

# 東京海上・再生可能 エネルギー・インカム戦略 ファンド（毎月決算型） ＜愛称 グリーンパワーシフト＞

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／株式 (課税上は株式投資信託として取扱われます。)	
信託期間	2021年6月15日から2030年11月15日	
運用方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。	
主要投資対象	東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略ファンド(毎月決算型)	「東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド」を主要投資対象とします。
	東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド	日本を含む世界の取引所に上場されている株式(これに準ずるものを含みます。)を主要投資対象とします。
投資制限	東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略ファンド(毎月決算型)	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
	東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
分配方針	<p>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。</p> <p>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。</p>	

## 運用報告書（全体版）

第6期	(決算日	2021年12月15日)
第7期	(決算日	2022年1月17日)
第8期	(決算日	2022年2月15日)
第9期	(決算日	2022年3月15日)
第10期	(決算日	2022年4月15日)
第11期	(決算日	2022年5月16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・再生可能エネルギー・インカム戦略ファンド（毎月決算型）＜愛称 グリーンパワーシフト＞」は、このたび、第11期の決算を行いましたので、第6期～第11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 (分配落)	準 価 額			株 式 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 分 配	込 金 騰 落	期 中 騰 落 率			
(設定日)	円		円	%	%	%	百万円
2021年6月15日	10,000		—	—	—	—	250
1期(2021年7月15日)	9,978		0	△0.2	79.2	15.4	658
2期(2021年8月16日)	10,116		0	1.4	79.3	15.9	818
3期(2021年9月15日)	10,149		20	0.5	81.3	15.2	940
4期(2021年10月15日)	10,374		20	2.4	80.3	15.3	981
5期(2021年11月15日)	10,610		20	2.5	81.5	15.0	1,055
6期(2021年12月15日)	9,965		20	△5.9	80.5	15.4	1,134
7期(2022年1月17日)	9,720		20	△2.3	80.5	16.1	1,190
8期(2022年2月15日)	9,401		20	△3.1	80.5	15.8	1,150
9期(2022年3月15日)	10,190		20	8.6	81.3	15.4	1,220
10期(2022年4月15日)	11,029		70	8.9	81.5	14.7	1,259
11期(2022年5月16日)	10,195		70	△6.9	80.8	15.7	1,306

(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、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」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		株 式 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		
第6期	(期首) 2021年11月15日	円	%	%	%
	11月末	10,610	—	81.5	15.0
	(期末) 2021年12月15日	10,263	△3.3	80.6	15.3
第7期	(期首) 2021年12月15日	9,985	△5.9	80.5	15.4
	12月末	9,965	—	80.5	15.4
	(期末) 2022年1月17日	10,280	3.2	80.2	15.3
第8期	(期首) 2022年1月17日	9,740	△2.3	80.5	16.1
	1月末	9,720	—	80.5	16.1
	(期末) 2022年2月15日	9,300	△4.3	80.8	16.0
第9期	(期首) 2022年2月15日	9,421	△3.1	80.5	15.8
	2月末	9,401	—	80.5	15.8
	(期末) 2022年3月15日	9,750	3.7	81.1	15.8
第10期	(期首) 2022年3月15日	10,210	8.6	81.3	15.4
	3月末	10,190	—	81.3	15.4
	(期末) 2022年4月15日	11,116	9.1	81.6	14.4
第11期	(期首) 2022年4月15日	11,099	8.9	81.5	14.7
	4月末	11,029	—	81.5	14.7
	(期末) 2022年5月16日	10,699	△3.0	80.7	14.5
		10,265	△6.9	80.8	15.7

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

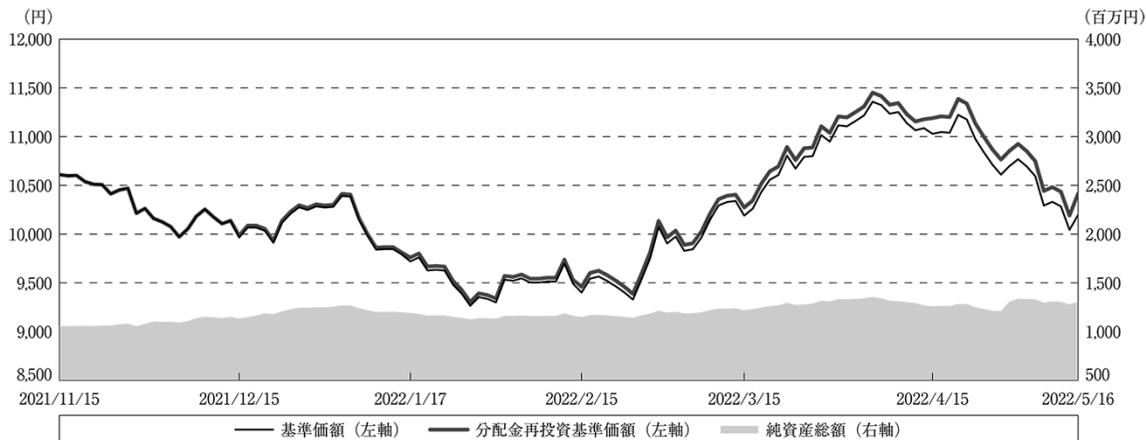
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

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

## ○運用経過

(2021年11月16日～2022年5月16日)

## ■作成期間中の基準価額等の推移



第6期首：10,610円

第11期末：10,195円 (既払分配金(税込み)：220円)

騰落率：△ 1.8% (分配金再投資ベース)

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

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

(注) 分配金再投資基準価額は、作成期首(2021年11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

- ・保有する再生可能エネルギー発電関連企業からの配当収入
- ・新型コロナウイルスワクチン接種の進展などを背景に経済活動正常化への期待が高まったこと
- ・円安米ドル高が進行したこと

## マイナス要因

- ・ロシアのウクライナ侵攻に伴う地政学的リスクの高まり
- ・コモディティ価格の上昇によるインフレの高進と欧米中央銀行による積極的な金融引き締め政策への懸念

## ■投資環境

### 【世界株式市場】

当作成期、世界の株式市場は下落しました。新型コロナウイルスワクチン接種の進展などを背景に経済活動正常化への期待は続きましたが、2022年の初めにかけて原油などコモディティ価格の上昇などによるインフレの高進から、欧米中央銀行の金融引き締め姿勢に対する懸念が高まり、株式市場は上値の重い展開となりました。その後も、ロシアのウクライナ侵攻に伴う地政学的リスクの高まりとそれに伴うインフレが加速するなか、欧米中央銀行による金融引き締め姿勢が一段と強まるとの観測から景気減速への懸念が高まり、株式市場は下落基調が継続しました。

### 【為替市場】

当作成期の米ドル円為替レートは円安米ドル高となりました。作成期前半、米ドル円為替レートはおおむね横ばいで推移しました。作成期後半は、米国で高まるインフレ懸念を背景にFRB（米連邦準備制度理事会）が利上げを実施した一方、日銀が金融緩和政策を維持し両国の金利差の拡大を背景に、円安米ドル高基調が大きく進行しました。

当作成期のユーロ円為替レートは円安ユーロ高となりました。作成期前半、ユーロ円為替レートはおおむねレンジ内での推移となりました。作成期後半は、ロシアによるウクライナ侵攻を受けてユーロを嫌気する動きから円高ユーロ安となる局面があったものの、その後はECB（欧州中央銀行）による金融緩和政策の修正を受けて日欧の金融政策の違いを背景とした金利差の拡大から円安ユーロ高となりました。

## ■ポートフォリオについて

### <東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略ファンド（毎月決算型）>

「東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持しました。当ファンドの基準価額（税引前分配金再投資）は、マザーファンドの値動きを反映し、1.8%下落しました。

### <東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド>

再生可能エネルギー分野で、今後成長することが期待される企業をグローバルに調査し、厳選した上で投資しました。

当作成期、株式市場全体の大幅な下落が再生可能エネルギー発電関連企業にとっても逆風となりました。ESG投資に注目が集まるなか、再生可能エネルギー分野に長期投資の資金が流入するという流れに変化はないものの、足元では世界的な金利上昇への懸念から、世界の株式市場は不安定な相場環境となりました。一方、主要通貨に対して円安が進行したことから、基準価額は0.9%の下落にとどまりました。

## ■当ファンドのベンチマークとの差異

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6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期
	2021年11月16日～ 2021年12月15日	2021年12月16日～ 2022年1月17日	2022年1月18日～ 2022年2月15日	2022年2月16日～ 2022年3月15日	2022年3月16日～ 2022年4月15日	2022年4月16日～ 2022年5月16日
当期分配金 (対基準価額比率)	20 0.200%	20 0.205%	20 0.212%	20 0.196%	70 0.631%	70 0.682%
当期の収益	11	0	4	20	19	13
当期の収益以外	8	19	15	—	50	56
翌期繰越分配対象額	563	545	529	536	1,076	1,021

(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・再生可能エネルギー・インカム戦略ファンド(毎月決算型)＞

「東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持します。

### ＜東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド＞

ESGへの意識が世界的に高まるなか、環境に優しい再生可能エネルギーは成長分野として期待されています。再生可能エネルギーは、風力発電、太陽光発電、バイオマス発電など様々な形態がありますが、地球温暖化対策として二酸化炭素排出削減を目的に、再生可能エネルギーへのシフトは進んでいくとみています。また、電力などのエネルギーは安定的な需要があることから、安定した業績を反映して配当も安定している企業が多いことが一般的な特徴です。

欧米中央銀行による金融引き締め政策やロシアによるウクライナ侵攻、新型コロナウイルス関連のニュースなどが投資家心理を左右し、株式市場のリスク要因となる可能性はありますが、安定した経営基盤のある再生可能エネルギー発電関連企業の株価は長期的には上昇していくとみています。

引き続き、再生可能エネルギー発電関連企業の株式等に投資を行い、配当収益と中長期的な値上がり益の獲得をめざします。

## ○ 1万口当たりの費用明細

(2021年11月16日～2022年5月16日)

項 目	第6期～第11期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	91	0.891	(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 ）	( 51)	(0.494)	*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 ）	( 39)	(0.384)	*購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
（ 受 託 会 社 ）	( 1)	(0.014)	*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) 売 買 委 託 手 数 料	4	0.043	(b)売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数
（ 株 式 ）	( 4)	(0.035)	*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
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 1)	(0.008)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	3	0.028	(c)有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数
（ 株 式 ）	( 2)	(0.021)	*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
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 1)	(0.007)	
(d) そ の 他 費 用	7	0.064	(d)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
（ 保 管 費 用 ）	( 6)	(0.058)	*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及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	( 1)	(0.005)	*監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	105	1.026	
作成期間の平均基準価額は、10,234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。

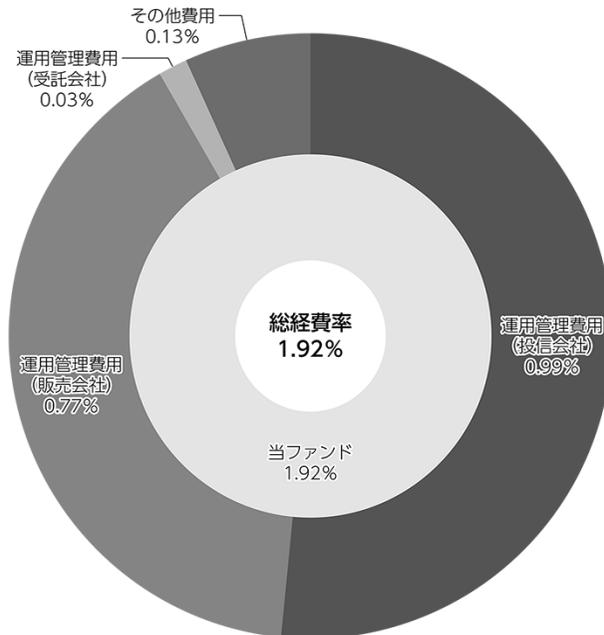
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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1.92%です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(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11月16日～2022年5月16日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第6期～第11期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド	千口 475,423	千円 505,747	千口 230,695	千円 250,804

## ○株式売買比率

(2021年11月16日～2022年5月16日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第6期～第11期	
	東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド	
(a) 当作成期中の株式売買金額	569,771千円	
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	1,360,268千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.41	

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年11月16日～2022年5月16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5月16日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	第5期末		第11期末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド	千口 981,789	千円 1,226,517	千口 1,226,517	千円 1,306,241

## ○投資信託財産の構成

(2022年5月16日現在)

項 目	第11期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド	1,306,241	99.2
コール・ローン等、その他	10,937	0.8
投資信託財産総額	1,317,178	100.0

(注) 東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産(1,661,565千円)の投資信託財産総額(1,819,703千円)に対する比率は91.3%です。

(注) 外貨建資産は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当作成期末における邦貨換算レートは1米ドル=129.65円、1カナダドル=100.43円、1ユーロ=134.95円、1英ポンド=159.07円、1デンマーククローネ=18.14円、1豪ドル=90.03円、1ニュージーランドドル=81.54円、1香港ドル=16.52円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第6期末	第7期末	第8期末	第9期末	第10期末	第11期末
	2021年12月15日現在	2022年1月17日現在	2022年2月15日現在	2022年3月15日現在	2022年4月15日現在	2022年5月16日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	1,138,013,700	1,195,014,883	1,154,938,670	1,224,441,779	1,305,054,545	1,317,178,396
東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド(附)	1,134,122,414	1,190,584,380	1,150,348,094	1,220,408,428	1,259,169,396	1,306,241,446
未収入金	3,891,286	4,430,503	4,590,576	4,033,351	45,885,149	10,936,950
(B) 負債	3,891,286	4,430,503	4,590,576	4,033,351	45,885,149	10,936,950
未払収益分配金	2,276,125	2,449,830	2,447,227	2,395,252	7,991,866	8,968,502
未払解約金	—	—	485,154	—	35,914,471	—
未払信託報酬	1,605,297	1,968,574	1,648,068	1,628,093	1,966,724	1,956,425
その他未払費用	9,864	12,099	10,127	10,006	12,088	12,023
(C) 純資産総額(A-B)	1,134,122,414	1,190,584,380	1,150,348,094	1,220,408,428	1,259,169,396	1,306,241,446
元本	1,138,062,808	1,224,915,075	1,223,613,542	1,197,626,029	1,141,695,196	1,281,214,639
次期繰越損益金	△ 3,940,394	△ 34,330,695	△ 73,265,448	22,782,399	117,474,200	25,026,807
(D) 受益権総口数	1,138,062,808口	1,224,915,075口	1,223,613,542口	1,197,626,029口	1,141,695,196口	1,281,214,639口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,965円	9,720円	9,401円	10,190円	11,029円	10,195円

(注) 当ファンドの第6期首元本額は994,849,297円、第6～11期中追加設定元本額は486,933,895円、第6～11期中一部解約元本額は200,568,553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6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期
	2021年11月16日～ 2021年12月15日	2021年12月16日～ 2022年1月17日	2022年1月18日～ 2022年2月15日	2022年2月16日～ 2022年3月15日	2022年3月16日～ 2022年4月15日	2022年4月16日～ 2022年5月16日
	円	円	円	円	円	円
(A) 有価証券売買損益	△64,205,716	△26,796,213	△34,561,517	98,305,285	102,554,792	△89,158,763
売買益	260,884	36,997	3,570	99,694,117	111,181,529	384,349
売買損	△64,466,600	△26,833,210	△34,565,087	△1,388,832	△8,626,737	△89,543,112
(B) 信託報酬等	△1,615,161	△1,980,673	△1,658,195	△1,638,099	△1,978,812	△1,968,448
(C) 当期損益金(A+B)	△65,820,877	△28,776,886	△36,219,712	96,667,186	100,575,980	△91,127,211
(D) 前期繰越損益金	49,627,995	△18,392,861	△48,879,833	△85,018,145	8,487,393	103,791,531
(E) 追加信託差損益金	14,528,613	15,288,882	14,281,324	13,528,610	16,402,693	21,330,989
(配当等相当額)	(15,274,744)	(20,560,502)	(21,278,940)	(21,173,481)	(21,751,941)	(34,093,021)
(売買損益相当額)	(△746,131)	(△5,271,620)	(△6,997,616)	(△7,644,871)	(△5,349,248)	(△12,762,032)
(F) 計(C+D+E)	△1,664,269	△31,880,865	△70,818,221	25,177,651	125,466,066	33,995,309
(G) 収益分配金	△2,276,125	△2,449,830	△2,447,227	△2,395,252	△7,991,866	△8,968,502
次期繰越損益金(F+G)	△3,940,394	△34,330,695	△73,265,448	22,782,399	117,474,200	25,026,807
追加信託差損益金	14,528,613	15,288,882	14,281,324	13,528,610	10,694,217	21,330,989
(配当等相当額)	(15,463,987)	(20,662,413)	(21,293,149)	(21,185,407)	(16,089,651)	(34,303,341)
(売買損益相当額)	(△935,374)	(△5,373,531)	(△7,011,825)	(△7,656,797)	(△5,395,434)	(△12,972,352)
分配準備積立金	48,687,600	46,115,343	43,501,887	43,077,913	106,779,983	96,584,814
繰越損益金	△67,156,607	△95,734,920	△131,048,659	△33,824,124	-	△92,888,996

(注) (A) 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) (B) 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) (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) 信託財産の運用指図に係る権限の全部または一部を委託するために要した費用として、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して年1万分の60の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しています。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期
	2021年11月16日～ 2021年12月15日	2021年12月16日～ 2022年1月17日	2022年1月18日～ 2022年2月15日	2022年2月16日～ 2022年3月15日	2022年3月16日～ 2022年4月15日	2022年4月16日～ 2022年5月16日
a. 配当等収益(費用控除後)	1,335,730円	78,312円	521,275円	3,227,749円	2,210,652円	1,761,785円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円	0円	0円	0円	67,342,510円	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	15,463,987円	20,662,413円	21,293,149円	21,185,407円	21,798,127円	34,303,341円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	49,627,995円	48,486,861円	45,427,839円	42,245,416円	39,510,211円	103,791,531円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	66,427,712円	69,227,586円	67,242,263円	66,658,572円	130,861,500円	139,856,657円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	583円	565円	549円	556円	1,146円	1,091円
g. 分配金	2,276,125円	2,449,830円	2,447,227円	2,395,252円	7,991,866円	8,968,502円
h. 分配金(1万円当たり)	20円	20円	20円	20円	70円	70円

## ○分配金のお知らせ

	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期
1万円当たり分配金(税込み)	20円	20円	20円	20円	70円	70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5月16日現在)

## ＜東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド＞

下記は、東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド全体(1,693,413千口)の内容です。

## 外国株式

銘柄	株数	第5期末		第11期末		業種等
		株数	金額	株数	評価額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
AVISTA CORP	62	73	316	41,032		公益事業
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	110	142	494	64,083		公益事業
CLEARWAY ENERGY INC-A	148	187	549	71,261		公益事業
ENPHASE ENERGY INC	13	20	325	42,183		半導体・半導体製造装置
IDACORP INC	27	37	405	52,516		公益事業
NEXTERA ENERGY INC	59	84	592	76,794		公益事業
SUNRUN INC	50	86	181	23,566		資本財
ATLANTICA SUSTAINABLE INFRAS	117	168	515	66,848		公益事業
小計	株数・金額	590	801	3,380	438,287	
	銘柄数<比率>	8	8	—	<24.3%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	153	256	466	46,834		公益事業
BORALEX INC -A	80	113	437	43,962		公益事業
INNERGEX RENEWABLE ENERGY	124	146	249	25,091		公益事業
NORTHLAND POWER INC	112	150	578	58,053		公益事業
TRANSALTA RENEWABLES INC	272	360	630	63,364		公益事業
小計	株数・金額	743	1,027	2,362	237,306	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<13.2%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
ENCAVIS AG	121	176	333	45,003		公益事業
小計	株数・金額	121	176	333	45,003	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<2.5%>	
(ユーロ…イタリア)						
ERG SPA	60	72	227	30,671		公益事業
ACEA SpA	107	136	214	28,946		公益事業
ENEL SPA	409	483	286	38,705		公益事業
小計	株数・金額	577	691	728	98,322	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<5.5%>	
(ユーロ…フランス)						
ALBIOMA SA	44	61	305	41,292		公益事業
小計	株数・金額	44	61	305	41,292	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<2.3%>	
(ユーロ…スペイン)						
EDP Renovaveis SA	125	204	417	56,292		公益事業
小計	株数・金額	125	204	417	56,292	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<3.1%>	
(ユーロ…オーストリア)						
VERBUND AG	37	53	436	58,943		公益事業
小計	株数・金額	37	53	436	58,943	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<3.3%>	

銘柄	株数	金額	第5期末		第11期末		業種等
			株数	金額	評価額	比率	
(ユーロ圏)ポルトガル	百株	百株	千ユーロ	千円			
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	458	540	235	31,826	公益事業		
小計	株数・金額	458	540	235	31,826		
	銘柄数<比率>	1	1	—	<1.8%>		
ユーロ計	株数・金額	1,365	1,728	2,457	331,681		
	銘柄数<比率>	8	8	—	<18.4%>		
(イギリス)			千英ポンド				
SEVERN TRENT PLC	66	114	353	56,281	公益事業		
Drax Group PLC	591	583	437	69,534	公益事業		
小計	株数・金額	658	698	790	125,815		
	銘柄数<比率>	2	2	—	<7.0%>		
(デンマーク)			千デンマーククローネ				
ORSTED A/S	22	28	1,995	36,207	公益事業		
小計	株数・金額	22	28	1,995	36,207		
	銘柄数<比率>	1	1	—	<2.0%>		
(オーストラリア)			千豪ドル				
NEW ENERGY SOLAR LTD-NEW	4,801	6,286	465	41,879	公益事業		
小計	株数・金額	4,801	6,286	465	41,879		
	銘柄数<比率>	1	1	—	<2.3%>		
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル				
CONTACT ENERGY LTD	636	750	555	45,293	公益事業		
MERCURY NZ LTD	731	862	487	39,719	公益事業		
MERIDIAN ENERGY LTD	1,152	1,358	607	49,516	公益事業		
小計	株数・金額	2,520	2,971	1,649	134,529		
	銘柄数<比率>	3	3	—	<7.5%>		
(香港)			千香港ドル				
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,330	1,560	2,396	39,584	公益事業		
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	988	1,460	1,661	27,447	資本財		
XINYI ENERGY HOLDINGS LTD	5,660	6,660	2,717	44,889	公益事業		
小計	株数・金額	7,978	9,680	6,774	111,921		
	銘柄数<比率>	3	3	—	<6.2%>		
合計	株数・金額	18,680	23,222	—	1,457,628		
	銘柄数<比率>	31	31	—	<80.8%>		

(注) 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で邦貨換算したものです。

(注) 小計、合計欄の<>内は、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各国別株式評価額の比率です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

## 国内投資信託証券

銘柄	口数	金額	第5期末		第11期末	
			口数	金額	評価額	比率
タカラレーベン・インフラ投資法人	284	441	49,303	千円	%	
カナディアン・ソーラー・インフラ投資法人	321	439	54,611			2.7
合計	口数・金額	605	880	103,915		3.0
	銘柄数<比率>	2	2	<5.8%>		

(注) 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。

## 外国投資信託証券

銘 柄	第5期末		第11期末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%	
HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE	6,785	10,282	385	50,029	2.8	
小 計	口 数 ・ 金 額	6,785	10,282	385	50,029	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 2.8% >	
(イギリス)			千英ポンド			
GREENCOAT UK WIND PLC	205,876	265,273	411	65,405	3.6	
RENEWABLES INFRASTRUCTURE GR	211,505	307,337	403	64,141	3.6	
小 計	口 数 ・ 金 額	417,381	572,610	814	129,546	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 7.2% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	424,166	582,892	—	179,576	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 10.0% >	

(注) 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で邦貨換算したものです。

(注) 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) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

## 東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド

## 運用報告書 第1期（決算日 2021年11月15日）

（計算期間 2021年6月15日～2021年11月15日）

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

## 東京海上アセットマネジメント

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

また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

## ○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率		株 組 入 比 式 率	投 資 信 託 券 率	純 資 産 額
		騰 落	中 率			
(設定日)	円		%	%	%	百万円
2021年6月15日	10,000		—	—	—	500
1期(2021年11月15日)	10,751		7.5	81.5	15.0	1,377

(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。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	期 騰 落 率		株 組 入 比 式 率	投 資 信 託 券 率
		騰 落	率		
(設定日)	円		%	%	%
2021年6月15日	10,000		—	—	—
6月末	10,084		0.8	79.8	16.5
7月末	10,198		2.0	78.9	15.4
8月末	10,294		2.9	80.2	15.2
9月末	10,062		0.6	80.5	15.2
10月末	10,946		9.5	80.4	15.0
(期 末)					
2021年11月15日	10,751		7.5	81.5	15.0

(注) 騰落率は設定日比です。

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。

## ○運用経過

(2021年6月15日～2021年11月15日)

## ■期中の基準価額等の推移

設定日：10,000円

期末：10,751円

騰落率：7.5%

## ◇基準価額の主な変動要因

## プラス要因

- ・保有する再生可能エネルギー発電関連企業からの配当収入
- ・新型コロナウイルスワクチン接種の進展などを背景に経済活動正常化への期待が高まり、再生可能エネルギー発電関連企業を含む株式市場が上昇したこと
- ・円安米ドル高が進行したこと

## マイナス要因

- ・中国大手不動産開発会社の経営不安に加えて、米国の量的緩和縮小に対する警戒感などから米国を中心に長期金利が上昇し、景気減速懸念から株式市場が下落したこと

## ■投資環境

## 【世界株式市場】

当期、世界の株式市場は上昇しました。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に経済活動正常化への期待が続くなか、期半ばにかけて上昇しました。その後は、中国大手不動産開発会社の経営不安に加えて、欧米中央銀行による金融緩和政策の見直しなどに対する警戒感などから世界的に長期金利が上昇し、景気減速への懸念から世界の株式市場は一時下落しましたが、長期金利の上昇に一服感が見られると、期末にかけて上昇に転じました。

## 【為替市場】

当期の米ドル円為替レートは円安米ドル高となりました。パウエルFRB（米連邦準備制度理事会）議長が議会証言で金融緩和を当面継続する姿勢を示したことなどから、円高米ドル安基調で推移していましたが、FRBによるテーパリング（量的緩和の縮小）の開始が意識されて米国債利回りが上昇したことなどから、期末にかけて円安米ドル高が進行しました。

ユーロ円為替レートは、欧州における新型コロナウイルスの感染再拡大に伴う景気後退懸念や、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和政策の修正が緩やかなものに止まるとの思惑から、小幅に円高ユーロ安となりました。

## ■ポートフォリオについて

再生可能エネルギー分野で、今後成長することが期待される企業をグローバルに調査し、厳選した上で投資しました。

当期、ポートフォリオに組み入れた再生可能エネルギー発電関連企業の株価は総じて堅調に推移しました。株式市場全体の上昇とともに、世界的なESG投資の流れの中で再生可能エネルギー発電関連企業にも注目が集まり、上昇しました。また、バイデン米政権による大型のインフラ投資法案の成立で、再生可能エネルギー分野にも長期投資の資金が流入するというニュースも、株価上昇の追い風となりました。

以上の運用の結果、基準価額は7.5%上昇しました。



## ○今後の運用方針

ESGへの意識が世界的に高まるなか、環境に優しい再生可能エネルギーは成長分野として期待されています。再生可能エネルギーは、風力発電、太陽光発電、バイオマス発電など様々な形態がありますが、地球温暖化対策として二酸化炭素排出削減を目的に、再生可能エネルギーへのシフトは進んでいくとみています。また、電力などのエネルギーは安定的な需要があることから、安定した業績を反映して配当も安定している企業が多いことが一般的特徴です。

欧米中央銀行による金融緩和政策の見直しや新型コロナウイルス関連のニュースなどが投資家心理を左右し、短期的には株式市場の下押し材料となる可能性はありますが、安定した経営基盤のある再生可能エネルギー発電関連企業の株価は長期的には上昇していくとみています。

引き続き、再生可能エネルギー発電関連企業の株式等に投資を行い、配当収益と中長期的な値上がり益の獲得をめざします。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年6月15日～2021年11月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	12	0.121	(a) 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 * 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)	(10)	(0.101)	
(投資信託証券)	(2)	(0.020)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	8	0.078	(b) 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 * 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
(株 式)	(6)	(0.059)	
(投資信託証券)	(2)	(0.019)	
(c) そ の 他 費 用	10	0.092	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 * 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 * その他は、信託事務等に要する諸費用
(保 管 費 用)	(9)	(0.092)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	30	0.291	
期中の平均基準価額は、10,316円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 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6月15日～2021年11月15日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ	百株 597	千米ドル 2,892	百株 7	千米ドル 101
	カナダ	743	千カナダドル 1,918	—	千カナダドル —
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	121	192	—	—
	イタリア	577	695	—	—
	フランス	44	155	—	—
	スペイン	125	256	—	—
	オーストリア	37	291	—	—
	ポルトガル	458	211	—	—
	イギリス	658	千英ポンド 434	—	千英ポンド —
国	デンマーク	22	千デンマーククローネ 1,972	—	千デンマーククローネ —
	オーストラリア	4,801	千豪ドル 414	—	千豪ドル —
	ニュージーランド	2,657	千ニュージーランドドル 1,685	136	千ニュージーランドドル 82
	香港	8,440	千香港ドル 6,114	462	千香港ドル 558

(注) 金額は受渡代金です。

## 投資信託証券

	銘 柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	タカラレーベン・インフラ投資法人	284	千円 34,744	—	千円 —
	カナディアン・ソーラー・インフラ投資法人	321	41,069	—	—
	合 計	605	75,814	—	—
外 国	アメリカ		千米ドル		千米ドル
	HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE	6,785	374	—	—
	小 計	6,785	374	—	—
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	GREENCOAT UK WIND PLC	205,876	270	—	—
	RENEWABLES INFRASTRUCTURE GR	211,505	273	—	—
	小 計	417,381	544	—	—

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

## ○株式売買比率

(2021年6月15日～2021年11月15日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	1,104,537千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	889,840千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.24

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年6月15日～2021年11月15日)

該当事項はございません。

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

## ○組入資産の明細

(2021年11月15日現在)

## 外国株式

銘 柄	株 数	当 期 末		業 種 等
		評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
AVISTA CORP	62	251	28,709	公益事業
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	110	441	50,359	公益事業
CLEARWAY ENERGY INC-A	148	517	59,019	公益事業
ENPHASE ENERGY INC	13	342	39,068	半導体・半導体製造装置
IDACORP INC	27	283	32,345	公益事業
NEXTERA ENERGY INC	59	511	58,337	公益事業
SUNRUN INC	50	296	33,783	資本財
ATLANTICA SUSTAINABLE INFRAS	117	478	54,604	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	590	3,124	356,229
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	-	<25.9%>
(カナダ)		千カナダドル		
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	153	274	24,907	公益事業
BORALEX INC -A	80	304	27,657	公益事業
INNERGEX RENEWABLE ENERGY	124	241	21,977	公益事業
NORTHLAND POWER INC	112	440	40,040	公益事業
TRANSALTA RENEWABLES INC	272	519	47,157	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	743	1,780	161,741
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	-	<11.7%>

銘柄	株数	期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ) ENCAVIS AG	百株 121	千ユーロ 214	千円 27,945	公益事業
小計	121	214	27,945	
	株数・金額 銘柄数<比率>	1	-	<2.0%>
(ユーロ…イタリア) ERG SPA ACEA SpA ENEL SPA	60 107 409	185 202 290	24,241 26,459 37,967	公益事業 公益事業 公益事業
小計	577	679	88,668	
	株数・金額 銘柄数<比率>	3	-	<6.4%>
(ユーロ…フランス) ALBIOMA SA	44	153	19,969	公益事業
小計	44	153	19,969	
	株数・金額 銘柄数<比率>	1	-	<1.4%>
(ユーロ…スペイン) EDP Renovaveis SA	125	285	37,299	公益事業
小計	125	285	37,299	
	株数・金額 銘柄数<比率>	1	-	<2.7%>
(ユーロ…オーストリア) VERBUND AG	37	322	42,145	公益事業
小計	37	322	42,145	
	株数・金額 銘柄数<比率>	1	-	<3.1%>
(ユーロ…ポルトガル) ENERGIAS DE PORTUGAL SA	458	217	28,438	公益事業
小計	458	217	28,438	
	株数・金額 銘柄数<比率>	1	-	<2.1%>
ユーロ計	1,365	1,873	244,468	
	株数・金額 銘柄数<比率>	8	-	<17.7%>
(イギリス) SEVERN TRENT PLC Drax Group PLC	66 591	千英ポンド 189 321	28,956 49,260	公益事業 公益事業
小計	658	511	78,216	
	株数・金額 銘柄数<比率>	2	-	<5.7%>
(デンマーク) ORSTED A/S	22	千デンマーククローネ 1,988	34,905	公益事業
小計	22	1,988	34,905	
	株数・金額 銘柄数<比率>	1	-	<2.5%>
(オーストラリア) NEW ENERGY SOLAR LTD-NEW	4,801	千豪ドル 398	33,305	公益事業
小計	4,801	398	33,305	
	株数・金額 銘柄数<比率>	1	-	<2.4%>
(ニュージーランド) CONTACT ENERGY LTD MERCURY NZ LTD MERIDIAN ENERGY LTD	636 731 1,152	千ニュージーランドドル 505 442 560	40,598 35,529 44,973	公益事業 公益事業 公益事業
小計	2,520	1,508	121,101	
	株数・金額 銘柄数<比率>	3	-	<8.8%>
(香港) CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	1,330 988	千香港ドル 2,186 1,790	31,988 26,191	公益事業 資本財

銘	柄	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)		百株	千香港ドル	千円	公益事業
XINYI ENERGY HOLDINGS LTD		5,660	2,411	35,275	
小 計	株 数 ・ 金 額	7,978	6,387	93,455	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	—	<6.8%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	18,680	—	1,123,423	
	銘 柄 数 < 比 率 >	31	—	<81.5%>	

(注) 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で邦貨換算したものです。

(注) 小計、合計欄の<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

## 国内投資信託証券

銘	柄	当 期 末		
		口 数	評 価 額	比 率
		口	千円	%
タカラレーベン・インフラ投資法人		284	32,773	2.4
カナディアン・ソーラー・インフラ投資法人		321	39,611	2.9
合 計	口 数 ・ 金 額	605	72,385	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	<5.3%>	

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

## 外国投資信託証券

銘	柄	当 期 末			比 率
		口 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		口	千米ドル	千円	%
HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE		6,785	434	49,565	3.6
小 計	口 数 ・ 金 額	6,785	434	49,565	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	—	<3.6%>	
(イギリス)			千英ポンド		
GREENCOAT UK WIND PLC		205,876	275	42,079	3.1
RENEWABLES INFRASTRUCTURE GR		211,505	280	42,842	3.1
小 計	口 数 ・ 金 額	417,381	555	84,922	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	—	<6.2%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	424,166	—	134,487	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	—	<9.8%>	

(注) 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で邦貨換算したものです。

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

## ○投資信託財産の構成

(2021年11月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	1,123,423	80.2
投資証券	206,872	14.8
コール・ローン等、その他	70,248	5.0
投資信託財産総額	1,400,543	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産(1,256,867千円)の投資信託財産総額(1,400,543千円)に対する比率は89.7%です。

(注) 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で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=114.00円、1カナダドル=90.84円、1ユーロ=130.50円、1英ポンド=152.99円、1デンマーククローネ=17.55円、1豪ドル=83.58円、1ニュージーランドドル=80.29円、1香港ドル=14.63円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年11月15日現在)

## ○損益の状況 (2021年6月15日～2021年11月15日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,436,832,877
コール・ローン等	68,672,162
株式(評価額)	1,123,423,035
投資証券(評価額)	206,872,379
未収入金	36,289,588
未収配当金	1,575,713
(B) 負債	58,946,580
未払金	53,186,551
未払解約金	5,759,971
未払利息	58
(C) 純資産総額(A-B)	1,377,886,297
元本	1,281,611,850
次期繰越損益金	96,274,447
(D) 受益権総口数	1,281,611,850口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,751円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	12,427,539
受取配当金	12,433,343
受取利息	560
支払利息	△ 6,364
(B) 有価証券売買損益	73,739,808
売買益	116,718,150
売買損	△ 42,978,342
(C) 保管費用等	△ 1,022,326
(D) 当期損益金(A+B+C)	85,145,021
(E) 追加信託差損益金	17,380,142
(F) 解約差損益金	△ 6,250,716
(G) 計(D+E+F)	96,274,447
次期繰越損益金(G)	96,274,447

(注) 当親ファンドの設定時元本額は500,000,000円、期中追加設定元本額は867,643,802円、期中一部解約元本額は86,031,952円です。

<元本の内訳>

東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略ファンド(毎月決算型) 981,789,993円

東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略ファンド(年1回決算型) 299,821,857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。

(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。