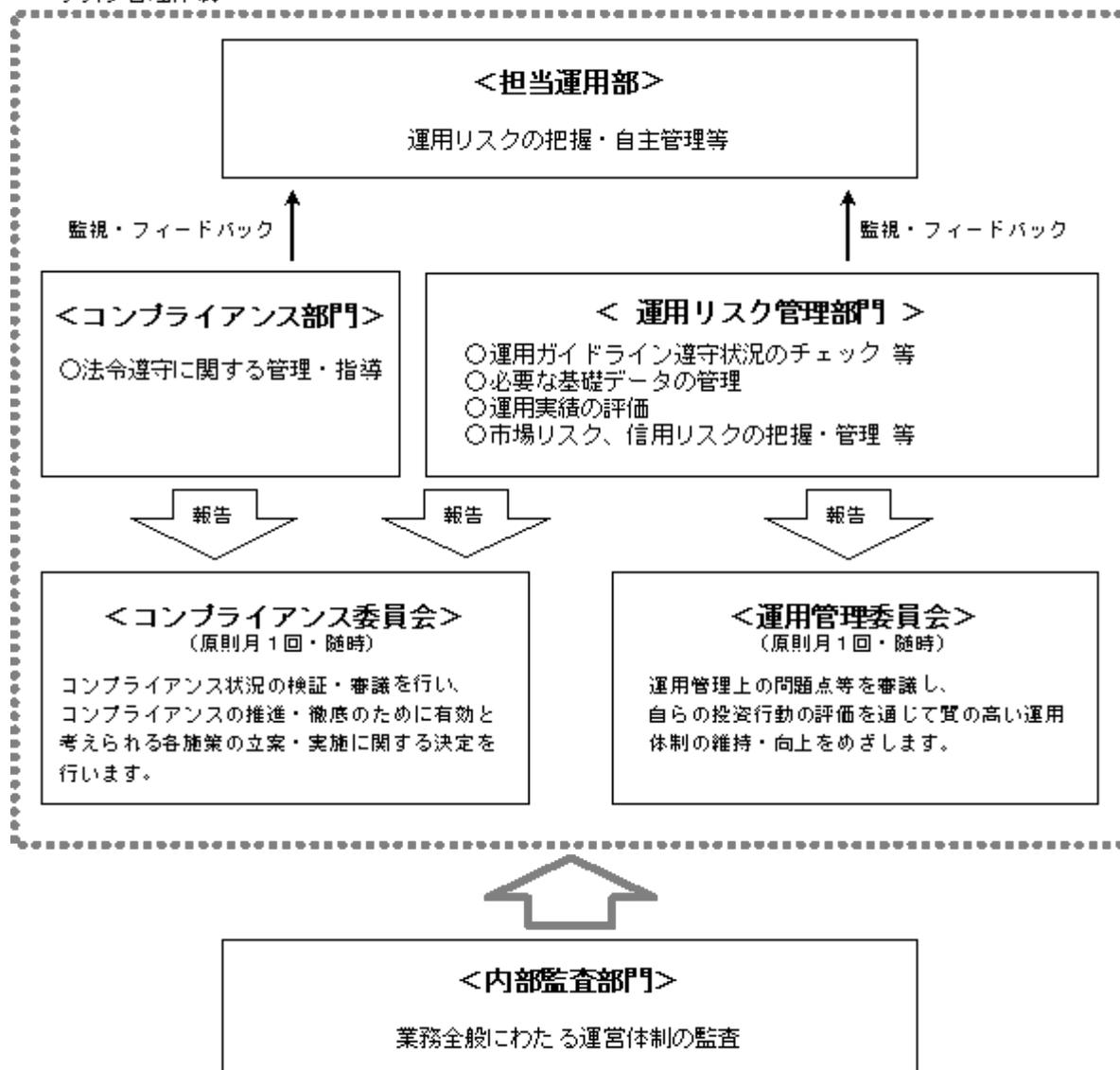
### 3. 管理体制

委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。

法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。

これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。

<リスク管理体制>



## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

発行価格に3.15%（税抜3%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。ただし、各コースから「マネープール・ファンド」へのスイッチングの場合は無手数料とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。申込手数料には、消費税等が含まれます。収益分配金の再投資により取得する口数については、手数料はありません。

### (2) 【換金（解約）手数料】

換金時（解約時）の手数料はありません。

**(3)【信託報酬等】**

## 各コース

委託会社、販売会社および受託会社の信託報酬の総額は信託財産の純資産総額に対し、年率0.96915%（税抜0.923%）を乗じて得た金額とし、計算期間を通じて、毎日計上します。

の信託報酬（消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬の配分については以下の通りとします。

委託会社	販売会社	受託会社
年0.294% （税抜0.28%）	年0.651% （税抜0.62%）	年0.02415% （税抜0.023%）

当ファンドの信託報酬のほかに、当ファンドが投資対象とする投資信託証券に関しても信託報酬等がかかります。投資対象とする投資信託証券の信託報酬を加えた実質的な信託報酬の上限は年率1.64615%（税込）程度となります。（本書作成日現在）

<参考情報> 当ファンドが投資対象とする投資信託証券の信託報酬（本書作成日現在）

投資信託証券の名称	信託報酬率 （年率）
外国投資信託（ケイマン諸島籍） 「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」	0.677%（ ）
親投資信託 「東京海上マネーマザーファンド」	信託報酬は ありません

（ ）信託報酬等として受託会社、投資顧問会社、副投資顧問会社、管理会社、保管銀行ならびに事務代行会社に対して支払われます。ただし、投資対象とする外国投資信託の信託報酬のうち受託会社に支払う報酬（年率0.01%）が10,000米ドルに満たない場合は10,000米ドルとなりますので、外国投資信託の純資産総額によっては上記報酬率を超える場合があります。

上記のほか、有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等の費用も別途かかります。なお、当ファンドが上記の各投資信託の受益証券を取得するに際しては、申込手数料はかかりません。

## マネープール・ファンド

委託会社、販売会社および受託会社の信託報酬の総額は信託財産の純資産総額に対し、 の信託報酬率を乗じて得た金額とし、計算期間を通じて、毎日計上します。

信託報酬率（年率）は月次で見直すものとし、前月の最終営業日の翌日から、当月の最終営業日までの信託報酬率は、当該期間の直前の5営業日間の当該信託または当該信託が投資する親投資信託の日々の基準価額算出に用いたコール・ローンのオーバーナイト物レートの最低レート（以下、「コールレート」といいます。）に応じて以下に定める率とします。

コールレート	信託報酬率			
	合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.45%以上	年0.23625% （税抜0.225%）	年0.06825% （税抜0.065%）	年0.1575% （税抜0.15%）	年0.0105% （税抜0.01%）
0.3%以上0.45%未満	年0.1575% （税抜0.15%）	年0.04725% （税抜0.045%）	年0.105% （税抜0.1%）	年0.00525% （税抜0.005%）
0.2%以上0.3%未満	年0.105% （税抜0.1%）	年0.0315% （税抜0.03%）	年0.06825% （税抜0.065%）	年0.00525% （税抜0.005%）
0.1%以上0.2%未満	年0.0525% （税抜0.05%）	年0.01575% （税抜0.015%）	年0.0357% （税抜0.034%）	年0.00105% （税抜0.001%）
0.05%以上0.1%未満	年0.02625% （税抜0.025%）	年0.00735% （税抜0.007%）	年0.01785% （税抜0.017%）	年0.00105% （税抜0.001%）
0.01%以上0.05%未満	年0.0105% （税抜0.01%）	年0.00315% （税抜0.003%）	年0.0063% （税抜0.006%）	年0.00105% （税抜0.001%）
0.01%未満	年0.00105% （税抜0.001%）	年0.000315% （税抜0.0003%）	年0.00063% （税抜0.0006%）	年0.000105% （税抜0.0001%）

の信託報酬（消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

**(4)【その他の手数料等】**

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は毎日、純資産総額に対し、年率0.0105%（税抜0.01%）を乗じて得た金額（ただし、年63万円（税抜60万円）の1日分相当額を上限

とします。)を計上し、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。(「マネープール・ファンド」は監査費用がかかりません。)

信託財産に関する租税および信託事務等に要する諸費用(消費税等相当額を含みます。)ならびに受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、外国における資産の保管等に要する費用等(全て消費税等相当額を含みます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産の一部解約に伴う支払資金の手当て、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行った場合、借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

監査費用を除くその他の手数料等については実際の取引等により変動するため、事前に料率、上限額等を表示することができません。

上記(1)から(4)の手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、あらかじめ表示することができません。

## (5)【課税上の取扱い】

日本の居住者たる個人または内国法人である受益者に対する課税については、株式投資信託として以下のような取扱いとなります。なお、税法が改正された場合は、以下の内容が変更になることがあります。また、以下は一般的な記載に過ぎませんので、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。

### < 個人の受益者に対する課税 >

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、平成25年12月31日までは10.147%(所得税7.147%、地方税3%)の税率による源泉徴収が行われます。申告不要制度の適用がありますが、総合課税または申告分離課税を選択することも可能です。いずれの場合も配当控除の適用はありません。申告分離課税を選択した場合の税率は、平成25年12月31日までは10.147%(所得税7.147%、地方税3%)となります。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)(1)は課税されません。

平成26年1月1日以降においては、源泉徴収税率は20.315%(所得税15.315%、地方税5%)となり、申告分離課税を選択した場合の税率は20.315%(所得税15.315%、地方税5%)となります。

解約時および償還時の譲渡益(解約時および償還時の価額から取得費(申込手数料(税込)を含む)を控除した利益)は、その全額が譲渡所得等の金額とみなされ課税が行われます。譲渡所得等については、平成25年12月31日までは10.147%(所得税7.147%、地方税3%)の税率による申告分離課税が適用されます(特定口座(源泉徴収選択口座)での取扱いも可能です。)

平成26年1月1日以降の税率は、20.315%(所得税15.315%、地方税5%)となります。

なお、解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡益および申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得の金額と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の譲渡益については、上場株式等の譲渡損と損益通算が可能です。

### < 法人の受益者に対する課税 >

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の「各受益者の個別元本」(2)超過額については、平成25年12月31日までは7.147%の税率による所得税の源泉徴収が行われます。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上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)(1)は課税されません。

平成26年1月1日以降の所得税の源泉徴収税率は15.315%となります。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

(1)「元本払戻金(特別分配金)」とは、収益分配金落ち後の基準価額が各受益者の個別元本を下回る場合、収益分配金のうち当該下回る部分に相当する額をさし、元本の一部払戻しに相当するものです。この場合、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

(2)「各受益者の個別元本」とは、原則として各受益者の信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。)をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、元本払戻金(特別分配金)が支払われた際に調整されます。

## 5【運用状況】

以下は平成25年4月30日現在の運用状況です。

また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### (1)【投資状況】

東京海上Rogge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)

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	ケイマン	66,889,434,302	99.62

親投資信託受益証券	日本	1,001,487	0.00
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		247,878,963	0.36
合計（純資産総額）		67,138,314,752	100.00

## 東京海上Rogge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）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン	7,124,506,919	101.03
親投資信託受益証券	日本	10,015	0.00
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		73,001,340	1.03
合計（純資産総額）		7,051,515,594	100.00

## 東京海上Rogge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）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン	46,571,399	98.47
親投資信託受益証券	日本	10,015	0.02
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		713,168	1.50
合計（純資産総額）		47,294,582	100.00

## 東京海上Rogge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）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン	6,879,638,005	98.20
親投資信託受益証券	日本	1,001,487	0.01
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		124,978,594	1.78
合計（純資産総額）		7,005,618,086	100.00

## 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアルコース（毎月分配型）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン	19,536,292,163	98.54
親投資信託受益証券	日本	1,001,487	0.00
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		288,093,115	1.45
合計（純資産総額）		19,825,386,765	100.00

## 東京海上Rogge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）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン	673,062,775	105.86
親投資信託受益証券	日本	10,015	0.00
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		37,327,379	5.87
合計（純資産総額）		635,745,411	100.00

## 東京海上Rogge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

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	23,698,550	100.00
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		731	0.00
合計（純資産総額）		23,697,819	100.00

（ご参考：親投資信託の投資状況）

東京海上Rogge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）、東京海上Rogge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）、東京海上Rogge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）、東京海上Rogge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）、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアルコース（毎月分配型）、東京海上Rogge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）、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネーパール・ファンドが主要投資対象とする親投資信託の投資状況は以下の通りです。

#### 東京海上マネーマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	119,986,320	94.22
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		7,349,205	5.77
合計（純資産総額）		127,335,525	100.00

## (2) 【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### a. 主要銘柄の明細

#### 東京海上Rogge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）

順位	銘柄名	地域	種類	数量	帳簿価額		評価額		投資比率（％）
					単価（円）	金額（円）	単価（円）	金額（円）	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund JPY-Hedged Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	6,103,607.4735	10,869.0600	66,340,478,298	10,959	66,889,434,302	99.62
2	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	991,474	1.0101	1,001,487	1.0101	1,001,487	0.00

#### 東京海上Rogge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）

順位	銘柄名	地域	種類	数量	帳簿価額		評価額		投資比率（％）
					単価（円）	金額（円）	単価（円）	金額（円）	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund USD-Hedged Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	507,732.8192	13,953.0300	7,084,413,493	14,032	7,124,506,919	101.03
2	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,915	1.0101	10,015	1.0101	10,015	0.00

#### 東京海上Rogge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）

順位	銘柄名	地域	種類	数量	帳簿価額		評価額		投資比率（％）
					単価（円）	金額（円）	単価（円）	金額（円）	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund EUR-Hedged Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	3,520.9344	13,226.1200	46,568,316	13,227	46,571,399	98.47
2	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,915	1.0101	10,015	1.0101	10,015	0.02

#### 東京海上Rogge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）

順位	銘柄名	地域	種類	数量	帳簿価額		評価額		投資比率（％）
					単価（円）	金額（円）	単価（円）	金額（円）	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund AUD-Hedged Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	504,224.4214	13,612.3300	6,863,669,218	13,644	6,879,638,005	98.20
2	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	991,474	1.0101	1,001,487	1.0101	1,001,487	0.01

#### 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアルコース（毎月分配型）

順位	銘柄名	地域	種類	数量	帳簿価額		評価額		投資比率（％）
					単価（円）	金額（円）	単価（円）	金額（円）	

1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund BRL-Hedged Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	1,737,795.0688	11,152	19,379,890,607	11,242	19,536,292,163	98.54
2	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	991,474	1.0101	1,001,487	1.0101	1,001,487	0.00

## 東京海上Rogge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)

順位	銘柄名	地域	種類	数量	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund Resources Currency Basket Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	54,667.217	12,223.8200	668,242,252	12,312	673,062,775	105.86
2	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,915	1.0101	10,015	1.0101	10,015	0.00

## 東京海上Rogge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

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	23,461,588	1.0100	23,696,204	1.0101	23,698,550	100.00

## b. 投資有価証券の種類

## 東京海上Rogge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)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.62
親投資信託受益証券	0.00
合計	99.63

## 東京海上Rogge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)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	101.03
親投資信託受益証券	0.00
合計	101.03

## 東京海上Rogge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)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.47
親投資信託受益証券	0.02
合計	98.49

## 東京海上Rogge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)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.20
親投資信託受益証券	0.01
合計	98.21

## 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアルコース(毎月分配型)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.54
親投資信託受益証券	0.00

合 計	98.54
-----	-------

## 東京海上Rogge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)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	105.86
親投資信託受益証券	0.00
合 計	105.87

## 東京海上Rogge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

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合 計	100.00

## 【投資不動産物件】

東京海上Rogge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)

該当事項はありません。

東京海上Rogge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)

該当事項はありません。

東京海上Rogge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)

該当事項はありません。

東京海上Rogge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)

該当事項はありません。

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアルコース(毎月分配型)

該当事項はありません。

東京海上Rogge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)

該当事項はありません。

東京海上Rogge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

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

東京海上Rogge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)

該当事項はありません。

東京海上Rogge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)

該当事項はありません。

東京海上Rogge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)

該当事項はありません。

東京海上Rogge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)

該当事項はありません。

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアルコース(毎月分配型)

該当事項はありません。

東京海上Rogge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)

該当事項はありません。

東京海上Rogge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

該当事項はありません。

(ご参考:親投資信託の投資資産)

投資有価証券の主要銘柄

## a. 主要銘柄の明細

## 東京海上マネーマザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	額面	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
							単価 (円)	金額(円)	単価 (円)	金額(円)	
1	第351回国庫短期証券	日本	国債証券	0.0	2013/06/17	120,000,000	99.98	119,985,720	99.98	119,986,320	94.22

## b. 投資有価証券の種類

## 東京海上マネーマザーファンド

種類	投資比率 (%)
国債証券	94.22
合計	94.22

## 投資不動産物件

## 東京海上マネーマザーファンド

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

## 東京海上マネーマザーファンド

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 東京海上Rogge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）

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1特定期間末	(平成24年 3月19日)	11,770	11,924	1.0394	1.0564
第2特定期間末	(平成24年 9月18日)	18,282	18,892	1.0701	1.1061
第3特定期間末	(平成25年 3月18日)	58,532	59,857	1.0895	1.1295
	平成24年 4月末日	16,605	-	1.0283	-
	5月末日	17,954	-	1.0147	-
	6月末日	18,167	-	1.0220	-
	7月末日	18,301	-	1.0442	-
	8月末日	18,184	-	1.0569	-
	9月末日	18,164	-	1.0725	-
	10月末日	18,326	-	1.0915	-
	11月末日	21,230	-	1.1001	-
	12月末日	33,950	-	1.1087	-
	平成25年 1月末日	46,186	-	1.0858	-
	2月末日	54,422	-	1.0864	-
	3月末日	61,893	-	1.0835	-
	4月末日	67,138	-	1.1024	-

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

## 東京海上Rogge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）

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1特定期間末	(平成24年 3月19日)	328	332	1.1184	1.1354
第2特定期間末	(平成24年 9月18日)	725	746	1.0844	1.1204

第3特定期間末	(平成25年 3月18日)	3,609	3,660	1.3526	1.3926
平成24年 4月末日		515	-	1.0732	-
5月末日		584	-	1.0361	-
6月末日		601	-	1.0479	-
7月末日		654	-	1.0561	-
8月末日		662	-	1.0742	-
9月末日		686	-	1.0785	-
10月末日		676	-	1.1273	-
11月末日		710	-	1.1704	-
12月末日		1,164	-	1.2346	-
平成25年 1月末日		1,945	-	1.2857	-
2月末日		2,797	-	1.2972	-
3月末日		4,588	-	1.3297	-
4月末日		7,051	-	1.4061	-

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

#### 東京海上Rogge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)

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1特定期間末	(平成24年 3月19日)	8	9	1.0830	1.0995
第2特定期間末	(平成24年 9月18日)	3	3	1.0453	1.0783
第3特定期間末	(平成25年 3月18日)	37	38	1.2875	1.3245
平成24年 4月末日		1	-	1.0408	-
5月末日		1	-	0.9429	-
6月末日		1	-	0.9561	-
7月末日		1	-	0.9499	-
8月末日		1	-	0.9848	-
9月末日		3	-	1.0173	-
10月末日		3	-	1.0669	-
11月末日		6	-	1.1111	-
12月末日		8	-	1.1939	-
平成25年 1月末日		23	-	1.2742	-
2月末日		23	-	1.2437	-
3月末日		36	-	1.2444	-
4月末日		47	-	1.3341	-

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

#### 東京海上Rogge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)

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1特定期間末	(平成24年 3月19日)	7,023	7,181	1.1430	1.1730
第2特定期間末	(平成24年 9月18日)	11,814	12,415	1.0982	1.1612
第3特定期間末	(平成25年 3月18日)	7,891	8,439	1.3366	1.4056
平成24年 4月末日		9,499	-	1.0764	-
5月末日		9,322	-	0.9759	-
6月末日		10,008	-	1.0138	-

7月末日	10,756	-	1.0657	-
8月末日	10,988	-	1.0643	-
9月末日	11,438	-	1.0774	-
10月末日	11,093	-	1.1155	-
11月末日	10,180	-	1.1697	-
12月末日	9,426	-	1.2227	-
平成25年 1月末日	8,924	-	1.2794	-
2月末日	8,075	-	1.2627	-
3月末日	7,432	-	1.3169	-
4月末日	7,005	-	1.3736	-

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアルコース(毎月分配型)

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1特定期間末	(平成24年 3月19日)	12,146	12,560	1.0851	1.1286
第2特定期間末	(平成24年 9月18日)	13,801	15,099	0.9184	1.0084
第3特定期間末	(平成25年 3月18日)	19,436	20,870	1.1261	1.2181
平成24年 4月末日		14,017	-	0.9955	-
5月末日		12,807	-	0.9016	-
6月末日		12,671	-	0.8699	-
7月末日		13,163	-	0.8973	-
8月末日		13,546	-	0.9013	-
9月末日		13,485	-	0.9060	-
10月末日		13,241	-	0.9410	-
11月末日		12,973	-	0.9367	-
12月末日		15,759	-	1.0039	-
平成25年 1月末日		18,080	-	1.0745	-
2月末日		18,289	-	1.0877	-
3月末日		19,495	-	1.0868	-
4月末日		19,825	-	1.1499	-

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

東京海上Rogge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)

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1特定期間末	(平成24年 3月19日)	470	482	1.1320	1.1650
第2特定期間末	(平成24年 9月18日)	693	741	1.0237	1.0927
第3特定期間末	(平成25年 3月18日)	554	594	1.2197	1.2927
平成24年 4月末日		762	-	1.0560	-
5月末日		659	-	0.9508	-
6月末日		664	-	0.9585	-
7月末日		706	-	0.9966	-
8月末日		654	-	0.9934	-
9月末日		697	-	1.0123	-
10月末日		610	-	1.0326	-

11月末日	673	-	1.0586	-
12月末日	709	-	1.1317	-
平成25年 1月末日	502	-	1.1693	-
2月末日	515	-	1.1810	-
3月末日	563	-	1.1944	-
4月末日	635	-	1.2598	-

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

#### 東京海上Rogge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

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
1期	(平成24年 3月19日)	17	17	1.0002	1.0002
2期	(平成24年 9月18日)	5	5	1.0006	1.0006
3期	(平成25年 3月18日)	23	23	1.0011	1.0011
	平成24年 4月末日	55	-	1.0003	-
	5月末日	66	-	1.0003	-
	6月末日	66	-	1.0004	-
	7月末日	5	-	1.0006	-
	8月末日	5	-	1.0007	-
	9月末日	2	-	1.0008	-
	10月末日	5	-	1.0008	-
	11月末日	5	-	1.0009	-
	12月末日	5	-	1.0009	-
	平成25年 1月末日	5	-	1.0010	-
	2月末日	23	-	1.0011	-
	3月末日	23	-	1.0011	-
	4月末日	23	-	1.0011	-

#### 【分配の推移】

##### 東京海上Rogge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)

期	1口当たりの分配金(円)
第1特定期間	0.0170
第2特定期間	0.0360
第3特定期間	0.0400

##### 東京海上Rogge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)

期	1口当たりの分配金(円)
第1特定期間	0.0170
第2特定期間	0.0360
第3特定期間	0.0400

##### 東京海上Rogge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)

期	1口当たりの分配金(円)
第1特定期間	0.0165
第2特定期間	0.0330
第3特定期間	0.0370

## 東京海上Rogge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）

期	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0300
第2特定期間	0.0630
第3特定期間	0.0690

## 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアルコース（毎月分配型）

期	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0435
第2特定期間	0.0900
第3特定期間	0.0920

## 東京海上Rogge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）

期	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0330
第2特定期間	0.0690
第3特定期間	0.0730

東京海上Rogge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  
該当事項はありません。

## 【収益率の推移】

## 東京海上Rogge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）

期	年月日	収益率（％）（分配付）
第1特定期間	（平成24年 3月19日）	5.6
第2特定期間	（平成24年 9月18日）	6.4
第3特定期間	（平成25年 3月18日）	5.6

(注)収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付）から、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落。以下、「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除した数値に100を乗じた数値です。

## 東京海上Rogge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）

期	年月日	収益率（％）（分配付）
第1特定期間	（平成24年 3月19日）	13.5
第2特定期間	（平成24年 9月18日）	0.2
第3特定期間	（平成25年 3月18日）	28.4

(注)収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付）から、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落。以下、「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除した数値に100を乗じた数値です。

## 東京海上Rogge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）

期	年月日	収益率（％）（分配付）
第1特定期間	（平成24年 3月19日）	10.0
第2特定期間	（平成24年 9月18日）	0.4
第3特定期間	（平成25年 3月18日）	26.7

(注)収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付）から、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落。以下、「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除した数値に100を乗じた数値です。

## 東京海上Rogge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)

期	年月日	収益率(%) (分配付)
第1特定期間	(平成24年 3月19日)	17.3
第2特定期間	(平成24年 9月18日)	1.6
第3特定期間	(平成25年 3月18日)	28.0

(注)収益率とは、特定期間末の基準価額(分配付)から、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額(分配落。以下、「前特定期間末基準価額」といいます。)を控除した額を前特定期間末基準価額で除した数値に100を乗じた数値です。

## 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアルコース(毎月分配型)

期	年月日	収益率(%) (分配付)
第1特定期間	(平成24年 3月19日)	12.9
第2特定期間	(平成24年 9月18日)	7.1
第3特定期間	(平成25年 3月18日)	32.6

(注)収益率とは、特定期間末の基準価額(分配付)から、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額(分配落。以下、「前特定期間末基準価額」といいます。)を控除した額を前特定期間末基準価額で除した数値に100を乗じた数値です。

## 東京海上Rogge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)

期	年月日	収益率(%) (分配付)
第1特定期間	(平成24年 3月19日)	16.5
第2特定期間	(平成24年 9月18日)	3.5
第3特定期間	(平成25年 3月18日)	26.3

(注)収益率とは、特定期間末の基準価額(分配付)から、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額(分配落。以下、「前特定期間末基準価額」といいます。)を控除した額を前特定期間末基準価額で除した数値に100を乗じた数値です。

## 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)マネーボール・ファンド

期	年月日	収益率(%) (分配付)
1期	(平成24年 3月19日)	0.0
2期	(平成24年 9月18日)	0.0
3期	(平成25年 3月18日)	0.0

## (4)【設定及び解約の実績】

## 東京海上Rogge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)

期	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1特定期間	12,064,874,346	741,039,462	11,323,834,884
第2特定期間	13,791,970,874	8,030,551,496	17,085,254,262
第3特定期間	47,718,012,229	11,078,977,029	53,724,289,462

## 東京海上Rogge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)

期	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1特定期間	294,170,870		294,170,870
第2特定期間	511,180,795	136,178,341	669,173,324
第3特定期間	2,552,428,080	553,046,045	2,668,555,359

## 東京海上Rogge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)

期	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)

第1特定期間	31,859,194	23,751,821	8,107,373
第2特定期間	2,560,256	7,270,966	3,396,663
第3特定期間	26,007,191	10,098	29,393,756

## 東京海上Rogge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)

期	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1特定期間	7,209,508,931	1,065,086,570	6,144,422,361
第2特定期間	8,528,037,339	3,914,072,908	10,758,386,792
第3特定期間	3,888,913,096	8,743,208,061	5,904,091,827

## 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアルコース(毎月分配型)

期	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1特定期間	13,211,487,207	2,016,925,855	11,194,561,352
第2特定期間	9,650,320,813	5,817,327,714	15,027,554,451
第3特定期間	13,957,210,115	11,724,998,622	17,259,765,944

## 東京海上Rogge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)

期	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1特定期間	497,140,600	81,276,360	415,864,240
第2特定期間	471,508,987	210,364,453	677,008,774
第3特定期間	386,582,166	608,629,773	454,961,167

## 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)マネーボール・ファンド

期	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
1期	17,853,916		17,853,916
2期	60,364,269	72,343,681	5,874,504
3期	20,710,827	2,914,500	23,670,831

## &lt; 参考情報 &gt;

(平成25年4月30日現在)

## 円コース(毎月分配型)

## ●基準価額・純資産総額の推移



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。

※基準価額は1万円当たりで表示しています。

※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

※設定日は2011年11月8日です。

## ●騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	設定来
ファンド	+2.40	+3.50	+4.84	+15.17	-	+21.12

※ファンドの騰落率は、税引前分配金を再投資したものと計算しているため、実際の投資家利回りとは異なります。

## ●基準価額・純資産総額

基準価額	11,024円
純資産総額	67,138百万円

## ●分配の推移(1万円当たり、税引前)

2012/5	2012/6	2012/7	2012/8	2012/9	2012/10	2012/11
60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円
2012/12	2013/1	2013/2	2013/3	2013/4	設定来累計	
70円	70円	70円	70円	70円	1,000円	

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

## ●主要な資産の状況

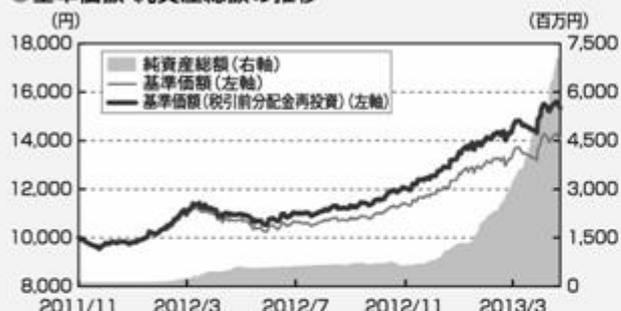
資産名	比率(%)
東京海上ストラテジックトラストー東京海上Roggeグローバルハイブリッドセキュリティーズ・ファンド(日本円クラス)	99.6
東京海上マネーマザーファンド	0.0
短期金融資産等	0.4
合計	100.0

※比率は純資産総額に占める割合です。

※短期金融資産等は、組入有価証券以外のものです。追加設定の影響等により、マイナスになる場合があります。

## 米ドルコース(毎月分配型)

## ●基準価額・純資産総額の推移



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。

※基準価額は1万円当たりで表示しています。

※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

※設定日は2011年11月8日です。

## ●騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	設定来
ファンド	+6.28	+11.06	+28.78	+39.89	-	+53.44

※ファンドの騰落率は、税引前分配金を再投資したものと計算しているため、実際の投資家利回りとは異なります。

## ●基準価額・純資産総額

基準価額	14,061円
純資産総額	7,052百万円

## ●分配の推移(1万円当たり、税引前)

2012/5	2012/6	2012/7	2012/8	2012/9	2012/10	2012/11
60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円
2012/12	2013/1	2013/2	2013/3	2013/4	設定来累計	
70円	70円	70円	70円	70円	1,000円	

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

## ●主要な資産の状況

資産名	比率(%)
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(米ドルクラス)	101.0
東京海上マネーマザーファンド	0.0
短期金融資産等	-1.0
合計	100.0

※比率は純資産総額に占める割合です。

※短期金融資産等は、組入有価証券以外のものです。追加設定の影響等により、マイナスになる場合があります。

## ユーロコース(毎月分配型)

### ●基準価額・純資産総額の推移



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。

※基準価額は1万口当たりで表示しています。

※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

※設定日は2011年11月8日です。

### ●騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	設定来
ファンド	+7.73	+6.27	+28.97	+36.65	-	+45.41

※ファンドの騰落率は、税引前分配金を再投資したものと計算しているため、実際の投資家利回りとは異なります。

### ●基準価額・純資産総額

基準価額	13,341円
純資産総額	47百万円

### ●分配の推移(1万口当たり、税引前)

2012/5	2012/6	2012/7	2012/8	2012/9	2012/10	2012/11
55円	55円	55円	55円	55円	55円	55円
2012/12	2013/1	2013/2	2013/3	2013/4	設定来累計	
65円	65円	65円	65円	65円	930円	

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

### ●主要な資産の状況

資産名	比率(%)
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(ユーロクラス)	98.5
東京海上マネーマザーファンド	0.0
短期金融資産等	1.5
合計	100.0

※比率は純資産総額に占める割合です。

※短期金融資産等は、組入有価証券以外のものです。追加設定の影響等により、マイナスになる場合があります。

## 豪ドルコース(毎月分配型)

### ●基準価額・純資産総額の推移



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。

※基準価額は1万口当たりで表示しています。

※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

※設定日は2011年11月8日です。

### ●騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	設定来
ファンド	+5.22	+10.28	+30.14	+43.14	-	+60.02

※ファンドの騰落率は、税引前分配金を再投資したものと計算しているため、実際の投資家利回りとは異なります。

### ●基準価額・純資産総額

基準価額	13,736円
純資産総額	7,006百万円

### ●分配の推移(1万口当たり、税引前)

2012/5	2012/6	2012/7	2012/8	2012/9	2012/10	2012/11
105円	105円	105円	105円	105円	105円	105円
2012/12	2013/1	2013/2	2013/3	2013/4	設定来累計	
120円	120円	120円	120円	120円	1,740円	

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

### ●主要な資産の状況

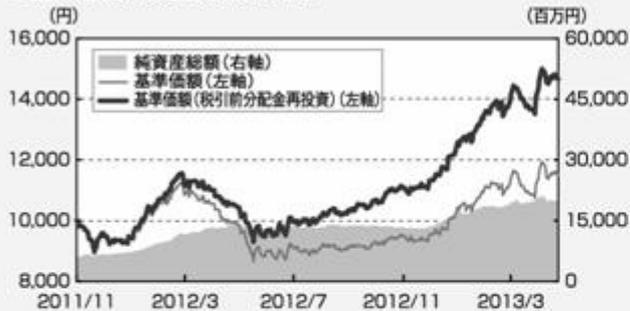
資産名	比率(%)
東京海上ストラテジックトラストー東京海上Roggeグローバルハイブリッドセキュリティーズ・ファンド(豪ドルクラス)	98.2
東京海上マネーマザーファンド	0.0
短期金融資産等	1.8
合計	100.0

※比率は純資産総額に占める割合です。

※短期金融資産等は、組入有価証券以外のものです。追加設定の影響等により、マイナスになる場合があります。

## ブラジル・リアルコース(毎月分配型)

### ●基準価額・純資産総額の推移



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。

※基準価額は1万口当たりで表示しています。

※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

※設定日は2011年11月8日です。

### ●騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	設定来
ファンド	+7.29	+11.63	+33.47	+39.20	-	+46.63

※ファンドの騰落率は、税引前分配金を再投資したものと計算しているため、実際の投資家利回りとは異なります。

### ●基準価額・純資産総額

基準価額	11,499円
純資産総額	19,825百万円

### ●分配の推移(1万口当たり、税引前)

2012/5	2012/6	2012/7	2012/8	2012/9	2012/10	2012/11
150円	150円	150円	150円	150円	150円	150円
2012/12	2013/1	2013/2	2013/3	2013/4	設定来累計	
150円	150円	160円	160円	160円	2,415円	

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

### ●主要な資産の状況

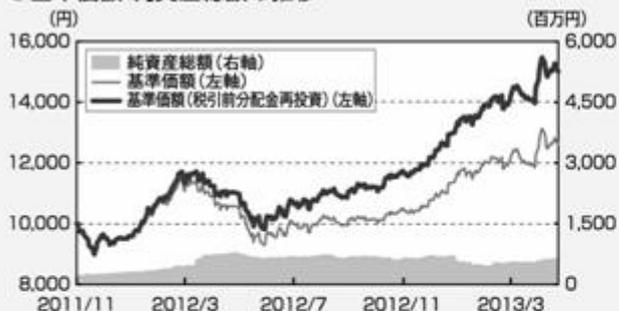
資産名	比率(%)
東京海上ストラテジックトラストー東京海上Roggeグローバルハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド(ブラジル・リアルクラス)	98.5
東京海上マネーマザーファンド	0.0
短期金融資産等	1.5
合計	100.0

※比率は純資産総額に占める割合です。

※短期金融資産等は、組入の有価証券以外のものです。追加設定の影響等により、マイナスになる場合があります。

## 資源国通貨バスケットコース(毎月分配型)

### ●基準価額・純資産総額の推移



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。

※基準価額は1万口当たりで表示しています。

※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

※設定日は2011年11月8日です。

### ●騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	設定来
ファンド	+6.53	+11.06	+30.02	+36.21	-	+50.02

※ファンドの騰落率は、税引前分配金を再投資したものと計算しているため、実際の投資家利回りとは異なります。

### ●基準価額・純資産総額

基準価額	12,598円
純資産総額	636百万円

### ●分配の推移(1万口当たり、税引前)

2012/5	2012/6	2012/7	2012/8	2012/9	2012/10	2012/11
115円	115円	115円	115円	115円	115円	115円
2012/12	2013/1	2013/2	2013/3	2013/4	設定来累計	
125円	125円	125円	125円	125円	1,875円	

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

### ●主要な資産の状況

資産名	比率(%)
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(資源国通貨バスケットクラス)	105.9
東京海上マネーマザーファンド	0.0
短期金融資産等	-5.9
合計	100.0

※比率は純資産総額に占める割合です。

※短期金融資産等は、組入の有価証券以外のものです。追加設定の影響等により、マイナスになる場合があります。

## マネープール・ファンド

## ●基準価額・純資産総額の推移



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。

※基準価額は1万口当たりで表示しています。

※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

※設定日は2011年11月8日です。

## ●騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	設定来
ファンド	±0.00	+0.01	+0.03	+0.08	-	+0.11

※ファンドの騰落率は、税引前分配金を再投資したものと計算しているため、実際の投資家利回りとは異なります。

## ●基準価額・純資産総額

基準価額	10,011円
純資産総額	24百万円

## ●分配の推移(1万口当たり、税引前)

第1期	2012年3月19日	0円
第2期	2012年9月18日	0円
第3期	2013年3月18日	0円
第4期	2013年9月17日	
第5期	2014年3月17日	
設定来累計		分配実績なし

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

## ●主要な資産の状況

資産名	比率(%)
債券	94.2
短期金融資産等	5.8
合計	100.0

※当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行っており、マザーファンドの資産の状況を記載しています。

※比率は純資産総額に占める割合です。

※短期金融資産等は、組入有価証券以外のものです。

## 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・ファンドの資産状況

※基準価額算定の基準で記載しています。

## ●証券種別構成比率

資産	比率(%)
期限付劣後債	55.8
永久劣後債	13.3
優先出資証券	20.7
その他	10.2

## ●ハイブリッド証券等の属性情報

平均残存期間(年)	6.57
平均修正デュレーション(年)	5.05
平均クーポン(%)	6.11
平均利回り(複利、%)	4.68
平均格付	BBB+

## ●組入上位5カ国

	国名	比率(%)
1	イギリス	21.8
2	アメリカ	14.9
3	フランス	11.9
4	スイス	8.3
5	オランダ	7.8

## ●格付別構成比率

格付	比率(%)
AAA格	0.0
AA格	4.5
A格	34.4
BBB格	60.7
BB格以下	0.4
無格付	0.0

※+-等の符号は省略して表示しています。

## ●組入上位10銘柄

	銘柄名	証券種類	クーポン(%)	償還日	国名	格付	比率(%)
1	RABOBANK NEDERLAND	優先出資証券	8.400	2017/6/29	オランダ	BBB+	2.3
2	CSG GUERNSEY I LTD	期限付劣後債	7.875	2016/8/24	スイス	BBB-	2.1
3	STANDARD LIFE PLC	期限付劣後債	5.500	2022/12/4	イギリス	BBB	2.0
4	BARCLAYS BANK PLC	期限付劣後債	6.000	2018/1/23	イギリス	A-	2.0
5	DNB BANK ASA	永久劣後債	6.012	2017/3/29	ノルウェー	BBB	1.9
6	ROYAL BK SCOTLAND GRP PLC	期限付劣後債	6.125	2022/12/15	イギリス	BBB-	1.9
7	MITSUMI SUMITOMO INSURANC	優先出資証券	7.000	2022/3/15	日本	A-	1.9
8	SOCIETE GENERALE	永久劣後債	6.625	2018/6/11	フランス	BBB	1.9
9	LLOYDS TSB BANK PLC	期限付劣後債	7.625	2025/4/22	イギリス	BBB-	1.9
10	DANSKE BANK A/S	期限付劣後債	5.375	2018/9/29	デンマーク	BBB	1.8

組入銘柄数 102

※各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。

※「ハイブリッド証券等の属性情報」は、保有するハイブリッド証券等の時価評価額を基に計算しています。平均残存期間、平均修正デュレーション、平均利回りは、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使用して計算しています。平均格付は、格付毎に点数化(例えばAAAは26、AA+は25等)し、加重平均した結果を四捨五入して表示しており、当ファンドの格付ではありません。また、保有債券のうち、格付が取得できない場合は、除外して計算しています。

※「組入上位10銘柄」の償還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)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。

## 東京海上マネーマザーファンドの資産状況

## ●組入上位10銘柄

	銘柄名	クーポン(%)	償還日	比率(%)
1	第351回国庫短期証券	0.00	2013/6/17	94.2
2				
3				

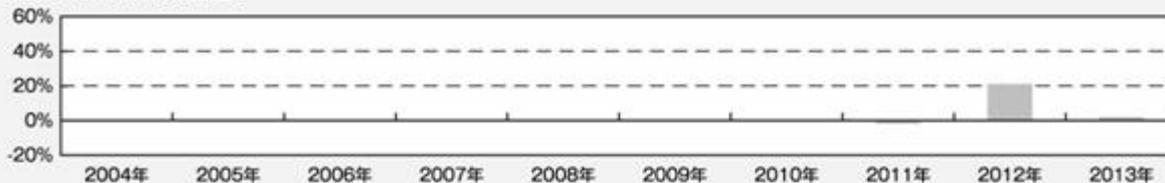
※比率は純資産総額に占める割合です。

組入銘柄数 1

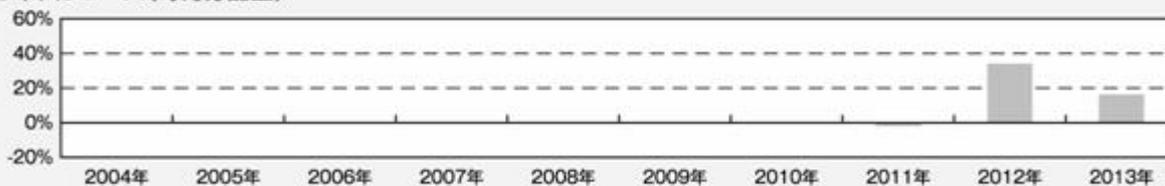
## 年間収益率の推移

※ベンチマークはありません。

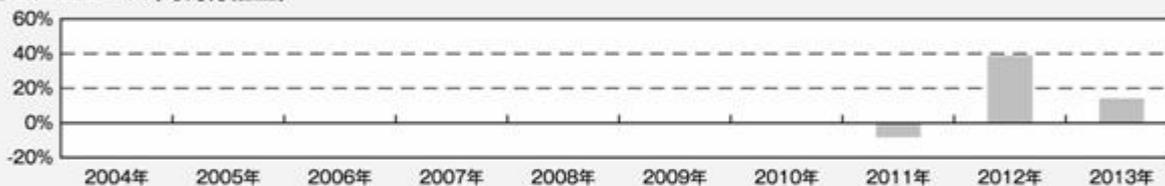
### ●円コース(毎月分配型)



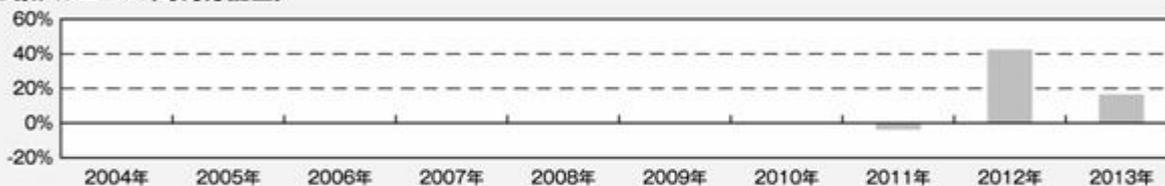
### ●米ドルコース(毎月分配型)



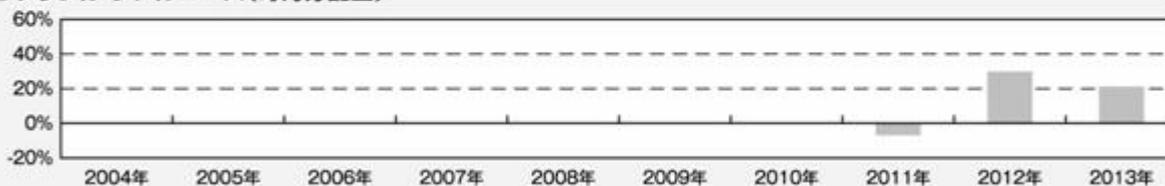
### ●ユーロコース(毎月分配型)



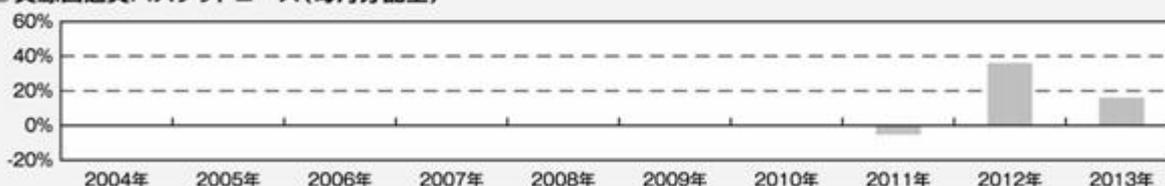
### ●豪ドルコース(毎月分配型)



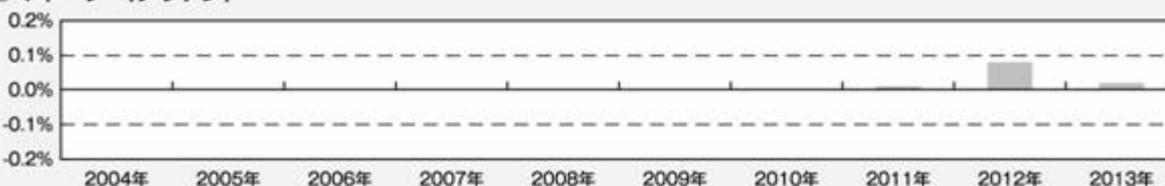
### ●ブラジル・リアルコース(毎月分配型)



### ●資源国通貨バスケットコース(毎月分配型)



### ●マネーパブル・ファンド



※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しており、設定日以降を表示しています。

※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

※上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

「マネーパブル・ファンド」を除く各コースの最新の運用実績は、委託会社のホームページでご確認いただけます。ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

- 毎営業日にお申込みを受け付けます。ただし、各コースのお申込み日が以下の日のいずれかに該当する場合には、取得（スイッチングを含みます。）のお申込みの受付を行いません。
  - ・ニューヨーク証券取引所の休業日

- ・ ニューヨークの銀行の休業日
  - ・ ロンドンの銀行の休業日
  - ・ ルクセンブルグの銀行の休業日
- b. 申込方法には、収益分配金の受取方法によって、以下の2種類のコースがあります。

分配金受取りコース	分配金を受け取るコースです。
分配金再投資コース	分配金が税引き後、自動的に無手数料で再投資されるコースです。

- c. 販売会社やお申込みのコース等によって申込単位は異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。なお、分配金再投資コースにおける収益分配金の再投資に際しては、1口単位で取得することができます。
- d. 各コース間および各コースと「マネープール・ファンド」間でスイッチングが可能です。販売会社によっては、一部のファンドのみの取扱いとなる場合やスイッチングの取扱いを行わない場合があります。
- e. 取得申込の受付は、原則として午後3時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みについては翌営業日受付の取扱いとなります。
- f. 受益権の取得申込価額は以下の通りです。  
取得申込受付日の翌営業日の基準価額  
基準価額は原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクにお問い合わせることにより知ることができます。  
委託会社のお問い合わせ先（委託会社サービスデスク）  
東京海上アセットマネジメント投信 サービスデスク  
0120-712-016（土日祝日・年末年始を除く9時～17時）
- g. 申込手数料は、発行価格に3.15%（税抜3%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。ただし、「マネープール・ファンド」へのスイッチングの場合は無手数料とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- h. 上記にかかわらず、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置を取った場合には、販売会社は、受益権の取得申込の受付を中止すること、および既に受け付けた取得申込の受付を取り消すことができます。
- i. 取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関等への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関等への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関等の定める方法により、振替機関等へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。
- j. 定時定額購入サービスを選択した取得申込者は、販売会社との間で定時定額購入サービスに関する取り決めを行います。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 2【換金（解約）手続等】

- a. 受益者は、自己に帰属する受益権につき、一部解約の実行請求（解約請求）の方法によりご換金の請求を行うことができます。
- b. ご換金のお申込みは販売会社で受け付けます。なお、販売会社の買取りによるご換金の請求については、販売会社にお問い合わせください。
- c. 解約請求による換金のお申込みは、毎営業日に行うことができます。ただし、各コースの解約請求日が以下の日のいずれかに該当する場合には、お申込みの受付を行いません。  
・ ニューヨーク証券取引所の休業日  
・ ニューヨークの銀行の休業日  
・ ロンドンの銀行の休業日  
・ ルクセンブルグの銀行の休業日  
「マネープール・ファンド」の換金については、毎営業日に行うことができます。
- d. 解約単位は、販売会社やお申込みのコース等によって異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- e. 解約請求のお申込みの受付は、原則として午後3時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みは翌営業日受付としてお取扱いします。
- f. 解約時の価額（解約価額）は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。  
信託財産留保額はありませぬ。
- g. 解約価額は、原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクにお問い合わせることにより知ることができます。
- h. 解約にかかる手数料はありません。
- i. 解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して6営業日目から、お支払いします。
- j. 委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよび既に受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取消することができます。解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日を

- 解約請求受付日とする解約請求を撤回できます。ただし受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にその請求を受け付けたものとして取扱います。
- k. 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口解約には制限を設ける場合があります。
- l. 受益者が解約の請求をするときは、振替受益権をもって行うものとし、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請が行われ、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

- a. 基準価額とは、受益権1口当たりの純資産価額（純資産総額を計算日における受益権総口数で除した金額）をいいます。ただし、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示されることがあります。
- b. 純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、外国為替予約に基づく予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。
- <主要投資対象資産の評価方法>

対象	評価方法
投資信託証券	原則として、当ファンドの基準価額計算日に知りうる直近の日における当該投資信託証券の基準価額で評価します。
マザーファンド 受益証券	原則として、当ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

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

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

原則として、平成23年11月8日から平成33年9月17日までとします。ただし、後記「(5)その他 信託の終了（繰上償還）」に該当する場合には、信託を終了させることがあります。

各コースが主要投資対象とする外国投資信託受益証券が存続しないこととなる場合には、信託を終了させます。

#### (4)【計算期間】

各コース

原則として、毎月18日から翌月17日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日（ ）を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。

マネープール・ファンド

原則として、毎年3月18日から9月17日まで、9月18日から翌年3月17日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日（ ）を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。

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

#### (5)【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

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

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

#### 信託約款の変更

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

#### 関係会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間の募集・販売等の取扱いに関する契約は、当事者の別段の意思表示がない限り、1年ごとに自動更新されます。募集・販売等の取扱いに関する契約は、当事者間の合意により変更することができます。

#### 運用報告書

##### 各コース

毎月の決算のうち、3月および9月の決算時および償還時に、委託会社が、期間中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成します。運用報告書は、知っている受益者に対して、販売会社から、あらかじめお申し出いただいたご住所にお届けします。なお、期間中に行った信託約款の変更等のうち、委託会社が重要と判断した事項については、運用報告書に記載します。

##### マネープール・ファンド

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

## 4【受益者の権利等】

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

## a. 収益分配金の請求権

収益分配金は、毎計算期間終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）にお支払いします。ただし、受益者が収益分配金について、上記に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社より交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。なお、分配金再投資コースの収益分配金は、税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

## b. 償還金の請求権

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

## c. 換金（解約）請求権

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

## d. 買取請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

東京海上Rogge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）  
東京海上Rogge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）  
東京海上Rogge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）  
東京海上Rogge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）  
東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアルコース（毎月分配型）  
東京海上Rogge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）

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、当特定期間（平成24年9月19日から平成25年3月18日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

東京海上Rogge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) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、第3期計算期間（平成24年9月19日から平成25年3月18日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

【東京海上Rogge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)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 [平成24年 9月18日現在]	当期 [平成25年 3月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	551,287,469	1,794,511,561
投資信託受益証券	18,020,798,350	58,200,996,030
親投資信託受益証券	1,000,893	1,001,388
未収利息	1,021	3,306
流動資産合計	18,573,087,733	59,996,512,285
資産合計		
	18,573,087,733	59,996,512,285
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	30,000,000	860,000,000
未払収益分配金	102,511,525	376,070,026
未払解約金	142,734,018	187,109,297
未払受託者報酬	387,505	1,018,524
未払委託者報酬	15,163,127	39,855,235
その他未払費用	52,500	52,500
流動負債合計	290,848,675	1,464,105,582
負債合計		
	290,848,675	1,464,105,582
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	17,085,254,262	53,724,289,462
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,196,984,796	4,808,117,241
( 分配準備積立金 )	823,982,359	845,137,143
元本等合計	18,282,239,058	58,532,406,703
純資産合計		
	18,282,239,058	58,532,406,703
負債純資産合計		
	18,573,087,733	59,996,512,285

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自平成24年3月20日 至平成24年9月18日	当期 自平成24年9月19日 至平成25年3月18日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	749,043,160	1,340,397,731
受取利息	221,467	498,610
有価証券売買等損益	532,589,067	119,598,175
<b>営業収益合計</b>	<b>1,281,853,694</b>	<b>1,460,494,516</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	2,081,945	3,858,805
委託者報酬	81,467,305	150,996,444
その他費用	315,000	315,000
<b>営業費用合計</b>	<b>83,864,250</b>	<b>155,170,249</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>1,197,989,444</b>	<b>1,305,324,267</b>
<b>経常利益又は経常損失( )</b>	<b>1,197,989,444</b>	<b>1,305,324,267</b>
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	<b>1,197,989,444</b>	<b>1,305,324,267</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	47,956,418	29,096,444
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>446,345,905</b>	<b>1,196,984,796</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>455,262,162</b>	<b>4,647,228,171</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	455,262,162	4,647,228,171
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>244,056,627</b>	<b>987,065,262</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	244,056,627	987,065,262
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
<b>分配金</b>	<b>1 610,599,670</b>	<b>1 1,325,258,287</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>1,196,984,796</b>	<b>4,808,117,241</b>

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当期
	自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 平成24年9月17日及び平成25年3月17日が休日のため、前特定期間末日を平成24年9月18日とし、当特定期間末日を平成25年3月18日としております。このため、当特定期間は、181日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[平成24年 9月18日現在]	[平成25年 3月18日現在]
1. 1 期首元本額	11,323,834,884円	17,085,254,262円
期中追加設定元本額	13,791,970,874円	47,718,012,229円
期中一部解約元本額	8,030,551,496円	11,078,977,029円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	17,085,254,262口	53,724,289,462口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期
自 平成24年 3月20日 至 平成24年 9月18日	自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
1 分配金の計算過程  (平成24年3月20日から平成24年4月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(88,260,440円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(179,854,741円)及び分配準備積立金(386,801,943円)より、分配対象額は654,917,124円(1万口当たり460.12円)であり、うち85,396,719円(1万口当たり60円)を分配金額としております。	1 分配金の計算過程  (平成24年9月19日から平成24年10月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(119,611,214円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(262,175,566円)、投資信託約款に規定される収益調整金(578,245,807円)及び分配準備積立金(726,613,572円)より、分配対象額は1,686,646,159円(1万口当たり988.02円)であり、うち102,422,017円(1万口当たり60円)を分配金額としております。
(平成24年4月18日から平成24年5月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(108,388,136円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(343,082,872円)及び分配準備積立金(364,199,818円)より、分配対象額は815,670,826円(1万口当たり466.23円)であり、うち104,964,454円(1万口当たり60円)を分配金額としております。	(平成24年10月18日から平成24年11月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(113,098,101円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(83,998,156円)、投資信託約款に規定される収益調整金(806,687,186円)及び分配準備積立金(851,208,503円)より、分配対象額は1,854,991,946円(1万口当たり1,044.21円)であり、うち106,583,936円(1万口当たり60円)を分配金額としております。

<p>(平成24年5月18日から平成24年6月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(115,494,702円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(398,402,164円)及び分配準備積立金(330,515,531円)より、分配対象額は844,412,397円(1万口当たり471.45円)であり、うち107,463,193円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成24年11月20日から平成24年12月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(146,343,577円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(175,263,116円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,552,432,346円)及び分配準備積立金(860,880,472円)より、分配対象額は2,734,919,511円(1万口当たり1,127.43円)であり、うち169,801,727円(1万口当たり70円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年6月19日から平成24年7月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(125,560,386円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(411,794,621円)及び分配準備積立金(317,371,260円)より、分配対象額は854,726,267円(1万口当たり483.49円)であり、うち106,063,578円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成24年12月18日から平成25年1月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(230,205,286円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(50,683,880円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,783,232,839円)及び分配準備積立金(968,833,529円)より、分配対象額は4,032,955,534円(1万口当たり1,139.99円)であり、うち247,634,050円(1万口当たり70円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年7月18日から平成24年8月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(122,565,767円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(233,441,219円)、投資信託約款に規定される収益調整金(429,712,684円)及び分配準備積立金(308,115,245円)より、分配対象額は1,093,834,915円(1万口当たり629.82円)であり、うち104,200,201円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成25年1月18日から平成25年2月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(270,494,327円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,980,486,290円)及び分配準備積立金(966,301,614円)より、分配対象額は5,217,282,231円(1万口当たり1,131.56円)であり、うち322,746,531円(1万口当たり70円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年8月18日から平成24年9月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(120,111,845円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(308,261,197円)、投資信託約款に規定される収益調整金(478,253,393円)及び分配準備積立金(498,120,842円)より、分配対象額は1,404,747,277円(1万口当たり822.18円)であり、うち102,511,525円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成25年2月19日から平成25年3月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(336,649,920円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,833,703,998円)及び分配準備積立金(884,557,249円)より、分配対象額は6,054,911,167円(1万口当たり1,127.02円)であり、うち376,070,026円(1万口当たり70円)を分配金額としております。</p>

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	前期	当期
	自平成24年 3月20日 至平成24年 9月18日	自平成24年 9月19日 至平成25年 3月18日

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。</p> <p>法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。</p> <p>これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。</p>	同左

## ・金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [平成24年 9月18日現在]	当期 [平成25年 3月18日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	---	----

(有価証券に関する注記)

前期（自平成24年3月20日 至 平成24年9月18日）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	327,772,557
親投資信託受益証券	100
合計	327,772,657

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

当期（自平成24年9月19日 至 平成25年3月18日）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	266,558,889
親投資信託受益証券	99
合計	266,558,988

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(1口当たり情報に関する注記)

前期 [平成24年 9月18日現在]		当期 [平成25年 3月18日現在]	
1口当たり純資産額	1.0701円	1口当たり純資産額	1.0895円
(1万口当たり純資産額)	10,701円)	(1万口当たり純資産額)	10,895円)

## (4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund JPY-Hedged Class Units	5,380,511.7898	58,200,996,030	
投資信託受益証券 合計		5,380,511.7898	58,200,996,030	
親投資信託 受益証券	東京海上マネーマザーファンド	991,474.0000	1,001,388	
親投資信託受益証券 合計		991,474.0000	1,001,388	
合計		6,371,985.7898	58,201,997,418	

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

## 【東京海上Rogge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)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 [平成24年 9月18日現在]	当期 [平成25年 3月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	27,576,352	237,922,633
投資信託受益証券	712,151,685	3,584,719,310
親投資信託受益証券	10,009	10,014
未収利息	51	438
流動資産合計	739,738,097	3,822,652,395
資産合計	739,738,097	3,822,652,395
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	8,000,000	140,000,000
未払収益分配金	4,015,039	18,679,887
未払解約金	1,461,359	52,361,948
未払受託者報酬	14,488	55,173
未払委託者報酬	566,864	2,158,954
その他未払費用	6,280	23,975
流動負債合計	14,064,030	213,279,937
負債合計	14,064,030	213,279,937
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	669,173,324	2,668,555,359
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	56,500,743	940,817,099
( 分配準備積立金 )	17,964,745	260,479,188
元本等合計	725,674,067	3,609,372,458
純資産合計	725,674,067	3,609,372,458
負債純資産合計	739,738,097	3,822,652,395

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自平成24年3月20日 至平成24年9月18日	当期 自平成24年9月19日 至平成25年3月18日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	24,803,898	50,931,052
受取利息	8,893	28,515
有価証券売買等損益	10,347,267	296,667,630
<b>営業収益合計</b>	<b>14,465,524</b>	<b>347,627,197</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	70,759	162,037
委託者報酬	2,768,769	6,340,520
その他費用	30,678	70,372
<b>営業費用合計</b>	<b>2,870,206</b>	<b>6,572,929</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>11,595,318</b>	<b>341,054,268</b>
<b>経常利益又は経常損失（ ）</b>	<b>11,595,318</b>	<b>341,054,268</b>
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>	<b>11,595,318</b>	<b>341,054,268</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	75,719	13,599,177
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>34,828,219</b>	<b>56,500,743</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>43,324,385</b>	<b>711,139,171</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	43,324,385	711,139,171
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>12,736,814</b>	<b>103,254,550</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,736,814	103,254,550
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
<b>分配金</b>	<b>1 20,586,084</b>	<b>1 51,023,356</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>56,500,743</b>	<b>940,817,099</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期 自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び親 投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本 となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 平成24年9月17日及び平成25年3月17日が休日のため、 前特定期間末日を平成24年9月18日とし、当特定期間末 日を平成25年3月18日としております。このため、当特 定期間は、181日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期 [平成24年 9月18日現在]	当 期 [平成25年 3月18日現在]
1. 1 期首元本額	294,170,870円	669,173,324円
期中追加設定元本額	511,180,795円	2,552,428,080円
期中一部解約元本額	136,178,341円	553,046,045円
2. 1 特定期間末日における受益権の総 数	669,173,324口	2,668,555,359口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前 期 自 平成24年 3月20日 至 平成24年 9月18日	当 期 自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
1 分配金の計算過程  (平成24年3月20日から平成24年4月17日までの 分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額 分配後の配当等収益から費用を控除した額 (2,741,377円)、解約に伴う当期純利益金額分 配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰 越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に 規定される収益調整金(24,901,414円)及び分 配準備積立金(17,695,235円)より、分配対象額 は45,338,026円(1万口当たり1,051.52円)で あり、うち2,586,968円(1万口当たり60円)を分 配金額としております。	1 分配金の計算過程  (平成24年9月19日から平成24年10月17日までの 分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額 分配後の配当等収益から費用を控除した額 (4,651,326円)、解約に伴う当期純利益金額分 配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰 越欠損金を補填した額(7,236,300円)、投資信 託約款に規定される収益調整金(50,263,721 円)及び分配準備積立金(16,990,407円)より、 分配対象額は79,141,754円(1万口当たり 1,219.61円)であり、うち3,893,409円(1万口当 たり60円)を分配金額としております。
(平成24年4月18日から平成24年5月17日までの 分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額 分配後の配当等収益から費用を控除した額 (3,578,506円)、解約に伴う当期純利益金額分 配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰 越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に 規定される収益調整金(36,840,511円)及び分 配準備積立金(16,976,635円)より、分配対象額 は57,395,652円(1万口当たり1,057.45円)で あり、うち3,256,600円(1万口当たり60円)を分 配金額としております。	(平成24年10月18日から平成24年11月19日まで の分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額 分配後の配当等収益から費用を控除した額 (3,903,581円)、解約に伴う当期純利益金額分 配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰 越欠損金を補填した額(21,908,794円)、投資信 託約款に規定される収益調整金(49,513,686 円)及び分配準備積立金(19,565,248円)より、 分配対象額は94,891,309円(1万口当たり 1,602.14円)であり、うち3,553,625円(1万口当 たり60円)を分配金額としております。

<p>(平成24年5月18日から平成24年6月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,668,454円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(40,250,400円)及び分配準備積立金(17,008,009円)より、分配対象額は60,926,863円(1万口当たり1,062.49円)であり、うち3,440,554円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成24年11月20日から平成24年12月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,692,894円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(26,160,334円)、投資信託約款に規定される収益調整金(83,656,073円)及び分配準備積立金(37,563,819円)より、分配対象額は152,073,120円(1万口当たり2,005.59円)であり、うち5,307,645円(1万口当たり70円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年6月19日から平成24年7月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,125,277円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(42,507,097円)及び分配準備積立金(17,235,909円)より、分配対象額は63,868,283円(1万口当たり1,074.08円)であり、うち3,567,685円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成24年12月18日から平成25年1月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,150,206円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(67,691,666円)、投資信託約款に規定される収益調整金(156,856,169円)及び分配準備積立金(54,091,285円)より、分配対象額は285,789,326円(1万口当たり2,768.19円)であり、うち7,226,744円(1万口当たり70円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年7月18日から平成24年8月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,455,582円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(45,246,691円)及び分配準備積立金(17,615,424円)より、分配対象額は67,317,697円(1万口当たり1,085.97円)であり、うち3,719,238円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成25年1月18日から平成25年2月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(11,629,475円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(85,005,123円)、投資信託約款に規定される収益調整金(375,592,120円)及び分配準備積立金(118,176,216円)より、分配対象額は590,402,934円(1万口当たり3,343.13円)であり、うち12,362,046円(1万口当たり70円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年8月18日から平成24年9月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,304,078円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(51,350,128円)及び分配準備積立金(17,675,706円)より、分配対象額は73,329,912円(1万口当たり1,095.80円)であり、うち4,015,039円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成25年2月19日から平成25年3月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(16,591,766円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(62,443,259円)、投資信託約款に規定される収益調整金(683,006,466円)及び分配準備積立金(197,455,495円)より、分配対象額は959,496,986円(1万口当たり3,595.54円)であり、うち18,679,887円(1万口当たり70円)を分配金額としております。</p>

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	前期	当期
	自平成24年 3月20日 至平成24年 9月18日	自平成24年 9月19日 至平成25年 3月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左

2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

## ・金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [平成24年 9月18日現在]	当期 [平成25年 3月18日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。  (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 同左  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

前期（自 平成24年3月20日 至 平成24年9月18日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	5,112,202
親投資信託受益証券	1
合計	5,112,203

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

当期（自 平成24年9月19日 至 平成25年3月18日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	65,816,366
親投資信託受益証券	1
合計	65,816,367

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

（1口当たり情報に関する注記）

前期 [平成24年 9月18日現在]		当期 [平成25年 3月18日現在]	
1口当たり純資産額	1.0844円	1口当たり純資産額	1.3526円
(1万口当たり純資産額)	10,844円)	(1万口当たり純資産額)	13,526円)

**(4)【附属明細表】**

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund USD-Hedged Class Units	265,928.7322	3,584,719,310	
投資信託受益証券 合計		265,928.7322	3,584,719,310	
親投資信託 受益証券	東京海上マネーマザーファンド	9,915.0000	10,014	
親投資信託受益証券 合計		9,915.0000	10,014	
合計		275,843.7322	3,584,729,324	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【東京海上Rogge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)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 [平成24年 9月18日現在]	当期 [平成25年 3月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	83,208	913,363
投資信託受益証券	3,477,936	37,132,658
親投資信託受益証券	10,009	10,014
未収利息	-	1
流動資産合計	3,571,153	38,056,036
資産合計	3,571,153	38,056,036
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	18,681	191,059
未払受託者報酬	42	502
未払委託者報酬	1,798	19,642
その他未払費用	-	201
流動負債合計	20,521	211,404
負債合計	20,521	211,404
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,396,663	29,393,756
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	153,969	8,450,876
(分配準備積立金)	110,162	2,193,305
元本等合計	3,550,632	37,844,632
純資産合計	3,550,632	37,844,632
負債純資産合計	3,571,153	38,056,036

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自平成24年3月20日 至平成24年9月18日	当期 自平成24年9月19日 至平成25年3月18日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	115,937	398,471
受取利息	32	211
有価証券売買等損益	248,872	1,982,727
<b>営業収益合計</b>	<b>132,903</b>	<b>2,381,409</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	373	1,320
委託者報酬	14,767	52,317
その他費用	70	506
<b>営業費用合計</b>	<b>15,210</b>	<b>54,143</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>148,113</b>	<b>2,327,266</b>
<b>経常利益又は経常損失（ ）</b>	<b>148,113</b>	<b>2,327,266</b>
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>	<b>148,113</b>	<b>2,327,266</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	156,143	453
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>672,513</b>	<b>153,969</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>45,778</b>	<b>6,404,820</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	45,778	6,404,820
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>154,397</b>	<b>1,505</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	152,873	1,505
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,524	-
<b>分配金</b>	<b>105,669</b>	<b>433,221</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>153,969</b>	<b>8,450,876</b>

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期 自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しており ます。時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び親 投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しており ます。
2. その他財務諸表作成のための基本 となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 平成24年9月17日及び平成25年3月17日が休日のため、 前特定期間末日を平成24年9月18日とし、当特定期間末 日を平成25年3月18日としております。このため、当特 定期間は、181日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期 [平成24年 9月18日現在]	当 期 [平成25年 3月18日現在]
1. 1 期首元本額	8,107,373円	3,396,663円
期中追加設定元本額	2,560,256円	26,007,191円
期中一部解約元本額	7,270,966円	10,098円
2. 1 特定期間末日における受益権の総 数	3,396,663口	29,393,756口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前 期 自 平成24年 3月20日 至 平成24年 9月18日	当 期 自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
1 分配金の計算過程  (平成24年3月20日から平成24年4月17日までの 分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額 分配後の配当等収益から費用を控除した額 (48,956円)、解約に伴う当期純利益金額分配後 の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠 損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定 される収益調整金(335円)及び分配準備積立金 (673,344円)より、分配対象額は722,635円(1 万口当たり890.89円)であり、うち44,611円(1 万口当たり55円)を分配金額としております。	1 分配金の計算過程  (平成24年9月19日から平成24年10月17日までの 分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額 分配後の配当等収益から費用を控除した額 (22,864円)、解約に伴う当期純利益金額分配後 の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠 損金を補填した額(46,267円)、投資信託約款に 規定される収益調整金(233,007円)及び分配準 備積立金(110,162円)より、分配対象額は 412,300円(1万口当たり1,210.46円)であり、 うち18,733円(1万口当たり55円)を分配金額と しております。
(平成24年4月18日から平成24年5月17日までの 分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額 分配後の配当等収益から費用を控除した額 (4,431円)、解約に伴う当期純利益金額分配後 の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠 損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定 される収益調整金(94,973円)及び分配準備積 立金(70,508円)より、分配対象額は169,912円 (1万口当たり890.57円)であり、うち10,493円 (1万口当たり55円)を分配金額としております。	(平成24年10月18日から平成24年11月19日まで の分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額 分配後の配当等収益から費用を控除した額 (22,662円)、解約に伴う当期純利益金額分配後 の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠 損金を補填した額(39,681円)、投資信託約款に 規定される収益調整金(234,083円)及び分配準 備積立金(160,560円)より、分配対象額は 456,986円(1万口当たり1,338.01円)であり、 うち18,784円(1万口当たり55円)を分配金額と しております。

<p>(平成24年5月18日から平成24年6月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(11,762円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(95,824円)及び分配準備積立金(64,446円)より、分配対象額は172,032円(1万口当たり896.89円)であり、うち10,549円(1万口当たり55円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成24年11月20日から平成24年12月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(38,881円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(321,672円)、投資信託約款に規定される収益調整金(516,001円)及び分配準備積立金(204,119円)より、分配対象額は1,080,673円(1万口当たり1,925.40円)であり、うち36,482円(1万口当たり65円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年6月19日から平成24年7月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(11,888円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(96,750円)及び分配準備積立金(65,659円)より、分配対象額は174,297円(1万口当たり903.52円)であり、うち10,609円(1万口当たり55円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成24年12月18日から平成25年1月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(48,310円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(590,647円)、投資信託約款に規定される収益調整金(779,810円)及び分配準備積立金(527,414円)より、分配対象額は1,946,181円(1万口当たり2,769.78円)であり、うち45,671円(1万口当たり65円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年7月18日から平成24年8月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(13,132円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(98,551円)及び分配準備積立金(66,938円)より、分配対象額は178,621円(1万口当たり915.86円)であり、うち10,726円(1万口当たり55円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成25年1月18日から平成25年2月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(128,934円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(1,145,290円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,976,581円)及び分配準備積立金(1,120,700円)より、分配対象額は6,371,505円(1万口当たり3,380.98円)であり、うち122,492円(1万口当たり65円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年8月18日から平成24年9月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(13,496円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(46,003円)、投資信託約款に規定される収益調整金(232,060円)及び分配準備積立金(69,344円)より、分配対象額は360,903円(1万口当たり1,062.49円)であり、うち18,681円(1万口当たり55円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成25年2月19日から平成25年3月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(111,932円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(7,540,046円)及び分配準備積立金(2,272,432円)より、分配対象額は9,924,410円(1万口当たり3,376.36円)であり、うち191,059円(1万口当たり65円)を分配金額としております。</p>

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	前期	当期
	自平成24年 3月20日 至平成24年 9月18日	自平成24年 9月19日 至平成25年 3月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左

2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

## ・金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [平成24年 9月18日現在]	当期 [平成25年 3月18日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。  (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 同左  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

前期(自平成24年3月20日 至 平成24年9月18日)  
 売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	187,267
親投資信託受益証券	1
合計	187,268

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

当期(自平成24年9月19日 至 平成25年3月18日)  
 売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	190,328
親投資信託受益証券	1
合計	190,327

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(1口当たり情報に関する注記)

前期 [平成24年 9月18日現在]		当期 [平成25年 3月18日現在]	
1口当たり純資産額	1.0453円	1口当たり純資産額	1.2875円
(1万口当たり純資産額)	10,453円)	(1万口当たり純資産額)	12,875円)

**(4)【附属明細表】**

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund EUR-Hedged Class Units	2,912.5938	37,132,658	
投資信託受益証券 合計		2,912.5938	37,132,658	
親投資信託 受益証券	東京海上マネーマザーファンド	9,915.0000	10,014	
親投資信託受益証券 合計		9,915.0000	10,014	
合計		12,827.5938	37,142,672	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【東京海上Rogge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）】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 [平成24年 9月18日現在]	当期 [平成25年 3月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	397,853,171	421,611,450
投資信託受益証券	11,608,276,498	7,748,537,786
親投資信託受益証券	1,000,893	1,001,388
未収利息	737	776
流動資産合計	12,007,131,299	8,171,151,400
資産合計	12,007,131,299	8,171,151,400
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	20,000,000	-
未払収益分配金	112,963,061	70,849,101
未払解約金	49,891,225	202,879,294
未払受託者報酬	238,188	153,345
未払委託者報酬	9,320,369	6,000,436
その他未払費用	52,500	52,500
流動負債合計	192,465,343	279,934,676
負債合計	192,465,343	279,934,676
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	10,758,386,792	5,904,091,827
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,056,279,164	1,987,124,897
（分配準備積立金）	555,003,491	1,382,457,999
元本等合計	11,814,665,956	7,891,216,724
純資産合計	11,814,665,956	7,891,216,724
負債純資産合計	12,007,131,299	8,171,151,400

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自平成24年3月20日 至平成24年9月18日	当期 自平成24年9月19日 至平成25年3月18日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	675,162,436	594,799,871
受取利息	143,205	103,066
有価証券売買等損益	186,714,311	1,909,261,783
<b>営業収益合計</b>	<b>488,591,330</b>	<b>2,504,164,720</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,183,107	1,192,968
委託者報酬	46,295,460	46,681,307
その他費用	315,000	315,000
<b>営業費用合計</b>	<b>47,793,567</b>	<b>48,189,275</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>440,797,763</b>	<b>2,455,975,445</b>
<b>経常利益又は経常損失（ ）</b>	<b>440,797,763</b>	<b>2,455,975,445</b>
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>	<b>440,797,763</b>	<b>2,455,975,445</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	21,982,345	155,609,390
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>878,612,500</b>	<b>1,056,279,164</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>556,838,029</b>	<b>683,661,949</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	556,838,029	683,661,949
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>240,948,374</b>	<b>1,504,619,644</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	232,299,957	1,504,619,644
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,648,417	-
<b>分配金</b>	<b>601,003,099</b>	<b>548,562,627</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>1,056,279,164</b>	<b>1,987,124,897</b>

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期 自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しており ます。時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び親 投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しており ます。
2. その他財務諸表作成のための基本 となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 平成24年9月17日及び平成25年3月17日が休日のため、 前特定期間末日を平成24年9月18日とし、当特定期間末 日を平成25年3月18日としております。このため、当特 定期間は、181日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期 [平成24年 9月18日現在]	当 期 [平成25年 3月18日現在]
1. 1 期首元本額	6,144,422,361円	10,758,386,792円
期中追加設定元本額	8,528,037,339円	3,888,913,096円
期中一部解約元本額	3,914,072,908円	8,743,208,061円
2. 1 特定期間末日における受益権の総 数	10,758,386,792口	5,904,091,827口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前 期 自 平成24年 3月20日 至 平成24年 9月18日	当 期 自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
1 分配金の計算過程  (平成24年3月20日から平成24年4月17日までの 分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額 分配後の配当等収益から費用を控除した額 (74,689,981円)、解約に伴う当期純利益金額分 配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰 越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に 規定される収益調整金(344,966,562円)及び分 配準備積立金(714,766,942円)より、分配対象 額は1,134,423,485円(1万口当たり1,539.78 円)であり、うち77,357,554円(1万口当たり105 円)を分配金額としております。	1 分配金の計算過程  (平成24年9月19日から平成24年10月17日ま での分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額 分配後の配当等収益から費用を控除した額 (114,529,830円)、解約に伴う当期純利益金額 分配後の有価証券売買等損益から費用を控除 し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託 約款に規定される収益調整金(1,066,431,819 円)及び分配準備積立金(496,353,528円)よ り、分配対象額は1,677,315,177円(1万口当 たり1,619.35円)であり、うち108,756,878円(1 万口当たり105円)を分配金額としております。
(平成24年4月18日から平成24年5月17日ま での分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額 分配後の配当等収益から費用を控除した額 (98,291,692円)、解約に伴う当期純利益金額分 配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰 越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に 規定される収益調整金(693,170,239円)及び分 配準備積立金(654,047,617円)より、分配対象 額は1,445,509,548円(1万口当たり1,545.88 円)であり、うち98,180,669円(1万口当たり105 円)を分配金額としております。	(平成24年10月18日から平成24年11月19日ま での分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額 分配後の配当等収益から費用を控除した額 (107,817,291円)、解約に伴う当期純利益金額 分配後の有価証券売買等損益から費用を控除 し、繰越欠損金を補填した額(314,039,795 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (999,131,756円)及び分配準備積立金 (411,219,986円)より、分配対象額は 1,832,208,828円(1万口当たり1,970.22円) であり、うち97,643,705円(1万口当たり105円) を分配金額としております。

<p>(平成24年5月18日から平成24年6月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(106,676,844円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(778,388,955円)及び分配準備積立金(616,821,931円)より、分配対象額は1,501,887,730円(1万口当たり1,551.68円)であり、うち101,629,363円(1万口当たり105円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成24年11月20日から平成24年12月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(94,437,393円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(517,359,893円)、投資信託約款に規定される収益調整金(959,272,331円)及び分配準備積立金(589,860,723円)より、分配対象額は2,160,930,340円(1万口当たり2,609.88円)であり、うち99,356,380円(1万口当たり120円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年6月19日から平成24年7月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(114,409,888円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(832,395,519円)及び分配準備積立金(595,305,188円)より、分配対象額は1,542,110,595円(1万口当たり1,563.93円)であり、うち103,533,311円(1万口当たり105円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成24年12月18日から平成25年1月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(87,228,599円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(558,141,564円)、投資信託約款に規定される収益調整金(945,500,403円)及び分配準備積立金(928,706,368円)より、分配対象額は2,519,576,934円(1万口当たり3,349.89円)であり、うち90,255,910円(1万口当たり120円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年7月18日から平成24年8月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(117,487,854円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(930,364,501円)及び分配準備積立金(563,812,135円)より、分配対象額は1,611,664,490円(1万口当たり1,576.52円)であり、うち107,339,141円(1万口当たり105円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成25年1月18日から平成25年2月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(77,499,093円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(171,959,640円)、投資信託約款に規定される収益調整金(929,244,871円)及び分配準備積立金(1,271,338,817円)より、分配対象額は2,450,042,421円(1万口当たり3,598.55円)であり、うち81,700,653円(1万口当たり120円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年8月18日から平成24年9月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(121,098,517円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(26,077,486円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,066,290,832円)及び分配準備積立金(520,790,549円)より、分配対象額は1,734,257,384円(1万口当たり1,611.98円)であり、うち112,963,061円(1万口当たり105円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成25年2月19日から平成25年3月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(67,942,137円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(203,126,509円)、投資信託約款に規定される収益調整金(872,662,811円)及び分配準備積立金(1,182,238,454円)より、分配対象額は2,325,969,911円(1万口当たり3,939.57円)であり、うち70,849,101円(1万口当たり120円)を分配金額としております。</p>

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	前期	当期
	自平成24年 3月20日 至平成24年 9月18日	自平成24年 9月19日 至平成25年 3月18日

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。</p> <p>法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。</p> <p>これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。</p>	同左

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [平成24年 9月18日現在]	当期 [平成25年 3月18日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	---	----

(有価証券に関する注記)

前期（自平成24年3月20日 至 平成24年9月18日）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	151,071,310
親投資信託受益証券	100
合計	151,071,410

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

当期（自平成24年9月19日 至 平成25年3月18日）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	205,754,776
親投資信託受益証券	99
合計	205,754,875

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(1口当たり情報に関する注記)

前期 [平成24年 9月18日現在]		当期 [平成25年 3月18日現在]	
1口当たり純資産額	1.0982円	1口当たり純資産額	1.3366円
(1万口当たり純資産額)	10,982円)	(1万口当たり純資産額)	13,366円)

## (4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund AUD-Hedged Class Units	584,530.6115	7,748,537,786	
投資信託受益証券 合計		584,530.6115	7,748,537,786	
親投資信託 受益証券	東京海上マネーマザーファンド	991,474.0000	1,001,388	
親投資信託受益証券 合計		991,474.0000	1,001,388	
合計		1,576,004.6115	7,749,539,174	

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

## 【東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアルコース(毎月分配型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 [平成24年 9月18日現在]	当期 [平成25年 3月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	588,990,200	817,751,008
投資信託受益証券	13,596,299,724	19,042,242,894
親投資信託受益証券	1,000,893	1,001,388
未収入金	-	200,000,000
未収利息	1,091	1,506
流動資産合計	14,186,291,908	20,060,996,796
資産合計	14,186,291,908	20,060,996,796
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	20,000,000	-
未払収益分配金	225,413,316	276,156,255
未払解約金	127,307,119	333,924,528
未払受託者報酬	291,703	350,980
未払委託者報酬	11,414,532	13,734,029
その他未払費用	52,500	52,500
流動負債合計	384,479,170	624,218,292
負債合計	384,479,170	624,218,292
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	15,027,554,451	17,259,765,944
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,225,741,713	2,177,012,560
(分配準備積立金)	611,402,454	1,978,923,418
元本等合計	13,801,812,738	19,436,778,504
純資産合計	13,801,812,738	19,436,778,504
負債純資産合計	14,186,291,908	20,060,996,796

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自平成24年3月20日 至平成24年9月18日	当期 自平成24年9月19日 至平成25年3月18日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	1,413,157,046	1,561,204,771
受取利息	165,422	201,901
有価証券売買等損益	2,263,235,435	3,267,443,665
<b>営業収益合計</b>	<b>849,912,967</b>	<b>4,828,850,337</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,606,863	1,855,944
委託者報酬	62,877,207	72,623,965
その他費用	315,000	315,000
<b>営業費用合計</b>	<b>64,799,070</b>	<b>74,794,909</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>914,712,037</b>	<b>4,754,055,428</b>
<b>経常利益又は経常損失（ ）</b>	<b>914,712,037</b>	<b>4,754,055,428</b>
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>	<b>914,712,037</b>	<b>4,754,055,428</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	59,329,345	285,556,091
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>952,102,229</b>	<b>1,225,741,713</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>544,615,941</b>	<b>1,017,149,433</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	388,815,764	463,652,344
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	155,800,177	553,497,089
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>569,360,095</b>	<b>649,354,100</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	68,609,222	341,532,493
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	500,750,873	307,821,607
<b>分配金</b>	<b>1,297,717,096</b>	<b>1,433,540,397</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>1,225,741,713</b>	<b>2,177,012,560</b>

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当期 自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 平成24年9月17日及び平成25年3月17日が休日のため、前特定期間末日を平成24年9月18日とし、当特定期間末日を平成25年3月18日としております。このため、当特定期間は、181日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期 [平成24年 9月18日現在]	当期 [平成25年 3月18日現在]
1. 1 期首元本額	11,194,561,352円	15,027,554,451円
期中追加設定元本額	9,650,320,813円	13,957,210,115円
期中一部解約元本額	5,817,327,714円	11,724,998,622円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	15,027,554,451口	17,259,765,944口
3. 2 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,225,741,713円であり、 す。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 平成24年 3月20日 至 平成24年 9月18日	当期 自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
1 分配金の計算過程  (平成24年3月20日から平成24年4月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(192,330,066円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(289,529,324円)及び分配準備積立金(823,261,419円)より、分配対象額は1,305,120,809円(1万口当たり1,006.34円)であり、うち194,530,559円(1万口当たり150円)を分配金額としております。	1 分配金の計算過程  (平成24年9月19日から平成24年10月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(232,904,866円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(765,533,319円)及び分配準備積立金(554,645,787円)より、分配対象額は1,553,083,972円(1万口当たり1,065.55円)であり、うち218,623,972円(1万口当たり150円)を分配金額としております。

<p>(平成24年4月18日から平成24年5月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(215,591,185円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(447,000,856円)及び分配準備積立金(760,179,443円)より、分配対象額は1,422,771,484円(1万口当たり1,013.20円)であり、うち210,632,991円(1万口当たり150円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成24年10月18日から平成24年11月19日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(216,745,595円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(807,542,640円)及び分配準備積立金(492,566,044円)より、分配対象額は1,516,854,279円(1万口当たり1,076.72円)であり、うち211,311,771円(1万口当たり150円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年5月18日から平成24年6月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(222,936,620円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(527,204,120円)及び分配準備積立金(718,703,300円)より、分配対象額は1,468,844,040円(1万口当たり1,020.13円)であり、うち215,974,373円(1万口当たり150円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成24年11月20日から平成24年12月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(226,390,513円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(949,165,921円)及び分配準備積立金(448,320,145円)より、分配対象額は1,623,876,579円(1万口当たり1,090.29円)であり、うち223,405,641円(1万口当たり150円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年6月19日から平成24年7月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(236,300,759円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(605,595,600円)及び分配準備積立金(692,674,469円)より、分配対象額は1,534,570,828円(1万口当たり1,032.24円)であり、うち222,992,513円(1万口当たり150円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成24年12月18日から平成25年1月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(254,310,553円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(518,776,511円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,122,702,084円)及び分配準備積立金(394,852,318円)より、分配対象額は2,290,641,466円(1万口当たり1,429.62円)であり、うち240,338,494円(1万口当たり150円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年7月18日から平成24年8月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(234,559,364円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(695,090,047円)及び分配準備積立金(659,176,433円)より、分配対象額は1,588,825,844円(1万口当たり1,044.46円)であり、うち228,173,344円(1万口当たり150円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成25年1月18日から平成25年2月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(262,724,567円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(1,342,551,437円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,325,616,430円)及び分配準備積立金(792,879,581円)より、分配対象額は3,723,772,015円(1万口当たり2,259.35円)であり、うち263,704,264円(1万口当たり160円)を分配金額としております。</p>

<p>(平成24年8月18日から平成24年9月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(233,810,073円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(747,749,002円)及び分配準備積立金(603,005,697円)より、分配対象額は1,584,564,772円(1万口当たり1,054.41円)であり、うち225,413,316円(1万口当たり150円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成25年2月19日から平成25年3月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(262,557,596円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(109,594,306円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,755,490,918円)及び分配準備積立金(1,882,927,771円)より、分配対象額は4,010,570,591円(1万口当たり2,323.64円)であり、うち276,156,255円(1万口当たり160円)を分配金額としております。</p>
---	---

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	前期 自 平成24年 3月20日 至 平成24年 9月18日	当期 自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

## . 金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [平成24年 9月18日現在]	当期 [平成25年 3月18日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左

2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。  (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 同左  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

前期（自 平成24年3月20日 至 平成24年9月18日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	63,310,746
親投資信託受益証券	100
合計	63,310,846

（注）時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

当期（自 平成24年9月19日 至 平成25年3月18日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	104,769,532
親投資信託受益証券	99
合計	104,769,631

（注）時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

（1口当たり情報に関する注記）

前期 [平成24年 9月18日現在]		当期 [平成25年 3月18日現在]	
1口当たり純資産額	0.9184円	1口当たり純資産額	1.1261円
（1万口当たり純資産額	9,184円）	（1万口当たり純資産額	11,261円）

**(4)【附属明細表】**

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund BRL-Hedged Class Units	1,730,012.0736	19,042,242,894	
投資信託受益証券 合計		1,730,012.0736	19,042,242,894	
親投資信託 受益証券	東京海上マネーマザーファンド	991,474.0000	1,001,388	
親投資信託受益証券 合計		991,474.0000	1,001,388	
合計		2,721,486.0736	19,043,244,282	

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

## 【東京海上Rogge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)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 [平成24年 9月18日現在]	当期 [平成25年 3月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	21,819,963	9,765,314
投資信託受益証券	681,256,453	541,217,688
親投資信託受益証券	10,009	10,014
未収入金	6,000,000	10,000,000
未収利息	40	17
流動資産合計	709,086,465	560,993,033
資産合計	709,086,465	560,993,033
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	7,785,600	5,687,014
未払解約金	7,635,488	-
未払受託者報酬	14,558	10,161
未払委託者報酬	569,626	397,613
その他未払費用	6,313	4,406
流動負債合計	16,011,585	6,099,194
負債合計	16,011,585	6,099,194
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	677,008,774	454,961,167
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	16,066,106	99,932,672
( 分配準備積立金 )	44,399,807	52,523,427
元本等合計	693,074,880	554,893,839
純資産合計	693,074,880	554,893,839
負債純資産合計	709,086,465	560,993,033

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自平成24年3月20日 至平成24年9月18日	当期 自平成24年9月19日 至平成25年3月18日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	58,548,662	46,532,935
受取利息	8,424	7,872
有価証券売買等損益	82,486,932	104,361,240
<b>営業収益合計</b>	<b>23,929,846</b>	<b>150,902,047</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	84,942	74,254
委託者報酬	3,323,928	2,905,396
その他費用	36,837	32,194
<b>営業費用合計</b>	<b>3,445,707</b>	<b>3,011,844</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>27,375,553</b>	<b>147,890,203</b>
<b>経常利益又は経常損失（ ）</b>	<b>27,375,553</b>	<b>147,890,203</b>
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>	<b>27,375,553</b>	<b>147,890,203</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	2,165,696	13,725,123
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>54,880,845</b>	<b>16,066,106</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>42,626,792</b>	<b>48,373,773</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	600,871	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	42,025,921	48,373,773
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>7,776,864</b>	<b>58,694,673</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,287,152	58,694,673
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	489,712	-
<b>分配金</b>	<b>48,454,810</b>	<b>39,977,614</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>16,066,106</b>	<b>99,932,672</b>

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当期
	自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 平成24年9月17日及び平成25年3月17日が休日のため、前特定期間末日を平成24年9月18日とし、当特定期間末日を平成25年3月18日としております。このため、当特定期間は、181日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[平成24年 9月18日現在]	[平成25年 3月18日現在]
1. 1 期首元本額	415,864,240円	677,008,774円
期中追加設定元本額	471,508,987円	386,582,166円
期中一部解約元本額	210,364,453円	608,629,773円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	677,008,774口	454,961,167口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期
自 平成24年 3月20日 至 平成24年 9月18日	自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
1 分配金の計算過程  (平成24年3月20日から平成24年4月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(8,623,756円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(44,502,109円)及び分配準備積立金(49,830,221円)より、分配対象額は102,956,086円(1万口当たり1,451.79円)であり、うち8,155,267円(1万口当たり115円)を分配金額としております。	1 分配金の計算過程  (平成24年9月19日から平成24年10月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(8,788,173円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(52,322,033円)及び分配準備積立金(41,604,769円)より、分配対象額は102,714,975円(1万口当たり1,568.86円)であり、うち7,529,124円(1万口当たり115円)を分配金額としております。
(平成24年4月18日から平成24年5月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(9,375,698円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(50,738,067円)及び分配準備積立金(45,555,427円)より、分配対象額は105,669,192円(1万口当たり1,467.58円)であり、うち8,280,165円(1万口当たり115円)を分配金額としております。	(平成24年10月18日から平成24年11月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,875,236円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(54,582,923円)及び分配準備積立金(36,932,993円)より、分配対象額は99,391,152円(1万口当たり1,590.57円)であり、うち7,185,995円(1万口当たり115円)を分配金額としております。

<p>(平成24年5月18日から平成24年6月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(9,067,756円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(49,081,739円)及び分配準備積立金(44,406,568円)より、分配対象額は102,556,063円(1万口当たり1,483.77円)であり、うち7,948,524円(1万口当たり115円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成24年11月20日から平成24年12月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(8,881,331円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(59,786,607円)及び分配準備積立金(34,201,264円)より、分配対象額は102,869,202円(1万口当たり1,615.08円)であり、うち7,961,579円(1万口当たり125円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年6月19日から平成24年7月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(9,514,459円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(49,416,115円)及び分配準備積立金(45,525,800円)より、分配対象額は104,456,374円(1万口当たり1,505.96円)であり、うち7,976,563円(1万口当たり115円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成24年12月18日から平成25年1月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(6,544,156円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(23,764,850円)、投資信託約款に規定される収益調整金(45,524,236円)及び分配準備積立金(24,216,672円)より、分配対象額は100,049,914円(1万口当たり2,137.85円)であり、うち5,849,847円(1万口当たり125円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年7月18日から平成24年8月17日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(9,912,874円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(53,660,220円)及び分配準備積立金(46,862,219円)より、分配対象額は110,435,313円(1万口当たり1,528.51円)であり、うち8,308,691円(1万口当たり115円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成25年1月18日から平成25年2月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(5,280,668円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(23,128,962円)、投資信託約款に規定される収益調整金(58,073,286円)及び分配準備積立金(35,806,638円)より、分配対象額は122,289,554円(1万口当たり2,651.96円)であり、うち5,764,055円(1万口当たり125円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成24年8月18日から平成24年9月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(8,927,636円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(52,726,801円)及び分配準備積立金(43,257,771円)より、分配対象額は104,912,208円(1万口当たり1,549.62円)であり、うち7,785,600円(1万口当たり115円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成25年2月19日から平成25年3月18日までの分配金計算期間)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(5,979,985円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(2,619,595円)、投資信託約款に規定される収益調整金(65,484,233円)及び分配準備積立金(49,610,861円)より、分配対象額は123,694,674円(1万口当たり2,718.76円)であり、うち5,687,014円(1万口当たり125円)を分配金額としております。</p>

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	前期 自平成24年 3月20日 至平成24年 9月18日	当期 自平成24年 9月19日 至平成25年 3月18日

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

## ・金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [平成24年 9月18日現在]	当期 [平成25年 3月18日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。  (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 同左  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	---	----

(有価証券に関する注記)

前期(自平成24年3月20日 至 平成24年9月18日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	5,927,101
親投資信託受益証券	1
合計	5,927,102

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

当期(自平成24年9月19日 至 平成25年3月18日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	2,478,460
親投資信託受益証券	1
合計	2,478,461

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(1口当たり情報に関する注記)

前期 [平成24年 9月18日現在]		当期 [平成25年 3月18日現在]	
1口当たり純資産額	1.0237円	1口当たり純資産額	1.2197円
(1万口当たり純資産額)	10,237円)	(1万口当たり純資産額)	12,197円)

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund Resources Currency Basket Class Units	45,434.6616	541,217,688	
投資信託受益証券 合計		45,434.6616	541,217,688	
親投資信託 受益証券	東京海上マネーマザーファンド	9,915.0000	10,014	
親投資信託受益証券 合計		9,915.0000	10,014	
合計		55,349.6616	541,227,702	

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

## 【東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)マネーブル・ファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 [平成24年 9月18日現在]	第3期 [平成25年 3月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	5,883,142	23,697,393
流動資産合計	5,883,142	23,697,393
資産合計	5,883,142	23,697,393
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	209	50
未払委託者報酬	4,624	1,139
流動負債合計	4,833	1,189
負債合計	4,833	1,189
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 5,874,504	1 23,670,831
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,805	25,373
(分配準備積立金)	2,694	4,670
元本等合計	5,878,309	23,696,204
純資産合計	5,878,309	23,696,204
負債純資産合計	5,883,142	23,697,393

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期 自平成24年3月20日 至平成24年9月18日	第3期 自平成24年9月19日 至平成25年3月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	18,726	4,362
営業収益合計	18,726	4,362
営業費用		
受託者報酬	209	50
委託者報酬	4,624	1,139
営業費用合計	4,833	1,189
営業利益又は営業損失( )	13,893	3,173
経常利益又は経常損失( )	13,893	3,173
当期純利益又は当期純損失( )	13,893	3,173
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	11,338	140
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,301	3,805
剰余金増加額又は欠損金減少額	13,150	20,143
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	13,150	20,143
剰余金減少額又は欠損金増加額	15,201	1,888
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	15,201	1,888
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,805	25,373

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第3期 自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 平成24年9月17日及び平成25年3月17日が休日のため、前計算期間末日を平成24年9月18日とし、当計算期間末日を平成25年3月18日としております。このため、当計算期間は、181日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期 [平成24年 9月18日現在]	第3期 [平成25年 3月18日現在]
1. 1 期首元本額	17,853,916円	5,874,504円
期中追加設定元本額	60,364,269円	20,710,827円
期中一部解約元本額	72,343,681円	2,914,500円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	5,874,504口	23,670,831口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 平成24年 3月20日 至 平成24年 9月18日	第3期 自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
1 分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（54円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（2,501円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,111円）及び分配準備積立金（139円）より、分配対象額は3,805円（1万口当たり6.45円）であります。分配を行っておりません。	1 分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（139円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（3,174円）、投資信託約款に規定される収益調整金（20,703円）及び分配準備積立金（1,357円）より、分配対象額は25,373円（1万口当たり10.70円）であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	第2期 自 平成24年 3月20日 至 平成24年 9月18日	第3期 自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左

2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

## ・金融商品の時価等に関する事項

区分	第2期 [平成24年 9月18日現在]	第3期 [平成25年 3月18日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。  (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 同左  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第2期（自平成24年3月20日 至 平成24年9月18日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,912
合計	2,912

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

第3期（自平成24年9月19日 至 平成25年3月18日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	4,362
合計	4,362

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

（1口当たり情報に関する注記）

第2期 [平成24年 9月18日現在]		第3期 [平成25年 3月18日現在]	
1口当たり純資産額	1.0006円	1口当たり純資産額	1.0011円
(1万口当たり純資産額)	10,006円)	(1万口当たり純資産額)	10,011円)

**(4)【附属明細表】**

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	東京海上マネーマザーファンド	23,462,766	23,697,393	
親投資信託受益証券 合計		23,462,766	23,697,393	
合計		23,462,766	23,697,393	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（ご参考）

東京海上Rogge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）は「Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund Currency Selection JPY-Hedged Class Units」を、米ドルコース（毎月分配型）は「USD-Hedged Class Units」を、ユーロコース（毎月分配型）は「EUR-Hedged Class Units」を、豪ドルコース（毎月分配型）は「AUD-Hedged Class Units」を、ブラジル・リアルコース（毎月分配型）は「BRL-Hedged Class Units」を、資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）は「Resources Currency Basket Class Units」を、主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」はこれらファンドの受益証券です。

また、東京海上Rogge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）、米ドルコース（毎月分配型）、ユーロコース（毎月分配型）、豪ドルコース（毎月分配型）、ブラジル・リアルコース（毎月分配型）、資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）、マネープール・ファンドは、「東京海上マネーマザーファンド」を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同ファンドの受益証券です。なお、これら投資信託受益証券及び親投資信託受益証券の状況は次のとおりです。

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

### 「Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund Currency Selection」の状況

当投資信託は、ケイマンの法律に基づき設立された複数の通貨クラスを持つ円建て外国投資信託です。同ファンドの財務書類は、アメリカ合衆国において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠して作成され、独立監査人の監査を受けております。以下に記載した情報は、委託会社が同投資信託の管理会社であるMitsubishi UFJ Global Custody S.A.から入手した平成24年2月29日現在の財務書類の一部を抜粋・翻訳したものです。なお、開示情報につきましては、各通貨クラスを合算した単位（Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund Currency Selection）の純資産計算書、重要な会計方針に関する注記、投資有価証券明細表、及び為替予約取引に係る未実現損益明細表を掲載しております。

「Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund Currency Selection」は、ファンド名を「Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund」に変更しております。

#### (1)純資産計算書

平成24年2月29日現在

金額（円）

##### 資産：

債券（公正価値）	27,911,531,998
取得原価	25,691,541,758
現預金	700,120,816
外貨預金	21,003,731
取得原価	15,246,572
未収利息	629,644,884
追加設定に係る未収入金	1,745,300,000
為替予約取引に係る未実現利益	1,858,044,884
資産合計	32,865,646,313

##### 負債：

未払解約金	33,000,000
為替予約取引に係る未実現損失	2,377,032,080
未払費用	27,360,067
未払金	1,568,902,778
負債合計	4,006,294,925

##### 純資産総額

28,859,351,388

#### 各通貨クラスの基準価額

Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund Currency Selection

JPY-Hedged Class Units	10,374
USD-Hedged Class Units	10,845
EUR-Hedged Class Units	10,452
AUD-Hedged Class Units	11,284
BRL-Hedged Class Units	11,015
Resources Currency Basket-Hedged Class Units	11,291

#### (2)重要な会計方針に関する注記

当財務書類は、アメリカ合衆国において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠して作成しております。ファンドの経営者は、財務書類に記載されている期末日現在の資産及び負債や、計算期間に発生した収益及び費用の金額に影響を与える見積もりや仮定を行うよう求められています。また、実際の結果についてはこれらの見積もりと異なることがあります。以下、重要な会計方針の要約です。

現金及び現金同等物

現金及び現金同等物は当座預金で保有しています。

#### 有価証券の評価

株式市場に上場又は組織的市場で取引されている有価証券については、当該株式市場又は組織的市場における入手可能な最終相場にて評価しています。ただし、関連する株式市場以外又は店頭市場においてプレミアム価格やディスカウント価格により取得又は取引された銘柄については、評価日におけるプレミアムやディスカウントの水準を考慮して評価します。

非上場有価証券については、ファンドマネジャーが適切だと判断する、直近に行われた同銘柄又は類似した銘柄の取引や、ブローカーや評価機関から入手した評価情報を考慮に入れ、ファンドマネジャーが誠実に判断した公正な市場相場にて評価しています。

#### 有価証券取引

有価証券取引は約定日に計上しています。オプション、先物及び債券の実現損益は、平均原価法に基づいて決定しています。

#### 外貨取引

当ファンドの基準通貨は日本円です。

外貨建資産及び負債は期末日現在に適用される為替レートで日本円に換算しています。外貨取引については、約定日に適用される為替レートで日本円に換算しています。

平成24年2月29日現在の為替レートは下記のとおりです。

1 JPY=	0.021212 BRL	1 JPY=	0.00773 GBP
1 JPY=	0.077756 CNY	1 JPY=	111.440573 IDR
1 JPY=	0.009236 EUR	1 JPY=	0.012355 USD
1 JPY=	0.011435 AUD		

#### 為替予約取引

為替予約取引は、満期までの残存期間に適用される期末日現在の先物為替レートで評価しています。保有している為替予約取引の未実現損益については、約定レートと期末日のレートの差で計算していません。

#### 利息配当の認識

受取利息については実効金利法により日々未収利息を計上しています。

### (3)投資有価証券明細表

平成24年2月29日現在

(単位：円)

種類	発行国・銘柄名	通貨	額面金額	評価金額	投資比率 (%)
債券	オーストラリア				
	Aust & Nz Banking Group 5.125% 10/09/2019	EUR	1,620,000	182,971,623	0.63
	Commonwealth Bank Aust 5.5% 06/08/2019	EUR	1,560,000	179,713,221	0.62
	National Australia Bank 4.625% 10/02/2020	EUR	1,640,000	178,362,177	0.62
	オーストラリア小計			541,047,021	1.87
	ケイマン				
	MUFG Capital Fin 2% FRN PERP	EUR	3,000,000	322,283,492	1.12
	ケイマン小計			322,283,492	1.12
	デンマーク				
	Danske Bank A/S Frn 29/09/2021	GBP	4,685,000	514,416,844	1.78
	デンマーク小計			514,416,844	1.78
	フランス				
Axa Sa Frn 16/04/2040	EUR	8,300,000	761,352,887	2.64	
Cnp Assurances Frn 30/09/2041	EUR	4,900,000	428,697,448	1.48	
Societe General Frn PERP	EUR	2,700,000	275,981,969	0.96	

フランス小計			1,466,032,304	5.08
ドイツ				
Deutsche Bank Ag 5% 24/06/2020	EUR	4,750,000	525,844,885	1.82
ドイツ小計			525,844,885	1.82
ガーンジー				
Csg Guernsey I Ltd Frn 24/02/2041	USD	7,010,000	568,172,388	1.97
ガーンジー小計			568,172,388	1.97
香港				
Bank Of China Hong Kong 5.55% 11/02/2020	USD	3,150,000	269,162,322	0.93
Bank Of China Hong Kong 5.55% 11/02/2020	USD	190,000	16,438,646	0.06
香港小計			285,600,968	0.99
アイルランド				
Cloverie (Zurich Ins) Frn 24/07/2039	EUR	5,950,000	695,397,950	2.41
アイルランド小計			695,397,950	2.41
日本				
Sumitomo Mitsui Bk 4% 09/11/2020	EUR	1,640,000	178,864,705	0.62
日本小計			178,864,705	0.62
ジャージー				
Hsbc Capital Funding Lp Frn PERP	USD	9,710,000	756,451,350	2.62
Qbe Cap Funding Iii Ltd Frn 24/05/2041	USD	4,400,000	325,825,252	1.13
ジャージー小計			1,082,276,602	3.75
メキシコ				
Bbva Bancomer Sa Texas 6.5% 10/03/2021	USD	390,000	32,337,456	0.11
Bbva Bancomer Sa Texas 6.5% 10/03/2021	USD	6,060,000	502,847,077	1.75
メキシコ小計			535,184,533	1.86
オランダ				
Abn Amro Bank Nv 6.375% 27/04/2021	EUR	7,180,000	804,931,186	2.79
Allianz Finance Ii B.V. Frn 08/07/2041	EUR	5,300,000	548,812,219	1.90
Ing Bank Nv Frn 29/05/2023	GBP	5,300,000	686,613,622	2.38
Rabobank Nederland 3.75% 09/11/2020	EUR	3,580,000	366,625,489	1.27
オランダ小計			2,406,982,516	8.34
ノルウェー				
Dnb Bank Asa Frn PERP	GBP	5,760,000	722,456,268	2.50
ノルウェー小計			722,456,268	2.50
シンガポール				
Dbz Bank Ltd/Singapore Frn 15/11/2019	USD	2,120,000	180,018,003	0.62

Oversea-Chinese Banking Frn 18/11/2019	USD	2,190,000	183,218,029	0.64
United Overseas Bank Ltd Frn 03/09/2019	USD	2,160,000	184,732,792	0.64
シンガポール小計			547,968,824	1.90
スウェーデン				
Nordea Bank Ab 4% 29/03/2021	EUR	4,300,000	444,070,850	1.54
Nordea Bank Ab Frn PERP	USD	3,840,000	329,461,275	1.14
Svenska Handelsbanken Ab Frn PERP	EUR	4,650,000	485,034,377	1.68
スウェーデン小計			1,258,566,502	4.36
スイス				
Ubs AG Jersey Branch Frn 22/02/2022	USD	6,920,000	555,539,920	1.92
スイス小計			555,539,920	1.92
英国				
Abbey Natl Treasury Serv 3.625% 14/10/2016	EUR	2,820,000	316,726,078	1.10
Amlin Plc Frn 19/12/2026	GBP	3,980,000	437,650,521	1.52
Aviva Plc Frn 02/10/2023	EUR	2,510,000	266,521,254	0.92
Aviva Plc Frn 20/05/2058	GBP	4,460,000	474,781,759	1.65
Barclays Bank Plc 6% 23/01/2018	EUR	9,110,000	989,922,022	3.43
Coventry Bldg Society 5.875% 28/09/2022	GBP	4,130,000	531,163,604	1.84
Hsbc Holdings Plc 6.8% 01/06/2038	USD	2,150,000	198,237,759	0.69
Lloyds Tsb Bank Plc Frn 05/03/2018	EUR	5,080,000	484,025,607	1.68
Nationwide Bldg Society 6.75% 22/07/2020	EUR	6,340,000	644,902,590	2.23
Prudential Plc Frn 29/05/2039	GBP	2,150,000	364,555,903	1.26
Royal Bk Of Scotland Plc 6.934% 09/04/2018	EUR	9,070,000	908,917,441	3.15
Standard Chartered Bank 5.875% 26/09/2017	EUR	1,450,000	170,118,264	0.59
Standard Chartered Plc Frn PERP	USD	11,200,000	848,881,856	2.94
英国小計			6,636,404,658	23.00
米国				
American Express Co Frn 01/09/2066	USD	6,990,000	580,622,065	2.01
Bac Capital Trust Xi 6.625% 23/05/2036	USD	6,190,000	487,586,282	1.69
Bnp Paribas Cap Trust Vi Frn PERP	EUR	9,690,000	991,444,373	3.44
Capital One Capital V 10.25% 15/08/2039	USD	7,060,000	600,825,348	2.08
Citigroup Capital Xxi Frn 21/12/2057	USD	9,500,000	794,842,945	2.75

Cred Suisse Gp Fin(Us) Frn 14/09/2020	EUR	3,360,000	342,600,207	1.19
Ge Capital Trust I Frn 15/11/2067	USD	12,070,000	994,286,582	3.45
Goldman Sachs Group Inc 4.75% 12/10/2021	EUR	8,480,000	830,401,203	2.88
Jpmc Capital Xviii 6.95% 17/08/2036	USD	10,270,000	848,078,376	2.94
Pnc Financial Services Frn PERP	USD	6,290,000	534,140,566	1.85
State Street Capital Tru Frn PERP	USD	3,090,000	249,166,702	0.86
Us Treasury N/B 2% 15/11/2021	USD	3,500,000	284,861,368	0.99
Us Treasury N/B 2.125% 15/08/2021	USD	3,110,000	256,895,524	0.89
Us Treasury N/B 3.125% 15/05/2021	USD	2,700,000	242,764,981	0.84
Us Treasury N/B 3.625% 15/02/2021	USD	2,600,000	242,947,728	0.84
Wells Fargo Capital X 5.95% 15/12/2036	USD	9,610,000	787,027,368	2.73
米國小計			9,068,491,618	31.43
債券合計			27,911,531,998	96.72

## (4) 為替予約取引に係る未実現損益明細表

平成24年2月29日現在

(単位：円)

満期	通貨(売)	金額(売)	通貨(買)	金額(買)	未実現利益
2012/ 9/3	JPY	6,183,101,296	AUD	74,905,523	360,080,758
2012/ 9/3	BRL	196,000	JPY	9,221,234	2,069
2012/ 9/3	JPY	10,870,428,786	BRL	243,786,927	596,468,092
2012/ 9/3	JPY	29,883,991	EUR	297,368	2,311,996
2012/ 9/3	JPY	52,418,202	USD	664,028	1,324,366
2012/12/4	JPY	17,551,818,750	USD	227,905,593	888,098,418
2012/ 9/3	JPY	155,420,444	ZAR	15,225,848	9,759,185
未実現利益合計					1,858,044,884

満期	通貨(売)	金額(売)	通貨(買)	金額(買)	未実現損失
2012/ 9/3	AUD	405,000	JPY	33,987,244	1,390,504
2012/12/4	EUR	119,701,529	JPY	12,124,847,701	833,432,393
2012/ 9/3	GBP	28,300,129	JPY	3,441,470,522	215,194,451
2012/ 9/3	USD	353,320,000	JPY	27,307,983,528	1,287,681,362
2012/12/4	USD	23,596,175	JPY	1,870,134,726	39,039,692
2012/ 9/3	ZAR	876,000	JPY	9,209,724	293,678
未実現損失合計					2,377,032,080

## 「東京海上マネーマザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

		[平成24年 9月18日現在]	[平成25年 3月18日現在]
--	--	-----------------	-----------------

区 分	注記 番号	金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		9,898,461	10,635,791
国債証券		159,997,280	119,992,680
未収入金		9,999,830	
未収利息		18	19
流動資産合計		179,895,589	130,628,490
資産合計		179,895,589	130,628,490
純資産の部			
元本等			
元本	1	178,199,913	129,332,905
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		1,695,676	1,295,585
元本等合計		179,895,589	130,628,490
純資産合計		179,895,589	130,628,490
負債純資産合計		179,895,589	130,628,490

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成24年 9月19日 至 平成25年 3月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価 評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価 額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供 する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均 値)等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[平成24年 9月18日現在]	[平成25年 3月18日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期 首における当該親投資信託の元本額	62,675,746円	178,199,913円
同期中における追加設定元本額	231,339,831円	20,528,580円
同期中における一部解約元本額	115,815,664円	69,395,588円
同期末における元本額	178,199,913円	129,332,905円
元本の内訳*		
東京海上・東南アジア株式ファンド	1,100,000円	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	1,100,000円
大和マイクロファイナンス ・ファンド	992,261円	992,261円
東京海上Rogge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	991,474円
東京海上Rogge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	9,915円

東京海上Rogge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	9,915円
東京海上Rogge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	991,474円
東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) ブラジル・リアルコース (毎月分配型)	991,474円	991,474円
東京海上Rogge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	9,915円
東京海上Rogge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	5,827,779円	23,462,766円
TMAマネーファンド (適格機関投資家限定)	166,175,706円	99,673,711円
計	178,199,913円	129,332,905円
2. 1 本書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	178,199,913口	129,332,905口

(注)\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

区分	自平成24年 3月20日 至平成24年 9月18日	自平成24年 9月19日 至平成25年 3月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。</p> <p>法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。</p> <p>これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。</p>	同左
-------------------	---	----

## ・金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成24年 9月18日現在]	[平成25年 3月18日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(自 平成24年3月20日 至 平成24年9月18日)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	12,140
合計	12,140

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(平成24年8月16日から平成24年9月18日まで)を指しております。

(自平成24年9月19日 至 平成25年3月18日)  
売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	16,680
合計	16,680

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(平成24年8月16日から平成25年3月18日まで)を指しております。

(1口当たり情報に関する注記)

[平成24年 9月18日現在]		[平成25年 3月18日現在]	
1口当たり純資産額	1.0095円	1口当たり純資産額	1.0100円
(1万口当たり純資産額	10,095円)	(1万口当たり純資産額	10,100円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第341回国庫短期証券	120,000,000	119,992,680	
国債証券	合計	120,000,000	119,992,680	
	合計	120,000,000	119,992,680	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

東京海上Rogge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)

平成25年4月30日現在

種類	金額
資産総額	69,259,593,174 円
負債総額	2,121,278,422 円
純資産総額( - )	67,138,314,752 円
発行済数量	60,900,734,587 口
1単位当たり純資産額( / )	1.1024 円

東京海上Rogge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)

平成25年4月30日現在

種類	金額
資産総額	7,544,138,527 円

負債総額	492,622,933 円
純資産総額( - )	7,051,515,594 円
発行済数量	5,014,928,995 口
1単位当たり純資産額( / )	1.4061 円

東京海上Rogge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)  
平成25年4月30日現在

種類	金額
資産総額	47,311,207 円
負債総額	16,625 円
純資産総額( - )	47,294,582 円
発行済数量	35,451,206 口
1単位当たり純資産額( / )	1.3341 円

東京海上Rogge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)  
平成25年4月30日現在

種類	金額
資産総額	7,165,274,331 円
負債総額	159,656,245 円
純資産総額( - )	7,005,618,086 円
発行済数量	5,100,352,877 口
1単位当たり純資産額( / )	1.3736 円

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアルコース(毎月分配型)  
平成25年4月30日現在

種類	金額
資産総額	20,147,867,401 円
負債総額	322,480,636 円
純資産総額( - )	19,825,386,765 円
発行済数量	17,240,241,330 口
1単位当たり純資産額( / )	1.1499 円

東京海上Rogge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)  
平成25年4月30日現在

種類	金額
資産総額	688,833,860 円
負債総額	53,088,449 円
純資産総額( - )	635,745,411 円
発行済数量	504,639,010 口
1単位当たり純資産額( / )	1.2598 円

東京海上Rogge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  
平成25年4月30日現在

種類	金額
----	----

資産総額	23,698,550 円
負債総額	731 円
純資産総額( - )	23,697,819 円
発行済数量	23,670,831 口
1単位当たり純資産額( / )	1.0011 円

(ご参考：親投資信託の現況)  
東京海上マネーマザーファンド

平成25年4月30日現在

種類	金額
資産総額	130,635,927 円
負債総額	3,300,402 円
純資産総額( - )	127,335,525 円
発行済数量	126,064,325 口
1単位当たり純資産額( / )	1.0101 円

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、振替受益権となり、委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

1. 名義書換  
該当事項はありません。
2. 受益者に対する特典  
特典はありません。
3. 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。
4. 受益権の譲渡  
受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。  
上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。  
上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
5. 受益権の譲渡の対抗要件  
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
6. 受益権の再分割  
委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
7. 償還金  
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益

権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)にお支払いします。

8. 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて  
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

平成25年4月末日現在、資本金の額は20億円です。なお、会社の発行可能株式総数は160,000株であり、38,300株を発行済みです。

委託会社業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役の選任は株主総会において、議決権を行使することができる株主の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもってこれを行い、累積投票によらないものとします。取締役の任期は、選任後1年内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役中より代表取締役を選任します。

投資信託の投資運用の意思決定プロセスは以下の通りです。

運用本部で運用計画案、収益分配方針案等の運用の基本方針案を作成します。

運用の基本方針は、運用本部長を委員長とする投資政策委員会で投資環境見通し等をふまえて決定されます。

決定された運用の基本方針に基づき、具体的運用計画を策定し、運用を行います。

売買の執行はトレーディング部が行います。

運用部門とは独立した管理部門にて運用評価、ガイドライン遵守状況のチェックを行い、管理本部長を委員長とし運用管理室を事務局とする運用管理委員会に結果報告します。

運用管理委員会から投資政策委員会へ運用評価、ガイドライン遵守状況がフィードバックされ次の基本方針決定に生かされます。

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成25年4月30日現在、委託会社が運用を行っている証券投資信託（親投資信託を除きます。）は次の通りです。

	本数	純資産総額（百万円）
追加型公社債投資信託	1	6,763
追加型株式投資信託	121	1,898,156
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	13	71,076
合計	135	1,975,995

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第27期事業年度(平成23年4月1日から平成24年3月31日まで)の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間会計期間(平成24年4月1日から平成24年9月30日まで)の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	5,046,015	5,761,145
前払費用	125,909	137,793
未収委託者報酬	1,451,584	1,436,947
未収収益	1,921,269	1,777,274
繰延税金資産	205,707	190,994
その他の流動資産	63,354	21,473
流動資産計	8,813,842	9,325,628
固定資産		
有形固定資産	* 1 339,073	* 1 259,429
建物	180,320	153,031
器具備品	158,752	106,397
無形固定資産	3,144	3,144
電話加入権	3,144	3,144
投資その他の資産	1,013,432	929,396
投資有価証券	39,419	16,664
関係会社株式	254,342	254,342
その他の関係会社有価証券	30,000	31,200
長期前払費用	192,205	143,968
敷金	368,720	361,849
繰延税金資産	128,745	121,371
固定資産計	1,355,650	1,191,969
資産合計	10,169,492	10,517,598
負債の部		
流動負債		
預り金	25,297	28,305
未払金	* 2 1,113,561	* 2 1,318,980
未払手数料	387,066	388,412
その他未払金	726,495	930,567
未払費用	322,235	52,898
未払消費税等	100,812	67,999
未払法人税等	616,000	544,000
前受収益	513,554	415,827
賞与引当金	202,702	207,304
その他の流動負債	1,250	787
流動負債計	2,895,413	2,636,103
固定負債		
退職給付引当金	110,188	115,077
役員退職慰労引当金	18,170	25,260
固定負債計	128,358	140,337

負債合計	3,023,771	2,776,440
純資産の部		
株主資本	7,145,769	7,741,052
資本金	2,000,000	2,000,000
利益剰余金	5,145,769	5,741,052
利益準備金	334,429	388,426
その他利益剰余金	4,811,339	5,352,625
繰越利益剰余金	4,811,339	5,352,625
評価・換算差額等	47	105
その他有価証券評価差額金	47	105
純資産合計	7,145,721	7,741,157
負債・純資産合計	10,169,492	10,517,598

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	4,632,692	5,441,098
運用受託報酬	5,850,581	6,132,962
投資助言報酬	12,636	24,836
その他営業収益	1,992	1,992
営業収益計	10,497,903	11,600,891
営業費用		
支払手数料	1,391,029	1,957,922
広告宣伝費	174,374	117,675
公告費	-	2,281
調査費	3,295,822	3,263,965
調査費	1,319,199	1,195,887
委託調査費	* 1 1,976,623	* 1 2,068,077
委託計算費	79,398	85,593
営業雑経費	128,802	127,614
通信費	34,541	31,372
印刷費	68,848	69,710
協会費	6,488	14,644
諸会費	10,375	4,391
図書費	8,548	7,495
営業費用計	5,069,426	5,555,052
一般管理費		
給料	2,215,928	2,399,236
役員報酬	66,840	71,115
給料・手当	* 1 1,639,732	* 1 1,730,916
賞与	509,356	597,205
交際費	13,554	10,606
旅費交通費	110,556	100,354
租税公課	40,194	41,500
不動産賃借料	383,281	343,381
役員退職慰労引当金繰入	5,570	7,090
退職給付費用	77,059	72,098
賞与引当金繰入	202,702	207,304
固定資産減価償却費	113,902	99,879
法定福利費	360,240	381,465
福利厚生費	9,681	9,181
諸経費	395,518	377,049
一般管理費計	3,928,188	4,049,148
営業利益	1,500,287	1,996,689
営業外収益		

受取配当金	* 1	117,681	* 1	115,821
受取利息		2,129		1,091
雑益		19,676		1,064
営業外収益計		139,487		117,976
営業外費用				
雑損		25,194		32,361
営業外費用計		25,194		32,361
経常利益		1,614,580		2,082,305
特別損失				
器具備品除却損		1,551		71
投資有価証券売却損		6		
資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額		7,443		
特別損失計		9,000		71
税引前当期純利益		1,605,579		2,082,233
法人税、住民税及び事業税		792,702		924,989
法人税等還付税額		24,710		
法人税等調整額		89,175		21,996
法人税等合計		678,816		946,985
当期純利益		926,763		1,135,247

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月 31日)	第27期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月 31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	2,000,000	2,000,000
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	2,000,000	2,000,000
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	287,619	334,429
当期変動額		
剰余金の配当	46,810	53,996
当期変動額合計	46,810	53,996
当期末残高	334,429	388,426
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
当期首残高	4,399,488	4,811,339
当期変動額		
剰余金の配当	514,912	593,960
当期純利益	926,763	1,135,247
当期変動額合計	411,850	541,286
当期末残高	4,811,339	5,352,625
利益剰余金合計		
当期首残高	4,687,107	5,145,769
当期変動額		
剰余金の配当	468,102	539,964
当期純利益	926,763	1,135,247
当期変動額合計	458,661	595,282
当期末残高	5,145,769	5,741,052

株主資本合計		
当期首残高	6,687,107	7,145,769
当期変動額		
剰余金の配当	468,102	539,964
当期純利益	926,763	1,135,247
当期変動額合計	458,661	595,282
当期末残高	7,145,769	7,741,052
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	73	47
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	121	153
当期変動額合計	121	153
当期末残高	47	105
評価・換算差額等合計		
当期首残高	73	47
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	121	153
当期変動額合計	121	153
当期末残高	47	105
純資産合計		
当期首残高	6,687,181	7,145,721
当期変動額		
剰余金の配当	468,102	539,964
当期純利益	926,763	1,135,247
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	121	153
当期変動額合計	458,540	595,436
当期末残高	7,145,721	7,741,157

## 重要な会計方針

第27期 自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	
(1) 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券	
移動平均法による原価法	
(2) その他有価証券	
時価のあるもの	
決算日の市場価格等に基づく時価法	
(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)	
時価を把握することが極めて困難と認められるもの	
移動平均法による原価法	
2. 固定資産の減価償却の方法	
(1) 有形固定資産	
定率法	

ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)については定額法、少額固定資産(取得価格が10万円以上20万円未満の資産)については3年間で均等償却する方法を採用しております。

## (2) 長期前払費用

定額法

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当期負担額を計上しております。

## (2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務に基づき計上しております。

## (3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

## 4. 消費税等の会計処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 追加情報

## 第27期

自 平成23年4月1日

至 平成24年3月31日

(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用)

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

## 注記事項

(貸借対照表関係)

第26期 平成23年3月31日現在	第27期 平成24年3月31日現在
* 1. 有形固定資産の減価償却累計額は次の通りであります。	* 1. 有形固定資産の減価償却累計額は次の通りであります。
建物 67,520千円	建物 95,026千円
器具備品 337,637千円	器具備品 401,705千円
* 2. 関係会社に対する主な資産・負債	* 2. 関係会社に対する主な資産・負債
区分掲記した以外で各科目に含まれている関係会社に対するものは次の通りであります。	区分掲記した以外で各科目に含まれている関係会社に対するものは次の通りであります。
未払金 541,759千円	未払金 576,853千円
(うち支配株主に対するもの 107,000千円)	(うち支配株主に対するもの 124,843千円)
(うち子会社に対するもの 122,692千円)	(うち子会社に対するもの 123,032千円)
(うち関連会社に対するもの 312,065千円)	(うち関連会社に対するもの 328,978千円)

(損益計算書関係)

第26期 自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日	第27期 自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日
* 1. 関係会社との主な取引高は次の通りであります。	* 1. 関係会社との主な取引高は次の通りであります。

給与・手当	462,103千円	給与・手当	473,719千円
委託調査費	1,279,757千円	委託調査費	1,576,497千円
受取配当金	117,681千円	受取配当金	115,821千円

## (株主資本等変動計算書関係)

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

## 1. 発行済株式に関する事項

(単位:株)

株式の種類	平成22年4月1日 現在	増加	減少	平成23年3月31日 現在
普通株式	38,300	-	-	38,300

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成22年6月29日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

## ・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	468,102千円
(ロ) 1株当たり配当額	12,222円
(ハ) 基準日	平成22年3月31日
(ニ) 効力発生日	平成22年6月30日

## (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成23年6月29日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

## ・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	509,964千円
(ロ) 配当の原資	利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	13,315円
(ニ) 基準日	平成23年3月31日
(ホ) 効力発生日	平成23年6月30日

第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

## 1. 発行済株式に関する事項

(単位:株)

株式の種類	平成23年4月1日 現在	増加	減少	平成24年3月31日 現在
普通株式	38,300	-	-	38,300

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成23年6月29日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

## ・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	509,964千円
(ロ) 1株当たり配当額	13,315円
(ハ) 基準日	平成23年3月31日
(ニ) 効力発生日	平成23年6月30日

## (2) 金銭以外による配当

平成23年6月15日の臨時株主総会において、次のとおり決議しております。

## ・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当財産の種類	株式会社東京海上研究所普通株式
(ロ) 配当財産の帳簿価格	30,000千円
(ハ) 1株当たり配当額	783円
(ニ) 基準日	平成23年6月15日
(ホ) 効力発生日	平成23年6月21日

## (3) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成24年6月26日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

## ・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	551,864千円
(ロ) 配当の原資	利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	14,409円

(二) 基準日  
(ホ) 効力発生日

平成24年 3月31日  
平成24年 6月27日

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

第26期 自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日	第27期 自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日
<p>(1) 金融商品に対する取組方針 当社の資本は本来の事業目的のために使用することを基本とし、資産の運用に際しては、資産運用リスクを極力最小限に留めることを基本方針としております。</p> <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク 営業債権である未収収益は顧客の信用リスクに晒されており、未収委託者報酬は市場リスクに晒されております。投資有価証券は、主にファンドの自己設定に関連する投資信託であり、基準価額の変動リスクに晒されております。 営業債務である未払金は、ほとんど1年以内の支払期日であり、流動性リスクに晒されております。</p> <p>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 未収収益については、管理部門において取引先ごとに期日及び残高を把握することで、回収懸念の早期把握や軽減を図っております。 市場リスク 未収委託者報酬には、運用資産の悪化から回収できず当社が損失を被るリスクが存在しますが、過去の回収実績からリスクは僅少であると判断しております。 投資有価証券については、管理部門において定期的に時価を把握する体制としております。 流動性リスク 当社は、日々資金残高管理を行っており流動性リスクを管理しております。</p>	<p>(1) 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク 同左</p> <p>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 同左  市場リスク 同左  流動性リスク 同左</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

第26期（平成23年3月31日現在）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません（（注2）参照）。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金・預金	5,046,015	5,046,015	
(2)未収委託者報酬	1,451,584	1,451,584	
(3)未収収益	1,921,269	1,921,269	
(4)投資有価証券 其他有価証券	9,419	9,419	
(5)敷金	368,720	236,852	131,868
(6)未払金	(1,113,561)	(1,113,561)	

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

第27期（平成24年3月31日現在）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の

とおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません(注2)参照)。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金・預金	5,761,145	5,761,145	
(2)未収委託者報酬	1,436,947	1,436,947	
(3)未収収益	1,777,274	1,777,274	
(4)投資有価証券 其他有価証券	16,664	16,664	
(5)敷金	361,849	258,063	103,786
(6)未払金	(1,318,980)	(1,318,980)	

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(注1)金融商品の時価の算定方法ならびに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

第26期 平成23年3月31日現在	第27期 平成24年3月31日現在
(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬並びに(3)未収収益及び(6)未払金 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。	(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬並びに(3)未収収益及び(6)未払金 同左
(4)投資有価証券 時価の算定方法につきましては「重要な会計方針」の「1.有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(4)投資有価証券 同左
(5)敷金 当社では、敷金の時価の算定は、その将来キャッシュ・フローを国債の利回り等適切な指標に当該建物の残存耐用年数を加味した利率で割り引いた現在価値より算定しております。	(5)敷金 同左

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

第26期 平成23年3月31日現在	第27期 平成24年3月31日現在																						
以下については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。	以下については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。																						
(単位：千円)	(単位：千円)																						
<table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>貸借対照表計上額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>投資有価証券</td> <td></td> </tr> <tr> <td>    其他有価証券</td> <td></td> </tr> <tr> <td>        非上場株式</td> <td>30,000</td> </tr> <tr> <td>        子会社株式</td> <td>221,595</td> </tr> <tr> <td>        関連会社株式</td> <td>32,747</td> </tr> <tr> <td>        その他の関係会社有価証券</td> <td>30,000</td> </tr> </tbody> </table>		貸借対照表計上額	投資有価証券		其他有価証券		非上場株式	30,000	子会社株式	221,595	関連会社株式	32,747	その他の関係会社有価証券	30,000	<table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>貸借対照表計上額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>子会社株式</td> <td>221,595</td> </tr> <tr> <td>関連会社株式</td> <td>32,747</td> </tr> <tr> <td>その他の関係会社有価証券</td> <td>31,200</td> </tr> </tbody> </table>		貸借対照表計上額	子会社株式	221,595	関連会社株式	32,747	その他の関係会社有価証券	31,200
	貸借対照表計上額																						
投資有価証券																							
其他有価証券																							
非上場株式	30,000																						
子会社株式	221,595																						
関連会社株式	32,747																						
その他の関係会社有価証券	30,000																						
	貸借対照表計上額																						
子会社株式	221,595																						
関連会社株式	32,747																						
その他の関係会社有価証券	31,200																						

(注3)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

第26期 平成23年3月31日現在	第27期 平成24年3月31日現在

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。	同左
---	----

## (注4) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

第26期 平成23年3月31日現在			第27期 平成24年3月31日現在		
(単位：千円)			(単位：千円)		
	1年以内	1年超		1年以内	1年超
預金	5,045,953		預金	5,761,116	
未収委託者報酬	1,451,584		未収委託者報酬	1,436,947	
未収収益	1,921,269		未収収益	1,777,274	
合計	8,418,807		投資有価証券		
			その他有価証券のうち満期があるもの		1,000
			合計	8,975,337	1,000

## (有価証券関係)

第26期 平成23年3月31日現在	第27期 平成24年3月31日現在
<p>1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 子会社株式221,595千円、関連会社株式32,747千円)並びにその他の関係会社有価証券(貸借対照表計上額 30,000千円)は、市場価格がなく時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。</p> <p>2. その他有価証券</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p>	<p>1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 子会社株式221,595千円、関連会社株式32,747千円)並びにその他の関係会社有価証券(貸借対照表計上額 31,200千円)は、市場価格がなく時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。</p> <p>2. その他有価証券</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p>

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの証券投資信託	2,113	2,100	13
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの証券投資信託	7,305	7,400	94
合計	9,419	9,500	80

(注)非上場株式(貸借対照表計上額30,000千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

区分	第26期
	自平成22年4月1日 至平成23年3月31日
売却額	994千円
売却益の合計額	-千円
売却損の合計額	6千円

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの証券投資信託	15,700	15,500	200
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの証券投資信託	964	1,000	35
合計	16,664	16,500	164

### 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 該当事項はありません。

## (退職給付関係)

第26期 自平成22年4月1日 至平成23年3月31日	第27期 自平成23年4月1日 至平成24年3月31日																				
<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>退職金制度及び確定拠出年金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項</p> <table border="1"> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>110,188千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>110,188千円</td> </tr> </table> <p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <table border="1"> <tr> <td>勤務費用</td> <td>51,271千円</td> </tr> <tr> <td>確定拠出年金への掛金支払額</td> <td>25,787千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>77,059千円</td> </tr> </table> <p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <p>退職給付債務の計算は簡便法を採用しており、確定拠出年金部分を除く退職給付費用は「勤務費用」に計上しております。</p>	退職給付債務	110,188千円	退職給付引当金	110,188千円	勤務費用	51,271千円	確定拠出年金への掛金支払額	25,787千円	退職給付費用	77,059千円	<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>同左</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項</p> <table border="1"> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>115,077千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>115,077千円</td> </tr> </table> <p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <table border="1"> <tr> <td>勤務費用</td> <td>43,770千円</td> </tr> <tr> <td>確定拠出年金への掛金支払額</td> <td>28,327千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>72,098千円</td> </tr> </table> <p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <p>同左</p>	退職給付債務	115,077千円	退職給付引当金	115,077千円	勤務費用	43,770千円	確定拠出年金への掛金支払額	28,327千円	退職給付費用	72,098千円
退職給付債務	110,188千円																				
退職給付引当金	110,188千円																				
勤務費用	51,271千円																				
確定拠出年金への掛金支払額	25,787千円																				
退職給付費用	77,059千円																				
退職給付債務	115,077千円																				
退職給付引当金	115,077千円																				
勤務費用	43,770千円																				
確定拠出年金への掛金支払額	28,327千円																				
退職給付費用	72,098千円																				

## (税効果会計関係)

### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の 主な原因別の内訳

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
繰延税金資産		

役員退職慰労引当金	7,393千円	9,601千円
退職給付引当金損金算入限度超過額	44,835千円	41,013千円
未払金	15,454千円	13,175千円
賞与引当金損金算入限度超過額	82,479千円	78,796千円
未払法定福利費否認	8,592千円	9,234千円
未払事業所税否認	3,444千円	3,362千円
未払事業税否認	46,947千円	40,452千円
未払調査費	47,913千円	41,860千円
ソフトウェア償却超過額	70,659千円	63,265千円
敷金償却費	5,824千円	7,550千円
未払確定拠出年金	876千円	927千円
未払費用	-	3,185千円
繰延税金資産小計	334,420千円	312,424千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	334,420千円	312,424千円
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	32千円	58千円
繰延税金負債合計	32千円	58千円
繰延税金資産の純額	334,453千円	312,365千円

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)	
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の百分の五以下であるため注記を省略しております。	法定実効税率	40.7%
	(調整)	
	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.2%
	タックスヘイブン課税	5.6%
	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.3%
	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2%
	その他	0.2%
	税効果会計適用後の法人税等の負担率	45.5%

## 3. 法人税率の変更等による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については、38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、35.6%となります。

この税率変更により、繰延税金資産（繰延税金負債を控除した金額）は26,174千円減少し、法人税等調整額が26,182千円、その他有価証券評価差額金が8千円それぞれ増加しております。

### (セグメント情報等)

第26期	第27期
自 平成22年4月1日	自 平成23年4月1日
至 平成23年3月31日	至 平成24年3月31日

<p>[セグメント情報]</p> <p>当社は「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として運用（投資運用業）を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。</p> <p>当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。</p> <p>[関連情報]</p> <p>1. 製品及びサービスごとの情報</p> <p>単一のサービス区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>2. 地域ごとの情報</p> <p>(1) 営業収益</p> <p>本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>(2) 有形固定資産</p> <p>本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報</p> <p>当社は、単一の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の10%以上に該当する顧客がありますが、秘密保持義務を負っているため記載をしておりません。</p>	<p>[セグメント情報]</p> <p>同左</p> <p>[関連情報]</p> <p>1. 製品及びサービスごとの情報</p> <p>同左</p> <p>2. 地域ごとの情報</p> <p>(1) 営業収益</p> <p>同左</p> <p>(2) 有形固定資産</p> <p>同左</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報</p> <p>同左</p>
---	---

## ( 関連当事者情報 )

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

## 1. 関連当事者との取引

- (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等  
重要な取引はありません。

## (2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の 所有 割合	関連当 事者との 関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
関連会社	TOKIO MARINE ROGGE ASSET MANAGEMENT LIMITED	英国・ London	300千	金融商品 取引業	(所有) 直接50%	運用の 再委任 役員の 派遣	委託 調査費 の支払	1,092,497	未払金	307,738

(注) \* 取引価格については、市場実勢等を勘案し、交渉の上決定しております。

\* 取引金額及び期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

- (3) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等  
重要な取引はありません。

- (4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主(個人の場合に限る。)等  
重要な取引はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する情報

(1) 親会社情報

東京海上ホールディングス株式会社(東京証券取引所及び大阪証券取引所に上場)  
東京海上日動火災保険株式会社(非上場)

- (2) 重要な関連会社の要約財務情報  
重要な関連会社はありません。

第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

1. 関連当事者との取引

- (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等  
重要な取引はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の 所有 割合	関連当 事者との 関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
関連会社	TOKIO MARINE ROGGE ASSET MANAGEMENT LIMITED	英国・ London	300千	金融商品 取引業	(所有) 直接50%	運用の 再委任 役員の 派遣	委託 調査費 の支払	1,367,824	未払金	328,743

(注)\*取引価格については、市場実勢等を勘案し、交渉の上決定しております。

\*取引金額及び期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

- (3) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等  
重要な取引はありません。

- (4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主(個人の場合に限る。)等  
重要な取引はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する情報

(1) 親会社情報

東京海上ホールディングス株式会社(東京証券取引所及び大阪証券取引所に上場)  
東京海上日動火災保険株式会社(非上場)

- (2) 重要な関連会社の要約財務情報  
重要な関連会社はありません。

(1株当たり情報)

	第26期 自平成22年4月1日 至平成23年3月31日	第27期 自平成23年4月1日 至平成24年3月31日
1株当たり純資産額	186,572円36銭	202,119円00銭
1株当たり当期純利益 金額	24,197円49銭	29,640円93銭
	(注)1. 潜在株式調整後1株当たり 当期純利益については、潜在 株式がないため記載しており ません。 (注)2. 1株当たり当期純利益金額 の算定上の基礎は以下のと おりであります。	(注)1. 潜在株式調整後1株当たり 当期純利益については、潜在 株式がないため記載しており ません。 (注)2. 1株当たり当期純利益金額 の算定上の基礎は以下のと おりであります。

	当期純利益	926,763千円	当期純利益	1,135,247千円
	普通株主に 帰属しない金額	-	普通株主に 帰属しない金額	-
	普通株式に係る 当期純利益	926,763千円	普通株式に係る 当期純利益	1,135,247千円
	期中平均株式数	38,300株	期中平均株式数	38,300株

中間財務諸表  
(イ) 中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間 (平成24年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金・預金	5,598,495
前払費用	108,870
未収委託者報酬	1,503,333
未収収益	2,249,493
繰延税金資産	217,476
その他の流動資産	12,326
流動資産計	9,689,995
固定資産	
有形固定資産	* 1 241,876
建物	141,405
器具備品	100,470
無形固定資産	3,144
電話加入権	3,144
投資その他の資産	901,802
投資有価証券	17,368
関係会社株式	254,342
その他の関係会社有価証券	31,200
長期前払費用	119,653
敷金	353,902
繰延税金資産	125,336
固定資産計	1,146,823
資産合計	10,836,819
負債の部	
流動負債	
預り金	35,507
未払金	1,346,551
未払手数料	405,507
その他未払金	941,044
未払費用	77,550
未払消費税等	* 2 64,592
未払法人税等	506,000
前受収益	375,601
賞与引当金	359,561
流動負債計	2,765,364
固定負債	

退職給付引当金	125,220
役員退職慰労引当金	28,240
<b>固定負債計</b>	<b>153,460</b>
<b>負債合計</b>	<b>2,918,825</b>
<b>純資産の部</b>	
株主資本	7,918,078
資本金	2,000,000
利益剰余金	5,918,078
利益準備金	443,612
その他利益剰余金	5,474,465
繰越利益剰余金	5,474,465
評価・換算差額等	84
その他有価証券評価差額金	84
<b>純資産合計</b>	<b>7,917,993</b>
<b>負債・純資産合計</b>	<b>10,836,819</b>

## (口) 中間損益計算書

(単位：千円)

当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)	
<b>営業収益</b>	
委託者報酬	3,260,575
運用受託報酬	3,091,941
投資助言報酬	10,263
その他営業収益	736
<b>営業収益計</b>	<b>6,363,517</b>
<b>営業費用</b>	
支払手数料	1,251,802
広告宣伝費	55,435
公告費	1,190
調査費	1,732,451
調査費	589,591
委託調査費	1,142,860
委託計算費	42,836
営業雑経費	72,617
通信費	14,577
印刷費	38,553
協会費	12,430
諸会費	2,983
図書費	4,071
<b>営業費用計</b>	<b>3,156,333</b>
<b>一般管理費</b>	
給料	985,157
役員報酬	35,238
給料・手当	866,064
賞与	83,855
交際費	4,381
旅費交通費	55,639
租税公課	23,394
不動産賃借料	171,690
役員退職慰労引当金繰入	2,980

退職給付費用		35,451
賞与引当金繰入		359,561
固定資産減価償却費	* 1	33,066
法定福利費		189,341
福利厚生費		6,513
諸経費		173,863
一般管理費計		2,041,043
営業利益		1,166,140
営業外収益		
受取配当金		37,741
受取利息		470
雑益		2,539
営業外収益計		40,750
営業外費用		
雑損		16,299
営業外費用計		16,299
経常利益		1,190,591
特別損失		
器具備品除却損		628
特別損失計		628
税引前中間純利益		1,189,962
法人税、住民税及び事業税		491,414
法人税等調整額		30,342
法人税等合計		461,071
中間純利益		728,890

## (八) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

当中間会計期間	
(自平成24年4月1日	
至平成24年9月30日)	
株主資本	
資本金	
当期首残高	2,000,000
当中間期変動額	-
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	2,000,000
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	388,426
当中間期変動額	
剰余金の配当	55,186
当中間期変動額合計	55,186
当中間期末残高	443,612
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	
当期首残高	5,352,625
当中間期変動額	
剰余金の配当	607,051
中間純利益	728,890
当中間期変動額合計	121,839

当中間期末残高	5,474,465
利益剰余金合計	
当期首残高	5,741,052
当中間期変動額	
剰余金の配当	551,864
中間純利益	728,890
当中間期変動額合計	177,026
当中間期末残高	5,918,078
株主資本合計	
当期首残高	7,741,052
当中間期変動額	
剰余金の配当	551,864
中間純利益	728,890
当中間期変動額合計	177,026
当中間期末残高	7,918,078
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	105
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	190
当中間期変動額合計	190
当中間期末残高	84
評価・換算差額等合計	
当期首残高	105
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	190
当中間期変動額合計	190
当中間期末残高	84
純資産合計	
当期首残高	7,741,157
当中間期変動額	
剰余金の配当	551,864
中間純利益	728,890
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	190
当中間期変動額合計	176,835
当中間期末残高	7,917,993

## (二) 重要な会計方針

	当中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
1. 資産の評価基準及び 評価方法	有価証券 (1) 子会社株式及び関連会社株式 並びにその他の関係会社有価 証券 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの

	<p>中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）</p> <p>時価を把握することが極めて困難と認められるもの</p> <p>移動平均法による原価法</p>
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法</p> <p>ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）については定額法、少額固定資産（取得価格が10万円以上20万円未満の資産）については、3年間で均等償却する方法を採用しております。</p> <p>(2) 長期前払費用 定額法</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金</p> <p>従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>(3) 役員退職慰労引当金</p> <p>役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づく中間期末要支給額を計上しております。</p>
4. 消費税等の会計処理方法	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## (会計方針の変更)

<p>当中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)</p> <p>(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更) 当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。 なお、この変更による当中間会計期間の損益の与える影響額は軽微であります。</p>
---

## (会計上の見積りの変更)

<p>当中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)</p>
---

当中間会計期間において、本社事務所の一部解約申し込みを行ったため、原状回復義務の費用総額及び履行時期の見積りの変更を行っております。これにより、従来の方法に比べて、当中間会計期間の諸経費が4,512千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前中間純利益がそれぞれ4,512千円減少しております。

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

	当中間会計期間 (平成24年9月30日現在)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	建物	106,652千円
	器具備品	395,683千円
2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。	

## (中間損益計算書関係)

	当中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)	
1 減価償却実施額	有形固定資産	33,066千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)				
1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項				
株式の種類	当事業年度期首 (株)	当中間会計期間 増加 (株)	当中間会計期間 減少 (株)	当中間会計期間末 (株)
普通株式	38,300	-	-	38,300
2. 配当に関する事項				
(1) 配当金支払額				
平成24年6月26日定時株主総会において、次のとおり決議しております。				
・普通株式の配当に関する事項				
(イ) 配当金総額・・・・・・・・・・551,864千円				
(ロ) 配当の原資・・・・・・・・・・利益剰余金				
(ハ) 1株当たり配当額・・・・・・・・14,409円				
(ニ) 基準日・・・・・・・・・・平成24年3月31日				
(ホ) 効力発生日・・・・・・・・・・平成24年6月27日				

## (金融商品関係)

当中間会計期間(平成24年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

平成24年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含まれておりません(注2)参照)。

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
--	---------------	-------	----

(1)現金・預金	5,598,495	5,598,495	
(2)未収委託者報酬	1,503,333	1,503,333	
(3)未収収益	2,249,493	2,249,493	
(4)投資有価証券 その他有価証券	17,368	17,368	
(5)敷金	353,902	258,308	95,593
(6)未払金	(1,346,551)	(1,346,551)	

(\*) 負債で計上されているものについては、( )で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益及び(6) 未払金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(4) 投資有価証券

時価の算定方法につきましては「(二)重要な会計方針」の「1.資産の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(5) 敷金

当社では、敷金の時価の算定は、その将来キャッシュ・フローを国債の利回り等適切な指標に当該建物の残存耐用年数を加味した利率で割り引いた現在価値より算定しております。

(注2) 子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 子会社株式221,595千円、関連会社株式32,747千円)並びにその他の関係会社有価証券(中間貸借対照表計上額 31,200千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

(有価証券関係)

当中間会計期間(平成24年9月30日)

1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券

子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 子会社株式221,595千円、関連会社株式32,747千円)並びにその他の関係会社有価証券(中間貸借対照表計上額31,200千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	証券投資信託	8,272	8,100	172
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	証券投資信託	9,095	9,400	304
合計		17,368	17,500	131

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)

当社は「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として運用(投資運用業)を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間(自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

単一のサービス区分の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

当社は、外部顧客からの収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

## (1株当たり情報)

	当中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
1株当たり純資産額	206,736円12銭
1株当たり中間純利益金額	19,031円10銭
	潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益	728,890千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式にかかる中間純利益	728,890千円
期中平均株式数	38,300株

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託者は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等(委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。)又は子法人等(委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。

委託者の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記に掲げるもののほか、委託者の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

##### (1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2)訴訟事件その他の重要事項

提出日現在、訴訟事件その他委託会社およびファンドに重要な影響を及ぼした事実、及び重要な影響を与えることが予想される事実はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

- ・名称 三菱UFJ信託銀行株式会社
- ・資本金の額 324,279百万円(平成24年9月末日現在)
- ・事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

#### <参考情報：再信託受託会社の概要>

- ・名称 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
- ・資本金の額 10,000百万円(平成24年9月末日現在)
- ・事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額( )	事業の内容
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

( )平成24年9月末日現在

### 2【関係業務の概要】

受託会社は、信託財産の保管・管理等を行います。また、当ファンドにかかる信託事務の一部につき日本マスタートラスト信託銀行株式会社に委託することがあります。

販売会社は、募集・販売の取扱い、一部解約事務および収益分配金・解約金・償還金の支払い等を行います。

### 3【資本関係】

資本関係はありません。

### 第3【参考情報】

当計算期間において、当ファンドに係る以下の書類を関東財務局長宛に提出しております。

書類名	提出年月日
有価証券届出書	平成24年12月17日
有価証券報告書	平成24年12月17日
臨時報告書	平成24年9月27日 平成24年12月27日

## 独立監査人の監査報告書

平成25年5月8日

東京海上アセットマネジメント投信株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上Rogge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）の平成24年9月19日から平成25年3月18日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）円コース（毎月分配型）の平成25年3月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

東京海上アセットマネジメント投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）1．上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[東京海上Rogge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（当期）へ](#)



## 独立監査人の監査報告書

平成25年5月8日

東京海上アセットマネジメント投信株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上Rogge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）の平成24年9月19日から平成25年3月18日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）米ドルコース（毎月分配型）の平成25年3月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

東京海上アセットマネジメント投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）1．上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[東京海上Rogge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（当期）へ](#)



## 独立監査人の監査報告書

平成25年5月8日

東京海上アセットマネジメント投信株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上Rogge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）の平成24年9月19日から平成25年3月18日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）ユーロコース（毎月分配型）の平成25年3月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

東京海上アセットマネジメント投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）1．上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[Rogge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\(当期\)へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成25年5月8日

東京海上アセットマネジメント投信株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 業務執行社員 公認会計士 和田 渉

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上Rogge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）の平成24年9月19日から平成25年3月18日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）豪ドルコース（毎月分配型）の平成25年3月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

東京海上アセットマネジメント投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）1．上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[Rogge世界ハイブリッド証券ファンド\(通貨選択型\)ブラジル・リアルコース\(当期\)へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成25年5月8日

東京海上アセットマネジメント投信株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアルコース（毎月分配型）の平成24年9月19日から平成25年3月18日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアルコース（毎月分配型）の平成25年3月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

東京海上アセットマネジメント投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）1．上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[Rogge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\(当期\)へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成25年5月8日

東京海上アセットマネジメント投信株式会社

取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員  
業務執行社員 公認会計士 和田 渉

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上Rogge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）の平成24年9月19日から平成25年3月18日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）の平成25年3月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

東京海上アセットマネジメント投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）1．上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド\(通貨選択型\)マネーブル・ファンド\(当期\)へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成25年5月8日

東京海上アセットマネジメント投信株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上Rogge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・ファンドの平成24年9月19日から平成25年3月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンドの平成25年3月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

東京海上アセットマネジメント投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）1．上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[東京海上Rogge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（当期）へ  
委託会社の監査報告書（当期）へ](#)



## 独立監査人の監査報告書

平成24年6月27日

東京海上アセットマネジメント投信株式会社  
取締役会御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 鶴田 光夫  
業務執行社員指定社員 公認会計士 奈良 昌彦  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント投信株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント投信株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

[委託会社の監査報告書\(中間\)へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月26日

東京海上アセットマネジメント投信株式会社  
取締役会御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉  
業務執行社員指定社員 公認会計士 奈良 昌彦  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント投信株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント投信株式会社の平成24年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）上記は、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。