

東京海上ストラテジック・トラスト

東京海上^{ローグ}Rogge ニッポン・ボンド・ファンド・ カレンシー・セレクション

米ドルヘッジクラス(米ドル建)
ブラジル・リアルヘッジクラス(米ドル建)
中国元ヘッジクラス(米ドル建)
インドネシア・ルピアヘッジクラス(米ドル建)

ケイマン諸島籍契約型オープンエンド型外国投資信託

交付運用報告書(償還報告書)

作成対象期間 第11期

(2020年3月1日～2021年2月26日(償還日))

その他記載事項

運用報告書(全体版)は代行協会のウェブサイト(<https://www.sc.mufig.jp/>)の投資信託情報ページにて電磁的方法により提供しております。

ファンドの運用報告書(全体版)は受益者のご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

管理会社

ルクセンブルク三菱UFJ
インベスターサービス銀行S.A.

代行協会

三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、東京海上ストラテジック・トラスト(以下「トラスト」といいます。)のサブ・ファンドである東京海上Roggeニッポン・ボンド・ファンド・カレンシー・セレクション(以下「ファンド」といいます。)は、2021年2月26日をもって償還いたしました。

ファンドの目的は、主として、日系の発行体が日本国内および海外で発行する公社債、優先出資証券、譲渡性預金証書(CD)およびコマーシャルペーパー(CP)への投資を通じて、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です。当期につきましてもそれに沿った運用を行いました。ここに、運用状況をご報告申し上げますとともに、受益者のみなさまのご愛顧に対して、厚く御礼申し上げます。

第11期末		
クラス名	1口当たり 純資産価格	純資産総額
米ドルヘッジクラス	111.49米ドル	6,409,752.47米ドル
ブラジル・リアルヘッジクラス	12.78米ドル	6,981,958.77米ドル
中国元ヘッジクラス	126.48米ドル	28,457.92米ドル
インドネシア・ルピアヘッジクラス	47.18米ドル	297,071.50米ドル
第11期		
クラス名	騰落率	1口当たり 分配金合計額
米ドルヘッジクラス	1.14%	3.85米ドル
ブラジル・リアルヘッジクラス	-17.21%	1.41米ドル
中国元ヘッジクラス	11.21%	2.75米ドル
インドネシア・ルピアヘッジクラス	5.59%	5.40米ドル

(注1)騰落率は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算しています。以下同じです。

(注2)1口当たり分配金合計額は、税引前の1口当たり分配金の合計額を記載しています。以下同じです。

《運用経過》

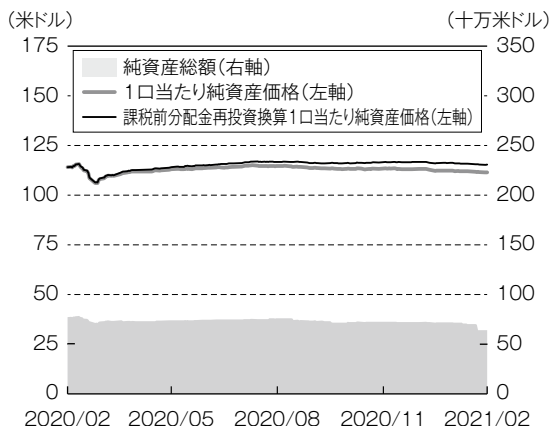
【当期の1口当たり純資産価格等の推移について】

* 課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。以下同じです。

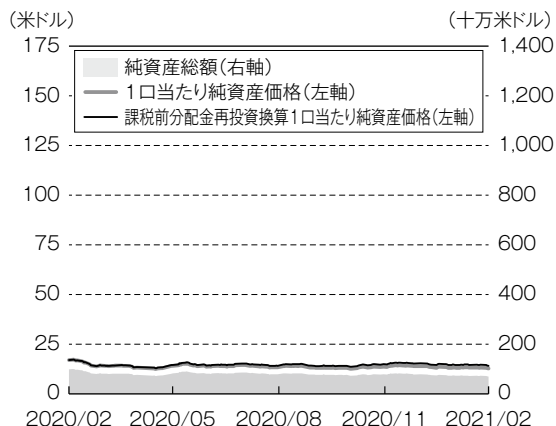
* 課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格は、第10期末の1口当たり純資産価格を起点として計算しています。

* ファンドにベンチマークは設定されていません。

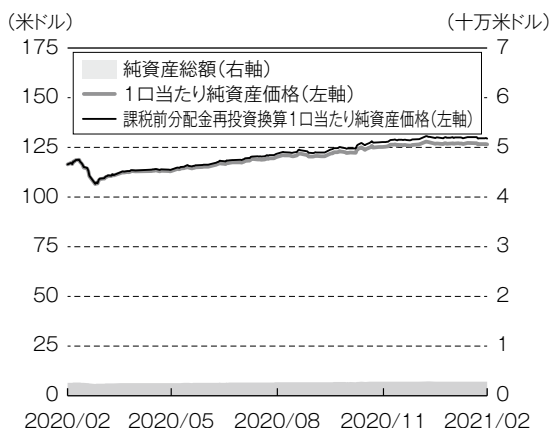
米ドルヘッジクラス



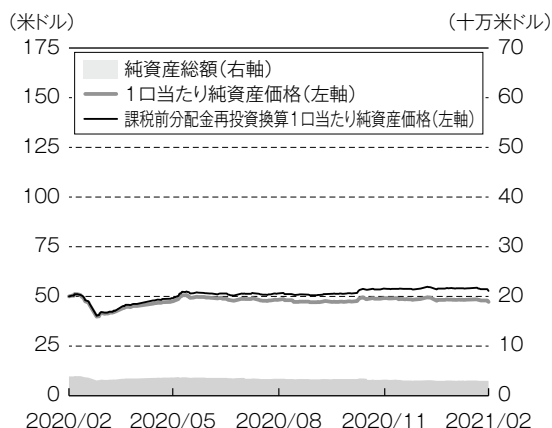
ブラジル・リアルヘッジクラス



中国元ヘッジクラス



インドネシア・ルピアヘッジクラス



	第10期末の 1口当たり純資産価格：	第11期末の 1口当たり純資産価格：	第11期中の 1口当たり分配金合計額：	騰落率：
米ドルヘッジクラス	114.04米ドル	111.49米ドル	3.85米ドル	1.14%
ブラジル・リアルヘッジクラス	17.06米ドル	12.78米ドル	1.41米ドル	-17.21%
中国元ヘッジクラス	116.39米ドル	126.48米ドル	2.75米ドル	11.21%
インドネシア・ルピアヘッジクラス	49.99米ドル	47.18米ドル	5.40米ドル	5.59%

■1口当たり純資産価格の主な変動要因

[プラス要因]

- ・債券の利息収入
- ・2020年秋頃から新型コロナウイルスワクチンの開発および接種が進展し、経済活動正常化への期待が高まったことを背景に社債スプレッド(国債との利回り格差)が縮小したこと

[マイナス要因]

- ・新型コロナウイルスワクチン接種の進展により経済活動正常化への期待が高まったことを背景に、基準金利となる米国債利回りが上昇(債券価格は下落)したこと

【費用の明細】

項目	項目の概要	
管理報酬 (副管理報酬を含みます。) 保管報酬および 管理事務代行報酬	ファンドの純資産総額の 年率0.15%	管理報酬、保管報酬および管理事務代行報酬は、信託証券に定める管理会社、保管会社および管理事務代行会社としての業務の対価として、管理会社に支払われます。
受託報酬	ファンドの純資産総額の 年率0.01% (最低年間10,000米ドル)	受託報酬は、信託証券に定める受託会社としての受託業務の対価として、受託会社に支払われます。
投資顧問報酬 (副投資顧問報酬 を含みます。)	ファンドの純資産総額の 年率0.70%	投資顧問報酬は、ファンドのポートフォリオの投資運用、資産の投資および再投資の管理業務等の対価として、投資顧問会社に支払われます。 副投資顧問報酬は、投資顧問会社に提供する投資顧問業務の対価として、副投資顧問会社に支払われます。
販売報酬	ファンドの純資産総額の 年率0.50%	販売報酬は、口座内でのファンドの管理および事務手続き、運用報告書等各種書類の送付、購入後の情報提供等の対価として販売会社に支払われます。
代行協会員報酬	ファンドの純資産総額の 年率0.05%	代行協会員報酬は、ファンド証券1口当たりの純資産価格の公表を行い、またファンド証券に関する目論見書、決算報告書その他の書類を販売会社に交付する等の業務の対価として代行協会員に支払われます。
その他の費用 (当期)	1.25%	専門家報酬、清算費用、副保管報酬等

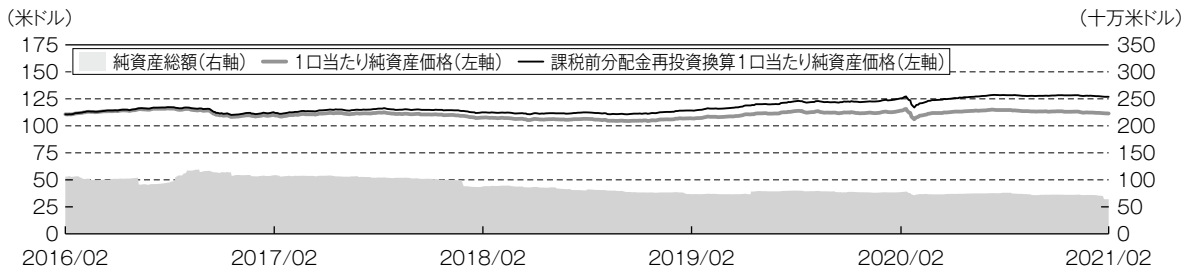
(注)各報酬については、目論見書に定められている料率および金額を記しています。「その他の費用(当期)」には、運用状況等により変動するものや実費となるものが含まれます。便宜上、当期のその他の費用の金額をファンドの当期末の純資産総額で除して100を乗じた比率を表示していますが、実際の比率とは異なります。

【最近5年間の1口当たり純資産価格等の推移について】

(注1) 課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格は、第6期末の1口当たり純資産価格を起点として計算しています。

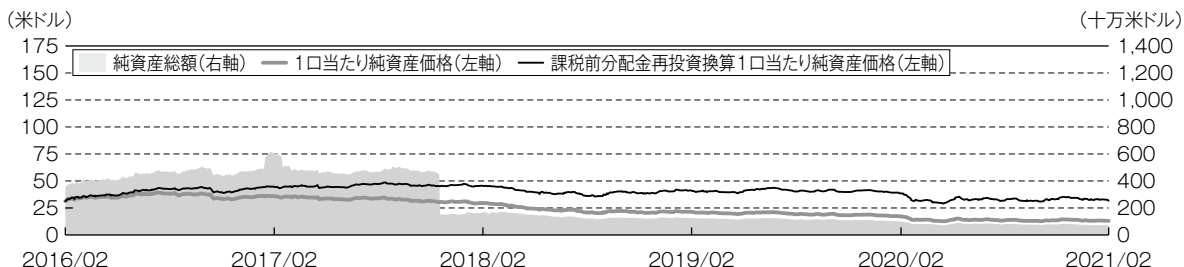
(注2) ファンドにベンチマークおよび参考指数は設定されていません。

米ドルヘッジクラス



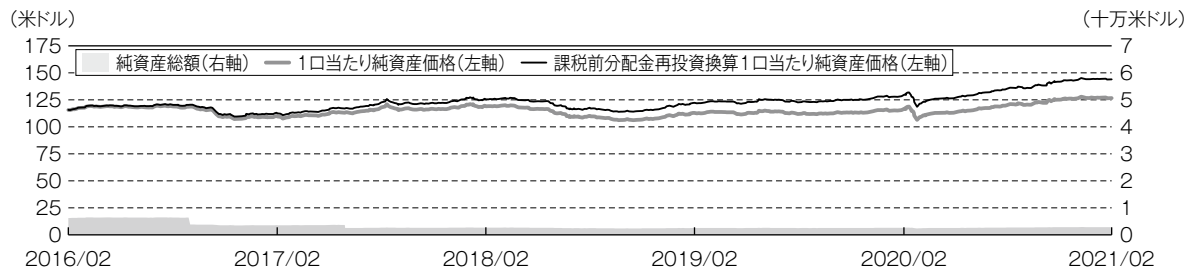
	第6期末 (2016年 2月末日)	第7期末 (2017年 2月末日)	第8期末 (2018年 2月末日)	第9期末 (2019年 2月末日)	第10期末 (2020年 2月末日)	第11期末 (2021年 2月26日)
1口当たり純資産価格 (米ドル)	110.74	110.06	107.55	106.94	114.04	111.49
1口当たり分配金合計額 (米ドル)	—	2.40	2.40	2.40	3.30	3.85
騰落率 (%)	—	1.53	-0.13	1.71	9.84	1.14
純資産総額 (米ドル)	10,609,345.73	10,837,540.62	8,777,827.32	7,355,752.79	7,730,659.42	6,409,752.47

ブラジル・リアルヘッジクラス



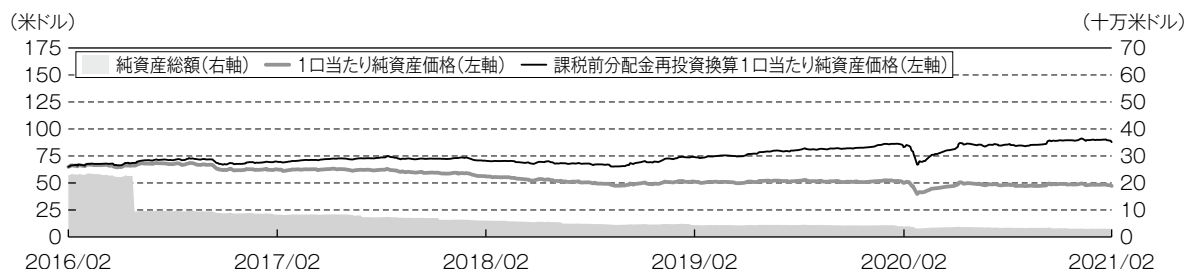
	第6期末 (2016年 2月末日)	第7期末 (2017年 2月末日)	第8期末 (2018年 2月末日)	第9期末 (2019年 2月末日)	第10期末 (2020年 2月末日)	第11期末 (2021年 2月26日)
1口当たり純資産価格 (米ドル)	31.31	35.99	29.52	21.36	17.06	12.78
1口当たり分配金合計額 (米ドル)	—	7.80	7.05	5.20	3.02	1.41
騰落率 (%)	—	42.81	1.59	-9.62	-6.91	-17.21
純資産総額 (米ドル)	35,435,322.28	60,875,358.89	17,006,322.42	12,699,413.14	9,880,907.99	6,981,958.77

中国元ヘッジクラス



	第6期末 (2016年 2月末日)	第7期末 (2017年 2月末日)	第8期末 (2018年 2月末日)	第9期末 (2019年 2月末日)	第10期末 (2020年 2月末日)	第11期末 (2021年 2月26日)
1口当たり純資産価格 (米ドル)	115.62	110.02	119.05	112.90	116.39	126.48
1口当たり分配金合計額 (米ドル)	—	3.00	3.00	3.00	3.00	2.75
騰落率 (%)	—	-2.33	11.08	-2.59	5.86	11.21
純資産総額 (米ドル)	62,433.56	35,755.99	26,785.62	25,402.25	26,187.13	28,457.92

インドネシア・ルピアヘッジクラス



	第6期末 (2016年 2月末日)	第7期末 (2017年 2月末日)	第8期末 (2018年 2月末日)	第9期末 (2019年 2月末日)	第10期末 (2020年 2月末日)	第11期末 (2021年 2月26日)
1口当たり純資産価格 (米ドル)	64.92	62.62	55.92	51.19	49.99	47.18
1口当たり分配金合計額 (米ドル)	—	7.20	7.20	7.20	7.20	5.40
騰落率 (%)	—	7.63	0.53	5.31	12.35	5.59
純資産総額 (米ドル)	2,280,557.09	832,164.49	603,409.99	440,603.58	387,850.72	297,071.50

【投資環境について】

【2020年3月-2020年7月】

米国債利回りは低下しました。

新型コロナウイルスが世界的に感染拡大を続けるなか、FRB(米連邦準備制度理事会)をはじめとした主要中央銀行が金融緩和姿勢を継続したことから、米国債利回りは低下しました。

ドイツ国債利回りは小幅に上昇しました。

主要中央銀行が金融緩和姿勢を継続したものの、既にマイナス圏で推移していたドイツ国債利回りの低下余地は乏しく、狭いレンジ内で小幅に上昇しました。

海外社債市場では、2020年3月に新型コロナウイルスの世界的な感染拡大から、社債スプレッドが大幅に拡大したものの、その後FRBやECB(欧州中央銀行)など先進国の中央銀行による社債の購入や、段階的な移動制限の緩和に伴う景気回復期待などを受けて縮小に転じました。

当ファンドが投資対象とする日系外貨建社債も海外社債市場と同様に、スプレッドが大幅に拡大した後、縮小に転じました。

【2020年8月-2021年2月】

米国債利回りおよびドイツ国債利回りは上昇しました。

新型コロナウイルスワクチンの開発および接種が徐々に進展するなか、経済活動正常化に伴う景気回復期待が高まり、米国債およびドイツ国債利回りは上昇しました。新型コロナウイルスの感染再拡大で景気回復期待が後退し、国債利回りが低下する局面もありましたが、2021年1月に発足したバイデン米政権による大型の追加経済対策などを背景に景気回復期待が高まり、期末にかけて米国債およびドイツ国債利回りは一段と上昇しました。

海外社債市場では、主要中央銀行による金融緩和が継続されたことや、新型コロナウイルスワクチン接種の進展により経済情勢が安定するという期待から、社債スプレッドは縮小しました。

当ファンドが投資対象とする日系外貨建社債も海外社債市場と同様に、社債スプレッドは期初から縮小しました。

以上のような経過を経て、米国債利回り、ドイツ国債利回りはともに期を通じて上昇した一方、日系外貨建社債のスプレッドは、期初との比較で縮小した水準で期を終えました。

【ポートフォリオについて】

当期、欧米の債券利回りが全般的に上昇したものの、日系外貨建社債スプレッドは縮小したことから、1口当たり純資産価格(分配金再投資)は、米ドルヘッジクラスは1.1%上昇しました。

中国元ヘッジクラスは、中国元が米ドルに対して上昇したことから、11.2%の上昇となりました。インドネシア・ルピアヘッジクラスは、インドネシア・ルピアが米ドルに対して上下に大きく動きつつ前期末対比でほぼ横ばいとなったものの、為替取引によるプレミアム収入などにより5.6%上昇しました。ブラジル・リアルヘッジクラスは、為替取引によるプレミアム収入があったものの、ブラジル・リアルが米ドルに対して下落したことから、17.2%下落しました。

【分配金について】

当期(2020年3月1日～2021年2月26日)の1口当たり分配金(税引前)はそれぞれ下表のとおりです。なお、下表の「分配金を含む1口当たり純資産価格の変動額」は、当該分配落日における1口当たり分配金額と比較する目的で、便宜上算出しているものです。

米ドルヘッジクラス

(金額:米ドル)

分配落日	1口当たり純資産価格 ^(注1)	1口当たり分配金額 (対1口当たり純資産価格比率 ^(注2))	分配金を含む1口当たり 純資産価格の変動額 ^(注3)
2020年3月10日	114.36	0.35 (0.31%)	2.10
2020年4月14日	110.61	0.35 (0.32%)	-3.40
2020年5月11日	111.91	0.35 (0.31%)	1.65
2020年6月10日	113.25	0.35 (0.31%)	1.69
2020年7月10日	113.96	0.35 (0.31%)	1.06
2020年8月11日	114.82	0.35 (0.30%)	1.21
2020年9月10日	114.22	0.35 (0.31%)	-0.25
2020年10月13日	113.37	0.35 (0.31%)	-0.50
2020年11月10日	112.98	0.35 (0.31%)	-0.04
2020年12月10日	113.06	0.35 (0.31%)	0.43
2021年1月12日	112.13	0.35 (0.31%)	-0.58

(注1) 当該分配落日が評価日でない場合には、当該分配落日の直後の評価日における1口当たり純資産価格とします。下記(注2)から(注4)を含め、以下本「分配金について」において同様とします。

(注2) 「対1口当たり純資産価格比率」とは、以下の計算式により算出される値であり、ファンドの収益率とは異なる点にご留意ください。

対1口当たり純資産価格比率(%) = $100 \times a / b$

a = 当該分配落日における1口当たり分配金額

b = 当該分配落日における1口当たり純資産価格 + 当該分配落日における1口当たり分配金額

以下同じです。

(注3) 「分配金を含む1口当たり純資産価格の変動額」とは、以下の計算式により算出されます。

分配金を含む1口当たり純資産価格の変動額 = $b - c$

b = 当該分配落日における1口当たり純資産価格 + 当該分配落日における1口当たり分配金額

c = 当該分配落日の直前の分配落日における1口当たり純資産価格

以下同じです。

(注4) 2020年3月10日の直前の分配落日(2020年2月10日)における1口当たり純資産価格は、112.61米ドルでした。

(注5) 2021年2月に支払われた分配金はありません。

ブラジル・リアルヘッジクラス

(金額：米ドル)

分配落日	1口当たり純資産価格	1口当たり分配金額 (対1口当たり純資産価格比率)	分配金を含む1口当たり 純資産価格の変動額
2020年3月10日	16.42	0.15 (0.91%)	-0.92
2020年4月14日	14.20	0.15 (1.05%)	-2.07
2020年5月11日	12.76	0.15 (1.16%)	-1.29
2020年6月10日	15.19	0.15 (0.98%)	2.58
2020年7月10日	13.97	0.13 (0.92%)	-1.09
2020年8月11日	13.84	0.13 (0.93%)	0.00
2020年9月10日	14.01	0.11 (0.78%)	0.28
2020年10月13日	13.11	0.11 (0.83%)	-0.79
2020年11月10日	13.43	0.11 (0.81%)	0.43
2020年12月10日	14.34	0.11 (0.76%)	1.02
2021年1月12日	13.15	0.11 (0.83%)	-1.08

(注1) 2020年3月10日の直前の分配落日(2020年2月10日)における1口当たり純資産価格は、17.49米ドルでした。

(注2) 2021年2月に支払われた分配金はありません。

中国元ヘッジクラス

(金額：米ドル)

分配落日	1口当たり純資産価格	1口当たり分配金額 (対1口当たり純資産価格比率)	分配金を含む1口当たり 純資産価格の変動額
2020年3月10日	117.55	0.25 (0.21%)	2.62
2020年4月14日	112.01	0.25 (0.22%)	-5.29
2020年5月11日	113.00	0.25 (0.22%)	1.24
2020年6月10日	114.88	0.25 (0.22%)	2.13
2020年7月10日	116.85	0.25 (0.21%)	2.22
2020年8月11日	118.91	0.25 (0.21%)	2.31
2020年9月10日	120.50	0.25 (0.21%)	1.84
2020年10月13日	121.76	0.25 (0.20%)	1.51
2020年11月10日	123.67	0.25 (0.20%)	2.16
2020年12月10日	125.92	0.25 (0.20%)	2.50
2021年1月12日	126.76	0.25 (0.20%)	1.09

(注1) 2020年3月10日の直前の分配落日(2020年2月10日)における1口当たり純資産価格は、115.18米ドルでした。

(注2) 2021年2月に支払われた分配金はありません。

インドネシア・ルピアヘッジクラス

(金額：米ドル)

分配落日	1口当たり純資産価格	1口当たり分配金額 (対1口当たり純資産価格比率)	分配金を含む1口当たり 純資産価格の変動額
2020年3月10日	49.83	0.60 (1.19%)	-1.37
2020年4月14日	43.91	0.48 (1.08%)	-5.44
2020年5月11日	46.34	0.48 (1.03%)	2.91
2020年6月10日	49.99	0.48 (0.95%)	4.13
2020年7月10日	48.78	0.48 (0.97%)	-0.73
2020年8月11日	48.27	0.48 (0.98%)	-0.03
2020年9月10日	47.29	0.48 (1.00%)	-0.50
2020年10月13日	47.21	0.48 (1.01%)	0.40
2020年11月10日	48.61	0.48 (0.98%)	1.88
2020年12月10日	48.59	0.48 (0.98%)	0.46
2021年1月12日	47.86	0.48 (0.99%)	-0.25

(注1) 2020年3月10日の直前の分配落日(2020年2月10日)における1口当たり純資産価格は、51.80米ドルでした。

(注2) 2021年2月に支払われた分配金はありません。

《今後の運用方針》

当ファンドは、2021年2月26日に償還いたしました。永年ご愛顧いただき、誠にありがとうございました。

《お知らせ》

- ・ファンドは、2021年2月26日に償還いたしました。
- ・受託会社であるCIBCバンク・アンド・トラスト・カンパニー(ケイマン)リミテッドは、2020年11月23日をもって、その商号をファーストカリビアン・インターナショナル・バンク・アンド・トラスト・カンパニー(ケイマン)リミテッドに変更しました。

《ファンドの概要》

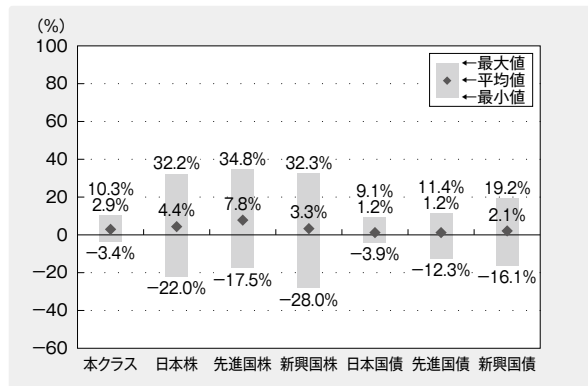
ファンド形態	ケイマン諸島籍契約型オープンエンド型外国投資信託
信託期間	ファンドは、管理会社が受託会社と協議の上、存続期間の延長を決定しない限り、2021年2月26日に終了します。ただし、有価証券報告書に定めるいずれかの方法により当該日までに終了する場合を除きます。 ファンドは、2021年2月26日に償還いたしました。
運用方針	ファンドの目的は、主として、日系の発行体が日本国内および海外で発行する公社債、優先出資証券、譲渡性預金証書(CD)およびコマーシャルペーパー(CP)への投資を通じて、安定したインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることです。
主要投資対象	ファンドは、日系発行体(日本企業あるいはその子会社、日本の政府機関など)が世界で発行する公社債・優先出資証券・譲渡性預金証書(CD)・コマーシャルペーパー(CP)に主として投資を行います。また、取得時において、投資適格相当以上の格付けを取得している有価証券を投資対象とします。
ファンドの運用方法	ファンドは、分散投資を行うことで信用リスクの低減を図ります。 組み入れる個別銘柄は、ポートフォリオ全体の利回りを考慮して選定を行います。
主な投資制限	<p>ファンドに適用される投資制限は以下のとおりです。</p> <p>(イ) ファンドについて空売りされる有価証券の時価総額は、ファンドの純資産総額を超えないものとします。</p> <p>(ロ) ファンドの純資産総額の10%を超えて、借入れを行うものではありません。ただし、合併等の特別緊急事態により一時的に、かかる10%を超える場合はこの限りではありません。</p> <p>(ハ) ファンドおよび管理会社の運用するミューチュアル・ファンドの全体において、一発行会社の議決権総数の50%を超えて投資を行ってはなりません。かかる制限は、他の投資信託に対する投資には適用されません。</p> <p>(注) 上記の比率の計算は、買付時点基準または時価基準のいずれかによることができます。</p> <p>(ニ) ファンドは、私募株式、非上場株式または不動産等、流動性に欠ける資産に対しその純資産の15%を超えて投資を行いません。ただし、日本証券業協会が定める外国投資信託受益証券の選別基準(随時改定または修正されることがあります。)に要求されるとおり、価格の透明性を確保する方法が取られている場合はこの限りではありません。</p> <p>(注) 上記の比率の計算は、買付時点基準または時価基準のいずれかによることができます。</p> <p>(ホ) 投資対象の購入、投資および追加の結果、ファンドの資産額の50%を超えて、日本の金融商品取引法において規定される「有価証券」の定義に該当しない資産を構成する場合、かかる投資対象の購入、投資および追加を行いません。</p> <p>(ヘ) 管理会社、投資顧問会社または副投資顧問会社が自己または第三者の利益を図る目的で行う取引等、受益者の保護に欠け、またはファンドの資産の適正な運用を害するファンドのための管理会社、投資顧問会社または副投資顧問会社の取引は、すべて禁止されます。</p> <p>(ト) 日本証券業協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とします。</p> <p>ファンドの投資対象の価値の変化、再構成、合併、ファンドの資産からの支払またはファンドの受益証券の買戻しの結果としてファンドに適用される制限を超えた場合、管理会社は、直ちにファンドの投資対象を売却する必要はありません。しかし、管理会社は、ファンドの受益者の利益を考慮した上で、違反が判明してから合理的な期間内にファンドに適用ある制限を遵守するために合理的に可能な措置を講じるものとします。</p>
分配方針	管理会社は、いずれのクラスに関しても、投資顧問会社と協議の上、毎月10日(当該日が営業日でない場合は翌営業日)に、純投資収入、純実現・未実現キャピタルゲインおよび配当可能資本から分配を宣言することができます。

《参考情報》

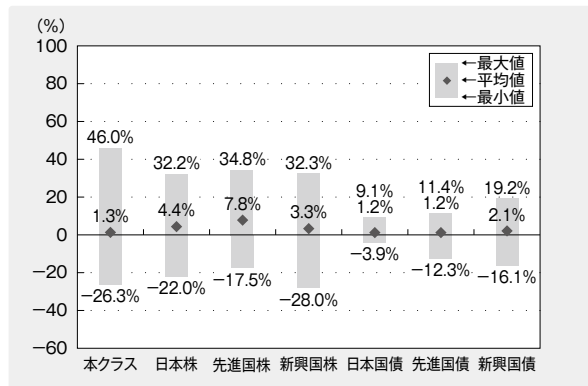
【ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較】

このグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したもので、2016年3月～2021年2月の5年間における年間騰落率(各月末時点)の平均と振れ幅を、ファンドと代表的な資産クラスとの間で比較したものです。

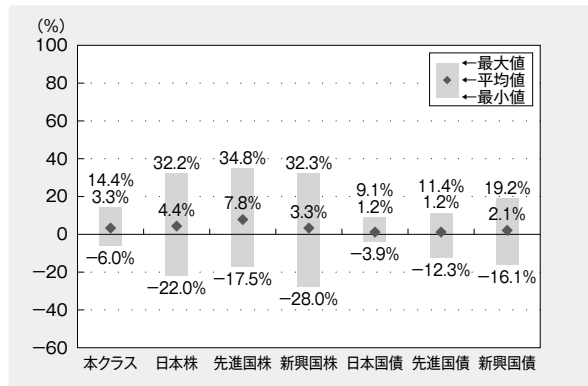
米ドルヘッジクラス



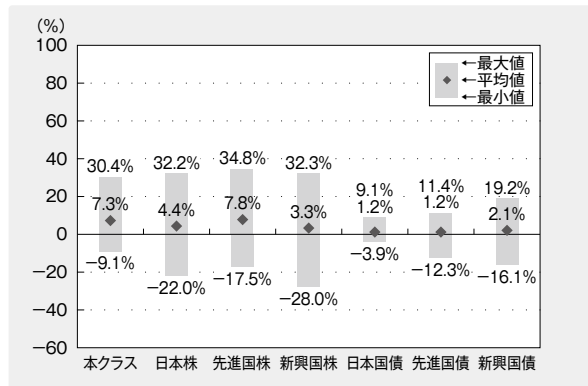
ブラジル・リアルヘッジクラス



中国元ヘッジクラス



インドネシア・ルピアヘッジクラス



出所：Bloomberg L.P.および指数提供会社のデータを基に森・濱田松本法律事務所が作成

※ファンドの年間騰落率(各月末時点)は、各月末とその1年前における課税前分配金再投資換算1口当たり純資産価格を対比して、その騰落率を算出したものです。

※代表的な資産クラスの年間騰落率(各月末時点)は、各月末とその1年前における下記の指数の値を対比して、その騰落率を算出したものです。

※ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較は、上記の5年間の各月末時点における年間騰落率を用いて、それらの平均・最大・最小をグラフにして比較したものです。

※ファンドの年間騰落率は、実際の1口当たり純資産価格に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率は、各受益証券の参照通貨建てで計算されており、円貨に換算されておりません。したがって、円貨に換算した場合、上記とは異なる騰落率となります。

※ファンドは代表的な資産クラスの全てに投資するものではありません。

●各資産クラスの指数

日本株・・・TOPIX(配当込み)

先進国株・・・FTSE先進国株価指数(除く日本、円ベース)

新興国株・・・S&P新興国総合指数

日本国債・・・ブルームバーグE1年超日本国債指数

先進国債・・・FTSE世界国債指数(除く日本、円ベース)

新興国債・・・FTSE新興国市場国債指数(円ベース)

(注)S&P新興国総合指数は、Bloomberg L.P.で円換算しています。

TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所(以下「**㈱東京証券取引所**」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、**㈱東京証券取引所**が有しています。なお、ファンドは、**㈱東京証券取引所**により提供、保証または販売されるものではなく、**㈱東京証券取引所**は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

FTSE先進国株価指数(除く日本、円ベース)、FTSE世界国債指数(除く日本、円ベース)およびFTSE新興国市場国債指数(円ベース)に関するすべての権利は、London Stock Exchange Group plcまたはそのいずれかのグループ企業に帰属します。各指数は、FTSE International Limited、FTSE Fixed Income LLCまたはそれらの関連会社等によって計算されています。London Stock Exchange Group plcおよびそのグループ企業は、指数の使用、依存または誤謬から生じるいかなる負債について、何人に対しても一切の責任を負いません。

《ファンドデータ》

【ファンドの組入資産の内容】

(第11期末現在)

●組入上位資産

有価証券等の組入れはありません。

【純資産等】

第11期末			
クラス名	純資産総額	発行済口数	1口当たり純資産価格
米ドルヘッジクラス	6,409,752.47米ドル	57,490口	111.49米ドル
ブラジル・リアルヘッジクラス	6,981,958.77米ドル	546,506口	12.78米ドル
中国元ヘッジクラス	28,457.92米ドル	225口	126.48米ドル
インドネシア・ルピアヘッジクラス	297,071.50米ドル	6,297口	47.18米ドル

第11期			
クラス名	販売口数	買戻口数	発行済口数
米ドルヘッジクラス	2,590 (2,590)	12,890 (12,890)	57,490 (57,490)
ブラジル・リアルヘッジクラス	17,800 (17,800)	50,542 (50,542)	546,506 (546,506)
中国元ヘッジクラス	0 (0)	0 (0)	225 (225)
インドネシア・ルピアヘッジクラス	0 (0)	1,461 (1,461)	6,297 (6,297)

(注) () の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数です。