

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）

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 (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11月13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 円コース (年1回決算型)	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・ファンドー日本円クラス」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・ファンドー日本円クラス	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 円コース (年1回決算型)	・株式への直接投資は行いません。 ・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ・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・ファンドー日本円クラス	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。 ・外貨建資産への投資は、円貨で約定し円貨で決済するもの(為替リスクの生じないもの)に限ります。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の、繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。	

第8期 運用報告書（全体版）
(決算日 2021年9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 円コース(年1回決算型)」は、このたび、第8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。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額 税 分 込 配 金 騰 落 中 率	債 組 入 比	券 率	投 証 資 信 託 組 入 比 券 率	純 資 産 額
	円	円	%	%	%	百万円
4期(2017年9月19日)	11,561	0	3.5	0.0	98.9	307
5期(2018年9月18日)	11,144	0	△3.6	0.0	97.9	203
6期(2019年9月17日)	11,854	0	6.4	0.0	98.4	124
7期(2020年9月17日)	12,394	0	4.6	0.0	98.3	137
8期(2021年9月17日)	12,811	0	3.4	0.0	98.5	146

(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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額 騰 落 率	債 組 入 比	券 率	投 証 資 信 託 組 入 比 券 率
(期 首) 2020年9月17日	円 12,394	% —		% 0.0	% 98.3
9月末	12,330	△0.5		0.0	98.3
10月末	12,377	△0.1		0.0	97.9
11月末	12,634	1.9		0.0	98.7
12月末	12,719	2.6		0.0	98.3
2021年1月末	12,710	2.5		0.0	98.8
2月末	12,568	1.4		0.0	98.9
3月末	12,488	0.8		—	102.2
4月末	12,573	1.4		0.0	98.2
5月末	12,588	1.6		0.0	99.3
6月末	12,677	2.3		0.0	98.9
7月末	12,788	3.2		0.0	98.5
8月末	12,801	3.3		0.0	98.9
(期 末) 2021年9月17日	12,811	3.4		0.0	98.5

(注) 騰落率は期首比です。

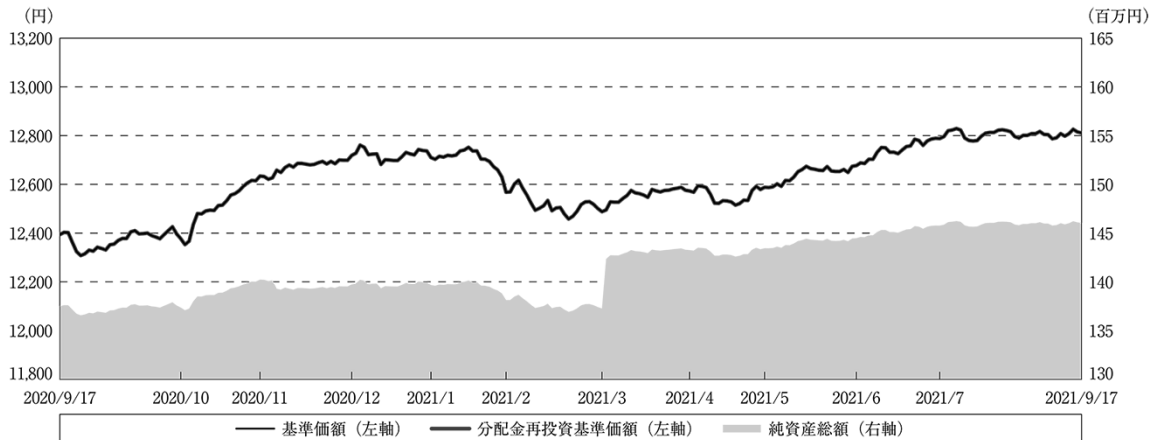
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

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

(2020年9月18日～2021年9月17日)

■期中の基準価額等の推移



期 首：12,394円

期 末：12,811円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 3.4% (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(2020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
- ・景気回復期待の高まりや先進国の中央銀行による金融緩和の継続などを背景としたハイブリッド証券のスプレッド(国債との利回り格差)の縮小

マイナス要因

- ・景気回復期待の高まりなどを背景とした米国、ドイツ、英国の国債利回りの上昇(債券価格は下落)

■投資環境

【外国債券市場】

当期、米国債利回りは上昇しました。2020年11月にかけては、米国大統領選挙や議会選挙で民主党が勝利し、積極的な財政政策が実施されることへの期待の高まりを背景として米国債利回りは上昇基調となりました。2021年に入り民主党の勝利が確定したことや新型コロナウイルスワクチンの接種が本格化したことなどを背景に3月にかけて米国債利回りは一段と上昇しました。6月以降はFOMC(米連邦公開市場委員会)で想定より早い金融緩和の修正が示されたことや新型コロナウイルス変異株の感染拡大などを背景に、景気回復基調の鈍化が意識され、米国債利回りは低下基調で推移しましたが、前期末対比では上昇して期を終えました。

ドイツ国債利回りは上昇しました。2021年1月にかけてはレンジ内で推移しましたが、その後は米国債利回りが上昇基調を強めたことや欧州各国で都市封鎖を緩和する動きが広がったことなどから、ドイツ国債利回りは上昇基調が続きました。期末にかけては、ドイツ国債利回りは低下する局面もありましたが、前期末対比では上昇して期を終えました。

英国債利回りは上昇しました。2020年末にかけてはレンジ内で推移しましたが、2021年1月以降は、EU(欧州連合)との貿易協定が成立したことや新型コロナウイルスワクチンの接種が進展したことなどから、英国債利回りは上昇基調となりました。その後、英国債利回りは低下する局面もありましたが、前期末対比では上昇して期を終えました。

【ハイブリッド証券市場】

ハイブリッド証券の価格はおおむね上昇しました。新型コロナウイルス変異株の感染拡大により、経済活動の正常化が遅れるとの懸念からハイブリッド証券のスプレッドは拡大する局面があったものの、ワクチン接種の進展に伴う景気回復期待の高まりや、主要中央銀行による金融緩和の継続が追い風となり、ハイブリッド証券のスプレッドは縮小しました。

■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 円コース(年1回決算型)>

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・ファンドー日本円クラス」(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)を主要投資対象とし、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は、主に外国投資信託証券の値動きを反映し、3.4%上昇しました。

<外国投資信託証券>

期を通じて、ハイブリッド証券等の組入比率を高位に維持しました。

当期は、新型コロナウイルスの感染状況や先進国の中央銀行の金融政策に対する姿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、また市場での流動性などを勘案して運用を行いました。

組入資産については、対日本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。

以上のような運用の結果、基準価額(分配金再投資)は上昇しました。

【組入銘柄の概要（2021年8月末現在）】

証券種別構成

証券種類	比率
	%
期限付劣後債	61.2
永久劣後債	13.0
優先出資証券	5.8
その他	20.0

格付別構成

格付	比率
	%
AAA格	－
AA格	1.4
A格	35.9
BBB格	62.7
BB格以下	－
無格付	－

組入上位5カ国

	国	比率
		%
1	イギリス	18.3
2	アメリカ	17.6
3	フランス	12.8
4	日本	6.7
5	オランダ	6.1

組入上位10銘柄

	銘柄	証券種類	国	通貨	比率
					%
1	DAI-ICHI LIFE INSURANCE	永久劣後債	日本	米ドル	2.2
2	AXA SA	永久劣後債	フランス	英ポンド	2.2
3	GOLDMAN SACHS CAPITAL I	優先出資証券	アメリカ	米ドル	2.1
4	BPCE SA	期限付劣後債	フランス	米ドル	2.0
5	STANDARD CHARTERED PLC	期限付劣後債	イギリス	米ドル	1.9
6	DISCOVER BANK	期限付劣後債	アメリカ	米ドル	1.6
7	BANCO SANTANDER MEXICO	その他	スペイン	米ドル	1.6
8	UNICREDIT SPA	期限付劣後債	イタリア	ユーロ	1.6
9	CHINA CONSTRUCTION BANK	優先出資証券	中国	米ドル	1.6
10	AUST & NZ BANKING GROUP	期限付劣後債	オーストラリア	ユーロ	1.6
組入銘柄数		129銘柄			

(注) 比率は保有するハイブリッド証券等の時価総額に占める割合です。

(注) 格付はMoody's社、S&P社、Fitch社のうち、原則として上位の格付を集計、記載しています。＋・－等の符号は省略して表示しています。

(注) 国は発行体のリスク所在国（資本関係を含む）を記載しています。

(注) 基準価額算定の基準で記載しています。

<親投資信託>

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

■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

当期においては、運用の効率性などを勘案して、収益分配を行わないこととしました。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 8 期
	2020年 9 月18日～ 2021年 9 月17日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	— %
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,867

(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)>

外国投資信託証券および親投資信託を主要投資対象とし、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>

欧米経済は、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考えていますが、感染拡大が収束し経済活動が元の水準に戻るまでには時間を要するとみています。先進国の中央銀行は緩和的な金融政策を当面の間維持するとみられ、欧米の国債利回りは過去との比較で相対的に低い水準にとどまると想定しています。

このような環境下、金融機関の収益改善への期待もあり、ハイブリッド証券に資金が流入しやすい状態が継続することを予想します。

ハイブリッド証券等の組入比率については現在の水準を維持し、財務状況が相対的に健全と考える米国、英国、ユーロ圏、北欧などの金融機関を中心に、選別して投資する方針です。

組入資産については、対日本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。

<親投資信託>

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

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年9月18日～2021年9月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 128	% 1.015	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(39)	(0.308)	* 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)	(86)	(0.682)	* 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)	(3)	(0.025)	* 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	1	0.011	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.011)	* 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	129	1.026	
期中の平均基準価額は、12,604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) 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。

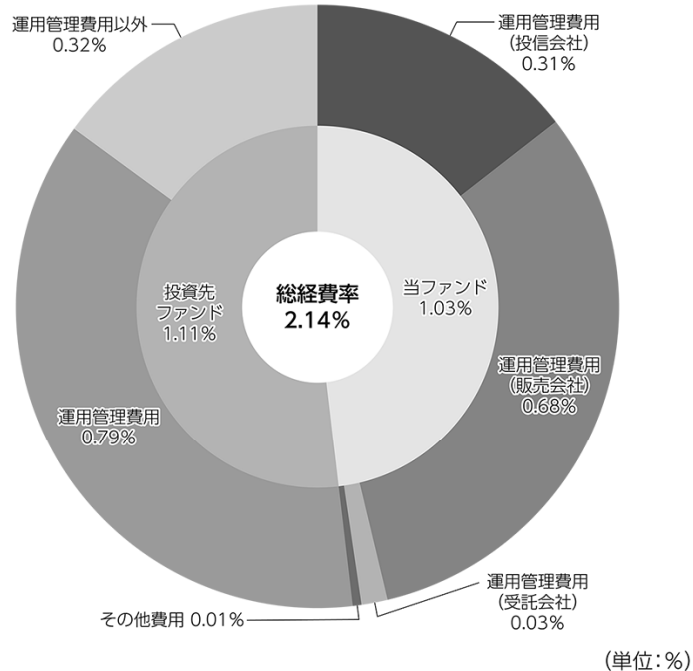
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）が支払った費用を含みません。

(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2.14%です。



総経費率(①+②+③)	2.14
①当ファンドの費用の比率	1.03
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.79
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.32

- (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

(2020年9月18日～2021年9月17日)

投資信託証券

銘			買 付		売 付	
			口 数	金 額	口 数	金 額
外 国 (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 グローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ フ ァ ン ド ー 日 本 円 ク ラ ス	千口	千円	千口	千円
			1	11,400	0.1556	1,400

(注) 金額は受渡代金です。

○利害関係人との取引状況等

(2020年9月18日～2021年9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

(2021年9月17日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
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 日 本 円 ク ラ ス		千口	千口	千円	%
		15	16	143,791	98.5
		合 計			
		15	16	143,791	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		期首(前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
東京海上マネーマザーファンド		千口	千口	千円
		9	9	10

○投資信託財産の構成

(2021年9月17日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 143,791	% 98.0
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	2,990	2.0
投資信託財産総額	146,791	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年9月17日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	146,791,430
コール・ローン等	2,990,182
投資信託受益証券(評価額)	143,791,239
東京海上マネーマザーファンド(評価額)	10,009
(B) 負債	744,364
未払信託報酬	736,457
未払利息	3
その他未払費用	7,904
(C) 純資産総額(A－B)	146,047,066
元本	114,003,585
次期繰越損益金	32,043,481
(D) 受益権総口数	114,003,585口
1万口当たり基準価額(C／D)	12,811円

- (注) 当ファンドの期首元本額は110,946,789円、期中追加設定元本額は4,190,026円、期中一部解約元本額は1,133,230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 (2020年9月18日～2021年9月17日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	7,537,939
受取配当金	7,538,510
受取利息	2
支払利息	△ 573
(B) 有価証券売買損益	△ 1,373,912
売買益	15,532
売買損	△ 1,389,444
(C) 信託報酬等	△ 1,450,419
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	4,713,608
(E) 前期繰越損益金	14,224,572
(F) 追加信託差損益金	13,105,301
(配当等相当額)	(19,481,618)
(売買損益相当額)	(△ 6,376,317)
(G) 計(D＋E＋F)	32,043,481
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G＋H)	32,043,481
追加信託差損益金	13,105,301
(配当等相当額)	(19,481,618)
(売買損益相当額)	(△ 6,376,317)
分配準備積立金	36,014,128
繰越損益金	△17,075,948

- (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) (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	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	6,087,562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	19,481,618円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	29,926,566円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	55,495,746円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,867円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○お知らせ

- ・2020年12月18日付で、信託期間を2年延長し信託終了日を2026年9月17日とする約款変更を行いました。
- ・当ファンドが投資する外国投資信託の運用委託先を、2021年4月末付で「Tokio Marine Rogge Asset Management Limited」（東京海上Rogge社）から「Allianz Global Investors GmbH」（アリアンツGI）に変更しました。なお、ファンドの運用体制、運用方法に変更ありません。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2021年9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(11,504千口)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	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 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	7,998	68.7	－	－	－	68.7
	(8,000)	(7,998)	(68.7)	(－)	(－)	(－)	(68.7)
合 計	8,000	7,998	68.7	－	－	－	68.7
	(8,000)	(7,998)	(68.7)	(－)	(－)	(－)	(68.7)

(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	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	4,999	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	7,998	

(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)
(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（年1回決算型）」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）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 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. 副管理会社：MUFGルクスマネジメントカンパニーS.A. 投資顧問会社：東京海上アセットマネジメント株式会社 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
収益	
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
収益合計	1,259,566,332
費用	
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)
費用合計	(418,281,190)
投資純利益／（損失）	841,285,142
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)
当期実現純利益／（損失）	(456,438,663)
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
	852,361,627
運用による純資産の増加／（減少）額	1,237,208,106

（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 (%)	通貨	評価額 (邦貨建金額) (円)	組入比率 (%)
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 (%)	通貨	評価額 (邦貨建金額) (円)	組入比率 (%)
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 (%)	通貨	評価額 (邦貨建金額) (円)	組入比率 (%)
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%

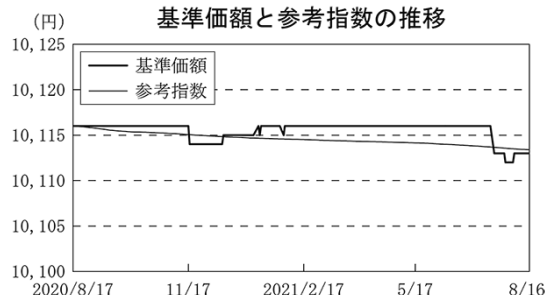
◇基準価額の主な変動要因

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				残存期間別組入比率		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 組 入 比 率	5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	8,000 (8,000)	7,997 (7,997)	68.7 (68.7)	— (—)	— (—)	— (—)	68.7 (68.7)
合 計	8,000 (8,000)	7,997 (7,997)	68.7 (68.7)	— (—)	— (—)	— (—)	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・がんとたたかう投信(為替ヘッジなし)(年1回決算型)	9,890円
東京海上・がんとたたかう投信(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。