

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	2015年1月20日から2024年12月13日 (2022年6月10日 繰上償還)	
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめぐって運用を行います。	
主要投資対象	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)	外国投資信託「東京海上グローバル・トラストー東京海上Roggeグローバル・インフラストラクチャー・ハイイールド・ボンド・ファンド(ノンヘッジクラス)」および親投資信託「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。
	東京海上グローバル・トラストー 東京海上Roggeグローバル・ インフラストラクチャー・ハイ・ イールド・ボンド・ファンド (ノンヘッジクラス)	世界(新興国を含みます)のインフラ関連企業が発行するハイイールド債券(BB格相当またはそれ以下の格付けの債券)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ス・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 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)	<ul style="list-style-type: none"> 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。
	東京海上グローバル・トラストー 東京海上Roggeグローバル・ インフラストラクチャー・ハイ・ イールド・ボンド・ファンド (ノンヘッジクラス)	<ul style="list-style-type: none"> 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。 同一発行体への投資割合は、原則として純資産総額の10%以下とします。
	東京海上 マネーマザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> 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	第1期決算時には、分配を行いません。第2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。	

ロゲー
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)

繰上償還 運用報告書(全体版)

第83期(決算日)	2022年1月13日)
第84期(決算日)	2022年2月14日)
第85期(決算日)	2022年3月14日)
第86期(決算日)	2022年4月13日)
第87期(決算日)	2022年5月13日)
第88期(償還日)	2022年6月10日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「東京海上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)」は、このたび、2022年6月10日をもちまして繰上償還となりました。ここに、運用経過と償還の内容をご報告申し上げます。

長年のご愛顧に対し厚くお礼申し上げますと共に、今後とも当社ファンドにつきまして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 (分配落)	準 価		額 中 率	債 組 入 比	券 率	投 資 信 託 組 入 比	純 資 産 率	純 資 産 額
		税 分	込 配						
	円 銭		円	%	%	%	%	%	百万円
59期(2020年1月14日)	8,107		40	1.1	0.0		98.8		562
60期(2020年2月13日)	8,122		40	0.7	0.1		98.7		562
61期(2020年3月13日)	7,241		40	△10.4	0.1		98.2		495
62期(2020年4月13日)	7,174		40	△0.4	0.1		98.5		489
63期(2020年5月13日)	7,222		40	1.2	0.1		98.8		491
64期(2020年6月15日)	7,477		40	4.1	0.1		98.7		504
65期(2020年7月13日)	7,446		40	0.1	0.1		98.6		492
66期(2020年8月13日)	7,712		40	4.1	0.1		98.6		510
67期(2020年9月14日)	7,631		40	△0.5	0.1		98.8		500
68期(2020年10月13日)	7,541		40	△0.7	0.1		98.6		491
69期(2020年11月13日)	7,539		40	0.5	0.1		95.7		475
70期(2020年12月14日)	7,560		40	0.8	0.1		99.3		460
71期(2021年1月13日)	7,602		40	1.1	0.1		98.4		454
72期(2021年2月15日)	7,652		40	1.2	0.1		99.7		452
73期(2021年3月15日)	7,802		40	2.5	0.1		99.1		448
74期(2021年4月13日)	7,858		40	1.2	0.1		98.8		448
75期(2021年5月13日)	7,859		40	0.5	0.1		98.5		436
76期(2021年6月14日)	7,870		40	0.6	0.1		99.1		433
77期(2021年7月13日)	7,809		40	△0.3	0.1		99.0		428
78期(2021年8月13日)	7,764		40	△0.1	0.1		99.0		426
79期(2021年9月13日)	7,728		40	0.1	0.1		99.2		421
80期(2021年10月13日)	7,837		40	1.9	0.1		99.4		426
81期(2021年11月15日)	7,820		40	0.3	0.1		98.4		410
82期(2021年12月13日)	7,651		40	△1.6	0.1		98.6		400
83期(2022年1月13日)	7,723		40	1.5	0.1		98.9		403
84期(2022年2月14日)	7,564		40	△1.5	0.1		99.3		393
85期(2022年3月14日)	7,334		40	△2.5	0.1		98.4		367
86期(2022年4月13日)	7,750		40	6.2	0.1		98.9		372
87期(2022年5月13日)	7,474		0	△3.6	0.1		98.0		351
(償還時)	(償還価額)								
88期(2022年6月10日)	7,491.19		—	0.2	—		—		323

(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	騰 落 率		債 組 入 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
			騰 落 率	騰 落 率		
第83期	(期 首) 2021年12月13日	円 銭 7,651	% —		% 0.1	% 98.6
	12月末	7,733	1.1		0.1	94.5
	(期 末) 2022年1月13日	7,763	1.5		0.1	98.9
第84期	(期 首) 2022年1月13日	7,723	—		0.1	98.9
	1月末	7,564	△2.1		0.1	98.5
	(期 末) 2022年2月14日	7,604	△1.5		0.1	99.3
第85期	(期 首) 2022年2月14日	7,564	—		0.1	99.3
	2月末	7,420	△1.9		0.1	98.3
	(期 末) 2022年3月14日	7,374	△2.5		0.1	98.4
第86期	(期 首) 2022年3月14日	7,334	—		0.1	98.4
	3月末	7,756	5.8		0.1	98.7
	(期 末) 2022年4月13日	7,790	6.2		0.1	98.9
第87期	(期 首) 2022年4月13日	7,750	—		0.1	98.9
	4月末	7,646	△1.3		0.1	99.3
	(期 末) 2022年5月13日	7,474	△3.6		0.1	98.0
第88期	(期 首) 2022年5月13日	7,474	—		0.1	98.0
	5月末	7,495	0.3		0.1	2.5
	(償還時) 2022年6月10日	(償還価額) 7,491.19	0.2		—	—

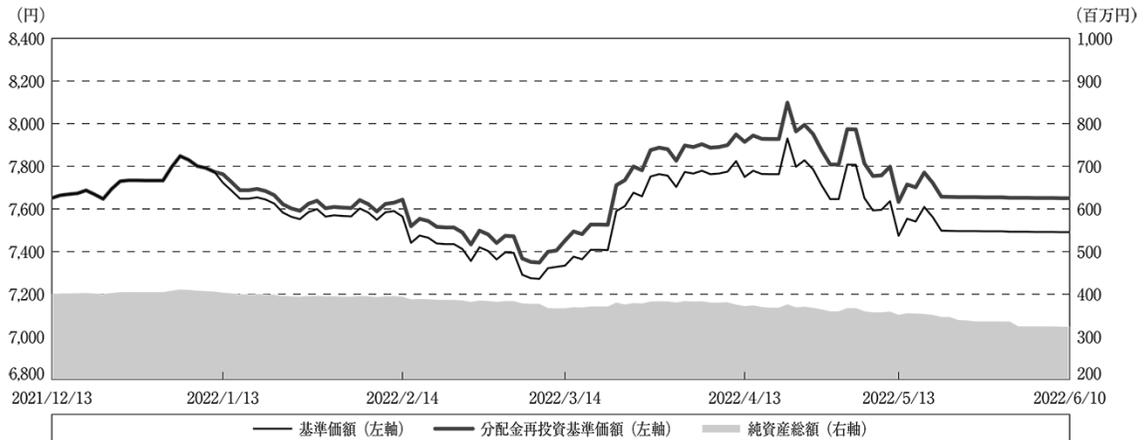
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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12月14日～2022年6月10日)

■作成期間中の基準価額等の推移



第 83 期 首： 7,651円

第88期末(償還日)： 7,491円19銭 (既払分配金(税込み)：160円)

騰 落 率： △ 0.0% (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12月13日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・保有するハイイールド債券の利息収入
- ・主要通貨に対して円安が進行したこと

マイナス要因

- ・主要中央銀行の金融引き締めにより主要国の国債利回りが上昇したこと
- ・主要中央銀行による金融政策正常化への動きなどからハイイールド債の国債に対するスプレッド(利回り格差)が拡大したこと

■投資環境

【外国債券市場】

米国中期国債利回りは上昇しました。作成期初は、FRB(米連邦準備制度理事会)が量的緩和縮小ペースの加速を決定し、その後も米国CPI(消費者物価指数)が市場予想以上に上昇したことなどから、米国中期国債利回りは上昇しました。作成期半ば以降、ロシアのウクライナ侵攻の激化とロシアに対する制裁の本格化を受けて市場参加者のリスク回避姿勢が強まり、米国中期国債利回りは低下する局面もありましたが、米国CPIの高止まりやFRBが利上げを急ぐ姿勢を引き続き示したことから、上昇基調が継続しました。

ドイツ中期国債利回りは上昇しました。作成期初、ユーロ圏のインフレ率が上昇するなか、ECB(欧州中央銀行)が金融政策正常化を急ぐとの観測が広がり、ドイツ中期国債利回りは上昇しました。その後、ロシアによるウクライナ侵攻を受けて市場参加者のリスク回避姿勢が強まったことから、ドイツ中期国債利回りは低下する局面もありましたが、物価指数の上振れなどを背景にECBが金融引き締めに積極的な姿勢を維持したことなどから、上昇基調が継続しました。

英国中期国債利回りは、物価指数の上昇を受けたBOE(イングランド銀行)の金融政策正常化への動きから上昇しました。

グローバルのハイイールドスプレッド(ハイイールド債券と国債の利回り格差)は、各国中央銀行の金融政策正常化が意識されたことや、ロシアによるウクライナ侵攻が深刻化し、市場参加者のリスク回避姿勢が強まったことなどを背景に拡大しました。

【為替市場】

米ドル円為替レートは、作成期前半はおおむね横ばいで推移しましたが、作成期後半はFRBが金融政策正常化を前倒しした一方、日銀は金融緩和政策を維持したことで内外金利差の拡大から円安米ドル高が進行しました。

ユーロ円および英ポンド円為替レートは、各国中央銀行による金融政策正常化への動きなどから円安が進行しました。

■ポートフォリオについて

<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)>

「東京海上グローバル・トラストー東京海上Roggeグローバル・インフラストラクチャー・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(ノンヘッジクラス)」(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(税引前分配金再投資)は、主に外国投資信託証券の値動きを反映し、前作成期末対比おおむね同水準となりました。

<外国投資信託証券>

主として、ボトムアップリサーチ(発行体分析)の下、私たちの日常生活や経済活動の基盤として必要不可欠なサービスや設備を提供するインフラ関連企業が発行するハイイールド債券に投資し、債券の組入比率は作成期間を通じて高位に維持しました。業種配分では、主に公益セクター、通信セクター、エネルギーセクター、運輸セクターの銘柄に投資しました。銘柄選択においては、デフォルト(債務不履行)する可能性が低く、安定的な利息収入の獲得が期待できると考えた銘柄などを組み入れました。

以上のような運用の結果、基準価額(分配金再投資)は、保有するハイイールド債券の利息収入や円安の進行などがプラス要因となった一方、主要国の国債利回りが上昇したことやグローバルのハイイールドスプレッドが拡大したことなどがマイナス要因となり、前作成期末対比おおむね同水準となりました。

<親投資信託>

元本の安全性と流動性を重視して政府保証債や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横ばいに推移しました。

■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。

◇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第83期	第84期	第85期	第86期	第87期
	2021年12月14日～ 2022年1月13日	2022年1月14日～ 2022年2月14日	2022年2月15日～ 2022年3月14日	2022年3月15日～ 2022年4月13日	2022年4月14日～ 2022年5月13日
当期分配金	40	40	40	40	—
(対基準価額比率)	0.515%	0.526%	0.542%	0.513%	—%
当期の収益	38	30	30	40	—
当期の収益以外	1	10	10	—	—
翌期繰越分配対象額	466	461	458	460	460

(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。

○設定来の運用経過

(2015年1月20日～2022年6月10日)

■設定来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。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・保有するハイイールド債券の利息収入
- ・円安米ドル高、円安ユーロ高の進行

マイナス要因

- ・主要国の国債利回りが上昇したこと
- ・円高英ポンド安の進行

■投資環境

【外国債券市場】

米国中期国債利回りは上昇しました。2018年にかけては、トランプ米大統領による減税政策が実施され各経済指標が堅調に推移したことや、FRB（米連邦準備制度理事会）が利上げを実施したことなどから米国中期国債利回りは上昇しました。その後、米中貿易摩擦や新型コロナウイルスの感染拡大に伴う景気後退、FRBによる大規模な金融緩和などから米国中期国債利回りは低下しました。2021年以降は、インフレ率の上昇とFRBによる金融政策正常化への動きから米国中期国債利回りは上昇基調となりました。

ドイツ中期国債利回りは上昇しました。2016年の英国のEU（欧州連合）離脱に対する懸念や2018年後半の世界的な景気減速懸念、2020年の新型コロナウイルスの感染拡大に伴う景気後退とECB（欧州中央銀行）による金融緩和などからドイツ中期国債利回りは低下しました。2021年以降は、インフレ率の上昇とそれに伴う各国中央銀行による金融政策正常化への動きからドイツ中期国債利回りは大きく上昇しました。

英国中期国債利回りは上昇しました。英国のEU離脱や新型コロナウイルスの感染拡大から2020年にかけて低下しましたが、その後はBOE（イングランド銀行）の金融政策見直しへの動きなどから上昇しました。

グローバルのハイイールドスプレッド（ハイイールド債券と国債の利回り格差）は、2015年から2016年にかけての中国の景気悪化懸念や、2020年の新型コロナウイルス感染拡大による世界的な景気後退から拡大する局面もありましたが、運用期間を通じてはおおむね横ばいとなりました。

【為替市場】

米ドル円為替レートは円安米ドル高となりました。2016年央は英国のEU離脱により投資家のリスク回避姿勢が高まり、円高米ドル安となりましたが、2016年末にかけてはトランプ米大統領による減税政策の実施などにより円安米ドル高が進行し、その後はボックス圏での推移となりました。2021年以降は米国のインフレ率上昇への懸念とFRBによる金融政策正常化への動きから円安米ドル高が進行しました。

ユーロ円為替レートは円安ユーロ高、英ポンド円為替レートは円高英ポンド安となりました。英国のEU離脱などから投資家のリスク回避姿勢が高まり、円高基調となる場面があった一方、2021年以降はインフレ率上昇への懸念と各国中央銀行による金融政策正常化への動きから円安が進行しました。

■ポートフォリオについて

<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)>

「東京海上グローバル・トラストー東京海上Rogge グローバル・インフラストラクチャー・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(ノンヘッジクラス)」(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(税引前分配金再投資)は、主に外国投資信託証券の値動きを反映し、12.7%上昇しました。

<外国投資信託証券>

主として、ボトムアップリサーチ(発行体分析)の下、私たちの日常生活や経済活動の基盤として必要不可欠なサービスや設備を提供するインフラ関連企業が発行するハイイールド債券に投資し、債券の組入比率は期を通じて高位に維持しました。業種配分では、主に公益セクター、通信セクター、エネルギーセクター、運輸セクターの銘柄に投資しました。銘柄選択においては、デフォルト(債務不履行)する可能性が低く、安定的な利息収入の獲得が期待できると考えた銘柄などを組み入れました。

以上のような運用の結果、保有するハイイールド債券の利息収入や、円安米ドル高および円安ユーロ高の進行などがプラス要因となり、基準価額(分配金再投資)は上昇しました。

<親投資信託>

元本の安全性と流動性を重視して政府保証債や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横ばいに推移しました。

■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、収益分配を行いました。各期の分配金額につきましては、後掲の「投資信託財産運用総括表」をご覧ください。

当ファンドは、2022年6月10日をもちまして償還となりました。最後に、受益者の皆さまのご愛顧に心よりお礼を申し上げますとともに、今後とも当社ファンドにつきまして一層のお引き立てを賜りますよう、よろしく願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2021年12月14日～2022年6月10日)

項 目	第83期～第88期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(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)	(11)	(0.151)	*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)	(29)	(0.378)	*購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受 託 会 社)	(1)	(0.012)	*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	41	0.546	
作成期間の平均基準価額は、7,602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。

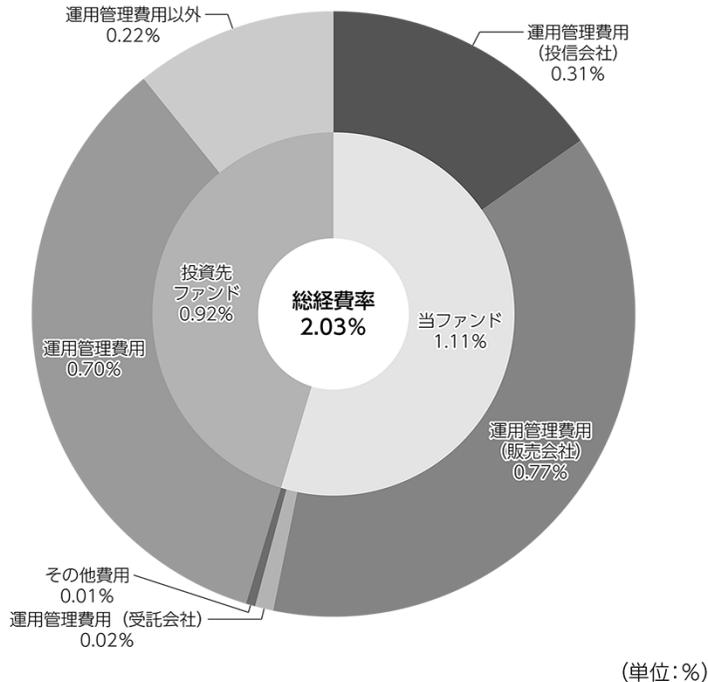
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券(親投資信託を除く。)が支払った費用を含みません。

(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2.03%です。



総経費率(①+②+③)	2.03
①当ファンドの費用の比率	1.11
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.70
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.22

- (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、「東京海上グローバル・トラストー東京海上Roggeグローバル・インフラストラクチャー・ハイ・イールド・ボンド・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12月14日～2022年6月10日)

投資信託証券

銘			第83期～第88期			
			買付		売付	
			口数	金額	口数	金額
			千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	ケイマン	東京海上グローバル・トラストー 東京海上Roggeグローバル・インフラストラクチャー・ ハイ・イールド・ボンド・ファンド(ノンヘッジクラス)	1	15,000	51	403,510

(注) 金額は受渡代金です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘		第83期～第88期			
		設定		解約	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千円	千口	千円
東京海上マネーマザーファンド		—	—	494	500

○利害関係人との取引状況等

(2021年12月14日～2022年6月10日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2022年6月10日現在)

2022年6月10日現在、有価証券等の組入れはございません。

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82期末	
		口数	
東京海上グローバル・トラストー東京海上Roggeグローバル・インフラストラクチャー・ ハイ・イールド・ボンド・ファンド(ノンヘッジクラス)			千口
			49
合		計	
			49

親投資信託残高

銘	柄	第82期末	
		口	数
東京海上マネーマザーファンド		千口	494

○投資信託財産の構成

(2022年6月10日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 324,776	% 100.0
投資信託財産総額	324,776	100.0

○資産、負債、元本及び償還(基準)価額の状況

項 目	第83期末	第84期末	第85期末	第86期末	第87期末	償 還 時
	2022年1月13日現在	2022年2月14日現在	2022年3月14日現在	2022年4月13日現在	2022年5月13日現在	2022年6月10日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	406,746,137	396,415,714	382,765,141	381,934,836	352,007,621	324,776,417
コール・ローン等	7,108,829	4,866,998	21,176,128	3,459,988	7,140,016	324,776,417
投資信託受益証券(評価額)	399,137,061	391,048,469	361,088,766	367,974,552	344,367,309	-
東京海上マネーマザーファンド(評価額)	500,247	500,247	500,247	500,296	500,296	-
未収入金	-	-	-	10,000,000	-	-
(B) 負債	3,234,665	2,471,157	15,721,569	9,856,156	572,153	1,042,349
未払収益分配金	2,089,936	2,083,288	2,001,821	1,920,358	-	-
未払解約金	761,558	-	13,393,253	7,590,199	236,809	751,907
未払信託報酬	379,400	384,049	323,278	342,203	332,050	286,540
未払利息	4	3	7	1	1	1,060
その他未払費用	3,767	3,817	3,210	3,395	3,293	2,842
(C) 純資産総額(A-B)	403,511,472	393,944,557	367,043,572	372,078,680	351,435,468	323,734,068
元本	522,484,173	520,822,151	500,455,406	480,089,705	470,189,363	432,153,282
次期繰越損益金	△118,972,701	△126,877,594	△133,411,834	△108,011,025	△118,753,895	-
償還差損金	-	-	-	-	-	△108,419,214
(D) 受益権総口数	522,484,173口	520,822,151口	500,455,406口	480,089,705口	470,189,363口	432,153,282口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,723円	7,564円	7,334円	7,750円	7,474円	-
1万口当たり償還価額(C/D)	-	-	-	-	-	7,491円19銭

(注) 当ファンドの第83期首元本額は523,588,158円、第83～88期中追加設定元本額は2,032,460円、第83～88期中一部解約元本額は93,467,336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1万口当たり償還(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83期	第84期	第85期	第86期	第87期	第88期
	2021年12月14日～ 2022年1月13日	2022年1月14日～ 2022年2月14日	2022年2月15日～ 2022年3月14日	2022年3月15日～ 2022年4月13日	2022年4月14日～ 2022年5月13日	2022年5月14日～ 2022年6月10日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	2,159,333	2,238,707	2,155,843	2,058,229	△ 58	△ 6,596
受取配当金	2,159,647	2,238,832	2,155,904	2,058,255	—	—
受取利息	—	—	1	—	—	—
支払利息	△ 314	△ 125	△ 62	△ 26	△ 58	△ 6,596
(B) 有価証券売買損益	4,078,505	△ 8,050,889	△ 11,323,359	20,179,698	△ 12,634,877	1,024,383
売買益	4,091,406	37,637	609,938	20,872,843	32,093	1,109,553
売買損	△ 12,901	△ 8,088,526	△ 11,933,297	△ 693,145	△ 12,666,970	△ 85,170
(C) 信託報酬等	△ 383,167	△ 387,866	△ 326,488	△ 345,598	△ 335,343	△ 289,382
(D) 当期損益金(A+B+C)	5,854,671	△ 6,200,048	△ 9,494,004	21,892,329	△ 12,970,278	728,405
(E) 前期繰越損益金	△ 99,820,329	△ 95,683,225	△ 99,313,295	△ 105,719,771	△ 83,915,953	△ 89,048,881
(F) 追加信託差損益金	△ 22,917,107	△ 22,911,033	△ 22,602,714	△ 22,263,225	△ 21,867,664	△ 20,098,738
(配当等相当額)	(21,881,598)	(21,813,712)	(20,462,542)	(19,152,475)	(18,759,697)	(17,242,182)
(売買損益相当額)	(△ 44,798,705)	(△ 44,724,745)	(△ 43,065,256)	(△ 41,415,700)	(△ 40,627,361)	(△ 37,340,920)
(G) 計(D+E+F)	△ 116,882,765	△ 124,794,306	△ 131,410,013	△ 106,090,667	△ 118,753,895	—
(H) 収益分配金	△ 2,089,936	△ 2,083,288	△ 2,001,821	△ 1,920,358	0	—
次期繰越損益金(G+H)	△ 118,972,701	△ 126,877,594	△ 133,411,834	△ 108,011,025	△ 118,753,895	—
償還差損金(D+E+F+H)	—	—	—	—	—	△ 108,419,214
追加信託差損益金	△ 22,917,107	△ 23,431,855	△ 23,103,169	△ 22,263,225	△ 21,867,664	—
(配当等相当額)	(21,881,598)	(21,292,890)	(19,962,087)	(19,152,475)	(18,759,697)	(—)
(売買損益相当額)	(△ 44,798,705)	(△ 44,724,745)	(△ 43,065,256)	(△ 41,415,700)	(△ 40,627,361)	(—)
分配準備積立金	2,469,050	2,747,960	2,966,408	2,949,188	2,886,186	—
繰越損益金	△ 98,524,644	△ 106,193,699	△ 113,275,073	△ 88,696,988	△ 99,772,417	—

(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83期	第84期	第85期	第86期	第87期
	2021年12月14日～ 2022年1月13日	2022年1月14日～ 2022年2月14日	2022年2月15日～ 2022年3月14日	2022年3月15日～ 2022年4月13日	2022年4月14日～ 2022年5月13日
a. 配当等収益(費用控除後)	2,026,738円	1,850,947円	1,829,589円	2,026,543円	0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
c. 信託約款に規定する収益調整金	21,881,598円	21,813,712円	20,462,542円	19,152,475円	18,759,697円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	2,532,248円	2,459,479円	2,638,185円	2,843,003円	2,886,186円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	26,440,584円	26,124,138円	24,930,316円	24,022,021円	21,645,883円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	506円	501円	498円	500円	460円
g. 分配金	2,089,936円	2,083,288円	2,001,821円	1,920,358円	0円
h. 分配金(1万口当たり)	40円	40円	40円	40円	0円

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2015年1月20日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年6月10日		資産総額	324,776,417円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	1,042,349円
受益権口数	500,000,000口	432,153,282口	△67,846,718口	純資産総額	323,734,068円
元本額	500,000,000円	432,153,282円	△67,846,718円	受益権口数	432,153,282口
1万口当たり償還金					
7,491円19銭					
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	582,202,379円	605,628,146円	10,402円	－円	－%
第2期	583,663,656	603,600,462	10,342	40	0.4
第3期	680,449,469	705,292,142	10,365	40	0.4
第4期	708,621,610	748,415,488	10,562	40	0.4
第5期	784,121,309	816,200,480	10,409	40	0.4
第6期	841,555,311	873,493,907	10,380	40	0.4
第7期	1,678,963,164	1,679,661,561	10,004	40	0.4
第8期	7,268,187,487	7,132,444,575	9,813	40	0.4
第9期	7,295,387,787	7,234,880,521	9,917	40	0.4
第10期	7,316,705,957	6,975,880,018	9,534	40	0.4
第11期	7,293,573,078	6,652,009,186	9,120	40	0.4
第12期	7,095,643,810	6,004,130,209	8,462	40	0.4
第13期	6,810,080,447	6,025,576,674	8,848	40	0.4
第14期	6,418,657,481	5,468,218,872	8,519	40	0.4
第15期	6,310,230,075	5,437,799,894	8,617	40	0.4
第16期	6,055,870,546	5,146,433,408	8,498	40	0.4
第17期	5,741,518,992	4,721,600,974	8,224	40	0.4
第18期	5,405,010,903	4,314,567,353	7,983	40	0.4
第19期	5,041,709,438	4,090,669,545	8,114	40	0.4
第20期	4,667,409,947	3,775,216,808	8,088	40	0.4
第21期	4,160,556,444	3,416,145,158	8,211	40	0.4
第22期	3,786,087,160	3,394,812,038	8,967	40	0.4
第23期	3,425,450,359	3,032,096,324	8,852	40	0.4
第24期	3,236,336,044	2,872,679,653	8,876	40	0.4
第25期	2,887,303,047	2,568,300,778	8,895	40	0.4
第26期	2,671,058,005	2,290,245,407	8,574	40	0.4
第27期	2,456,379,593	2,206,778,787	8,984	40	0.4
第28期	2,320,940,995	2,034,883,145	8,767	40	0.4
第29期	2,014,271,678	1,807,196,351	8,972	40	0.4
第30期	1,918,900,825	1,671,073,230	8,708	40	0.4

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1 万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第31期	1,876,079,863円	1,653,347,382円	8,813円	40円	0.4%
第32期	1,782,699,947	1,606,876,142	9,014	40	0.4
第33期	1,703,601,208	1,528,291,652	8,971	40	0.4
第34期	1,642,994,777	1,474,600,189	8,975	40	0.4
第35期	1,602,855,052	1,422,233,636	8,873	40	0.4
第36期	1,536,444,828	1,309,314,532	8,522	40	0.4
第37期	1,529,599,974	1,277,095,503	8,349	40	0.4
第38期	1,414,997,469	1,187,891,522	8,395	40	0.4
第39期	1,307,054,522	1,101,668,310	8,429	40	0.4
第40期	1,261,497,054	1,060,267,313	8,405	40	0.4
第41期	1,233,170,720	1,050,938,274	8,522	40	0.4
第42期	1,213,005,209	1,013,506,517	8,355	40	0.4
第43期	1,183,268,253	994,541,902	8,405	40	0.4
第44期	1,135,253,158	953,865,943	8,402	40	0.4
第45期	1,110,198,585	932,428,376	8,399	40	0.4
第46期	1,087,822,413	888,485,602	8,168	40	0.4
第47期	1,079,858,522	847,138,154	7,845	40	0.4
第48期	1,042,040,703	842,604,100	8,086	40	0.4
第49期	964,582,581	790,327,645	8,193	40	0.4
第50期	959,230,546	797,714,640	8,316	40	0.4
第51期	939,996,966	759,922,626	8,084	40	0.4
第52期	917,445,829	733,991,471	8,000	40	0.4
第53期	892,751,371	716,445,788	8,025	40	0.4
第54期	858,922,676	667,273,757	7,769	40	0.4
第55期	835,245,207	665,016,898	7,962	40	0.4
第56期	823,545,400	658,485,613	7,996	40	0.4
第57期	737,970,549	592,775,625	8,033	40	0.4
第58期	713,993,255	575,105,653	8,055	40	0.4
第59期	693,492,819	562,225,218	8,107	40	0.4
第60期	692,987,218	562,878,049	8,122	40	0.4
第61期	684,267,170	495,470,996	7,241	40	0.4
第62期	681,980,210	489,233,089	7,174	40	0.4
第63期	680,885,295	491,765,451	7,222	40	0.4
第64期	675,430,460	504,993,080	7,477	40	0.4
第65期	660,925,316	492,102,895	7,446	40	0.4
第66期	661,602,139	510,223,727	7,712	40	0.4
第67期	655,250,691	500,024,300	7,631	40	0.4
第68期	651,652,122	491,396,965	7,541	40	0.4
第69期	631,060,179	475,775,388	7,539	40	0.4

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1 万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第70期	608,593,410円	460,079,781円	7,560円	40円	0.4%
第71期	598,472,608	454,975,492	7,602	40	0.4
第72期	591,222,854	452,375,969	7,652	40	0.4
第73期	575,325,334	448,846,034	7,802	40	0.4
第74期	571,135,096	448,814,326	7,858	40	0.4
第75期	555,991,634	436,964,054	7,859	40	0.4
第76期	550,802,548	433,498,405	7,870	40	0.4
第77期	548,710,346	428,483,737	7,809	40	0.4
第78期	549,161,199	426,392,476	7,764	40	0.4
第79期	545,783,305	421,771,093	7,728	40	0.4
第80期	544,860,187	426,996,452	7,837	40	0.4
第81期	524,489,492	410,131,510	7,820	40	0.4
第82期	523,588,158	400,591,373	7,651	40	0.4
第83期	522,484,173	403,511,472	7,723	40	0.4
第84期	520,822,151	393,944,557	7,564	40	0.4
第85期	500,455,406	367,043,572	7,334	40	0.4
第86期	480,089,705	372,078,680	7,750	40	0.4
第87期	470,189,363	351,435,468	7,474	0	0.0

○分配金のお知らせ

	第83期	第84期	第85期	第86期	第87期
1 万口当たり分配金 (税込み)	40円	40円	40円	40円	0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。

○償還金のお知らせ

1 万口当たり償還金 (税込み)	7,491円19銭
------------------	-----------