

東京海上・世界モノポリー  
戦略株式ファンド（毎月決算型）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |                                                                                                                                                                      |                                                                                                                              |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 商品分類   | 追加型投信／海外／株式<br>(課税上は株式投資信託として取扱われます。)                                                                                                                                |                                                                                                                              |
| 信託期間   | 2020年3月13日から2030年1月15日                                                                                                                                               |                                                                                                                              |
| 運用方針   | 信託財産の成長をめざして運用を行います。                                                                                                                                                 |                                                                                                                              |
| 主要投資対象 | 東京海上・世界モノポリー戦略株式ファンド(毎月決算型)                                                                                                                                          | 内国投資信託「世界モノポリー戦略株式ファンド(適格機関投資家限定)」および親投資信託「東京海上マネーブルマザーファンド」を主要投資対象とします。                                                     |
|        | 世界モノポリー戦略株式ファンド(適格機関投資家限定)                                                                                                                                           | 「アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド」(以下、マザーファンド)への投資を通じて、主として日本を除く世界の株式等の中から、モノポリー企業(モノやサービス等を独占・寡占(地域独占含む)していると判断する企業)の株式等を投資対象とします。 |
|        | 東京海上マネーブルマザーファンド                                                                                                                                                     | 円建て短期公社債およびコマーシャル・ペーパーを主要投資対象とします。                                                                                           |
| 投資制限   | 東京海上・世界モノポリー戦略株式ファンド(毎月決算型)                                                                                                                                          | ・株式への直接投資は行いません。<br>・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。<br>・投資信託証券への投資割合には制限を設けません。                                                    |
|        | 世界モノポリー戦略株式ファンド(適格機関投資家限定)                                                                                                                                           | ・マザーファンドの受益証券への投資割合には制限を設けません。<br>・株式等への直接投資は、原則として行いません。<br>・マザーファンドを通じて行う投資信託証券(上場投資信託は除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。  |
|        | 東京海上マネーブルマザーファンド                                                                                                                                                     | ・株式への投資は行いません。<br>・外貨建資産への投資は、円貨で約定し円貨で決済するもの(為替リスクの生じないもの)に限ります。                                                            |
| 分配方針   | 毎決算時に、原則として経費控除後の、繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。 |                                                                                                                              |

運用報告書（全体版）

|          |              |
|----------|--------------|
| 第17期（決算日 | 2021年8月16日）  |
| 第18期（決算日 | 2021年9月15日）  |
| 第19期（決算日 | 2021年10月15日） |
| 第20期（決算日 | 2021年11月15日） |
| 第21期（決算日 | 2021年12月15日） |
| 第22期（決算日 | 2022年1月17日）  |

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。  
さて、「東京海上・世界モノポリー戦略株式ファンド(毎月決算型)」は、このたび、第22期の決算を行いましたので、第17期～第22期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

東京都千代田区丸の内1-8-2 鉄鋼ビルディング

お問い合わせ窓口  
東京海上アセットマネジメント サービスデスク 0120-712-016  
受付時間：営業日の9時～17時  
<https://www.tokiomarineam.co.jp/>

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。  
また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

## ○設定以来の運用実績

| 決 算 期            | 基<br>(分配落) | 準 価 額 |     |                  | 債 券<br>組 入 比 率 | 投 資 信 託<br>証 組 入 比 | 純 資 産<br>総 額 |
|------------------|------------|-------|-----|------------------|----------------|--------------------|--------------|
|                  |            | 税 分   | 込 配 | み 期<br>金 騰 落 中 率 |                |                    |              |
| (設定日)            | 円          |       |     | 円                | %              | %                  | 百万円          |
| 2020年3月13日       | 10,000     | —     | —   | —                | —              | —                  | 1,000        |
| 1期(2020年4月15日)   | 11,567     |       | 0   | 15.7             | 0.0            | 98.4               | 1,156        |
| 2期(2020年5月15日)   | 10,934     |       | 0   | △ 5.5            | 0.1            | 98.3               | 1,104        |
| 3期(2020年6月15日)   | 11,685     |       | 0   | 6.9              | 0.1            | 98.0               | 1,195        |
| 4期(2020年7月15日)   | 11,756     |       | 20  | 0.8              | 0.0            | 98.5               | 1,213        |
| 5期(2020年8月17日)   | 12,067     |       | 20  | 2.8              | 0.1            | 99.2               | 1,262        |
| 6期(2020年9月15日)   | 11,709     |       | 20  | △ 2.8            | 0.1            | 99.0               | 1,219        |
| 7期(2020年10月15日)  | 11,940     |       | 20  | 2.1              | 0.1            | 98.8               | 1,244        |
| 8期(2020年11月16日)  | 12,372     |       | 20  | 3.8              | 0.1            | 99.0               | 1,289        |
| 9期(2020年12月15日)  | 12,043     |       | 20  | △ 2.5            | 0.1            | 99.2               | 1,255        |
| 10期(2021年1月15日)  | 11,923     |       | 20  | △ 0.8            | 0.1            | 99.0               | 1,243        |
| 11期(2021年2月15日)  | 11,953     |       | 20  | 0.4              | 0.1            | 99.1               | 1,248        |
| 12期(2021年3月15日)  | 12,527     |       | 20  | 5.0              | 0.1            | 99.5               | 1,307        |
| 13期(2021年4月15日)  | 13,031     |       | 20  | 4.2              | 0.1            | 98.6               | 1,359        |
| 14期(2021年5月17日)  | 13,462     |       | 20  | 3.5              | 0.1            | 98.5               | 1,398        |
| 15期(2021年6月15日)  | 13,858     |       | 20  | 3.1              | 0.1            | 98.7               | 1,430        |
| 16期(2021年7月15日)  | 13,559     |       | 20  | △ 2.0            | 0.1            | 98.2               | 1,393        |
| 17期(2021年8月16日)  | 13,859     |       | 20  | 2.4              | 0.1            | 98.1               | 1,409        |
| 18期(2021年9月15日)  | 13,652     |       | 50  | △ 1.1            | 0.1            | 98.6               | 1,388        |
| 19期(2021年10月15日) | 13,913     |       | 50  | 2.3              | 0.1            | 98.8               | 1,412        |
| 20期(2021年11月15日) | 13,927     |       | 50  | 0.5              | 0.0            | 99.6               | 1,409        |
| 21期(2021年12月15日) | 13,911     |       | 50  | 0.2              | 0.0            | 97.4               | 1,425        |
| 22期(2022年1月17日)  | 14,252     |       | 50  | 2.8              | 0.1            | 97.8               | 1,537        |

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しています。

当ファンドにベンチマークはなく、また当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる指数もないため、ベンチマーク、参考指数を記載していません。

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決 算 期 | 年 月 日       | 基 準    | 価 額   | 債 券 組 入 比 率 | 投 資 信 託 証 書 組 入 比 率 |
|-------|-------------|--------|-------|-------------|---------------------|
|       |             |        | 騰 落 率 |             |                     |
| 第17期  | (期 首)       | 円      | %     | %           | %                   |
|       | 2021年7月15日  | 13,559 | —     | 0.1         | 98.2                |
|       | 7月末         | 13,680 | 0.9   | 0.1         | 98.4                |
|       | (期 末)       |        |       |             |                     |
|       | 2021年8月16日  | 13,879 | 2.4   | 0.1         | 98.1                |
| 第18期  | (期 首)       |        |       |             |                     |
|       | 2021年8月16日  | 13,859 | —     | 0.1         | 98.1                |
|       | 8月末         | 13,806 | △0.4  | 0.1         | 98.2                |
|       | (期 末)       |        |       |             |                     |
|       | 2021年9月15日  | 13,702 | △1.1  | 0.1         | 98.6                |
| 第19期  | (期 首)       |        |       |             |                     |
|       | 2021年9月15日  | 13,652 | —     | 0.1         | 98.6                |
|       | 9月末         | 13,452 | △1.5  | 0.1         | 98.2                |
|       | (期 末)       |        |       |             |                     |
|       | 2021年10月15日 | 13,963 | 2.3   | 0.1         | 98.8                |
| 第20期  | (期 首)       |        |       |             |                     |
|       | 2021年10月15日 | 13,913 | —     | 0.1         | 98.8                |
|       | 10月末        | 14,072 | 1.1   | 0.0         | 99.0                |
|       | (期 末)       |        |       |             |                     |
|       | 2021年11月15日 | 13,977 | 0.5   | 0.0         | 99.6                |
| 第21期  | (期 首)       |        |       |             |                     |
|       | 2021年11月15日 | 13,927 | —     | 0.0         | 99.6                |
|       | 11月末        | 13,695 | △1.7  | 0.0         | 98.2                |
|       | (期 末)       |        |       |             |                     |
|       | 2021年12月15日 | 13,961 | 0.2   | 0.0         | 97.4                |
| 第22期  | (期 首)       |        |       |             |                     |
|       | 2021年12月15日 | 13,911 | —     | 0.0         | 97.4                |
|       | 12月末        | 14,565 | 4.7   | 0.0         | 97.1                |
|       | (期 末)       |        |       |             |                     |
|       | 2022年1月17日  | 14,302 | 2.8   | 0.1         | 97.8                |

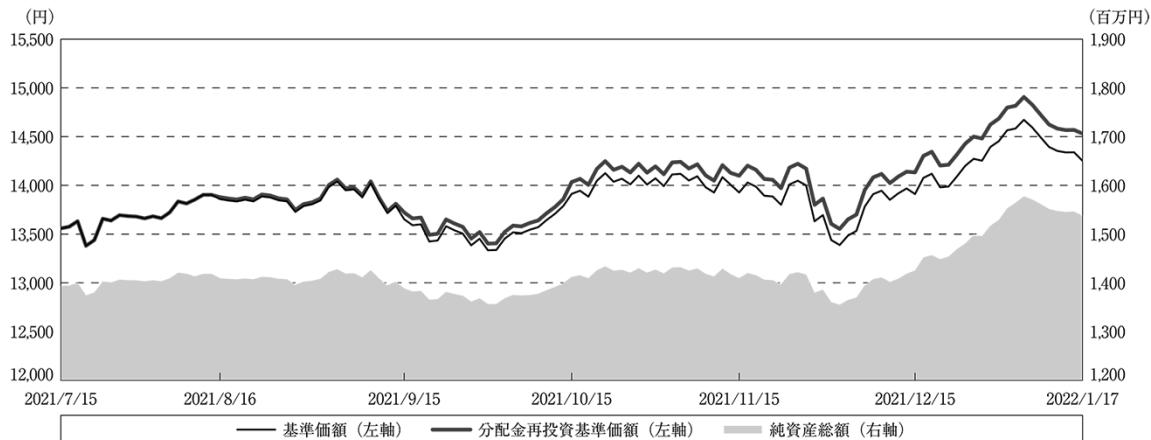
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

## ○運用経過

(2021年7月16日～2022年1月17日)

## ■作成期間中の基準価額等の推移



第17期首：13,559円

第22期末：14,252円(既払分配金(税込み):270円)

騰落率：7.2%(分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額は、作成期首(2021年7月15日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

## ◇基準価額の主な変動要因

## プラス要因

- ・企業業績が堅調であったこと
- ・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
- ・米国長期金利の上昇などを背景に円安米ドル高が進行したこと

## マイナス要因

- ・欧米中央銀行の金融緩和政策見直しに対する警戒感などから長期金利が上昇し、景気減速懸念から株式市場が下落したこと
- ・中国大手不動産開発会社の経営不安により、投資家のリスク回避姿勢が強まったこと
- ・新型コロナウイルスの新たな変異株(オミクロン株)が確認され、景気への悪影響が懸念されたこと

## ■投資環境

### 【株式市場】

世界の株式市場は上昇しました。企業業績が堅調であったことに加えて、新型コロナウイルス感染状況の改善やワクチン接種の進展などを背景とした経済活動正常化への期待が続くなか、2021年8月末にかけて世界の株式市場は上昇しました。その後は、中国大手不動産開発会社の経営不安のほか、欧米中央銀行による金融緩和政策の見直しなどで長期金利が上昇したことが嫌気されて、世界の株式市場は下落しましたが、長期金利の上昇に一服感が見られると、再び上昇に転じました。11月以降、オミクロン株の確認により景気への悪影響が懸念されて世界の株式市場は下落しましたが、その後オミクロン株は重症化するリスクが相対的に低いとの楽観的な見方が広がったことから、作成期末にかけて再び上昇しました。

### 【為替市場】

米ドル円為替レートは、円安米ドル高となりました。作成期初からレンジ内で推移していましたが、2021年8月にパウエルFRB（米連邦準備制度理事会）議長が年内のテーパリング（量的緩和の縮小）開始を示唆し、11月のFOMC（米連邦公開市場委員会）においてテーパリングの開始が発表され米国長期金利が上昇したことから、円安米ドル高が進行しました。

ユーロ円為替レートは円安ユーロ高となりました。新型コロナウイルスワクチン接種の進展による景気回復期待などを背景に投資家のリスク選好度が高まるなか、円安ユーロ高基調で推移しました。

## ■ポートフォリオについて

### <東京海上・世界モノポリー戦略株式ファンド(毎月決算型)>

「世界モノポリー戦略株式ファンド(適格機関投資家限定)」(以下、投資信託証券)および「東京海上マネープールマザーファンド」(以下、親投資信託)を主要投資対象とし、投資信託証券の組入比率を高位に保ちました。

当ファンドの基準価額（税引前分配金再投資）は、主に投資信託証券の値動きを反映し、7.2%上昇しました。

### <投資信託証券>

「アンカーMFG 世界モノポリー戦略株式マザーファンド」(以下、マザーファンド)を主要投資対象とし、組入比率を高位に保ちました。

基準価額（分配金再投資）は、マザーファンドの値動きを反映し、8.0%上昇しました。

世界の株式市場が上昇するなか、モノポリー企業の株価も総じて堅調に推移しました。新型コロナウイルスワクチン接種の進展に伴う旅客数や交通量の回復期待から、空港や有料道路関連銘柄の株価は総じて堅調となりました。また、エネルギー価格の上昇を受けて、原油や天然ガスなどを輸送するパイプラインを運営するエネルギー・インフラ関連銘柄も堅調に推移しました。一方、米国長期金利の上昇を受けて配当利回りの魅力が相対的に低下したことから、通信関連銘柄は軟調に推移しました。

### <親投資信託>

元本の安全性と流動性を重視して地方債を中心とする円建て公社債に投資し、プラスの収益の確保に努めました。その結果、基準価額はおおむね横ばいで推移しました。

## ■当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けていません。

また、当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる参考指数もないため、記載する事項はありません。

## ■分配金

当ファンドの収益分配方針に基づき、基準価額の水準や市況動向などを勘案して、次表の通りとしました。なお、収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

## ◇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

| 項 目                | 第17期                      | 第18期                      | 第19期                       | 第20期                        | 第21期                        | 第22期                       |
|--------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|
|                    | 2021年7月16日～<br>2021年8月16日 | 2021年8月17日～<br>2021年9月15日 | 2021年9月16日～<br>2021年10月15日 | 2021年10月16日～<br>2021年11月15日 | 2021年11月16日～<br>2021年12月15日 | 2021年12月16日～<br>2022年1月17日 |
| 当期分配金<br>(対基準価額比率) | 20<br>0.144%              | 50<br>0.365%              | 50<br>0.358%               | 50<br>0.358%                | 50<br>0.358%                | 50<br>0.350%               |
| 当期の収益              | —                         | —                         | 50                         | 44                          | 33                          | 50                         |
| 当期の収益以外            | 20                        | 50                        | —                          | 5                           | 16                          | —                          |
| 翌期繰越分配対象額          | 3,859                     | 3,809                     | 3,912                      | 3,927                       | 3,910                       | 4,252                      |

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ○今後の運用方針

### <東京海上・世界モノポリー戦略株式ファンド(毎月決算型)>

投資信託証券と親投資信託を主要投資対象とし、投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。

### <投資信託証券>

新型コロナウイルスの感染状況を巡り市場環境の不透明性は残っていますが、生活に必要な不可欠なサービスを独占的に提供するモノポリー企業の株価は、高い参入障壁や高い価格決定力、高い利益成長の予測可能性により、長期的に上昇すると見えています。

引き続き、独占・寡占という競争優位性を持つ、希少性の高いモノポリー企業の中から、市況動向や規制緩和等の影響を受けにくい銘柄を厳選し、組み入れを行う方針です。

### <親投資信託>

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

このような環境下、政府保証債や地方債を中心とする円建て公社債およびコマーシャル・ペーパーを主要投資対象として運用することにより、プラスの収益の確保もしくはマイナス幅を極力最小化するように努める方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年 7 月16日～2022年 1 月17日)

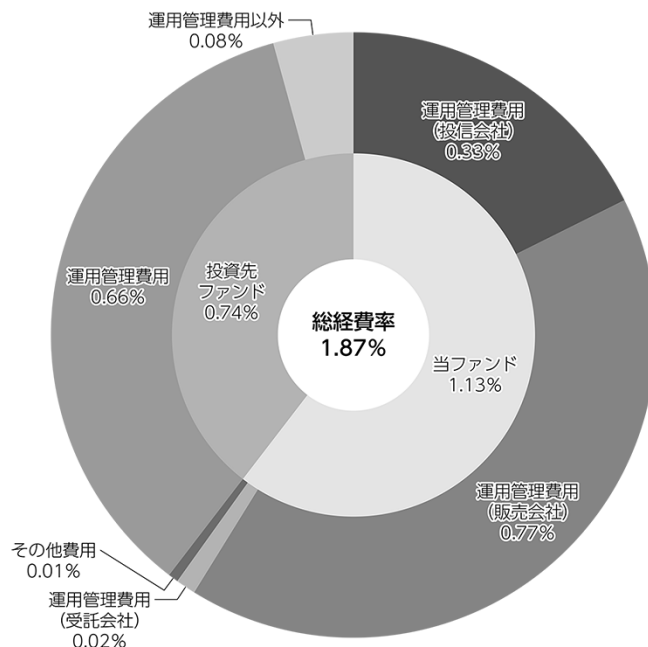
| 項 目                     | 第17期～第22期 |            | 項 目 の 概 要                                             |
|-------------------------|-----------|------------|-------------------------------------------------------|
|                         | 金 額       | 比 率        |                                                       |
| (a) 信 託 報 酬             | 円<br>79   | %<br>0.572 | (a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率                            |
| ( 投 信 会 社 )             | (23)      | (0.168)    | * 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価                        |
| ( 販 売 会 社 )             | (54)      | (0.392)    | * 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの<br>管理および事務手続き等の対価 |
| ( 受 託 会 社 )             | ( 2 )     | (0.011)    | * 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価                          |
| (b) そ の 他 費 用           | 1         | 0.006      | (b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数                     |
| ( 監 査 費 用 )             | ( 1 )     | (0.006)    | * 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用                          |
| 合 計                     | 80        | 0.578      |                                                       |
| 作成期間の平均基準価額は、13,878円です。 |           |            |                                                       |

- (注) 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 消費税は報告日の税率を採用しています。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。
- (注) その他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
- (注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）が支払った費用を含みません。
- (注) 当ファンドが組み入れている投資信託証券の直近の計算期間における「1 万口当たりの費用明細」が取得できるものについては後述することとしています。
- (注) 各比率は1 万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## (参考情報)

## ○総経費率

作成期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.87%です。



(単位: %)

|                      |      |
|----------------------|------|
| 総経費率(①+②+③)          | 1.87 |
| ①当ファンドの費用の比率         | 1.13 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率   | 0.66 |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.08 |

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）です。

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

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

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



○売買及び取引の状況

(2021年7月16日～2022年1月17日)

投資信託証券

| 銘柄 |                            | 第17期～第22期  |          |            |          |
|----|----------------------------|------------|----------|------------|----------|
|    |                            | 買付         |          | 売付         |          |
|    |                            | 口数         | 金額       | 口数         | 金額       |
| 国内 | 世界モノポリー戦略株式ファンド（適格機関投資家限定） | 53,712,390 | 80,000千円 | 28,102,656 | 40,000千円 |

(注) 金額は受渡代金です。

○利害関係人との取引状況等

(2021年7月16日～2022年1月17日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2022年1月17日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| 銘柄 |                            | 第16期末       | 第22期末         |           |      |
|----|----------------------------|-------------|---------------|-----------|------|
|    |                            | 口数          | 口数            | 評価額       | 比率   |
|    |                            | 口           | 口             | 千円        | %    |
|    | 世界モノポリー戦略株式ファンド（適格機関投資家限定） | 992,161,394 | 1,017,771,128 | 1,504,163 | 97.8 |
|    | 合計                         | 992,161,394 | 1,017,771,128 | 1,504,163 | 97.8 |

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

親投資信託残高

| 銘柄 |                   | 第16期末 | 第22期末 |       |
|----|-------------------|-------|-------|-------|
|    |                   | 口数    | 口数    | 評価額   |
|    |                   | 千口    | 千口    | 千円    |
|    | 東京海上マネーブールマザーファンド | 996   | 996   | 1,000 |

## ○投資信託財産の構成

(2022年1月17日現在)

| 項 目               | 第22期末     |       |
|-------------------|-----------|-------|
|                   | 評 価 額     | 比 率   |
|                   | 千円        | %     |
| 投資信託受益証券          | 1,504,163 | 97.4  |
| 東京海上マネープールマザーファンド | 1,000     | 0.1   |
| コール・ローン等、その他      | 39,643    | 2.5   |
| 投資信託財産総額          | 1,544,806 | 100.0 |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目                    | 第17期末          | 第18期末          | 第19期末          | 第20期末          | 第21期末          | 第22期末          |
|------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
|                        | 2021年8月16日現在   | 2021年9月15日現在   | 2021年10月15日現在  | 2021年11月15日現在  | 2021年12月15日現在  | 2022年1月17日現在   |
|                        | 円              | 円              | 円              | 円              | 円              | 円              |
| (A) 資産                 | 1,417,467,356  | 1,395,017,534  | 1,418,675,070  | 1,419,698,900  | 1,431,971,604  | 1,544,806,448  |
| コール・ローン等               | 33,094,534     | 25,216,824     | 21,979,523     | 15,081,701     | 42,630,417     | 39,642,399     |
| 投資信託受益証券(評価額)          | 1,383,372,623  | 1,368,800,511  | 1,395,695,348  | 1,403,617,100  | 1,388,340,988  | 1,504,163,950  |
| 東京海上マネープールマザーファンド(評価額) | 1,000,199      | 1,000,199      | 1,000,199      | 1,000,099      | 1,000,199      | 1,000,099      |
| (B) 負債                 | 7,922,755      | 6,474,721      | 6,377,276      | 9,877,490      | 6,425,939      | 6,971,807      |
| 未払収益分配金                | 2,034,164      | 5,085,307      | 5,075,495      | 5,061,405      | 5,123,847      | 5,395,096      |
| 未払解約金                  | 4,494,963      | 76,150         | 21,325         | 3,446,863      | 29             | 20,141         |
| 未払信託報酬                 | 1,380,053      | 1,300,491      | 1,267,993      | 1,355,931      | 1,289,357      | 1,541,395      |
| 未払利息                   | 63             | 38             | 48             | 13             | 80             | 80             |
| その他未払費用                | 13,512         | 12,735         | 12,415         | 13,278         | 12,626         | 15,095         |
| (C) 純資産総額(A-B)         | 1,409,544,601  | 1,388,542,813  | 1,412,297,794  | 1,409,821,410  | 1,425,545,665  | 1,537,834,641  |
| 元本                     | 1,017,082,289  | 1,017,061,425  | 1,015,099,010  | 1,012,281,171  | 1,024,769,453  | 1,079,019,372  |
| 次期繰越損益金                | 392,462,312    | 371,481,388    | 397,198,784    | 397,540,239    | 400,776,212    | 458,815,269    |
| (D) 受益権総口数             | 1,017,082,289口 | 1,017,061,425口 | 1,015,099,010口 | 1,012,281,171口 | 1,024,769,453口 | 1,079,019,372口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)        | 13,859円        | 13,652円        | 13,913円        | 13,927円        | 13,911円        | 14,252円        |

(注) 当ファンドの第17期首元本額は1,027,844,608円、第17～22期中追加設定元本額は68,450,194円、第17～22期中一部解約元本額は17,275,430円です。

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

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

## ○損益の状況

| 項 目              | 第17期                      | 第18期                      | 第19期                       | 第20期                        | 第21期                        | 第22期                       |
|------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|
|                  | 2021年7月16日～<br>2021年8月16日 | 2021年8月17日～<br>2021年9月15日 | 2021年9月16日～<br>2021年10月15日 | 2021年10月16日～<br>2021年11月15日 | 2021年11月16日～<br>2021年12月15日 | 2021年12月16日～<br>2022年1月17日 |
|                  | 円                         | 円                         | 円                          | 円                           | 円                           | 円                          |
| (A) 配当等収益        | △ 1,369                   | △ 1,041                   | 5,856,594                  | △ 873                       | △ 1,164                     | 5,985,444                  |
| 受取配当金            | —                         | —                         | 5,857,405                  | —                           | —                           | 5,987,221                  |
| 受取利息             | 103                       | 127                       | 36                         | —                           | 90                          | 216                        |
| 支払利息             | △ 1,472                   | △ 1,168                   | △ 847                      | △ 873                       | △ 1,254                     | △ 1,993                    |
| (B) 有価証券売買損益     | 33,903,241                | △ 14,573,225              | 26,936,504                 | 7,868,575                   | 4,726,666                   | 35,816,682                 |
| 売買益              | 34,189,997                | 290                       | 26,936,493                 | 7,921,752                   | 4,728,709                   | 35,822,955                 |
| 売買損              | △ 286,756                 | △ 14,573,515              | 11                         | △ 53,177                    | △ 2,043                     | △ 6,273                    |
| (C) 信託報酬等        | △ 1,393,565               | △ 1,313,226               | △ 1,280,408                | △ 1,369,209                 | △ 1,301,983                 | △ 1,556,490                |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 32,508,307                | △ 15,887,492              | 31,512,690                 | 6,498,493                   | 3,423,519                   | 40,245,636                 |
| (E) 前期繰越損益金      | 350,869,651               | 381,267,287               | 359,522,801                | 384,685,046                 | 385,954,505                 | 384,196,491                |
| (F) 追加信託差損益金     | 11,118,518                | 11,186,900                | 11,238,788                 | 11,418,105                  | 16,522,035                  | 39,768,238                 |
| (配当等相当額)         | ( 10,679,540)             | ( 10,748,100)             | ( 10,807,542)              | ( 10,981,099)               | ( 16,047,709)               | ( 37,325,574)              |
| (売買損益相当額)        | ( 438,978)                | ( 438,800)                | ( 431,246)                 | ( 437,006)                  | ( 474,326)                  | ( 2,442,664)               |
| (G) 計(D+E+F)     | 394,496,476               | 376,566,695               | 402,274,279                | 402,601,644                 | 405,900,059                 | 464,210,365                |
| (H) 収益分配金        | △ 2,034,164               | △ 5,085,307               | △ 5,075,495                | △ 5,061,405                 | △ 5,123,847                 | △ 5,395,096                |
| 次期繰越損益金(G+H)     | 392,462,312               | 371,481,388               | 397,198,784                | 397,540,239                 | 400,776,212                 | 458,815,269                |
| 追加信託差損益金         | 11,118,518                | 11,186,900                | 11,238,788                 | 11,418,105                  | 16,522,035                  | 39,768,238                 |
| (配当等相当額)         | ( 10,679,540)             | ( 10,748,100)             | ( 10,807,542)              | ( 10,981,099)               | ( 16,047,709)               | ( 37,325,579)              |
| (売買損益相当額)        | ( 438,978)                | ( 438,800)                | ( 431,246)                 | ( 437,006)                  | ( 474,326)                  | ( 2,442,659)               |
| 分配準備積立金          | 381,850,946               | 376,689,031               | 385,959,996                | 386,122,593                 | 384,255,161                 | 419,047,031                |
| 繰越損益金            | △ 507,152                 | △ 16,394,543              | —                          | △ 459                       | △ 984                       | —                          |

(注) (B)有価証券売買損益は、各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (C)信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (F)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

| 項 目                 | 第17期                      | 第18期                      | 第19期                       | 第20期                        | 第21期                        | 第22期                       |
|---------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|
|                     | 2021年7月16日～<br>2021年8月16日 | 2021年8月17日～<br>2021年9月15日 | 2021年9月16日～<br>2021年10月15日 | 2021年10月16日～<br>2021年11月15日 | 2021年11月16日～<br>2021年12月15日 | 2021年12月16日～<br>2022年1月17日 |
| a. 配当等収益(費用控除後)     | 0円                        | 0円                        | 5,628,564円                 | 0円                          | 0円                          | 5,763,064円                 |
| b. 有価証券等損益額(費用控除後)  | 0円                        | 0円                        | 9,524,697円                 | 6,498,952円                  | 3,424,044円                  | 34,481,588円                |
| c. 信託約款に規定する収益調整金   | 10,679,540円               | 10,748,100円               | 11,238,788円                | 11,417,646円                 | 16,521,051円                 | 39,768,238円                |
| d. 信託約款に規定する分配準備積立金 | 383,885,110円              | 381,774,338円              | 375,882,230円               | 384,685,046円                | 385,954,964円                | 384,197,475円               |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d)  | 394,564,650円              | 392,522,438円              | 402,274,279円               | 402,601,644円                | 405,900,059円                | 464,210,365円               |
| f. 分配対象収益(1万口当たり)   | 3,879円                    | 3,859円                    | 3,962円                     | 3,977円                      | 3,960円                      | 4,302円                     |
| g. 分配金              | 2,034,164円                | 5,085,307円                | 5,075,495円                 | 5,061,405円                  | 5,123,847円                  | 5,395,096円                 |
| h. 分配金(1万口当たり)      | 20円                       | 50円                       | 50円                        | 50円                         | 50円                         | 50円                        |

○分配金のお知らせ

|                 | 第17期 | 第18期 | 第19期 | 第20期 | 第21期 | 第22期 |
|-----------------|------|------|------|------|------|------|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 20円  | 50円  | 50円  | 50円  | 50円  | 50円  |

(注) 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、分配金は全額普通分配金となります。  
(注) 分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。  
(注) 分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合は、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。  
(注) 元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細 (2022年 1 月17日現在)

<東京海上マネープールマザーファンド>

下記は、東京海上マネープールマザーファンド全体(16,400千口)の内容です。

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分   | 第22期末    |          |         |                     |           |       |        |  |
|-------|----------|----------|---------|---------------------|-----------|-------|--------|--|
|       | 額 面 金 額  | 評 価 額    | 組 入 比 率 | うちB B格以下<br>組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 |       |        |  |
|       |          |          |         |                     | 5 年以上     | 2 年以上 | 2 年未満  |  |
| 地方債証券 | 千円       | 千円       | %       | %                   | %         | %     | %      |  |
|       | 13,000   | 13,001   | 79.0    | —                   | —         | —     | 79.0   |  |
|       | (13,000) | (13,001) | (79.0)  | (—)                 | (—)       | (—)   | (79.0) |  |
| 合 計   | 13,000   | 13,001   | 79.0    | —                   | —         | —     | 79.0   |  |
|       | (13,000) | (13,001) | (79.0)  | (—)                 | (—)       | (—)   | (79.0) |  |

(注) ( )内は非上場債で内書きです。  
(注) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合です。  
(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘 柄                | 第22期末 |         |        |             |  |
|--------------------|-------|---------|--------|-------------|--|
|                    | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額  | 償 還 年 月 日   |  |
| 地方債証券              | %     | 千円      | 千円     |             |  |
| 平成23年度第 5 回広島県公募公債 | 0.99  | 7,000   | 7,001  | 2022/ 1 /27 |  |
| 平成28年度第 2 回福島県公募公債 | 0.02  | 6,000   | 6,000  | 2022/ 2 /23 |  |
| 合 計                |       | 13,000  | 13,001 |             |  |

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| 商 品 分 類                 |                                | 追加型投信／海外／株式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|-------------------------|--------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 信 託 期 間                 |                                | 無期限                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 運 用 方 針                 |                                | アンカーMFG世界モノポリ－戦略株式マザーファンドの受益証券への投資を通じて、信託財産の成長を目指して運用を行います。<br>実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 主 要 運 用 対 象             | 世界モノポリ－戦略株式ファンド<br>(適格機関投資家限定) | アンカーMFG世界モノポリ－戦略株式マザーファンド受益証券                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|                         | アンカーMFG世界モノポリ－戦略株式マザーファンド      | 海外の金融商品取引所に上場している企業の株式等※<br>※リート（不動産投資信託証券）やDR（預託証券）、その他の証券を含みます。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| マ ザ ー フ ァ ン ド の 運 用 方 法 |                                | 1. 主として日本を除く世界の株式等の中から、モノポリ－企業（モノやサービス等を独占・寡占（地域独占含む）していると判断する企業）の株式等を投資対象とします。<br>2. 銘柄選定に関しては、持続可能な競争優位性を持つと判断される銘柄を選別します。<br>3. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。<br>4. 資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。<br>5. モノポリ－企業の株式等の運用は、マゼラン・アセット・マネジメント・リミテッドに運用指図に関する権限を一部委託します。                                                                                                                      |
| 組 入 制 限                 | 世界モノポリ－戦略株式ファンド<br>(適格機関投資家限定) | 1. アンカーMFG世界モノポリ－戦略株式マザーファンド（以下、「マザーファンド」）の受益証券への投資割合には制限を設けません。<br>2. 株式等※への直接投資は、原則として行いません。<br>※リート（不動産投資信託証券）やDR（預託証券）、その他の証券を含みます。以下同じ。<br>3. マザーファンドを通じて行う一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係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信託財産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％を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行います。<br>4. マザーファンドを通じて行う投資信託証券（上場投資信託は除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5％以内とします。 |
|                         | アンカーMFG世界モノポリ－戦略株式マザーファンド      | 1. 株式等への投資割合には制限を設けません。<br>2. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係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信託財産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％を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行います。<br>3. 投資信託証券（上場投資信託は除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5％以内とします。                                                                                                                                                |
| 分 配 方 針                 |                                | 収益分配金額は、分配対象額の範囲（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含む）等の全額）内で委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。但し、必ず分配を行うものではありません。                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

当ファンドは、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、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。

# 世界モノポリ－戦略 株式ファンド (適格機関投資家限定)

## 運用報告書（全体版）

第6期（決算日 2021年9月30日）

第7期（決算日 2022年1月4日）

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼を申し上げます。

さて、「世界モノポリ－戦略株式ファンド（適格機関投資家限定）」は、去る2022年1月4日に第7期の決算を行いました。第6期及び第7期の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。



運用報告書に関するお問い合わせ先  
ノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社  
業務部  
〒106-0032 東京都港区六本木一丁目9-10  
アークヒルズ仙石山森タワー  
電話番号：03-5575-5780  
受付時間：営業日の午前9時～午後5時  
ホームページ：www.northerntrust.jp/

◀世界モノポリー戦略株式ファンド（適格機関投資家限定）▶

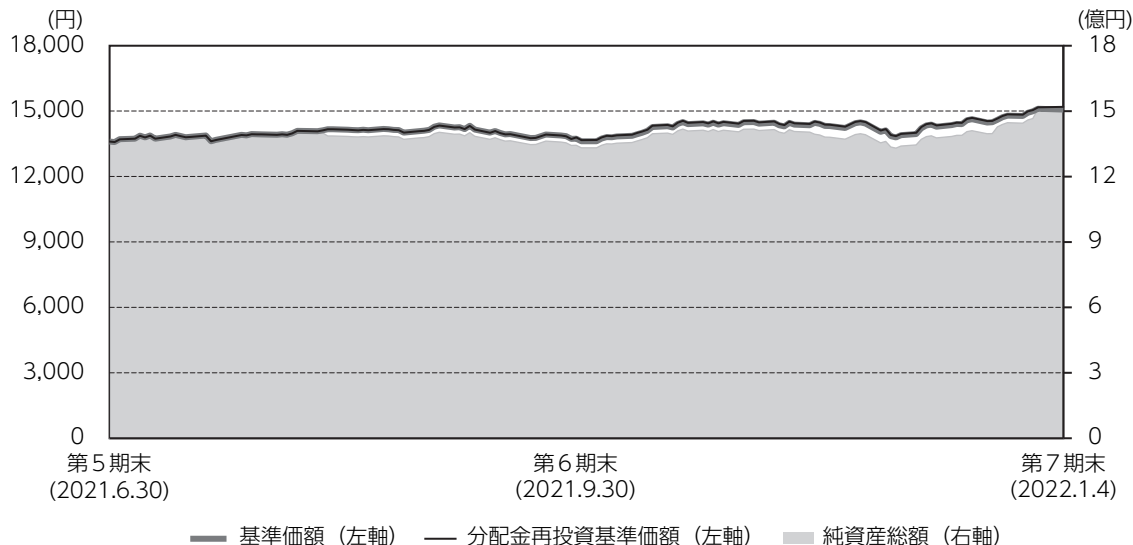
設定以来の運用実績

| 決 算 期                   | 基 準 価 額     |            |            | 参 考 指 数 |            | 株 式<br>組入比率 | 投資証券<br>組入比率 | 純資産<br>総 額 |
|-------------------------|-------------|------------|------------|---------|------------|-------------|--------------|------------|
|                         |             | 税 込<br>分配金 | 期 中<br>騰落率 |         | 期 中<br>騰落率 |             |              |            |
| (設 定 日)<br>(2020年3月16日) | 円<br>10,000 | 円<br>－     | %<br>－     | 10,000  | %<br>－     | %<br>－      | %<br>－       | 百万円<br>980 |
| 1 期 (2020年6月30日)        | 11,631      | 60         | 16.9       | 10,806  | 8.1        | 90.0        | 7.6          | 1,178      |
| 2 期 (2020年9月30日)        | 11,699      | 60         | 1.1        | 10,854  | 0.4        | 91.4        | 7.9          | 1,195      |
| 3 期 (2021年1月4日)         | 12,072      | 60         | 3.7        | 12,130  | 11.8       | 90.9        | 7.8          | 1,233      |
| 4 期 (2021年3月31日)        | 13,074      | 60         | 8.8        | 13,276  | 9.4        | 90.2        | 8.1          | 1,325      |
| 5 期 (2021年6月30日)        | 13,603      | 60         | 4.5        | 13,693  | 3.1        | 90.1        | 8.3          | 1,359      |
| 6 期 (2021年9月30日)        | 13,734      | 60         | 1.4        | 14,028  | 2.4        | 90.5        | 7.7          | 1,343      |
| 7 期 (2022年1月4日)         | 15,070      | 60         | 10.2       | 15,082  | 7.5        | 89.7        | 7.6          | 1,503      |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。  
(注2) 参考指数としてS&P グローバル・インフラストラクチャー・インデックス（税引後配当込み、円換算、2020年3月16日を10,000とする。）を使用しています。基準日前営業日の米ドル建て指数を基準日の対顧客電信売買相場仲値を用いて当社が独自に円換算しています。

## 《運用経過》

## 基準価額等の推移について



（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

## ■基準価額・騰落率

第6期首：13,603円

第7期末：15,070円（既払分配金120円）

騰落率：+11.7%（分配金再投資ベース）

## ■組入ファンドの当期間中の騰落率

| 組入ファンド                    | 騰落率   |
|---------------------------|-------|
| アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド | 12.1% |

## ■基準価額の主な変動要因

株式および為替がともにプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。株式では、主に送配電、空港セクターでの保有銘柄が値上がりしたことがプラス寄与しました。米ドル円相場も円安米ドル高となりプラス寄与しました。

世界モノポリー戦略株式ファンド

| 決算期   | 年 月 日                  | 基 準 価 額     |        | 参 考 指 数 |        | 株 式<br>組入比率 | 投資証券<br>組入比率 |
|-------|------------------------|-------------|--------|---------|--------|-------------|--------------|
|       |                        |             | 騰 落 率  |         | 騰 落 率  |             |              |
| 第 6 期 | (期 首)<br>2021年 6 月30日  | 円<br>13,603 | %<br>－ |         | %<br>－ | %<br>90.1   | %<br>8.3     |
|       | 7 月末                   | 13,932      | 2.4    | 13,790  | 0.7    | 89.7        | 7.9          |
|       | 8 月末                   | 14,097      | 3.6    | 13,923  | 1.7    | 90.1        | 8.0          |
|       | (期 末)<br>2021年 9 月30日  | 13,794      | 1.4    | 14,028  | 2.4    | 90.5        | 7.7          |
|       |                        |             |        |         |        |             |              |
| 第 7 期 | (期 首)<br>2021年 9 月30日  | 13,734      | －      | 14,028  | －      | 90.5        | 7.7          |
|       | 10月末                   | 14,442      | 5.2    | 14,864  | 6.0    | 90.3        | 8.1          |
|       | 11月末                   | 14,115      | 2.8    | 14,176  | 1.1    | 90.0        | 8.2          |
|       | 12月末                   | 15,108      | 10.0   | 14,975  | 6.7    | 89.4        | 7.6          |
|       | (期 末)<br>2022年 1 月 4 日 | 15,130      | 10.2   | 15,082  | 7.5    | 89.7        | 7.6          |

(注 1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は各期首比。  
(注 2) 参考指数としてS&P グローバル・インフラストラクチャー・インデックス（税引後配当込み、円換算、2020年3月16日を10,000とする。）  
を使用しています。基準日前営業日の米ドル建て指数を基準日の対顧客電信売買相場仲値を用いて当社が独自に円換算しています。



## 投資環境について

### ○世界株式市況

当期の世界株式市場は、期首と比べて上昇しました。中国恒大集団のデフォルト（債務不履行）懸念や、新型コロナウイルスの新たな変異株（オミクロン株）の感染拡大などを受けて一時急落する局面も見られましたが、良好な米経済指標や好調な企業決算発表、原油相場の大幅高などが好材料となった他、期末にかけては、オミクロン株の重症化リスクがデルタ株よりも低いとの報告が相次いだことなどが好感され、上昇しました。モノポリー企業関連では、空港銘柄や送配電銘柄などの株価が上昇を牽引しました。空港銘柄のシドニー・エアポートは、インフラ投資を手がけるファンド連合から買収提案を受けたと発表し、買収時の株価プレミアム（上乗せ幅）を見込んだ買いが集まり、株価が大幅に上昇しました。送配電銘柄のナショナル・グリッドは、英国とノルウェー間の海底送電線の稼働に伴う予想より早めの収益化や良好な電力入札価格などを背景に、2022年3月までの通期収益予想を大幅に上方修正したことが好感され、株価が上昇しました。反対に、有料道路セクターは低調でした。トランスアーバン・グループは、金利の上昇やインフレ警戒感の強まりを受けて、株価が下落しました。

### ○為替相場

当期の米ドル円相場は、米金利の上昇や、原油相場高などを背景に、円安米ドル高となりました。下旬には、オミクロン株の重症化リスクがデルタ株よりも低いとの報告を受けて、相対的に低リスク通貨とされる円が売られ、円安米ドル高が進行しました。

## 前期における「今後の運用方針」

「アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド」の受益証券への投資を行います。

## ポートフォリオについて

### ○当ファンド

「アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド」の受益証券への投資を行いました。

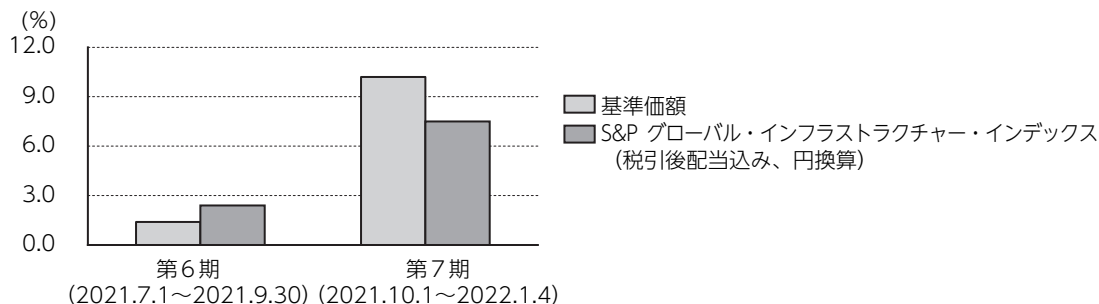
### ○アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド

当ファンドは、高い参入障壁等により、一定の地域においてモノ・サービス等を独占・寡占していると判断するモノポリー（独占的）企業の中から、市況動向や規制緩和等の影響を受けにくく、長期的かつ安定的な利益成長が見込まれる銘柄をさらに厳選し、組み入れを行いました。以上の運用の結果、保有する株式の上昇がプラス寄与し、基準価額（税引前分配金再投資）は上昇しました。当期の寄与度上位の銘柄は、シドニー・エアポート（空港）やナショナル・グリッド（送配電）などとなった一方、寄与度下位の銘柄は、セルネックス（通信）、ヴォパック（エネルギー・インフラ）、トランスアーバン・グループ（有料道路）などでした。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。参考指数は世界のモノポリー企業から構成される株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。



## 分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込）」欄をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目          | 第 6 期                    |  | 第 7 期                    |  |
|--------------|--------------------------|--|--------------------------|--|
|              | 2021年7月1日<br>～2021年9月30日 |  | 2021年10月1日<br>～2022年1月4日 |  |
| 当期分配金（税込）（円） | 60                       |  | 60                       |  |
| 対基準価額比率（％）   | 0.435                    |  | 0.397                    |  |
| 当期の収益（円）     | 60                       |  | 60                       |  |
| 当期の収益以外（円）   | －                        |  | －                        |  |
| 翌期繰越分配対象額（円） | 3,733                    |  | 5,069                    |  |

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売却等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注2）円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込）に合致しない場合があります。

（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込）の期末基準価額（分配金込）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

## 《今後の運用方針》

### ○当ファンド

「アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド」の受益証券への投資を行い、信託財産の成長を目指して運用を行います。

### ○アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド

新型コロナウイルスを巡り市場環境の不透明性は残っていますが、生活に必要不可欠なサービスを独占的に提供するモノポリー企業の株価は、長期的に上昇すると見えています。高い参入障壁、高い価格決定力、高い利益成長の予測可能性により、モノポリー企業は長期的かつ安定的な利益成長が見込まれるためです。株価の変動は、短期的にはその時々の問題を反映する傾向がありますが、長期的には企業の利益成長を反映すると考えています。引き続き、独占・寡占という競争優位性を持つ、希少性の高いモノポリー企業の中から、市況動向や規制緩和等の影響を受けにくい銘柄を厳選し、組み入れを行う方針です。

1万口当りの費用の明細

| 項 目         | 第6期～第7期             |         | 項 目 の 概 要                                                          |
|-------------|---------------------|---------|--------------------------------------------------------------------|
|             | (2021.7.1～2022.1.4) |         |                                                                    |
|             | 金 額                 | 比 率     |                                                                    |
| (a) 信託報酬    | 49円                 | 0.348%  | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br><b>期中の平均基準価額は14,147円です。</b>                |
| (投信会社)      | (48)                | (0.340) | 投信会社分は、委託した資金の運用の対価                                                |
| (販売会社)      | (0)                 | (0.001) | 販売会社分は、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価                  |
| (受託銀行)      | (1)                 | (0.008) | 受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価                                     |
| (b) 募集手数料   | －                   | －       |                                                                    |
| (c) 売買委託手数料 | 1                   | 0.009   | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (株式)        | (1)                 | (0.009) |                                                                    |
| (投資証券)      | (0)                 | (0.000) |                                                                    |
| (d) 有価証券取引税 | －                   | －       | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金   |
| (e) その他費用   | 6                   | 0.044   | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数                                          |
| (保管費用)      | (3)                 | (0.018) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用                 |
| (監査費用)      | (3)                 | (0.024) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用                                        |
| (その他)       | (0)                 | (0.002) |                                                                    |
| 合 計         | 56                  | 0.401   |                                                                    |

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当りのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## ■売買及び取引の状況

(2021年7月1日から2022年1月4日まで)

## 投資信託受益証券

|                               | 設 定    |        | 解 約    |        |
|-------------------------------|--------|--------|--------|--------|
|                               | □ 数    | 金 額    | □ 数    | 金 額    |
|                               | 千口     | 千円     | 千口     | 千円     |
| アンカーMFG世界モノポリー<br>戦略株式マザーファンド | 32,193 | 50,000 | 46,226 | 67,182 |

(注) 単位未満は切捨て。

## ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2021年7月1日から2022年1月4日まで)

| 項 目               | 当 作 成 期                   |
|-------------------|---------------------------|
|                   | アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額     | 163,698千円                 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 1,257,664千円               |
| (c) 売買高比率 (a)÷(b) | 0.13                      |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■利害関係人との取引状況

当ファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

## ■組入資産明細表

親投資信託残高

(2022年1月4日現在)

|                           | 当作成期首<br>(前作成期末) | 当 作 成 期 末 |           |
|---------------------------|------------------|-----------|-----------|
|                           | □ 数              | □ 数       | 評 価 額     |
|                           | 千口               | 千口        | 千円        |
| アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド | 972,763          | 958,729   | 1,512,395 |

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

(2022年1月4日現在)

| 項 目                       | 当 作 成 期 末 |       |
|---------------------------|-----------|-------|
|                           | 評 価 額     | 比 率   |
|                           | 千円        | %     |
| アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド | 1,512,395 | 100.0 |
| コール・ローン等、その他              | 20        | 0.0   |
| 投資信託財産総額                  | 1,512,415 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、1月4日における邦貨換算レートは、1米ドル=115.44円、1カナダドル=90.51円、1スイスフラン=125.78円、1オーストラリアドル=83.05円、1英ポンド=155.53円、1メキシコペソ=5.63円、1香港ドル=14.81円、1ニュージーランドドル=78.44円、100チリペソ=13.54円、1ユーロ=130.49円です。

(注3) アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(1,503,902千円)の投資信託財産総額(1,526,997千円)に対する比率は98.5%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年1月4日現在)

| 項 目                                 | 第6期末           | 第7期末           |
|-------------------------------------|----------------|----------------|
| (A) 資産                              | 1,352,036,424円 | 1,512,415,772円 |
| コール・ローン等                            | 19,973         | 19,974         |
| アンカーMFG世界モノポリー<br>戦略株式マザーファンド (評価額) | 1,352,016,451  | 1,512,395,798  |
| (B) 負債                              | 8,874,974      | 8,644,578      |
| 未払収益分配金                             | 5,867,964      | 5,987,287      |
| 未払信託報酬                              | 2,347,010      | 2,483,723      |
| その他未払費用                             | 660,000        | 173,568        |
| (C) 純資産総額(A-B)                      | 1,343,161,450  | 1,503,771,194  |
| 元本                                  | 977,994,078    | 997,881,185    |
| 次期繰越損益金                             | 365,167,372    | 505,890,009    |
| (D) 受益権総口数                          | 977,994,078口   | 997,881,185口   |
| 1万口当り基準価額(C/D)                      | 13,734円        | 15,070円        |

\* 第6期首における元本額999,442,594円、当作成期間(第6期～第7期)における追加設定元本額33,822,447円、同解約額35,383,856円

\* 計算口数当りの純資産総額は、第6期末1.3734円、第7期末1.5070円です。

## ■損益の状況

第6期 (自2021年7月1日 至2021年9月30日)

第7期 (自2021年10月1日 至2022年1月4日)

| 項 目            | 第 6 期        | 第 7 期         |
|----------------|--------------|---------------|
| (A) 有価証券売買損益   | 21,210,715円  | 138,392,785円  |
| 売買益            | 22,035,110   | 139,254,321   |
| 売買損            | △ 824,395    | △ 861,536     |
| (B) 信託報酬等      | △ 2,513,426  | △ 2,657,291   |
| (C) 当期損益金(A+B) | 18,697,289   | 135,735,494   |
| (D) 前期繰越損益金    | 342,985,451  | 350,744,914   |
| (E) 追加信託差損益金   | 9,352,596    | 25,396,888    |
| (配当等相当額)       | ( 2,682,109) | ( 15,041,963) |
| (売買損益相当額)      | ( 6,670,487) | ( 10,354,925) |
| (F) 合計(C+D+E)  | 371,035,336  | 511,877,296   |
| (G) 収益分配金      | △ 5,867,964  | △ 5,987,287   |
| 次期繰越損益金(F+G)   | 365,167,372  | 505,890,009   |
| 追加信託差損益金       | 9,352,596    | 25,396,888    |
| (配当等相当額)       | ( 2,682,109) | ( 15,188,261) |
| (売買損益相当額)      | ( 6,670,487) | ( 10,208,627) |
| 分配準備積立金        | 355,814,776  | 480,493,121   |

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 分配金の計算過程

第6計算期間末に、費用控除後の配当等収益額13,624,690円(1万口当り139.31円)、有価証券売買等損益5,072,599円(1万口当り51.87円)収益調整金額9,352,596円(1万口当り95.63円)及び、分配準備積立金342,985,451円(1万口当り3,507.03円)から分配対象収益額は371,035,336円(1万口当り3,793円)となり、うち5,867,964円(1万口当り60円)を分配金額としております。

第7計算期間末に、費用控除後の配当等収益額10,042,187円(1万口当り100.63円)、有価証券売買等損益125,693,307円(1万口当り1,259.60円)収益調整金額25,396,888円(1万口当り254.51円)及び、分配準備積立金350,744,914円(1万口当り3,514.90円)から分配対象収益額は511,877,296円(1万口当り5,129円)となり、うち5,987,287円(1万口当り60円)を分配金額としております。

## &lt;補足情報&gt;

当ファンド（世界モノポリー戦略株式ファンド（適格機関投資家限定））が投資対象としている「アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド」の決算日（2021年9月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年1月4日）現在におけるアンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンドの組入資産の内容を掲載いたしました。

## ■組入資産明細表

下記は、2022年1月4日現在におけるアンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド（958,729千口）の内容です。

（2022年1月4日現在）

## (1) 外国株式

| 銘 柄                          | 前期末 | 当 期 末 |               | 業 種 等    |              |
|------------------------------|-----|-------|---------------|----------|--------------|
|                              | 株 数 | 株 数   | 評 価 額         |          |              |
|                              |     |       | 外貨建金額<br>千米ドル |          | 邦貨換算金額<br>千円 |
| (アメリカ)                       | 百株  | 百株    | 千米ドル          | 千円       |              |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 24  | 27    | 247           | 28,529   | 公益事業         |
| PINNACLE WEST CAPITAL        | 8   | 8     | 60            | 7,033    | 公益事業         |
| AMEREN CORP                  | 20  | 19    | 168           | 19,479   | 公益事業         |
| FIRSTENERGY CORP             | 45  | 39    | 164           | 19,014   | 公益事業         |
| BLACK HILLS CORP             | 4   | 4     | 30            | 3,477    | 公益事業         |
| SEMPRA ENERGY                | 15  | 18    | 248           | 28,660   | 公益事業         |
| CALIFORNIA WATER SERVICE GRP | 2   | 3     | 28            | 3,293    | 公益事業         |
| CHESAPEAKE UTILITIES CORP    | 1   | 1     | 16.00         | 1,910.00 | 公益事業         |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 28  | 26    | 229           | 26,484   | 公益事業         |
| CMS ENERGY CORP              | 21  | 19    | 123           | 14,290   | 公益事業         |
| AMERICAN STATES WATER CO     | 2   | 2     | 30            | 3,477    | 公益事業         |
| DTE ENERGY CO                | 13  | 12    | 152           | 17,610   | 公益事業         |
| IDACORP INC                  | 3   | 3     | 38            | 4,403    | 公益事業         |
| ATMOS ENERGY CORP            | 10  | 10    | 105           | 12,134   | 公益事業         |
| ENTERGY CORP                 | 14  | 13    | 148           | 17,103   | 公益事業         |
| CENTERPOINT ENETGY INC       | 39  | 44    | 122           | 14,096   | 公益事業         |
| DOMINION ENERGY INC          | 27  | 31    | 247           | 28,563   | 公益事業         |
| MGE ENERGY INC               | 1   | 1     | 15            | 1,741    | 公益事業         |
| XCEL ENERGY INC              | 31  | 36    | 247           | 28,532   | 公益事業         |
| NISOURCE INC                 | 29  | 29    | 81            | 9,425    | 公益事業         |
| PPL CORP                     | 55  | 51    | 154           | 17,803   | 公益事業         |
| PNM RESOURCES INC            | 6   | 6     | 27            | 3,209    | 公益事業         |
| SJW GRP                      | 1   | 1     | 10            | 1,268    | 公益事業         |
| SOUTH JERSEY INDUSTRIES      | 8   | 8     | 22            | 2,546    | 公益事業         |
| SOUTHERN CO/THE              | 34  | 34    | 236           | 27,252   | 公益事業         |
| AVISTA CORP                  | 3   | 3     | 15            | 1,732    | 公益事業         |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 18  | 16    | 100           | 11,653   | 公益事業         |
| ALLETE INC                   | 4   | 4     | 28            | 3,274    | 公益事業         |
| NORTHWESTERN CORP            | 2   | 2     | 15            | 1,758    | 公益事業         |
| PORTLAND GENERAL ELECTRIC CO | 6   | 6     | 33            | 3,899    | 公益事業         |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 14  | 13    | 244           | 28,229   | 公益事業         |
| DUKE ENERGY CORP             | 21  | 23    | 243           | 28,099   | 公益事業         |
| EVERGY INC                   | 16  | 14    | 100           | 11,582   | 公益事業         |
| NORTHWEST NATURAL HLDG CO    | 1   | 1     | 7             | 906      | 公益事業         |
| ONE GAS INC                  | 3   | 3     | 28            | 3,338    | 公益事業         |
| ESSENTIAL UTILITIES INC      | 21  | 18    | 96            | 11,174   | 公益事業         |

| 銘 柄                          |                    | 前期末          | 当 期 末       |            | 業 種 等              |          |
|------------------------------|--------------------|--------------|-------------|------------|--------------------|----------|
|                              |                    | 株 数          | 株 数         | 評 価 額      |                    |          |
|                              |                    |              |             | 外貨建金額      | 邦貨換算金額             |          |
| (アメリカ)                       |                    | 百株           | 百株          | 千米ドル       | 千円                 |          |
| EVERSOURCE ENERGY            |                    | 27           | 26          | 231        | 26,762             | 公益事業     |
| AVANGRID INC                 |                    | 2            | 2           | 14         | 1,690              | 公益事業     |
| SPIRE INC                    |                    | 3            | 3           | 24         | 2,808              | 公益事業     |
| WEC ENERGY GRP INC           |                    | 21           | 21          | 205        | 23,693             | 公益事業     |
| 小 計                          | 株 数・金 額<br>銘柄数<比率> | 625<br>40銘柄  | 620<br>40銘柄 | 4,348<br>- | 501,947<br><33.2%> |          |
| (スペイン)                       |                    | 百株           | 百株          | 千ユーロ       | 千円                 |          |
| ENAGAS SA                    |                    | 56           | 56          | 114        | 14,932             | 公益事業     |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA |                    | 104          | 104         | 200        | 26,228             | 公益事業     |
| AENA SME SA                  |                    | 18           | 18          | 256        | 33,455             | 運輸       |
| CELLNEX TELECOM SA           |                    | 61           | 66          | 339        | 44,347             | 電気通信サービス |
| 小 計                          | 株 数・金 額<br>銘柄数<比率> | 241<br>4銘柄   | 246<br>4銘柄  | 911<br>-   | 118,964<br><7.9%>  |          |
| (イタリア)                       |                    | 百株           | 百株          | 千ユーロ       | 千円                 |          |
| ACEA SPA                     |                    | 10           | 10          | 20         | 2,687              | 公益事業     |
| SNAM SPA                     |                    | 459          | 467         | 251        | 32,765             | 公益事業     |
| TERNA SPA                    |                    | 350          | 346         | 248        | 32,463             | 公益事業     |
| ENAV SPA                     |                    | 61           | 61          | 24         | 3,215              | 運輸       |
| ITALGAS SPA                  |                    | 129          | 110         | 67         | 8,798              | 公益事業     |
| 小 計                          | 株 数・金 額<br>銘柄数<比率> | 1,011<br>5銘柄 | 996<br>5銘柄  | 612<br>-   | 79,929<br><5.3%>   |          |
| (フランス)                       |                    | 百株           | 百株          | 千ユーロ       | 千円                 |          |
| ADP                          |                    | 8            | 8           | 95         | 12,502             | 運輸       |
| VINCI SA                     |                    | 33           | 37          | 345        | 45,085             | 資本財      |
| GETLINK SE                   |                    | 99           | 95          | 141        | 18,470             | 運輸       |
| 小 計                          | 株 数・金 額<br>銘柄数<比率> | 141<br>3銘柄   | 141<br>3銘柄  | 582<br>-   | 76,058<br><5.0%>   |          |
| (ドイツ)                        |                    | 百株           | 百株          | 千ユーロ       | 千円                 |          |
| FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT |                    | 8            | 8           | 55         | 7,208              | 運輸       |
| 小 計                          | 株 数・金 額<br>銘柄数<比率> | 8<br>1銘柄     | 8<br>1銘柄    | 55<br>-    | 7,208<br><0.5%>    |          |
| (オランダ)                       |                    | 百株           | 百株          | 千ユーロ       | 千円                 |          |
| VOPAK                        |                    | 17           | 16          | 49         | 6,472              | エネルギー    |
| 小 計                          | 株 数・金 額<br>銘柄数<比率> | 17<br>1銘柄    | 16<br>1銘柄   | 49<br>-    | 6,472<br><0.4%>    |          |

| 銘柄                                                                                                                                                      | 前期末                                           | 当 期 末                                          |                                                                                                        | 業 種 等                                                                                                        |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------|------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                                                                                                                                         | 株 数                                           | 株 数                                            | 評 価 額<br>外貨建金額 邦貨換算金額                                                                                  |                                                                                                              |
| <b>(ポルトガル)</b><br>REDES ENERGETICAS NACIONAIS                                                                                                           | 百株<br>93                                      | 百株<br>93                                       | 千ユーロ<br>23 3,126                                                                                       | 千円<br>3,126 公益事業                                                                                             |
| 小 計                                                                                                                                                     | 株数・金額<br>銘柄数<比率>                              | 93<br>1銘柄                                      | 93<br>1銘柄<br>23<br>—                                                                                   | 3,126<br><0.2%>                                                                                              |
| ユーロ計                                                                                                                                                    | 株数・金額<br>銘柄数<比率>                              | 1,513<br>15銘柄                                  | 1,502<br>15銘柄<br>2,235<br>—                                                                            | 291,759<br><19.3%>                                                                                           |
| <b>(カナダ)</b><br>CANADIAN UTILITIES LTD-A<br>FORTIS INC<br>ENBRIDGE INC<br>EMERA INC<br>ALGONQUIN POWER AND UTILITIES<br>TC ENERGY CORP<br>HYDRO ONE LTD | 百株<br>27<br>82<br>95<br>55<br>127<br>72<br>74 | 百株<br>27<br>82<br>100<br>58<br>143<br>81<br>76 | 千カナドル<br>100 9,052<br>500 45,295<br>495 44,846<br>371 33,622<br>262 23,779<br>479 43,380<br>252 22,891 | 千円<br>9,052 公益事業<br>45,295 公益事業<br>44,846 エネルギー<br>33,622 公益事業<br>23,779 公益事業<br>43,380 エネルギー<br>22,891 公益事業 |
| 小 計                                                                                                                                                     | 株数・金額<br>銘柄数<比率>                              | 534<br>7銘柄                                     | 570<br>7銘柄<br>2,462<br>—                                                                               | 222,867<br><14.7%>                                                                                           |
| <b>(オーストラリア)</b><br>TRANSURBAN GRP<br>APA GRP<br>SPARK INFRASTRUCTURE GRP<br>SYDNEY AIRPORT<br>AUSNET SERVICES<br>ATLAS ARTERIA                         | 百株<br>338<br>287<br>413<br>659<br>440<br>235  | 百株<br>381<br>287<br>—<br>585<br>440<br>235     | 千オーストラリアドル<br>526 43,753<br>288 23,997<br>—<br>507 42,182<br>113 9,406<br>163 13,545                   | 千円<br>43,753 運輸<br>23,997 公益事業<br>— 公益事業<br>42,182 運輸<br>9,406 公益事業<br>13,545 運輸                             |
| 小 計                                                                                                                                                     | 株数・金額<br>銘柄数<比率>                              | 2,375<br>6銘柄                                   | 1,930<br>5銘柄<br>1,600<br>—                                                                             | 132,885<br><8.8%>                                                                                            |
| <b>(イギリス)</b><br>PENNON GRP PLC<br>SEVERN TRENT PLC<br>UNITED UTILITIES GRP PLC<br>NATIONAL GRID PLC                                                    | 百株<br>111<br>59<br>167<br>293                 | 百株<br>67<br>61<br>173<br>266                   | 千英ポンド<br>78 12,229<br>182 28,330<br>189 29,409<br>282 43,999                                           | 千円<br>12,229 公益事業<br>28,330 公益事業<br>29,409 公益事業<br>43,999 公益事業                                               |
| 小 計                                                                                                                                                     | 株数・金額<br>銘柄数<比率>                              | 632<br>4銘柄                                     | 569<br>4銘柄<br>732<br>—                                                                                 | 113,969<br><7.5%>                                                                                            |
| <b>(メキシコ)</b><br>PROMOTORA Y OPERADORA DE INF<br>GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B<br>GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B<br>GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT           | 百株<br>—<br>46<br>83<br>80                     | 百株<br>50<br>46<br>73<br>80                     | 千メキシコペソ<br>816 4,597<br>1,964 11,061<br>2,093 11,790<br>1,096 6,172                                    | 千円<br>4,597 運輸<br>11,061 運輸<br>11,790 運輸<br>6,172 運輸                                                         |
| 小 計                                                                                                                                                     | 株数・金額<br>銘柄数<比率>                              | 210<br>3銘柄                                     | 251<br>4銘柄<br>5,970<br>—                                                                               | 33,621<br><2.2%>                                                                                             |
| <b>(香港)</b><br>POWER ASSETS HLDG LTD                                                                                                                    | 百株<br>305                                     | 百株<br>305                                      | 千香港ドル<br>1,502 22,246                                                                                  | 千円<br>22,246 公益事業                                                                                            |
| 小 計                                                                                                                                                     | 株数・金額<br>銘柄数<比率>                              | 305<br>1銘柄                                     | 305<br>1銘柄<br>1,502<br>—                                                                               | 22,246<br><1.5%>                                                                                             |
| <b>(ニュージーランド)</b><br>VECTOR LTD<br>AUCKLAND INTL AIRPORT LTD                                                                                            | 百株<br>67<br>270                               | 百株<br>67<br>282                                | 千ニュージーランドドル<br>27 2,126<br>217 17,048                                                                  | 千円<br>2,126 公益事業<br>17,048 運輸                                                                                |
| 小 計                                                                                                                                                     | 株数・金額<br>銘柄数<比率>                              | 338<br>2銘柄                                     | 349<br>2銘柄<br>244<br>—                                                                                 | 19,174<br><1.3%>                                                                                             |
| <b>(スイス)</b><br>FLUGHAFEN ZURICH AG-REG                                                                                                                 | 百株<br>4                                       | 百株<br>4                                        | 千スイスフラン<br>76 9,654                                                                                    | 千円<br>9,654 運輸                                                                                               |
| 小 計                                                                                                                                                     | 株数・金額<br>銘柄数<比率>                              | 4<br>1銘柄                                       | 4<br>1銘柄<br>76<br>—                                                                                    | 9,654<br><0.6%>                                                                                              |

| 銘柄                                | 前期末              | 当 期 末         |                          | 業 種 等               |
|-----------------------------------|------------------|---------------|--------------------------|---------------------|
|                                   | 株 数              | 株 数           | 評 価 額<br>外貨建金額 邦貨換算金額    |                     |
| <b>(チリ)</b><br>AGUAS ANDINAS SA-A | 百株<br>649        | 百株<br>649     | 千チリペソ<br>9,915 1,343     | 千円<br>1,343 公益事業    |
| 小 計                               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 649<br>1銘柄    | 649<br>1銘柄<br>9,915<br>— | 1,343<br><0.1%>     |
| 合計                                | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 7,187<br>80銘柄 | 6,752<br>80銘柄<br>—<br>—  | 1349,470<br><89.2%> |

(注1) 邦貨換算金額は期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。

(注2) < >は純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 単位未満は切捨て。

(注4) 業種はGICS分類（産業グループ）によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS & PおよびMSCI Inc.に帰属します。

## (2) 投資証券

| 銘柄                                                                                        | 前期末                       | 当 期 末                     |                                                | 業 種 等                                        |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|---------------------------|------------------------------------------------|----------------------------------------------|
|                                                                                           | 口 数                       | 口 数                       | 評 価 額<br>外貨建金額 邦貨換算金額                          |                                              |
| <b>(アメリカ)</b><br>AMERICAN TOWER CORP<br>CROWN CASTLE INTL CORP<br>SBA COMMUNICATIONS CORP | 千口<br>0.984<br>1<br>0.837 | 千口<br>0.894<br>1<br>0.674 | 千米ドル<br>256 29,555<br>262 30,264<br>256 29,556 | 千円<br>29,555 不動産<br>30,264 不動産<br>29,556 不動産 |
| 小 計                                                                                       | 口数・金額<br>銘柄数<比率>          | 3<br>3銘柄                  | 2<br>3銘柄<br>774<br>—                           | 89,376<br><5.9%>                             |
| <b>(イギリス)</b><br>INTL PUBLIC PARTNER<br>HICL INFRASTRUCTURE PLC                           | 千口<br>42<br>49            | 千口<br>42<br>49            | 千英ポンド<br>72 11,324<br>87 13,630                | 千円<br>11,324 その他<br>13,630 その他               |
| 小 計                                                                                       | 口数・金額<br>銘柄数<比率>          | 92<br>2銘柄                 | 92<br>2銘柄<br>160<br>—                          | 24,954<br><1.6%>                             |
| 合計                                                                                        | 口数・金額<br>銘柄数<比率>          | 95<br>5銘柄                 | 95<br>5銘柄<br>—<br>—                            | 114,330<br><7.6%>                            |

(注1) 邦貨換算金額は期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。

(注2) < >は純資産総額に対する各国別投資信託受益証券、投資証券評価額の比率。

(注3) 単位未満は切捨て。

(注4) 業種はGICS分類（産業グループ）によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS & PおよびMSCI Inc.に帰属します。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運用方針   | 信託財産の成長を目指して運用を行います。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 主要運用対象 | 海外の金融商品取引所に上場している企業の株式等※<br>※リート（不動産投資信託証券）やDR（預託証券）、その他の証券を含みます。                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 運用方法   | <ol style="list-style-type: none"> <li>主として日本を除く世界の株式等の中から、モノポリー企業（モノやサービス等を独占・寡占（地域独占含む）していると判断する企業）の株式等を投資対象とします。</li> <li>銘柄選定に関しては、持続可能な競争優位性を持つと判断される銘柄を選別します。</li> <li>外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</li> <li>資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができません場合があります。</li> <li>モノポリー企業の株式等の運用は、マゼラン・アセット・マネジメント・リミテッドに運用指図に関する権限を一部委託します。</li> </ol> |
| 組入制限   | <ol style="list-style-type: none"> <li>株式等への投資割合には制限を設けません。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係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信託財産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%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行います。</li> <li>投資信託証券（上場投資信託は除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</li> </ol>                                  |

# アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド

## 運用報告書

第2期（決算日 2021年9月30日）

### 受益者のみなさまへ

毎々格別のお引き立てにあずかり厚くお礼を申し上げます。

さて、「アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド」は、去る2021年9月30日に第2期の決算を行いましたので期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。



運用報告書に関するお問い合わせ先  
 ノーザン・トラスト・グローバル・インベストメンツ株式会社  
 業務部  
 〒106-0032 東京都港区六本木一丁目9-10  
 アークヒルズ仙石山森タワー  
 電話番号：03-5575-5780  
 受付時間：営業日の午前9時～午後5時  
 ホームページ：www.northerntrust.jp/

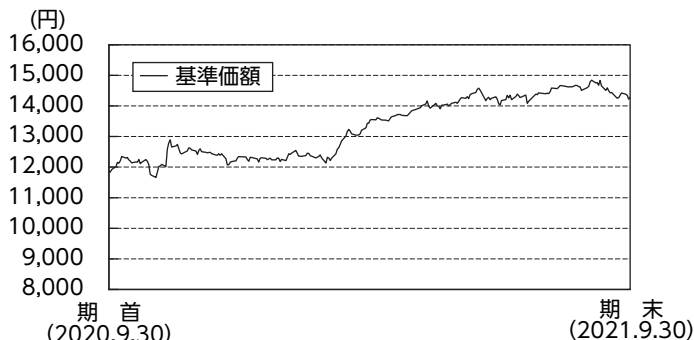


■設定以来の運用実績

| 決 算 期                   | 基 準 価 額 |            | 参 考 指 数 |            | 株 式<br>組入比率 | 投資証券<br>組入比率 | 純資産<br>総 額 |
|-------------------------|---------|------------|---------|------------|-------------|--------------|------------|
|                         |         | 期 中<br>騰落率 |         | 期 中<br>騰落率 |             |              |            |
| (設 定 日)<br>(2020年3月16日) | 円       | %          |         | %          | %           | %            | 百万円        |
|                         | 10,000  | —          | 10,000  | —          | —           | —            | 980        |
| 1期(2020年9月30日)          | 11,867  | 18.7       | 10,854  | 8.5        | 90.7        | 7.8          | 1,204      |
| 2期(2021年9月30日)          | 14,290  | 20.4       | 14,028  | 29.2       | 89.9        | 7.6          | 1,352      |

(注) 参考指数としてS&P グローバル・インフラストラクチャー・インデックス (税引後配当込み、円換算、2020年3月16日を10,000とする。) を使用しています。基準日前営業日の米ドル建て指数を基準日の対顧客電信売買相場仲値を用いて当社が独自に円換算しています。

■当期中の基準価額と市況等の推移



| 年 月 日               | 基 準 価 額 |       | 参 考 指 数 |       | 株 式<br>組入比率 | 投資証券<br>組入比率 |
|---------------------|---------|-------|---------|-------|-------------|--------------|
|                     |         | 騰 落 率 |         | 騰 落 率 |             |              |
| (期 首)<br>2020年9月30日 | 円       | %     |         | %     | %           | %            |
|                     | 11,867  | —     | 10,854  | —     | 90.7        | 7.8          |
| 10月末                | 11,728  | △ 1.2 | 10,638  | △ 2.0 | 90.5        | 7.7          |
| 11月末                | 12,524  | 5.5   | 12,085  | 11.3  | 90.2        | 7.9          |
| 12月末                | 12,343  | 4.0   | 12,143  | 11.9  | 90.4        | 7.7          |
| 2021年1月末            | 12,254  | 3.3   | 12,138  | 11.8  | 90.2        | 8.1          |
| 2月末                 | 12,303  | 3.7   | 12,580  | 15.9  | 90.0        | 8.1          |
| 3月末                 | 13,436  | 13.2  | 13,276  | 22.3  | 89.6        | 8.1          |
| 4月末                 | 13,841  | 16.6  | 13,632  | 25.6  | 90.0        | 8.2          |
| 5月末                 | 14,119  | 19.0  | 13,812  | 27.3  | 89.9        | 8.2          |
| 6月末                 | 14,066  | 18.5  | 13,693  | 26.2  | 89.5        | 8.2          |
| 7月末                 | 14,415  | 21.5  | 13,790  | 27.1  | 89.6        | 7.9          |
| 8月末                 | 14,595  | 23.0  | 13,923  | 28.3  | 90.0        | 8.0          |
| (期 末)<br>2021年9月30日 | 14,290  | 20.4  | 14,028  | 29.2  | 89.9        | 7.6          |

(注) 騰落率は期首比。

## 《運用経過》

### ◆基準価額等の推移について

#### 【基準価額・騰落率】

期首：11,867円 期末：14,290円 騰落率：+20.4%

#### 【基準価額の主な変動要因】

株式および為替がともにプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。株式では、主に空港やエネルギー・インフラセクターでの保有銘柄の株価が大きく値上がりしたことがプラス寄与しました。為替では、米ドル円相場は円安米ドル高となりプラス寄与しました。

### ◆投資環境について

#### ○世界株式市況

当期の世界株式市場は、米国のバイデン新政権の大型経済対策への期待の高まりや、新型コロナウイルス向けワクチンの接種開始による経済活動の早期正常化期待などを受け、上昇基調で推移しました。モノポリー企業関連では、空港セクターやエネルギー・インフラセクターのパフォーマンスが良好となり、上昇を牽引しました。空港銘柄のシドニー・エアポートは、ワクチン接種開始により、交通需要の回復への期待が高まったことなどから、株価が上昇しました。エネルギー・インフラ銘柄では、米バイデン新政権下での大型経済対策の成立期待の高まりから、米国で事業を展開するTCエナジーやエンブリッジなどの株価が上昇しました。

#### ○為替相場

当期の米ドル円相場は、米国の大型経済対策の成立期待や新型コロナウイルスワクチン接種の進展に伴う経済正常化への期待の高まり、米国長期金利の上昇などを背景に、円安米ドル高となりました。

### ◆前期における「今後の運用方針」

新型コロナウイルスを巡る問題は依然予断を許しませんが、生活に必要な不可欠なサービスを独占的に提供するモノポリー企業の株価は、長期的に回復すると見えています。高い参入障壁、高い価格決定力、高い利益成長の予測可能性により、モノポリー企業は長期的かつ安定的な利益成長が見込まれるためです。株価の変動は、短期的にはその時々の問題を反映する傾向がありますが、長期的には企業の利益成長を反映すると考えています。引き続き、独占・寡占という競争優位性を持つ、希少性の高いモノポリー企業の中から、市況動向や規制緩和等の影響を受けにくい銘柄を厳選し、組み入れを行う方針です。

### ◆ポートフォリオについて

当ファンドは、高い参入障壁等により、一定の地域においてモノ・サービス等を独占・寡占していると判断するモノポリー（独占的）企業の中から、市況動向や規制緩和等の影響を受けにくく、長期的かつ安定的な利益成長が見込まれる銘柄をさらに厳選し、組み入れを行いました。以上の運用の結果、保有する株式の上昇がプラス寄与し、基準価額（税引前分配金再投資）は上昇しました。当期の寄与度上位の銘柄は、エンブリッジ（エネルギー・インフラ）やシドニー・エアポート（空港）、バンシ（有料道路）などとなった一方、寄与度下位の銘柄は、ウォパックやAPAグループ（エネルギー・インフラ）、アグアス・アンディーナス（水道）などでした。

### ◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。参考指数は世界のモノポリー企業から構成される株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。

基準価額と参考指数の騰落率は、それぞれ+20.4%、+29.2%となりました。

## 《今後の運用方針》

新型コロナウイルスを巡る問題は依然予断を許しませんが、生活に必要な不可欠なサービスを独占的に提供するモノポリー企業の株価は、長期的に上昇すると見えています。高い参入障壁、高い価格決定力、高い利益成長の予測可能性により、モノポリー企業は長期的かつ安定的な利益成長が見込まれるためです。株価の変動は、短期的にはその時々の問題を反映する傾向がありますが、長期的には企業の利益成長を反映すると考えています。引き続き、独占・寡占という競争優位性を持つ、希少性の高いモノポリー企業の中から、市況動向や規制緩和等の影響を受けにくい銘柄を厳選し、組み入れを行う方針です。

■ 1 万口当りの費用の明細

| 項 目                           | 当 期                |
|-------------------------------|--------------------|
| (a) 売買委託手数料<br>(株式)<br>(投資証券) | 1円<br>( 1)<br>( 0) |
| (b) 有価証券取引税                   | —                  |
| (c) その他費用<br>(保管費用)<br>(その他)  | 5<br>( 5)<br>( 0)  |
| 合 計                           | 6                  |

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって  
受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。  
(c) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数  
(d) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数  
(注2) 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

■ 売買及び取引の状況

(2020年10月1日から2021年9月30日まで)

(1) 株 式

|                       | 買 付  |             | 売 付  |             |
|-----------------------|------|-------------|------|-------------|
|                       | 株 数  | 金 額         | 株 数  | 金 額         |
| アメリカ                  | 百株   | 千米ドル        | 百株   | 千米ドル        |
|                       | 81   | 409         | 61   | 455         |
|                       | (6)  | (24)        | (－)  | (－)         |
| カナダ                   | 百株   | 千カナダドル      | 百株   | 千カナダドル      |
|                       | 38   | 188         | 66   | 298         |
| オーストラリア               | 百株   | 千オーストラリアドル  | 百株   | 千オーストラリアドル  |
|                       | 95   | 105         | 191  | 170         |
| イギリス                  | 百株   | 千英ポンド       | 百株   | 千英ポンド       |
|                       | 30   | 33          | 72   | 79          |
| メキシコ                  | 百株   | 千メキシコペソ     | 百株   | 千メキシコペソ     |
|                       | —    | —           | 1    | 471         |
|                       | (1)  | (354)       | (53) | (354)       |
| ニュージーランド              | 百株   | 千ニュージーランドドル | 百株   | 千ニュージーランドドル |
|                       | 11   | 8           | 36   | 28          |
| ユ<br>ー<br>ロ           | 百株   | 千ユーロ        | 百株   | 千ユーロ        |
|                       | 17   | 77          | 102  | 155         |
|                       | (66) | (23)        | (－)  | (－)         |
| ロ<br>フ<br>ラ<br>ン<br>ス | 百株   | 千ユーロ        | 百株   | 千ユーロ        |
|                       | 5    | 21          | 16   | 58          |

|             |         | 買 付  |      | 売 付  |      |
|-------------|---------|------|------|------|------|
|             |         | 株 数  | 金 額  | 株 数  | 金 額  |
| ユ<br>ー<br>ロ | イタリア    | 百株   | 千ユーロ | 百株   | 千ユーロ |
|             |         | —    | —    | 60   | 32   |
|             |         | (－)  | (－)  | (16) | (29) |
|             | ユーロ 通貨計 | 百株   | 千ユーロ | 百株   | 千ユーロ |
|             |         | 22   | 98   | 180  | 245  |
|             |         | (66) | (23) | (16) | (29) |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) ( )内は増資割当、株式転換・合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。  
(注3) 単位未満は切捨て。

(2) 投資証券

|      | 買 付  |      | 売 付   |      |
|------|------|------|-------|------|
|      | 口 数  | 金 額  | 口 数   | 金 額  |
| アメリカ | 千口   | 千米ドル | 千口    | 千米ドル |
|      | 0.51 | 109  | 0.677 | 167  |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2020年10月1日から2021年9月30日まで)

| 項 目               | 当 期                       |
|-------------------|---------------------------|
|                   | アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額     | 222,145千円                 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 1,178,100千円               |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.18                      |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。  
 (注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(2020年10月1日から2021年9月30日まで)

(1) 株式

| 当 期                     |       |        |        | 期                       |       |        |        |
|-------------------------|-------|--------|--------|-------------------------|-------|--------|--------|
| 買                       |       | 付      |        | 売                       |       | 付      |        |
| 銘 柄                     | 株 数   | 金 額    | 平均単価   | 銘 柄                     | 株 数   | 金 額    | 平均単価   |
|                         | 千株    | 千円     | 円      |                         | 千株    | 千円     | 円      |
| CENTERPOINT ENETGY INC  | 3     | 11,346 | 2,873  | CELLNEX TELECOM SA      | 1     | 12,133 | 6,847  |
| TC ENERGY CORP          | 2     | 11,100 | 4,581  | ENBRIDGE INC            | 2     | 10,963 | 3,759  |
| CELLNEX TELECOM SA      | 1     | 10,032 | 5,772  | TC ENERGY CORP          | 1     | 9,509  | 4,989  |
| TRANSURBAN GRP          | 6     | 6,478  | 1,078  | AMERICAN ELECTRIC POWER | 0.681 | 6,377  | 9,364  |
| SEMPRA ENERGY           | 0.397 | 5,257  | 13,243 | DUKE ENERGY CORP        | 0.614 | 6,211  | 10,117 |
| XCEL ENERGY INC         | 0.682 | 4,775  | 7,001  | SEMPRA ENERGY           | 0.422 | 5,809  | 13,765 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 0.51  | 4,408  | 8,643  | NATIONAL GRID PLC       | 3     | 5,170  | 1,316  |
| DOMINION ENERGY INC     | 0.47  | 3,674  | 7,818  | SYDNEY AIRPORT          | 8     | 4,794  | 552    |
| ENBRIDGE INC            | 1     | 3,545  | 3,064  | TRANSURBAN GRP          | 3     | 4,365  | 1,150  |
| DUKE ENERGY CORP        | 0.281 | 2,608  | 9,283  | VINCI SA                | 0.337 | 3,707  | 11,001 |

(注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(2) 投資証券

| 当 期                     |       |       |        | 期                       |       |       |        |
|-------------------------|-------|-------|--------|-------------------------|-------|-------|--------|
| 買                       |       | 付     |        | 売                       |       | 付     |        |
| 銘 柄                     | 口 数   | 金 額   | 平均単価   | 銘 柄                     | 口 数   | 金 額   | 平均単価   |
|                         | 千口    | 千円    | 円      |                         | 千口    | 千円    | 円      |
| AMERICAN TOWER CORP     | 0.173 | 4,099 | 23,695 | AMERICAN TOWER CORP     | 0.256 | 7,536 | 29,437 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 0.125 | 3,736 | 29,893 | CROWN CASTLE INTL CORP  | 0.147 | 5,540 | 20,219 |
| CROWN CASTLE INTL CORP  | 0.212 | 3,667 | 17,300 | SBA COMMUNICATIONS CORP | 0.274 | 5,340 | 36,328 |

(注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

■組入資産の明細

(2021年9月30日現在)

(1) 外国株式

| 銘<br>柄                       | 前期末              |             | 当 期 末       |            | 業 種 等              |
|------------------------------|------------------|-------------|-------------|------------|--------------------|
|                              | 株 数              | 株 数         | 評 価 額       |            |                    |
|                              |                  |             | 外貨建金額       | 邦貨換算金額     |                    |
| (アメリカ)                       | 百株               | 百株          | 千米ドル        | 千円         |                    |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 27               | 25          | 208         | 23,322     | 公益事業               |
| PINNACLE WEST CAPITAL        | 8                | 8           | 63          | 7,073      | 公益事業               |
| AMEREN CORP                  | 19               | 19          | 156         | 17,555     | 公益事業               |
| FIRSTENERGY CORP             | 42               | 43          | 156         | 17,485     | 公益事業               |
| BLACK HILLS CORP             | 4                | 4           | 27          | 3,065      | 公益事業               |
| SEMPRA ENERGY                | 17               | 17          | 221         | 24,793     | 公益事業               |
| CALIFORNIA WATER SERVICE GRP | 2                | 2           | 15          | 1,724      | 公益事業               |
| CHESAPEAKE UTILITIES CORP    | -                | 1           | 14          | 1,587      | 公益事業               |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 25               | 26          | 194         | 21,759     | 公益事業               |
| CMS ENERGY CORP              | 21               | 19          | 114         | 12,814     | 公益事業               |
| AMERICAN STATES WATER CO     | 1                | 2           | 25          | 2,849      | 公益事業               |
| DTE ENERGY CO                | 13               | 12          | 144         | 16,206     | 公益事業               |
| IDACORP INC                  | 3                | 3           | 35          | 4,020      | 公益事業               |
| ATMOS ENERGY CORP            | 10               | 10          | 88          | 9,960      | 公益事業               |
| ENTERGY CORP                 | 14               | 13          | 133         | 14,995     | 公益事業               |
| CENTERPOINT ENETGY INC       | -                | 39          | 99          | 11,095     | 公益事業               |
| DOMINION ENERGY INC          | 26               | 28          | 212         | 23,765     | 公益事業               |
| MGE ENERGY INC               | 1                | 1           | 13          | 1,559      | 公益事業               |
| XCEL ENERGY INC              | 29               | 33          | 212         | 23,833     | 公益事業               |
| NISOURCE INC                 | 29               | 29          | 71          | 8,045      | 公益事業               |
| PPL CORP                     | 55               | 51          | 145         | 16,304     | 公益事業               |
| PNM RESOURCES INC            | 6                | 6           | 30          | 3,393      | 公益事業               |
| SJW GRP                      | 1                | 1           | 10          | 1,133      | 公益事業               |
| SOUTH JERSEY INDUSTRIES      | 4                | 8           | 18          | 2,058      | 公益事業               |
| SOUTHERN CO/THE              | 40               | 34          | 216         | 24,277     | 公益事業               |
| AVISTA CORP                  | 3                | 3           | 14          | 1,581      | 公益事業               |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 18               | 16          | 94          | 10,537     | 公益事業               |
| ALLETE INC                   | 4                | 4           | 25          | 2,887      | 公益事業               |
| NORTHWESTERN CORP            | 2                | 2           | 15          | 1,762      | 公益事業               |
| PORTLAND GENERAL ELECTRIC CO | 6                | 6           | 30          | 3,453      | 公益事業               |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 14               | 13          | 238         | 26,664     | 公益事業               |
| DUKE ENERGY CORP             | 25               | 21          | 214         | 24,048     | 公益事業               |
| EVERGY INC                   | 16               | 14          | 92          | 10,405     | 公益事業               |
| NORTHWEST NATURAL HLDG CO    | 1                | 1           | 7           | 840        | 公益事業               |
| ONE GAS INC                  | 3                | 3           | 24          | 2,706      | 公益事業               |
| ESSENTIAL UTILITIES INC      | 18               | 18          | 85          | 9,549      | 公益事業               |
| EVERSOURCE ENERGY            | 27               | 25          | 211         | 23,644     | 公益事業               |
| AVANGRID INC                 | 2                | 2           | 14          | 1,630      | 公益事業               |
| SPIRE INC                    | 3                | 3           | 23          | 2,590      | 公益事業               |
| WEC ENERGY GRP INC           | 21               | 21          | 190         | 21,278     | 公益事業               |
| 小 計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 579<br>38銘柄 | 606<br>40銘柄 | 3,915<br>- | 438,262<br><32.4%> |
| (スペイン)                       | 百株               | 百株          | 千ユーロ        | 千円         |                    |
| ENAGAS SA                    | 63               | 56          | 108         | 14,032     | 公益事業               |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 114              | 104         | 180         | 23,471     | 公益事業               |
| AENA SME SA                  | 19               | 18          | 271         | 35,288     | 運輸                 |

| 銘柄                            |                  | 前期末           | 当 期 末         |            | 業 種 等              |          |
|-------------------------------|------------------|---------------|---------------|------------|--------------------|----------|
|                               |                  | 株 数           | 株 数           | 評 価 額      |                    |          |
|                               |                  |               | 外貨建金額         | 邦貨換算金額     |                    |          |
| (スペイン)                        |                  | 百株            | 百株            | 千ユーロ       | 千円                 |          |
| CELLNEX TELECOM SA            |                  | 55            | 54            | 291        | 37,876             | 電気通信サービス |
| 小 計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 252<br>4銘柄    | 234<br>4銘柄    | 852<br>-   | 110,669<br><8.2%>  |          |
| (イタリア)                        |                  | 百株            | 百株            | 千ユーロ       | 千円                 |          |
| ASTM SPA                      |                  | 16            | -             | -          | -                  | 運輸       |
| ACEA SPA                      |                  | 10            | 10            | 20         | 2,637              | 公益事業     |
| SNAM SPA                      |                  | 494           | 459           | 219        | 28,532             | 公益事業     |
| TERNA SPA                     |                  | 375           | 350           | 217        | 28,254             | 公益事業     |
| ENAV SPA                      |                  | 61            | 61            | 24         | 3,211              | 運輸       |
| ITALGAS SPA                   |                  | 129           | 129           | 71         | 9,340              | 公益事業     |
| 小 計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,087<br>6銘柄  | 1,011<br>5銘柄  | 554<br>-   | 71,975<br><5.3%>   |          |
| (フランス)                        |                  | 百株            | 百株            | 千ユーロ       | 千円                 |          |
| ADP                           |                  | 9             | 8             | 93         | 12,114             | 運輸       |
| VINCI SA                      |                  | 36            | 34            | 315        | 40,940             | 資本財      |
| GETLINK SE                    |                  | 112           | 103           | 141        | 18,378             | 運輸       |
| 小 計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 158<br>3銘柄    | 146<br>3銘柄    | 550<br>-   | 71,433<br><5.3%>   |          |
| (オランダ)                        |                  | 百株            | 百株            | 千ユーロ       | 千円                 |          |
| VOPAK                         |                  | 17            | 17            | 60         | 7,831              | エネルギー    |
| 小 計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 17<br>1銘柄     | 17<br>1銘柄     | 60<br>-    | 7,831<br><0.6%>    |          |
| (ドイツ)                         |                  | 百株            | 百株            | 千ユーロ       | 千円                 |          |
| FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT  |                  | 8             | 8             | 54         | 7,119              | 運輸       |
| 小 計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 8<br>1銘柄      | 8<br>1銘柄      | 54<br>-    | 7,119<br><0.5%>    |          |
| (ポルトガル)                       |                  | 百株            | 百株            | 千ユーロ       | 千円                 |          |
| REDES ENERGETICAS NACIONAIS   |                  | 93            | 93            | 23         | 3,086              | 公益事業     |
| 小 計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 93<br>1銘柄     | 93<br>1銘柄     | 23<br>-    | 3,086<br><0.2%>    |          |
| ユーロ計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,618<br>16銘柄 | 1,511<br>15銘柄 | 2,095<br>- | 272,116<br><20.1%> |          |
| (カナダ)                         |                  | 百株            | 百株            | 千カナダドル     | 千円                 |          |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A      |                  | 27            | 27            | 93         | 8,200              | 公益事業     |
| FORTIS INC                    |                  | 84            | 81            | 456        | 40,056             | 公益事業     |
| ENBRIDGE INC                  |                  | 109           | 91            | 466        | 40,954             | エネルギー    |
| EMERA INC                     |                  | 55            | 55            | 317        | 27,891             | 公益事業     |
| ALGONQUIN POWER AND UTILITIES |                  | 132           | 127           | 239        | 21,021             | 公益事業     |
| TC ENERGY CORP                |                  | 71            | 76            | 471        | 41,415             | エネルギー    |
| HYDRO ONE LTD                 |                  | 83            | 76            | 232        | 20,372             | 公益事業     |
| 小 計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 564<br>7銘柄    | 536<br>7銘柄    | 2,276<br>- | 199,913<br><14.8%> |          |
| (オーストラリア)                     |                  | 百株            | 百株            | 千オーストラリアドル | 千円                 |          |
| TRANSURBAN GRP                |                  | 339           | 361           | 495        | 39,899             | 運輸       |
| APA GRP                       |                  | 313           | 287           | 246        | 19,828             | 公益事業     |

アンカーMFG世界モノポリー戦略株式マザーファンド

| 銘 柄                          | 前期末              | 当 期 末         |                | 業 種 等                 |
|------------------------------|------------------|---------------|----------------|-----------------------|
|                              | 株 数              | 株 数           | 評 価 額          |                       |
|                              |                  |               | 外貨建金額 邦貨換算金額   |                       |
| (オーストラリア)                    | 百株               | 百株            | オーストラリアドル 千円   |                       |
| SPARK INFRASTRUCTURE GRP     | 413              | 413           | 115 9,311      | 公益事業                  |
| SYDNEY AIRPORT               | 686              | 625           | 513 41,300     | 運輸                    |
| AUSNET SERVICES              | 440              | 440           | 112 9,077      | 公益事業                  |
| ATLAS ARTERIA                | 267              | 235           | 150 12,136     | 運輸                    |
| 小 計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 2,461<br>6銘柄  | 2,364<br>6銘柄   | 1,635<br>-            |
| (イギリス)                       | 百株               | 百株            | 千英ポンド 千円       |                       |
| PENNON GRP PLC               | 111              | 67            | 77 11,595      | 公益事業                  |
| SEVERN TRENT PLC             | 63               | 60            | 159 24,035     | 公益事業                  |
| UNITED UTILITIES GRP PLC     | 181              | 167           | 163 24,549     | 公益事業                  |
| NATIONAL GRID PLC            | 301              | 282           | 253 38,186     | 公益事業                  |
| 小 計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 657<br>4銘柄    | 578<br>4銘柄     | 653<br>-              |
| (メキシコ)                       | 百株               | 百株            | 千メキシコペソ 千円     |                       |
| GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B | 46               | 46            | 1,743 9,512    | 運輸                    |
| GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B | 83               | 83            | 1,997 10,898   | 運輸                    |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT | 80               | 80            | 966 5,270      | 運輸                    |
| INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N | 53               | -             | -              | 公益事業                  |
| 小 計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 264<br>4銘柄    | 210<br>3銘柄     | 4,707<br>-            |
| (香港)                         | 百株               | 百株            | 千香港ドル 千円       |                       |
| POWER ASSETS HLDG LTD        | 305              | 305           | 1,396 20,087   | 公益事業                  |
| 小 計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 305<br>1銘柄    | 305<br>1銘柄     | 1,396<br>-            |
| (ニュージーランド)                   | 百株               | 百株            | 千ニュージーランドドル 千円 |                       |
| VECTOR LTD                   | 67               | 67            | 27 2,107       | 公益事業                  |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | 306              | 282           | 216 16,691     | 運輸                    |
| 小 計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 374<br>2銘柄    | 349<br>2銘柄     | 244<br>-              |
| (スイス)                        | 百株               | 百株            | 千スイスフラン 千円     |                       |
| FLUGHAFEN ZURICH AG-REG      | 4                | 4             | 76 9,141       | 運輸                    |
| 小 計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 4<br>1銘柄      | 4<br>1銘柄       | 76<br>-               |
| (チリ)                         | 百株               | 百株            | 千チリペソ 千円       |                       |
| AGUAS ANDINAS SA-A           | 649              | 649           | 10,743 1,484   | 公益事業                  |
| 小 計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 649<br>1銘柄    | 649<br>1銘柄     | 10,743<br>-           |
| 合 計                          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 7,479<br>80銘柄 | 7,116<br>80銘柄  | 1,215,407<br>->89.9%< |

(2) 投資証券

| 銘 柄                     | 前期末              | 当 期 末     |              | 業 種 等          |
|-------------------------|------------------|-----------|--------------|----------------|
|                         | 口 数              | 口 数       | 評 価 額        |                |
|                         |                  |           | 外貨建金額 邦貨換算金額 |                |
| (アメリカ)                  | 千口               | 千口        | 千米ドル 千円      |                |
| AMERICAN TOWER CORP     | 0.959            | 0.876     | 236 26,472   | 不動産            |
| CROWN CASTLE INTL CORP  | 1                | 1         | 233 26,183   | 不動産            |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 0.762            | 0.74      | 246 27,561   | 不動産            |
| 小 計                     | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 3<br>3銘柄  | 2<br>3銘柄     | 716<br>->5.9%< |
| (イギリス)                  | 千口               | 千口        | 千英ポンド 千円     |                |
| INTL PUBLIC PARTNER     | 42               | 42        | 70 10,540    | その他            |
| HICL INFRASTRUCTURE PLC | 49               | 49        | 82 12,466    | その他            |
| 小 計                     | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 92<br>2銘柄 | 92<br>2銘柄    | 152<br>->1.7%< |
| 合 計                     | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 95<br>5銘柄 | 95<br>5銘柄    | -<br>->7.6%<   |

- (注1) 邦貨換算金額は期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。
- (注2) < >は純資産総額に対する各国別投資信託受益証券、投資証券評価額の比率。
- (注3) 単位未満は切捨て。
- (注4) 業種はG I C S分類（産業グループ）によるものです。なお、G I C Sに関する知的財産所有権はS & PおよびMSCI Inc.に帰属します。

## ■投資信託財産の構成

(2021年9月30日現在)

| 項 目          | 当 期 末     |       |
|--------------|-----------|-------|
|              | 評 価 額     | 比 率   |
|              | 千円        | %     |
| 株式           | 1,215,407 | 89.9  |
| 投資証券         | 103,224   | 7.6   |
| コール・ローン等、その他 | 33,418    | 2.5   |
| 投資信託財産総額     | 1,352,049 | 100.0 |

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、9月30日における邦貨換算レートは、1米ドル=111.92円、1カナダドル=87.81円、1スイスフラン=119.88円、1オーストラリアドル=80.46円、1英ポンド=150.43円、1メキシコペソ=5.45円、1香港ドル=14.38円、1ニュージーランドドル=76.95円、100チリペソ=13.81円、1ユーロ=129.86円です。

(注3) 当期末における外貨建資産(1,343,001千円)の投資信託財産総額(1,352,049千円)に対する比率は、99.3%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年9月30日現在)

| 項 目            | 当 期 末          |
|----------------|----------------|
| (A) 資産         | 1,352,049,630円 |
| コール・ローン等       | 30,478,034     |
| 株式(評価額)        | 1,215,407,255  |
| 投資証券(評価額)      | 103,224,378    |
| 未収配当金          | 2,939,963      |
| (B) 純資産総額(A)   | 1,352,049,630  |
| 元本             | 946,127,678    |
| 次期繰越損益金        | 405,921,952    |
| (C) 受益権総口数     | 946,127,678口   |
| 1万口当り基準価額(B/C) | 14,290円        |

\* 期首における元本額1,014,747,027円、当期中における追加設定元本額0円、同解約額68,619,349円

\* 当期末における当マザーファンドを対象とする投資信託元本額は、世界モノポリー戦略株式ファンド(適格機関投資家限定) 946,127,678円

\* 当期末の計算口数当りの純資産総額は14,290円です。

## ■損益の状況

当期(自2020年10月1日 至2021年9月30日)

| 項 目                  | 当 期          |
|----------------------|--------------|
| (A) 配当等収益            | 46,261,463円  |
| 受取配当金                | 46,261,463   |
| (B) 有価証券売買損益         | 195,651,335  |
| 売買益                  | 222,030,955  |
| 売買損                  | △ 26,379,620 |
| (C) 信託報酬等            | △ 509,672    |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | 241,403,126  |
| (E) 前期繰越損益金          | 189,478,340  |
| (F) 解約差損益金           | △ 24,959,514 |
| (G) 合計(D + E + F)    | 405,921,952  |
| 次期繰越損益金(G)           | 405,921,952  |

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 解約差損益金とは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

## 東京海上マネープールマザーファンド

## 運用報告書 第11期（決算日 2021年10月25日）

（計算期間 2020年10月27日～2021年10月25日）

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

## 東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。  
また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

## ○最近5期の運用実績

| 決 算 期            | 基 準    | 価 額   | 参 考    | 指 数   | 債 組 入 比 | 純 資 産 額 |
|------------------|--------|-------|--------|-------|---------|---------|
|                  |        | 騰 落 率 |        | 騰 落 率 |         |         |
|                  | 円      | %     |        | %     | %       | 百万円     |
| 7期(2017年10月25日)  | 10,033 | △0.0  | 100.32 | △0.0  | 115.3   | 36      |
| 8期(2018年10月25日)  | 10,033 | 0.0   | 100.26 | △0.1  | 57.6    | 125     |
| 9期(2019年10月25日)  | 10,032 | △0.0  | 100.20 | △0.1  | 82.4    | 37      |
| 10期(2020年10月26日) | 10,034 | 0.0   | 100.17 | △0.0  | 84.0    | 45      |
| 11期(2021年10月25日) | 10,035 | 0.0   | 100.14 | △0.0  | 68.6    | 36      |

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日       | 基 準    | 価 額   | 参 考    | 指 数   | 債 組 入 比 | 券 率  |
|-------------|--------|-------|--------|-------|---------|------|
|             |        | 騰 落 率 |        | 騰 落 率 |         |      |
| (期 首)       | 円      | %     |        | %     |         | %    |
| 2020年10月26日 | 10,034 | —     | 100.17 | —     |         | 84.0 |
| 10月末        | 10,034 | 0.0   | 100.17 | △0.0  |         | 83.6 |
| 11月末        | 10,032 | △0.0  | 100.16 | △0.0  |         | 84.8 |
| 12月末        | 10,033 | △0.0  | 100.16 | △0.0  |         | 84.9 |
| 2021年1月末    | 10,033 | △0.0  | 100.16 | △0.0  |         | 89.2 |
| 2月末         | 10,033 | △0.0  | 100.16 | △0.0  |         | 63.0 |
| 3月末         | 10,034 | 0.0   | 100.16 | △0.0  |         | 30.6 |
| 4月末         | 10,034 | 0.0   | 100.16 | △0.0  |         | 87.3 |
| 5月末         | 10,034 | 0.0   | 100.16 | △0.0  |         | 87.9 |
| 6月末         | 10,034 | 0.0   | 100.15 | △0.0  |         | 89.2 |
| 7月末         | 10,035 | 0.0   | 100.15 | △0.0  |         | 74.6 |
| 8月末         | 10,035 | 0.0   | 100.15 | △0.0  |         | 74.6 |
| 9月末         | 10,035 | 0.0   | 100.15 | △0.0  |         | 81.5 |
| (期 末)       |        |       |        |       |         |      |
| 2021年10月25日 | 10,035 | 0.0   | 100.14 | △0.0  |         | 68.6 |

（注）騰落率は期首比です。

参考指数は、無担保コール翌日物金利です。無担保コール翌日物金利は、設定日を100として指数化したものです。



## ○運用経過

(2020年10月27日～2021年10月25日)

## ■期中の基準価額等の推移

期 首：10,034円

期 末：10,035円

騰落率： 0.0%

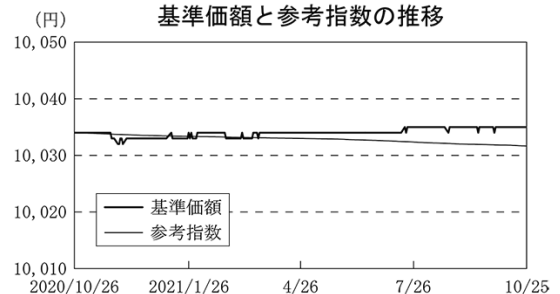
## ◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・安定した利息収入の獲得

マイナス要因

- ・保有する債券の評価損



(注) 参考指数は、期首(2020年10月26日)の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) 参考指数は、無担保コール翌日物金利です。

## ■投資環境

当期の短期金融市場金利は、日銀が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を維持したことで、マイナス圏で推移しました。金融緩和の度合いを測る上で着目する日銀の当座預金残高は、480兆円から540兆円程度へと拡大しており、短期金融市場の資金余剰感は非常に強い状況が継続しました。

このような状況下、無担保コール翌日物金利は-0.05%から-0.01%程度で推移しました。また、3カ月物の短期国債利回りは、-0.15%から-0.08%程度で推移しました。

## ■ポートフォリオについて

元本の安全性と流動性を重視して政府保証債や地方債を中心とする円建て公社債に投資し、安定的な収益の確保に努めました。その結果、基準価額はおおむね横ばいで推移しました。

## ○今後の運用方針

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

このような環境下、政府保証債や地方債を中心とする円建て公社債およびコマーシャル・ペーパーを主要投資対象として運用することにより、プラスの収益の確保もしくはマイナス幅を極力最小化するように努める方針です。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年10月27日～2021年10月25日)

該当事項はございません。

## ○ 売買及び取引の状況

(2020年10月27日～2021年10月25日)

## 公社債

|   |       | 買 付 額         | 売 付 額                    |
|---|-------|---------------|--------------------------|
| 国 | 地方債証券 | 千円<br>142,071 | 千円<br>4,002<br>(151,050) |
|   | 特殊債券  | 9,019         | —<br>( 9,000)            |

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれていません)

(注) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

## ○ 利害関係人との取引状況等

(2020年10月27日～2021年10月25日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ○組入資産の明細

(2021年10月25日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分   | 当 期      |          |         | 末                   |           |      |        |
|-------|----------|----------|---------|---------------------|-----------|------|--------|
|       | 額 面 金 額  | 評 価 額    | 組 入 比 率 | うちB B格以下<br>組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 |      |        |
|       | 千円       | 千円       | %       | %                   | 5年以上      | 2年以上 | 2年未満   |
| 地方債証券 | 25,000   | 25,012   | 68.6    | —                   | —         | —    | 68.6   |
|       | (25,000) | (25,012) | (68.6)  | (—)                 | (—)       | (—)  | (68.6) |
| 合 計   | 25,000   | 25,012   | 68.6    | —                   | —         | —    | 68.6   |
|       | (25,000) | (25,012) | (68.6)  | (—)                 | (—)       | (—)  | (68.6) |

(注) ( )内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

## (B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘 柄                | 当 期   |         |        | 末          |  |
|--------------------|-------|---------|--------|------------|--|
|                    | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額  | 償 還 年 月 日  |  |
| 地方債証券              | %     | 千円      | 千円     |            |  |
| 第354回大阪府公募公債 (10年) | 1.03  | 10,000  | 10,000 | 2021/10/28 |  |
| 平成23年度第1回大分県公募公債   | 1.0   | 3,000   | 3,000  | 2021/10/29 |  |
| 平成23年度第2回島根県公募公債   | 1.03  | 5,000   | 5,004  | 2021/11/25 |  |
| 平成23年度第1回三重県公募公債   | 1.021 | 7,000   | 7,006  | 2021/11/30 |  |
| 合 計                |       | 25,000  | 25,012 |            |  |

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

## ○投資信託財産の構成

(2021年10月25日現在)

| 項 目          | 当 期    |       | 末      |       |
|--------------|--------|-------|--------|-------|
|              | 評 価 額  | 比 率   | 評 価 額  | 比 率   |
| 公社債          | 千円     | %     | 千円     | %     |
|              | 25,012 | 60.4  | 25,012 | 60.4  |
| コール・ローン等、その他 | 16,431 | 39.6  | 16,431 | 39.6  |
| 投資信託財産総額     | 41,443 | 100.0 | 41,443 | 100.0 |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年10月25日現在)

| 項 目             | 当 期 末       |
|-----------------|-------------|
|                 | 円           |
| (A) 資産          | 41,443,386  |
| コール・ローン等        | 16,336,934  |
| 公社債(評価額)        | 25,012,330  |
| 未収利息            | 46,644      |
| 前払費用            | 47,478      |
| (B) 負債          | 5,004,025   |
| 未払金             | 5,004,000   |
| 未払利息            | 25          |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 36,439,361  |
| 元本              | 36,313,840  |
| 次期繰越損益金         | 125,521     |
| (D) 受益権総口数      | 36,313,840口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D) | 10,035円     |

(注) 当親ファンドの期首元本額は45,463,273円、期中追加設定元本額は4,555,408円、期中一部解約元本額は13,704,841円です。

<元本の内訳>

東京海上J-REIT投信(通貨選択型) マネープール・ファンド(年2回決算型) 25,277,948円  
 東京海上J-REIT投信(通貨選択型) ブラジルリアルコース(毎月分配型) 2,999,301円  
 東京海上J-REIT投信(通貨選択型) 円コース(毎月分配型) 1,000,000円  
 東京海上J-REIT投信(通貨選択型) インドネシアルピアコース(毎月分配型) 1,000,000円  
 東京海上J-REIT投信(通貨選択型) インドネシアルピアコース(年2回決算型) 1,000,000円  
 東京海上J-REIT投信(通貨選択型) 豪ドルコース(年2回決算型) 1,000,000円  
 東京海上J-REIT投信(通貨選択型) 円コース(年2回決算型) 1,000,000円  
 東京海上J-REIT投信(通貨選択型) 豪ドルコース(毎月分配型) 1,000,000円  
 東京海上J-REIT投信(通貨選択型) ブラジルリアルコース(年2回決算型) 1,000,000円  
 東京海上・世界モノポリー戦略株式ファンド(毎月決算型) 996,711円  
 東京海上J-REIT投信(通貨選択型) 米ドルコース(毎月分配型) 9,970円  
 東京海上J-REIT投信(通貨選択型) メキシコペソコース(毎月分配型) 9,970円  
 東京海上J-REIT投信(通貨選択型) 米ドルコース(年2回決算型) 9,970円  
 東京海上J-REIT投信(通貨選択型) メキシコペソコース(年2回決算型) 9,970円

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

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

## ○損益の状況 (2020年10月27日～2021年10月25日)

| 項 目            | 当 期      |
|----------------|----------|
|                | 円        |
| (A) 配当等収益      | 354,232  |
| 受取利息           | 358,065  |
| 支払利息           | △ 3,833  |
| (B) 有価証券売買損益   | △351,040 |
| 売買益            | 456      |
| 売買損            | △351,496 |
| (C) 当期損益金(A+B) | 3,192    |
| (D) 前期繰越損益金    | 153,065  |
| (E) 追加信託差損益金   | 15,943   |
| (F) 解約差損益金     | △ 46,679 |
| (G) 計(C+D+E+F) | 125,521  |
| 次期繰越損益金(G)     | 125,521  |

(注) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (E)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) (F)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。