

東京海上・気候変動対応
株式ファンド
(為替ヘッジなし)
＜愛称 グリーンフューチャー＞

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10月4日から2031年8月8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・気候変動対応株式ファンド(為替ヘッジなし)	「東京海上・気候変動対応株式マザーファンド」を主要投資対象とします。
	東京海上・気候変動対応株式マザーファンド	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・気候変動対応株式ファンド(為替ヘッジなし)	・株式への実質投資割合には制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	東京海上・気候変動対応株式マザーファンド	・株式への投資割合には制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
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。	

第2期 運用報告書(全体版)
(決算日 2022年8月10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・気候変動対応株式ファンド(為替ヘッジなし)＜愛称 グリーンフューチャー＞」は、このたび、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 準 (分配落)	価 額			株 式 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比	純 資 産 総 額
		税 分 達 配	金 騰 落	中 率			
(設定日)	円	円		%	%	%	百万円
2021年10月4日	10,000	—	—	—	—	—	250
1期(2022年2月10日)	10,254	0		2.5	87.1	4.4	7,954
2期(2022年8月10日)	11,132	100		9.5	91.1	4.2	8,725

(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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		株 式 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比	託 券 率
		騰 落	率			
(期 首)	円		%	%		%
2022年2月10日	10,254	—	—	87.1		4.4
2月末	9,859	△3.9		86.0		4.7
3月末	10,926	6.6		88.3		4.9
4月末	10,803	5.4		88.3		5.2
5月末	10,850	5.8		87.6		5.0
6月末	10,350	0.9		87.3		4.8
7月末	11,028	7.5		89.5		4.7
(期 末)						
2022年8月10日	11,232	9.5		91.1		4.2

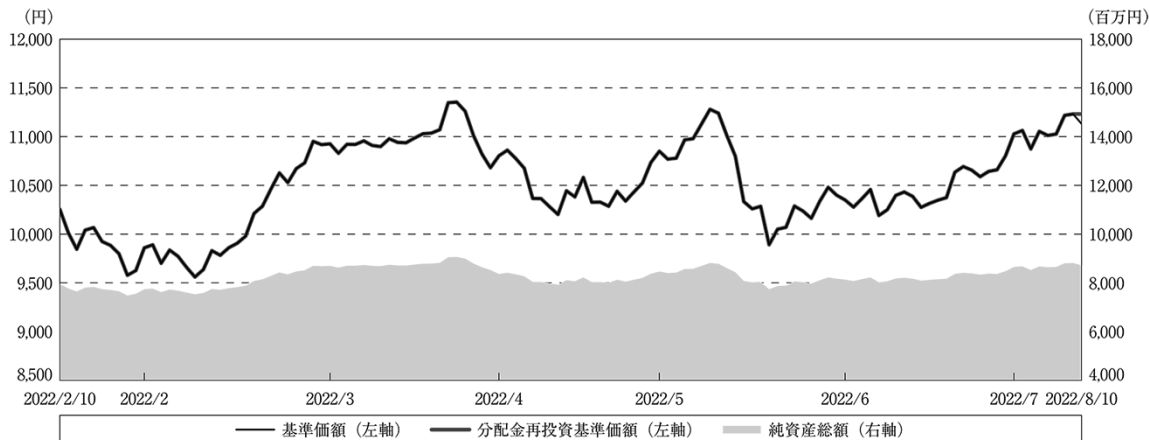
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

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

(2022年2月11日～2022年8月10日)

■期中の基準価額等の推移



期 首：10,254円

期 末：11,132円 (既払分配金(税込み):100円)

騰落率： 9.5% (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、期首(2022年2月10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

- ・新型コロナウイルス対策として実施された行動制限の解除に伴う経済活動再開などを背景とした米国企業の堅調な決算
- ・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

- ・ロシアによるウクライナ侵攻によって投資家のリスク回避姿勢が強まったこと
- ・世界的なインフレの進行に対して欧米中央銀行が金融引き締めを実施したこと
- ・中国大手都市のロックダウン(都市封鎖)により世界的に供給網が混乱したこと

■投資環境

【世界株式市場】

当期の世界株式市場は下落しました。期初、世界株式市場はロシアによるウクライナ侵攻を受けて下落しました。その後も、ウクライナ紛争の長期化による欧州経済の減速懸念や中国大手都市のロックダウンによる世界的な供給網の混乱などにより投資家のリスク回避姿勢が強まったこと、また、世界的なインフレの進行に対して欧米の中央銀行が金融引き締めを実施したことにより長期金利が上昇したことから、世界株式市場は下落基調となりました。期末にかけて、新型コロナウイルス対策として実施された行動制限の解除に伴う経済活動再開などを背景に米国企業の決算が堅調となったことなどから、世界株式市場は上昇に転じる局面もありましたが、前期末対比で下落して期を終えました。

【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。期初は落ち着いた動きとなりましたが、ロシアによるウクライナ侵攻後はインフレ懸念が高まり、欧米中央銀行が金融引き締め姿勢を強めたことで、金融緩和政策を維持する日本との金利差が拡大し、急速に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。期初はボックス圏での推移が続きましたが、欧州においてもインフレ懸念の高まりを背景に日欧の金利差が拡大し、円安ユーロ高が進みました。期末にかけては、欧州の景気減速懸念から円高ユーロ安基調となりましたが、前期末対比では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・気候変動対応株式ファンド(為替ヘッジなし)＞

「東京海上・気候変動対応株式マザーファンド」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、9.5%上昇しました。

＜東京海上・気候変動対応株式マザーファンド＞

気候変動への対応に積極的に取り組む企業（気候変動の影響を「緩和」する、または気候変動の影響に「適応」する事業を行う企業）の株式等に投資を行いました。

「低炭素電力」をテーマとする米国の薄膜太陽電池モジュール製造・販売会社FIRST SOLAR INCの株価上昇がプラス寄与した一方、「水と資源の管理」をテーマとするフランスの水ビジネス大手VEOLIA ENVIRONMENTの株価下落がマイナス寄与しました。

以上のような運用の結果、株式市場の下落に伴い、当マザーファンドが保有する株式はマイナス寄与となったものの、主要通貨に対して大幅に円安が進行したことから、基準価額は10.5%上昇しました。

■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2期
	2022年2月11日～ 2022年8月10日
当期分配金	100
(対基準価額比率)	0.890%
当期の収益	10
当期の収益以外	90
翌期繰越分配対象額	1,132

(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・気候変動対応株式ファンド(為替ヘッジなし)＞

「東京海上・気候変動対応株式マザーファンド」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・気候変動対応株式マザーファンド＞

引き続き、気候変動の影響を緩和する(温室効果ガスの排出を抑制する)事業を行う企業、または気候変動の影響に適応する(気候変動の影響による被害を回避・軽減する)事業を行う企業といった、気候変動への対応に積極的に取り組む企業に投資を行います。

今後も、製品やサービスなどを通じて環境の持続可能性や気候変動リスクに直接的に対応している企業の発掘に努めます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年2月11日～2022年8月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 97	% 0.914	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(55)	(0.518)	* 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)	(41)	(0.382)	* 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	2	0.017	(b) 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)	(2)	(0.017)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.012	(c) 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)	(1)	(0.012)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	2	0.023	(d) 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)	(2)	(0.017)	* 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	102	0.966	
期中の平均基準価額は、10,636円です。			

(注) 期中の費用（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。

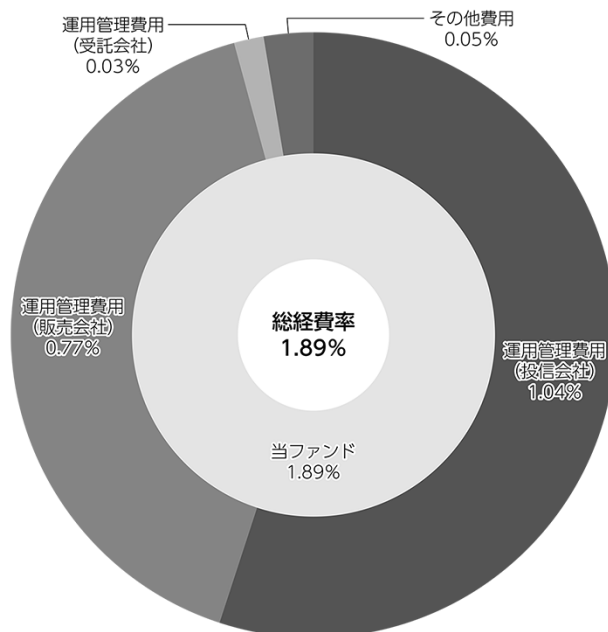
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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）を期中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

当期中の運用・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。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.89%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

(2022年2月11日～2022年8月10日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
東京海上・気候変動対応株式マザーファンド		493, 123	515, 340	547, 975	599, 120

○株式売買比率

(2022年2月11日～2022年8月10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
	東京海上・気候変動対応株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	9, 665, 416千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	9, 182, 544千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1. 05

(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

(2022年2月11日～2022年8月10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8月10日現在)

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
東京海上・気候変動対応株式マザーファンド		千口	千口	千円
		7, 707, 045	7, 652, 194	8, 725, 797

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2022年8月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
東京海上・気候変動対応株式マザーファンド	千円 8,725,797	% 98.0
コール・ローン等、その他	179,337	2.0
投資信託財産総額	8,905,134	100.0

(注) 東京海上・気候変動対応株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(10,169,794千円)の投資信託財産総額(11,107,782千円)に対する比率は91.6%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＝135.25円、1ユーロ＝138.08円、1英ポンド＝163.25円、1スウェーデンクローナ＝13.31円、1デンマーククローネ＝18.56円、1香港ドル＝17.23円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年8月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,905,134,673
東京海上・気候変動対応株式マザーファンド(評価額)	8,725,797,493
未収入金	179,337,180
(B) 負債	179,337,180
未払収益分配金	78,384,055
未払解約金	25,154,728
未払信託報酬	75,348,708
その他未払費用	449,689
(C) 純資産総額(A－B)	8,725,797,493
元本	7,838,405,559
次期繰越損益金	887,391,934
(D) 受益権総口数	7,838,405,559口
1万口当たり基準価額(C／D)	11,132円

(注) 当ファンドの期首元本額は7,757,617,900円、期中追加設定元本額は498,048,727円、期中一部解約元本額は417,261,068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 (2022年2月11日～2022年8月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	837,974,889
売買益	872,746,980
売買損	△ 34,772,091
(B) 信託報酬等	△ 75,798,397
(C) 当期損益金(A＋B)	762,176,492
(D) 前期繰越損益金	△276,171,890
(E) 追加信託差損益金	479,771,387
(配当等相当額)	(4,722,199)
(売買損益相当額)	(475,049,188)
(F) 計(C＋D＋E)	965,775,989
(G) 収益分配金	△ 78,384,055
次期繰越損益金(F＋G)	887,391,934
追加信託差損益金	409,225,737
(配当等相当額)	(5,817,008)
(売買損益相当額)	(403,408,729)
分配準備積立金	478,166,197

(注) (A)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) (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	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	89,301,945円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	396,702,657円
c. 信託約款に規定する収益調整金	479,771,387円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	0円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	965,775,989円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,232円
g. 分配金	78,384,055円
h. 分配金(1万口当たり)	100円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	100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。

東京海上・気候変動対応株式マザーファンド

運用報告書 第1期（決算日 2022年8月10日）

（計算期間 2021年10月4日～2022年8月10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	株 組 入 比	式 率	投 資 信 託 券 率	純 資 産 額
(設定日)	円		%	%	百万円
2021年10月4日	10,000		—	—	500
1期(2022年8月10日)	11,403		91.1	4.2	10,766

(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	株 組 入 比	式 率	投 資 信 託 券 率
(設定日)	円		%	%
2021年10月4日	10,000		—	—
10月末	10,883	8.8	90.3	4.4
11月末	10,603	6.0	90.6	4.5
12月末	10,933	9.3	91.3	4.4
2022年1月末	10,008	0.1	87.3	4.2
2月末	9,933	△ 0.7	85.9	4.7
3月末	11,023	10.2	88.1	4.9
4月末	10,915	9.2	88.0	5.2
5月末	10,980	9.8	87.1	5.0
6月末	10,493	4.9	86.7	4.7
7月末	11,191	11.9	88.7	4.7
(期 末)				
2022年8月10日	11,403	14.0	91.1	4.2

(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10月4日～2022年8月10日)

■期中の基準価額等の推移

設定日：10,000円
 期 末：11,403円
 騰落率：14.0%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・新型コロナウイルスワクチン接種の進展により、経済活動正常化への期待が高まったこと
- ・新型コロナウイルス対策として実施された行動制限の解除に伴う経済活動再開などを背景とした米国企業の堅調な決算
- ・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

- ・ロシアによるウクライナ侵攻によって投資家のリスク回避姿勢が強まったこと
- ・世界各国におけるインフレ進行に対する警戒感などから長期金利が上昇したこと
- ・中国大手都市のロックダウン（都市封鎖）により世界的に供給網が混乱したこと

■投資環境

【世界株式市場】

当期の海外株式市場は下落しました。期初、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などから、堅調な展開で始まった世界株式市場は、2022年2月にロシアによるウクライナ侵攻を受けて下落基調となりました。その後も、ウクライナ紛争の長期化による欧州経済の減速懸念や中国大手都市のロックダウンによる世界的な供給網の混乱などにより投資家のリスク回避姿勢が強まったこと、また、世界的なインフレの進行に対して欧米の中央銀行が金融引き締めを実施したことにより長期金利が上昇したことから、世界株式市場は下落基調となりました。期末にかけて、新型コロナウイルス対策として実施された行動制限の解除に伴う経済活動再開などを背景に米国企業の決算が堅調となったことなどから、世界株式市場は上昇に転じる局面もありましたが、期初からは下落した水準で期を終えました。

【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。期初は落ち着いた動きとなりましたが、ロシアによるウクライナ侵攻後はインフレ懸念が高まり、欧米の中央銀行が金融引き締め姿勢を強めたことで、金融緩和政策を維持する日本との金利差が拡大し、急速に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。期初はボックス圏での推移が続きましたが、欧州においてもインフレ懸念の高まりを背景に日欧の金利差が拡大し、円安ユーロ高が進みました。期末にかけては、欧州の景気減速懸念から円高ユーロ安基調となりましたが、期を通じては円安ユーロ高となりました。

■ポートフォリオについて

気候変動への対応に積極的に取り組む企業（気候変動の影響を「緩和」する、または気候変動の影響に「適応」する事業を行う企業）の株式等に投資を行いました。

当期は、「低炭素輸送」をテーマとする銘柄に注目しました。今後数年にわたって電動化や低炭素化に対応した自動車への需要が「低炭素輸送」に対する投資の支援材料となることを想定しています。また、農業関連分野で革新的な技術が魅力的な成長機会を提供している企業にも注目し、この分野の銘柄にも積極的に投資をしました。

以上の運用の結果、株式市場の下落に伴い、当マザーファンドが保有する株式はマイナス寄与となったものの、主要通貨に対して大幅に円安が進行したことから、基準価額は14.0%上昇しました。



○今後の運用方針

引き続き、気候変動の影響を緩和する（温室効果ガスの排出を抑制する）事業を行う企業、または気候変動の影響に適応する（気候変動の影響による被害を回避・軽減する）事業を行う企業といった、気候変動への対応に積極的に取り組む企業に投資を行います。

今後も、製品やサービスなどを通じて環境の持続可能性や気候変動リスクに直接的に対応している企業の発掘に努めます。

○1万口当たりの費用明細

(2021年10月4日～2022年8月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	4	0.039	(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)	(4)	(0.038)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.001)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	9	0.084	(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)	(9)	(0.084)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	5	0.047	(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)	(5)	(0.047)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	18	0.170	
期中の平均基準価額は、10,696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10月4日～2022年8月10日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上場	千株 227	千円 1,076,500	千株 95	千円 443,901
外国	アメリカ	百株 8,744 (72)	千米ドル 88,447 (1,060)	百株 3,109 (171)	千米ドル 27,780 (2,565)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	328	5,666	163	2,632
	イタリア	2,693	1,870	2,693	1,415
	フランス	1,593	6,192	932	3,204
	スペイン	107	1,702	107	1,521
	イギリス	3,713	千英ポンド 5,527	1,730	千英ポンド 2,236
	スイス	470	千スイスフラン 1,516	470	千スイスフラン 1,393
	スウェーデン	1,510	千スウェーデンクローナ 20,629	549	千スウェーデンクローナ 6,598
	デンマーク	576	千デンマーククローネ 12,865	130	千デンマーククローネ 2,577
	香港	9,669	千香港ドル 16,482	4,140	千香港ドル 6,131

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ()内は株式分割、移転、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE	30,941	1,788	1,446	56
	WEYERHAEUSER CO	77,415	2,931	18,375	665
	小 計	108,356	4,719	19,821	722

(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10月4日～2022年8月10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	21,341,540千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,363,250千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.55

(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10月4日～2022年8月10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8月10日現在)

国内株式

銘 柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
機械 (31.9%)		
クボタ	78.7	169,519
電気機器 (40.8%)		
日立製作所	32.8	217,070

銘 柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
陸運業 (27.3%)		
東日本旅客鉄道	20.6	145,353
合 計	株 数 ・ 金 額	132 531,943
	銘柄数<比率>	3 <4.9%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

外国株式

銘柄		当期末			業種等
		株数	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	
ACUITY BRANDS INC		119	2,071	280,140	資本財
AECOM		442	3,228	436,596	資本財
AMERICAN WATER WORKS CO INC		190	2,965	401,090	公益事業
AVANGRID INC		194	966	130,729	公益事業
CONSOLIDATED EDISON INC		324	3,212	434,543	公益事業
DARLING INGREDIENTS INC		261	1,880	254,279	食品・飲料・タバコ
DEERE & CO		46	1,599	216,330	資本財
ASPEN TECHNOLOGY INC		86	1,740	235,413	ソフトウェア・サービス
EVERSOURCE ENERGY		341	3,125	422,760	公益事業
EXELON CORP		759	3,447	466,316	公益事業
FMC CORP		225	2,424	327,928	素材
FIRST SOLAR INC		383	4,182	565,712	半導体・半導体製造装置
GREEN PLAINS INC		354	1,342	181,637	エネルギー
HUBBELL INC		30	654	88,570	資本財
MOODY'S CORP		105	3,289	444,967	各種金融
S&P GLOBAL INC		97	3,659	494,917	各種金融
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC		54	1,704	230,570	半導体・半導体製造装置
VERISK ANALYTICS INC		200	3,989	539,635	商業・専門サー ビス
WABTEC CORP/DE		356	3,295	445,732	資本財
WASTE MANAGEMENT INC		189	3,213	434,601	商業・専門サー ビス
WOLFSPEED INC		184	1,515	204,985	半導体・半導体製造装置
APTIV PLC		196	1,949	263,700	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC		55	815	110,296	資本財
ATLANTICA SUSTAINABLE INFRAS		101	352	47,620	公益事業
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL		230	1,245	168,410	資本財
小計		株数・金額	5,535	57,874	7,827,487
		銘柄数<比率>	25	—	<72.7%>
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		30	709	98,002	保険
SIEMENS AG		133	1,423	196,590	資本財
小計		株数・金額	164	2,133	294,593
		銘柄数<比率>	2	—	<2.7%>
(ユーロ…フランス)					
VEOLIA ENVIRONNEMENT		448	1,102	152,242	公益事業
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN		213	953	131,606	資本財
小計		株数・金額	661	2,055	283,849
		銘柄数<比率>	2	—	<2.6%>
ユーロ計		株数・金額	825	4,189	578,442
		銘柄数<比率>	4	—	<5.4%>
(イギリス)			千英ポンド		
PERSIMMON PLC		855	1,562	255,003	耐久消費財・アパレル
NATIONAL GRID PLC		1,128	1,300	212,241	公益事業
小計		株数・金額	1,983	2,862	467,245
		銘柄数<比率>	2	—	<4.3%>
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
HEXAGON AB-B SHS		960	11,024	146,741	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計		株数・金額	960	11,024	146,741
		銘柄数<比率>	1	—	<1.4%>

銘		柄		当 期 末			業 種 等
				株 数	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)				百株	千デンマーククローネ	千円	資本財
VESTAS WIND SYSTEMS A/S				445	8,117	150,651	
小 計	株 数	・ 金 額	445	8,117	150,651		
	銘 柄 数	< 比 率 >	1	—	<1.4%>		
(香港)					千香港ドル		公益事業
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H				5,529	6,402	110,319	
小 計	株 数	・ 金 額	5,529	6,402	110,319		
	銘 柄 数	< 比 率 >	1	—	<1.0%>		
合 計	株 数	・ 金 額	15,280	—	9,280,888		
	銘 柄 数	< 比 率 >	34	—	<86.2%>		

(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、合計欄のくゝ内は、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。

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				29,495	1,284	173,689	1.6
WEYERHAEUSER CO				59,040	2,079	281,317	2.6
合 計	口	数 ・ 金 額		88,535	3,364	455,006	
	銘	柄 数 < 比 率 >		2	—	<4.2%>	

(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

(2022年8月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 9,812,831	% 88.3
投資証券	455,006	4.1
コール・ローン等、その他	839,945	7.6
投資信託財産総額	11,107,782	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産（10,169,794千円）の投資信託財産総額（11,107,782千円）に対する比率は91.6%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＝135.25円、1ユーロ＝138.08円、1英ポンド＝163.25円、1スウェーデンクローナ＝13.31円、1デンマーククローネ＝18.56円、1香港ドル＝17.23円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年8月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	11,107,782,686
コール・ローン等	724,045,132
株式(評価額)	9,812,831,840
投資証券(評価額)	455,006,900
未収入金	105,529,279
未収配当金	10,369,535
(B) 負債	341,455,319
未払金	135,741,884
未払解約金	205,713,348
未払利息	87
(C) 純資産総額(A－B)	10,766,327,367
元本	9,442,012,260
次期繰越損益金	1,324,315,107
(D) 受益権総口数	9,442,012,260口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,403円

(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10,173,612,827円、期中一部解約元本額は1,231,600,567円です。

<元本の内訳>

東京海上・気候変動対応株式ファンド(為替ヘッジなし) 7,652,194,592円
東京海上・気候変動対応株式ファンド(為替ヘッジあり) 1,789,817,668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 (2021年10月4日～2022年8月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	158,084,795
受取配当金	157,397,422
受取利息	742,920
その他収益金	1,778
支払利息	△ 57,325
(B) 有価証券売買損益	590,168,220
売買益	2,143,503,563
売買損	△1,553,335,343
(C) 保管費用等	△ 4,468,902
(D) 当期損益金(A+B+C)	743,784,113
(E) 追加信託差損益金	682,271,310
(F) 解約差損益金	△ 101,740,316
(G) 計(D+E+F)	1,324,315,107
次期繰越損益金(G)	1,324,315,107

(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。