

ロゲー  
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モディティ・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モディティ・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)	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への直接投資は行いません。</li> <li>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</li> <li>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</li> </ul>
	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	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への投資は行いません。</li> <li>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。</li> </ul>
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10期 運用報告書(全体版)  
(決算日 2023年9月19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10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		騰落率	債組 入比	券率	投資信託 組入比	純資産額
		税分 込	み金					
	円	円	円	%	%	%	%	百万円
6期(2019年9月17日)	11,854	0	0	6.4	0.0	0.0	98.4	124
7期(2020年9月17日)	12,394	0	0	4.6	0.0	0.0	98.3	137
8期(2021年9月17日)	12,811	0	0	3.4	0.0	0.0	98.5	146
9期(2022年9月20日)	10,531	0	0	△17.8	0.0	0.0	98.3	124
10期(2023年9月19日)	10,319	0	0	△2.0	0.0	0.0	98.2	111

(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 額	騰落率		債組 入比	券率	投資信託 組入比	純資産額
		騰	落				
	円	%	%	%	%	%	百万円
(期首) 2022年9月20日	10,531	—	—	0.0	0.0	98.3	124
9月末	10,103	△4.1	—	0.0	0.0	98.3	124
10月末	10,083	△4.3	—	0.0	0.0	97.5	124
11月末	10,381	△1.4	—	0.0	0.0	97.5	124
12月末	10,369	△1.5	—	0.0	0.0	97.3	124
2023年1月末	10,665	1.3	—	0.0	0.0	97.3	124
2月末	10,486	△0.4	—	0.0	0.0	98.8	124
3月末	10,309	△2.1	—	0.0	0.0	98.5	124
4月末	10,378	△1.5	—	0.0	0.0	98.3	124
5月末	10,340	△1.8	—	0.0	0.0	98.2	124
6月末	10,286	△2.3	—	0.0	0.0	97.9	124
7月末	10,402	△1.2	—	0.0	0.0	97.7	124
8月末	10,337	△1.8	—	0.0	0.0	98.5	124
(期末) 2023年9月19日	10,319	△2.0	—	0.0	0.0	98.2	111

(注) 騰落率は期首比です。

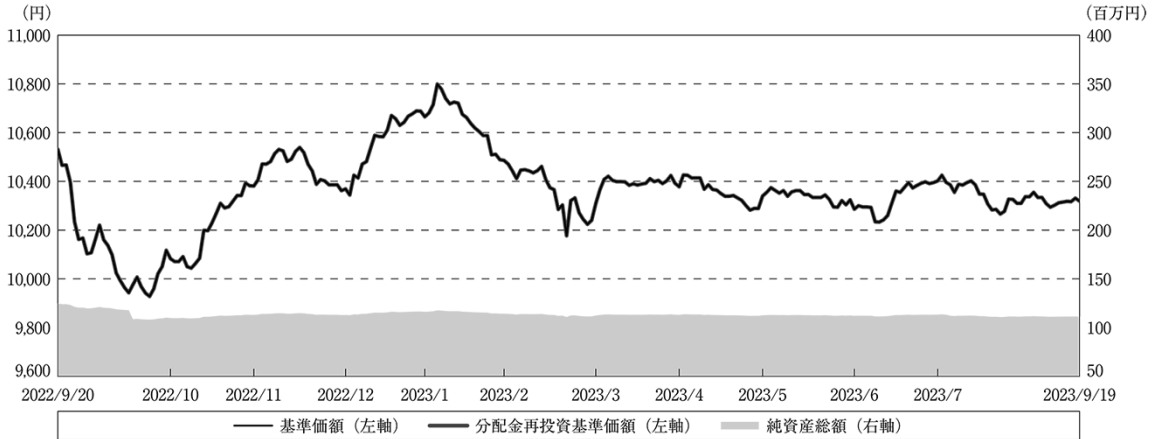
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

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

(2022年9月21日～2023年9月19日)

### ■期中の基準価額等の推移



期首：10,531円

期末：10,319円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 2.0% (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がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額は、期首(2022年9月20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
- ・企業業績の回復や金融システム不安の沈静化に伴う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

- ・インフレの進行に伴う政策金利の引き上げなどを背景とした主要先進国の国債利回りの上昇(債券価格は下落)
- ・為替ヘッジなどのコスト

## ■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。期初、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融引き締め懸念から、米国債利回りは上昇した局面もありましたが、インフレ指標に一時落ち着く兆しがみられると、金融引き締め終了に対する期待から低下し、期半ばにかけてボックス圏で推移しました。2023年4月初旬にかけては、米国地方銀行の破綻などで金融システム不安が高まり、米国債利回りは低下しましたが、その後、米国経済が想定以上に底固く推移したことから、上昇基調となりました。期末にかけては、ジャクソンホール会議でのパウエルFRB議長のコメントが事前の想定通り、引き続きインフレを警戒する内容だったことなどから、米国債利回りは高い水準でもみ合う展開となりました。

ドイツ国債利回りは上昇しました。欧州におけるインフレは高止まりしており、ECB（欧州中央銀行）による金融引き締め姿勢を受けてドイツ国債利回りは上昇しました。

英国債利回りは上昇しました。期初、景気の先行き懸念が高まったこともあって英国債利回りは低下基調となりましたが、その後はインフレの高止まりから、BOE（イングランド銀行）の金融引き締め姿勢が継続し、上昇基調となりました。

### 【ハイブリッド証券市場】

当期、ハイブリッド証券の価格はおおむね横ばいとなりました。期初は資源高やインフレの進行、海外の主要中央銀行による金融引き締め政策などから、ハイブリッド証券のスプレッドは拡大しましたが、期後半は企業業績の回復や金融システム不安の落ち着きなどで縮小傾向となりました。

## ■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、2.0%下落しました。

### <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、インフレ状況、主要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、政府保証債や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10期
	2022年9月21日～ 2023年9月19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	5,554

(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>

米国ではインフレ率がピークを迎えつつあると考えており、高インフレへの対応としてFRBが政策金利の引き上げを継続する可能性は残りますが、2023年内には金融引き締めを終了する可能性が高まっていると考えます。欧州では、ECBによる利上げの継続が予想される一方、金利引き上げに伴う金融システム不安への警戒感から慎重に対応することが想定されます。

今後も金融セクターの信用不安拡大の影響について警戒する必要がありますが、これまでの金融危機を受けた規制強化もあり金融機関の多くが過去に比べて健全な財務状況にあることや、欧米金融当局による金融市場の安定化に向けた流動性支援策などが、ハイブリッド証券市場の下支え要因になると考えます。

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。

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>

日銀が2%の「物価安定の目標」の持続的・安定的な実現を見通せる状況となるまで緩和的な政策を継続するとの姿勢を示していることから、国内の短期金利は当面低位での推移が継続すると予想しています。ただし、国内経済・物価の先行きにかかる不確実性は高く、将来的な日銀の金融政策運営を巡る動向には留意が必要です。

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

(2022年9月21日～2023年9月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 105	% 1.013	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	( 32)	(0.307)	*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 )	( 70)	(0.680)	*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	106	1.024	
期中の平均基準価額は、10,344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。

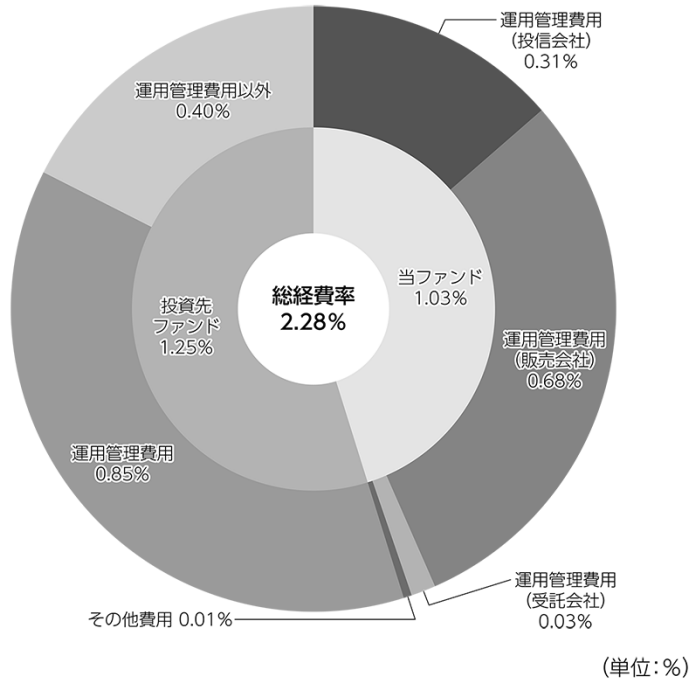
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）が支払った費用を含みません。

(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2.28%です。



総経費率(①+②+③)	2.28
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	0.85
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.40

- (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」の費用を基に算出しています。

## ○売買及び取引の状況

(2022年9月21日～2023年9月19日)

### 投資信託証券

銘		柄	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
			0.2918	2,000	1	10,000

(注) 金額は受渡代金です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年9月21日～2023年9月19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

(2023年9月19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
		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 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		17	16	109,368	98.2
合	計	17	16	109,368	98.2

(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	柄	期首(前期末)	当期末	
		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

(2023年9月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	109,368	97.7
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	2,553	2.3
投資信託財産総額	111,931	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年9月19日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	111,931,426
コール・ローン等	2,552,435
投資信託受益証券(評価額)	109,368,978
東京海上マネーマザーファンド(評価額)	10,013
(B) 負債	578,457
未払信託報酬	572,343
未払利息	5
その他未払費用	6,109
(C) 純資産総額(A-B)	111,352,969
元本	107,909,769
次期繰越損益金	3,443,200
(D) 受益権総口数	107,909,769口
1万円当たり基準価額(C/D)	10,319円

(注) 当ファンドの期首元本額は118,488,187円、期中追加設定元本額は113,235円、期中一部解約元本額は10,691,653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1万円当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

## ○損益の状況 (2022年9月21日～2023年9月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,586,776
受取配当金	3,588,052
受取利息	15
支払利息	△ 1,291
(B) 有価証券売買損益	△ 4,706,994
売買益	557,452
売買損	△ 5,264,446
(C) 信託報酬等	△ 1,161,578
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 2,281,796
(E) 前期繰越損益金	△ 5,904,126
(F) 追加信託差損益金	11,629,122
(配当等相当額)	( 35,840,044)
(売買損益相当額)	(△24,210,922)
(G) 計(D+E+F)	3,443,200
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	3,443,200
追加信託差損益金	11,629,122
(配当等相当額)	( 35,840,044)
(売買損益相当額)	(△24,210,922)
分配準備積立金	24,094,837
繰越損益金	△32,280,759

(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)	2,425,210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	35,840,044円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	21,669,627円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	59,934,881円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	5,554円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万円当たり)	0円

## ○お知らせ

当ファンドが投資する外国投資信託について、「Allianz Global Investors GmbH」(アリアンツGI社)の運用拠点である「Allianz GI GmbH UK branch」が、当局の承認を得て、「Allianz Global Investors UK Limited」(アリアンツGI UK社)となったことに伴い、2023年5月30日付で運用委託先を変更しました。

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

(2023年9月19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(8,527千口)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BB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	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
地方債証券	6,000 (6,000)	6,002 (6,002)	69.6 (69.6)	— (—)	— (—)	— (—)	69.6 (69.6)	
合 計	6,000 (6,000)	6,002 (6,002)	69.6 (69.6)	— (—)	— (—)	— (—)	69.6 (69.6)	

(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54回川崎市公募公債(5年)	0.02	3,000	2,999	2023/9/20
平成25年度第2回福井県公募公債	0.68	3,000	3,002	2023/10/25
合 計		6,000	6,002	

(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。その他、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: MUFGLuxsma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 UK Limited

※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

2022年3月1日  
～2023年2月28日  
(円)

当期中における純資産額	33,264,238,262
<b>収益</b>	
銀行預金に係る受取利息	11,751,024
債券に係る受取利息（純額）	1,181,386,890
その他収益	85,660
<b>収益合計</b>	<b>1,193,223,574</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	( 51,039,810)
代行協会員報酬	( 8,368,283)
販売報酬	( 99,247,968)
当座借越に係る支払利息	( 500,701)
投資顧問報酬	( 209,970,615)
その他の費用	( 7,253,177)
専門家報酬	( 12,072,560)
副保管機関報酬	( 2,682,063)
副管理者報酬	( 7,878,545)
受託報酬	( 3,158,131)
<b>費用合計</b>	<b>( 402,171,853)</b>
<b>投資純利益／（損失）</b>	<b>791,051,721</b>
投資に係る実現純利益／（損失）	607,657,999
為替予約および為替先渡取引に係る実現純利益／（損失）	627,701,808
<b>当期実現純利益／（損失）</b>	<b>1,235,359,807</b>
以下に係る未実現純利益（損失）の増減	
－投資	( 286,552,384)
－為替予約および為替先渡取引	( 292,465,808)
－その他の資産および負債の為替換算	11,467,706
	<b>( 567,550,486)</b>
<b>運用による純資産の増加／（減少）額</b>	<b>1,458,861,042</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

2023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	731,553,226	2.5
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	期限付劣後債	2023/6/15	5.625	USD	563,879,019	1.9
	BANK OF AMERICA CORP	期限付劣後債	2038/5/14	7.75	USD	473,275,036	1.6
	CAPITAL ONE FINANCIAL CO	その他	2029/6/12	1.65	EUR	396,002,310	1.3
	JPMORGAN CHASE & CO	期限付劣後債	2030/5/13	2.956	USD	389,109,560	1.3
	FIFTH THIRD BANCORP	その他	2032/4/25	4.337	USD	326,469,362	1.1
	METLIFE INC	期限付劣後債	2031/12/15	6.4	USD	273,014,689	0.9
	JACKSON FINANCIAL INC	その他	2031/8/23	3.125	USD	272,087,453	0.9
	BANK OF AMERICA CORP	その他	2032/2/4	2.972	USD	250,660,647	0.8
	PRINCIPAL FINANCIAL GRP	期限付劣後債	2023/4/3	7.90757	USD	249,099,776	0.8
	HUNTINGTON BANCSHARES	その他	2032/5/17	5.023	USD	228,566,018	0.8
	SYNOVUS BANK GA	期限付劣後債	2025/10/29	4	USD	218,233,457	0.7
	CITIGROUP INC	その他	2039/7/15	8.125	USD	176,958,740	0.6
	LIBERTY MUTUAL GROUP INC	期限付劣後債	2026/9/15	4.125	USD	160,814,067	0.5
	CHUBB INA HOLDINGS INC	その他	2037/9/15	2.5	EUR	152,548,184	0.5
	GLOBAL ATLANTIC FIN CO	その他	2031/3/15	3.125	USD	134,142,786	0.5
	HARTFORD FINL SVCS GRP	期限付劣後債	2023/4/3	6.98857	USD	128,504,550	0.4
	DIGITAL DUTCH FINCO BV	その他	2031/10/15	1	EUR	103,970,155	0.3
	NASDAQ INC	その他	2049/10/28	3.25	USD	82,575,696	0.3
	COREBRIDGE FINANCIAL INC	その他	2027/3/5	3.65	USD	82,568,161	0.3
小計 (金額・比率)						5,394,032,892	18.1
イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	期限付劣後債	2038/6/1	6.8	USD	433,269,455	1.5
	NATWEST GROUP PLC	期限付劣後債	2027/6/14	1.043	EUR	416,811,531	1.4
	PHOENIX GRP HLD PLC	期限付劣後債	2029/1/24	4.375	EUR	385,053,461	1.3
	STANDARD CHARTERED PLC	期限付劣後債	2027/2/19	4.3	USD	315,610,427	1.1
	HSBC BANK USA NA	期限付劣後債	2039/1/15	7	USD	306,105,590	1.0
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	期限付劣後債	2026/9/15	1.985	GBP	302,599,851	1.0
	AVIVA PLC	期限付劣後債	2035/3/3	4	GBP	257,645,437	0.9
	HSBC BANK PLC	永久劣後債	2023/3/31	4.44	USD	244,761,328	0.8
	HSBC HOLDINGS PLC	その他	2026/6/15	3.019	EUR	206,174,111	0.7
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	永久劣後債	2024/12/27	5.125	GBP	200,897,433	0.7
	M&G PLC	期限付劣後債	2031/10/20	5.625	GBP	185,854,166	0.6
	VIRGIN MONEY UK PLC	期限付劣後債	2026/5/19	2.625	GBP	153,776,243	0.5
	RL FINANCE NO 4 PLC	期限付劣後債	2039/4/7	4.875	GBP	150,102,016	0.5
	BARCLAYS PLC	永久劣後債	2028/9/15	9.25	GBP	148,591,479	0.5
	STANDARD CHARTERED PLC	期限付劣後債	2043/1/9	5.3	USD	139,539,177	0.5
	HSBC HOLDINGS PLC	期限付劣後債	2040/3/29	6	GBP	120,888,024	0.4
	NATWEST GROUP PLC	期限付劣後債	2026/8/26	2.105	GBP	69,863,010	0.2
RL FINANCE BONDS NO3	期限付劣後債	2028/11/13	6.125	GBP	64,354,895	0.2	
小計 (金額・比率)						4,101,897,634	13.8
イタリア	ASSICURAZIONI GENERALI	期限付劣後債	2028/6/8	5	EUR	364,239,972	1.2
小計 (金額・比率)						364,239,972	1.2
オーストラリア	AUST & NZ BANKING GROUP	期限付劣後債	2026/5/5	0.669	EUR	557,125,571	1.9
	MACQUARIE GROUP LTD	その他	2027/6/21	4.098	USD	358,923,272	1.2
	COMMONWEALTH BANK AUST	期限付劣後債	2032/3/14	3.784	USD	270,040,469	0.9
	WESTPAC BANKING CORP	期限付劣後債	2026/5/13	0.766	EUR	229,332,744	0.8
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	期限付劣後債	2026/9/15	1.699	GBP	165,225,318	0.6
小計 (金額・比率)						1,580,647,374	5.3
オランダ	DE VOLKSBANK NV	期限付劣後債	2025/10/22	1.75	EUR	497,770,671	1.7
	NN GROUP NV	永久劣後債	2026/1/15	4.5	EUR	460,457,890	1.5
	ABN AMRO BANK NV	期限付劣後債	2031/12/13	3.324	USD	309,886,946	1.0
	ASR NEDERLAND NV	期限付劣後債	2029/2/2	3.375	EUR	281,619,168	0.9
	ARGENTUM (SWISS RE LTD)	永久劣後債	2027/8/15	5.524	USD	226,277,639	0.8
	AEON NV	優先出資証券	2023/4/15	3.584	USD	223,083,964	0.7
	COOPERATIEVE RABOBANK UA	期限付劣後債	2027/8/30	3.875	EUR	176,798,414	0.6
	ING GROEP NV	期限付劣後債	2026/2/26	2.125	EUR	157,112,836	0.5

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	COOPERATIEVE RABOBANK UA	優先出資証券	2027/6/29	4.375	EUR	155,208,617	0.5
	ELM BV (HELVETIA SCHWEIZ)	期限付劣後債	2027/9/29	3.375	EUR	124,505,439	0.4
	ING GROEP NV	その他	2032/3/28	4.252	USD	102,790,867	0.3
	ING GROEP NV	期限付劣後債	2027/3/9	0.875	EUR	60,944,137	0.2
	COOPERATIEVE RABOBANK UA	その他	2032/4/6	3.758	USD	47,347,359	0.2
小計 (金額・比率)						2,823,803,947	9.5
スイス	CREDIT SUISSE GROUP AG	その他	2027/6/9	2.25	GBP	362,182,302	1.2
	ZUERCHER KANTONALBANK	期限付劣後債	2027/4/13	2.02	EUR	242,000,544	0.8
	SWISS RE FINANCE LUX	永久劣後債	2024/9/4	4.25	USD	227,465,938	0.8
	UBS GROUP AG	永久劣後債	2026/7/29	5.125	USD	212,973,569	0.7
	ZURICH FINANCE IRELAND	期限付劣後債	2031/1/19	3	USD	194,136,124	0.7
小計 (金額・比率)						1,415,365,025	4.8
スウェーデン	SWEDBANK AB	期限付劣後債	2027/8/23	3.625	EUR	86,714,612	0.3
小計 (金額・比率)						86,714,612	0.3
スペイン	BANCO SANTANDER SA	期限付劣後債	2027/1/19	3.125	EUR	408,133,241	1.4
	CAIXABANK SA	期限付劣後債	2026/3/18	1.25	EUR	364,540,324	1.2
	SANTANDER UK GROUP HLDGS	期限付劣後債	2045/9/15	5.625	USD	171,578,450	0.6
	BANCO SANTANDER SA	期限付劣後債	2027/7/4	2.25	GBP	121,286,264	0.4
	MAPPRE SA	期限付劣後債	2030/4/13	2.875	EUR	85,025,462	0.3
	MAPPRE SA	期限付劣後債	2027/3/31	4.375	EUR	83,043,302	0.3
小計 (金額・比率)						1,233,607,043	4.1
デンマーク	DANSKE BANK A/S	期限付劣後債	2026/2/15	1	EUR	374,758,358	1.3
	DANSKE BANK A/S	期限付劣後債	2024/6/21	2.5	EUR	312,960,743	1.1
	JYSKE BANK A/S	期限付劣後債	2026/1/28	1.25	EUR	283,510,462	1.0
小計 (金額・比率)						971,229,563	3.3
ドイツ	LB BADEN-WUERTEMBERG	期限付劣後債	2025/6/16	3.625	EUR	277,708,023	0.9
	LANDBK HESSEN-THUERINGEN	期限付劣後債	2027/6/15	4.5	EUR	232,199,848	0.8
	HANNOVER RE	期限付劣後債	2029/7/9	1.125	EUR	190,528,193	0.6
	DEUTSCHE BANK NY	期限付劣後債	2030/10/14	3.729	USD	182,631,472	0.6
	DEUTSCHE BANK AG	その他	2031/2/17	1.375	EUR	140,065,992	0.5
小計 (金額・比率)						1,129,662,128	3.8
ノルウェー	DNB BANK ASA	永久劣後債	2024/11/12	4.875	USD	256,366,655	0.9
小計 (金額・比率)						256,366,655	0.9
フランス	AXA SA	永久劣後債	2026/3/4	5.453	GBP	465,181,001	1.6
	SOCIETE GENERALE	期限付劣後債	2026/6/30	1.125	EUR	386,683,864	1.3
	LA BANQUE POSTALE	期限付劣後債	2027/5/3	0.75	EUR	349,425,008	1.2
	CNP ASSURANCES	期限付劣後債	2033/1/18	5.25	EUR	281,311,563	0.9
	GROUPE ACM	期限付劣後債	2031/10/21	1.85	EUR	264,717,065	0.9
	BNP PARIBAS	期限付劣後債	2028/8/31	0.875	EUR	260,011,764	0.9
	CREDIT AGRICOLE ASSRNCES	期限付劣後債	2028/1/29	2.625	EUR	252,908,769	0.8
	MUTUELLE ASSURANCE	期限付劣後債	2032/3/21	2.125	EUR	190,276,110	0.6
	BANQUE FED CRED MUTUEL	期限付劣後債	2031/11/19	1.125	EUR	186,514,194	0.6
	CREDIT AGRICOLE SA	永久劣後債	2027/12/23	4	EUR	175,296,362	0.6
	CREDIT AGRICOLE SA	期限付劣後債	2026/12/9	1.874	GBP	165,941,127	0.6
	CREDIT AGRICOLE SA	永久劣後債	2028/9/23	7.25	EUR	160,548,313	0.5
	BPCE SA	期限付劣後債	2026/10/13	1.5	EUR	145,703,695	0.5
	BNP PARIBAS	期限付劣後債	2026/5/24	2	GBP	142,790,601	0.5
小計 (金額・比率)						3,427,309,436	11.5
ペルー	BANCO DE CREDITO DEL PER	期限付劣後債	2025/7/1	3.125	USD	326,858,109	1.1
小計 (金額・比率)						326,858,109	1.1
日本	DAI-ICHI LIFE INSURANCE	永久劣後債	2024/10/28	5.1	USD	634,619,583	2.1
	MTSUI SUMITOMO INSURANC	永久劣後債	2029/3/6	4.95	USD	406,339,157	1.4
	SUMITOMO MITSUI FINL GRP	期限付劣後債	2029/9/17	3.202	USD	317,932,632	1.1
	SOMPO JAPAN INSURANCE	期限付劣後債	2023/3/28	5.325	USD	175,444,988	0.6
	AVIATION CAPITAL GROUP	その他	2027/7/1	3.5	USD	164,053,129	0.6
小計 (金額・比率)						1,698,389,489	5.7

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	BAWAG GROUP AG	期限付劣後債	2024/3/26	2.375	EUR	552,657,627	1.9
	VOLKSBANK WIEN AG	その他	2026/3/23	0.875	EUR	230,682,549	0.8
	RAIFFEISENBANK AS	その他	2027/6/9	1	EUR	153,371,131	0.5
	UNIQA INSURANCE GROUP AG	期限付劣後債	2031/6/9	2.375	EUR	61,590,893	0.2
小計 (金額・比率)					998,302,200	3.4	
アイルランド	BANK OF IRELAND GROUP	期限付劣後債	2024/10/14	2.375	EUR	492,868,438	1.7
小計 (金額・比率)					492,868,438	1.7	
イスラエル	BANK HAPOALIM	期限付劣後債	2026/10/21	3.255	USD	384,327,611	1.3
小計 (金額・比率)					384,327,611	1.3	
フィンランド	NORDEA BANK ABP	期限付劣後債	2026/5/18	0.625	EUR	363,339,399	1.2
	SAMPO OYJ	期限付劣後債	2032/6/3	2.5	EUR	171,353,948	0.6
	NORDEA BANK ABP	期限付劣後債	2027/9/9	1.625	GBP	107,066,987	0.4
小計 (金額・比率)					641,760,334	2.2	
韓国	HANWHA LIFE INSURANCE	期限付劣後債	2027/2/4	3.379	USD	361,266,249	1.2
小計 (金額・比率)					361,266,249	1.2	
カナダ	BANK OF NOVA SCOTIA	期限付劣後債	2026/10/27	3.625	USD	229,504,567	0.8
小計 (金額・比率)					229,504,567	0.8	
ベルギー	BELFIUS BANK SA/NV	期限付劣後債	2029/1/5	1.25	EUR	225,481,110	0.8
	AGEAS	永久劣後債	2029/12/10	3.875	EUR	150,836,882	0.5
	AGEAS	期限付劣後債	2029/7/2	3.25	EUR	86,683,656	0.3
小計 (金額・比率)					463,001,648	1.6	
香港	AIA GROUP LTD	永久劣後債	2026/4/7	2.7	USD	213,498,787	0.7
	AIA GROUP LTD	期限付劣後債	2028/6/9	0.88	EUR	148,966,959	0.5
小計 (金額・比率)					362,465,746	1.2	
中国	HUARONG FINANCE 2019	その他	2030/6/30	3.625	USD	130,596,131	0.4
	AVOLON HOLDINGS FNDG LTD	その他	2026/3/15	4.25	USD	88,483,853	0.3
	AVOLON HOLDINGS FNDG LTD	その他	2026/3/1	4.375	USD	83,050,125	0.3
	AVOLON HOLDINGS FNDG LTD	その他	2025/12/15	5.5	USD	75,115,992	0.3
小計 (金額・比率)					377,246,101	1.3	
トーゴ共和国	BANQUE OUEST AFRICAINE D	その他	2032/10/22	2.75	EUR	43,482,221	0.1
小計 (金額・比率)					43,482,221	0.1	
総計					29,164,348,994	98.0	

(注) 管理会社である「ルクセンブルク三菱UFJインベ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2023年2月28日現在のデータです。邦貨換算額は、2023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16期 (決算日 2023年8月15日)

(計算期間 2022年8月16日～2023年8月15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
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
15期(2022年8月15日)	10,118	0.0	100.66	△0.02	71.1	8
16期(2023年8月15日)	10,119	0.0	100.62	△0.04	69.6	8

## ○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) 2022年8月15日	円	%			%
8月末	10,118	—	100.66	—	71.1
9月末	10,118	0.0	100.65	△0.00	71.1
10月末	10,118	0.0	100.65	△0.01	70.2
11月末	10,118	0.0	100.65	△0.01	70.2
12月末	10,118	0.0	100.64	△0.02	70.3
2023年1月末	10,118	0.0	100.64	△0.02	69.6
2月末	10,118	0.0	100.64	△0.02	69.6
3月末	10,118	0.0	100.64	△0.02	69.5
4月末	10,119	0.0	100.63	△0.03	69.6
5月末	10,119	0.0	100.63	△0.03	69.6
6月末	10,119	0.0	100.62	△0.04	69.6
7月末	10,119	0.0	100.62	△0.04	69.6
(期末) 2023年8月15日	10,119	0.0	100.62	△0.04	69.6

(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

(2022年8月16日～2023年8月15日)

## ■期中の基準価額等の推移

期首：10,118円

期末：10,119円

騰落率： 0.0%

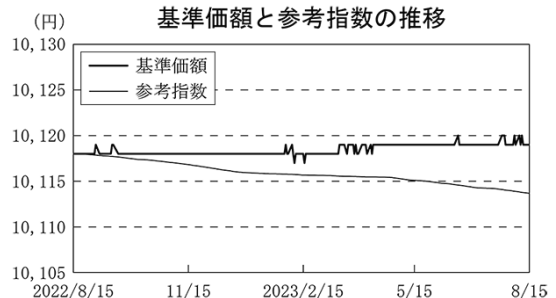
## ◇基準価額の主な変動要因

## 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



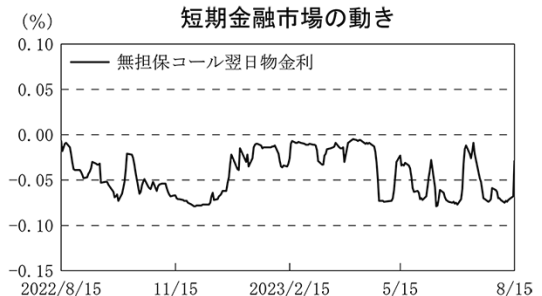
(注) 参考指数は、期首（2022年8月15日）の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(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・質的金融緩和を維持したことで、マイナス圏で推移しました。金融緩和の度合いを測る上で着目する日銀の当座預金残高は、476兆円から555兆円程度で推移し、短期金融市場の資金余剰感が非常に強い状況が継続しました。

このような状況下、無担保コール翌日物金利は-0.08%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、-0.30%から-0.10%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、政府保証債や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。

## ○今後の運用方針

日銀が2%の「物価安定の目標」の持続的・安定的な実現を見通せる状況となるまで緩和的な政策を継続するとの姿勢を示していることから、国内の短期金利は当面低位にとどまると予想しています。ただし、国内経済・物価の先行きに関する不確実性は高く、将来的な日銀の金融政策運営を巡る動向には留意が必要です。

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

(2022年8月16日～2023年8月15日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2022年8月16日～2023年8月15日)

## 公社債

		買付額	売付額
国	地方債証券	千円 24,015	千円 — (24,000)
	内 特殊債券	6,009	— (6,000)

(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

(2022年8月16日～2023年8月15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

(2023年8月15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BB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	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
地方債証券	6,000 (6,000)	6,003 (6,003)	69.6 (69.6)	— (—)	— (—)	— (—)	69.6 (69.6)	
合 計	6,000 (6,000)	6,003 (6,003)	69.6 (69.6)	— (—)	— (—)	— (—)	69.6 (69.6)	

(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54回川崎市公募公債(5年)	0.02	3,000	3,000	2023/9/20
平成25年度第2回福井県公募公債	0.68	3,000	3,003	2023/10/25
合 計		6,000	6,003	

(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

(2023年8月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	6,003	69.6
コール・ローン等、その他	2,626	30.4
投資信託財産総額	8,629	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年8月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,629,544
コール・ローン等	2,619,166
公社債(評価額)	6,003,930
未収利息	1,156
前払費用	5,292
(B) 負債	4
未払利息	4
(C) 純資産総額(A-B)	8,629,540
元本	8,527,678
次期繰越損益金	101,862
(D) 受益権総口数	8,527,678口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,119円

(注) 当親ファンドの期首元本額は8,340,052円、期中追加設定元本額は197,528円、期中一部解約元本額は9,902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) マナープール・ファンド	2,274,827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・東南アジア株式ファンド	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) ブラジル・リアルコース (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) 豪ドルコース (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) 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) 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 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 (為替ヘッジあり) (年1回決算型)	9,890円
東京海上・がんたたたかう投信 (為替ヘッジなし) (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 (2022年8月16日～2023年8月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	24,606
受取利息	25,769
支払利息	△ 1,163
(B) 有価証券売買損益	△ 23,040
売買益	960
売買損	△ 24,000
(C) 当期損益金(A+B)	1,566
(D) 前期繰越損益金	98,082
(E) 追加信託差損益金	2,330
(F) 解約差損益金	△ 116
(G) 計(C+D+E+F)	101,862
次期繰越損益金(G)	101,862

(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。