

東京海上・エンターテインメント・ テクノロジー株式会社ファンド (為替ヘッジなし) 〈愛称 エンテック〉

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／株式 (課税上は株式投資信託として取扱われます。)	
信託期間	2020年8月28日から2030年8月6日	
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行います。	
主要投資対象	東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式会社ファンド(為替ヘッジなし)	「東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式会社マザーファンド」を主要投資対象とします。
	東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式会社マザーファンド	日本を含む世界の取引所に上場されている株式(これに準ずるものを含みます。)を主要投資対象とします。
投資制限	東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式会社ファンド(為替ヘッジなし)	<ul style="list-style-type: none"> 株式への実質投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式会社マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の、繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。 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6期 運用報告書(全体版)
(決算日 2023年8月7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・エンターテインメント・テクノロジー株式会社ファンド(為替ヘッジなし)〈愛称 エンテック〉」は、このたび、第6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			株組 入比	式率	純資 産額
		税分	込配	み金 期騰 落 中率			
	円		円		%	百万円	
2期(2021年8月6日)	11,510		500	△ 4.3	98.4	12,865	
3期(2022年2月7日)	10,458		0	△ 9.1	97.0	8,002	
4期(2022年8月8日)	9,556		0	△ 8.6	97.1	4,762	
5期(2023年2月6日)	9,494		0	△ 0.6	96.7	4,017	
6期(2023年8月7日)	11,099		200	19.0	98.7	3,931	

(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、「株式組入比率」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		株組 入比	式率
		騰	落 率		
(期首) 2023年2月6日	円 9,494		% -		96.7
2月末	9,292	△	2.1		96.8
3月末	9,622		1.3		97.1
4月末	9,700		2.2		97.8
5月末	10,177		7.2		98.6
6月末	11,074		16.6		97.1
7月末	11,537		21.5		98.3
(期末) 2023年8月7日	11,299		19.0		98.7

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

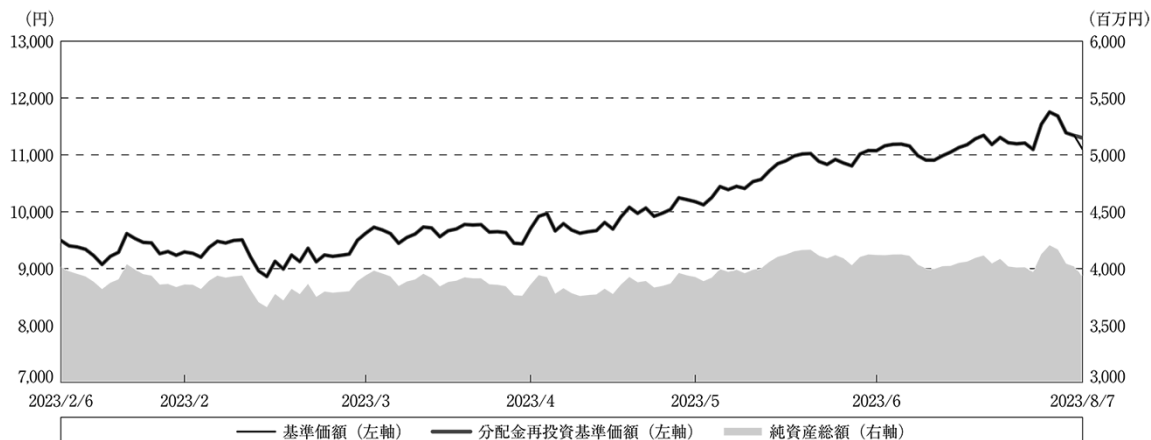
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

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

(2023年2月7日～2023年8月7日)

■期中の基準価額等の推移



期首：9,494円

期末：11,099円(既払分配金(税込み):200円)

騰落率：19.0%(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(2023年2月6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

- ・米国でインフレ進行の不服感から金融引き締めペースの減速に対する期待が高まる場面があったこと
- ・ハイテク関連銘柄を中心に事前予想を上回る好調な決算が発表されたこと
- ・円安が進行したこと

マイナス要因

- ・インフレ懸念の高まりを背景に、欧米の中央銀行が金融引き締めを継続したこと

■投資環境

【世界株式市場】

当期、世界の株式市場は上昇しました。ロシアによるウクライナ侵攻の長期化やそれを受けたインフレ高進を背景とした欧米の中央銀行の金融引き締め継続といった環境に大きな変化はなかったものの、米国でインフレ進行の不服感を示す指標が出始めたことで、金融引き締めペースの減速に対する期待が高まり、株式市場は堅調な展開となりました。一部のハイテク関連銘柄で事前予想を上回る決算が発表されるなど、ハイテク関連企業を中心に業績の回復が見られたことも株式市場のサポート材料となりました。

【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。期初はインフレ懸念を背景とした欧米の中央銀行による金融引き締め継続により、米国金利の先高観が強まり円安米ドル高が進行しましたが、その後は米国地方銀行の破綻などで金融システム不安の高まりから米ドルが売られ、円高米ドル安となる場面が見られました。しかし、金融システム不安が徐々に和らぐにつれて、再びインフレの高まりに注目が集まり円安米ドル高の動きが強まりました。日銀が長期金利の許容変動幅を柔軟化しましたが円高の動きは一時的で、期を通じては円安米ドル高となりました。

ユーロ円為替レートは円安ユーロ高となりました。期初は米国の金融システム不安の影響から横ばいでの推移となったものの、その後金融システム不安の懸念が和らぐと、金利差を背景に円安ユーロ高が進行しました。日銀が長期金利の許容変動幅を柔軟化しましたが、ユーロ圏のGDP(国内総生産)が想定よりも堅調となったことなどから円安ユーロ高の流れが強まりました。

■ポートフォリオについて

<東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式ファンド(為替ヘッジなし)>

「東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式マザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持しました。

当ファンドの基準価額(税引前分配金再投資)は、マザーファンドの値動きを反映し、19.0%上昇しました。

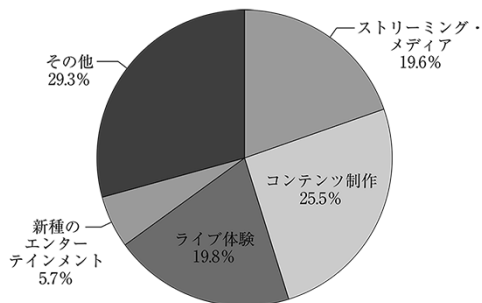
<東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式マザーファンド>

エンターテインメント業界における技術的發展を牽引する、あるいはその恩恵を受けると判断する企業(エンテック関連企業)の株式等に投資しました。

当期、株式市場が堅調に推移するなか、ハイテク関連企業を中心にエンテック関連企業の株価は上昇しました。

以上の運用の結果、保有銘柄の上昇や円安の進行などから、基準価額は19.9%上昇しました。

【投資テーマ別構成(2023年8月7日現在)】



※「投資テーマ」はTCW Asset Management Company LLCの情報を基に作成しています。銘柄の事業内容によっては、複数の投資テーマに分類される場合があります。

※比率は各銘柄の投資テーマ毎に占める割合を基に、株式時価総額で加重平均したものです。

■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つ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6期
	2023年2月7日～ 2023年8月7日
当期分配金	200
(対基準価額比率)	1.770%
当期の収益	29
当期の収益以外	170
翌期繰越分配対象額	1,572

(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・エンターテインメント・テクノロジー株式会社ファンド(為替ヘッジなし)>

「東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式マザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持します。

<東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式マザーファンド>

エンテック関連企業は、最新のテクノロジーを駆使して急速な成長を遂げています。新型コロナウイルスの影響によって、人々は新しい生活スタイルを模索するなか、音楽や映画鑑賞、コンサートやスポーツ観戦、ゲームといった日常生活に必要な不可欠なエンターテインメントは、コンテンツの一層の拡充やサービス形態などあらゆる側面で進化を続けるとともに、顧客数を拡大させています。

欧米におけるインフレ懸念やロシアによるウクライナ侵攻関連のニュースなどが投資家心理を左右し、短期的には株式市場の下押し材料となる可能性はありますが、開発力やブランド力のあるエンテック関連企業の株価は、長期的には上昇していくとみています。

引き続き、徹底したファンダメンタルズリサーチを通じ、エンターテインメント技術の発展により収益拡大が期待される企業への投資を行っていきます。

○ 1万口当たりの費用明細

(2023年2月7日～2023年8月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	87	0.850	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(46)	(0.453)	*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 ）	(39)	(0.384)	*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)	(0.014)	*運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	3	0.027	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
（ 株 式 ）	(3)	(0.027)	*売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.005	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数
（ 株 式 ）	(1)	(0.005)	*有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) そ の 他 費 用	1	0.013	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(1)	(0.005)	*保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(1)	(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
（ そ の 他 ）	(0)	(0.003)	*その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	92	0.895	
期中の平均基準価額は、10,233円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

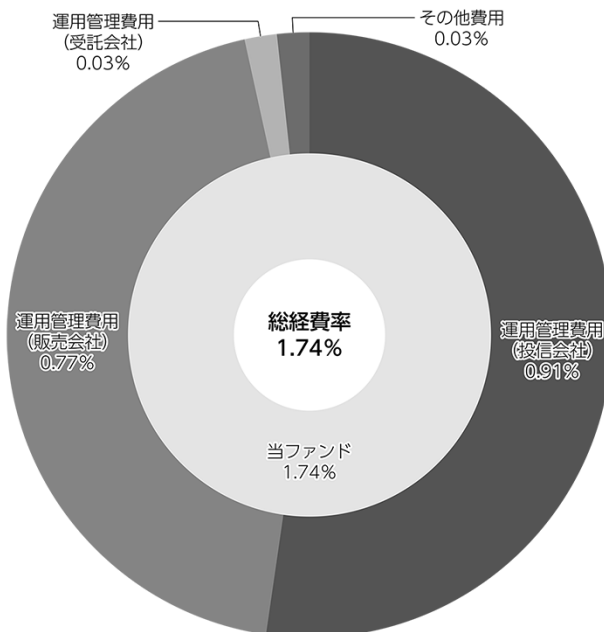
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.74%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2023年2月7日～2023年8月7日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式マザーファンド		千口 78,065	千円 87,079	千口 764,195	千円 897,364

○株式売買比率

(2023年2月7日～2023年8月7日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	1,725,585千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,597,015千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.26	

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2023年2月7日～2023年8月7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7日現在)

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式マザーファンド		千口 3,733,023	千口 3,046,894	千円 3,931,712

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2023年8月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式マザーファンド	3,931,712	97.2
コール・ローン等、その他	114,030	2.8
投資信託財産総額	4,045,742	100.0

(注) 東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(6,198,364千円)の投資信託財産総額(6,862,232千円)に対する比率は90.3%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=141.70円、1ユーロ=155.96円、1英ポンド=180.80円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年8月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,045,742,215
東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式マザーファンド(評価額)	3,931,712,060
未収入金	114,030,155
(B) 負債	114,030,155
未払収益分配金	70,844,873
未払解約金	9,485,984
未払信託報酬	33,483,374
その他未払費用	215,924
(C) 純資産総額(A-B)	3,931,712,060
元本	3,542,243,672
次期繰越損益金	389,468,388
(D) 受益権総口数	3,542,243,672口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,099円

(注) 当ファンドの期首元本額は4,231,356,606円、期中追加設定元本額は88,780,404円、期中一部解約元本額は777,893,338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 (2023年2月7日~2023年8月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	670,555,152
売買益	740,738,354
売買損	△ 70,183,202
(B) 信託報酬等	△ 33,699,298
(C) 当期損益金(A+B)	636,855,854
(D) 前期繰越損益金	△439,821,486
(E) 追加信託差損益金	263,278,893
(配当等相当額)	(218,022,068)
(売買損益相当額)	(45,256,825)
(F) 計(C+D+E)	460,313,261
(G) 収益分配金	△ 70,844,873
次期繰越損益金(F+G)	389,468,388
追加信託差損益金	263,278,893
(配当等相当額)	(218,078,598)
(売買損益相当額)	(45,200,295)
分配準備積立金	338,911,755
繰越損益金	△212,722,260

(注) (A)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (B)信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (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) 信託財産の運用指図に係る権限の全部または一部を委託するため要した費用として、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対して年1万分の52.5の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しています。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	10,521,902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	218,078,598円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	399,234,726円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	627,835,226円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,772円
g. 分配金	70,844,873円
h. 分配金(1万口当たり)	200円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金 (税込み)	200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。

東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式会社マザーファンド

運用報告書 第3期（決算日 2023年8月7日）

（計算期間 2022年8月9日～2023年8月7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。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		株 組 入 比 率	純 資 産 額
		騰 落	中 率		
(設定日)	円		%		百万円
2020年8月28日	10,000		—	—	3,659
1期(2021年8月6日)	12,700		27.0	98.4	20,973
2期(2022年8月8日)	10,745		△15.4	97.1	8,110
3期(2023年8月7日)	12,904		20.1	98.7	6,692

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		株 組 入 比 率
		騰 落	率	
(期 首)	円		%	%
2022年8月8日	10,745		—	97.1
8月末	10,495		△ 2.3	96.5
9月末	9,778		△ 9.0	96.9
10月末	10,387		△ 3.3	96.6
11月末	9,912		△ 7.8	95.8
12月末	9,152		△14.8	97.1
2023年1月末	10,231		△ 4.8	97.6
2月末	10,543		△ 1.9	96.7
3月末	10,933		1.7	96.8
4月末	11,035		2.7	97.5
5月末	11,593		7.9	98.1
6月末	12,627		17.5	96.5
7月末	13,170		22.6	97.5
(期 末)				
2023年8月7日	12,904		20.1	98.7

(注) 騰落率は期首比です。

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8月9日～2023年8月7日)

■期中の基準価額等の推移

期首：10,745円

期末：12,904円

騰落率：20.1%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・米国でインフレ進行の一服感から金融引き締めペースの減速に対する期待が高まる場面があったこと
- ・ハイテク関連銘柄を中心に事前予想を上回る好調な決算が発表されたこと
- ・円安が進行したこと

マイナス要因

- ・インフレ懸念の高まりを背景に、欧米の中央銀行が金融引き締めを継続したこと

■投資環境

【世界株式市場】

当期、世界の株式市場は上昇しました。期初はロシアによるウクライナ侵攻の長期化などを背景としたインフレ懸念が残るなか、欧米の中央銀行が金融引き締めを継続したことから、株式市場は軟調に推移しましたが、その後は米国でインフレ進行に落ち着きを示す指標が出始めたことで、金融引き締めペースの減速に対する期待が高まり、株式市場は堅調な展開となりました。一部のハイテク関連銘柄で事前予想を上回る決算が発表されるなど、ハイテク関連企業を中心に業績の回復が見られたことも株式市場のサポート材料となりました。

【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。期初は欧米の中央銀行が積極的な金融引き締め政策を継続し、日米の金利差拡大を背景に円安米ドル高が進行しました。その後はインフレ進行の一服感から、米国長期金利が落ち着いた動きとなり、一転して円高米ドル安の動きとなりました。しかし、インフレ基調の継続により改めて金利の先高観が高まると、再び円安米ドル高基調となりました。米国での金融システム不安の高まりや日銀による長期金利の許容変動幅の柔軟化などを受けた円高の動きは一時的なものに留まりました。

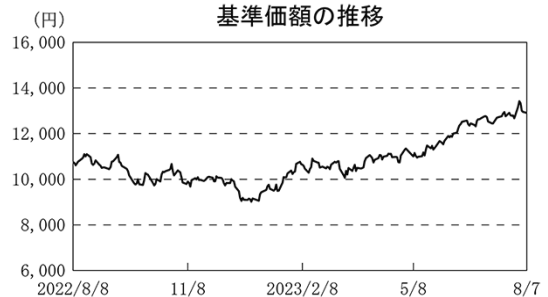
ユーロ円為替レートは円安ユーロ高となりました。期初は欧米の中央銀行による積極的な金融引き締め政策による日本との金利差拡大を背景に円安ユーロ高が進行しました。その後はインフレ沈静化への期待から金利が横ばいで推移したことにより、為替相場もボックス圏で推移する場面がありましたが、インフレ懸念に再び焦点が集まったことに加え、ユーロ圏の2023年4-6月期のGDP（国内総生産）が想定よりも堅調となったことなどから円安ユーロ高の流れが強まりました。

■ポートフォリオについて

エンターテインメント業界における技術的発展を牽引する、あるいはその恩恵を受けると判断する企業（エンテック関連企業）の株式等に投資しました。

当期、新型コロナウイルスの感染拡大は一段落し、消費者の外出自粛も徐々に和らいだことから、経済活動正常化の動きが強まり、株式市場が堅調に推移するなか、ハイテク関連企業を中心にエンテック関連企業の株価は上昇しました。

以上の運用の結果、保有銘柄の上昇や円安の進行などから、基準価額は20.1%上昇しました。



○今後の運用方針

エンテック関連企業は、最新のテクノロジーを駆使して急速な成長を遂げています。新型コロナウイルスの影響によって、人々は新しい生活スタイルを模索するなか、音楽や映画鑑賞、コンサートやスポーツ観戦、ゲームといった日常生活に必要不可欠なエンターテインメントは、コンテンツの一層の拡充やサービス形態などあらゆる側面で進化を続けるとともに、顧客数を拡大させています。

欧米におけるインフレ懸念やロシアによるウクライナ侵攻関連のニュースなどが投資家心理を左右し、短期的には株式市場の下押し材料となる可能性はありますが、開発力やブランド力のあるエンテック関連企業の株価は、長期的には上昇していくとみています。

引き続き、徹底したファンダメンタルズリサーチを通じ、エンターテインメント技術の発展により収益拡大が期待される企業への投資を行ってまいります。

○1万口当たりの費用明細

(2022年8月9日～2023年8月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 8 (8)	% 0.077 (0.077)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式)	2 (2)	0.019 (0.019)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 * 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	2 (1) (1)	0.015 (0.010) (0.005)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 * 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 * その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	12	0.111	
期中の平均基準価額は、10,821円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 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。

○売買及び取引の状況

(2022年8月9日～2023年8月7日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上場	千株 —	千円 —	千株 17	千円 157,870
外国	アメリカ	百株 2,703 (1,474)	千米ドル 9,680 (1,911)	百株 5,913 (303)	千米ドル 25,418 (1,911)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
国	フランス	—	—	310	703
	オランダ	—	—	216	453
	イギリス	62	千英ポンド 762	3	千英ポンド 57

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ()内は株式分割、移転、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

○株式売買比率

(2022年8月9日～2023年8月7日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	5,363,201千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,575,576千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.81

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2022年8月9日～2023年8月7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7日現在)

国内株式

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		期末
		株数	株数	株数	株数	評価額
電気機器 (46.0%)		千株		千株		千円
ソニーグループ	25.3			15.7		202,765
情報・通信業 (54.0%)						
コナミグループ	36.8			29.3		238,472
合計	株数・金額	62		45		441,238
	銘柄数<比率>	2		2		<6.6%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

外国株式

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
AT&T INC	938	—	—	—		電気通信サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	—	27	255	36,166		メディア・娯楽
ADOBE INC	44	19	1,035	146,779		ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL A	284	89	1,146	162,452		メディア・娯楽
AMAZON.COM INC	176	140	1,958	277,551		一般消費財・サービス流通・小売り
APPLE INC	106	90	1,648	233,613		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLANTA BRAVES HOLDINGS IN-C	—	8	34	4,901		メディア・娯楽
TOPGOLF CALLAWAY BRANDS CORP	—	470	903	128,002		耐久消費財・アパレル
CHURCHILL DOWNS INC	62	98	1,186	168,072		消費者サービス
THE WALT DISNEY CO	124	174	1,502	212,926		メディア・娯楽
DOUBLEVERIFY HOLDINGS INC	488	457	1,527	216,406		ソフトウェア・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	143	109	1,345	190,594		メディア・娯楽
ENDEAVOR GROUP HOLD-CLASS A	682	517	1,229	174,271		メディア・娯楽
META PLATFORMS INC-A	96	75	2,330	330,272		メディア・娯楽
HYATT HOTELS CORP-CL A	112	—	—	—		消費者サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	—	13	48	6,941		メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	—	303	2,252	319,118		メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	426	—	—	—		メディア・娯楽
LIVE NATION	132	124	1,096	155,379		メディア・娯楽
MGM MIRAGE	358	—	—	—		消費者サービス
MICROSOFT CORP	108	35	1,157	164,048		ソフトウェア・サービス
MICRON TECHNOLOGY INC	210	125	876	124,234		半導体・半導体製造装置
NETFLIX INC	46	28	1,243	176,195		メディア・娯楽
NEXSTAR MEDIA GROUP	79	49	906	128,420		メディア・娯楽

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
NINTENDO CO LTD-UNSPONS ADR		274	—	—	—	メディア・娯楽
NVIDIA CORP		64	43	1,962	278,127	半導体・半導体製造装置
ROBLOX CORP-CLASS A		95	—	—	—	メディア・娯楽
ROKU INC		—	265	2,295	325,313	メディア・娯楽
SEA LTD-ADR		—	211	1,254	177,827	メディア・娯楽
T-MOBILE US INC		137	84	1,139	161,508	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE		141	76	1,093	154,970	メディア・娯楽
TENCENT HOLDINGS LTD-UNS ADR		269	253	1,101	156,095	メディア・娯楽
TRADE DESK INC/THE -CLASS A		190	247	2,100	297,600	メディア・娯楽
TWITTER INC		281	—	—	—	メディア・娯楽
UBER TECHNOLOGIES INC		350	308	1,395	197,723	運輸
VAIL RESORTS INC		25	24	559	79,304	消費者サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC		368	—	—	—	電気通信サービス
PARAMOUNT GLOBAL CLASS-B		336	—	—	—	メディア・娯楽
WARNER BROS DISCOVERY INC		604	1,254	1,751	248,253	メディア・娯楽
WARNER MUSIC GROUP CORP-CL A		563	530	1,652	234,098	メディア・娯楽
SPOTIFY TECHNOLOGY SA		—	28	410	58,181	メディア・娯楽
小 計	株 数 ・ 金 額	8,328	6,289	40,404	5,725,354	
	銘 柄 数 < 比 率 >	33	32	—	<85.6%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
UBISOFT ENTERTAINMENT		310	—	—	—	メディア・娯楽
小 計	株 数 ・ 金 額	310	—	—	—	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	—	—	<—%>	
(ユーロ…オランダ)						
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV		962	746	1,769	276,035	メディア・娯楽
小 計	株 数 ・ 金 額	962	746	1,769	276,035	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<4.1%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	1,273	746	1,769	276,035	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	1	—	<4.1%>	
(イギリス)				千英ポンド		
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		—	58	884	159,878	消費者サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	—	58	884	159,878	
	銘 柄 数 < 比 率 >	—	1	—	<2.4%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	9,601	7,093	—	6,161,268	
	銘 柄 数 < 比 率 >	35	34	—	<92.1%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

(注) 小計、合計欄の<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

○投資信託財産の構成

(2023年8月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	6,602,507	96.2
コール・ローン等、その他	259,725	3.8
投資信託財産総額	6,862,232	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産(6,198,364千円)の投資信託財産総額(6,862,232千円)に対する比率は90.3%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=141.70円、1ユーロ=155.96円、1英ポンド=180.80円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年8月7日現在)

○損益の状況 (2022年8月9日～2023年8月7日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,862,232,239
コール・ローン等	259,373,353
株式(評価額)	6,602,507,014
未収配当金	351,872
(B) 負債	170,109,278
未払解約金	170,108,744
未払利息	534
(C) 純資産総額(A-B)	6,692,122,961
元本	5,186,184,593
次期繰越損益金	1,505,938,368
(D) 受益権総口数	5,186,184,593口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,904円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	46,856,061
受取配当金	43,851,958
受取利息	3,067,724
その他収益金	4
支払利息	△ 63,625
(B) 有価証券売買損益	1,143,036,898
売買益	1,783,006,909
売買損	△ 639,970,011
(C) 保管費用等	△ 1,043,525
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,188,849,434
(E) 前期繰越損益金	562,604,784
(F) 追加信託差損益金	13,711,350
(G) 解約差損益金	△ 259,227,200
(H) 計(D+E+F+G)	1,505,938,368
次期繰越損益金(H)	1,505,938,368

(注) 当親ファンドの期首元本額は7,548,384,027円、期中追加設定元本額は430,797,174円、期中一部解約元本額は2,792,996,608円です。

<元本の内訳>

東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式会社ファンド(為替ヘッジなし) 3,046,894,033円
 東京海上・エンターテインメント・テクノロジー株式会社ファンド(為替ヘッジあり) 2,139,290,560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。

(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) (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) (G)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。