

東京海上・気候変動対応  
株式ファンド  
(為替ヘッジあり)  
＜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<br>(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。原則として、為替ヘッジを行うことにより、為替変動リスクの低減を図ります。                                                                                                                |                                                     |
| 主要投資対象 | 東京海上・気候変動対応株式ファンド(為替ヘッジあり)                                                                                                                                                   | 「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(為替ヘッジあり)                                                                                                                                                   | ・株式への実質投資割合には制限を設けません。<br>・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 |
|        | 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。<br>・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。<br><br>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 1 期 運用報告書 (全体版)  
(決算日 2022年 2 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(為替ヘッジあり)＜愛称 グリーンフューチャー＞」は、このたび、第 1 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<br>(分配落) | 価 額 |     |             | 株 式 組 入 比 率 | 投 資 信 託 組 入 比 率 | 純 資 産 総 額 |
|-------------------|--------------|-----|-----|-------------|-------------|-----------------|-----------|
|                   |              | 税 分 | 達 配 | み 期 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) | 9,906        |     |     | 0           | △0.9        | 87.7            | 2,235     |

(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 率 | 純 資 産 総 額 |
|--------------|--------|-----|------|-------------|-----------------|-----------|
|              |        | 騰 落 | 率    |             |                 |           |
| (設定日)        | 円      |     | %    | %           | %               | %         |
| 2021年10月 4 日 | 10,000 |     | —    | —           | —               | —         |
| 10月末         | 10,609 |     | 6.1  | 91.1        | 4.4             | 4.4       |
| 11月末         | 10,395 |     | 4.0  | 90.2        | 4.5             | 4.5       |
| 12月末         | 10,575 |     | 5.8  | 92.6        | 4.4             | 4.4       |
| 2022年 1 月末   | 9,678  |     | △3.2 | 87.8        | 4.2             | 4.2       |
| (期 末)        |        |     |      |             |                 |           |
| 2022年 2 月10日 | 9,906  |     | △0.9 | 87.7        | 4.5             | 4.5       |

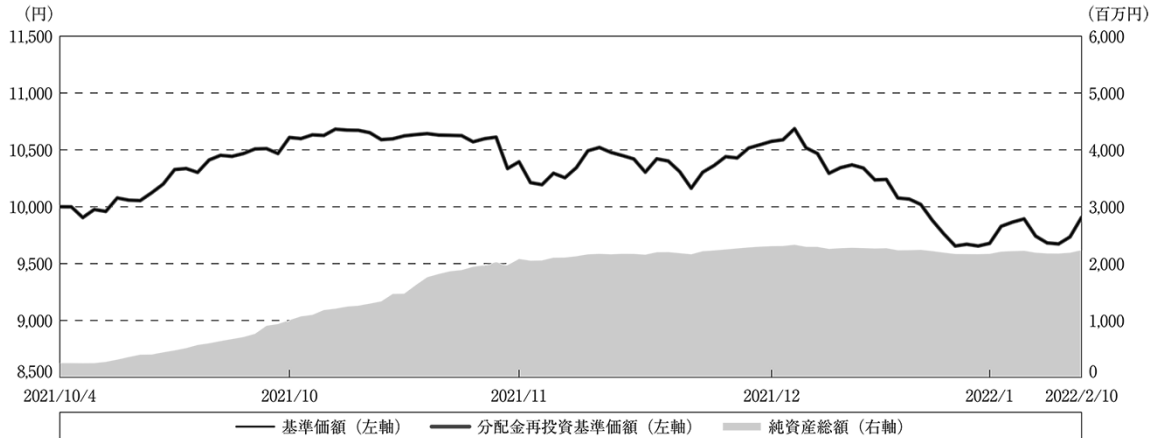
(注) 騰落率は設定日比です。  
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。  
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

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

(2021年10月4日～2022年2月10日)

## ■期中の基準価額等の推移



設定日：10,000円

期 末：9,906円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 0.9% (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。

## ◇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

マイナス要因

- ・欧米中央銀行の金融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局面があったこと
- ・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

### 【世界株式市場】

当期、世界の株式市場は上昇しました。期初は、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、株式市場は上昇しました。2021年11月にオミクロン株への懸念から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、年末にかけて上昇しました。2022年初以降は、インフレ懸念から欧米の中央銀行が金融引き締め政策に転換するとの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は軟調に推移しましたが、期初からは上昇して期を終えました。

## ■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(為替ヘッジあり)＞

「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。また、マザーファンドの通貨ウェイトに応じて対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

当ファンドの基準価額は、マザーファンドが保有する株式の値動きを反映し、0.9%下落しました。

### ＜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」をテーマとする英国の公益事業会社NATIONAL GRID PLCの株価上昇がプラス寄与した一方、同じく「低炭素電力」をテーマとする米国の住宅用太陽光発電事業会社SUNNOVA ENERGY INTERNATIONALの株価下落がマイナス寄与しました。

当マザーファンドの基準価額は、主要通貨で円安が進行したことを主因に3.2%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

当期においては、基準価額の水準などを勘案して、収益分配を行わないこととしました。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1期                       |
|--------------------|---------------------------|
|                    | 2021年10月4日～<br>2022年2月10日 |
| 当期分配金<br>(対基準価額比率) | —<br>— %                  |
| 当期の収益              | —                         |
| 当期の収益以外            | —                         |
| 翌期繰越分配対象額          | 4                         |

(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(為替ヘッジあり)＞

「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。また、マザーファンドの通貨ウェイトに応じて対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。

### ＜東京海上・気候変動対応株式マザーファンド＞

テーマ別では「低炭素輸送」での投資機会に注目しています。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期待しています。また、干ばつや在庫逼迫を受けて、農業関連分野でも革新的技術が魅力的な成長機会を提供すると考えています。

欧米中央銀行による金融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、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）事業を行う企業については、世界的な気候変動への関心の高まりとともに、中長期的には株価が上昇していくと考えます。

今後も、製品やサービスなどを通じて気候変動への対応に積極的に取り組む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2月10日)

| 項 目                   | 当 期     |            | 項 目 の 概 要                                           |
|-----------------------|---------|------------|-----------------------------------------------------|
|                       | 金 額     | 比 率        |                                                     |
| (a) 信 託 報 酬           | 円<br>68 | %<br>0.656 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率                            |
| ( 投 信 会 社 )           | (38)    | (0.372)    | * 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 )           | (28)    | (0.274)    | * 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 )   | (0.010)    | * 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     | 3       | 0.024      | (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                   |
| ( 株 式 )               | ( 2 )   | (0.023)    | * 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 )       | ( 0 )   | (0.001)    |                                                     |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税     | 9       | 0.089      | (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                   |
| ( 株 式 )               | ( 9 )   | (0.089)    | * 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                   |
| (d) そ の 他 費 用         | 4       | 0.035      | (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 )           | ( 3 )   | (0.031)    | * 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 )           | ( 0 )   | (0.003)    | * 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                        |
| ( そ の 他 )             | ( 0 )   | (0.001)    | * その他は、信託事務等に要する諸費用                                 |
| 合 計                   | 84      | 0.804      |                                                     |
| 期中の平均基準価額は、10,314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。

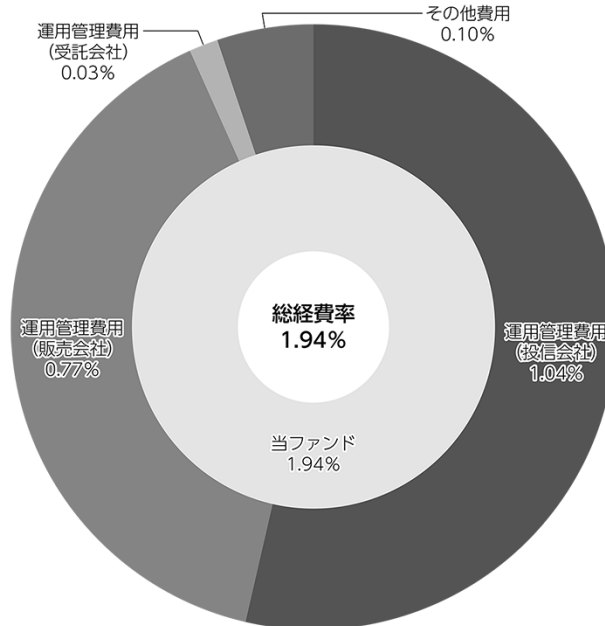
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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1.94%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10月4日～2022年2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 |   | 2,233,202 | 2,373,738 | 52,423 | 55,378 |

○株式売買比率

(2021年10月4日～2022年2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       | 11,678,370千円         |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 7,134,309千円          |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.63                 |

(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2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2月10日現在)

親投資信託残高

| 銘                    | 柄 | 当 期 末               |
|----------------------|---|---------------------|
|                      |   | 口 数 評 価 額           |
|                      |   | 千口 千円               |
| 東京海上・気候変動対応株式マザーファンド |   | 2,180,778 2,250,781 |

# ○投資信託財産の構成

(2022年2月10日現在)

| 項 目                  | 当 期 末     |       |
|----------------------|-----------|-------|
|                      | 評 価 額     | 比 率   |
|                      | 千円        | %     |
| 東京海上・気候変動対応株式マザーファンド | 2,250,781 | 99.5  |
| コール・ローン等、その他         | 11,215    | 0.5   |
| 投資信託財産総額             | 2,261,996 | 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(9,142,269千円)の投資信託財産総額(10,320,445千円)に対する比率は88.6%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=115.61円、1ユーロ=132.00円、1英ポンド=156.39円、1スイスフラン=125.05円、1スウェーデンクローナ=12.68円、1デンマーククローネ=17.74円、1香港ドル=14.84円です。

# ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年2月10日現在)

| 項 目                       | 当 期 末          |
|---------------------------|----------------|
|                           | 円              |
| (A) 資産                    | 4,223,917,301  |
| 東京海上・気候変動対応株式マザーファンド(評価額) | 2,250,781,742  |
| 未収入金                      | 1,973,135,559  |
| (B) 負債                    | 1,988,127,065  |
| 未払金                       | 1,976,912,236  |
| 未払信託報酬                    | 11,148,341     |
| その他未払費用                   | 66,488         |
| (C) 純資産総額(A－B)            | 2,235,790,236  |
| 元本                        | 2,257,047,302  |
| 次期繰越損益金                   | △ 21,257,066   |
| (D) 受益権総口数                | 2,257,047,302口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D)           | 9,906円         |

(注) 当ファンドの設定時元本額は250,000,000円、期中追加設定元本額は2,018,661,092円、期中一部解約元本額は11,613,790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 (2021年10月4日～2022年2月10日)

| 項 目            | 当 期           |
|----------------|---------------|
|                | 円             |
| (A) 有価証券売買損益   | △102,728,053  |
| 売買益            | 20,819,305    |
| 売買損            | △123,547,358  |
| (B) 信託報酬等      | △ 11,222,529  |
| (C) 当期損益金(A＋B) | △113,950,582  |
| (D) 追加信託差損益金   | 92,693,516    |
| (売買損益相当額)      | ( 92,693,516) |
| (E) 計(C＋D)     | △ 21,257,066  |
| (F) 収益分配金      | 0             |
| 次期繰越損益金(E＋F)   | △ 21,257,066  |
| 追加信託差損益金       | 92,693,516    |
| (配当等相当額)       | ( 938,682)    |
| (売買損益相当額)      | ( 91,754,834) |
| 繰越損益金          | △113,950,582  |

(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) (D)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)     | 0円       |
| b. 有価証券等損益額(費用控除後)  | 0円       |
| c. 信託約款に規定する収益調整金   | 938,682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)  | 938,682円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり)   | 4円       |
| g. 分配金              | 0円       |
| h. 分配金(1万口当たり)      | 0円       |

## ○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2022年2月10日現在)

## &lt;東京海上・気候変動対応株式マザーファンド&gt;

下記は、東京海上・気候変動対応株式マザーファンド全体(9,887,824千円)の内容です。

## 国内株式

| 銘柄           | 柄                | 当期    |     | 期末      |
|--------------|------------------|-------|-----|---------|
|              |                  | 株数    | 評価額 | 額       |
| 機械 (48.6%)   |                  | 千株    |     | 千円      |
| クボタ          |                  | 129.6 |     | 313,243 |
| ダイキン工業       |                  | 4.6   |     | 103,270 |
| 電気機器 (31.9%) |                  |       |     |         |
| 日立製作所        |                  | 45    |     | 273,330 |
| 陸運業 (19.5%)  |                  |       |     |         |
| 東日本旅客鉄道      |                  | 23.2  |     | 166,692 |
| 合 計          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 202   |     | 856,535 |
|              |                  | 4     |     | <8.4%>  |

(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&lt; &gt;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            |              | 73    | 1,409  | 162,951   | 資本財         |
| AECOM                        |              | 362   | 2,708  | 313,185   | 資本財         |
| ASPEN TECHNOLOGY INC         |              | 136   | 1,954  | 225,970   | ソフトウェア・サービス |
| AVANGRID INC                 |              | 265   | 1,214  | 140,405   | 公益事業        |
| CONSOLIDATED EDISON INC      |              | 319   | 2,759  | 319,065   | 公益事業        |
| DARLING INGREDIENTS INC      |              | 363   | 2,401  | 277,596   | 食品・飲料・タバコ   |
| DEERE & CO                   |              | 76    | 3,035  | 350,886   | 資本財         |
| EVERSOURCE ENERGY            |              | 429   | 3,749  | 433,498   | 公益事業        |
| FMC CORP                     |              | 240   | 2,820  | 326,135   | 素材          |
| FIRST SOLAR INC              |              | 97    | 723    | 83,698    | 半導体・半導体製造装置 |
| HUBBELL INC                  |              | 64    | 1,235  | 142,824   | 資本財         |
| MOODY'S CORP                 |              | 36    | 1,250  | 144,609   | 各種金融        |
| S&P GLOBAL INC               |              | 58    | 2,387  | 275,975   | 各種金融        |
| SUNNOVA ENERGY INTERNATIONAL |              | 358   | 689    | 79,669    | 公益事業        |
| VERISK ANALYTICS INC         |              | 142   | 2,842  | 328,584   | 商業・専門サービス   |
| WABTEC CORP/DE               |              | 218   | 2,028  | 234,505   | 資本財         |
| WASTE MANAGEMENT INC         |              | 144   | 2,115  | 244,530   | 商業・専門サービス   |
| APTIV PLC                    |              | 116   | 1,619  | 187,219   | 自動車・自動車部品   |
| EATON CORP PLC               |              | 95    | 1,491  | 172,376   | 資本財         |
| ATLANTICA SUSTAINABLE INFRAS |              | 361   | 1,201  | 138,888   | 公益事業        |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION |              | 377   | 2,620  | 302,901   | 資本財         |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 4,338 | 42,258 | 4,885,480 |             |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 21    | —      | <47.9%>   |             |
| (ユーロ…ドイツ)                    |              |       | 千ユーロ   |           |             |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   |              | 83    | 2,286  | 301,798   | 保険          |
| SIEMENS AG                   |              | 166   | 2,305  | 304,304   | 資本財         |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 250   | 4,591  | 606,103   |             |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 2     | —      | <5.9%>    |             |

| 銘柄                           |   | 株         | 数            | 当 期 末       |           | 業 種 等              |
|------------------------------|---|-----------|--------------|-------------|-----------|--------------------|
|                              |   |           |              | 評 価 額       |           |                    |
|                              |   |           |              | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |                    |
| (ユーロ…イタリア)                   |   |           | 百株           | 千ユーロ        | 千円        | 公益事業               |
| ENEL SPA                     |   |           | 2,649        | 1,716       | 226,522   |                    |
| 小                            | 計 | 株 数 ・ 金 額 | 2,649        | 1,716       | 226,522   |                    |
|                              |   |           | 銘柄 数 < 比 率 > | 1           | <2.2%>    |                    |
| (ユーロ…フランス)                   |   |           |              |             |           | 公益事業<br>資本財        |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         |   |           | 882          | 2,892       | 381,867   |                    |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN    |   |           | 340          | 2,108       | 278,379   |                    |
| 小                            | 計 | 株 数 ・ 金 額 | 1,223        | 5,001       | 660,246   |                    |
|                              |   |           | 銘柄 数 < 比 率 > | 2           | <6.5%>    |                    |
| (ユーロ…スペイン)                   |   |           |              |             |           | 公益事業               |
| ACCIONA S.A.                 |   |           | 107          | 1,616       | 213,368   |                    |
| 小                            | 計 | 株 数 ・ 金 額 | 107          | 1,616       | 213,368   |                    |
|                              |   |           | 銘柄 数 < 比 率 > | 1           | <2.1%>    |                    |
| ユ                            | ー | ロ 計       | 株 数 ・ 金 額    | 4,231       | 12,926    | 1,706,241          |
|                              |   |           | 銘柄 数 < 比 率 > | 6           | <16.7%>   |                    |
| (イギリス)                       |   |           |              | 千英ポンド       |           | 耐久消費財・アパレル<br>公益事業 |
| PERSIMMON PLC                |   |           | 795          | 1,966       | 307,618   |                    |
| NATIONAL GRID PLC            |   |           | 2,334        | 2,521       | 394,306   |                    |
| 小                            | 計 | 株 数 ・ 金 額 | 3,130        | 4,488       | 701,924   |                    |
|                              |   |           | 銘柄 数 < 比 率 > | 2           | <6.9%>    |                    |
| (スイス)                        |   |           | 百株           | 千スイスフラン     | 千円        | 資本財                |
| ABB LTD                      |   |           | 423          | 1,396       | 174,674   |                    |
| 小                            | 計 | 株 数 ・ 金 額 | 423          | 1,396       | 174,674   |                    |
|                              |   |           | 銘柄 数 < 比 率 > | 1           | <1.7%>    |                    |
| (スウェーデン)                     |   |           |              | 千スウェーデンクローナ |           | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| HEXAGON AB-B SHS             |   |           | 1,216        | 15,920      | 201,873   |                    |
| 小                            | 計 | 株 数 ・ 金 額 | 1,216        | 15,920      | 201,873   |                    |
|                              |   |           | 銘柄 数 < 比 率 > | 1           | <2.0%>    |                    |
| (デンマーク)                      |   |           |              | 千デンマーククローネ  |           | 資本財                |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      |   |           | 481          | 8,116       | 143,986   |                    |
| 小                            | 計 | 株 数 ・ 金 額 | 481          | 8,116       | 143,986   |                    |
|                              |   |           | 銘柄 数 < 比 率 > | 1           | <1.4%>    |                    |
| (香港)                         |   |           |              | 千香港ドル       |           | 公益事業               |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H |   |           | 8,989        | 14,742      | 218,773   |                    |
| 小                            | 計 | 株 数 ・ 金 額 | 8,989        | 14,742      | 218,773   |                    |
|                              |   |           | 銘柄 数 < 比 率 > | 1           | <2.1%>    |                    |
| 合                            | 計 | 株 数 ・ 金 額 | 22,811       | —           | 8,032,955 |                    |
|                              |   |           | 銘柄 数 < 比 率 > | 33          | <78.7%>   |                    |

(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。

## 外国投資信託証券

| 銘柄                           |               | 当 期 末  |       |         |     |
|------------------------------|---------------|--------|-------|---------|-----|
|                              |               | 口 数    | 評 価 額 |         | 比 率 |
|                              |               |        | 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 |               | 30,209 | 1,307 | 151,188 | 1.5 |
| WEYERHAEUSER CO              |               | 61,357 | 2,611 | 301,969 | 3.0 |
| 合 計                          | 口 数 ・ 金 額     | 91,566 | 3,919 | 453,158 |     |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 2      | —     | <4.4%>  |     |

(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。