

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) ユーロコース (毎月分配型)

追加型投信/内外/債券

交付運用報告書

第136期 (決算日2023年4月17日) 第137期 (決算日2023年5月17日) 第138期 (決算日2023年6月19日)
第139期 (決算日2023年7月18日) 第140期 (決算日2023年8月17日) 第141期 (決算日2023年9月19日)

作成対象期間 (2023年3月18日～2023年9月19日)

| 第141期末 (2023年9月19日) | |
|---------------------|--------|
| 基準価額 | 8,306円 |
| 純資産総額 | 3百万円 |
| 第136期～第141期 | |
| 騰落率 | 13.7% |
| 分配金(税込み)合計 | 390円 |

(注) 騰落率は分配金(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す。

- 交付運用報告書は、運用報告書に記載すべき事項のうち重要なものを記載した書面です。その他の内容については、運用報告書(全体版)に記載しています。
- 当ファンドは、投資信託約款において運用報告書(全体版)に記載すべき事項を、電磁的方法によりご提供する旨を定めています。運用報告書(全体版)は、東京海上アセットマネジメントのホームページにて閲覧・ダウンロードいただけます。
- 運用報告書(全体版)は、受益者の方からのご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

<運用報告書(全体版)の閲覧・ダウンロード方法>
右記の<照会先>ホームページにアクセス
⇒「基準価額一覧」等から対象ファンドを選択
⇒「運用報告書」ボタンを選択
⇒「運用報告書」ページから閲覧・ダウンロード

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^{ロゲー}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)」は、このたび、第141期の決算を行いました。

当ファンドは、世界の金融機関が発行するハイブリッド証券等を実質的な主要投資対象とし、原資産通貨売り/ユーロ買いの為替取引を行うことで、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します。当作成期についても、この方針に基づき運用を行いました。

ここに、当作成期の運用経過等につい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。

<照会先>

- ホームページ

<https://www.tokiomarineam.co.jp/>

- サービスデスク

0120-712-016 受付時間：営業日の9時～17時

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

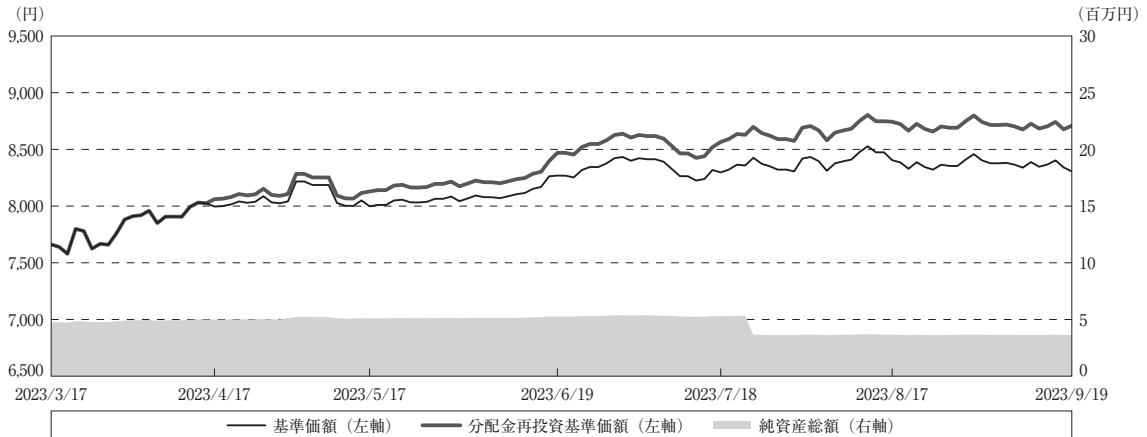
【本資料の表記について】

原則、各表・グラフの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、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。

運用経過

作成期間中の基準価額等の推移

（2023年3月18日～2023年9月19日）



第136期首：7,662円

第141期末：8,306円（既払分配金(税込み):390円）

騰落率：13.7%（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、作成期首（2023年3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
- ・企業業績の回復や金融システム不安の落ち着きなどを背景としたハイブリッド証券の спреッド（国債との利回り格差）の縮小
- ・日欧の金利差を反映した継続的な円安ユーロ高の進行

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）

1万口当たりの費用明細

（2023年3月18日～2023年9月19日）

| 項目 | 第136期～第141期 | | 項目の概要 |
|------------------------|-------------|------------|---------------------------------------------------|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 円 42 | % 0.516 | (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) | (13) | (0.157) | * 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) | (28) | (0.347) | * 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) | (0.013) | * 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 | 0.004 | (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) | (0.004) | * 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 | 42 | 0.520 | |
| 作成期間の平均基準価額は、8,195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。

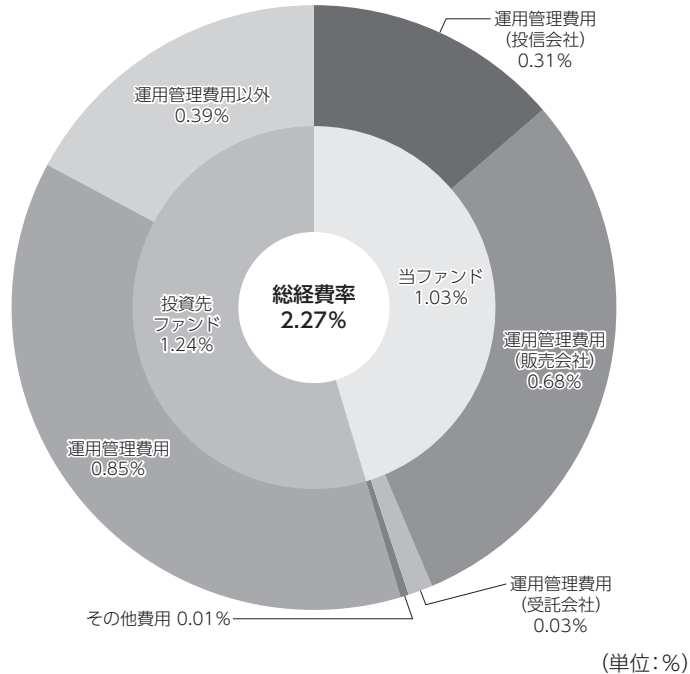
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）が支払った費用を含みません。

(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2.27%です。

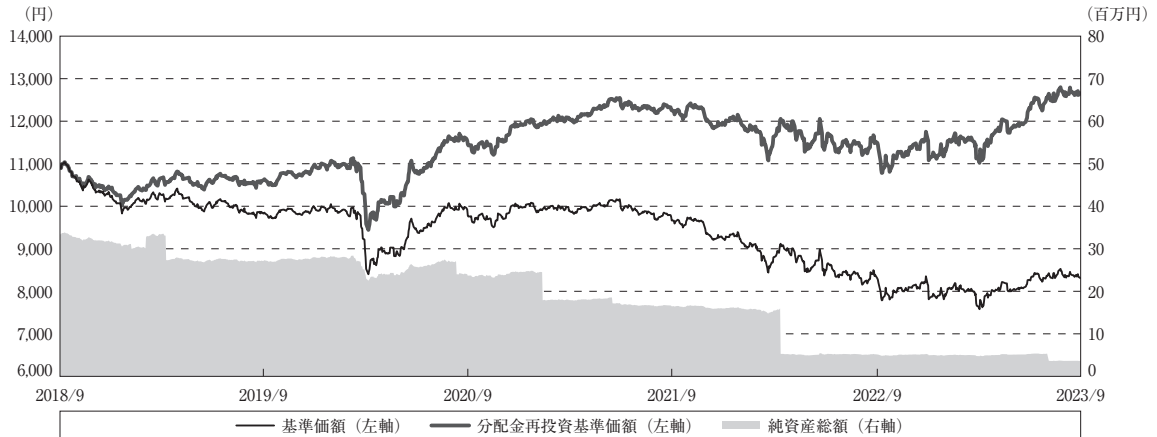


| | |
|----------------------|-------------|
| 総経費率(①+②+③) | 2.27 |
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.03 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.85 |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.39 |

- (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・セキュリティティーズ・ファンド」の費用を基に算出しています。

最近5年間の基準価額等の推移

（2018年9月19日～2023年9月19日）



- (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、2018年9月18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。

| | 2018年9月18日 決算日 | 2019年9月17日 決算日 | 2020年9月17日 決算日 | 2021年9月17日 決算日 | 2022年9月20日 決算日 | 2023年9月19日 決算日 |
|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基準価額 (円) | 10,897 | 9,827 | 9,778 | 9,666 | 8,303 | 8,306 |
| 期間分配金合計 (税込み) (円) | — | 780 | 780 | 780 | 780 | 780 |
| 分配金再投資基準価額騰落率 (%) | — | △ 2.6 | 7.9 | 7.0 | △ 6.2 | 10.1 |
| 純資産総額 (百万円) | 33 | 27 | 23 | 16 | 5 | 3 |

(注) 騰落率は1年前の決算応当日との比較です。

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。

投資環境

（2023年3月18日～2023年9月19日）

【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、インフレ高進が一段落するとの見通しが高まったことから、米国債利回りはおおむねボックス圏で推移しましたが、その後、予想を上回る米国景気の強さから、FRB（米連邦準備制度理事会）によるインフレ抑制に向けた利上げが想定以上に進むとの見方が強まり、上昇しました。作成期末にかけては、インフレ指標が事前予想を下回ったことにより、米国債利回りは低下する場面があったものの、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から、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。インフレ高進とその抑制のためのECB（欧州中央銀行）による金融引き締めの影響を受けて、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。インフレ高進とその抑制のためBOE（イングランド銀行）が金融引き締めに積極的な姿勢を示したことから、英国債利回りは上昇しました。作成期末にかけては、インフレ率の伸びが一段落する見通しが高まり、英国債利回りはおおむね横ばいで推移しました。

【ハイブリッド証券市場】

当作成期、ハイブリッド証券の価格は上昇しました。作成期間を通じて、企業業績の回復や金融システム不安の落ち着きなどにより、ハイブリッド証券のスプレッドが縮小したことが価格の上昇をサポートしました。

【為替市場】

ユーロ円為替レートは円安ユーロ高となりました。高インフレを背景としたECBの積極的な利上げにより日欧の金利差が拡大したことから、継続的に円安ユーロ高が進行しました。

ポートフォリオについて

（2023年3月18日～2023年9月19日）

<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）>

当ファンドは、「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－ユーロクラス」（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、13.7%上昇しました。

<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、発表された経済指標や主要中央銀行の動向などが相場変動の要因となるなか、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しました。

また、原資産通貨売り／ユーロ買いの為替取引を行い、ユーロ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、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

（2023年3月18日～2023年9月19日）

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

（2023年3月18日～2023年9月19日）

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136期 | 第137期 | 第138期 | 第139期 | 第140期 | 第141期 |
|-----------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2023年3月18日～ 2023年4月17日 | 2023年4月18日～ 2023年5月17日 | 2023年5月18日～ 2023年6月19日 | 2023年6月20日～ 2023年7月18日 | 2023年7月19日～ 2023年8月17日 | 2023年8月18日～ 2023年9月19日 |
| 当期分配金 | 65 | 65 | 65 | 65 | 65 | 65 |
| （対基準価額比率） | 0.806% | 0.806% | 0.780% | 0.777% | 0.767% | 0.776% |
| 当期の収益 | 15 | 15 | 15 | 10 | 15 | 10 |
| 当期の収益以外 | 50 | 50 | 50 | 55 | 50 | 55 |
| 翌期繰越分配対象額 | 3,008 | 2,959 | 2,912 | 2,863 | 2,816 | 2,761 |

（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（通貨選択型）ユーロコース（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>

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。

また、原資産通貨売り／ユーロ買いの為替取引を行い、ユーロの通貨比率を高位に保つ運用を行います。

<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。

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。

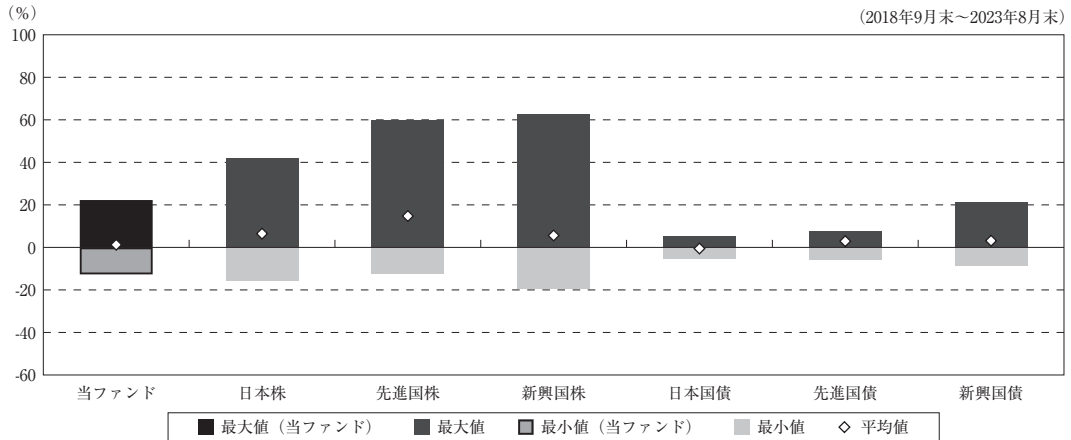
なお、ファンドの運用体制、運用方法に変更ありません。

当ファンドの概要

| | | |
|---------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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 | 2011年11月8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）ユーロコース（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・ファンドーユーロクラス」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・ファンドーユーロクラス | 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。 |
| 運用方法 | 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）等を主要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・ファンドーユーロクラス」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、外国投資信託の投資比率を高位に保つことを基本とします。外国投資信託の組入資産について、原則として、原資産通貨売り／ユーロ買いの為替取引を行います。 | |
| 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。 | |

（参考情報）

○当ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



（単位：%）

| | 当ファンド | 日本株 | 先進国株 | 新興国株 | 日本国債 | 先進国債 | 新興国債 |
|-----|--------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|
| 最大値 | 22.3 | 42.1 | 59.8 | 62.7 | 5.4 | 7.9 | 21.5 |
| 最小値 | △ 12.7 | △ 16.0 | △ 12.4 | △ 19.4 | △ 5.5 | △ 6.1 | △ 8.8 |
| 平均値 | 1.2 | 6.5 | 14.8 | 5.6 | △ 0.5 | 2.9 | 3.2 |

（注）全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

（注）2018年9月から2023年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものであり、騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

（注）当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

《各資産クラスの指数》

日本株：TOPIX（東証株価指数）（配当込み）

先進国株：MSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）

新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）

日本国債：NOMURA - BPI（国債）

先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）

※各指数についての説明は、最終ページの「代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について」をご参照ください。

（注）海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

当ファンドのデータ

組入資産の内容

（2023年9月19日現在）

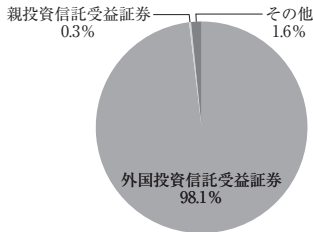
○組入上位ファンド

| 銘柄名 | 第141期末 |
|-----------------------------------------------------------------|-----------|
| 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-ユーロクラス | 98.1 % |
| 東京海上マネーマザーファンド | 0.3 |
| 組入銘柄数 | 2銘柄 |

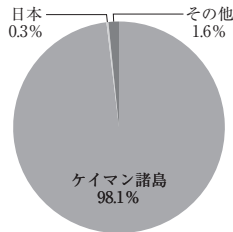
（注）比率は純資産総額に対する割合です。

（注）組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）に記載しています。

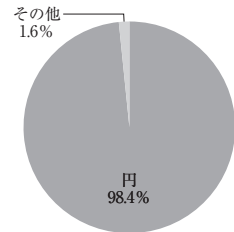
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



（注）比率は純資産総額に対する割合です。資産の状況等によっては合計が100%と異なる場合があります。

（注）その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

（注）国別配分につきましては発行国を表示しています。

純資産等

| 項 目 | 第136期末 | 第137期末 | 第138期末 | 第139期末 | 第140期末 | 第141期末 |
|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| | 2023年4月17日 | 2023年5月17日 | 2023年6月19日 | 2023年7月18日 | 2023年8月17日 | 2023年9月19日 |
| 純資産総額 | 4,984,649円 | 5,087,551円 | 5,263,087円 | 5,284,403円 | 3,656,056円 | 3,615,917円 |
| 受益権総口数 | 6,233,646口 | 6,361,009口 | 6,365,148口 | 6,369,080口 | 4,350,007口 | 4,353,218口 |
| 1万口当たり基準価額 | 7,996円 | 7,998円 | 8,269円 | 8,297円 | 8,405円 | 8,306円 |

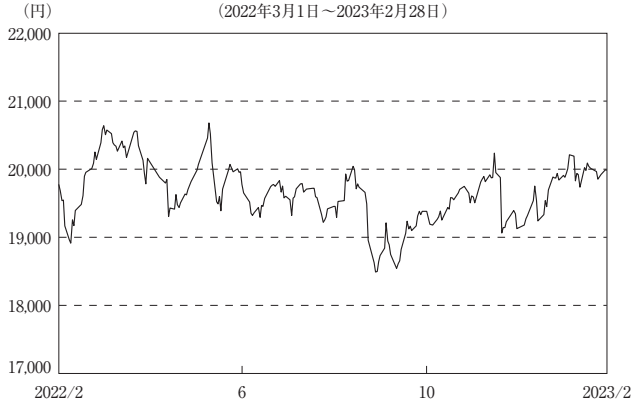
* 当作成期間（第136期～第141期）中における追加設定元本額は146,127円、同解約元本額は2,022,306円です。

組入上位ファンドの概要

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・ファンドーユーロクラス

【基準価額の推移】

(2022年3月1日～2023年2月28日)



(注) グラフは分配金再投資基準価額です。

以下は「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」の内容です。

【1口当たりの費用明細】

(2022年3月1日～2023年2月28日)

当該期間の1口当たりの費用明細については開示されていないため、掲載していません。

【組入上位10銘柄】

(2023年2月28日現在)

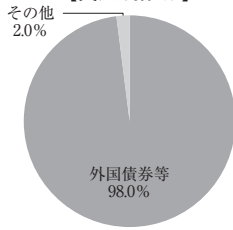
| | 銘柄名 | 種類 | 国（地域） | 通貨 | 比率 % |
|-------|--------------------------|--------|---------|------|---------|
| 1 | GOLDMAN SACHS CAPITAL I | 優先出資証券 | アメリカ | 米ドル | 2.5 |
| 2 | DAI-ICHI LIFE INSURANCE | 永久劣後債 | 日本 | 米ドル | 2.1 |
| 3 | PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 期限付劣後債 | アメリカ | 米ドル | 1.9 |
| 4 | AUST & NZ BANKING GROUP | 期限付劣後債 | オーストラリア | ユーロ | 1.9 |
| 5 | BAWAG GROUP AG | 期限付劣後債 | オーストリア | ユーロ | 1.9 |
| 6 | DE VOLKSBANK NV | 期限付劣後債 | オランダ | ユーロ | 1.7 |
| 7 | BANK OF IRELAND GROUP | 期限付劣後債 | アイルランド | ユーロ | 1.7 |
| 8 | BANK OF AMERICA CORP | 期限付劣後債 | アメリカ | 米ドル | 1.6 |
| 9 | AXA SA | 永久劣後債 | フランス | 英ポンド | 1.6 |
| 10 | NN GROUP NV | 永久劣後債 | オランダ | ユーロ | 1.5 |
| 組入銘柄数 | | | 121銘柄 | | |

(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

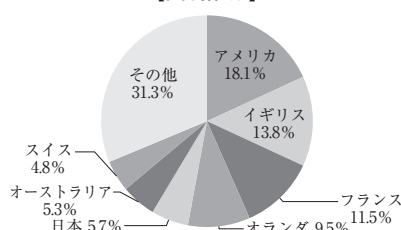
(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）に記載しています。

(注) 国（地域）につきまして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。

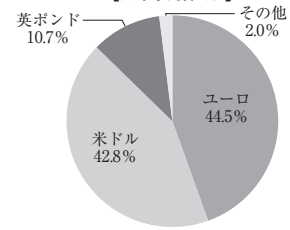
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



(注) 比率は純資産総額に対する割合です。資産の状況等によっては合計が100%とならない場合があります。

(注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

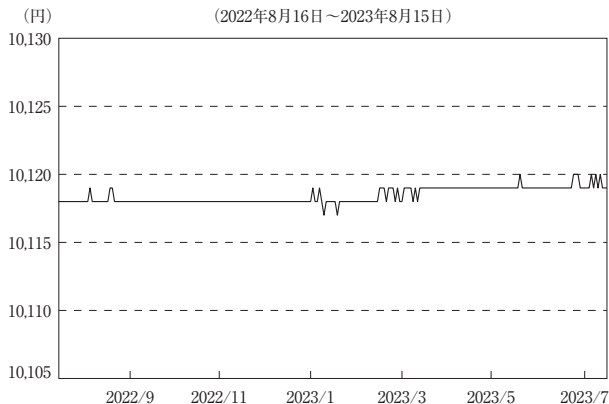
(注) 国別配分につきましては発行体のリスク所在国（資本関連を含む）を記載しています。

(注) ユーロクラスにおいては、ファンドの保有資産に対して、原資産通貨売り／ユーロ買いの為替取引を行っています。

東京海上マネーマザーファンド

【基準価額の推移】

(2022年8月16日～2023年8月15日)



【1万口当たりの費用明細】

(2022年8月16日～2023年8月15日)

該当事項はありません。

【組入上位10銘柄】

(2023年8月15日現在)

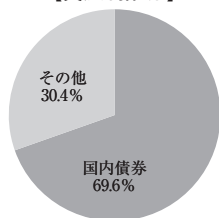
| | 銘柄名 | 業種／種別等 | 通貨 | 国（地域） | 比率 % |
|-------|------------------|--------|-----|-------|---------|
| 1 | 平成25年度第2回福井県公募公債 | 地方債証券 | 円 | 日本 | 34.8 |
| 2 | 第54回川崎市公募公債(5年) | 地方債証券 | 円 | 日本 | 34.8 |
| 3 | — | — | — | — | — |
| 4 | — | — | — | — | — |
| 5 | — | — | — | — | — |
| 6 | — | — | — | — | — |
| 7 | — | — | — | — | — |
| 8 | — | — | — | — | — |
| 9 | — | — | — | — | — |
| 10 | — | — | — | — | — |
| 組入銘柄数 | | | 2銘柄 | | |

(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

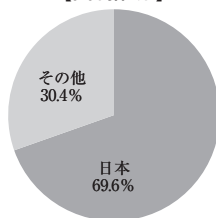
(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）に記載しています。

(注) 国（地域）につきましては発行国を表示しています。

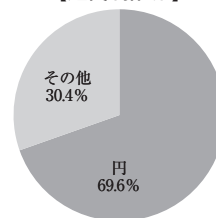
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



(注) 比率は純資産総額に対する割合です。資産の状況等によっては合計が100%とならない場合があります。

(注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

(注) 国別配分につきましては発行国を表示しています。

※当マザーファンドの計算期間における運用経過の説明は運用報告書（全体版）をご参照ください。

<代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について>

○TOPIX（東証株価指数）（配当込み）

TOPIXの指数値およびTOPIXにかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下、J P X）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXにかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。

J P Xは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

○MSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）

MSCIコクサイ指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。

○MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）

MSCIエマージング・マーケット・インデックスの著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。

○NOMURA – BPI（国債）

NOMURA – BPI（国債）に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。

○FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

FTSE世界国債インデックスは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

○JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

東京海上アセットマネジメント
YouTube公式チャンネル

ファンド・マーケット関連動画などを公開しています。

