

ロゲー  
 東京海上Rogge  
 世界ハイブリッド証券ファンド  
 (通貨選択型)  
 トルコ・リラコース (毎月分配型)

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／内外／債券<br>(課税上は株式投資信託として取扱われます。)                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                     |
| 信託期間   | 2013年9月4日から2026年9月17日                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                     |
| 運用方針   | 安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                                                                     |
| 主要投資対象 | 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)トルコ・リラコース(毎月分配型)                                                                                                                                                     | 主に世界の金融機関が発行するハイブリッド証券(劣後債、優先出資証券など)等を投資対象とする外国投資信託「東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンドトルコ・リラクラス」と、主に円建て短期公社債およびコマーシャル・ペーパー等に投資する親投資信託「東京海上マネーマザーファンド」を主要投資対象とします。 |
|        | 東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンドトルコ・リラクラス                                                                                                                                      | 世界の金融機関が発行するハイブリッド証券等を主要投資対象とします。                                                                                                                                                   |
|        | 東京海上マネーマザーファンド                                                                                                                                                                                     | 円建て短期公社債およびコマーシャル・ペーパーなどを主要投資対象とします。                                                                                                                                                |
| 投資制限   | 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)トルコ・リラコース(毎月分配型)                                                                                                                                                     | ・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。                                                                                                           |
|        | 東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンドトルコ・リラクラス                                                                                                                                      | 原則として、純資産総額の10%を超える借入れは行わないものとします。                                                                                                                                                  |
|        | 東京海上マネーマザーファンド                                                                                                                                                                                     | ・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   | 第1期および第2期の決算時には、分配を行いません。第3期以降の毎決算時に、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98期 (決算日 2021年10月18日)  
 第99期 (決算日 2021年11月17日)  
 第100期 (決算日 2021年12月17日)  
 第101期 (決算日 2022年1月17日)  
 第102期 (決算日 2022年2月17日)  
 第103期 (決算日 2022年3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Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)トルコ・リラコース(毎月分配型)」は、このたび、第103期の決算を行いましたので、第98期～第103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。

## ○最近30期の運用実績

| 決 算 期             | 基<br>(分配落) | 準<br>税 分 | 価<br>込 配 | 額<br>み 金 | 期<br>騰 落 | 中<br>率 | 債<br>組 入 比 | 券<br>率 | 投<br>証 組 入 比 | 信<br>託 券 率 | 純<br>資 産 額 |
|-------------------|------------|----------|----------|----------|----------|--------|------------|--------|--------------|------------|------------|
|                   | 円          |          |          | 円        |          | %      |            | %      |              | %          | 百万円        |
| 74期(2019年10月17日)  | 2,796      |          |          | 90       | △        | 1.2    |            | 0.0    |              | 98.1       | 3,419      |
| 75期(2019年11月18日)  | 2,812      |          |          | 90       |          | 3.8    |            | 0.0    |              | 98.5       | 3,863      |
| 76期(2019年12月17日)  | 2,744      |          |          | 90       |          | 0.8    |            | 0.0    |              | 99.3       | 4,063      |
| 77期(2020年1月17日)   | 2,703      |          |          | 90       |          | 1.8    |            | 0.0    |              | 98.3       | 4,211      |
| 78期(2020年2月17日)   | 2,561      |          |          | 90       | △        | 1.9    |            | 0.0    |              | 98.8       | 4,295      |
| 79期(2020年3月17日)   | 2,142      |          |          | 70       | △        | 13.6   |            | 0.0    |              | 98.5       | 3,715      |
| 80期(2020年4月17日)   | 2,000      |          |          | 50       | △        | 4.3    |            | 0.0    |              | 96.3       | 3,454      |
| 81期(2020年5月18日)   | 1,981      |          |          | 50       |          | 1.6    |            | 0.0    |              | 99.1       | 3,310      |
| 82期(2020年6月17日)   | 2,048      |          |          | 50       |          | 5.9    |            | 0.0    |              | 99.0       | 3,450      |
| 83期(2020年7月17日)   | 2,029      |          |          | 50       |          | 1.5    |            | 0.0    |              | 98.0       | 3,466      |
| 84期(2020年8月17日)   | 1,881      |          |          | 50       | △        | 4.8    |            | 0.0    |              | 98.7       | 3,233      |
| 85期(2020年9月17日)   | 1,812      |          |          | 50       | △        | 1.0    |            | 0.0    |              | 98.9       | 2,908      |
| 86期(2020年10月19日)  | 1,702      |          |          | 50       | △        | 3.3    |            | 0.0    |              | 99.1       | 2,669      |
| 87期(2020年11月17日)  | 1,701      |          |          | 50       |          | 2.9    |            | 0.0    |              | 99.1       | 2,532      |
| 88期(2020年12月17日)  | 1,648      |          |          | 50       | △        | 0.2    |            | 0.0    |              | 98.5       | 2,452      |
| 89期(2021年1月18日)   | 1,712      |          |          | 50       |          | 6.9    |            | 0.0    |              | 98.6       | 2,577      |
| 90期(2021年2月17日)   | 1,831      |          |          | 50       |          | 9.9    |            | 0.0    |              | 99.2       | 2,832      |
| 91期(2021年3月17日)   | 1,698      |          |          | 50       | △        | 4.5    |            | 0.0    |              | 98.3       | 2,542      |
| 92期(2021年4月19日)   | 1,569      |          |          | 50       | △        | 4.7    |            | 0.0    |              | 98.7       | 2,368      |
| 93期(2021年5月17日)   | 1,474      |          |          | 50       | △        | 2.9    |            | 0.0    |              | 99.1       | 2,234      |
| 94期(2021年6月17日)   | 1,452      |          |          | 50       |          | 1.9    |            | 0.0    |              | 99.0       | 2,236      |
| 95期(2021年7月19日)   | 1,442      |          |          | 50       |          | 2.8    |            | 0.0    |              | 99.1       | 2,230      |
| 96期(2021年8月17日)   | 1,414      |          |          | 50       |          | 1.5    |            | 0.0    |              | 99.3       | 2,196      |
| 97期(2021年9月17日)   | 1,384      |          |          | 50       |          | 1.4    |            | 0.0    |              | 99.2       | 2,238      |
| 98期(2021年10月18日)  | 1,283      |          |          | 50       | △        | 3.7    |            | 0.0    |              | 98.8       | 2,115      |
| 99期(2021年11月17日)  | 1,117      |          |          | 50       | △        | 9.0    |            | 0.0    |              | 99.1       | 1,919      |
| 100期(2021年12月17日) | 729        |          |          | 20       | △        | 32.9   |            | 0.0    |              | 98.1       | 1,223      |
| 101期(2022年1月17日)  | 814        |          |          | 20       |          | 14.4   |            | 0.0    |              | 98.1       | 1,280      |
| 102期(2022年2月17日)  | 785        |          |          | 20       | △        | 1.1    |            | 0.0    |              | 101.3      | 1,171      |
| 103期(2022年3月17日)  | 727        |          |          | 20       | △        | 4.8    |            | 0.0    |              | 98.5       | 1,112      |

(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。

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 券 組 入 比 率 |
|-------|----------------------|------------|--------|-------------|---------------------|
|       |                      |            | 騰 落 率  |             |                     |
| 第98期  | (期 首)<br>2021年9月17日  | 円<br>1,384 | %<br>— | %<br>0.0    | %<br>99.2           |
|       | 9月末                  | 1,357      | △ 2.0  | 0.0         | 98.5                |
|       | (期 末)<br>2021年10月18日 | 1,333      | △ 3.7  | 0.0         | 98.8                |
| 第99期  | (期 首)<br>2021年10月18日 | 1,283      | —      | 0.0         | 98.8                |
|       | 10月末                 | 1,242      | △ 3.2  | 0.0         | 98.7                |
|       | (期 末)<br>2021年11月17日 | 1,167      | △ 9.0  | 0.0         | 99.1                |
| 第100期 | (期 首)<br>2021年11月17日 | 1,117      | —      | 0.0         | 99.1                |
|       | 11月末                 | 896        | △19.8  | 0.0         | 98.0                |
|       | (期 末)<br>2021年12月17日 | 749        | △32.9  | 0.0         | 98.1                |
| 第101期 | (期 首)<br>2021年12月17日 | 729        | —      | 0.0         | 98.1                |
|       | 12月末                 | 900        | 23.5   | 0.0         | 95.6                |
|       | (期 末)<br>2022年1月17日  | 834        | 14.4   | 0.0         | 98.1                |
| 第102期 | (期 首)<br>2022年1月17日  | 814        | —      | 0.0         | 98.1                |
|       | 1月末                  | 824        | 1.2    | 0.0         | 97.9                |
|       | (期 末)<br>2022年2月17日  | 805        | △ 1.1  | 0.0         | 101.3               |
| 第103期 | (期 首)<br>2022年2月17日  | 785        | —      | 0.0         | 101.3               |
|       | 2月末                  | 754        | △ 3.9  | 0.0         | 97.8                |
|       | (期 末)<br>2022年3月17日  | 747        | △ 4.8  | 0.0         | 98.5                |

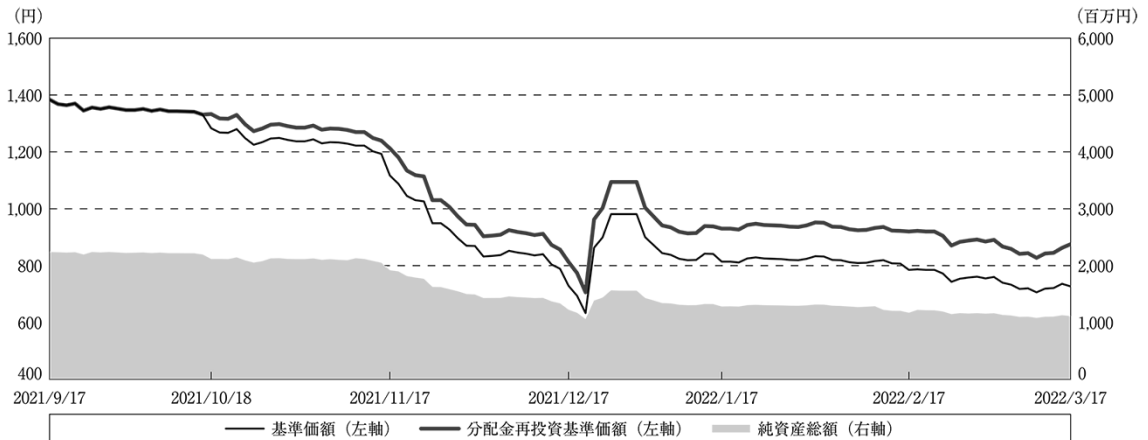
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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9月18日～2022年3月17日)

### ■作成期間中の基準価額等の推移



- (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9月17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

- ・ハイブリッド証券の利息収入
- ・原資産通貨売り／トルコ・リラ買いの為替取引によるプレミアム(金利差相当分の収益)

#### マイナス要因

- ・欧米中央銀行の金融政策見直しを背景とした国債利回りの上昇(債券価格は下落)
- ・新型コロナウイルスの新たな変異株(オミクロン株)の感染拡大やウクライナ情勢の深刻化を受けた投資家のリスク回避姿勢などによるハイブリッド証券のスプレッド(国債との利回り格差)の拡大
- ・円高トルコ・リラ安の進行

## ■投資環境

### 【外国債券市場】

当作成期、米国債利回りは上昇しました。作成期初、FRB（米連邦準備制度理事会）が2022年中の利上げ開始を示唆したことなどを背景に米国債利回りは上昇しましたが、その後はオミクロン株の感染が拡大し、経済を下押しするとの懸念が強まったことから低下基調となりました。作成期後半は、ロシアによるウクライナ侵攻が深刻化し、投資家のリスク回避姿勢が強まったことから米国債利回りは一時低下する局面もありましたが、インフレ抑制のためFRBによる利上げが想定以上に進むとの見方が広まったことなどから上昇基調となりました。

ドイツ国債利回りは上昇しました。作成期初、ドイツ国債利回りは上昇基調で推移しましたが、オミクロン株の感染拡大を受けて作成期半ばにかけて低下しました。作成期半ば以降、インフレ懸念の高まりを背景にドイツ国債利回りは大きく上昇しました。その後、ウクライナ情勢の深刻化を背景にドイツ国債利回りは低下する局面もありましたが、ECB（欧州中央銀行）が金融引き締めに積極的な姿勢を明確にしたことから、作成期末にかけて一段と上昇しました。

英国債利回りは上昇しました。作成期初、早期利上げ観測を受けて英国債利回りは上昇しましたが、BOE（イングランド銀行）が市場予想に反して政策金利を据え置くと、作成期半ばにかけて低下しました。作成期後半は、BOEによる政策金利の引き上げなどから英国債利回りは上昇しました。

### 【ハイブリッド証券市場】

ハイブリッド証券の価格は下落しました。オミクロン株の感染拡大や欧米の中央銀行による金融政策の正常化への動きに加え、ウクライナ情勢の深刻化などにより投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、ハイブリッド証券のスプレッドは拡大しました。

### 【為替市場】

トルコ・リラ円為替レートは円高トルコ・リラ安となりました。インフレ率が高水準で留まったものの、エルドアン大統領からの利下げ圧力を受けて、トルコ中央銀行が政策金利の引き下げに動いたことから、作成期半ばにかけて大きく円高トルコ・リラ安が進行しました。

## ■ポートフォリオについて

### ＜東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）トルコ・リラコース（毎月分配型）＞

当ファンドは、「東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンドートルコ・リラクラス」（以下、外国投資信託証券）および「東京海上マネーマザーファンド」（以下、親投資信託）を投資対象とし、外国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、外国投資信託証券の値動きを反映し、36.8%下落しました。

### ＜外国投資信託証券＞

作成期間を通じて、ハイブリッド証券等の組入比率を高位に維持しました。

当作成期は、新型コロナウイルスの感染状況や欧米中央銀行の金融政策に対する姿勢、ウクライナ情勢などが相場の変動要因となるなか、発行体の財務状況を改めて精査し、市場流動性などを勘案して運用を行いました。

また、原資産通貨売り／トルコ・リラ買いの為替取引を行い、トルコ・リラの通貨比率を高位に保つ運用を行いました。

以上のような運用の結果、基準価額（分配金再投資）は下落しました。

### ＜親投資信託＞

元本の安全性と流動性を重視し、地方債を中心とする円建て短期公社債に投資して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98期                       | 第99期                        | 第100期                       | 第101期                      | 第102期                     | 第103期                     |
|-----------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------|
|           | 2021年9月18日～<br>2021年10月18日 | 2021年10月19日～<br>2021年11月17日 | 2021年11月18日～<br>2021年12月17日 | 2021年12月18日～<br>2022年1月17日 | 2022年1月18日～<br>2022年2月17日 | 2022年2月18日～<br>2022年3月17日 |
| 当期分配金     | 50                         | 50                          | 20                          | 20                         | 20                        | 20                        |
| (対基準価額比率) | 3.751%                     | 4.284%                      | 2.670%                      | 2.398%                     | 2.484%                    | 2.677%                    |
| 当期の収益     | 30                         | 30                          | 10                          | 19                         | 19                        | 19                        |
| 当期の収益以外   | 20                         | 20                          | 10                          | 0                          | 0                         | 0                         |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,708                      | 1,691                       | 1,691                       | 1,691                      | 1,690                     | 1,690                     |

(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。

(注) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

## ○今後の運用方針

### <東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)トルコ・リラコース(毎月分配型)>

外国投資信託証券および親投資信託を投資対象とし、外国投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。

### <外国投資信託証券>

世界経済は新型コロナウイルス感染拡大の影響による大幅な成長鈍化からの回復局面にあるとみていますが、米国や欧州、英国では金融政策の正常化に向けて動き始めており、その影響には注意が必要と考えます。また、ロシアによるウクライナ侵攻に対し、米国やEU(欧州連合)、その他諸国からのロシアへの経済制裁が強化されており、この問題のエネルギー市場やマクロ経済、金融市場への影響などについて慎重に見極めていくことが必要と考えています。

このような市場環境下、財務状況が健全と考える米国、英国、ユーロ圏、北欧などの金融機関を中心に引き続き財務状況を精査し、ハイブリッド証券等の組入比率について現在の水準を維持する方針です。

また、原資産通貨売り／トルコ・リラ買いの為替取引を行い、トルコ・リラの通貨比率を高位に保つ運用を行います。

### <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9月18日～2022年3月17日)

| 項 目                  | 第98期～第103期 |            | 項 目 の 概 要                                         |
|----------------------|------------|------------|---------------------------------------------------|
|                      | 金 額        | 比 率        |                                                   |
| (a) 信 託 報 酬          | 円<br>5     | %<br>0.503 | (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 )          | (2)        | (0.153)    | * 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 )          | (3)        | (0.338)    | * 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 )          | (0)        | (0.012)    | * 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        | 0          | 0.005      | (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 )          | (0)        | (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                  | 5          | 0.508      |                                                   |
| 作成期間の平均基準価額は、995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。

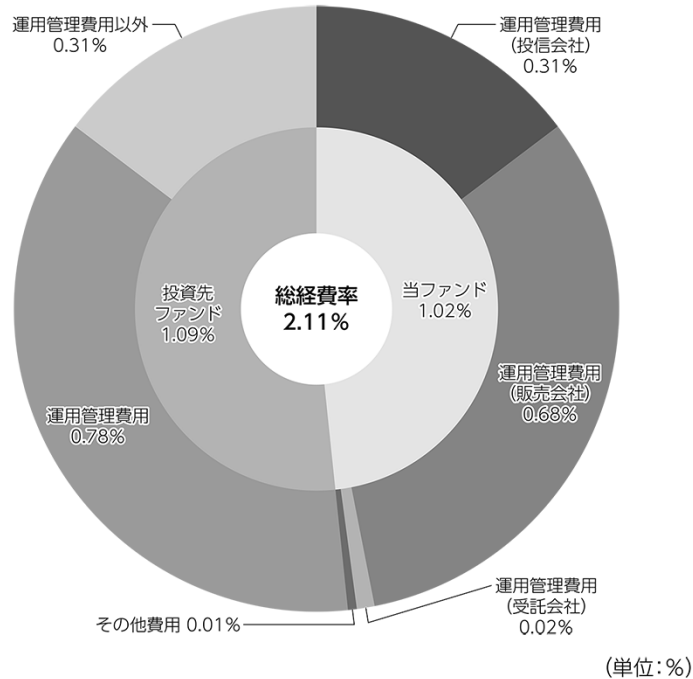
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）が支払った費用を含みません。

(注) 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2.11%です。



|                      |      |
|----------------------|------|
| 総経費率(①+②+③)          | 2.11 |
| ①当ファンドの費用の比率         | 1.02 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率   | 0.78 |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.31 |

- (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。
- (注) 投資先ファンドの費用は、「東京海上ストラテジック・トラスト東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド」の費用を基に算出しています。



## ○売買及び取引の状況

(2021年9月18日～2022年3月17日)

### 投資信託証券

| 銘            |      |                                                                                     | 第98期～第103期 |         |     |         |
|--------------|------|-------------------------------------------------------------------------------------|------------|---------|-----|---------|
|              |      |                                                                                     | 買 付        |         | 売 付 |         |
|              |      |                                                                                     | 口 数        | 金 額     | 口 数 | 金 額     |
| 外 国<br>(邦貨建) | ケイマン | 東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Rogge<br>グローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・<br>フ ァ ン ド ー ト ル コ ・ リ ラ ク ラ ス | 千口         | 千円      | 千口  | 千円      |
|              |      |                                                                                     | 177        | 178,000 | 318 | 242,000 |

(注) 金額は受渡代金です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年9月18日～2022年3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3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                                                                                   |  | 第97期末 | 第103期末 |           |      |
|-------------------------------------------------------------------------------------|--|-------|--------|-----------|------|
|                                                                                     |  | 口 数   | 口 数    | 評 価 額     | 比 率  |
|                                                                                     |  | 千口    | 千口     | 千円        | %    |
| 東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Rogge<br>グローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・<br>フ ァ ン ド ー ト ル コ ・ リ ラ ク ラ ス |  | 1,636 | 1,495  | 1,096,445 | 98.5 |
| 合 計                                                                                 |  | 1,636 | 1,495  | 1,096,445 | 98.5 |

(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              |  | 第97期末 | 第103期末 |       |
|----------------|--|-------|--------|-------|
|                |  | 口 数   | 口 数    | 評 価 額 |
|                |  | 千口    | 千口     | 千円    |
| 東京海上マネーマザーファンド |  | 9     | 9      | 10    |

## ○投資信託財産の構成

(2022年3月17日現在)

| 項 目            | 第103期末    |       |
|----------------|-----------|-------|
|                | 評 価 額     | 比 率   |
|                | 千円        | %     |
| 投資信託受益証券       | 1,096,445 | 95.8  |
| 東京海上マネーマザーファンド | 10        | 0.0   |
| コール・ローン等、その他   | 47,709    | 4.2   |
| 投資信託財産総額       | 1,144,164 | 100.0 |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目                 | 第98期末           | 第99期末           | 第100期末          | 第101期末          | 第102期末          | 第103期末          |
|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
|                     | 2021年10月18日現在   | 2021年11月17日現在   | 2021年12月17日現在   | 2022年1月17日現在    | 2022年2月17日現在    | 2022年3月17日現在    |
|                     | 円               | 円               | 円               | 円               | 円               | 円               |
| (A) 資産              | 2,206,235,616   | 2,024,121,621   | 1,280,238,877   | 1,327,070,089   | 1,242,310,779   | 1,144,164,947   |
| コール・ローン等            | 114,930,013     | 122,030,373     | 49,883,706      | 70,448,586      | 56,105,619      | 47,709,735      |
| 投資信託受益証券(評価額)       | 2,091,295,591   | 1,902,081,235   | 1,200,345,158   | 1,256,611,491   | 1,186,195,148   | 1,096,445,200   |
| 東京海上マネーマザーファンド(評価額) | 10,012          | 10,013          | 10,013          | 10,012          | 10,012          | 10,012          |
| 未収入金                | —               | —               | 30,000,000      | —               | —               | —               |
| (B) 負債              | 90,425,657      | 105,115,764     | 56,305,165      | 46,708,558      | 71,099,102      | 31,517,989      |
| 未払金                 | —               | —               | —               | —               | 40,000,000      | —               |
| 未払収益分配金             | 82,449,372      | 85,932,194      | 33,573,655      | 31,462,099      | 29,824,010      | 30,611,109      |
| 未払解約金               | 6,036,497       | 17,406,715      | 21,405,627      | 14,052,788      | 154,723         | —               |
| 未払信託報酬              | 1,918,838       | 1,757,677       | 1,311,621       | 1,180,812       | 1,108,325       | 897,156         |
| 未払利息                | 175             | 149             | 65              | 84              | 53              | 19              |
| その他未払費用             | 20,775          | 19,029          | 14,197          | 12,775          | 11,991          | 9,705           |
| (C) 純資産総額(A－B)      | 2,115,809,959   | 1,919,005,857   | 1,223,933,712   | 1,280,361,531   | 1,171,211,677   | 1,112,646,958   |
| 元本                  | 16,489,874,463  | 17,186,438,850  | 16,786,827,558  | 15,731,049,636  | 14,912,005,089  | 15,305,554,729  |
| 次期繰越損益金             | △14,374,064,504 | △15,267,432,993 | △15,562,893,846 | △14,450,688,105 | △13,740,793,412 | △14,192,907,771 |
| (D) 受益権総口数          | 16,489,874,463口 | 17,186,438,850口 | 16,786,827,558口 | 15,731,049,636口 | 14,912,005,089口 | 15,305,554,729口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)     | 1,283円          | 1,117円          | 729円            | 814円            | 785円            | 727円            |

(注) 当ファンドの第98期首元本額は16,168,677,691円、第98～103期中追加設定元本額は3,536,127,777円、第98～103期中一部解約元本額は4,399,250,739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98期                           | 第99期                        | 第100期                       | 第101期                          | 第102期                             | 第103期                             |
|-------------------|--------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|--------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
|                   | 2021年 9 月 18 日～<br>2021年10月18日 | 2021年10月19日～<br>2021年11月17日 | 2021年11月18日～<br>2021年12月17日 | 2021年12月18日～<br>2022年 1 月 17 日 | 2022年 1 月 18 日～<br>2022年 2 月 17 日 | 2022年 2 月 18 日～<br>2022年 3 月 17 日 |
|                   | 円                              | 円                           | 円                           | 円                              | 円                                 | 円                                 |
| (A) 配当等収益         | 56,279,038                     | 55,940,939                  | 34,770,139                  | 31,112,372                     | 30,387,397                        | 31,411,908                        |
| 受取配当金             | 56,281,174                     | 55,943,663                  | 34,771,497                  | 31,113,964                     | 30,388,334                        | 31,412,482                        |
| 受取利息              | —                              | —                           | —                           | 1                              | —                                 | 10                                |
| 支払利息              | △ 2,136                        | △ 2,724                     | △ 1,358                     | △ 1,593                        | △ 937                             | △ 584                             |
| (B) 有価証券売買損益      | △ 137,624,366                  | △ 249,221,427               | △ 644,059,511               | 133,597,202                    | △ 41,664,980                      | △ 88,838,850                      |
| 売買益               | 746,743                        | 4,963,260                   | 20,293,715                  | 148,730,536                    | 1,436,119                         | 837,007                           |
| 売買損               | △ 138,371,109                  | △ 254,184,747               | △ 664,353,226               | △ 15,133,334                   | △ 43,101,099                      | △ 89,675,857                      |
| (C) 信託報酬等         | △ 1,939,613                    | △ 1,776,706                 | △ 1,325,818                 | △ 1,193,587                    | △ 1,120,316                       | △ 906,861                         |
| (D) 当期損益金 (A+B+C) | △ 83,284,941                   | △ 195,057,254               | △ 610,615,190               | 163,515,987                    | △ 12,397,899                      | △ 58,333,803                      |
| (E) 前期繰越損益金       | △ 1,596,363,496                | △ 1,670,926,469             | △ 1,811,285,237             | △ 2,255,198,957                | △ 1,984,096,113                   | △ 1,982,130,961                   |
| (F) 追加信託差損益金      | △ 12,611,966,695               | △ 13,315,517,076            | △ 13,107,419,764            | △ 12,327,543,036               | △ 11,714,475,390                  | △ 12,121,831,898                  |
| (配当等相当額)          | ( 2,807,300,808)               | ( 2,896,786,248)            | ( 2,797,435,304)            | ( 2,606,412,415)               | ( 2,471,608,306)                  | ( 2,539,207,318)                  |
| (売買損益相当額)         | (△ 15,419,267,503)             | (△ 16,212,303,324)          | (△ 15,904,855,068)          | (△ 14,933,955,451)             | (△ 14,186,083,696)                | (△ 14,661,039,216)                |
| (G) 計 (D+E+F)     | △ 14,291,615,132               | △ 15,181,500,799            | △ 15,529,320,191            | △ 14,419,226,006               | △ 13,710,969,402                  | △ 14,162,296,662                  |
| (H) 収益分配金         | △ 82,449,372                   | △ 85,932,194                | △ 33,573,655                | △ 31,462,099                   | △ 29,824,010                      | △ 30,611,109                      |
| 次期繰越損益金 (G+H)     | △ 14,374,064,504               | △ 15,267,432,993            | △ 15,562,893,846            | △ 14,450,688,105               | △ 13,740,793,412                  | △ 14,192,907,771                  |
| 追加信託差損益金          | △ 12,644,946,444               | △ 13,349,889,954            | △ 13,124,206,592            | △ 12,327,543,036               | △ 11,714,475,390                  | △ 12,121,831,898                  |
| ( 2,774,321,059)  | ( 2,774,321,059)               | ( 2,862,413,370)            | ( 2,780,648,476)            | ( 2,606,412,415)               | ( 2,471,608,306)                  | ( 2,539,207,318)                  |
| (売買損益相当額)         | (△ 15,419,267,503)             | (△ 16,212,303,324)          | (△ 15,904,855,068)          | (△ 14,933,955,451)             | (△ 14,186,083,696)                | (△ 14,661,039,216)                |
| 分配準備積立金           | 43,480,473                     | 44,622,102                  | 58,806,929                  | 53,807,063                     | 49,726,203                        | 48,535,786                        |
| 繰越損益金             | △ 1,772,598,533                | △ 1,962,165,141             | △ 2,497,494,183             | △ 2,176,952,132                | △ 2,076,044,225                   | △ 2,119,611,659                   |

(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98期                           | 第99期                        | 第100期                       | 第101期                          | 第102期                             | 第103期                             |
|---------------------|--------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|--------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
|                     | 2021年 9 月 18 日～<br>2021年10月18日 | 2021年10月19日～<br>2021年11月17日 | 2021年11月18日～<br>2021年12月17日 | 2021年12月18日～<br>2022年 1 月 17 日 | 2022年 1 月 18 日～<br>2022年 2 月 17 日 | 2022年 2 月 18 日～<br>2022年 3 月 17 日 |
| a. 配当等収益(費用控除後)     | 54,339,425円                    | 54,164,234円                 | 33,444,321円                 | 30,886,903円                    | 29,267,081円                       | 30,505,049円                       |
| b. 有価証券等損益額(費用控除後)  | 0円                             | 0円                          | 0円                          | 0円                             | 0円                                | 0円                                |
| c. 信託約款に規定する収益調整金   | 2,807,300,808円                 | 2,896,786,248円              | 2,797,435,304円              | 2,606,412,415円                 | 2,471,608,306円                    | 2,539,207,318円                    |
| d. 信託約款に規定する分配準備積立金 | 38,610,671円                    | 42,017,184円                 | 42,149,435円                 | 54,382,259円                    | 50,283,132円                       | 48,641,846円                       |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d)  | 2,900,250,904円                 | 2,992,967,666円              | 2,873,029,060円              | 2,691,681,577円                 | 2,551,158,519円                    | 2,618,354,213円                    |
| f. 分配対象収益(1万円当たり)   | 1,758円                         | 1,741円                      | 1,711円                      | 1,711円                         | 1,710円                            | 1,710円                            |
| g. 分配金              | 82,449,372円                    | 85,932,194円                 | 33,573,655円                 | 31,462,099円                    | 29,824,010円                       | 30,611,109円                       |
| h. 分配金(1万円当たり)      | 50円                            | 50円                         | 20円                         | 20円                            | 20円                               | 20円                               |

## ○分配金のお知らせ

|                 | 第98期 | 第99期 | 第100期 | 第101期 | 第102期 | 第103期 |
|-----------------|------|------|-------|-------|-------|-------|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 50円  | 50円  | 20円   | 20円   | 20円   | 20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3月17日現在)

### <東京海上マネーマザーファンド>

下記は、東京海上マネーマザーファンド全体(10,318千口)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103期末  |         |         |                    |           |      |        |
|-------|---------|---------|---------|--------------------|-----------|------|--------|
|       | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 組 入 比 率 | うちBB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      | %       | %                  | %         | %    | %      |
|       | 9,000   | 9,008   | 86.3    | —                  | —         | —    | 86.3   |
|       | (9,000) | (9,008) | (86.3)  | (—)                | (—)       | (—)  | (86.3) |
| 合 計   | 9,000   | 9,008   | 86.3    | —                  | —         | —    | 86.3   |
|       | (9,000) | (9,008) | (86.3)  | (—)                | (—)       | (—)  | (86.3) |

- (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103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24年度第3回静岡県公募公債 | 0.906  | 3,000   | 3,004 | 2022/5/20 |
| 平成23年度第9回千葉県公募公債 | 1.0    | 3,000   | 3,000 | 2022/3/25 |
| 平成23年度第3回福井県公募公債 | 1.03   | 3,000   | 3,003 | 2022/4/25 |
| 合 計              |        | 9,000   | 9,008 |           |

(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。

<参考情報>

東京海上ストラテジック・トラストー  
東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド  
(日本円クラス／米ドルクラス／ユーロクラス／豪ドルクラス／  
ブラジル・リアルクラス／メキシコ・ペソクラス／トルコ・リラクラス／  
ロシア・ルーブルクラス／資源国通貨バスケットクラス)  
(外国投資信託 ケイマン諸島籍) の運用状況

東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンドは、「東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）」が投資対象とする外国投資信託証券です。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|-----------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 形 態       | ケイマン諸島籍契約型外国投資信託／円建て                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 運 用 方 針   | 世界の金融機関が発行するハイブリッド証券等を主要投資対象とし、安定したインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることをめざします。また、為替取引を用いて、各クラスで定められた通貨（日本円クラス＝日本円、米ドルクラス＝米ドル、ユーロクラス＝ユーロ、豪ドルクラス＝豪ドル、ブラジル・リアルクラス＝ブラジル・リアル、メキシコ・ペソクラス＝メキシコ・ペソ、トルコ・リラクラス＝トルコ・リラ、ロシア・ルーブルクラス＝ロシア・ルーブル、資源国通貨バスケットクラス＝豪ドル／ブラジル・リアル／南アフリカ・ランド（比率は概ね3分の1ずつ））への投資効果を追求します。        |
| 主な投資制限    | 原則として、純資産総額の10%を超える借入れは行わないものとします。                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 収 益 分 配   | 原則として、毎月分配を行います。                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 信 託 期 間   | 原則として2026年9月10日まで                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 決 算 日     | 原則として毎年2月末日                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 信 託 報 酬 等 | ファンドの純資産総額に対し年率0.667%を乗じて得た額が投資顧問会社、副投資顧問会社、管理会社、副管理会社、保管銀行ならびに事務代行会社への報酬の合計額としてファンドから支払われます。またファンドの純資産総額に対し年率0.01%（ただし、年額10,000米ドルを下回らないものとします。）を乗じて得た額が受託会社への報酬としてファンドから支払われます。この他、ファンドは、ファンドの設立に係る費用（ファンドの3会計期間にわたり償却）、組入有価証券の売買委託手数料等の取引に要する費用、組入有価証券の保管に要する費用、信託財産に関する租税、監査報酬、法的費用等を負担します。 |
| 関 係 法 人   | 受託会社：FirstCaribbean International Bank and Trust Company (Cayman) Limited<br>管理会社、保管銀行、事務代行会社：ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S. A.<br>副管理会社：MUFGルクスマネジメントカンパニーS. A.<br>投資顧問会社：東京海上アセットマネジメント株式会社<br>副投資顧問会社：Allianz Global Investors GmbH                                                              |

※資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## (1) 損益計算書

2020年3月1日  
～2021年2月28日

(円)

|                            |                       |
|----------------------------|-----------------------|
| 当期中における純資産額                | 39,124,693,159        |
| <b>収益</b>                  |                       |
| 銀行預金に係る受取利息                | 703,440               |
| 債券に係る受取利息（純額）              | 1,258,382,669         |
| その他収益                      | 480,223               |
| <b>収益合計</b>                | <b>1,259,566,332</b>  |
| <b>費用</b>                  |                       |
| 管理事務代行報酬、管理報酬および保管機関報酬     | ( 46,510,493)         |
| 代行協会員報酬                    | ( 7,983,937)          |
| 販売報酬                       | ( 94,304,801)         |
| 当座借越に係る支払利息                | ( 419,127)            |
| 投資顧問報酬                     | ( 236,949,970)        |
| その他の費用                     | ( 12,451,387)         |
| 諸税金                        | ( 2,055,826)          |
| 専門家報酬                      | ( 2,768,582)          |
| 副保管機関報酬                    | ( 1,833,260)          |
| 副管理者報酬                     | ( 9,302,090)          |
| 受託報酬                       | ( 3,701,717)          |
| <b>費用合計</b>                | <b>( 418,281,190)</b> |
| <b>投資純利益／（損失）</b>          | <b>841,285,142</b>    |
| 投資に係る実現純利益／（損失）            | 1,144,632,990         |
| 為替予約および為替先渡取引に係る実現純利益／（損失） | ( 1,601,071,653)      |
| <b>当期実現純利益／（損失）</b>        | <b>( 456,438,663)</b> |
| 以下に係る未実現純利益（損失）の増減         |                       |
| －投資                        | 666,534,248           |
| －為替予約および為替先渡取引             | ( 11,945,127)         |
| －その他の資産および負債の為替換算          | 197,772,506           |
|                            | <b>852,361,627</b>    |
| <b>運用による純資産の増加／（減少）額</b>   | <b>1,237,208,106</b>  |

(ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S. A. 提供の監査財務諸表より作成)

## (2) 組入有価証券の明細

2021年2月28日現在

| 国名         | 銘柄名                      | 証券種類   | 償還年月日      | 利率<br>(%) | 通貨  | 評価額 (邦貨建金額)<br>(円) | 組入比率<br>(%) |
|------------|--------------------------|--------|------------|-----------|-----|--------------------|-------------|
| アメリカ       | GOLDMAN SACHS CAPITAL I  | 優先出資証券 | 2034/2/15  | 6.345     | USD | 764,120,599        | 2.0         |
|            | DISCOVER BANK            | 期限付劣後債 | 2023/8/9   | 4.682     | USD | 595,002,677        | 1.6         |
|            | TRUIST BANK              | 期限付劣後債 | 2024/9/17  | 2.636     | USD | 561,860,001        | 1.5         |
|            | ATHENE GLOBAL FUNDING    | その他    | 2027/8/20  | 2.45      | USD | 519,430,552        | 1.4         |
|            | BANK OF AMERICA CORP     | 期限付劣後債 | 2038/5/14  | 7.75      | USD | 501,855,836        | 1.3         |
|            | PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 期限付劣後債 | 2023/6/15  | 5.625     | USD | 474,231,596        | 1.2         |
|            | CNA FINANCIAL CORP       | その他    | 2030/5/15  | 2.05      | USD | 429,562,890        | 1.1         |
|            | DIGITAL REALTY TRUST LP  | その他    | 2028/4/15  | 4.45      | USD | 422,153,459        | 1.1         |
|            | CHUBB INA HOLDINGS INC   | その他    | 2037/9/15  | 2.5       | EUR | 409,511,591        | 1.1         |
|            | JPMORGAN CHASE & CO      | 期限付劣後債 | 2030/5/13  | 2.956     | USD | 377,504,249        | 1.0         |
|            | AMERICAN HOMES 4 RENT    | その他    | 2027/11/15 | 4.25      | USD | 376,641,648        | 1.0         |
|            | MORGAN STANLEY           | 期限付劣後債 | 2027/4/23  | 3.95      | USD | 362,406,572        | 0.9         |
|            | CAPITAL ONE FINANCIAL CO | その他    | 2029/6/12  | 1.65      | EUR | 288,047,095        | 0.8         |
|            | METLIFE INC              | 期限付劣後債 | 2031/12/15 | 6.4       | USD | 268,480,801        | 0.7         |
|            | EQUITABLE HOLDINGS INC   | その他    | 2047/10/20 | 5         | USD | 245,570,967        | 0.6         |
|            | FIRST HORIZON BANK       | 期限付劣後債 | 2030/2/1   | 5.75      | USD | 203,666,766        | 0.5         |
|            | SYNOVUS BANK GA          | 期限付劣後債 | 2025/10/29 | 4         | USD | 198,030,693        | 0.5         |
|            | PRINCIPAL FINANCIAL GRP  | 期限付劣後債 | 2021/4/1   | 3.24163   | USD | 193,896,142        | 0.5         |
|            | AMERICAN INTL GROUP      | 期限付劣後債 | 2028/4/1   | 5.75      | USD | 193,781,772        | 0.5         |
|            | CITIGROUP INC            | その他    | 2039/7/15  | 8.125     | USD | 184,568,059        | 0.5         |
|            | HARTFORD FINL SVCS GRP   | 期限付劣後債 | 2021/4/1   | 2.31875   | USD | 175,248,606        | 0.5         |
|            | LEXINGTON REALTY TRUST   | その他    | 2030/6/15  | 2.7       | USD | 144,864,570        | 0.4         |
|            | DIGITAL DUTCH FINCO BV   | その他    | 2031/10/15 | 1         | EUR | 127,374,599        | 0.3         |
|            | NASDAQ INC               | その他    | 2049/10/28 | 3.25      | USD | 95,297,260         | 0.2         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 8,113,109,000      | 21.2        |
| イギリス       | STANDARD CHARTERED PLC   | 期限付劣後債 | 2027/2/19  | 4.3       | USD | 700,492,886        | 1.8         |
|            | HSBC BANK USA NA         | 期限付劣後債 | 2039/1/15  | 7         | USD | 482,290,601        | 1.3         |
|            | HSBC HOLDINGS PLC        | 期限付劣後債 | 2038/6/1   | 6.8       | USD | 471,091,916        | 1.2         |
|            | HASTINGS GROUP FINANCE   | その他    | 2025/2/24  | 3         | GBP | 445,168,014        | 1.2         |
|            | PHOENIX GRP HLD PLC      | 期限付劣後債 | 2029/1/24  | 4.375     | EUR | 430,986,542        | 1.1         |
|            | VIRGIN MONEY UK PLC      | その他    | 2024/6/22  | 3.125     | GBP | 411,546,294        | 1.1         |
|            | AVIVA PLC                | 期限付劣後債 | 2035/3/3   | 4         | GBP | 321,981,025        | 0.8         |
|            | NATWEST GROUP PLC        | その他    | 2028/5/18  | 4.892     | USD | 310,697,277        | 0.8         |
|            | NATIONWIDE BLDG SOCIETY  | その他    | 2029/7/18  | 3.96      | USD | 287,182,407        | 0.8         |
|            | HSBC BANK PLC            | 永久劣後債  | 2021/3/31  | 0.75      | USD | 217,898,699        | 0.6         |
|            | M&G PLC                  | 期限付劣後債 | 2031/10/20 | 5.625     | GBP | 215,103,856        | 0.6         |
|            | BARCLAYS PLC             | 期限付劣後債 | 2023/2/7   | 2         | EUR | 205,318,071        | 0.5         |
|            | M&G PLC                  | 期限付劣後債 | 2035/7/20  | 5.56      | GBP | 203,602,257        | 0.5         |
|            | LLOYDS BANKING GROUP PLC | 永久劣後債  | 2024/12/27 | 5.125     | GBP | 199,355,895        | 0.5         |
|            | RL FINANCE NO 4 PLC      | 期限付劣後債 | 2039/4/7   | 4.875     | GBP | 194,116,298        | 0.5         |
|            | HSBC HOLDINGS PLC        | 永久劣後債  | 2021/6/1   | 6.875     | USD | 189,346,085        | 0.5         |
|            | HSBC HOLDINGS PLC        | 期限付劣後債 | 2040/3/29  | 6         | GBP | 165,092,992        | 0.4         |
|            | STANDARD CHARTERED PLC   | 期限付劣後債 | 2043/1/9   | 5.3       | USD | 149,735,365        | 0.4         |
|            | PHOENIX GRP HLD PLC      | 期限付劣後債 | 2026/6/4   | 4.75      | USD | 68,251,655         | 0.2         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 5,669,258,135      | 14.8        |
| イタリア       | UNICREDIT SPA            | 期限付劣後債 | 2024/9/23  | 2         | EUR | 586,262,168        | 1.5         |
|            | ASSICURAZIONI GENERALI   | 期限付劣後債 | 2028/6/8   | 5         | EUR | 392,310,712        | 1.0         |
|            | ASSICURAZIONI GENERALI   | 期限付劣後債 | 2030/10/1  | 2.124     | EUR | 108,965,628        | 0.3         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 1,087,538,508      | 2.8         |
| オーストラリア    | AUST & NZ BANKING GROUP  | 期限付劣後債 | 2026/5/5   | 0.669     | EUR | 579,173,776        | 1.5         |
|            | COMMONWEALTH BANK AUST   | 期限付劣後債 | 2029/9/12  | 3.61      | USD | 383,466,654        | 1.0         |
|            | NATIONAL AUSTRALIA BANK  | 期限付劣後債 | 2030/8/21  | 2.332     | USD | 374,925,768        | 1.0         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 1,337,566,198      | 3.5         |
| オランダ       | DE VOLKSBANK NV          | 期限付劣後債 | 2025/10/22 | 1.75      | EUR | 516,441,750        | 1.4         |
|            | NN GROUP NV              | 永久劣後債  | 2026/1/15  | 4.5       | EUR | 485,176,606        | 1.3         |
|            | ASR NEDERLAND NV         | 期限付劣後債 | 2029/2/2   | 3.375     | EUR | 323,938,342        | 0.8         |

| 国名         | 銘柄名                      | 証券種類   | 償還年月日      | 利率<br>(%) | 通貨  | 評価額 (邦貨建金額)<br>(円) | 組入比率<br>(%) |
|------------|--------------------------|--------|------------|-----------|-----|--------------------|-------------|
| オランダ       | ARGENTUM (SWISS RE LTD)  | 永久劣後債  | 2022/8/15  | 4.625     | USD | 196,090,706        | 0.5         |
|            | AEGON NV                 | 優先出資証券 | 2021/4/15  | 1.207     | USD | 190,706,601        | 0.5         |
|            | COOPERATIEVE RABOBANK UA | 優先出資証券 | 2027/6/29  | 4.375     | EUR | 171,108,221        | 0.4         |
|            | ING GROEP NV             | 期限付劣後債 | 2026/2/26  | 2.125     | EUR | 164,250,733        | 0.4         |
|            | ELM BV(HELVETIA SCHWEIZ) | 期限付劣後債 | 2027/9/29  | 3.375     | EUR | 138,243,280        | 0.4         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 2,185,956,239      | 5.7         |
| スイス        | CREDIT SUISSE GROUP AG   | その他    | 2027/6/9   | 2.25      | GBP | 431,688,311        | 1.1         |
|            | SWISS RE FINANCE LUX     | 永久劣後債  | 2024/9/4   | 4.25      | USD | 199,799,577        | 0.5         |
|            | UBS GROUP AG             | 永久劣後債  | 2026/7/29  | 5.125     | USD | 193,243,851        | 0.5         |
|            | ZURICH FINANCE IRELAND   | 期限付劣後債 | 2031/1/19  | 3         | USD | 188,789,946        | 0.5         |
|            | ZURICH FINANCE (UK) PLC  | 永久劣後債  | 2022/10/2  | 6.625     | GBP | 122,292,791        | 0.3         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 1,135,814,476      | 3.0         |
| スペイン       | BANCO SANTANDER MEXICO   | その他    | 2025/4/17  | 5.375     | USD | 588,677,291        | 1.5         |
|            | BANCO SANTANDER SA       | 期限付劣後債 | 2027/1/19  | 3.125     | EUR | 437,050,430        | 1.1         |
|            | SANTANDER UK GROUP HLDGS | 期限付劣後債 | 2045/9/15  | 5.625     | USD | 203,239,967        | 0.5         |
|            | MAPFRE SA                | 期限付劣後債 | 2027/3/31  | 4.375     | EUR | 89,329,686         | 0.2         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 1,318,297,374      | 3.4         |
| デンマーク      | DANSKE BANK A/S          | 期限付劣後債 | 2026/2/15  | 1         | EUR | 384,075,208        | 1.0         |
|            | DANSKE BANK A/S          | 期限付劣後債 | 2024/6/21  | 2.5       | EUR | 306,861,543        | 0.8         |
|            | JYSKE BANK A/S           | 期限付劣後債 | 2026/1/28  | 1.25      | EUR | 291,102,821        | 0.8         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 982,039,572        | 2.6         |
| ドイツ        | DEUTSCHE BANK AG         | その他    | 2025/9/3   | 1.375     | EUR | 439,932,546        | 1.2         |
|            | MUNICH RE                | 期限付劣後債 | 2029/5/26  | 3.25      | EUR | 299,107,944        | 0.8         |
|            | LB BADEN-WUERTEMBERG     | 期限付劣後債 | 2025/6/16  | 3.625     | EUR | 282,694,716        | 0.7         |
|            | HANNOVER RE              | 期限付劣後債 | 2029/7/9   | 1.125     | EUR | 219,001,236        | 0.6         |
|            | DEUTSCHE BANK AG         | その他    | 2031/2/17  | 1.375     | EUR | 167,449,678        | 0.4         |
|            | MUNICH RE                | 期限付劣後債 | 2030/11/26 | 1.25      | EUR | 90,677,570         | 0.2         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 1,498,863,690      | 3.9         |
| ノルウェー      | DNB BANK ASA             | 永久劣後債  | 2024/11/12 | 4.875     | USD | 223,910,858        | 0.6         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 223,910,858        | 0.6         |
| フランス       | AXA SA                   | 永久劣後債  | 2026/3/4   | 5.453     | GBP | 808,685,487        | 2.1         |
|            | CREDIT AGRICOLE SA       | 期限付劣後債 | 2025/3/17  | 4.375     | USD | 758,728,449        | 2.0         |
|            | BPCE SA                  | 期限付劣後債 | 2025/3/15  | 4.5       | USD | 741,256,060        | 1.9         |
|            | BNP PARIBAS              | 期限付劣後債 | 2025/9/28  | 4.375     | USD | 676,021,074        | 1.8         |
|            | LA BANQUE POSTALE        | 期限付劣後債 | 2027/5/3   | 0.75      | EUR | 381,382,802        | 1.0         |
|            | BANQUE FED CRED MUTUEL   | 期限付劣後債 | 2026/3/24  | 2.375     | EUR | 365,825,558        | 1.0         |
|            | CNP ASSURANCES           | 期限付劣後債 | 2030/7/27  | 2         | EUR | 307,324,567        | 0.8         |
|            | CREDIT AGRICOLE ASSRNCES | 期限付劣後債 | 2028/1/29  | 2.625     | EUR | 274,953,881        | 0.7         |
|            | CREDIT AGRICOLE SA       | 永久劣後債  | 2027/12/23 | 4         | EUR | 196,231,654        | 0.5         |
|            | LA MONDIALE              | 期限付劣後債 | 2026/1/20  | 0.75      | EUR | 181,851,206        | 0.5         |
|            | XLIT LTD                 | 期限付劣後債 | 2027/6/29  | 3.25      | EUR | 174,030,302        | 0.5         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 4,866,291,040      | 12.7        |
| 日本         | DAI-ICHI LIFE INSURANCE  | 永久劣後債  | 2024/10/28 | 5.1       | USD | 817,039,944        | 2.1         |
|            | MITSUI SUMITOMO INSURANC | 永久劣後債  | 2029/3/6   | 4.95      | USD | 381,915,645        | 1.0         |
|            | NIPPON LIFE INSURANCE    | 期限付劣後債 | 2031/1/21  | 2.75      | USD | 312,144,090        | 0.8         |
|            | SUMITOMO MITSUI FINL GRP | 期限付劣後債 | 2029/9/17  | 3.202     | USD | 306,775,270        | 0.8         |
|            | AVIATION CAPITAL GROUP   | その他    | 2025/7/1   | 4.875     | USD | 215,163,510        | 0.6         |
|            | AVIATION CAPITAL GROUP   | その他    | 2027/7/1   | 3.5       | USD | 152,515,322        | 0.4         |
|            | SOMPO JAPAN INSURANCE    | 期限付劣後債 | 2023/3/28  | 5.325     | USD | 148,104,430        | 0.4         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 2,333,658,211      | 6.1         |
| 中国         | CHINA CONSTRUCTION BANK  | 優先出資証券 | 2025/6/24  | 2.45      | USD | 568,899,631        | 1.5         |
|            | AVOLON HOLDINGS FNDG LTD | その他    | 2026/1/21  | 2.125     | USD | 332,920,722        | 0.9         |
|            | HUARONG FINANCE 2019     | その他    | 2030/6/30  | 3.625     | USD | 139,907,796        | 0.4         |
|            | AVOLON HOLDINGS FNDG LTD | その他    | 2026/3/15  | 4.25      | USD | 78,902,033         | 0.2         |
|            | AVOLON HOLDINGS FNDG LTD | その他    | 2026/3/1   | 4.375     | USD | 73,995,845         | 0.2         |
|            | AVOLON HOLDINGS FNDG LTD | その他    | 2025/12/15 | 5.5       | USD | 67,154,623         | 0.2         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 1,261,780,650      | 3.3         |
| オーストリア     | BAWAG GROUP AG           | 期限付劣後債 | 2024/3/26  | 2.375     | EUR | 534,725,799        | 1.4         |
|            | UNIQA INSURANCE GROUP AG | その他    | 2030/4/9   | 1.375     | EUR | 264,714,850        | 0.7         |



| 国名         | 銘柄名                      | 証券種類   | 償還年月日      | 利率<br>(%) | 通貨  | 評価額 (邦貨建金額)<br>(円) | 組入比率<br>(%) |
|------------|--------------------------|--------|------------|-----------|-----|--------------------|-------------|
| オーストリア     | RAIFFEISEN BANK INTL     | 期限付劣後債 | 2027/6/18  | 2.875     | EUR | 249,672,163        | 0.7         |
|            | ERSTE GROUP BANK AG      | 永久劣後債  | 2027/10/15 | 4.25      | EUR | 215,193,848        | 0.6         |
|            | ERSTE GROUP BANK AG      | 永久劣後債  | 2021/10/15 | 8.875     | EUR | 162,576,320        | 0.4         |
|            | VOLKSBANK WIEN AG        | 期限付劣後債 | 2022/10/6  | 2.75      | EUR | 144,543,148        | 0.4         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 1,571,426,128      | 4.1         |
| シンガポール     | DBS GROUP HOLDINGS LTD   | 期限付劣後債 | 2023/4/11  | 1.5       | EUR | 488,171,487        | 1.3         |
|            | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 期限付劣後債 | 2024/4/15  | 3.75      | USD | 229,455,199        | 0.6         |
|            | DBS GROUP HOLDINGS LTD   | 優先出資証券 | 2025/2/27  | 3.3       | USD | 197,954,730        | 0.5         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 915,581,416        | 2.4         |
| アイルランド     | BANK OF IRELAND GROUP    | 期限付劣後債 | 2024/10/14 | 2.375     | EUR | 477,407,796        | 1.2         |
|            | ATB GROUP PLC            | 期限付劣後債 | 2026/5/30  | 2.875     | EUR | 210,271,025        | 0.6         |
|            | ATB GROUP PLC            | その他    | 2024/5/28  | 1.25      | EUR | 133,781,025        | 0.4         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 821,459,846        | 2.1         |
| カナダ        | BANK OF MONTREAL         | 期限付劣後債 | 2027/12/15 | 3.803     | USD | 441,959,820        | 1.2         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 441,959,820        | 1.2         |
| ベルギー       | KBC GROUP NV             | 期限付劣後債 | 2024/12/3  | 0.5       | EUR | 386,298,189        | 1.0         |
|            | AGEAS                    | 期限付劣後債 | 2029/7/2   | 3.25      | EUR | 247,776,228        | 0.6         |
|            | AGEAS                    | 永久劣後債  | 2029/12/10 | 3.875     | EUR | 186,705,037        | 0.5         |
|            | KBC GROUP NV             | 期限付劣後債 | 2024/9/18  | 1.625     | EUR | 120,949,939        | 0.3         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 941,729,393        | 2.5         |
| カタール       | QNB FINANCE LTD          | その他    | 2027/2/12  | 2.75      | USD | 257,272,048        | 0.7         |
|            | MAR SUKUK LTD            | その他    | 2025/9/2   | 2.21      | USD | 219,250,798        | 0.6         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 476,522,846        | 1.2         |
| フィンランド     | SAMPO OYJ                | 期限付劣後債 | 2032/6/3   | 2.5       | EUR | 210,984,603        | 0.6         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 210,984,603        | 0.6         |
| 香港         | PEAK RE BVI HOLDING LTD  | 優先出資証券 | 2025/10/28 | 5.35      | USD | 196,788,970        | 0.5         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 196,788,970        | 0.5         |
| トーゴ共和国     | BANQUE OUEST AFRICAINE D | その他    | 2032/10/22 | 2.75      | EUR | 53,358,263         | 0.1         |
| 小計 (金額・比率) |                          |        |            |           |     | 53,358,263         | 0.1         |
| 総計         |                          |        |            |           |     | 37,643,895,236     | 98.5        |

(注) 管理会社である「ルクセンブルク三菱UFJインバスターサービス銀行S.A.」からの情報提供を受け、その内容を記載しています。

(注) 本明細は、現地2021年2月28日現在のデータです。邦貨換算額は、2021年2月28日現在の為替レートで換算しています。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 国は、発行体のリスク所在国（資本関連を含む）を記載しています。

(注) 償還年月日は、繰上償還条項が付与されている銘柄は基準日以降最初の繰上償還予定日を表示しています。

(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。

## 東京海上マネーマザーファンド

## 運用報告書 第14期（決算日 2021年8月16日）

（計算期間 2020年8月18日～2021年8月16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 | 券 率  | 純 資 産 額 |
|-----------------|---------|------|---------|---------|------|---------|
|                 | 期 騰 落   | 中 率  |         |         |      |         |
|                 | 円       | %    |         |         | %    | 百万円     |
| 10期(2017年8月15日) | 10,117  | 0.0  | 100.86  | △0.05   | 83.5 | 10      |
| 11期(2018年8月15日) | 10,116  | △0.0 | 100.81  | △0.05   | 74.1 | 10      |
| 12期(2019年8月15日) | 10,113  | △0.0 | 100.75  | △0.06   | 69.4 | 10      |
| 13期(2020年8月17日) | 10,116  | 0.0  | 100.71  | △0.04   | 69.0 | 14      |
| 14期(2021年8月16日) | 10,113  | △0.0 | 100.68  | △0.03   | 68.7 | 11      |

## ○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    |         |         |      |
| (期 首)      | 円       | %    |         |         | %    |
| 2020年8月17日 | 10,116  | —    | 100.71  | —       | 69.0 |
| 8月末        | 10,116  | 0.0  | 100.71  | △0.00   | 68.9 |
| 9月末        | 10,116  | 0.0  | 100.70  | △0.01   | 61.3 |
| 10月末       | 10,116  | 0.0  | 100.70  | △0.01   | 72.9 |
| 11月末       | 10,114  | △0.0 | 100.70  | △0.01   | 76.6 |
| 12月末       | 10,115  | △0.0 | 100.69  | △0.01   | 82.5 |
| 2021年1月末   | 10,116  | 0.0  | 100.69  | △0.01   | 90.5 |
| 2月末        | 10,116  | 0.0  | 100.69  | △0.02   | 41.1 |
| 3月末        | 10,116  | 0.0  | 100.69  | △0.02   | —    |
| 4月末        | 10,116  | 0.0  | 100.69  | △0.02   | 68.9 |
| 5月末        | 10,116  | 0.0  | 100.69  | △0.02   | 68.9 |
| 6月末        | 10,116  | 0.0  | 100.69  | △0.02   | 60.1 |
| 7月末        | 10,112  | △0.0 | 100.68  | △0.02   | 68.7 |
| (期 末)      |         |      |         |         |      |
| 2021年8月16日 | 10,113  | △0.0 | 100.68  | △0.03   | 68.7 |

(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（2008年3月28日）を100として指数化したものです。

## ○運用経過

(2020年8月18日～2021年8月16日)

## ■期中の基準価額等の推移

期 首：10,116円

期 末：10,113円

騰落率：△ 0.0%

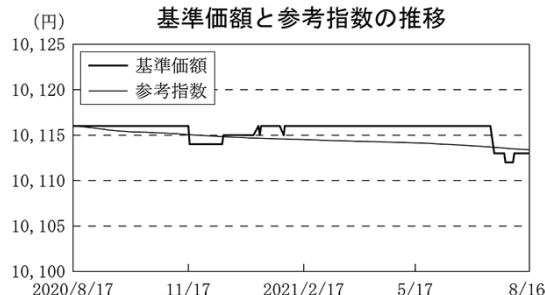
## ◇基準価額の主な変動要因

## 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など



(注) 参考指数は、期首（2020年8月17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は、日銀が長短金利操作付き量的・質的金融緩和を継続するなど、金融緩和環境が維持されたことにより、非常に低い金利水準が継続しました。金融緩和の度合いを知る上で着目する日銀の当座預金残高は、450兆円台から540兆円台へと拡大しており、短期金融市場の資金余剰感が一段と強くなりました。

このような状況下、無担保コール翌日物金利は-0.07%程度から-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、-0.18%程度から-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地方債など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に推移しました。

## ○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8月18日～2021年8月16日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2020年8月18日～2021年8月16日)

公社債

|   |       | 買付額    | 売付額      |
|---|-------|--------|----------|
| 国 |       | 千円     | 千円       |
| 内 | 地方債証券 | 45,874 | —        |
|   |       |        | (47,700) |

(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す。

○利害関係人との取引状況等

(2020年8月18日～2021年8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

(2021年8月16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 |      |        |
|       |         |         |         |                     | 5年以上      | 2年以上 | 2年未満   |
| 地方債証券 | 千円      | 千円      | %       | %                   | %         | %    | %      |
|       | 8,000   | 7,997   | 68.7    | —                   | —         | —    | 68.7   |
|       | (8,000) | (7,997) | (68.7)  | (—)                 | (—)       | (—)  | (68.7) |
| 合 計   | 8,000   | 7,997   | 68.7    | —                   | —         | —    | 68.7   |
|       | (8,000) | (7,997) | (68.7)  | (—)                 | (—)       | (—)  | (68.7) |

(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、価格情報会社など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13回せたがや区民債 | 0.1  | 5,000   | 4,998 | 2021/10/26 |  |
| 第14回なごやか市民債 | 0.08 | 3,000   | 2,999 | 2021/10/29 |  |
| 合 計         |      | 8,000   | 7,997 |            |  |

(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8月16日現在)

| 項 目          | 当 期 末  |       |
|--------------|--------|-------|
|              | 評 価 額  | 比 率   |
|              | 千円     | %     |
| 公社債          | 7,997  | 68.7  |
| コール・ローン等、その他 | 3,637  | 31.3  |
| 投資信託財産総額     | 11,634 | 100.0 |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年8月16日現在)

| 項 目             | 当 期 末       |
|-----------------|-------------|
|                 | 円           |
| (A) 資産          | 11,634,667  |
| コール・ローン等        | 3,635,012   |
| 公社債(評価額)        | 7,997,440   |
| 未収利息            | 440         |
| 前払費用            | 1,775       |
| (B) 負債          | 4           |
| 未払利息            | 4           |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 11,634,663  |
| 元本              | 11,504,340  |
| 次期繰越損益金         | 130,323     |
| (D) 受益権総口数      | 11,504,340口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,113円     |

(注) 当親ファンドの期首元本額は14,203,918円、期中追加設定元本額は99,417,824円、期中一部解約元本額は102,117,402円です。

<元本の内訳>

|                                                     |            |
|-----------------------------------------------------|------------|
| 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) マネーボール・ファンド          | 3,263,547円 |
| 東京海上・東南アジア株式ファンド                                    | 1,100,000円 |
| 東京海上・アジア中小型成長株ファンド                                  | 1,100,000円 |
| 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) 円コース(毎月分配型)          | 991,474円   |
| 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) 豪ドルコース(毎月分配型)        | 991,474円   |
| 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) ブラジル・レアルコース(毎月分配型)   | 991,474円   |
| 東京海上・米国優先リートファンド(為替プレミアム)                           | 989,316円   |
| 東京海上Roggeグローバルインフラ・ハイイールド債ファンド(為替ヘッジなし)(毎月決算型)      | 494,511円   |
| 東京海上Roggeグローバルインフラ・ハイイールド債ファンド(為替ヘッジなし)(年2回決算型)     | 494,511円   |
| 東京海上Roggeグローバルインフラ・ハイイールド債ファンド(為替ヘッジあり)(毎月決算型)      | 494,511円   |
| 東京海上Roggeグローバルインフラ・ハイイールド債ファンド(為替ヘッジあり)(年2回決算型)     | 494,511円   |
| 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) 米ドルコース(毎月分配型)        | 9,915円     |
| 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) ユーロコース(毎月分配型)        | 9,915円     |
| 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) 資源国通貨バスケットコース(毎月分配型) | 9,915円     |

|                                                   |        |
|---------------------------------------------------|--------|
| 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) メキシコ・ペソコース(毎月分配型)  | 9,898円 |
| 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) トルコ・リラコース(毎月分配型)   | 9,898円 |
| 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型) ロシア・ルーブルコース(毎月分配型) | 9,898円 |
| 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド 円コース(年1回決算型)              | 9,896円 |
| 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド 米ドルコース(年1回決算型)            | 9,896円 |
| 東京海上・がんたたたかう投信(為替ヘッジなし)(年1回決算型)                   | 9,890円 |
| 東京海上・がんたたたかう投信(為替ヘッジあり)(年1回決算型)                   | 9,890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8月18日～2021年8月16日)

| 項 目            | 当 期        |
|----------------|------------|
|                | 円          |
| (A) 配当等収益      | 81,264     |
| 受取利息           | 83,013     |
| 支払利息           | △ 1,749    |
| (B) 有価証券売買損益   | △ 84,288   |
| 売買損            | △ 84,288   |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 3,024    |
| (D) 前期繰越損益金    | 164,562    |
| (E) 追加信託差損益金   | 1,152,713  |
| (F) 解約差損益金     | △1,183,928 |
| (G) 計(C+D+E+F) | 130,323    |
| 次期繰越損益金(G)     | 130,323    |

(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。