【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2021年12月17日
【発行者名】	東京海上アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長　　後藤　俊夫
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	尾崎　正幸
【電話番号】	０３－３２１２－８４２１
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	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） 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） 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） 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） 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） 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） 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） 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） 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） 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	上限　各１兆円
【縦覧に供する場所】	該当なし

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

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）
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）
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）
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）
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）
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）
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）
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）
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）
東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンド

本書では、各ファンドについて、正式名称ではなく下記の略称等で記載する場合があります。

正式名称	略称	
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）	円コース	各コース
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）	米ドルコース	
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）	ユーロコース	
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）	豪ドルコース	
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）	ブラジル・レアルコース	
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）	メキシコ・ペソコース	
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）	トルコ・リラコース	
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）	ロシア・ルーブルコース	
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）	資源国通貨バスケットコース	
東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンド	マネープール・ファンド	

（上記のそれぞれをまたは総称して、以下「当ファンド」ということがあります。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。
当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定に基づく投資信託の受益権であり、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である東京海上アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。
当初の１口当たり元本は１円です。
委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

各１兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額
基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。

●委託会社のお問い合わせ先（以下「委託会社サービスデスク」といいます。）
東京海上アセットマネジメント　サービスデスク
０１２０－７１２－０１６（土日祝日・年末年始を除く９時～17時）

(5)【申込手数料】

①発行価格に3.3%（税抜３％）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。ただし、各コースから「マネープール・ファンド」へのスイッチングの場合は無手数料とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が含まれます。

②収益分配金の再投資により取得する口数については、手数料はありません。

(6)【申込単位】

①申込方法には、収益分配金の受取方法によって、以下の２種類のコースがあります。

分配金受取りコース	分配金を受け取るコースです。
分配金再投資コース	分配金が税引き後、自動的に無手数料で再投資されるコースです。

②販売会社やお申込みのコース等によって申込単位は異なります。また、販売会社により取扱うコースが異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。（販売会社との間で定時定額購入サービスに関する契約を締結した場合、当該契約で規定する取得申込単位によるものとします。）

③分配金再投資コースにおける収益分配金の再投資に際しては、上記にかかわらず１口単位で取得することができます。

(7)【申込期間】

2021年12月18日から2022年６月17日まで
上記申込期間中の毎営業日にお申込みを受け付けます。ただし、申込期間において、各コースのお申込み日が以下の日のいずれかに該当する場合には、取得（スイッチングを含みます。）のお申込みの受付を行いません。
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日
・ロンドンの銀行の休業日
・ルクセンブルグの銀行の休業日
※申込期間は、上記期間満了前に委託会社が有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(8)【申込取扱場所】

販売会社の本・支店等で取扱います。ただし、一部取扱いを行わない支店等がある場合がありますので、販売会社の最寄りの本・支店等にお問い合わせください。なお、販売会社については、委託会社サービスデスクにお問い合わせください。

(9)【払込期日】

取得申込者は、申込金（発行価格に取得申込口数を乗じて得た額に申込手数料を加算した申込時の支払総額をいいます。）を販売会社所定の期日までに販売会社に支払うものとします。
各取得申込日の発行価額の総額は各追加信託が行われる日に、販売会社から、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社である三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）の指定する当ファンドの口座に振込まれます。

(10)【払込取扱場所】

申込金は、お申込みの販売会社にお支払いください。

(11)【振替機関に関する事項】

当ファンドの受益権の振替機関は下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

①申込の方法

a.受益権の取得申込は、販売会社において申込期間中の毎営業日に受け付けます。ただし、お申込み日が上記「(7)申込期間」に記載の申込不可日のいずれかに該当する場合には、お申込みの受付を行いません。
受益権の取得申込に際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

b.取得申込者は、申込金額相当額の申込金を販売会社に支払うものとします。ただし、当ファンドは上記「(9)払込期日」にしたがい受託会社に払込まれた時点で初めて設定がなされ、取得申込者はその時点から当ファンドの当該設定にかかる受益者となります。申込金には利息を付けません。

c.取得申込の受付は、原則として午後３時までの受付分を当日分とし、この受付時間を過ぎてからの申込分は翌営業日の受付分とします。

d.上記にかかわらず、取引所（※）における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置を取った場合には、販売会社は、受益権の取得申込の受付を中止すること、および既に受け付けた取得申込の受付を取り消すことができます。

（※）金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます（以下、本書において同じ。）。

e.定時定額購入サービスを選択した取得申込者は、販売会社との間で定時定額購入サービスに関する取り決めを行います。

f.各コース間および各コースと「マネープール・ファンド」間でスイッチングが可能です。販売会社によっては、各コースへのスイッチングの際に購入時手数料がかかる場合があります。スイッチングとは、当ファンドの受益者が、保有する当該ファンドの受益権を換金した手取金をもって、その換金申込受付日と同日の受付時間内に当ファンドを構成する他のファンドの受益権の取得申込を行うことです（本書において同じ。）。なお、「マネープール・ファンド」の取得申込は、「マネープール・ファンド」以外の各コースからのスイッチングのみとします。また、販売会社によっては、一部のファンドのみの取扱いとなる場合やスイッチングの取扱いを行わない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

②日本以外の地域における発行

該当ありません。

③振替受益権について

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

第二部【ファンド情報】
第１【ファンドの状況】
１【ファンドの性格】
(1)【ファンドの目的及び基本的性格】
①ファンドの目的
●各コース
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。
●マネープール・ファンド
安定した収益の確保を目指して安定運用を行います。
②基本的性格
当ファンドの商品分類表および属性区分表は、以下の通りです。
●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）

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）
単位型投信 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　） 不動産投信 その他資産（投資信託証券（債券（その他債券））） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり （フルヘッジ） なし

※当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。
※投資形態が、ファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資することとなりますので、商品分類表と属性区分表の投資対象資産が異なります。
※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

●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）
●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）
●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）

●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）
●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）
●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）
●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）
●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）

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）
単位型投信 追加型投信	国　　内 海　　外 内　　外	株　　式 債　　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 　一般 　大型株 　中小型株 債券 　一般 　公債 　社債 　その他債券 　クレジット属性 　（　　） 不動産投信 その他資産（投資信託証券（債券（その他債券））） 資産複合 （　　） 　資産配分固定型 　資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　　）	グローバル （日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり なし

※当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。
※投資形態が、ファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資することとなりますので、商品分類表と属性区分表の投資対象資産が異なります。
※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

●東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンド

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）

単位型投信 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態
株式 　一般 　大型株 　中小型株 債券 　一般 　公債 　社債 　その他債券 　クレジット属性 　（　　） 不動産投信 その他資産（投資信託証券（債券（一般）） 資産複合 （　　） 　資産配分固定型 　資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　　）	グローバル 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ

※当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。
※投資形態が、ファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資することとなりますので、商品分類表と属性区分表の投資対象資産が異なります。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型投信	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	ＭＭＦ（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会の「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定められるＭＭＦをいいます。
	ＭＲＦ（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会の「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定められるＭＲＦをいいます。
	ＥＴＦ	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	特殊型	目論見書または投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

※商品分類の定義は、一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」をもとに委託会社が作成しております。

属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	目論見書または投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	目論見書または投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。

		公債	目論見書または投資信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	目論見書または投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	目論見書または投資信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		格付等クレジットによる属性	目論見書または投資信託約款において、上記債券の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記債券に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記します。
	不動産投信		目論見書または投資信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産		目論見書または投資信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	資産配分固定型	目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。
		資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
決算頻度	年１回		目論見書または投資信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年２回		目論見書または投資信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年４回		目論見書または投資信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年６回（隔月）		目論見書または投資信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）		目論見書または投資信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々		目論見書または投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他		上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米		目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

	アフリカ	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会の「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定されるファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	目論見書または投資信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経２２５	目論見書または投資信託約款において、日経２２５に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	ＴＯＰＩＸ	目論見書または投資信託約款において、ＴＯＰＩＸに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記指数にあてはまらない全てのものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	目論見書または投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動（一定倍の連動若しくは逆連動を含む。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	目論見書または投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	目論見書または投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他型	目論見書または投資信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

※属性区分の定義は、一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」をもとに委託会社が作成しております。

③信託金の限度額

各コースの信託金限度額は、信託約款の定めにより各2,000億円となっています。また、「マネープール・ファンド」の信託金限度額は、信託約款の定めにより１兆円となっています。上記の各限度額は、受託会社と合意のうえ、変更することができます。

④ファンドの特色

1 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（「マネープール・ファンド」を除く）。

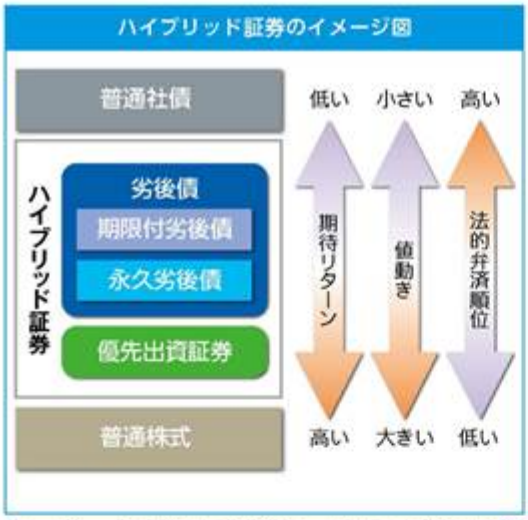
- 各コースは、世界の金融機関が発行するハイブリッド証券等を主要投資対象とする円建ての外国投資信託「東京海上ストラテジック・トラスト－東京海上 Rogge グローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド」（以下「外国投資信託」といいます。）と、円建ての国内籍の投資信託である「東京海上マネーマザーファンド」を投資対象とするファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。
- 「マネープール・ファンド」は、円建ての短期公社債等を実質的な投資対象とし、安定した収益の確保を図ることを目的として運用を行います。

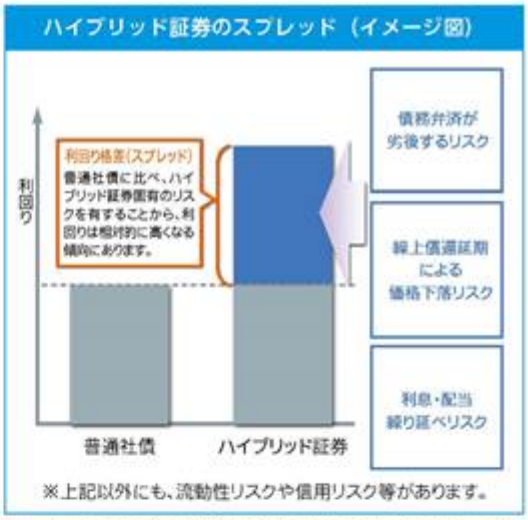
ハイブリッド証券とは

- ハイブリッド証券とは「資本」と「負債」の性格を併せ持った証券で、具体的には、劣後債（期限付劣後債、永久劣後債）、優先出資証券等があります。
- ハイブリッド証券は「満期償還」「繰上償還」「利息（または配当）」等が定められていることから債券（発行体にとっての「負債」）に類似した性格を持つ一方で、普通社債と比較して債務不履行（デフォルト）時の支払い順位が劣後する点や発行体を取り巻く経済状況等により利息（または配当）の支払いの繰り延べまたは停止や繰上償還が延期されることがある点等から、発行体にとっては「資本」としての性格を併せ持っており、株式と債券の中間に位置すると考えられます。

次ページへ続く

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。





劣　後　債：発行体の経営破たん時に、借入金や普通社債等よりも債務弁済の順位が劣る債券のこと。その分、普通社債等に比べて利率が高くなります。償還期限に定めのない「永久劣後債」と、償還期限がある「期限付劣後債」があります。

優先出資証券：配当や残余財産請求権（企業が解散する際に、負債＜他人資本＞を返済し、なお財産が残る場合、株主はその持ち株数に応じて残った財産の分配を受けることができるという権利）が普通株に対して優先される優先株に類似した性質を持つ有価証券です。

※上記は、ハイブリッド証券に関する一般的な内容を示したものであり、必ずしもすべてを表すものではありません。ハイブリッド証券には、金融監督当局が発行体を実質破たん状態にあると判断した場合、元本が削減される場合があります。（一部のハイブリッド証券については、発行体の判断や財務状況等の要因により元本が削減される場合や株式に転換される場合等があります。）

2 投資対象は取得時において投資適格（BBB格）相当以上を有するものとします。

- 外国投資信託が投資対象とするハイブリッド証券等は、取得時において、ムーディーズ社、S&P 社、フィッチ社（2021 年 9 月末時点）のいずれかより投資適格相当以上の格付けを取得しているハイブリッド証券等に限ります。

※取得後に格付けが投資適格相当未満に下がった場合においても、個別銘柄分析等による投資判断に基づいて当該銘柄の保有を継続する場合があります。

次ページへ続く

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。

3 「東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）」は、投資対象とする外国投資信託における為替取引手法の異なる9本のコースおよび「マネープール・ファンド」から構成されます。

- 「円コース（毎月分配型）」においては、投資対象である外国投資信託の組入資産について、原則として対日本円での為替ヘッジを行います。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。
- 「円コース（毎月分配型）」以外の各コースにおいては、投資対象である外国投資信託の組入資産について、原則として当該通貨での為替取引を行います。（例えば「豪ドルコース（毎月分配型）」においては、「原資産通貨売り／豪ドル買い」等。）
- 「資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）」においては、豪ドル、ブラジル・レアル、南アフリカ・ランドで概ね３分の１ずつ為替取引を行います。
- 「円コース（毎月分配型）」の対日本円での為替ヘッジおよび「円コース（毎月分配型）」以外の各コースの当該通貨での為替取引は外国投資信託において行います。
- 各コース間および各コースと「マネープール・ファンド」間でスイッチングが可能です。

4 ハイブリッド証券等の実質的な運用は「Allianz Global Investors GmbH」（アリアンツGI社）の英国支店が行います。

- 外国投資信託におけるハイブリッド証券等の運用の指図（米ドル以外の通貨建資産の対米ドルでの為替取引を含みます。）は「アリアンツ GI 社」が行います。
- 外国投資信託における各クラスの対日本円での為替ヘッジおよび日本円を除く当該通貨での為替取引は、「東京海上アセットマネジメント」が行います。

Allianz Global Investors GmbH

アリアンツGI社は、世界有数の保険会社であるアリアンツ社の系列投資顧問会社として、グローバルに投資を行っており、アリアンツGI社のグローバル債券運用担当のチームが運用を行います。

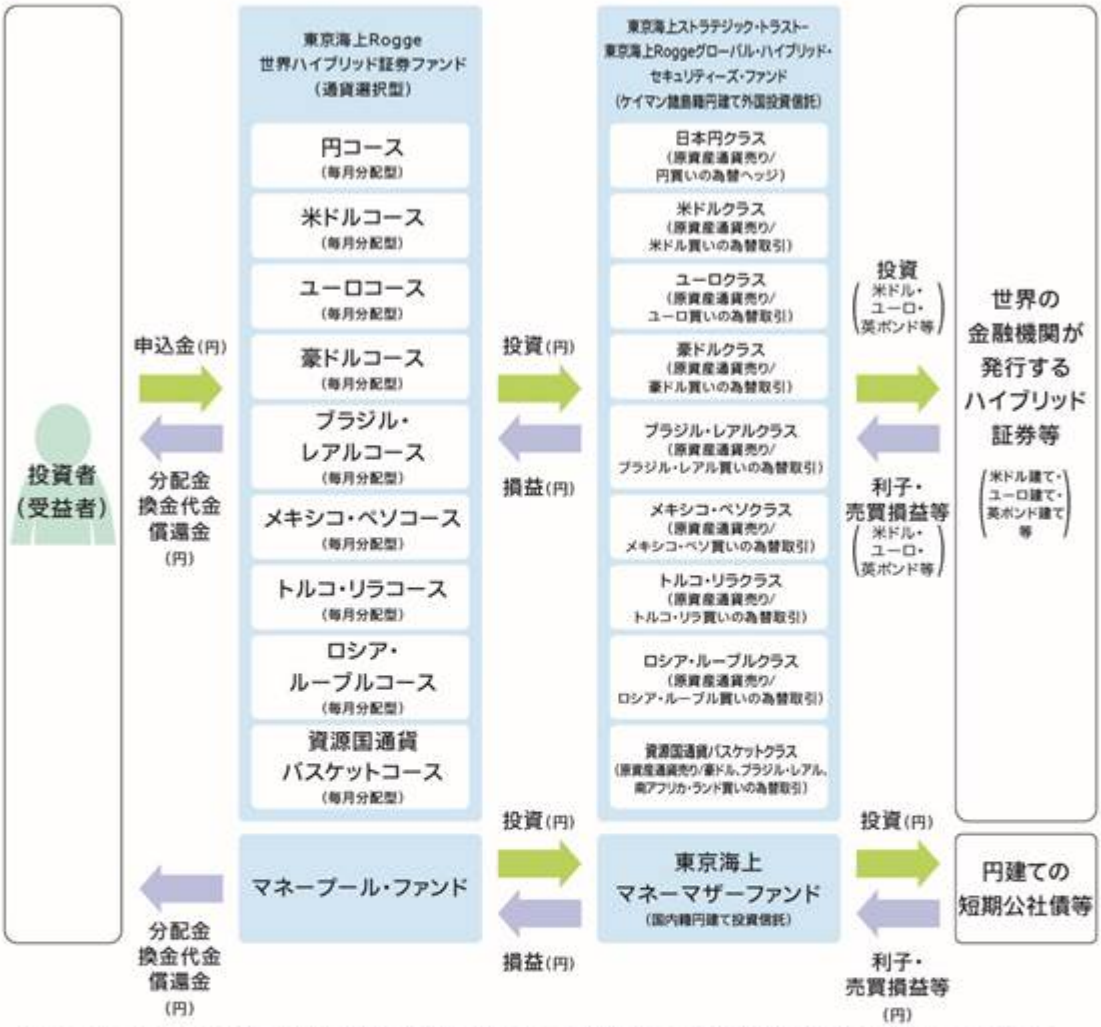
- グローバル債券運用に特化したプロフェッショナル集団です。
- 経験豊富なシニアファンドマネージャーを中心に、グローバルに社債の調査、分析を行うアナリストチームとともに、チーム運用を行っています。

次ページへ続く

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。

ファンドの仕組み

- 各コースは、ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。
- 「マネープール・ファンド」は、ファミリーファンド方式により運用を行います。



※「ファンド・オブ・ファンズ方式」とは、複数の投資信託証券への投資を通じて、実質的な投資対象へ投資を行う方式です。
※「ファミリーファンド方式」とは、受益者の投資資金をベビーファンドとしてまとめ、その資金を主としてマザーファンドに投資することにより、実質的な運用をマザーファンドにて行う方式です。ベビーファンドがマザーファンドに投資するに際しての投資コストはかかりません。また、他のベビーファンドが、マザーファンドへ投資することがあります。

- 外国投資信託において、米ドル建以外のハイブリッド証券等に関しては、原則として原資産通貨売り/米ドル買いの為替取引を行った上で、各クラス（「日本円クラス」を除く）では米ドル売り/各コースの通貨買いの為替取引を行い、「日本円クラス」では米ドル売り/円買いの為替ヘッジを行います。
- 各コースは、「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」の他に、「東京海上マネーマザーファンド」にも投資します。
- 「マネープール・ファンド」の購入は、各コースからのスイッチングの場合のみとします。

次ページへ続く

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。

主な投資制限

各コース

株　　式	株式への直接投資は行いません。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

マネープール・ファンド

株　　式	株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。（ただし、転換社債の転換、新株引受権の行使および新株予約権の行使により取得する場合に限ります。）
外貨建資産	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。

次ページへ続く

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。

分配方針

各コース

◎毎月決算を行います。

- 毎月17日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として次の方針に基づき分配を行います。

分配対象額は、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。)等の全額とします。
収益分配にあたっては、原則として毎決算時に安定分配を継続的に行うことをめざします。収益分配金額は、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。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。
※「安定分配を継続的に行う」としていますが、これは、運用による収益が安定したものになることや基準価額が安定的に推移すること等を示唆するものではありません。また、基準価額の水準、運用の状況等によっては安定分配とならない場合があることにご留意ください。

《イメージ図》

決算	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
分配	💰	💰	💰	💰	💰	💰	💰	💰	💰	💰	💰	💰

①上図はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について、示唆・保証するものではありません。実際の分配金額は運用実績に応じて決定されます。

マネープール・ファンド

◎年2回決算を行います。

- 3月および9月の各17日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として次の方針に基づき分配を行います。

分配対象額は、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。)等の全額とします。
収益分配金額は、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。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。

《イメージ図》

決算	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
分配			💰						💰			

①上図はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について、示唆・保証するものではありません。実際の分配金額は運用実績に応じて決定されます。

次ページへ続く

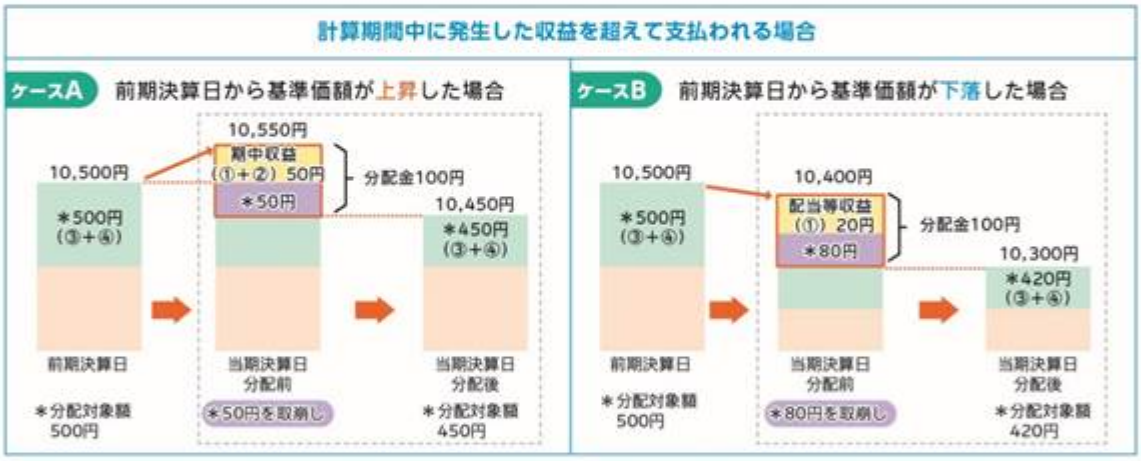
資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

※分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。
分配対象額とは、
①配当等収益（経費控除後） ②評価益を含む売買益（経費控除後） ③分配準備積立金 ④収益調整金 です。



ⓘ上記はイメージ図であり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご留意ください。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

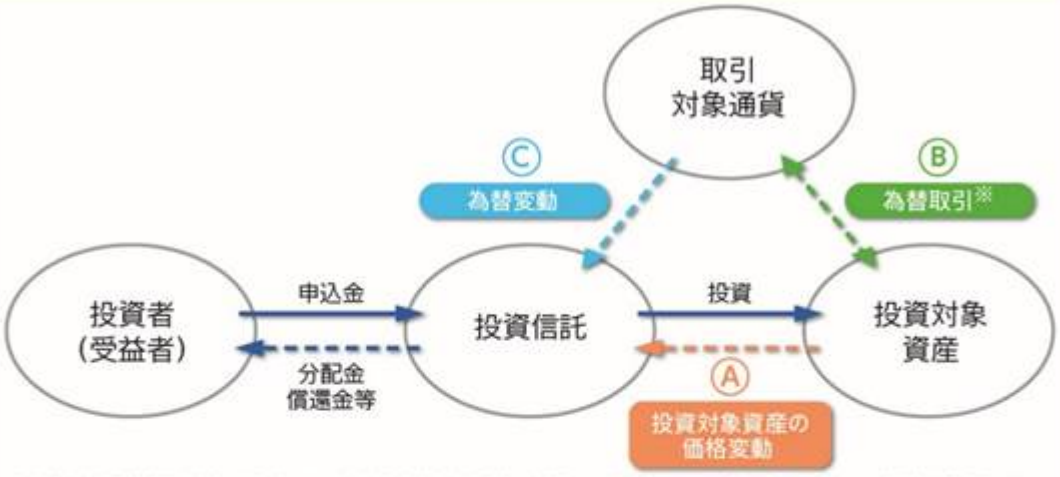
※元本払戻金（特別分配金）は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また元本払戻金（特別分配金）部分は非課税扱いとなります。

普通分配金 個別元本（投資者のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。
元本払戻金（特別分配金） 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

通貨選択型の投資信託の収益のイメージ

- 通貨選択型の投資信託は、株式や債券等といった投資対象資産に加えて、為替取引の対象となる円以外の通貨も選択することができるよう設計された投資信託です。

通貨選択型の投資信託の収益のイメージ図



※取引対象通貨が円以外の場合には、当該取引対象通貨の対円での為替リスクが発生することに留意が必要です。

- 通貨選択型の投資信託の収益源としては、以下の３つの要素が挙げられます。
これらの収益源に相応してリスクが内在していることに注意が必要です。

※「取引対象通貨」と「投資対象資産の通貨」が同一通貨の場合、為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）や為替取引によるコスト（金利差相当分の費用）は発生しません。
※新興国通貨の場合等は、為替取引によるプレミアム / コストに金利差がそのまま反映されない場合があります。
※為替市場における需給の影響等によっては、為替取引によるプレミアム / コストが金利差相当分とは異なる水準となる場合があります。

(2)【ファンドの沿革】

各コース（メキシコ・ペソコース、トルコ・リラコース、ロシア・ルーブルコースを除く）およびマネープール・ファンド

2011年11月８日　　ファンドの設定、運用開始
2020年12月18日　　信託期間を「2021年９月17日まで」から「2026年９月17日まで」に変更

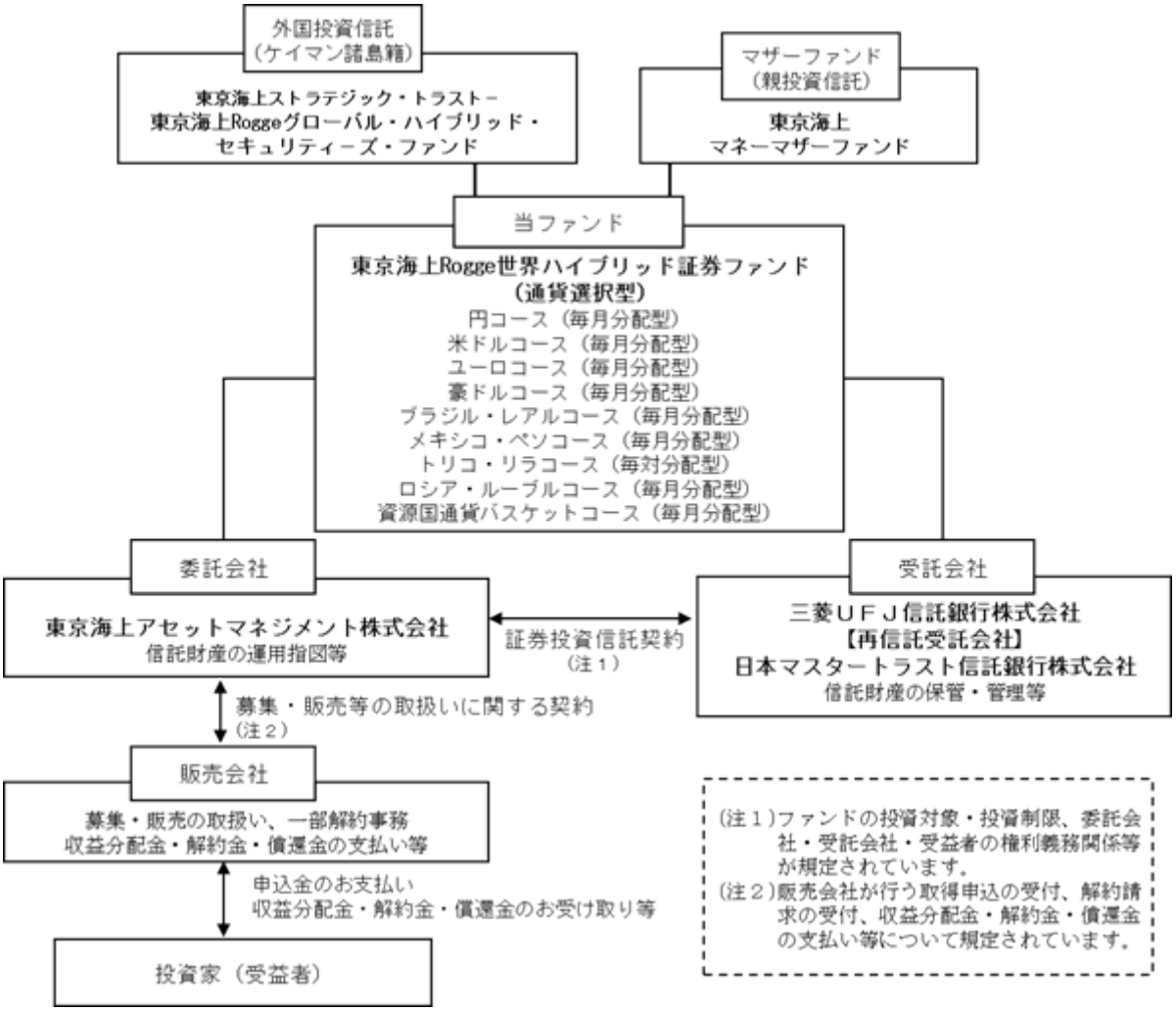
メキシコ・ペソコース、トルコ・リラコース、ロシア・ルーブルコース

2013年９月４日　　ファンドの設定、運用開始
2020年12月18日　　信託期間を「2021年９月17日まで」から「2026年９月17日まで」に変更

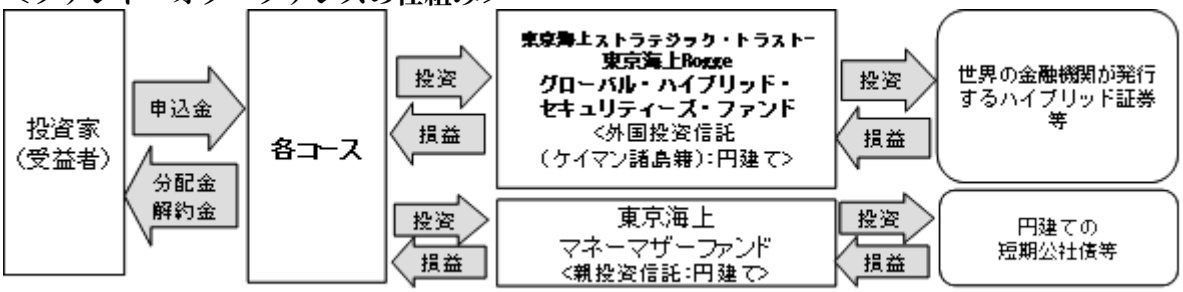
(3)【ファンドの仕組み】

①ファンドの仕組み

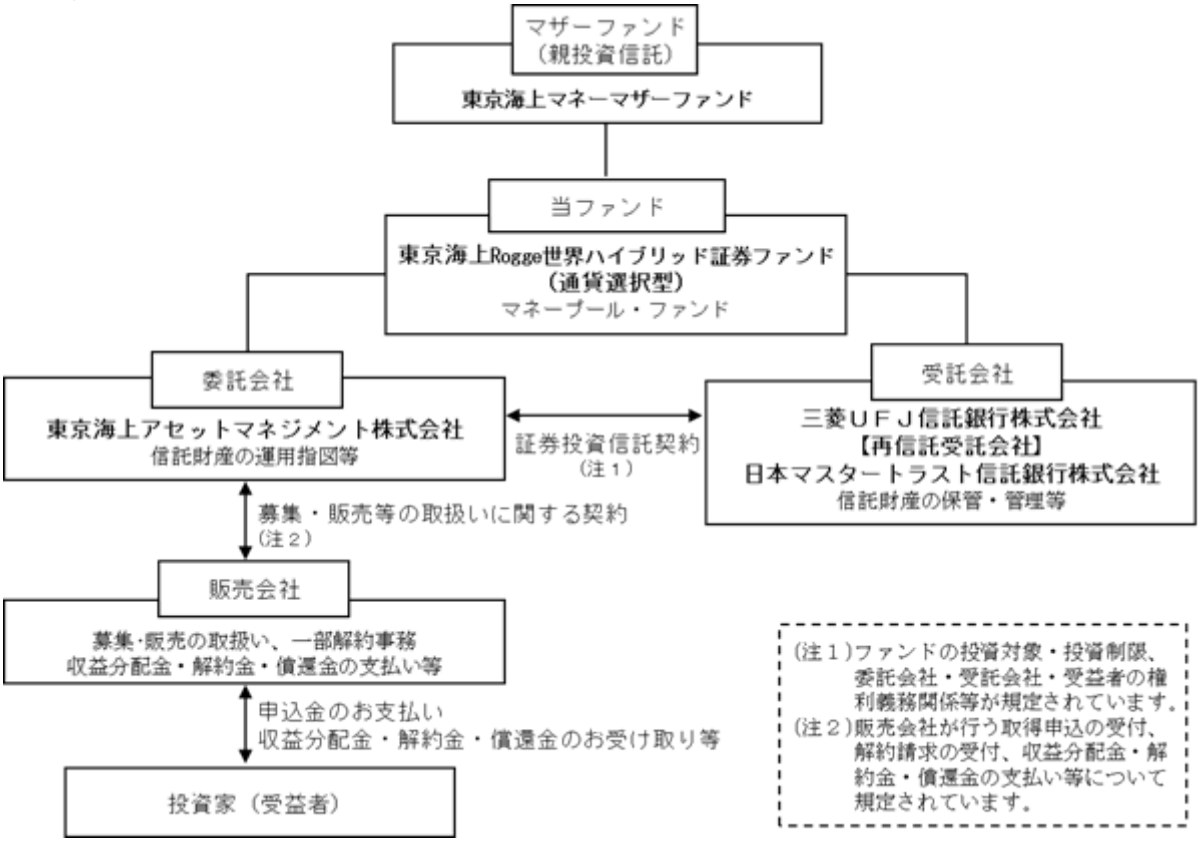
●各コース



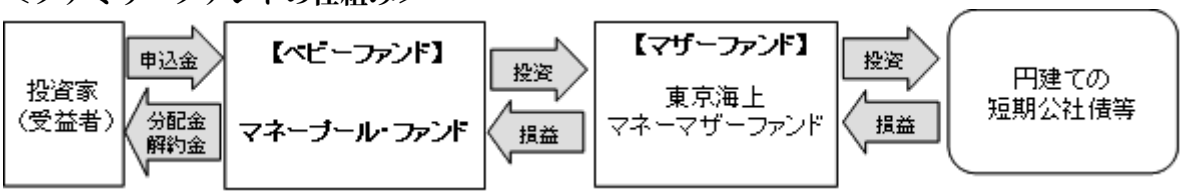
＜ファンド・オブ・ファンズの仕組み＞



●マネープール・ファンド



＜ファミリーファンドの仕組み＞



※「ファミリーファンド方式」とは、受益者の投資資金をベビーファンドとしてまとめ、その資金を主としてマザーファンド（親投資信託）に投資することにより、実質的な運用をマザーファンドにて行う方式です。ベビーファンドがマザーファンドに投資するに際しての投資コストはかかりません。また、他のベビーファンドが、マザーファンドへ投資することがあります。

②委託会社の概況

・名称　東京海上アセットマネジメント株式会社

・資本金の額　20億円　（2021年９月末日現在）

・会社の沿革

1985年12月	東京海上グループ（現：東京海上日動グループ）等の出資により、資産運用ビジネスの戦略的位置付けで、東京海上エム・シー投資顧問株式会社の社名にて資本金２億円で設立
1987年２月	投資顧問業者として登録
同年６月	投資一任業務認可取得
1991年４月	国内および海外年金の運用受託を開始
1998年５月	東京海上アセットマネジメント投信株式会社に社名変更し、投資信託法上の委託会社としての免許取得
2007年９月	金融商品取引業者として登録
2014年４月	東京海上アセットマネジメント株式会社に社名変更
2016年10月	東京海上不動産投資顧問株式会社と合併

・大株主の状況（2021年９月末日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
東京海上ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目２番１号	38,300株	100.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

●各コース

1．基本方針

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。

2．運用方法

(1) 主要投資対象

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－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」の受益証券と、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」の受益証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

①外国投資信託「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」の受益証券および親投資信託「東京海上マネーマザーファンド」の受益証券への投資を通じて、世界の金融機関が発行するハイブリッド証券等に実質的に投資します。

②運用にあたっては、上記の投資信託証券（投資信託および外国投資信託の受益証券を含みます。以下同じ。）のうち、「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」の組入比率を高位に保つことを基本とします。

③資金動向、市況動向、残存期間等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。

●マネープール・ファンド

1．基本方針

主として「東京海上マネーマザーファンド」（以下「マザーファンド」ということがあります。）受益証券に投資を行い、安定した収益の確保を目指して安定運用を行います。

2．運用方法

(1) 主要投資対象

主としてマザーファンド受益証券に投資し、高位の組入比率を維持します。なお、有価証券等の資産に直接投資することがあります。

(2) 投資態度

①主として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するマザーファンド受益証券に投資します。

②当ファンドの運用は、ファミリーファンド方式により行います。したがって、実質的な運用は、マザーファンドで行うこととなります。

③資金動向、市況動向、残存期間等の事情によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。

(2)【投資対象】

●各コース

1．当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

(1) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第３条で定めるものをいいます。以下同じ。）

① 有価証券

② 金銭債権（①③に掲げるものに該当するものを除きます。）

③ 約束手形（金融商品取引法第２条第１項第15号に掲げるものを除きます。）

(2) 次に掲げる特定資産以外の資産

為替手形

2．委託会社は、信託金を、主として次の(1)および(2)に掲げる投資信託証券ならびに(3)から(6)に掲げる有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

(1)

コース名	投資対象（外国投資信託）
円コース （毎月分配型）	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－日本円クラス

米ドルコース （毎月分配型）	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－米ドルクラス
ユーロコース （毎月分配型）	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
豪ドルコース （毎月分配型）	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－豪ドルクラス
ブラジル・レアルコース （毎月分配型）	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－ブラジル・レアルクラス
メキシコ・ペソコース （毎月分配型）	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－メキシコ・ペソクラス
トルコ・リラコース （毎月分配型）	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－トルコ・リラクラス
ロシア・ルーブルコース （毎月分配型）	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－ロシア・ルーブルクラス
資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）	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－資源国通貨バスケットクラス

(2) 「東京海上マネーマザーファンド」の受益証券
(3) コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
(4) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(3)の証券の性質を有するもの
(5) 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）
(6) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、上記(5)の証券を「公社債」といい、公社債にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

３．委託会社は、信託金を、上記２．に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
(1) 預金
(2) 指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
(3) コール・ローン
(4) 手形割引市場において売買される手形

４．上記２．の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記３．に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

＜参考情報＞当ファンドが投資対象とする投資信託証券について

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 （日本円クラス／米ドルクラス／ユーロクラス／豪ドルクラス／ブラジル・レアルクラス／ メキシコ・ペソクラス／トルコ・リラクラス／ロシア・ルーブルクラス／ 資源国通貨バスケットクラス） 正式名称：Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund	
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目指します。 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、ユーロクラス＝ユーロ、豪ドルクラス＝豪ドル、ブラジル・レアルクラス＝ブラジル・レアル、メキシコ・ペソクラス＝メキシコ・ペソ、トルコ・リラクラス＝トルコ・リラ、ロシア・ルーブルクラス＝ロシア・ルーブル、資源国通貨バスケットクラス＝豪ドル／ブラジル・レアル／南アフリカ・ランド（比率は概ね３分の１ずつ））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、市況動向、残存期間等の事情によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。

東京海上マネーマザーファンド	
形態	親投資信託
運用方針	内外の公社債およびコマーシャル・ペーパーを中心に投資し、安定した収益の確保をはかります。
主な投資制限	・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。
収益分配	無分配
信託設定日	2008年３月28日
信託期間	無期限
決算日	原則として毎年８月15日
信託報酬等	信託報酬はかかりません。有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等が信託財産から支払われます。
委託会社	東京海上アセットマネジメント株式会社
受託銀行	三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社
ベンチマーク	なし

※資金動向、市況動向、残存期間等の事情によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。

●マネープール・ファンド

１．当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

(1) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第３条で定めるものをいいます。以下同じ。）
① 有価証券
② デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。）
③ 金銭債権（①④に掲げるものに該当するものを除きます。）
④ 約束手形（金融商品取引法第２条第１項第15号に掲げるものを除きます。）
(2) 次に掲げる特定資産以外の資産
為替手形

２．委託会社は、信託金を、主として東京海上アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託会社として締結された「東京海上マネーマザーファンド」の受益証券および次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
(1) 転換社債の転換、新株引受権の行使および新株予約権の行使により取得した株券および新株引受権証書
(2) 国債証券
(3) 地方債証券
(4) 特別の法律により法人の発行する債券
(5) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
(6) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
(7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
(8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
(9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
(10)コマーシャル・ペーパー
(11)新株引受権証券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）および新株予約権証券
(12)外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(1)から(11)までの証券または証書の性質を有するもの
(13)投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
(14)投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）
(15)外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
(16)オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
(17)預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
(18)外国法人が発行する譲渡性預金証書
(19)指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
(20)抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます。）
(21)貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
(22)外国の者に対する権利で上記(21)の有価証券の性質を有するもの
なお、(1)の証券または証書、(12)および(17)の証券または証書のうち(1)の証券または証書の性質を有するものを「株式」といい、(2)から(6)までの証券、(12)および(17)の証券または証書のうち(2)から(6)までの証券の性質を有するものならびに(14)の投資法人債券を「公社債」といい、(13)の証券および(14)の証券（投資法人債券を除きます。）を「投資信託証券」といいます。

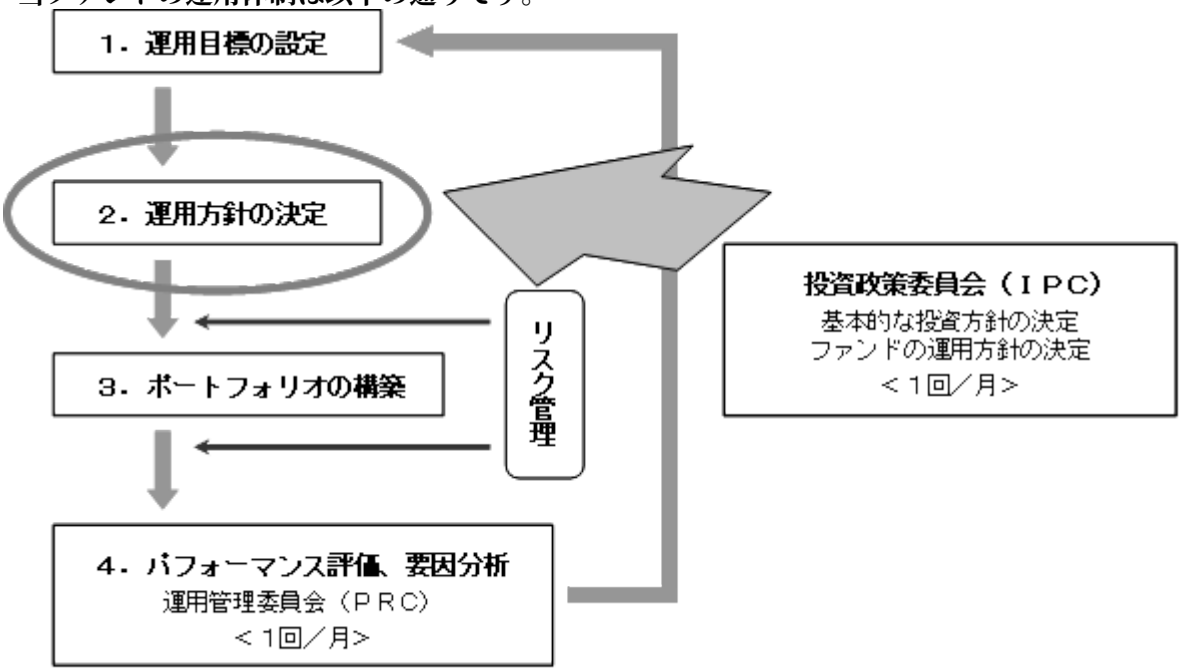
３．委託会社は、信託金を、上記２．に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
(1) 預金
(2) 指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
(3) コール・ローン
(4) 手形割引市場において売買される手形
(5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

(6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

４．上記２．の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記３．に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(3)【運用体制】

当ファンドの運用体制は以下の通りです。



ファンドの運用に関する社内規則として「投資運用業に係る業務運営規程」を設けております。

運用におけるリスク管理は、運用リスク管理部門（５～10名程度）による法令・運用ガイドライン等の遵守状況のチェックや運用リスク項目のチェック等が随時実施され、担当運用部へフィードバックされるとともに、原則として月１回開催される運用管理委員会（運用リスク管理部門担当役員を委員長に、運用・営業・商品企画などファンド運用に関係する各部長が参加）において投資行動の評価が行われます。（リスク管理についての詳細は、「３ 投資リスク」の「３.管理体制」をご参照ください）

この運用管理委員会での評価もふまえて、投資政策委員会（運用本部長を委員長とし、各運用部長が参加）において運用方針を決定し、より質の高い運用体制の維持・向上を目指します。

また、受託銀行等の管理については、関連部署において、受託銀行業務等に関する「内部統制の整備及び運用状況報告書」の入手・検証、現地モニタリング等を通じて実施しております。

（上記の体制や人員等については、2021年９月末日現在）

(4)【分配方針】

●各コース

月１回（原則として毎月17日、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、毎決算時に原則として以下の通り収益分配を行う方針です。
分配対象額は、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。）等の全額とします。収益分配にあたっては、原則として毎決算時に安定分配を継続的に行うことを目指します。収益分配金額は、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。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。なお、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、投資方針に基づいて運用を行います。

●マネープール・ファンド

年２回（原則として、３月および９月の各17日、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、毎決算時に原則として以下の通り収益分配を行う方針です。
分配対象額は、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。）等の全額とし、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して収益分配金額を決定します。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。なお、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、投資方針に基づいて運用を行います。

●各コース／マネープール・ファンド　共通

①信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。
a.配当金、利子、およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費（※）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
b.売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費（※）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
（※）諸経費とは、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（消費税等相当額を含みます。）、信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）ならびに受託会社の立替えた立替金の利息をいいます。（「マネープール・ファンド」は、監査費用がかかりません。）
②計算期末において信託財産に損失が生じた場合は、次期に繰越します。
③分配金は、毎計算期間終了後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して５営業日まで）から、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、お支払いします。なお、分配金を再投資する場合は、分配金は税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5)【投資制限】

●各コース

①運用の基本方針に基づく制限（約款別紙「運用の基本方針」）

a.株式への直接投資は行いません。

b.外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

c.投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

d.同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

②公社債の借入（約款第19条）

a.委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入の指図をすることができます。なお、当該公社債の借入を行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

b.上記a.の借入の指図は、当該借入にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うことができるものとします。

c.信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の借入にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

d.上記a.の借入にかかる品借料は信託財産中から支弁します。

③特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第20条）

外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

④外国為替予約取引（約款第21条）

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

⑤信用リスク集中回避のための投資制限（約款第21条の２）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑥資金の借入（約款第27条）

a.委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

b.一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

c.収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

d.借入金の利息は信託財産中から支弁します。

●マネープール・ファンド

①運用の基本方針に基づく制限（約款別紙「運用の基本方針」）

a.委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。（ただし、転換社債の転換、新株引受権の行使および新株予約権の行使により取得する場合に限ります。）

b.外貨建資産への投資は、円貨で約定し、円貨で決済する取引により取得した、外国において発行された有価証券について、円貨での決済が困難になる事態が発生した場合に限り、当該外貨建資産の為替リスクのヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。ただしこの場合においては、可能な限り速やかに当該外貨建資産を売却することとします。

c.委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

d.委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券ならびに取引所に上場し、かつ当該取引所において常時売却可能な投資信託証券、また既に組入れていた株式等が転換等により投資信託証券に該当することとなった投資信託証券を除きます。）の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

e.委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。
f.委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。
g.委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

②投資する株式等の範囲（約款第19条）
a.委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
b.上記a.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

③信用取引（約款第21条）
a.委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡または買戻により行うことの指図をすることができるものとします。
b.上記a.の信用取引の指図は、当該売付にかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
c.信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の売付にかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

④先物取引等（約款第22条）
a.委託会社は、日本国内の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
b.委託会社は、日本国内の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
c.委託会社は、日本国内の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

⑤スワップ取引（約款第23条）
a.委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
b.スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
c.スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
d.委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入が必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。

⑥金利先渡取引および為替先渡取引（約款第24条）
a.委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
b.金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
c.金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
d.委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入が必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。

⑦デリバティブ取引等に係る投資制限（約款第24条の２）

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

⑧有価証券の貸付（約款第25条）

a.委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

・株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

・公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

b.上記a.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

c.委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入の指図を行うものとします。

⑨有価証券の空売（約款第26条）

a.委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または下記「⑩ 有価証券の借入」の規定により借入れた有価証券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売付けた有価証券の引渡または買戻により行うことの指図をすることができるものとします。

b.上記a.の売付の指図は、当該売付にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うことができるものとします。

c.信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の売付にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その額を超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

⑩有価証券の借入（約款第27条）

a.委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入の指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入を行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

b.上記a.の借入の指図は、当該借入にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うことができるものとします。

c.信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の借入にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

d.上記a.の借入にかかる品借料は信託財産中から支弁します。

⑪特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第28条）

外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

⑫信用リスク集中回避のための投資制限（約款第29条の２）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑬資金の借入（約款第35条）

a.委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

b.一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

c.収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

d.借入金の利息は信託財産中から支弁します。

3【投資リスク】

1．投資リスク

※以下の記載は、当ファンドが主要投資対象とする投資信託証券およびマザーファンドを組み入れることにより、当ファンドが間接的に受ける実質的なリスクを含みます。

各コース（「マネープール・ファンド」を除きます。）は、主に投資信託証券への投資を通じてハイブリッド証券等値動きのある証券を実質的な投資対象としますので、基準価額は変動します。また、「マネープール・ファンド」は、主に公社債等値動きのある証券を実質的な投資対象としますので、基準価額は変動します。したがって、当ファンドは元本が保証されているものではありません。
委託会社の運用指図によって信託財産に生じた利益および損失は、全て投資家に帰属します。
投資信託は預貯金や保険と異なります。
当ファンドへの投資には主に以下のリスクが想定され、これらの影響により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

●各コース

①ハイブリッド証券への投資に伴うリスク

ハイブリッド証券への投資には次のような特有のリスクがあり、信用リスクや流動性リスクは普通社債への投資と比較して相対的に大きいものとなります。

・弁済の劣後リスク

一般的にハイブリッド証券の法的弁済順位は株式に優先し、普通社債に劣後します。したがって、発行体が経営破たん等に陥り、普通社債等が全額支払われない場合、ハイブリッド証券は元利金の支払いを受けられないことがあります。また、ハイブリッド証券は、一般的に普通社債と比較して低い格付が格付機関により付与されていますが、その格付がさらに下落する場合には、ハイブリッド証券の価格が普通社債以上に大きく下落する場合があります。

・トリガーイベントに伴うリスク

ハイブリッド証券には、金融監督当局が発行体を実質破たん状態にあると判断した場合等のトリガーイベントが発生した場合、当該証券の元本が削減されるリスク等があります。この場合、当該証券の価格が大きく下落することがあります。

・繰上償還延期リスク

一般的にハイブリッド証券には、繰上償還（コール）条項が付与されており、この繰上償還の実施は発行体が決定することとなっています。市場環境等の要因によって予定された期日に繰上償還が実施されない場合、あるいは実施されないと見込まれる場合には、当該証券の価格が大きく下落することがあります。

・利息・配当繰り延べリスク

利息または配当の支払い繰り延べ条項を有するハイブリッド証券は、発行体の財務状況や収益動向等の要因によって、利息または配当の支払いが繰り延べまたは停止される可能性があります。この場合、期待されるインカムゲインが得られないこととなり、ハイブリッド証券の価格が下落する可能性があります。

・制度変更等に関わるリスク

将来、ハイブリッド証券にかかる税制の変更や、当該証券市場にとって不利益な制度上の重大な変更等があった場合には、税制上・財務上のメリットがなくなるか、もしくは著しく低下する等の事由により、投資成果に悪影響を及ぼす可能性があります。

②為替変動リスク

＜円コース＞

主要投資対象である外国投資信託は、原資産通貨売り／円買いの為替ヘッジにより、為替変動リスクの低減を図ります。ただし、追加設定・解約の影響等により、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。また、原資産通貨の金利が円金利より高い場合、これらの金利差相当分のヘッジコストがかかります。ただし、為替市場における需給の影響等によっては、金利差相当分以上のヘッジコストがかかる場合があります。

＜円コース以外の各コース＞

主要投資対象である外国投資信託は、原資産通貨売り／各コースの通貨買い（資源国通貨バスケットコースは豪ドル、ブラジル・レアル、南アフリカ・ランドを概ね３分の１ずつ）の為替取引を行います。これにより、各コース通貨の為替レートの変動の影響を受け、各コースの通貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となります。当該為替取引は、追加設定・解約の影響等により、原資産通貨売りの額と各コースの通貨買いの額を完全に一致させることができるものではありません。また、原資産通貨の金利が各コース通貨の金利より高い場合、これらの金利差相当分のコストがかかります。ただし、為替市場における需給の影響等によっては、金利差相当分以上のコストがかかる場合があります。

※各コースの主要投資対象である外国投資信託の組入資産は、米ドルやユーロ等複数の通貨（原資産通貨）で構成されています。外国投資信託における米ドル建以外の組入資産に関しては、原則として原資産通貨売り／米ドル買いの為替取引を行った上で、各クラス（「日本円クラス」を除く）では米ドル売り／各コースの通貨買いの為替取引を行い、「日本円クラス」では米ドル売り／円買いの為替ヘッジを行います。その際、取引のタイミングや金額のずれが生じる場合があり、必ずしも完全な為替取引および為替ヘッジの効果が得られない場合があります。
※外国為替予約取引と類似する直物為替先渡取引（ＮＤＦ）を利用することにより、為替取引を行うことがあります。ＮＤＦの取引価格は、需給や当該対象通貨に対する期待等により、当該通貨の金利差から理論上期待される水準とは大きく異なる場合があります。この結果、当ファンドの基準価額の値動きは、実際の当該対象通貨の為替市場の値動きから想定されるものと大きく乖離する場合があります。

③カントリーリスク
投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想以上に下落したり、投資方針に沿った運用が困難となることがあります。
また、投資対象国・地域には新興国が含まれています。新興国を取巻く社会的・経済的環境は不透明な場合もあり、金融危機、デフォルト（債務不履行）、重大な政策変更や様々な規制の新たな導入等による投資環境の変化が、先進国への投資に比べてより大きなリスク要因となることがあります。さらに、新興国においては市場規模が小さく流動性が低い場合があり、そのため証券価格の変動が大きくなることがあります。

④特定の業種への集中投資リスク
投資対象とする投資信託証券を通じて、金融機関が発行するハイブリッド証券に集中的に投資するため、幅広い業種に分散投資を行うファンドと比較して、基準価額の変動が大きくなる場合があります。

●各コース、マネープール・ファンド共通
①金利変動リスク
ハイブリッド証券や公社債は、一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、反対に金利が下落した場合には価格は上昇します。したがって、金利が上昇した場合、基準価額が下落する要因となります。
②信用リスク
一般に、ハイブリッド証券や公社債、短期金融商品等の発行体にデフォルトが生じた場合、またはデフォルトが予想される場合には、当該公社債等の価格は大幅に下落することになります。したがって、組入公社債等にデフォルトが生じた場合、またデフォルトが予想される場合には、基準価額が下落する要因となります。
③流動性リスク
受益者から解約申込があった場合、組入資産を売却することで解約資金の手当てを行うことがあります。その際、組入資産の市場における流動性が低いときには直前の市場価格よりも大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。
なお、各コースが実質的に投資対象とするハイブリッド証券は、比較的流動性が低いため、より流動性の高い資産への投資を行うファンドと比べて、基準価額への影響度合いが大きくなる可能性があります。

２．その他の留意事項

(1) 一般的な留意事項

投資信託は、その商品性格から次の特徴をご理解のうえご購入ください。
・投資信託は株式・公社債などの値動きのある証券に投資しますので、基準価額は変動します。
・投資信託は金融機関の預金と異なり元金が保証されているものではありません。
・投資信託は保険契約および預金ではありません。
・投資信託は保険契約者保護機構の補償対象契約ではありません。
・投資信託は預金保険の対象ではありません。
・登録金融機関から購入した投資信託は投資者保護基金の補償対象ではありません。
・当ファンドの各コースは、主に投資信託証券への投資を通じてハイブリッド証券等を実質的な投資対象としています。また、「マネープール・ファンド」は、主に国内の公社債を実質的な投資対象としています。当ファンドの基準価額は、組入れたハイブリッド証券や公社債の値動きやそれらハイブリッド証券や公社債の発行者の信用状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下しますので、投資元本を割り込むことがあります。したがって、当ファンドは元本が保証されているものではありません。

・委託会社の運用指図によって信託財産に生じた利益および損失は、全て投資家に帰属します。

(2) 法令・税制・会計等の変更可能性

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

(3) その他の留意点

①取得申込者から販売会社に申込代金が支払われた場合であっても、販売会社より委託会社に対して申込代金の払込が現実になされるまでは、当ファンドも委託会社もいかなる責任も負わず、かつその後、受託会社に払込がなされるまでは、取得申込者は受益権および受益権に付随するいかなる権利も取得しません。

②一部解約金、収益分配金および償還金の支払は全て販売会社を通じて行われます。

③委託会社は、販売会社とは別法人であり、委託会社は設定・運用を善良なる管理者の注意をもって行う責任を負担し、販売会社は販売（申込代金の預り等を含みます。）について責任を負担しており、互いに他について責任を負担しません。

④受託会社は、委託会社に収益分配金、一部解約金および償還金を委託会社の指定する預金口座等へ払い込んだ後は、受益者に対し、それらを支払う責任を負いません。

⑤当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の６の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

⑥「マネープール・ファンド」は、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、「マネープール・ファンド」が投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等に伴う資金変動等があり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

⑦各コースが投資対象とする外国投資信託受益証券が存続しないこととなる場合は、当該ファンドを繰上償還させます。

⑧店頭デリバティブ取引等について、規制強化等が行われています。各コースが投資対象とする外国投資信託で行われる為替予約取引および直物為替先渡取引（ＮＤＦ）が規制強化により、取引の担保として現金等を差し入れることとなった場合、現金等を資産の一部として保有することがあります。その場合、各コースの実質的な主要投資対象資産の組入比率が低下し、高位に組入れた場合と比較して、期待される投資成果が得られない場合があります。

⑨「マネープール・ファンド」は、マイナス利回りの公社債や金融商品等での運用となることがあり、この場合、基準価額の下落要因となりますのでご留意ください。

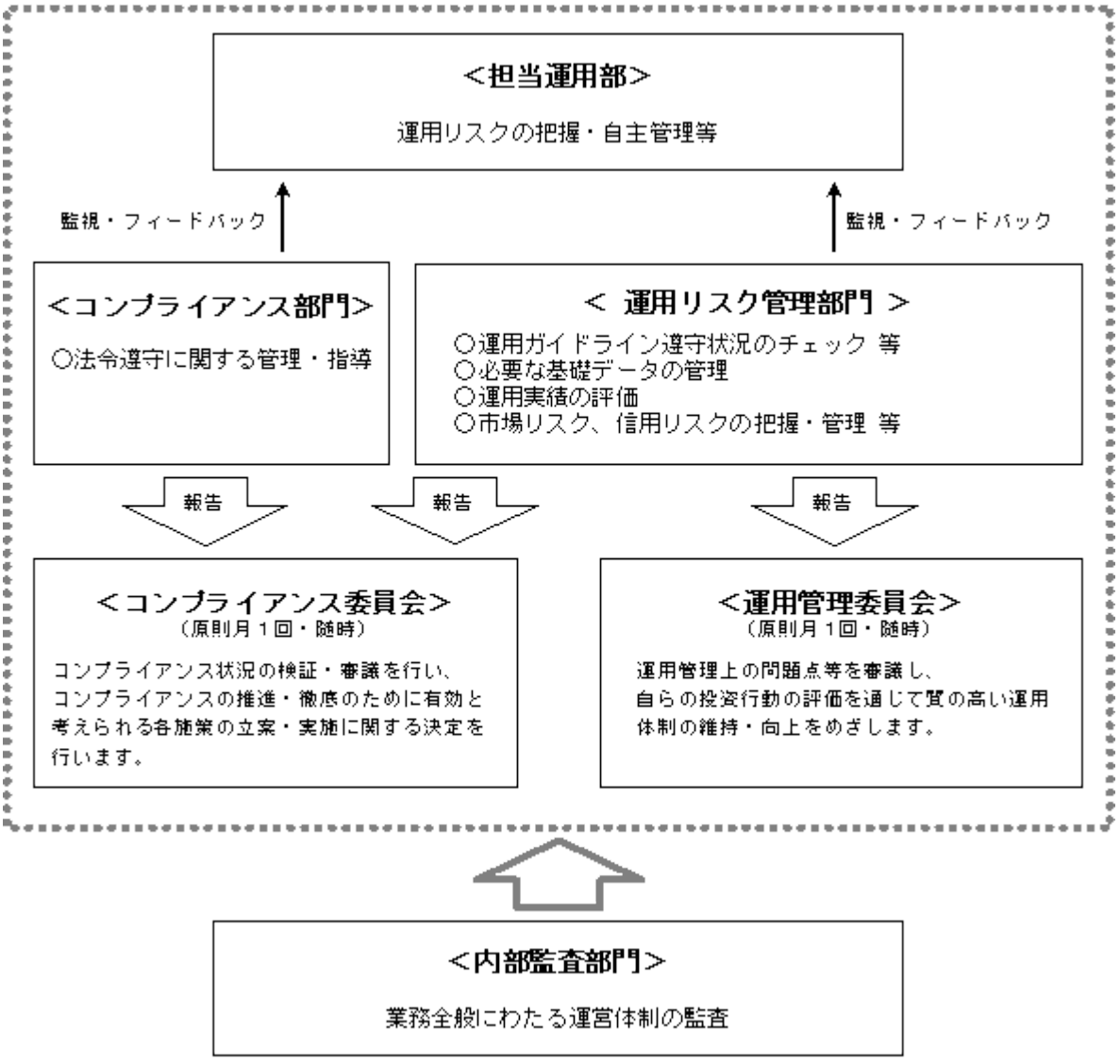
３．管理体制

委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。

法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。（なお、当ファンドは、比較的流動性の低い資産にも投資するため、流動性リスクにも配慮した管理を行っています。）

これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。

<リスク管理体制>



参考情報

2016年10月～2021年9月

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

過去5年間の各月末における分配金再投資基準価額と直近1年間の騰落率を表示したものです。

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較

ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。過去5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものです。

円コース（毎月分配型）

※後述の注記事項をご参照ください。

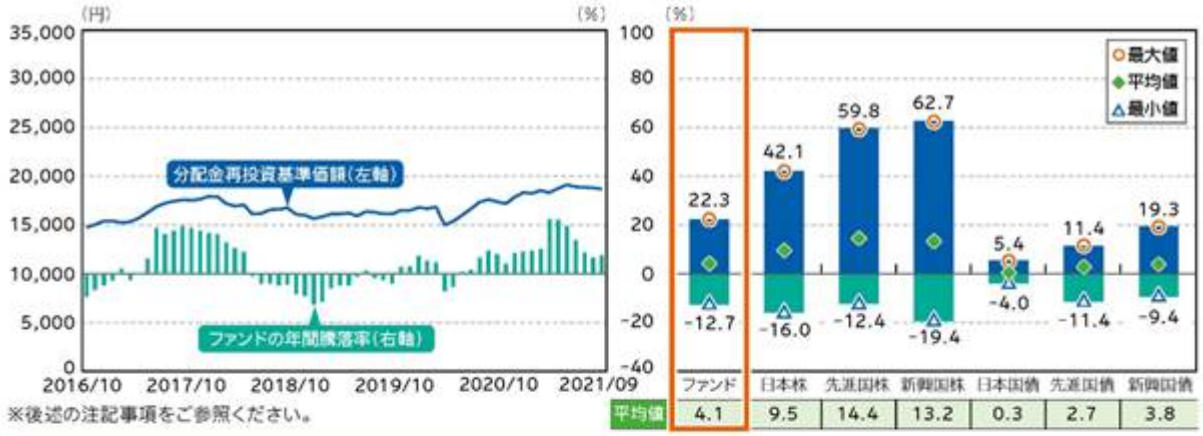
米ドルコース（毎月分配型）

※後述の注記事項をご参照ください。

次ページへ続く

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

ユーロコース（毎月分配型）



※後述の注記事項をご参照ください。

豪ドルコース（毎月分配型）

※後述の注記事項をご参照ください。

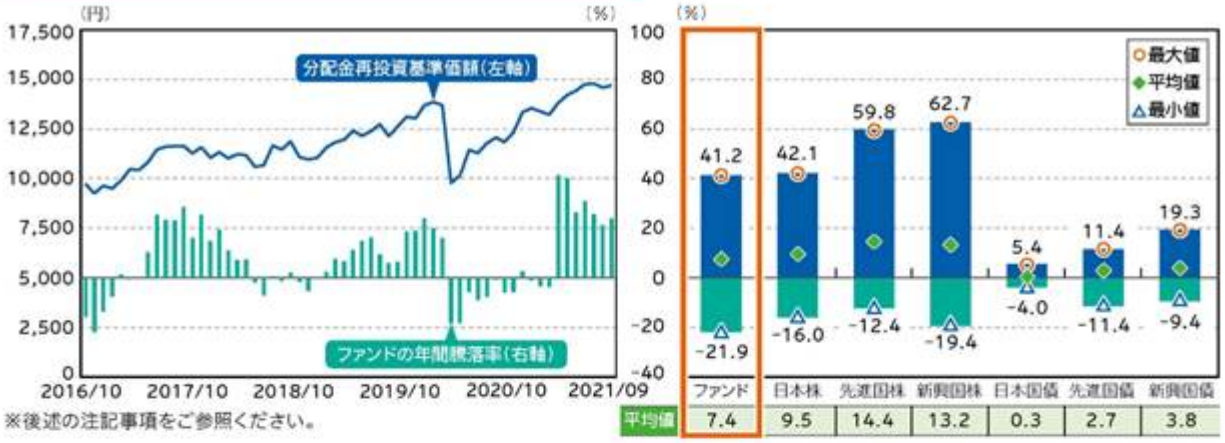
ブラジル・レアルコース（毎月分配型）

※後述の注記事項をご参照ください。

次ページへ続く

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

メキシコ・ペソコース（毎月分配型）



	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
平均値	7.4	9.5	14.4	13.2	0.3	2.7	3.8

※後述の注記事項をご参照ください。

トルコ・リラコース（毎月分配型）

	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
平均値	-2.4	9.5	14.4	13.2	0.3	2.7	3.8

※後述の注記事項をご参照ください。

ロシア・ルーブルコース（毎月分配型）

	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
平均値	9.0	9.5	14.4	13.2	0.3	2.7	3.8

※後述の注記事項をご参照ください。

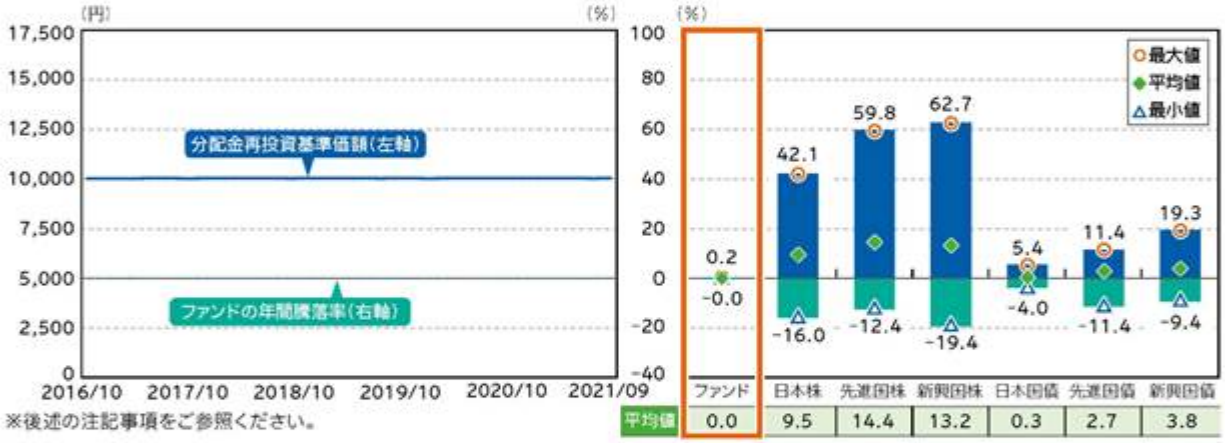
次ページへ続く

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）

※後述の注記事項をご参照ください。

マネープール・ファンド



※後述の注記事項をご参照ください。

注記事項

※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものとして計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。

※年間騰落率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

※ファンドは分配金再投資基準価額の年間騰落率です。税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

次ページへ続く

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

代表的な資産クラスと指数名

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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）

指数について

●TOPIXの指数値および商標は、東京証券取引所の知的財産であり、TOPIXに関するすべての権利およびノウハウは東京証券取引所が有します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、公表の停止、TOPIXの算出の変更、使用の停止を行う場合があります。 ●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）に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券に帰属します。 ●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・マーケッツ・グローバル・ディバーシ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。

（注）海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

①発行価格に3.3%（税抜３%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。ただし、各コースから「マネープール・ファンド」へのスイッチングの場合は無手数料とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。申込手数料には、消費税等が含まれます。
申込手数料は、商品の説明、購入に関する事務コスト等の対価として、申込時にご負担いただくものです。

②収益分配金の再投資により取得する口数については、手数料はありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金時（解約時）の手数料はありません。

(3)【信託報酬等】

●各コース

①委託会社、販売会社および受託会社の信託報酬の総額は信託財産の純資産総額に対し、年率1.0153%（税抜0.923%）を乗じて得た金額とし、計算期間を通じて、毎日計上します。

②①の信託報酬（消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

③信託報酬の配分（税抜）については以下の通りとします。

委託会社＊1	販売会社＊2	受託会社＊3
年率0.28%	年率0.62%	年率0.023%

＊1 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
＊2 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
＊3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

④当ファンドの信託報酬のほかに、当ファンドが投資対象とする投資信託証券に関しても信託報酬等がかかります。投資対象とする投資信託証券の信託報酬を加えた実質的な信託報酬の上限は年率1.6923%程度（税込）となります。（本書作成日現在）

＜参考情報＞当ファンドが投資対象とする投資信託証券の信託報酬（本書作成日現在）

投資信託証券の名称	信託報酬率 (年率)
外国投資信託（ケイマン諸島籍） 「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」	0.677%（※）
親投資信託 「東京海上マネーマザーファンド」	信託報酬は ありません

（※）信託報酬等として受託会社、投資顧問会社、副投資顧問会社、管理会社、保管銀行ならびに事務代行会社に対して支払われます。ただし、投資対象とする外国投資信託の信託報酬のうち受託会社に支払う報酬（年率0.01%）が10,000米ドルに満たない場合は10,000米ドルとなりますので、外国投資信託の純資産総額によっては上記報酬率を超える場合があります。

上記のほか、有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等の費用も別途かかります。なお、当ファンドが上記の各投資信託の受益証券を取得するに際しては、申込手数料はかかりません。

●マネープール・ファンド

①委託会社、販売会社および受託会社の信託報酬の総額は信託財産の純資産総額に対し、②の信託報酬率を乗じて得た金額とし、計算期間を通じて、毎日計上します。

②信託報酬率（年率）は月次で見直すものとし、前月の最終営業日の翌日から、当月の最終営業日までの信託報酬率は、当該期間の直前の５営業日間の当該信託または当該信託が投資する親投資信託の日々の基準価額算出に用いたコール・ローンのオーバーナイト物レートの最低レート（以下、「コールレート」といいます。）に応じて以下に定める率とします。

コールレート	信託報酬率			
	合計	委託会社＊1（税抜）	販売会社＊2（税抜）	受託会社＊3（税抜）
0.45%以上	年率0.2475%（税抜0.225%）	年率0.065%	年率0.15%	年率0.01%
0.3%以上0.45%未満	年率0.165%（税抜0.15%）	年率0.045%	年率0.1%	年率0.005%
0.2%以上0.3%未満	年率0.11%（税抜0.1%）	年率0.03%	年率0.065%	年率0.005%
0.1%以上0.2%未満	年率0.055%（税抜0.05%）	年率0.015%	年率0.034%	年率0.001%
0.05%以上0.1%未満	年率0.0275%（税抜0.025%）	年率0.007%	年率0.017%	年率0.001%
0.01%以上0.05%未満	年率0.011%（税抜0.01%）	年率0.003%	年率0.006%	年率0.001%
0.01%未満	年率0.0011%（税抜0.001%）	年率0.0003%	年率0.0006%	年率0.0001%

＊１ 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

＊２ 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

＊３ 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

③①の信託報酬（消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

(4)【その他の手数料等】

①信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用であり、毎日、純資産総額に対し、年率0.011%（税抜0.01%）を乗じて得た金額（ただし、年66万円（税抜60万円）の１日分相当額を上限とします。）を計上し、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。（「マネープール・ファンド」は監査費用がかかりません。）

②信託財産に関する租税および信託事務等に要する諸費用（消費税等相当額を含みます。）ならびに受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

③ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、外国における資産の保管等に要する費用等（全て消費税等相当額を含みます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

④信託財産の一部解約に伴う支払資金の手当て、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行った場合、借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

※監査費用を除くその他の手数料等については実際の取引等により変動するため、事前に料率、上限額等を表示することができません。

上記(1)から(4)の手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、あらかじめ表示することができません。

(5)【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として以下のような取扱いとなります。なお、税法が改正された場合は、以下の内容が変更になることがあります。また、以下は一般的な記載に過ぎませんので、課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認ください。

＜個人の受益者に対する課税＞

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%※および地方税５%）の税率による源泉徴収が行われます。申告不要制度の適用がありますが、総合課税または申告分離課税を選択することも可能です。いずれの場合も配当控除の適用はありません。申告分離課税を選択した場合の税率は、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税５%）となります。収益分配金のうち課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）（※１）は課税されません。

※2037年12月31日までの間、復興特別所得税（所得税15%×2.1%）が付加されます。

解約時および償還時の差益（解約時および償還時の価額から取得費（申込手数料（税込）を含む）を控除した差額）は、その全額が譲渡所得等の金額とみなされ課税対象となります。譲渡所得等については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税５%）の税率による申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）での取扱いも可能です。）。

普通分配金（申告分離課税を選択したものに限ります。）ならびに解約時および償還時の損益については、確定申告により、上場株式等（特定公社債および公募公社債投信を含みます。）の利子所得および配当所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）ならびに譲渡所得等との間で損益通算を行うことができます。

少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアＮＩＳＡ」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託や上場株式等から生じる配当所得および譲渡所得等が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記とは異なる場合があります。

＜法人の受益者に対する課税＞

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の「各受益者の個別元本」（※２）超過額については、15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）の税率による源泉徴収が行われます。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）（※１）は課税されません。
なお、益金不算入制度の適用はありません。

（※１）「元本払戻金（特別分配金）」とは、収益分配金落ち後の基準価額が各受益者の個別元本を下回る場合、収益分配金のうち当該下回る部分に相当する額をさし、元本の一部払戻しに相当するものです。この場合、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

（※２）「各受益者の個別元本」とは、原則として各受益者の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、元本払戻金（特別分配金）が支払われた際に調整されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数の支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＊上記は、2021年９月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容等が変更される場合があります。

5【運用状況】

以下は2021年9月30日現在の運用状況です。
また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

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）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	ケイマン	7,750,576,355	99.38
親投資信託受益証券	日本	1,002,875	0.01
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		46,876,691	0.60
合計（純資産総額）		7,798,455,921	100.00

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）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	ケイマン	4,899,300,778	98.95
親投資信託受益証券	日本	10,029	0.00
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		51,531,032	1.04
合計（純資産総額）		4,950,841,839	100.00

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）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	ケイマン	16,142,203	97.67
親投資信託受益証券	日本	10,029	0.06
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		374,014	2.26
合計（純資産総額）		16,526,246	100.00

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）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	ケイマン	1,334,039,674	98.97
親投資信託受益証券	日本	1,002,875	0.07
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		12,878,603	0.95
合計（純資産総額）		1,347,921,152	100.00

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）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	ケイマン	1,179,940,973	98.41
親投資信託受益証券	日本	1,002,875	0.08
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		17,972,054	1.49
合計（純資産総額）		1,198,915,902	100.00

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）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	ケイマン	535,435,395	98.78
親投資信託受益証券	日本	10,011	0.00
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		6,569,392	1.21

合計（純資産総額）	542,014,798	100.00

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）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	ケイマン	2,205,758,723	98.52
親投資信託受益証券	日本	10,011	0.00
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		33,028,340	1.47
合計（純資産総額）		2,238,797,074	100.00

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）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	ケイマン	285,045,776	98.74
親投資信託受益証券	日本	10,011	0.00
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		3,607,245	1.24
合計（純資産総額）		288,663,032	100.00

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）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	ケイマン	90,090,854	99.20
親投資信託受益証券	日本	10,029	0.01
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		714,211	0.78
合計（純資産総額）		90,815,094	100.00

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	3,301,072	100.00
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		0	0.00
合計（純資産総額）		3,301,072	100.00

（ご参考：親投資信託の投資状況）

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）、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）、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）、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）、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）、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）、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）、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）、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）、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンドが主要投資対象とする親投資信託の投資状況は以下の通りです。

東京海上マネーマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
地方債証券	日本	7,998,940	68.73
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		3,637,934	31.26
合計（純資産総額）		11,636,874	100.00

(2)【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

a.主要銘柄の明細

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）

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund JPY Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	886,793.6334	8,803	7,806,444,354	8,740	7,750,576,355	99.38
2	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	991,474	1.0115	1,002,875	1.0115	1,002,875	0.01

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）

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund USD Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	323,578.4148	14,935	4,832,643,625	15,141	4,899,300,778	98.95
2	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,915	1.0115	10,029	1.0115	10,029	0.00

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）

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund EUR Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	1,391.3294	11,598	16,136,638	11,602	16,142,203	97.67
2	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,915	1.0115	10,029	1.0115	10,029	0.06

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）

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund AUD Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	164,655.6004	8,096	1,333,051,740	8,102	1,334,039,674	98.97
2	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	991,474	1.0115	1,002,875	1.0115	1,002,875	0.07

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）

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund BRL Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	492,874.2581	2,432.9300	1,199,133,367	2,394	1,179,940,973	98.41
2	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	991,474	1.0115	1,002,875	1.0115	1,002,875	0.08

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）

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund MXN Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	101,408.2188	5,330	540,505,806	5,280	535,435,395	98.78
2	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,898	1.0115	10,011	1.0115	10,011	0.00

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）

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund TRY Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	1,659,713.11	1,355.4600	2,249,682,594	1,329	2,205,758,723	98.52
2	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,898	1.0115	10,011	1.0115	10,011	0.00

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）

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund RUB Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	76,728.3381	3,666	281,286,087	3,715	285,045,776	98.74
2	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,898	1.0115	10,011	1.0115	10,011	0.00

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）

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund Resources Currency Basket Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	17,800.9988	5,130	91,319,123	5,061	90,090,854	99.20

2	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,915	1.0115	10,029	1.0115	10,029	0.01

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンド

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	東京海上マネーマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,263,542	1.0115	3,301,073	1.0115	3,301,072	100.00

b.投資有価証券の種類

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）

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.38
親投資信託受益証券	0.01
合　計	99.39

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）

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.95
親投資信託受益証券	0.00
合　計	98.95

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）

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	97.67
親投資信託受益証券	0.06
合　計	97.73

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）

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.97
親投資信託受益証券	0.07
合　計	99.04

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）

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.41
親投資信託受益証券	0.08
合　計	98.50

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）

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.78
親投資信託受益証券	0.00
合　計	98.78

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）

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.52
親投資信託受益証券	0.00
合　計	98.52

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）

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.74
親投資信託受益証券	0.00
合　計	98.75

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）

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.20
親投資信託受益証券	0.01
合　計	99.21

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンド

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合　計	100.00

②【投資不動産物件】

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）

該当事項はありません。

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）

該当事項はありません。

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）

該当事項はありません。

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）

該当事項はありません。

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）

該当事項はありません。

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）

該当事項はありません。

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）

該当事項はありません。

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）

該当事項はありません。

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）

該当事項はありません。

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

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）

該当事項はありません。

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）
該当事項はありません。

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）
該当事項はありません。

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）
該当事項はありません。

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）
該当事項はありません。

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）
該当事項はありません。

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）
該当事項はありません。

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）
該当事項はありません。

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）
該当事項はありません。

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンド
該当事項はありません。

（ご参考：親投資信託の投資資産）
①投資有価証券の主要銘柄
a.主要銘柄の明細
東京海上マネーマザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	額面	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
							単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	第１３回せたがや区民債	日本	地方債証券	0.100	2021/10/26	5,000,000	99.96	4,998,250	99.98	4,999,300	42.96
2	第１４回なごやか市民債	日本	地方債証券	0.080	2021/10/29	3,000,000	99.97	2,999,190	99.98	2,999,640	25.77

b.投資有価証券の種類
東京海上マネーマザーファンド

種類	投資比率(%)
地方債証券	68.73
合　計	68.73

②投資不動産物件
東京海上マネーマザーファンド
該当事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの
東京海上マネーマザーファンド
該当事項はありません。

(3)【運用実績】
①【純資産の推移】
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）

期	年月日	純資産総額（百万円）（分配落）	純資産総額（百万円）（分配付）	1口当たり純資産額(円)（分配落）	1口当たり純資産額(円)（分配付）
第1特定期間末	（2012年 3月19日）	11,770	11,924	1.0394	1.0564
第2特定期間末	（2012年 9月18日）	18,282	18,892	1.0701	1.1061
第3特定期間末	（2013年 3月18日）	58,532	59,857	1.0895	1.1295
第4特定期間末	（2013年 9月17日）	73,032	75,853	1.0366	1.0786
第5特定期間末	（2014年 3月17日）	60,604	63,295	1.0591	1.1011
第6特定期間末	（2014年 9月17日）	51,027	53,200	1.0448	1.0868
第7特定期間末	（2015年 3月17日）	44,830	46,723	1.0347	1.0767
第8特定期間末	（2015年 9月17日）	38,389	40,165	0.9684	1.0104
第9特定期間末	（2016年 3月17日）	30,721	32,253	0.9313	0.9733
第10特定期間末	（2016年 9月20日）	26,958	28,246	0.9316	0.9736
第11特定期間末	（2017年 3月17日）	22,528	23,688	0.8817	0.9237
第12特定期間末	（2017年 9月19日）	19,978	20,936	0.8795	0.9195
第13特定期間末	（2018年 3月19日）	14,823	15,419	0.8356	0.8656
第14特定期間末	（2018年 9月18日）	11,981	12,469	0.7890	0.8190
第15特定期間末	（2019年 3月18日）	10,721	10,973	0.7808	0.7988
第16特定期間末	（2019年 9月17日）	10,744	10,988	0.8017	0.8197
第17特定期間末	（2020年 3月17日）	9,515	9,749	0.7588	0.7768
第18特定期間末	（2020年 9月17日）	9,939	10,164	0.8015	0.8195
第19特定期間末	（2021年 3月17日）	8,166	8,370	0.7911	0.8091

第20特定期間末	（2021年 9月17日）	7,952	8,135	0.7923	0.8103
2020年 9月末日		9,859	—	0.7974	—
10月末日		9,812	—	0.7975	—
11月末日		9,806	—	0.8112	—
12月末日		9,810	—	0.8137	—
2021年 1月末日		8,559	—	0.8101	—
2月末日		8,280	—	0.7981	—
3月末日		8,111	—	0.7900	—
4月末日		8,140	—	0.7924	—
5月末日		8,096	—	0.7903	—
6月末日		8,059	—	0.7929	—
7月末日		7,969	—	0.7969	—
8月末日		8,000	—	0.7947	—
9月末日		7,798	—	0.7863	—

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

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）

期	年月日	純資産総額（百万円）（分配落）	純資産総額（百万円）（分配付）	1口当たり純資産額(円)（分配落）	1口当たり純資産額(円)（分配付）
第1特定期間末	（2012年 3月19日）	328	332	1.1184	1.1354
第2特定期間末	（2012年 9月18日）	725	746	1.0844	1.1204
第3特定期間末	（2013年 3月18日）	3,609	3,660	1.3526	1.3926
第4特定期間末	（2013年 9月17日）	14,387	14,731	1.3508	1.3928
第5特定期間末	（2014年 3月17日）	11,769	12,170	1.4248	1.4668
第6特定期間末	（2014年 9月17日）	8,587	8,863	1.5034	1.5454
第7特定期間末	（2015年 3月17日）	8,440	8,664	1.7162	1.7582
第8特定期間末	（2015年 9月17日）	7,633	7,837	1.6253	1.6673
第9特定期間末	（2016年 3月17日）	5,883	6,062	1.5073	1.5493
第10特定期間末	（2016年 9月20日）	4,930	5,084	1.3873	1.4293
第11特定期間末	（2017年 3月17日）	4,662	4,801	1.4965	1.5385
第12特定期間末	（2017年 9月19日）	3,957	4,077	1.5027	1.5447
第13特定期間末	（2018年 3月19日）	3,535	3,642	1.3861	1.4281
第14特定期間末	（2018年 9月18日）	3,282	3,381	1.4104	1.4524
第15特定期間末	（2019年 3月18日）	3,446	3,546	1.3987	1.4407
第16特定期間末	（2019年 9月17日）	3,841	3,961	1.3962	1.4422
第17特定期間末	（2020年 3月17日）	4,351	4,521	1.2853	1.3393
第18特定期間末	（2020年 9月17日）	4,742	4,927	1.3340	1.3880
第19特定期間末	（2021年 3月17日）	4,727	4,917	1.3490	1.4030
第20特定期間末	（2021年 9月17日）	4,879	5,076	1.3373	1.3913
2020年 9月末日		4,742	—	1.3380	—
10月末日		4,671	—	1.3217	—
11月末日		4,693	—	1.3317	—
12月末日		4,722	—	1.3278	—
2021年 1月末日		4,688	—	1.3272	—

2月末日	4,673	—	1.3286	—
3月末日	4,770	—	1.3636	—
4月末日	4,775	—	1.3468	—
5月末日	4,753	—	1.3529	—
6月末日	5,192	—	1.3603	—
7月末日	4,956	—	1.3526	—
8月末日	4,932	—	1.3492	—
9月末日	4,950	—	1.3551	—

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

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）

期	年月日	純資産総額（百万円）（分配落）	純資産総額（百万円）（分配付）	1口当たり純資産額(円)（分配落）	1口当たり純資産額(円)（分配付）
第1特定期間末	（2012年 3月19日）	8	9	1.0830	1.0995
第2特定期間末	（2012年 9月18日）	3	3	1.0453	1.0783
第3特定期間末	（2013年 3月18日）	37	38	1.2875	1.3245
第4特定期間末	（2013年 9月17日）	62	63	1.3063	1.3453
第5特定期間末	（2014年 3月17日）	104	106	1.4464	1.4854
第6特定期間末	（2014年 9月17日）	110	113	1.4208	1.4598
第7特定期間末	（2015年 3月17日）	49	51	1.3246	1.3636
第8特定期間末	（2015年 9月17日）	35	36	1.3306	1.3696
第9特定期間末	（2016年 3月17日）	32	33	1.2004	1.2394
第10特定期間末	（2016年 9月20日）	30	31	1.1001	1.1391
第11特定期間末	（2017年 3月17日）	28	29	1.1207	1.1597
第12特定期間末	（2017年 9月19日）	31	32	1.2327	1.2717
第13特定期間末	（2018年 3月19日）	34	35	1.1491	1.1881
第14特定期間末	（2018年 9月18日）	33	34	1.0897	1.1287
第15特定期間末	（2019年 3月18日）	33	34	1.0268	1.0658
第16特定期間末	（2019年 9月17日）	27	28	0.9827	1.0217
第17特定期間末	（2020年 3月17日）	24	25	0.8973	0.9363
第18特定期間末	（2020年 9月17日）	23	24	0.9778	1.0168
第19特定期間末	（2021年 3月17日）	17	18	0.9892	1.0282
第20特定期間末	（2021年 9月17日）	16	17	0.9666	1.0056
2020年 9月末日		23	—	0.9724	—
10月末日		23	—	0.9544	—
11月末日		24	—	0.9843	—
12月末日		24	—	1.0038	—
2021年 1月末日		17	—	0.9929	—
2月末日		18	—	1.0020	—
3月末日		17	—	0.9851	—
4月末日		18	—	1.0027	—
5月末日		18	—	1.0146	—
6月末日		16	—	0.9962	—
7月末日		16	—	0.9884	—

8月末日	16	—	0.9772	—
9月末日	16	—	0.9666	—

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

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）

期	年月日	純資産総額（百万円）（分配落）	純資産総額（百万円）（分配付）	1口当たり純資産額(円)（分配落）	1口当たり純資産額(円)（分配付）
第1特定期間末	（2012年 3月19日）	7,023	7,181	1.1430	1.1730
第2特定期間末	（2012年 9月18日）	11,814	12,415	1.0982	1.1612
第3特定期間末	（2013年 3月18日）	7,891	8,439	1.3366	1.4056
第4特定期間末	（2013年 9月17日）	4,706	5,020	1.1746	1.2466
第5特定期間末	（2014年 3月17日）	4,738	5,038	1.1873	1.2593
第6特定期間末	（2014年 9月17日）	4,947	5,234	1.2299	1.3019
第7特定期間末	（2015年 3月17日）	5,762	6,080	1.1690	1.2410
第8特定期間末	（2015年 9月17日）	5,845	6,210	1.0167	1.0837
第9特定期間末	（2016年 3月17日）	4,686	4,902	0.9662	1.0082
第10特定期間末	（2016年 9月20日）	4,212	4,413	0.8836	0.9256
第11特定期間末	（2017年 3月17日）	4,046	4,235	0.9647	1.0067
第12特定期間末	（2017年 9月19日）	3,445	3,604	0.9970	1.0390
第13特定期間末	（2018年 3月19日）	2,759	2,893	0.8746	0.9166
第14特定期間末	（2018年 9月18日）	2,318	2,445	0.8095	0.8515
第15特定期間末	（2019年 3月18日）	2,008	2,122	0.7732	0.8152
第16特定期間末	（2019年 9月17日）	1,889	1,997	0.7303	0.7723
第17特定期間末	（2020年 3月17日）	1,428	1,535	0.5849	0.6269
第18特定期間末	（2020年 9月17日）	1,626	1,728	0.7008	0.7428
第19特定期間末	（2021年 3月17日）	1,574	1,668	0.7349	0.7769
第20特定期間末	（2021年 9月17日）	1,352	1,439	0.6705	0.7125
2020年 9月末日		1,575	—	0.6818	—
10月末日		1,508	—	0.6606	—
11月末日		1,586	—	0.7006	—
12月末日		1,618	—	0.7167	—
2021年 1月末日		1,597	—	0.7194	—
2月末日		1,639	—	0.7454	—
3月末日		1,539	—	0.7282	—
4月末日		1,545	—	0.7327	—
5月末日		1,504	—	0.7283	—
6月末日		1,464	—	0.7118	—
7月末日		1,421	—	0.6947	—
8月末日		1,384	—	0.6805	—
9月末日		1,347	—	0.6707	—

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

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）

期	年月日	純資産総額（百万円）（分配落）	純資産総額（百万円）（分配付）	1口当たり純資産額(円)（分配落）	1口当たり純資産額(円)（分配付）
第1特定期間末	（2012年 3月19日）	12,146	12,560	1.0851	1.1286
第2特定期間末	（2012年 9月18日）	13,801	15,099	0.9184	1.0084
第3特定期間末	（2013年 3月18日）	19,436	20,870	1.1261	1.2181
第4特定期間末	（2013年 9月17日）	13,228	14,742	0.9336	1.0296
第5特定期間末	（2014年 3月17日）	12,724	14,120	0.9198	1.0158
第6特定期間末	（2014年 9月17日）	10,491	11,556	0.9585	1.0545
第7特定期間末	（2015年 3月17日）	11,512	12,748	0.7762	0.8722
第8特定期間末	（2015年 9月17日）	13,159	15,036	0.5983	0.6873
第9特定期間末	（2016年 3月17日）	9,282	10,288	0.5545	0.6085
第10特定期間末	（2016年 9月20日）	8,409	9,238	0.5726	0.6266
第11特定期間末	（2017年 3月17日）	7,467	8,205	0.6441	0.6981
第12特定期間末	（2017年 9月19日）	5,377	5,887	0.6303	0.6843
第13特定期間末	（2018年 3月19日）	4,462	4,937	0.5302	0.5842
第14特定期間末	（2018年 9月18日）	2,946	3,366	0.3931	0.4471
第15特定期間末	（2019年 3月18日）	2,915	3,178	0.4096	0.4456
第16特定期間末	（2019年 9月17日）	2,557	2,810	0.3666	0.4026
第17特定期間末	（2020年 3月17日）	1,688	1,924	0.2609	0.2969
第18特定期間末	（2020年 9月17日）	1,456	1,688	0.2314	0.2674
第19特定期間末	（2021年 3月17日）	1,210	1,433	0.1932	0.2292
第20特定期間末	（2021年 9月17日）	1,209	1,441	0.1779	0.2139
2020年 9月末日		1,383	—	0.2162	—
10月末日		1,294	—	0.2041	—
11月末日		1,392	—	0.2186	—
12月末日		1,317	—	0.2193	—
2021年 1月末日		1,236	—	0.2046	—
2月末日		1,218	—	0.1978	—
3月末日		1,148	—	0.1890	—
4月末日		1,199	—	0.1944	—
5月末日		1,260	—	0.1979	—
6月末日		1,315	—	0.2053	—
7月末日		1,285	—	0.1955	—
8月末日		1,258	—	0.1854	—
9月末日		1,198	—	0.1751	—

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

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）

期	年月日	純資産総額（百万円）（分配落）	純資産総額（百万円）（分配付）	1口当たり純資産額(円)（分配落）	1口当たり純資産額(円)（分配付）
第1計算期間末	（2013年 9月17日）	38	38	1.0204	1.0204
第2特定期間末	（2014年 3月17日）	591	613	1.0613	1.1063
第3特定期間末	（2014年 9月17日）	643	675	1.1126	1.1666

第4特定期間末	（2015年 3月17日）	654	685	1.0782	1.1322
第5特定期間末	（2015年 9月17日）	662	698	0.9404	0.9924
第6特定期間末	（2016年 3月17日）	469	496	0.7982	0.8402
第7特定期間末	（2016年 9月20日）	367	391	0.6645	0.7065
第8特定期間末	（2017年 3月17日）	480	506	0.7182	0.7602
第9特定期間末	（2017年 9月19日）	524	552	0.7788	0.8208
第10特定期間末	（2018年 3月19日）	512	543	0.6804	0.7224
第11特定期間末	（2018年 9月18日）	468	498	0.6869	0.7289
第12特定期間末	（2019年 3月18日）	418	446	0.6616	0.7036
第13特定期間末	（2019年 9月17日）	517	547	0.6529	0.6949
第14特定期間末	（2020年 3月17日）	523	562	0.5148	0.5568
第15特定期間末	（2020年 9月17日）	585	628	0.5593	0.6013
第16特定期間末	（2021年 3月17日）	584	628	0.5664	0.6084
第17特定期間末	（2021年 9月17日）	556	599	0.5728	0.6148
2020年 9月末日		555	—	0.5288	—
10月末日		575	—	0.5441	—
11月末日		617	—	0.5808	—
12月末日		622	—	0.5831	—
2021年 1月末日		590	—	0.5693	—
2月末日		578	—	0.5551	—
3月末日		592	—	0.5731	—
4月末日		597	—	0.5825	—
5月末日		601	—	0.5843	—
6月末日		601	—	0.5907	—
7月末日		588	—	0.5847	—
8月末日		576	—	0.5704	—
9月末日		542	—	0.5673	—

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

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）

期	年月日	純資産総額（百万円）（分配落）	純資産総額（百万円）（分配付）	1口当たり純資産額(円)（分配落）	1口当たり純資産額(円)（分配付）
第1計算期間末	（2013年 9月17日）	1	1	1.0138	1.0138
第2特定期間末	（2014年 3月17日）	83	88	0.9712	1.0362
第3特定期間末	（2014年 9月17日）	140	147	0.9914	1.0694
第4特定期間末	（2015年 3月17日）	140	153	0.9439	1.0219
第5特定期間末	（2015年 9月17日）	198	216	0.7787	0.8527
第6特定期間末	（2016年 3月17日）	146	158	0.7485	0.8025
第7特定期間末	（2016年 9月20日）	83	93	0.6723	0.7263
第8特定期間末	（2017年 3月17日）	101	108	0.5789	0.6329
第9特定期間末	（2017年 9月19日）	615	639	0.6033	0.6573
第10特定期間末	（2018年 3月19日）	1,080	1,191	0.4794	0.5334
第11特定期間末	（2018年 9月18日）	515	620	0.2987	0.3527
第12特定期間末	（2019年 3月18日）	1,306	1,448	0.3218	0.3758

第13特定期間末	（2019年 9月17日）	2,854	3,237	0.2920	0.3460
第14特定期間末	（2020年 3月17日）	3,715	4,495	0.2142	0.2662
第15特定期間末	（2020年 9月17日）	2,908	3,414	0.1812	0.2112
第16特定期間末	（2021年 3月17日）	2,542	2,997	0.1698	0.1998
第17特定期間末	（2021年 9月17日）	2,238	2,702	0.1384	0.1684
2020年 9月末日		2,768	—	0.1745	—
10月末日		2,442	—	0.1599	—
11月末日		2,528	—	0.1689	—
12月末日		2,643	—	0.1772	—
2021年 1月末日		2,700	—	0.1750	—
2月末日		2,760	—	0.1762	—
3月末日		2,350	—	0.1551	—
4月末日		2,349	—	0.1550	—
5月末日		2,263	—	0.1477	—
6月末日		2,233	—	0.1442	—
7月末日		2,273	—	0.1459	—
8月末日		2,375	—	0.1451	—
9月末日		2,238	—	0.1357	—

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

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）

期	年月日	純資産総額（百万円）（分配落）	純資産総額（百万円）（分配付）	1口当たり純資産額(円)(分配落)	1口当たり純資産額(円)(分配付)
第1計算期間末	（2013年 9月17日）	1	1	1.0238	1.0238
第2特定期間末	（2014年 3月17日）	26	27	0.9525	1.0075
第3特定期間末	（2014年 9月17日）	9	9	0.9577	1.0237
第4特定期間末	（2015年 3月17日）	1,079	1,108	0.6735	0.7395
第5特定期間末	（2015年 9月17日）	1,864	2,039	0.6162	0.6772
第6特定期間末	（2016年 3月17日）	1,034	1,112	0.5408	0.5768
第7特定期間末	（2016年 9月20日）	927	997	0.5363	0.5723
第8特定期間末	（2017年 3月17日）	1,869	1,951	0.6531	0.6891
第9特定期間末	（2017年 9月19日）	1,590	1,690	0.6672	0.7032
第10特定期間末	（2018年 3月19日）	1,060	1,130	0.6150	0.6510
第11特定期間末	（2018年 9月18日）	899	960	0.5231	0.5591
第12特定期間末	（2019年 3月18日）	737	793	0.5318	0.5678
第13特定期間末	（2019年 9月17日）	658	705	0.5311	0.5671
第14特定期間末	（2020年 3月17日）	488	531	0.4226	0.4586
第15特定期間末	（2020年 9月17日）	327	366	0.4201	0.4561
第16特定期間末	（2021年 3月17日）	318	346	0.4244	0.4604
第17特定期間末	（2021年 9月17日）	283	308	0.4125	0.4485
2020年 9月末日		312	—	0.3995	—
10月末日		309	—	0.3931	—
11月末日		322	—	0.4094	—
12月末日		330	—	0.4180	—

2021年 1月末日	313	—	0.4036	—
2月末日	313	—	0.4130	—
3月末日	293	—	0.4109	—
4月末日	292	—	0.4112	—
5月末日	299	—	0.4197	—
6月末日	304	—	0.4238	—
7月末日	298	—	0.4168	—
8月末日	284	—	0.4123	—
9月末日	288	—	0.4177	—

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

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）

期	年月日	純資産総額（百万円）（分配落）	純資産総額（百万円）（分配付）	1口当たり純資産額(円)（分配落）	1口当たり純資産額(円)（分配付）
第1特定期間末	（2012年 3月19日）	470	482	1.1320	1.1650
第2特定期間末	（2012年 9月18日）	693	741	1.0237	1.0927
第3特定期間末	（2013年 3月18日）	554	594	1.2197	1.2927
第4特定期間末	（2013年 9月17日）	550	590	1.0779	1.1529
第5特定期間末	（2014年 3月17日）	356	384	1.0727	1.1477
第6特定期間末	（2014年 9月17日）	206	221	1.1173	1.1923
第7特定期間末	（2015年 3月17日）	170	183	1.0382	1.1132
第8特定期間末	（2015年 9月17日）	177	192	0.8843	0.9548
第9特定期間末	（2016年 3月17日）	98	105	0.7854	0.8334
第10特定期間末	（2016年 9月20日）	80	86	0.7835	0.8315
第11特定期間末	（2017年 3月17日）	100	106	0.8959	0.9439
第12特定期間末	（2017年 9月19日）	74	79	0.8998	0.9478
第13特定期間末	（2018年 3月19日）	71	74	0.8251	0.8731
第14特定期間末	（2018年 9月18日）	44	47	0.6896	0.7376
第15特定期間末	（2019年 3月18日）	87	90	0.6932	0.7412
第16特定期間末	（2019年 9月17日）	80	86	0.6516	0.6996
第17特定期間末	（2020年 3月17日）	61	67	0.5040	0.5520
第18特定期間末	（2020年 9月17日）	33	38	0.5210	0.5690
第19特定期間末	（2021年 3月17日）	95	101	0.5173	0.5653
第20特定期間末	（2021年 9月17日）	92	101	0.4961	0.5441
2020年 9月末日		32	—	0.4989	—
10月末日		32	—	0.4879	—
11月末日		79	—	0.5212	—
12月末日		82	—	0.5323	—
2021年 1月末日		97	—	0.5162	—
2月末日		95	—	0.5205	—
3月末日		94	—	0.5136	—
4月末日		98	—	0.5258	—
5月末日		101	—	0.5363	—
6月末日		101	—	0.5345	—

7月末日	96	—	0.5186	—
8月末日	93	—	0.5045	—
9月末日	90	—	0.4893	—

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間中の分配金累計額を加算した金額です。

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンド

期	年月日	純資産総額（百万円）（分配落）	純資産総額（百万円）（分配付）	1口当たり純資産額(円)（分配落）	1口当たり純資産額(円)（分配付）
第1計算期間末	（2012年 3月19日）	17	17	1.0002	1.0002
第2計算期間末	（2012年 9月18日）	5	5	1.0006	1.0006
第3計算期間末	（2013年 3月18日）	23	23	1.0011	1.0011
第4計算期間末	（2013年 9月17日）	13	13	1.0014	1.0014
第5計算期間末	（2014年 3月17日）	11	11	1.0018	1.0018
第6計算期間末	（2014年 9月17日）	1	1	1.0021	1.0021
第7計算期間末	（2015年 3月17日）	1	1	1.0022	1.0022
第8計算期間末	（2015年 9月17日）	6	6	1.0023	1.0023
第9計算期間末	（2016年 3月17日）	1	1	1.0022	1.0022
第10計算期間末	（2016年 9月20日）	1	1	1.0022	1.0022
第11計算期間末	（2017年 3月17日）	38	38	1.0020	1.0020
第12計算期間末	（2017年 9月19日）	1	1	1.0030	1.0030
第13計算期間末	（2018年 3月19日）	1	1	1.0036	1.0036
第14計算期間末	（2018年 9月18日）	1	1	1.0032	1.0032
第15計算期間末	（2019年 3月18日）	1	1	1.0035	1.0035
第16計算期間末	（2019年 9月17日）	1	1	1.0035	1.0035
第17計算期間末	（2020年 3月17日）	1	1	1.0035	1.0035
第18計算期間末	（2020年 9月17日）	5	5	1.0036	1.0036
第19計算期間末	（2021年 3月17日）	3	3	1.0037	1.0037
第20計算期間末	（2021年 9月17日）	3	3	1.0036	1.0036
2020年 9月末日		5	—	1.0036	—
10月末日		6	—	1.0036	—
11月末日		5	—	1.0034	—
12月末日		5	—	1.0035	—
2021年 1月末日		3	—	1.0037	—
2月末日		3	—	1.0037	—
3月末日		3	—	1.0037	—
4月末日		3	—	1.0037	—
5月末日		3	—	1.0037	—
6月末日		4	—	1.0037	—
7月末日		3	—	1.0033	—
8月末日		3	—	1.0035	—
9月末日		3	—	1.0036	—

②【分配の推移】

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）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）

第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	0.0170
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	0.0360
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	0.0400
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	0.0420
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	0.0420
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	0.0420
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	0.0420
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	0.0420
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	0.0420
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	0.0420
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	0.0420
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	0.0400
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	0.0300
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	0.0300
第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	0.0180
第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	0.0180
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	0.0180
第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	0.0180
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	0.0180
第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	0.0180

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）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	0.0170
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	0.0360
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	0.0400
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	0.0420
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	0.0420
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	0.0420
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	0.0420
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	0.0420
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	0.0420
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	0.0420
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	0.0420
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	0.0420
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	0.0420
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	0.0420
第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	0.0420
第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	0.0460
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	0.0540
第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	0.0540
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	0.0540
第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	0.0540

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）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	0.0165
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	0.0330
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	0.0370
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	0.0390
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	0.0390
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	0.0390
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	0.0390
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	0.0390
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	0.0390
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	0.0390
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	0.0390
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	0.0390
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	0.0390
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	0.0390
第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	0.0390
第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	0.0390
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	0.0390
第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	0.0390
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	0.0390
第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	0.0390

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）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	0.0300
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	0.0630
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	0.0690
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	0.0720
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	0.0720
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	0.0720
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	0.0720
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	0.0670
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	0.0420
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	0.0420
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	0.0420
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	0.0420
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	0.0420
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	0.0420
第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	0.0420
第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	0.0420
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	0.0420
第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	0.0420
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	0.0420

第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	0.0420

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）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	0.0435
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	0.0900
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	0.0920
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	0.0960
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	0.0960
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	0.0960
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	0.0960
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	0.0890
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	0.0540
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	0.0540
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	0.0540
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	0.0540
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	0.0540
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	0.0540
第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	0.0360
第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	0.0360
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	0.0360
第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	0.0360
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	0.0360
第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	0.0360

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）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	2013年 9月 4日～2013年 9月17日	0.0000
第2特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	0.0450
第3特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	0.0540
第4特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	0.0540
第5特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	0.0520
第6特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	0.0420
第7特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	0.0420
第8特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	0.0420
第9特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	0.0420
第10特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	0.0420
第11特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	0.0420
第12特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	0.0420
第13特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	0.0420
第14特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	0.0420
第15特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	0.0420
第16特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	0.0420
第17特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	0.0420

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）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	2013年 9月 4日～2013年 9月17日	0.0000
第2特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	0.0650
第3特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	0.0780
第4特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	0.0780
第5特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	0.0740
第6特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	0.0540
第7特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	0.0540
第8特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	0.0540
第9特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	0.0540
第10特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	0.0540
第11特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	0.0540
第12特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	0.0540
第13特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	0.0540
第14特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	0.0520
第15特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	0.0300
第16特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	0.0300
第17特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	0.0300

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）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	2013年 9月 4日～2013年 9月17日	0.0000
第2特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	0.0550
第3特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	0.0660
第4特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	0.0660
第5特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	0.0610
第6特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	0.0360
第7特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	0.0360
第8特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	0.0360
第9特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	0.0360
第10特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	0.0360
第11特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	0.0360
第12特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	0.0360
第13特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	0.0360
第14特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	0.0360
第15特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	0.0360
第16特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	0.0360
第17特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	0.0360

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）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	0.0330
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	0.0690
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	0.0730

第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	0.0750
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	0.0750
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	0.0750
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	0.0750
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	0.0705
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	0.0480
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	0.0480
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	0.0480
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	0.0480
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	0.0480
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	0.0480
第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	0.0480
第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	0.0480
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	0.0480
第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	0.0480
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	0.0480
第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	0.0480

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンド
該当事項はありません。

③【収益率の推移】
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）

期	計算期間	収益率（%）（分配付）
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	5.6
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	6.4
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	5.6
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	△1.0
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	6.2
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	2.6
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	3.1
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	△2.3
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	0.5
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	4.5
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	△0.8
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	4.3
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	△1.6
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	△2.0
第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	1.2
第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	5.0
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	△3.1
第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	8.0
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	0.9
第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	2.4

(注)収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付）から、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落。以下、「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除した数値に100を乗じた数値です。

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）

期	計算期間	収益率（%）（分配付）
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	13.5
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	0.2
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	28.4
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	3.0
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	8.6
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	8.5
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	16.9
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	△2.8
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	△4.7
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	△5.2
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	10.9
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	3.2
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	△5.0
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	4.8
第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	2.1
第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	3.1
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	△4.1
第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	8.0
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	5.2
第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	3.1

(注)収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付）から、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落。以下、「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除した数値に100を乗じた数値です。

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）

期	計算期間	収益率（%）（分配付）
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	10.0
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	△0.4
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	26.7
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	4.5
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	13.7
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	0.9
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	△4.0
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	3.4
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	△6.9
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	△5.1
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	5.4
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	13.5
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	△3.6
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	△1.8

第15特定期間	**2018年 9月19日～2019年 3月18日**	**△2.2**
第16特定期間	**2019年 3月19日～2019年 9月17日**	**△0.5**
第17特定期間	**2019年 9月18日～2020年 3月17日**	**△4.7**
第18特定期間	**2020年 3月18日～2020年 9月17日**	**13.3**
第19特定期間	**2020年 9月18日～2021年 3月17日**	**5.2**
第20特定期間	**2021年 3月18日～2021年 9月17日**	**1.7**

(注)収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付）から、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落。以下、「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除した数値に100を乗じた数値です。

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）

期	計算期間	収益率（%）（分配付）
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	17.3
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	1.6
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	28.0
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	△6.7
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	7.2
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	9.7
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	0.9
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	△7.3
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	△0.8
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	△4.2
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	13.9
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	7.7
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	△8.1
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	△2.6
第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	0.7
第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	△0.1
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	△14.2
第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	27.0
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	10.9
第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	△3.0

(注)収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付）から、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落。以下、「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除した数値に100を乗じた数値です。

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）

期	計算期間	収益率（%）（分配付）
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	12.9
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	△7.1
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	32.6
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	△8.6
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	8.8
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	14.6
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	△9.0
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	△11.5
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	1.7
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	13.0
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	21.9
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	6.2
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	△7.3
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	△15.7
第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	13.4
第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	△1.7
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	△19.0

第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	2.5
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	△1.0
第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	10.7

(注)収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付）から、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落。以下、「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除した数値に100を乗じた数値です。

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）

期	計算期間	収益率（%）（分配付）
第1計算期間	2013年 9月 4日～2013年 9月17日	2.0
第2特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	8.4
第3特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	9.9
第4特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	1.8
第5特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	△8.0
第6特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	△10.7
第7特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	△11.5
第8特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	14.4
第9特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	14.3
第10特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	△7.2
第11特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	7.1
第12特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	2.4
第13特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	5.0
第14特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	△14.7
第15特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	16.8
第16特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	8.8
第17特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	8.5

(注)収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付）から、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落。以下、「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除した数値に100を乗じた数値です。

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）

期	計算期間	収益率（%）（分配付）
第1計算期間	2013年 9月 4日～2013年 9月17日	1.4
第2特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	2.2
第3特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	10.1
第4特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	3.1
第5特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	△9.7
第6特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	3.1
第7特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	△3.0
第8特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	△5.9
第9特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	13.5
第10特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	△11.6
第11特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	△26.4
第12特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	25.8
第13特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	7.5
第14特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	△8.8

第15特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	△1.4
第16特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	10.3
第17特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	△0.8

(注)収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付）から、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落。以下、「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除した数値に100を乗じた数値です。

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）

期	計算期間	収益率（%）（分配付）
第1計算期間	2013年 9月 4日～2013年 9月17日	2.4
第2特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	△1.6
第3特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	7.5
第4特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	△22.8
第5特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	0.5
第6特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	△6.4
第7特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	5.8
第8特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	28.5
第9特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	7.7
第10特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	△2.4
第11特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	△9.1
第12特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	8.5
第13特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	6.6
第14特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	△13.7
第15特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	7.9
第16特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	9.6
第17特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	5.7

(注)収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付）から、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落。以下、「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除した数値に100を乗じた数値です。

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）

期	計算期間	収益率（%）（分配付）
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	16.5
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	△3.5
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	26.3
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	△5.5
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	6.5
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	11.1
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	△0.4
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	△8.0
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	△5.8
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	5.9
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	20.5
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	5.8
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	△3.0
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	△10.6
第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	7.5
第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	0.9
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	△15.3
第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	12.9
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	8.5
第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	5.2

(注)収益率とは、特定期間末の基準価額（分配付）から、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落。以下、「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除した数値に100を乗じた数値です。

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンド

期	計算期間	収益率（%）（分配付）
第1計算期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	0.0
第2計算期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	0.0
第3計算期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	0.0
第4計算期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	0.0
第5計算期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	0.0
第6計算期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	0.0
第7計算期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	0.0
第8計算期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	0.0
第9計算期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	△0.0
第10計算期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	0.0
第11計算期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	△0.0
第12計算期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	0.1
第13計算期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	0.1
第14計算期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	△0.0
第15計算期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	0.0
第16計算期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	0.0
第17計算期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	0.0

第18計算期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	0.0
第19計算期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	0.0
第20計算期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	△0.0

(4)【設定及び解約の実績】

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）

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	12,064,874,346	741,039,462	11,323,834,884
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	13,791,970,874	8,030,551,496	17,085,254,262
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	47,718,012,229	11,078,977,029	53,724,289,462
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	29,509,984,787	12,780,832,111	70,453,442,138
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	9,270,261,397	22,501,805,787	57,221,897,748
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	10,072,696,891	18,455,407,344	48,839,187,295
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	9,247,626,060	14,759,918,513	43,326,894,842
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	7,045,671,766	10,730,071,198	39,642,495,410
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	2,637,185,518	9,291,190,358	32,988,490,570
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	3,979,507,481	8,028,849,170	28,939,148,881
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	2,801,406,793	6,189,607,673	25,550,948,001
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	1,530,662,825	4,364,796,412	22,716,814,414
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	877,468,612	5,853,852,698	17,740,430,328
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	324,021,473	2,879,379,927	15,185,071,874
第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	432,091,858	1,886,466,897	13,730,696,835
第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	424,574,232	753,690,579	13,401,580,488
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	426,816,650	1,288,857,648	12,539,539,490
第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	298,375,261	436,588,150	12,401,326,601
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	135,872,701	2,213,534,022	10,323,665,280
第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	253,648,986	539,306,313	10,038,007,953

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）

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	294,170,870	―	294,170,870
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	511,180,795	136,178,341	669,173,324
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	2,552,428,080	553,046,045	2,668,555,359
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	9,258,046,551	1,275,455,844	10,651,146,066
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	2,437,673,165	4,827,916,375	8,260,902,856
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	892,521,979	3,441,557,871	5,711,866,964
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	1,517,713,271	2,311,296,587	4,918,283,648
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	1,221,244,638	1,442,819,966	4,696,708,320
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	326,492,646	1,119,643,817	3,903,557,149
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	202,184,093	551,501,652	3,554,239,590
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	206,921,431	645,382,684	3,115,778,337
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	81,980,568	564,228,472	2,633,530,433
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	224,856,696	307,567,941	2,550,819,188
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	105,868,329	329,572,189	2,327,115,328
第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	254,630,914	117,440,881	2,464,305,361

第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	352,445,530	65,511,237	2,751,239,654
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	715,940,441	81,678,900	3,385,501,195
第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	432,609,645	263,214,994	3,554,895,846
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	163,509,524	214,205,260	3,504,200,110
第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	465,541,581	321,312,934	3,648,428,757

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）

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	31,859,194	23,751,821	8,107,373
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	2,560,256	7,270,966	3,396,663
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	26,007,191	10,098	29,393,756
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	21,453,047	3,089,684	47,757,119
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	55,256,762	30,501,205	72,512,676
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	10,731,767	5,728,426	77,516,017
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	10,344,171	50,461,789	37,398,399
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	5,490,242	16,288,914	26,599,727
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	485,871	176,754	26,908,844
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	586,052	63,794	27,431,102
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	594,864	2,678,306	25,347,660
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	503,707	―	25,851,367
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	5,397,867	1,212,129	30,037,105
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	721,427	230,348	30,528,184
第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	3,204,158	1,250,799	32,481,543
第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	839,481	5,745,528	27,575,496
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	887,712	1,500,000	26,963,208
第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	989,041	3,771,587	24,180,662
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	619,235	6,722,687	18,077,210
第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	392,926	1,446,289	17,023,847

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）

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	7,209,508,931	1,065,086,570	6,144,422,361
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	8,528,037,339	3,914,072,908	10,758,386,792
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	3,888,913,096	8,743,208,061	5,904,091,827
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	1,889,309,952	3,786,757,791	4,006,643,988
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	1,890,660,519	1,906,643,121	3,990,661,386
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	1,195,833,391	1,163,714,499	4,022,780,278
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	2,049,804,381	1,142,929,752	4,929,654,907
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	1,867,744,025	1,048,049,558	5,749,349,374
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	228,136,773	1,127,451,810	4,850,034,337
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	571,525,438	653,914,986	4,767,644,789
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	303,348,640	876,272,967	4,194,720,462
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	98,057,272	837,427,353	3,455,350,381
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	160,280,504	460,906,369	3,154,724,516
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	23,341,807	314,034,053	2,864,032,270

第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	61,143,986	327,793,696	2,597,382,560
第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	85,422,016	95,823,270	2,586,981,306
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	67,070,935	211,436,870	2,442,615,371
第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	36,924,949	158,317,002	2,321,223,318
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	20,362,583	198,790,520	2,142,795,381
第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	21,517,815	146,512,148	2,017,801,048

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）

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	13,211,487,207	2,016,925,855	11,194,561,352
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	9,650,320,813	5,817,327,714	15,027,554,451
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	13,957,210,115	11,724,998,622	17,259,765,944
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	6,635,985,408	9,725,290,949	14,170,460,403
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	5,066,229,150	5,401,992,482	13,834,697,071
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	4,669,463,145	7,558,078,141	10,946,082,075
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	7,779,396,233	3,893,928,760	14,831,549,548
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	11,349,232,004	4,186,596,229	21,994,185,323
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	1,133,261,149	6,385,724,643	16,741,721,829
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	2,046,784,083	4,102,483,720	14,686,022,192
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	2,220,728,209	5,313,926,186	11,592,824,215
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	710,652,552	3,771,362,761	8,532,114,006
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	1,255,342,861	1,369,470,416	8,417,986,451
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	294,243,300	1,214,807,546	7,497,422,205
第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	211,033,713	591,647,757	7,116,808,161
第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	192,730,329	333,628,672	6,975,909,818
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	289,321,796	794,846,221	6,470,385,393
第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	296,613,428	471,545,720	6,295,453,101
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	765,188,819	798,367,752	6,262,274,168
第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	1,397,075,570	863,870,225	6,795,479,513

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）

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2013年 9月 4日～2013年 9月17日	37,480,054	―	37,480,054
第2特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	688,567,474	168,700,144	557,347,384
第3特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	147,315,965	126,569,118	578,094,231
第4特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	331,157,012	302,208,862	607,042,381
第5特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	187,864,866	90,707,043	704,200,204
第6特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	11,897,982	127,614,185	588,484,001
第7特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	4,283,294	39,884,180	552,883,115
第8特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	207,132,995	90,638,977	669,377,133
第9特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	169,366,010	164,839,443	673,903,700
第10特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	152,143,581	72,954,982	753,092,299
第11特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	18,337,842	89,180,189	682,249,952
第12特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	11,728,397	61,050,070	632,928,279
第13特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	205,927,284	46,408,142	792,447,421

第14特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	254,266,627	29,428,204	1,017,285,844
第15特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	48,744,149	19,317,719	1,046,712,274
第16特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	36,106,711	50,587,664	1,032,231,321
第17特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	25,262,336	85,650,374	971,843,283

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）

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2013年 9月 4日～2013年 9月17日	1,000,000	―	1,000,000
第2特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	85,221,195	107,364	86,113,831
第3特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	122,206,839	66,581,464	141,739,206
第4特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	96,939,503	89,352,506	149,326,203
第5特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	113,152,521	7,832,495	254,646,229
第6特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	1,797,007	60,140,893	196,302,343
第7特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	15,853,336	87,402,520	124,753,159
第8特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	81,555,101	30,448,716	175,859,544
第9特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	1,084,518,350	240,678,430	1,019,699,464
第10特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	1,544,661,652	310,538,886	2,253,822,230
第11特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	99,084,014	626,984,107	1,725,922,137
第12特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	2,677,649,405	344,819,424	4,058,752,118
第13特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	6,130,734,137	414,649,647	9,774,836,608
第14特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	8,535,271,461	960,690,696	17,349,417,373
第15特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	1,709,968,517	3,009,212,020	16,050,173,870
第16特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	1,963,246,583	3,038,456,977	14,974,963,476
第17特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	3,328,310,088	2,134,595,873	16,168,677,691

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）

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2013年 9月 4日～2013年 9月17日	1,048,821	―	1,048,821
第2特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	27,277,546	605,444	27,720,923
第3特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	1,235,759	19,262,802	9,693,880
第4特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	1,595,853,741	2,749,130	1,602,798,491
第5特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	2,252,009,317	829,449,601	3,025,358,207
第6特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	232,240,417	1,345,126,777	1,912,471,847
第7特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	324,135,127	507,983,791	1,728,623,183
第8特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	2,142,255,416	1,008,526,744	2,862,351,855
第9特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	580,277,374	1,058,229,297	2,384,399,932
第10特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	124,657,305	784,258,718	1,724,798,519
第11特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	316,449,713	321,481,396	1,719,766,836
第12特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	51,298,250	384,875,810	1,386,189,276
第13特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	63,223,235	209,636,333	1,239,776,178
第14特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	40,171,004	123,760,201	1,156,186,981
第15特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	30,345,058	407,103,237	779,428,802
第16特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	30,546,633	60,066,790	749,908,645
第17特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	31,341,321	94,182,947	687,067,019

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）

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1特定期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	497,140,600	81,276,360	415,864,240
第2特定期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	471,508,987	210,364,453	677,008,774
第3特定期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	386,582,166	608,629,773	454,961,167
第4特定期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	214,620,187	158,580,539	511,000,815
第5特定期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	23,436,193	201,785,227	332,651,781
第6特定期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	29,829,078	177,993,896	184,486,963
第7特定期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	25,144,358	45,004,919	164,626,402
第8特定期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	88,763,152	52,451,788	200,937,766
第9特定期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	2,117,845	77,199,350	125,856,261
第10特定期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	1,347,489	24,048,337	103,155,413
第11特定期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	12,604,528	3,117,777	112,642,164
第12特定期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	1,441,944	30,966,057	83,118,051
第13特定期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	7,765,426	4,826,957	86,056,520
第14特定期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	2,531,244	24,684,466	63,903,298
第15特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	62,648,690	710,865	125,841,123
第16特定期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	5,788,945	8,463,599	123,166,469
第17特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	2,355,569	3,205,992	122,316,046
第18特定期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	2,446,784	60,618,055	64,144,775
第19特定期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	126,455,368	6,401,892	184,198,251
第20特定期間	2021年 3月18日～2021年 9月17日	9,061,462	5,917,693	187,342,020

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンド

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2011年11月 8日～2012年 3月19日	17,853,916	—	17,853,916
第2計算期間	2012年 3月20日～2012年 9月18日	60,364,269	72,343,681	5,874,504
第3計算期間	2012年 9月19日～2013年 3月18日	20,710,827	2,914,500	23,670,831
第4計算期間	2013年 3月19日～2013年 9月17日	82,058,970	92,168,189	13,561,612
第5計算期間	2013年 9月18日～2014年 3月17日	5,755,454	8,201,722	11,115,344
第6計算期間	2014年 3月18日～2014年 9月17日	49,516	10,114,829	1,050,031
第7計算期間	2014年 9月18日～2015年 3月17日	849,771	49,516	1,850,286
第8計算期間	2015年 3月18日～2015年 9月17日	5,200,799	849,771	6,201,314
第9計算期間	2015年 9月18日～2016年 3月17日	4,343,169	9,066,892	1,477,591
第10計算期間	2016年 3月18日～2016年 9月20日	—	—	1,477,591
第11計算期間	2016年 9月21日～2017年 3月17日	52,288,847	15,447,153	38,319,285
第12計算期間	2017年 3月18日～2017年 9月19日	15,450,049	52,302,858	1,466,476
第13計算期間	2017年 9月20日～2018年 3月19日	—	—	1,466,476
第14計算期間	2018年 3月20日～2018年 9月18日	—	—	1,466,476
第15計算期間	2018年 9月19日～2019年 3月18日	9,803	—	1,476,279
第16計算期間	2019年 3月19日～2019年 9月17日	240,374	250,177	1,466,476
第17計算期間	2019年 9月18日～2020年 3月17日	1,729,399	1,515,409	1,680,466
第18計算期間	2020年 3月18日～2020年 9月17日	19,950,149	16,620,359	5,010,256
第19計算期間	2020年 9月18日～2021年 3月17日	4,497,459	5,693,154	3,814,561

第20計算期間	**2021年 3月18日～2021年 9月17日**	**81,226,809**	**81,751,986**	**3,289,384**

＜参考情報＞

基準日：2021年9月30日

基準価額・純資産の推移

円コース（毎月分配型）

※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2011年11月8日です。

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金	決算期	分配金
2020/10	30円	2021/05	30円
2020/11	30円	2021/06	30円
2020/12	30円	2021/07	30円
2021/01	30円	2021/08	30円
2021/02	30円	2021/09	30円
2021/03	30円	設定来累計	6,370円
2021/04	30円		

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

米ドルコース（毎月分配型）

※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2011年11月8日です。

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金	決算期	分配金
2020/10	90円	2021/05	90円
2020/11	90円	2021/06	90円
2020/12	90円	2021/07	90円
2021/01	90円	2021/08	90円
2021/02	90円	2021/09	90円
2021/03	90円	設定来累計	8,590円
2021/04	90円		

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

次ページへ続く

・「マネープール・ファンド」を除く各コースの最新の運用実績は、委託会社のホームページでご確認いただけます。
・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

基準日：2021年9月30日

ユーロコース（毎月分配型）

※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2011年11月8日です。

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金	決算期	分配金
2020/10	65円	2021/05	65円
2020/11	65円	2021/06	65円
2020/12	65円	2021/07	65円
2021/01	65円	2021/08	65円
2021/02	65円	2021/09	65円
2021/03	65円	設定来累計	7,495円
2021/04	65円		

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

豪ドルコース（毎月分配型）

※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2011年11月8日です。

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金	決算期	分配金
2020/10	70円	2021/05	70円
2020/11	70円	2021/06	70円
2020/12	70円	2021/07	70円
2021/01	70円	2021/08	70円
2021/02	70円	2021/09	70円
2021/03	70円	設定来累計	10,210円
2021/04	70円		

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

ブラジル・レアルコース（毎月分配型）

※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2011年11月8日です。

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金	決算期	分配金
2020/10	60円	2021/05	60円
2020/11	60円	2021/06	60円
2020/12	60円	2021/07	60円
2021/01	60円	2021/08	60円
2021/02	60円	2021/09	60円
2021/03	60円	設定来累計	12,385円
2021/04	60円		

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

次ページへ続く

・「マネープール・ファンド」を除く各コースの最新の運用実績は、委託会社のホームページでご確認いただけます。
・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

基準日:2021年9月30日

メキシコ・ペソコース（毎月分配型）

※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2013年9月4日です。

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金	決算期	分配金
2020/10	70円	2021/05	70円
2020/11	70円	2021/06	70円
2020/12	70円	2021/07	70円
2021/01	70円	2021/08	70円
2021/02	70円	2021/09	70円
2021/03	70円	設定来累計	7,090円
2021/04	70円		

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

トルコ・リラコース（毎月分配型）

※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2013年9月4日です。

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金	決算期	分配金
2020/10	50円	2021/05	50円
2020/11	50円	2021/06	50円
2020/12	50円	2021/07	50円
2021/01	50円	2021/08	50円
2021/02	50円	2021/09	50円
2021/03	50円	設定来累計	8,690円
2021/04	50円		

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

ロシア・ルーブルコース（毎月分配型）

※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2013年9月4日です。

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金	決算期	分配金
2020/10	60円	2021/05	60円
2020/11	60円	2021/06	60円
2020/12	60円	2021/07	60円
2021/01	60円	2021/08	60円
2021/02	60円	2021/09	60円
2021/03	60円	設定来累計	6,800円
2021/04	60円		

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

次ページへ続く

・「マネープール・ファンド」を除く各コースの最新の運用実績は、委託会社のホームページでご確認いただけます。
・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

基準日:2021年9月30日

資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）

※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2011年11月8日です。

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金	決算期	分配金
2020/10	80円	2021/05	80円
2020/11	80円	2021/06	80円
2020/12	80円	2021/07	80円
2021/01	80円	2021/08	80円
2021/02	80円	2021/09	80円
2021/03	80円	設定来累計	11,215円
2021/04	80円		

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

マネープール・ファンド

※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2011年11月8日です。

(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第16期	2019/09/17	0円
第17期	2020/03/17	0円
第18期	2020/09/17	0円
第19期	2021/03/17	0円
第20期	2021/09/17	0円
設定来累計		分配実績なし

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

次ページへ続く

・「マネープール・ファンド」を除く各コースの最新の運用実績は、委託会社のホームページでご確認いただけます。
・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

基準日：2021年9月30日

主要な資産の状況

資産構成

円コース（毎月分配型）

資産	比率
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（日本円クラス）	99.4%
東京海上マネーマザーファンド	0.0%
短期金融資産等	0.6%
合計	100.0%

メキシコ・ペソコース（毎月分配型）

資産	比率
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（メキシコ・ペソクラス）	98.8%
東京海上マネーマザーファンド	0.0%
短期金融資産等	1.2%
合計	100.0%

米ドルコース（毎月分配型）

資産	比率
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（米ドルクラス）	99.0%
東京海上マネーマザーファンド	0.0%
短期金融資産等	1.0%
合計	100.0%

トルコ・リラコース（毎月分配型）

資産	比率
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（トルコ・リラクラス）	98.5%
東京海上マネーマザーファンド	0.0%
短期金融資産等	1.5%
合計	100.0%

ユーロコース（毎月分配型）

資産	比率
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）	97.7%
東京海上マネーマザーファンド	0.1%
短期金融資産等	2.3%
合計	100.0%

ロシア・ルーブルコース（毎月分配型）

資産	比率
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（ロシア・ルーブルクラス）	98.7%
東京海上マネーマザーファンド	0.0%
短期金融資産等	1.2%
合計	100.0%

豪ドルコース（毎月分配型）

資産	比率
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（豪ドルクラス）	99.0%
東京海上マネーマザーファンド	0.1%
短期金融資産等	1.0%
合計	100.0%

資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）

資産	比率
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（資源国通貨バスケットクラス）	99.2%
東京海上マネーマザーファンド	0.0%
短期金融資産等	0.8%
合計	100.0%

ブラジル・レアルコース（毎月分配型）

資産	比率
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（ブラジル・レアルクラス）	98.4%
東京海上マネーマザーファンド	0.1%
短期金融資産等	1.5%
合計	100.0%

マネープール・ファンド

資産	比率
債券	68.7%
短期金融資産等	31.3%
合計	100.0%

注記事項

各コース

※比率は、純資産総額に占める割合です。
※短期金融資産等は、組入有価証券以外のものです。追加設定の影響等により、マイナスになる場合があります。

マネープール・ファンド

※ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行っており、マザーファンドの資産の状況を記載しています。
※比率は、純資産総額に占める割合です。
※短期金融資産等は、組入有価証券以外のものです。

次ページへ続く

・「マネープール・ファンド」を除く各コースの最新の運用実績は、委託会社のホームページでご確認いただけます。
・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

基準日:2021年9月30日

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・ファンドの資産状況

※基準価額算定の基準で記載しています。

証券種別構成

証券種類	比率
期限付劣後債	62.7%
永久劣後債	13.0%
優先出資証券	5.9%
その他	18.4%

ハイブリッド証券等の属性情報

残存期間	7.42年
修正デュレーション	6.07
クーポン	3.42%
最終利回り（複利）	1.90%
平均格付	BBB+

組入上位10カ国

	国	比率
1	イギリス	18.9%
2	アメリカ	14.9%
3	フランス	12.8%
4	日本	7.3%
5	オランダ	6.1%
6	オーストラリア	4.8%
7	スペイン	4.6%
8	オーストリア	4.5%
9	ドイツ	4.0%
10	中国	3.5%

格付別構成

格付	比率
AAA格	－
AA格	1.4%
A格	37.9%
BBB格	60.7%
BB格以下	－
無格付	－

※＋・－等の符号は省略して表示しています。

通貨別構成

通貨	比率
米ドル	46.0%
ユーロ	41.7%
英ポンド	12.3%

組入上位10銘柄

組入銘柄数：133銘柄

	銘柄	証券種類	クーポン	償還日	国	格付	比率
1	DAI-ICHI LIFE INSURANCE	永久劣後債	5.100%	2024/10/28	日本	A－	2.3%
2	AXA SA	永久劣後債	5.453%	2026/03/04	フランス	BBB＋	2.2%
3	GOLDMAN SACHS CAPITAL I	優先出資証券	6.345%	2034/02/15	アメリカ	BBB－	2.2%
4	BPCE SA	期限付劣後債	4.500%	2025/03/15	フランス	A－	2.0%
5	STANDARD CHARTERED PLC	期限付劣後債	4.300%	2027/02/19	イギリス	BBB＋	1.9%
6	BANCO SANTANDER MEXICO	その他	5.375%	2025/04/17	スペイン	BBB＋	1.6%
7	UNICREDIT SPA	期限付劣後債	2.000%	2024/09/23	イタリア	BBB－	1.6%
8	CHINA CONSTRUCTION BANK	優先出資証券	2.450%	2025/06/24	中国	BBB＋	1.6%
9	AUST & NZ BANKING GROUP	期限付劣後債	0.669%	2026/05/05	オーストラリア	A－	1.6%
10	BAWAG GROUP AG	期限付劣後債	2.375%	2024/03/26	オーストリア	BBB	1.4%

※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。
※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。
※「組入上位10銘柄」の償還日は、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（一部銘柄を除く）。
※「ハイブリッド証券等の属性情報」は、保有する各ハイブリッド証券等の数値を加重平均した数値です。保有するハイブリッド証券等の時価評価額を基に計算しています。残存期間、修正デュレーション、最終利回りは、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使用して計算しています（一部銘柄を除く）。平均格付は、格付毎に点数化し、加重平均した結果を四捨五入して表示しており、ファンドの格付ではありません。また、保有するハイブリッド証券等のうち、格付が取得できない場合は、除外して計算しています。
(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。

東京海上マネーマザーファンドの資産状況

組入上位10銘柄

組入銘柄数：2銘柄

	銘柄	クーポン	償還日	比率
1	第13回せたがや区民債	0.100%	2021/10/26	43.0%
2	第14回なごやか市民債	0.080%	2021/10/29	25.8%
3				
4				
5				

※比率は、純資産総額に占める割合です。

次ページへ続く

・「マネープール・ファンド」を除く各コースの最新の運用実績は、委託会社のホームページでご確認いただけます。
・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

基準日：2021年9月30日

年間収益率の推移

円コース（毎月分配型）

米ドルコース（毎月分配型）

ユーロコース（毎月分配型）

豪ドルコース（毎月分配型）

ブラジル・レアルコース（毎月分配型）

※後述の注記事項をご参照ください。

次ページへ続く

・「マネープール・ファンド」を除く各コースの最新の運用実績は、委託会社のホームページでご確認いただけます。
・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

基準日:2021年9月30日

メキシコ・ペソコース（毎月分配型）

トルコ・リラコース（毎月分配型）

ロシア・ルーブルコース（毎月分配型）

資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）

マネープール・ファンド

注記事項

※ファンドにはベンチマークがありません。
※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しており、設定日以降を表示しています。
※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

・「マネープール・ファンド」を除く各コースの最新の運用実績は、委託会社のホームページでご確認いただけます。
・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

a.毎営業日にお申込みを受け付けます。ただし、各コースのお申込み日が以下の日のいずれかに該当する場合には、取得（スイッチングを含みます。）のお申込みの受付を行いません。
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日
・ロンドンの銀行の休業日
・ルクセンブルグの銀行の休業日

b.申込方法には、収益分配金の受取方法によって、以下の２種類のコースがあります。

分配金受取りコース	分配金を受け取るコースです。
分配金再投資コース	分配金が税引き後、自動的に無手数料で再投資されるコースです。

c.販売会社やお申込みのコース等によって申込単位は異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。なお、分配金再投資コースにおける収益分配金の再投資に際しては、１口単位で取得することができます。

d.各コース間および各コースと「マネープール・ファンド」間でスイッチングが可能です。
※販売会社によっては、一部のファンドのみの取扱いとなる場合やスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

e.取得申込の受付は、原則として午後３時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みについては翌営業日受付の取扱いとなります。

f.受益権の取得申込価額は以下の通りです。
取得申込受付日の翌営業日の基準価額
基準価額は原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクに問い合わせることにより知ることができます。
●委託会社のお問い合わせ先（委託会社サービスデスク）
東京海上アセットマネジメント　サービスデスク
０１２０－７１２－０１６（土日祝日・年末年始を除く９時～17時）

g.申込手数料は、発行価格に3.3%（税抜３%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。ただし、「マネープール・ファンド」へのスイッチングの場合は無手数料とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

h.上記にかかわらず、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置を取った場合には、販売会社は、受益権の取得申込の受付を中止すること、および既に受け付けた取得申込の受付を取り消すことができます。

i.取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関等への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関等への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関等の定める方法により、振替機関等へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

j.定時定額購入サービスを選択した取得申込者は、販売会社との間で定時定額購入サービスに関する取り決めを行います。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

a.受益者は、自己に帰属する受益権につき、一部解約の実行請求（解約請求）の方法によりご換金の請求を行うことができます。
b.ご換金のお申込みは販売会社で受け付けます。なお、販売会社の買取りによるご換金の請求については、販売会社にお問い合わせください。
c.解約請求による換金のお申込みは、毎営業日に行うことができます。ただし、各コースの解約請求日が以下の日のいずれかに該当する場合には、お申込みの受付を行いません。
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日
・ロンドンの銀行の休業日
・ルクセンブルグの銀行の休業日
※「マネープール・ファンド」の換金については、毎営業日に行うことができます。
d.解約単位は、販売会社やお申込みのコース等によって異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
e.解約請求のお申込みの受付は、原則として午後３時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みは翌営業日受付としてお取扱いします。
f.解約時の価額（解約価額）は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
※信託財産留保額はありません。
g.解約価額は、原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクに問い合わせることにより知ることができます。
h.解約にかかる手数料はありません。
i.解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して６営業日目から、お支払いします。
j.委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよび既に受付けた一部解約の実行の請求の受付を取消すことができます。解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日を解約請求受付日とする解約請求を撤回できます。ただし受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にその請求を受け付けたものとして取扱います。
k.信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口解約には制限を設ける場合があります。
l.受益者が解約の請求をするときは、振替受益権をもって行うものとし、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請が行われ、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

a.基準価額とは、受益権１口当たりの純資産価額（純資産総額を計算日における受益権総口数で除した金額）をいいます。ただし、便宜上１万口当たりに換算した価額で表示されることがあります。

b.純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、外国為替予約に基づく予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

＜主要投資対象資産の評価方法＞

対象	評価方法
投資信託証券	原則として、当ファンドの基準価額計算日に知りうる直近の日における当該投資信託証券の基準価額で評価します。
マザーファンド受益証券	原則として、当ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

c.基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクに問い合わせることにより知ることができます。

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

各コース（メキシコ・ペソコース、トルコ・リラコース、ロシア・ルーブルコースを除く）およびマネープール・ファンド

原則として、2011年11月８日から2026年９月17日までとします。

メキシコ・ペソコース、トルコ・リラコース、ロシア・ルーブルコース

原則として、2013年９月４日から2026年９月17日までとします。

ただし、後記「(5)その他 ①信託の終了（繰上償還）」に該当する場合には、信託を終了させることがあります。

※各コースが主要投資対象とする外国投資信託受益証券が存続しないこととなる場合には、信託を終了させます。

(4)【計算期間】

●各コース

原則として、毎月18日から翌月17日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日（※）を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。

●マネープール・ファンド

原則として、毎年３月18日から９月17日まで、９月18日から翌年３月17日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日（※）を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。

（※）法令により、これと異なる日を計算期間の末日と定めている場合には、法令にしたがいます。

(5)【その他】

①信託の終了（繰上償還）

a.委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより各コースの受益権の総口数が10億口を下ることとなったとき、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

b.委託会社は、各コースが主要投資対象とする外国投資信託受益証券が存続しないこととなる場合には、信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

c.委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

d.上記c.の書面決議において、受益者（委託会社および信託の信託財産に信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下d.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

e.上記c.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

f.上記c.からe.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときおよび上記b.の規定に基づいて信託契約を解約する場合には適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記c.からe.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

g.委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。

h.上記g.の規定にかかわらず、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、信託は、「②信託約款の変更」b.の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

i.受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、「②信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

j.委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

②信託約款の変更

a.委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第２号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、信託約款は「②信託約款の変更」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

b.委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

c.上記b.の書面決議において、受益者（委託会社および信託の信託財産に信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下c.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

d.上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

e.書面決議の効力は、信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

f.上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

g.上記a.からf.までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

③関係会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間の募集・販売等の取扱いに関する契約は、当事者の別段の意思表示がない限り、１年ごとに自動更新されます。募集・販売等の取扱いに関する契約は、当事者間の合意により変更することができます。

④運用報告書

●各コース

a.３月および９月の決算時および償還時に、委託会社が、期間中の運用経過のほか、信託財産の内容などを記載した交付運用報告書を作成します。交付運用報告書は、知れている受益者に対して、販売会社から、あらかじめお申し出いただいたご住所にお届けします。

b.委託会社は、運用報告書（全体版）を作成し、委託会社のホームページ（https://www.tokiomarineam.co.jp/）に掲載します。

c.上記b.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合は、交付します。

●マネープール・ファンド

a.毎決算時および償還時に、委託会社が、期間中の運用経過のほか、信託財産の内容などを記載した交付運用報告書を作成します。交付運用報告書は、知れている受益者に対して、販売会社から、あらかじめお申し出いただいたご住所にお届けします。

b.委託会社は、運用報告書（全体版）を作成し、委託会社のホームページ（https://www.tokiomarineam.co.jp/）に掲載します。

c.上記b.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合は、交付します。

⑤公告

委託会社が受益者に対してする公告は、原則として電子公告の方法により行い、委託会社のホームページ（https://www.tokiomarineam.co.jp/）に掲載します。

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

４【受益者の権利等】

当ファンドの受益者の有する主な権利は以下の通りです。なお、議決権、受益者集会に関する権利は有しません。

a.収益分配金の請求権

収益分配金は、毎計算期間終了後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して５営業日まで）から、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、お支払いします。ただし、受益者が収益分配金について、上記に規定する支払開始日から５年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社より交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。なお、分配金再投資コースの収益分配金は、税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

b.償還金の請求権

償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合には当該償還日の翌営業日）から起算して５営業日まで）から、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）にお支払いします。ただし、受益者が償還金について、上記に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社より交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

c.換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行請求の方法により、換金を請求することができます。詳細は上記「２ 換金（解約）手続等」をご参照ください。

d.買取請求権

一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第１項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

第３【ファンドの経理状況】

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）
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）
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）
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）
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）
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）
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）
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）
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）

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は、6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、当特定期間(2021年3月18日から2021年9月17日まで)の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンド

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は、6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、第20期計算期間（2021年3月18日から2021年9月17日日まで）の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】
【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）】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	92,095,480	101,176,847
投資信託受益証券	8,081,715,237	7,906,681,806
親投資信託受益証券	1,002,975	1,002,875
未収入金	50,000,000	－
流動資産合計	8,224,813,692	8,008,861,528
資産合計	8,224,813,692	8,008,861,528
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	30,970,995	30,114,023
未払解約金	20,514,132	18,964,351
未払受託者報酬	160,917	171,642
未払委託者報酬	6,296,643	6,716,325
未払利息	63	105
その他未払費用	50,614	55,893
流動負債合計	57,993,364	56,022,339
負債合計	57,993,364	56,022,339
純資産の部		
元本等		
元本	※1 10,323,665,280	※1 10,038,007,953
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △2,156,844,952	※2 △2,085,168,764
（分配準備積立金）	126,414,276	123,126,232
元本等合計	8,166,820,328	7,952,839,189
純資産合計	8,166,820,328	7,952,839,189
負債純資産合計	8,224,813,692	8,008,861,528

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
営業収益		
受取配当金	248,723,807	217,654,372
受取利息	105	9
有価証券売買等損益	△83,260,089	18,966,469
営業収益合計	165,463,823	236,620,850
営業費用		
支払利息	12,504	12,688
受託者報酬	1,167,450	1,028,536
委託者報酬	45,682,455	40,246,984
その他費用	325,614	331,752
営業費用合計	47,188,023	41,619,960
営業利益又は営業損失（△）	118,275,800	195,000,890
経常利益又は経常損失（△）	118,275,800	195,000,890
当期純利益又は当期純損失（△）	118,275,800	195,000,890
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	7,284,908	1,356,266
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△2,461,348,601	△2,156,844,952
剰余金増加額又は欠損金減少額	423,192,158	112,632,739
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	423,192,158	112,632,739
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
剰余金減少額又は欠損金増加額	26,229,797	52,385,434
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	26,229,797	52,385,434
分配金	※1 203,449,604	※1 182,215,741
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△2,156,844,952	△2,085,168,764

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1.※1　期首元本額	12,401,326,601円	10,323,665,280円
期中追加設定元本額	135,872,701円	253,648,986円
期中一部解約元本額	2,213,534,022円	539,306,313円
2.※1　特定期間末日における受益権の総数	10,323,665,280口	10,038,007,953口
3.※2　元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,156,844,952円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,085,168,764円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
※1　分配金の計算過程 (2020年9月18日から2020年10月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（35,306,016円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（44,072,928円）及び分配準備積立金（149,961,204円）より、分配対象額は229,340,148円（１万口当たり186.19円）であり、うち36,949,484円(１万口当たり30円)を分配金額としております。	※1　分配金の計算過程 (2021年3月18日から2021年4月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（31,299,517円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（39,072,893円）及び分配準備積立金（125,286,889円）より、分配対象額は195,659,299円（１万口当たり190.05円）であり、うち30,882,015円(１万口当たり30円)を分配金額としております。

(2020年10月20日から2020年11月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（40,348,459円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（43,627,912円）及び分配準備積立金（145,136,816円）より、分配対象額は229,113,187円（１万口当たり189.57円）であり、うち36,253,100円(１万口当たり30円)を分配金額としております。	(2021年4月20日から2021年5月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（30,159,721円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（39,265,845円）及び分配準備積立金（125,157,547円）より、分配対象額は194,583,113円（１万口当たり189.47円）であり、うち30,808,498円(１万口当たり30円)を分配金額としております。
(2020年11月18日から2020年12月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（40,295,330円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（44,098,824円）及び分配準備積立金（148,407,310円）より、分配対象額は232,801,464円（１万口当たり193.04円）であり、うち36,175,743円(１万口当たり30円)を分配金額としております。	(2021年5月18日から2021年6月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（33,366,456円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（39,112,840円）及び分配準備積立金（122,959,844円）より、分配対象額は195,439,140円（１万口当たり192.31円）であり、うち30,484,827円(１万口当たり30円)を分配金額としております。
(2020年12月18日から2021年1月18日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（30,010,473円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（39,313,309円）及び分配準備積立金（133,825,696円）より、分配対象額は203,149,478円（１万口当たり191.38円）であり、うち31,841,807円(１万口当たり30円)を分配金額としております。	(2021年6月18日から2021年7月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（32,082,995円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（38,568,958円）及び分配準備積立金（123,707,866円）より、分配対象額は194,359,819円（１万口当たり194.41円）であり、うち29,990,019円(１万口当たり30円)を分配金額としております。
(2021年1月19日から2021年2月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（30,017,665円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（38,684,801円）及び分配準備積立金（129,484,643円）より、分配対象額は198,187,109円（１万口当たり190.19円）であり、うち31,258,475円(１万口当たり30円)を分配金額としております。	(2021年7月20日から2021年8月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（29,699,842円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（38,682,327円）及び分配準備積立金（125,393,371円）より、分配対象額は193,775,540円（１万口当たり194.17円）であり、うち29,936,359円(１万口当たり30円)を分配金額としております。

(2021年2月18日から2021年3月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（30,410,908円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（38,419,031円）及び分配準備積立金（126,974,363円）より、分配対象額は195,804,302円（１万口当たり189.65円）であり、うち30,970,995円(１万口当たり30円)を分配金額としております。	(2021年8月18日から2021年9月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（28,946,961円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（40,518,229円）及び分配準備積立金（124,293,294円）より、分配対象額は193,758,484円（１万口当たり193.02円）であり、うち30,114,023円(１万口当たり30円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3．　金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
前期（自 2020年9月18日　至 2021年3月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△161,045,338円
親投資信託受益証券	―円
合計	△161,045,338円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

当期（自 2021年3月18日　至 2021年9月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△28,849,554円
親投資信託受益証券	198円
合計	△28,849,356円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

（1口当たり情報に関する注記）

前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1口当たり純資産額　0.7911円 （1万口当たり純資産額　7,911円）	1口当たり純資産額　0.7923円 （1万口当たり純資産額　7,923円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
投資信託受益証券	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund JPY Class Units	898,180.3711	7,906,681,806	
投資信託受益証券　合計		898,180.3711	7,906,681,806	
親投資信託受益証券	東京海上マネーマザーファンド	991,474.0000	1,002,875	
親投資信託受益証券　合計		991,474.0000	1,002,875	
合計		1,889,654.3711	7,907,684,681	

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【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）】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	61,219,141	83,692,603
投資信託受益証券	4,651,053,970	4,832,643,625
親投資信託受益証券	10,030	10,029
未収入金	50,000,000	－
流動資産合計	4,762,283,141	4,916,346,257
資産合計	4,762,283,141	4,916,346,257
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	31,537,800	32,835,858
未払受託者報酬	91,412	105,951
未払委託者報酬	3,576,932	4,145,908
未払利息	42	86
その他未払費用	39,730	46,052
流動負債合計	35,245,916	37,133,855
負債合計	35,245,916	37,133,855
純資産の部		
元本等		
元本	※1 3,504,200,110	※1 3,648,428,757
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,222,837,115	1,230,783,645
（分配準備積立金）	53,009,546	33,546,105
元本等合計	4,727,037,225	4,879,212,402
純資産合計	4,727,037,225	4,879,212,402
負債純資産合計	4,762,283,141	4,916,346,257

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
営業収益		
受取配当金	144,333,233	145,305,384
受取利息	94	4
有価証券売買等損益	123,399,177	35,589,654
営業収益合計	267,732,504	180,895,042
営業費用		
支払利息	8,465	9,918
受託者報酬	591,699	626,588
委託者報酬	23,153,360	24,518,808
その他費用	257,161	272,344
営業費用合計	24,010,685	25,427,658
営業利益又は営業損失（△）	243,721,819	155,467,384
経常利益又は経常損失（△）	243,721,819	155,467,384
当期純利益又は当期純損失（△）	243,721,819	155,467,384
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	965,962	1,297,112
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,187,264,496	1,222,837,115
剰余金増加額又は欠損金減少額	53,787,668	163,929,679
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	53,787,668	163,929,679
剰余金減少額又は欠損金増加額	70,218,231	112,441,763
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	70,218,231	112,441,763
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	※1 190,752,675	※1 197,711,658
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,222,837,115	1,230,783,645

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1.※1　期首元本額	3,554,895,846円	3,504,200,110円
期中追加設定元本額	163,509,524円	465,541,581円
期中一部解約元本額	214,205,260円	321,312,934円
2.※1　特定期間末日における受益権の総数	3,504,200,110口	3,648,428,757口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
※1　分配金の計算過程 (2020年9月18日から2020年10月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（21,146,321円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,201,499,977円）及び分配準備積立金（120,697,047円）より、分配対象額は2,343,343,345円（１万口当たり6,619.85円）であり、うち31,858,806円(１万口当たり90円)を分配金額としております。	※1　分配金の計算過程 (2021年3月18日から2021年4月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（19,051,416円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,211,762,170円）及び分配準備積立金（52,642,063円）より、分配対象額は2,283,455,649円（１万口当たり6,435.79円）であり、うち31,932,497円(１万口当たり90円)を分配金額としております。

(2020年10月20日から2020年11月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（20,336,294円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,191,545,143円）及び分配準備積立金（109,292,408円）より、分配対象額は2,321,173,845円（１万口当たり6,587.57円）であり、うち31,712,058円(１万口当たり90円)を分配金額としております。	(2021年4月20日から2021年5月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（19,970,291円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,196,046,967円）及び分配準備積立金（39,324,068円）より、分配対象額は2,255,341,326円（１万口当たり6,402.48円）であり、うち31,703,415円(１万口当たり90円)を分配金額としております。
(2020年11月18日から2020年12月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（19,948,031円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,190,802,507円）及び分配準備積立金（96,647,686円）より、分配対象額は2,307,398,224円（１万口当たり6,554.23円）であり、うち31,684,195円(１万口当たり90円)を分配金額としております。	(2021年5月18日から2021年6月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（22,289,219円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,392,014,334円）及び分配準備積立金（27,343,821円）より、分配対象額は2,441,647,374円（１万口当たり6,375.68円）であり、うち34,466,592円(１万口当たり90円)を分配金額としております。
(2020年12月18日から2021年1月18日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（20,552,860円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,225,448,027円）及び分配準備積立金（84,794,163円）より、分配対象額は2,330,795,050円（１万口当たり6,522.09円）であり、うち32,163,182円(１万口当たり90円)を分配金額としております。	(2021年6月18日から2021年7月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（22,970,318円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,331,663,136円）及び分配準備積立金（29,777,472円）より、分配対象額は2,384,410,926円（１万口当たり6,346.92円）であり、うち33,811,081円(１万口当たり90円)を分配金額としております。
(2021年1月19日から2021年2月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（22,826,668円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,200,852,471円）及び分配準備積立金（71,605,610円）より、分配対象額は2,295,284,749円（１万口当たり6,496.76円）であり、うち31,796,634円(１万口当たり90円)を分配金額としております。	(2021年7月20日から2021年8月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（20,371,435円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,262,300,049円）及び分配準備積立金（29,289,173円）より、分配対象額は2,311,960,657円（１万口当たり6,312.57円）であり、うち32,962,215円(１万口当たり90円)を分配金額としております。

(2021年2月18日から2021年3月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（22,643,722円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,183,158,772円）及び分配準備積立金（61,903,624円）より、分配対象額は2,267,706,118円（１万口当たり6,471.39円）であり、うち31,537,800円(１万口当たり90円)を分配金額としております。	(2021年8月18日から2021年9月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（20,625,991円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,239,114,825円）及び分配準備積立金（31,162,257円）より、分配対象額は2,290,903,073円（１万口当たり6,279.14円）であり、うち32,835,858円(１万口当たり90円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3．　金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
前期（自 2020年9月18日　至 2021年3月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	56,750,759円
親投資信託受益証券	―円
合計	56,750,759円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

当期（自 2021年3月18日　至 2021年9月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	3,559,363円
親投資信託受益証券	2円
合計	3,559,365円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

（1口当たり情報に関する注記）

前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]

1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額	1.3490円 13,490円）
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額	1.3373円 13,373円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
投資信託受益証券	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund USD Class Units	323,578.4148	4,832,643,625	
投資信託受益証券　合計		323,578.4148	4,832,643,625	
親投資信託受益証券	東京海上マネーマザーファンド	9,915.0000	10,029	
親投資信託受益証券　合計		9,915.0000	10,029	
合計		333,493.4148	4,832,653,654	

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【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）】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	294,820	434,328
投資信託受益証券	17,709,540	16,136,638
親投資信託受益証券	10,030	10,029
流動資産合計	18,014,390	16,580,995
資産合計	18,014,390	16,580,995
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	117,501	110,655
未払受託者報酬	348	360
未払委託者報酬	13,672	13,965
その他未払費用	140	143
流動負債合計	131,661	125,123
負債合計	131,661	125,123
純資産の部		
元本等		
元本	※1 18,077,210	※1 17,023,847
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △194,481	※2 △567,975
（分配準備積立金）	44,167	25,907
元本等合計	17,882,729	16,455,872
純資産合計	17,882,729	16,455,872
負債純資産合計	18,014,390	16,580,995

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
営業収益		
受取配当金	511,634	389,222
有価証券売買等損益	762,944	27,097
営業収益合計	1,274,578	416,319
営業費用		
支払利息	11	5
受託者報酬	2,811	2,232
委託者報酬	110,411	86,570
その他費用	1,171	908
営業費用合計	114,404	89,715
営業利益又は営業損失（△）	1,160,174	326,604
経常利益又は経常損失（△）	1,160,174	326,604
当期純利益又は当期純損失（△）	1,160,174	326,604
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	32,931	16,615
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△536,420	△194,481
剰余金増加額又は欠損金減少額	96,797	552
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	96,797	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	552
剰余金減少額又は欠損金増加額	11,410	6,950
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	2,723
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	11,410	4,227
分配金	※1 870,691	※1 677,085
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△194,481	△567,975

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1.※1　期首元本額	24,180,662円	18,077,210円
期中追加設定元本額	619,235円	392,926円
期中一部解約元本額	6,722,687円	1,446,289円
2.※1　特定期間末日における受益権の総数	18,077,210口	17,023,847口
3.※2　元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は194,481円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は567,975円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
※1　分配金の計算過程 (2020年9月18日から2020年10月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（71,976円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（10,142,851円）及び分配準備積立金（114,800円）より、分配対象額は10,329,627円（１万口当たり4,252.61円）であり、うち157,884円(１万口当たり65円)を分配金額としております。	※1　分配金の計算過程 (2021年3月18日から2021年4月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（62,903円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（7,269,909円）及び分配準備積立金（44,167円）より、分配対象額は7,376,979円（１万口当たり4,065.95円）であり、うち117,931円(１万口当たり65円)を分配金額としております。

(2020年10月20日から2020年11月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（87,426円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（10,110,063円）及び分配準備積立金（113,907円）より、分配対象額は10,311,396円（１万口当たり4,223.41円）であり、うち158,695円(１万口当たり65円)を分配金額としております。	(2021年4月20日から2021年5月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（65,223円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（7,251,025円）及び分配準備積立金（34,497円）より、分配対象額は7,350,745円（１万口当たり4,036.76円）であり、うち118,361円(１万口当たり65円)を分配金額としております。
(2020年11月18日から2020年12月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（91,329円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（10,070,518円）及び分配準備積立金（128,089円）より、分配対象額は10,289,936円（１万口当たり4,195.66円）であり、うち159,412円(１万口当たり65円)を分配金額としております。	(2021年5月18日から2021年6月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（59,169円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（6,704,848円）及び分配準備積立金（24,925円）より、分配対象額は6,788,942円（１万口当たり4,006.68円）であり、うち110,135円(１万口当たり65円)を分配金額としております。
(2020年12月18日から2021年1月18日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（71,813円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（10,041,982円）及び分配準備積立金（133,581円）より、分配対象額は10,247,376円（１万口当たり4,159.82円）であり、うち160,121円(１万口当たり65円)を分配金額としております。	(2021年6月18日から2021年7月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（48,230円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（6,632,171円）及び分配準備積立金（24,623円）より、分配対象額は6,705,024円（１万口当たり3,970.25円）であり、うち109,772円(１万口当たり65円)を分配金額としております。
(2021年1月19日から2021年2月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（65,483円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（7,279,855円）及び分配準備積立金（95,753円）より、分配対象額は7,441,091円（１万口当たり4,131.14円）であり、うち117,078円(１万口当たり65円)を分配金額としております。	(2021年7月20日から2021年8月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（49,011円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（6,600,639円）及び分配準備積立金（22,189円）より、分配対象額は6,671,839円（１万口当たり3,934.15円）であり、うち110,231円(１万口当たり65円)を分配金額としております。

(2021年2月18日から2021年3月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（54,468円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（7,243,278円）及び分配準備積立金（107,200円）より、分配対象額は7,404,946円（１万口当たり4,096.27円）であり、うち117,501円(１万口当たり65円)を分配金額としております。	(2021年8月18日から2021年9月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（48,142円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（6,566,473円）及び分配準備積立金（20,324円）より、分配対象額は6,634,939円（１万口当たり3,897.42円）であり、うち110,655円(１万口当たり65円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3．　金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
前期（自 2020年9月18日　至 2021年3月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△111,323円
親投資信託受益証券	―円
合計	△111,323円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

当期（自 2021年3月18日　至 2021年9月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△12,522円
親投資信託受益証券	2円
合計	△12,520円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

（1口当たり情報に関する注記）

前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1口当たり純資産額　0.9892円 （1万口当たり純資産額　9,892円）	1口当たり純資産額　0.9666円 （1万口当たり純資産額　9,666円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
投資信託受益証券	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund EUR Class Units	1,391.3294	16,136,638	
投資信託受益証券　合計		1,391.3294	16,136,638	
親投資信託受益証券	東京海上マネーマザーファンド	9,915.0000	10,029	
親投資信託受益証券　合計		9,915.0000	10,029	
合計		11,306.3294	16,146,667	

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【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）】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	29,302,769	28,952,731
投資信託受益証券	1,535,392,428	1,339,001,037
親投資信託受益証券	1,002,975	1,002,875
未収入金	30,000,000	－
流動資産合計	1,595,698,172	1,368,956,643
資産合計	1,595,698,172	1,368,956,643
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	14,999,567	14,124,607
未払解約金	4,582,348	744,118
未払受託者報酬	31,343	29,704
未払委託者報酬	1,226,412	1,162,228
未払利息	20	30
その他未払費用	13,613	12,899
流動負債合計	20,853,303	16,073,586
負債合計	20,853,303	16,073,586
純資産の部		
元本等		
元本	※1 2,142,795,381	※1 2,017,801,048
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △567,950,512	※2 △664,917,991
（分配準備積立金）	1,579,164	7,210,529
元本等合計	1,574,844,869	1,352,883,057
純資産合計	1,574,844,869	1,352,883,057
負債純資産合計	1,595,698,172	1,368,956,643

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
営業収益		
受取配当金	46,826,026	41,490,709
受取利息	16	1
有価証券売買等損益	131,059,634	△79,391,491
営業収益合計	177,885,676	△37,900,781
営業費用		
支払利息	2,736	2,573
受託者報酬	200,307	188,401
委託者報酬	7,838,006	7,372,034
その他費用	86,996	81,826
営業費用合計	8,128,045	7,644,834
営業利益又は営業損失（△）	169,757,631	△45,545,615
経常利益又は経常損失（△）	169,757,631	△45,545,615
当期純利益又は当期純損失（△）	169,757,631	△45,545,615
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	893,858	△155,699
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△694,427,388	△567,950,512
剰余金増加額又は欠損金減少額	57,711,866	41,073,353
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	57,711,866	41,073,353
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,070,735	6,103,182
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,070,735	6,103,182
分配金	※1 94,028,028	※1 86,547,734
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△567,950,512	△664,917,991

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1.※1　期首元本額	2,321,223,318円	2,142,795,381円
期中追加設定元本額	20,362,583円	21,517,815円
期中一部解約元本額	198,790,520円	146,512,148円
2.※1　特定期間末日における受益権の総数	2,142,795,381口	2,017,801,048口
3.※2　元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は567,950,512円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は664,917,991円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
※1　分配金の計算過程 (2020年9月18日から2020年10月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（6,654,099円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（837,974,237円）及び分配準備積立金（7,327,449円）より、分配対象額は851,955,785円（１万口当たり3,693.77円）であり、うち16,145,184円(１万口当たり70円)を分配金額としております。	※1　分配金の計算過程 (2021年3月18日から2021年4月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,707,167円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（723,242,878円）及び分配準備積立金（1,547,926円）より、分配対象額は730,497,971円（１万口当たり3,467.89円）であり、うち14,745,151円(１万口当たり70円)を分配金額としております。

(2020年10月20日から2020年11月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,782,543円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（816,426,901円）及び分配準備積立金（6,944,729円）より、分配対象額は831,154,173円（１万口当たり3,658.02円）であり、うち15,904,902円(１万口当たり70円)を分配金額としております。	(2021年4月20日から2021年5月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（6,305,351円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（713,089,844円）及び分配準備積立金（932,188円）より、分配対象額は720,327,383円（１万口当たり3,427.90円）であり、うち14,709,496円(１万口当たり70円)を分配金額としております。
(2020年11月18日から2020年12月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,702,880円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（801,827,331円）及び分配準備積立金（7,844,299円）より、分配対象額は817,374,510円（１万口当たり3,622.15円）であり、うち15,796,087円(１万口当たり70円)を分配金額としております。	(2021年5月18日から2021年6月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（6,121,843円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（688,029,506円）及び分配準備積立金（2,968,003円）より、分配対象額は697,119,352円（１万口当たり3,387.65円）であり、うち14,404,720円(１万口当たり70円)を分配金額としております。
(2020年12月18日から2021年1月18日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,414,830円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（786,753,445円）及び分配準備積立金（8,698,729円）より、分配対象額は802,867,004円（１万口当たり3,585.28円）であり、うち15,675,359円(１万口当たり70円)を分配金額としております。	(2021年6月18日から2021年7月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,512,505円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（673,837,829円）及び分配準備積立金（4,938,729円）より、分配対象額は684,289,063円（１万口当たり3,344.59円）であり、うち14,321,626円(１万口当たり70円)を分配金額としております。
(2021年1月19日から2021年2月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,357,265円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（769,451,064円）及び分配準備積立金（9,282,075円）より、分配対象額は786,090,404円（１万口当たり3,548.48円）であり、うち15,506,929円(１万口当たり70円)を分配金額としております。	(2021年7月20日から2021年8月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,621,348円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（661,966,126円）及び分配準備積立金（4,282,885円）より、分配対象額は671,870,359円（１万口当たり3,302.21円）であり、うち14,242,134円(１万口当たり70円)を分配金額としております。

(2021年2月18日から2021年3月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（6,924,440円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（735,716,583円）及び分配準備積立金（9,654,291円）より、分配対象額は752,295,314円（１万口当たり3,510.81円）であり、うち14,999,567円(１万口当たり70円)を分配金額としております。	(2021年8月18日から2021年9月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,469,922円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（646,425,252円）及び分配準備積立金（5,776,209円）より、分配対象額は657,671,383円（１万口当たり3,259.32円）であり、うち14,124,607円(１万口当たり70円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3．　金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
前期（自 2020年9月18日　至 2021年3月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	15,416,667円
親投資信託受益証券	―円
合計	15,416,667円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

当期（自 2021年3月18日　至 2021年9月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△10,254,207円
親投資信託受益証券	198円
合計	△10,254,009円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

（1口当たり情報に関する注記）

前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1口当たり純資産額　0.7349円 （1万口当たり純資産額　7,349円）	1口当たり純資産額　0.6705円 （1万口当たり純資産額　6,705円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
投資信託受益証券	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund AUD Class Units	165,390.4443	1,339,001,037	
投資信託受益証券　合計		165,390.4443	1,339,001,037	
親投資信託受益証券	東京海上マネーマザーファンド	991,474.0000	1,002,875	
親投資信託受益証券　合計		991,474.0000	1,002,875	
合計		1,156,864.4443	1,340,003,912	

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【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）】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	65,057,370	59,313,648
投資信託受益証券	1,196,888,745	1,191,133,367
親投資信託受益証券	1,002,975	1,002,875
流動資産合計	1,262,949,090	1,251,449,890
資産合計	1,262,949,090	1,251,449,890
負債の部		
流動負債		
未払金	10,000,000	－
未払収益分配金	37,573,645	40,772,877
未払解約金	4,240,792	492,200
未払受託者報酬	23,687	26,768
未払委託者報酬	926,828	1,047,479
未払利息	45	61
その他未払費用	10,284	11,622
流動負債合計	52,775,281	42,351,007
負債合計	52,775,281	42,351,007
純資産の部		
元本等		
元本	※1 6,262,274,168	※1 6,795,479,513
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △5,052,100,359	※2 △5,586,380,630
（分配準備積立金）	4,034,275	19,786,214
元本等合計	1,210,173,809	1,209,098,883
純資産合計	1,210,173,809	1,209,098,883
負債純資産合計	1,262,949,090	1,251,449,890

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
営業収益		
受取配当金	72,898,344	63,251,191
受取利息	23	2
有価証券売買等損益	△75,696,821	73,244,522
営業収益合計	△2,798,454	136,495,715
営業費用		
支払利息	3,882	4,230
受託者報酬	166,728	158,435
委託者報酬	6,524,003	6,199,724
その他費用	72,403	68,796
営業費用合計	6,767,016	6,431,185
営業利益又は営業損失（△）	△9,565,470	130,064,530
経常利益又は経常損失（△）	△9,565,470	130,064,530
当期純利益又は当期純損失（△）	△9,565,470	130,064,530
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	2,566,310	577,166
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△4,838,731,083	△5,052,100,359
剰余金増加額又は欠損金減少額	626,991,701	696,532,701
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	626,991,701	696,532,701
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
剰余金減少額又は欠損金増加額	604,970,714	1,127,879,277
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	604,970,714	1,127,879,277
分配金	※1 223,258,483	※1 232,421,059
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△5,052,100,359	△5,586,380,630

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1.※1　期首元本額	6,295,453,101円	6,262,274,168円
期中追加設定元本額	765,188,819円	1,397,075,570円
期中一部解約元本額	798,367,752円	863,870,225円
2.※1　特定期間末日における受益権の総数	6,262,274,168口	6,795,479,513口
3.※2　元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,052,100,359円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,586,380,630円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
※1　分配金の計算過程 (2020年9月18日から2020年10月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（11,948,622円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,702,314,169円）及び分配準備積立金（16,063,196円）より、分配対象額は1,730,325,987円（１万口当たり2,704.92円）であり、うち38,381,557円(１万口当たり60円)を分配金額としております。	※1　分配金の計算過程 (2021年3月18日から2021年4月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（9,502,822円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,490,127,105円）及び分配準備積立金（3,737,869円）より、分配対象額は1,503,367,796円（１万口当たり2,451.11円）であり、うち36,800,359円(１万口当たり60円)を分配金額としております。

(2020年10月20日から2020年11月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（12,496,181円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,653,010,021円）及び分配準備積立金（14,815,257円）より、分配対象額は1,680,321,459円（１万口当たり2,664.81円）であり、うち37,833,452円(１万口当たり60円)を分配金額としております。	(2021年4月20日から2021年5月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（10,415,495円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,479,438,170円）及び分配準備積立金（4,001,405円）より、分配対象額は1,493,855,070円（１万口当たり2,407.98円）であり、うち37,222,196円(１万口当たり60円)を分配金額としております。
(2020年11月18日から2020年12月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（12,095,661円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,598,941,991円）及び分配準備積立金（14,234,529円）より、分配対象額は1,625,272,181円（１万口当たり2,624.37円）であり、うち37,157,650円(１万口当たり60円)を分配金額としております。	(2021年5月18日から2021年6月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（10,537,337円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,515,359,049円）及び分配準備積立金（8,077,173円）より、分配対象額は1,533,973,559円（１万口当たり2,364.38円）であり、うち38,926,813円(１万口当たり60円)を分配金額としております。
(2020年12月18日から2021年1月18日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（10,467,273円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,523,154,173円）及び分配準備積立金（13,344,503円）より、分配対象額は1,546,965,949円（１万口当たり2,581.89円）であり、うち35,949,553円(１万口当たり60円)を分配金額としております。	(2021年6月18日から2021年7月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（9,230,563円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,473,585,871円）及び分配準備積立金（11,841,972円）より、分配対象額は1,494,658,406円（１万口当たり2,318.80円）であり、うち38,674,714円(１万口当たり60円)を分配金額としております。
(2021年1月19日から2021年2月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（10,375,380円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,516,739,844円）及び分配準備積立金（11,723,641円）より、分配対象額は1,538,838,865円（１万口当たり2,539.14円）であり、うち36,362,626円(１万口当たり60円)を分配金額としております。	(2021年7月20日から2021年8月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（9,367,190円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,492,333,556円）及び分配準備積立金（14,588,817円）より、分配対象額は1,516,289,563円（１万口当たり2,273.05円）であり、うち40,024,100円(１万口当たり60円)を分配金額としております。

(2021年2月18日から2021年3月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（9,989,533円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,539,918,207円）及び分配準備積立金（12,831,564円）より、分配対象額は1,562,739,304円（１万口当たり2,495.46円）であり、うち37,573,645円(１万口当たり60円)を分配金額としております。	(2021年8月18日から2021年9月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（9,446,942円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,486,751,984円）及び分配準備積立金（17,134,751円）より、分配対象額は1,513,333,677円（１万口当たり2,226.96円）であり、うち40,772,877円(１万口当たり60円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3．　金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
前期（自 2020年9月18日　至 2021年3月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△34,727,719円
親投資信託受益証券	―円
合計	△34,727,719円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

当期（自 2021年3月18日　至 2021年9月17日）

売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△2,932,547円
親投資信託受益証券	198円
合計	△2,932,349円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

（1口当たり情報に関する注記）

前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1口当たり純資産額　0.1932円 （1万口当たり純資産額　1,932円）	1口当たり純資産額　0.1779円 （1万口当たり純資産額　1,779円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
投資信託受益証券	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund BRL Class Units	489,573.9281	1,191,133,367	
投資信託受益証券　合計		489,573.9281	1,191,133,367	
親投資信託受益証券	東京海上マネーマザーファンド	991,474.0000	1,002,875	
親投資信託受益証券　合計		991,474.0000	1,002,875	
合計		1,481,047.9281	1,192,136,242	

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【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）】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,348,715	15,407,614
投資信託受益証券	580,972,346	548,532,914
親投資信託受益証券	10,012	10,011
流動資産合計	592,331,073	563,950,539
資産合計	592,331,073	563,950,539
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	7,225,619	6,802,902
未払解約金	17,204	－
未払受託者報酬	11,348	12,291
未払委託者報酬	443,988	481,011
未払利息	7	15
その他未払費用	4,920	5,326
流動負債合計	7,703,086	7,301,545
負債合計	7,703,086	7,301,545
純資産の部		
元本等		
元本	※1 1,032,231,321	※1 971,843,283
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △447,603,334	※2 △415,194,289
（分配準備積立金）	32,199,844	30,736,875
元本等合計	584,627,987	556,648,994
純資産合計	584,627,987	556,648,994
負債純資産合計	592,331,073	563,950,539

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
営業収益		
受取配当金	46,718,894	45,086,130
受取利息	9	1
有価証券売買等損益	8,362,817	7,560,567
営業収益合計	55,081,720	52,646,698
営業費用		
支払利息	1,764	1,487
受託者報酬	75,139	75,368
委託者報酬	2,940,311	2,949,178
その他費用	32,585	32,677
営業費用合計	3,049,799	3,058,710
営業利益又は営業損失（△）	52,031,921	49,587,988
経常利益又は経常損失（△）	52,031,921	49,587,988
当期純利益又は当期純損失（△）	52,031,921	49,587,988
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△83,748	223,470
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△461,307,150	△447,603,334
剰余金増加額又は欠損金減少額	21,359,254	36,141,894
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	21,359,254	36,141,894
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
剰余金減少額又は欠損金増加額	15,624,378	10,646,631
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	15,624,378	10,646,631
分配金	※1 44,146,729	※1 42,450,736
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△447,603,334	△415,194,289

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1.※1　期首元本額	1,046,712,274円	1,032,231,321円
期中追加設定元本額	36,106,711円	25,262,336円
期中一部解約元本額	50,587,664円	85,650,374円
2.※1　特定期間末日における受益権の総数	1,032,231,321口	971,843,283口
3.※2　元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は447,603,334円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は415,194,289円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
※1　分配金の計算過程 (2020年9月18日から2020年10月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,229,386円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（191,626,860円）及び分配準備積立金（33,511,745円）より、分配対象額は232,367,991円（１万口当たり2,219.95円）であり、うち7,327,054円(１万口当たり70円)を分配金額としております。	※1　分配金の計算過程 (2021年3月18日から2021年4月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,526,815円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（189,492,266円）及び分配準備積立金（31,955,945円）より、分配対象額は228,975,026円（１万口当たり2,225.19円）であり、うち7,202,999円(１万口当たり70円)を分配金額としております。

(2020年10月20日から2020年11月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,643,474円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（194,177,519円）及び分配準備積立金（33,414,077円）より、分配対象額は235,235,070円（１万口当たり2,222.15円）であり、うち7,410,098円(１万口当たり70円)を分配金額としております。	(2021年4月20日から2021年5月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,160,259円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（188,933,833円）及び分配準備積立金（32,057,767円）より、分配対象額は228,151,859円（１万口当たり2,225.03円）であり、うち7,177,658円(１万口当たり70円)を分配金額としております。
(2020年11月18日から2020年12月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,555,781円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（195,197,339円）及び分配準備積立金（33,647,453円）より、分配対象額は236,400,573円（１万口当たり2,223.19円）であり、うち7,443,270円(１万口当たり70円)を分配金額としております。	(2021年5月18日から2021年6月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,002,060円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（187,414,424円）及び分配準備積立金（31,576,183円）より、分配対象額は225,992,667円（１万口当たり2,223.99円）であり、うち7,113,078円(１万口当たり70円)を分配金額としております。
(2020年12月18日から2021年1月18日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,483,065円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（196,100,906円）及び分配準備積立金（33,759,964円）より、分配対象額は237,343,935円（１万口当たり2,223.30円）であり、うち7,472,643円(１万口当たり70円)を分配金額としております。	(2021年6月18日から2021年7月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,300,017円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（187,389,540円）及び分配準備積立金（31,318,080円）より、分配対象額は226,007,637円（１万口当たり2,225.90円）であり、うち7,107,416円(１万口当たり70円)を分配金額としております。
(2021年1月19日から2021年2月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,173,454円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（190,940,778円）及び分配準備積立金（32,636,748円）より、分配対象額は230,750,980円（１万口当たり2,222.39円）であり、うち7,268,045円(１万口当たり70円)を分配金額としております。	(2021年7月20日から2021年8月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（6,969,153円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（185,898,331円）及び分配準備積立金（31,131,225円）より、分配対象額は223,998,709円（１万口当たり2,225.13円）であり、うち7,046,683円(１万口当たり70円)を分配金額としております。

(2021年2月18日から2021年3月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（7,190,869円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（189,943,735円）及び分配準備積立金（32,234,594円）より、分配対象額は229,369,198円（１万口当たり2,222.05円）であり、うち7,225,619円(１万口当たり70円)を分配金額としております。	(2021年8月18日から2021年9月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（6,705,049円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（179,584,158円）及び分配準備積立金（29,862,885円）より、分配対象額は216,152,092円（１万口当たり2,224.13円）であり、うち6,802,902円(１万口当たり70円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3．　金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
前期（自 2020年9月18日　至 2021年3月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△9,996,822円
親投資信託受益証券	―円
合計	△9,996,822円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

当期（自 2021年3月18日　至 2021年9月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△3,347,800円
親投資信託受益証券	2円
合計	△3,347,798円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

（1口当たり情報に関する注記）

前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1口当たり純資産額　0.5664円 （1万口当たり純資産額　5,664円）	1口当たり純資産額　0.5728円 （1万口当たり純資産額　5,728円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
投資信託受益証券	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund MXN Class Units	102,914.2429	548,532,914	
投資信託受益証券　合計		102,914.2429	548,532,914	
親投資信託受益証券	東京海上マネーマザーファンド	9,898.0000	10,011	
親投資信託受益証券　合計		9,898.0000	10,011	
合計		112,812.2429	548,542,925	

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【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）】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	134,871,994	106,152,809
投資信託受益証券	2,500,355,350	2,219,682,594
親投資信託受益証券	10,012	10,011
流動資産合計	2,635,237,356	2,325,845,414
資産合計	2,635,237,356	2,325,845,414
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	74,874,817	80,843,388
未払解約金	15,524,667	4,614,859
未払受託者報酬	52,866	50,332
未払委託者報酬	2,068,682	1,969,394
未払利息	93	110
その他未払費用	22,971	21,866
流動負債合計	92,544,096	87,499,949
負債合計	92,544,096	87,499,949
純資産の部		
元本等		
元本	※1 14,974,963,476	※1 16,168,677,691
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △12,432,270,216	※2 △13,930,332,226
（分配準備積立金）	34,177,992	39,040,868
元本等合計	2,542,693,260	2,238,345,465
純資産合計	2,542,693,260	2,238,345,465
負債純資産合計	2,635,237,356	2,325,845,414

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
営業収益		
受取配当金	344,774,527	330,655,009
受取利息	38	6
有価証券売買等損益	△64,500,189	△333,672,757
営業収益合計	280,274,376	△3,017,742
営業費用		
支払利息	7,877	8,327
受託者報酬	333,326	296,078
委託者報酬	13,043,087	11,585,530
その他費用	144,835	128,643
営業費用合計	13,529,125	12,018,578
営業利益又は営業損失（△）	266,745,251	△15,036,320
経常利益又は経常損失（△）	266,745,251	△15,036,320
当期純利益又は当期純損失（△）	266,745,251	△15,036,320
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△15,862,781	△3,575,506
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△13,141,464,424	△12,432,270,216
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,502,136,711	1,810,933,949
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,502,136,711	1,810,933,949
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,620,801,441	2,833,358,627
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,620,801,441	2,833,358,627
分配金	※1 454,749,094	※1 464,176,518
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△12,432,270,216	△13,930,332,226

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1.※1　期首元本額	16,050,173,870円	14,974,963,476円
期中追加設定元本額	1,963,246,583円	3,328,310,088円
期中一部解約元本額	3,038,456,977円	2,134,595,873円
2.※1　特定期間末日における受益権の総数	14,974,963,476口	16,168,677,691口
3.※2　元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は12,432,270,216円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は13,930,332,226円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
※1　分配金の計算過程 (2020年9月18日から2020年10月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（57,762,028円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,902,964,624円）及び分配準備積立金（77,267,005円）より、分配対象額は3,037,993,657円（１万口当たり1,937.26円）であり、うち78,408,864円(１万口当たり50円)を分配金額としております。	※1　分配金の計算過程 (2021年3月18日から2021年4月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（52,605,708円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,715,043,117円）及び分配準備積立金（33,178,053円）より、分配対象額は2,800,826,878円（１万口当たり1,854.74円）であり、うち75,504,240円(１万口当たり50円)を分配金額としております。

(2020年10月20日から2020年11月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（55,290,358円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,756,553,314円）及び分配準備積立金（53,285,095円）より、分配対象額は2,865,128,767円（１万口当たり1,924.45円）であり、うち74,439,182円(１万口当たり50円)を分配金額としております。	(2021年4月20日から2021年5月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（52,796,370円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,725,898,052円）及び分配準備積立金（10,074,469円）より、分配対象額は2,788,768,891円（１万口当たり1,839.64円）であり、うち75,795,999円(１万口当たり50円)を分配金額としております。
(2020年11月18日から2020年12月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（53,960,052円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,733,656,500円）及び分配準備積立金（55,675,366円）より、分配対象額は2,843,291,918円（１万口当たり1,910.79円）であり、うち74,399,971円(１万口当たり50円)を分配金額としております。	(2021年5月18日から2021年6月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（52,547,976円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,741,106,671円）及び分配準備積立金（16,830,418円）より、分配対象額は2,810,485,065円（１万口当たり1,824.25円）であり、うち77,029,879円(１万口当たり50円)を分配金額としております。
(2020年12月18日から2021年1月18日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（55,097,813円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,745,555,688円）及び分配準備積立金（57,016,407円）より、分配対象額は2,857,669,908円（１万口当たり1,897.87円）であり、うち75,285,814円(１万口当たり50円)を分配金額としております。	(2021年6月18日から2021年7月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（52,778,458円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,721,918,076円）及び分配準備積立金（22,810,695円）より、分配対象額は2,797,507,229円（１万口当たり1,808.53円）であり、うち77,341,303円(１万口当たり50円)を分配金額としております。
(2021年1月19日から2021年2月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（56,617,724円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,799,542,187円）及び分配準備積立金（58,885,918円）より、分配対象額は2,915,045,829円（１万口当たり1,884.54円）であり、うち77,340,446円(１万口当たり50円)を分配金額としております。	(2021年7月20日から2021年8月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（52,248,697円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,702,855,776円）及び分配準備積立金（28,838,208円）より、分配対象額は2,783,942,681円（１万口当たり1,792.32円）であり、うち77,661,709円(１万口当たり50円)を分配金額としております。

(2021年2月18日から2021年3月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（52,028,265円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,690,965,489円）及び分配準備積立金（57,024,544円）より、分配対象額は2,800,018,298円（１万口当たり1,869.78円）であり、うち74,874,817円(１万口当たり50円)を分配金額としております。	(2021年8月18日から2021年9月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（54,015,261円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,783,709,265円）及び分配準備積立金（33,531,640円）より、分配対象額は2,871,256,166円（１万口当たり1,775.79円）であり、うち80,843,388円(１万口当たり50円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3．　金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
前期（自 2020年9月18日　至 2021年3月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△171,727,351円
親投資信託受益証券	―円
合計	△171,727,351円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

当期（自 2021年3月18日　至 2021年9月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△22,049,502円
親投資信託受益証券	2円
合計	△22,049,500円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

（1口当たり情報に関する注記）

前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]

1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額	0.1698円 1,698円）	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額	0.1384円 1,384円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
投資信託受益証券	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund TRY Class Units	1,636,934.0668	2,219,682,594	
投資信託受益証券　合計		1,636,934.0668	2,219,682,594	
親投資信託受益証券	東京海上マネーマザーファンド	9,898.0000	10,011	
親投資信託受益証券　合計		9,898.0000	10,011	
合計		1,646,832.0668	2,219,692,605	

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【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）】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,127,102	7,092,259
投資信託受益証券	313,877,187	281,286,087
親投資信託受益証券	10,012	10,011
流動資産合計	323,014,301	288,388,357
資産合計	323,014,301	288,388,357
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	4,499,451	4,122,402
未払解約金	－	634,438
未払受託者報酬	6,139	6,132
未払委託者報酬	240,241	240,022
未払利息	6	7
その他未払費用	2,658	2,649
流動負債合計	4,748,495	5,005,650
負債合計	4,748,495	5,005,650
純資産の部		
元本等		
元本	※1 749,908,645	※1 687,067,019
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △431,642,839	※2 △403,684,312
（分配準備積立金）	35,015,429	28,974,103
元本等合計	318,265,806	283,382,707
純資産合計	318,265,806	283,382,707
負債純資産合計	323,014,301	288,388,357

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
営業収益		
受取配当金	24,454,743	21,935,774
受取利息	3	－
有価証券売買等損益	8,356,635	△4,091,101
営業収益合計	32,811,381	17,844,673
営業費用		
支払利息	910	780
受託者報酬	40,383	37,633
委託者報酬	1,580,222	1,472,547
その他費用	17,470	16,271
営業費用合計	1,638,985	1,527,231
営業利益又は営業損失（△）	31,172,396	16,317,442
経常利益又は経常損失（△）	31,172,396	16,317,442
当期純利益又は当期純損失（△）	31,172,396	16,317,442
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	67,459	△534,723
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△451,986,988	△431,642,839
剰余金増加額又は欠損金減少額	35,097,274	54,887,816
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	35,097,274	54,887,816
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
剰余金減少額又は欠損金増加額	17,933,716	18,360,673
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	17,933,716	18,360,673
分配金	※1 27,924,346	※1 25,420,781
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△431,642,839	△403,684,312

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1.※1　期首元本額	779,428,802円	749,908,645円
期中追加設定元本額	30,546,633円	31,341,321円
期中一部解約元本額	60,066,790円	94,182,947円
2.※1　特定期間末日における受益権の総数	749,908,645口	687,067,019口
3.※2　元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は431,642,839円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は403,684,312円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
※1　分配金の計算過程 (2020年9月18日から2020年10月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,820,929円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（202,148,223円）及び分配準備積立金（42,420,150円）より、分配対象額は248,389,302円（１万口当たり3,177.97円）であり、うち4,689,576円(１万口当たり60円)を分配金額としております。	※1　分配金の計算過程 (2021年3月18日から2021年4月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,417,338円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（186,126,588円）及び分配準備積立金（33,052,900円）より、分配対象額は222,596,826円（１万口当たり3,117.73円）であり、うち4,283,803円(１万口当たり60円)を分配金額としております。

(2020年10月20日から2020年11月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,979,685円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（203,716,165円）及び分配準備積立金（41,547,646円）より、分配対象額は249,243,496円（１万口当たり3,168.55円）であり、うち4,719,672円(１万口当たり60円)を分配金額としております。	(2021年4月20日から2021年5月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,584,027円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（185,159,075円）及び分配準備積立金（31,752,620円）より、分配対象額は220,495,722円（１万口当たり3,108.25円）であり、うち4,256,307円(１万口当たり60円)を分配金額としております。
(2020年11月18日から2020年12月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,064,419円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（204,397,329円）及び分配準備積立金（40,627,135円）より、分配対象額は249,088,883円（１万口当たり3,160.11円）であり、うち4,729,334円(１万口当たり60円)を分配金額としております。	(2021年5月18日から2021年6月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,614,851円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（186,431,898円）及び分配準備積立金（31,021,201円）より、分配対象額は221,067,950円（１万口当たり3,098.94円）であり、うち4,280,178円(１万口当たり60円)を分配金額としております。
(2020年12月18日から2021年1月18日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,801,593円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（203,053,827円）及び分配準備積立金（39,396,765円）より、分配対象額は246,252,185円（１万口当たり3,148.73円）であり、うち4,692,388円(１万口当たり60円)を分配金額としております。	(2021年6月18日から2021年7月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,410,731円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（186,173,465円）及び分配準備積立金（30,092,364円）より、分配対象額は219,676,560円（１万口当たり3,086.87円）であり、うち4,269,876円(１万口当たり60円)を分配金額としております。
(2021年1月19日から2021年2月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,857,925円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（199,041,376円）及び分配準備積立金（37,449,937円）より、分配対象額は240,349,238円（１万口当たり3,139.12円）であり、うち4,593,925円(１万口当たり60円)を分配金額としております。	(2021年7月20日から2021年8月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,352,392円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（182,990,963円）及び分配準備積立金（29,305,317円）より、分配対象額は215,648,672円（１万口当たり3,074.67円）であり、うち4,208,215円(１万口当たり60円)を分配金額としております。

(2021年2月18日から2021年3月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,804,175円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（195,196,374円）及び分配準備積立金（35,710,705円）より、分配対象額は234,711,254円（１万口当たり3,129.85円）であり、うち4,499,451円(１万口当たり60円)を分配金額としております。	(2021年8月18日から2021年9月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,368,910円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（178,775,003円）及び分配準備積立金（28,353,461円）より、分配対象額は210,497,374円（１万口当たり3,063.69円）であり、うち4,122,402円(１万口当たり60円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3．　金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
前期（自 2020年9月18日　至 2021年3月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	5,925,405円
親投資信託受益証券	―円
合計	5,925,405円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

当期（自 2021年3月18日　至 2021年9月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	2,455,307円
親投資信託受益証券	2円
合計	2,455,309円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

（1口当たり情報に関する注記）

前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1口当たり純資産額　0.4244円 （1万口当たり純資産額　4,244円）	1口当たり純資産額　0.4125円 （1万口当たり純資産額　4,125円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
投資信託受益証券	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund RUB Class Units	76,728.3381	281,286,087	
投資信託受益証券　合計		76,728.3381	281,286,087	
親投資信託受益証券	東京海上マネーマザーファンド	9,898.0000	10,011	
親投資信託受益証券　合計		9,898.0000	10,011	
合計		86,626.3381	281,296,098	

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【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）】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,282,546	3,187,420
投資信託受益証券	94,537,321	91,319,123
親投資信託受益証券	10,030	10,029
流動資産合計	96,829,897	94,516,572
資産合計	96,829,897	94,516,572
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,473,586	1,498,736
未払受託者報酬	1,856	2,019
未払委託者報酬	72,601	79,053
未払利息	1	3
その他未払費用	793	859
流動負債合計	1,548,837	1,580,670
負債合計	1,548,837	1,580,670
純資産の部		
元本等		
元本	※1 184,198,251	※1 187,342,020
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △88,917,191	※2 △94,406,118
（分配準備積立金）	354,771	614,480
元本等合計	95,281,060	92,935,902
純資産合計	95,281,060	92,935,902
負債純資産合計	96,829,897	94,516,572

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
営業収益		
受取配当金	3,578,732	4,731,836
有価証券売買等損益	3,190,193	781,801
営業収益合計	6,768,925	5,513,637
営業費用		
支払利息	286	166
受託者報酬	8,434	12,441
委託者報酬	329,723	486,865
その他費用	3,570	5,317
営業費用合計	342,013	504,789
営業利益又は営業損失（△）	6,426,912	5,008,848
経常利益又は経常損失（△）	6,426,912	5,008,848
当期純利益又は当期純損失（△）	6,426,912	5,008,848
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	58,180	△44,503
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△30,724,482	△88,917,191
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,081,364	2,770,092
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,081,364	2,770,092
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
剰余金減少額又は欠損金増加額	61,169,235	4,353,257
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	61,169,235	4,353,257
分配金	※1 6,473,570	※1 8,959,113
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△88,917,191	△94,406,118

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券及び親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1.※1　期首元本額	64,144,775円	184,198,251円
期中追加設定元本額	126,455,368円	9,061,462円
期中一部解約元本額	6,401,892円	5,917,693円
2.※1　特定期間末日における受益権の総数	184,198,251口	187,342,020口
3.※2　元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は88,917,191円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は94,406,118円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
※1　分配金の計算過程 (2020年9月18日から2020年10月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（264,485円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（22,778,939円）及び分配準備積立金（1,553,013円）より、分配対象額は24,596,437円（１万口当たり3,755.13円）であり、うち524,004円(１万口当たり80円)を分配金額としております。	※1　分配金の計算過程 (2021年3月18日から2021年4月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（752,553円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（64,327,331円）及び分配準備積立金（354,317円）より、分配対象額は65,434,201円（１万口当たり3,524.86円）であり、うち1,485,083円(１万口当たり80円)を分配金額としております。

(2020年10月20日から2020年11月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（289,667円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（22,909,673円）及び分配準備積立金（1,293,494円）より、分配対象額は24,492,834円（１万口当たり3,719.12円）であり、うち526,850円(１万口当たり80円)を分配金額としております。	(2021年4月20日から2021年5月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（779,255円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（64,335,082円）及び分配準備積立金（178,693円）より、分配対象額は65,293,030円（１万口当たり3,486.55円）であり、うち1,498,164円(１万口当たり80円)を分配金額としております。
(2020年11月18日から2020年12月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（667,363円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（55,158,910円）及び分配準備積立金（1,055,385円）より、分配対象額は56,881,658円（１万口当たり3,682.63円）であり、うち1,235,669円(１万口当たり80円)を分配金額としております。	(2021年5月18日から2021年6月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（780,849円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（64,061,147円）及び分配準備積立金（396,137円）より、分配対象額は65,238,133円（１万口当たり3,447.85円）であり、うち1,513,704円(１万口当たり80円)を分配金額としております。
(2020年12月18日から2021年1月18日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（611,474円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（54,928,622円）及び分配準備積立金（1,104,914円）より、分配対象額は56,645,010円（１万口当たり3,642.15円）であり、うち1,244,204円(１万口当たり80円)を分配金額としております。	(2021年6月18日から2021年7月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（690,027円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（61,895,793円）及び分配準備積立金（409,761円）より、分配対象額は62,995,581円（１万口当たり3,405.15円）であり、うち1,480,000円(１万口当たり80円)を分配金額としております。
(2021年1月19日から2021年2月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（782,279円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（64,361,863円）及び分配準備積立金（1,059,622円）より、分配対象額は66,203,764円（１万口当たり3,604.73円）であり、うち1,469,257円(１万口当たり80円)を分配金額としております。	(2021年7月20日から2021年8月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（695,936円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（61,298,706円）及び分配準備積立金（359,788円）より、分配対象額は62,354,430円（１万口当たり3,362.70円）であり、うち1,483,426円(１万口当たり80円)を分配金額としております。

(2021年2月18日から2021年3月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（722,665円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（63,821,445円）及び分配準備積立金（1,105,692円）より、分配対象額は65,649,802円（１万口当たり3,564.08円）であり、うち1,473,586円(１万口当たり80円)を分配金額としております。	(2021年8月18日から2021年9月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（679,717円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（61,011,419円）及び分配準備積立金（496,789円）より、分配対象額は62,187,925円（１万口当たり3,319.47円）であり、うち1,498,736円(１万口当たり80円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	前期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	当期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3．　金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
前期（自 2020年9月18日　至 2021年3月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△872,424円
親投資信託受益証券	―円
合計	△872,424円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

当期（自 2021年3月18日　至 2021年9月17日）
売買目的有価証券

種　類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△37,026円
親投資信託受益証券	2円
合計	△37,024円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

（1口当たり情報に関する注記）

前期 [2021年 3月17日現在]	当期 [2021年 9月17日現在]
1口当たり純資産額　0.5173円 （1万口当たり純資産額　5,173円）	1口当たり純資産額　0.4961円 （1万口当たり純資産額　4,961円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
投資信託受益証券	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund Resources Currency Basket Class Units	17,800.9988	91,319,123	
投資信託受益証券　合計		17,800.9988	91,319,123	
親投資信託受益証券	東京海上マネーマザーファンド	9,915.0000	10,029	
親投資信託受益証券　合計		9,915.0000	10,029	
合計		27,715.9988	91,329,152	

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンド】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第19期 [2021年 3月17日現在]	第20期 [2021年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	3,828,524	3,301,077
流動資産合計	3,828,524	3,301,077
資産合計	3,828,524	3,301,077
負債の部		
流動負債		
未払委託者報酬	－	5
流動負債合計	－	5
負債合計	－	5
純資産の部		
元本等		
元本	※1 3,814,561	※1 3,289,384
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	13,963	11,688
（分配準備積立金）	18,320	8,370
元本等合計	3,828,524	3,301,072
純資産合計	3,828,524	3,301,072
負債純資産合計	3,828,524	3,301,077

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	第20期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
営業収益		
有価証券売買等損益	△1	△327
営業収益合計	△1	△327
営業費用		
委託者報酬	－	5
営業費用合計	－	5
営業利益又は営業損失（△）	△1	△332
経常利益又は経常損失（△）	△1	△332
当期純利益又は当期純損失（△）	△1	△332
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△414	150
期首剰余金又は期首欠損金（△）	18,268	13,963
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,655	300,538
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	15,655	300,538
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,373	302,331
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,373	302,331
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	※1 －	※1 －
期末剰余金又は期末欠損金（△）	13,963	11,688

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	第20期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

第20期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第19期 [2021年 3月17日現在]	第20期 [2021年 9月17日現在]
1.※1　期首元本額	5,010,256円	3,814,561円
期中追加設定元本額	4,497,459円	81,226,809円
期中一部解約元本額	5,693,154円	81,751,986円
2.※1　計算期間末日における受益権の総数	3,814,561口	3,289,384口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第19期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	第20期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（13,991円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（99,930円）及び分配準備積立金（4,329円）より、分配対象額は118,250円（１万口当たり309.97円）でありますが、分配を行っておりません。	※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（8,307円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（103,736円）及び分配準備積立金（63円）より、分配対象額は112,106円（１万口当たり340.80円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	第19期 自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	第20期 自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2．金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3．金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	第19期 [2021年 3月17日現在]	第20期 [2021年 9月17日現在]
1．貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左

	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
第19期（自 2020年9月18日　至 2021年3月17日）
売買目的有価証券

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	756円
合計	756円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

第20期（自 2021年3月18日　至 2021年9月17日）
売買目的有価証券

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	△1円
合計	△1円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

（1口当たり情報に関する注記）

第19期 [2021年 3月17日現在]	第20期 [2021年 9月17日現在]
1口当たり純資産額　1.0037円 （1万口当たり純資産額　10,037円）	1口当たり純資産額　1.0036円 （1万口当たり純資産額　10,036円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
親投資信託受益証券	東京海上マネーマザーファンド	3,263,547	3,301,077	

親投資信託受益証券　合計	3,263,547	3,301,077	
合計	3,263,547	3,301,077	

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（ご参考）
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）は「Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund JPY Class Units」を、米ドルコース（毎月分配型）は「USD Class Units」を、ユーロコース（毎月分配型）は「EUR Class Units」を、豪ドルコース（毎月分配型）は「AUD Class Units」を、ブラジル・レアルコース（毎月分配型）は「BRL Class Units」を、メキシコ・ペソコース（毎月分配型）は「MXN Class Units」を、トルコ・リラコース（毎月分配型）は「TRY Class Units」を、ロシア・ルーブルコース（毎月分配型）は「RUB Class Units」を、資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）は「Resources Currency Basket Class Units」を、主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」はこれらファンドの受益証券です。
また、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）、米ドルコース（毎月分配型）、ユーロコース（毎月分配型）、豪ドルコース（毎月分配型）、ブラジル・レアルコース（毎月分配型）、メキシコ・ペソコース（毎月分配型）、トルコ・リラコース（毎月分配型）、ロシア・ルーブルコース（毎月分配型）、資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）、マネープール・ファンドは、「東京海上マネーマザーファンド」を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同ファンドの受益証券です。なお、これら投資信託受益証券及び親投資信託受益証券の状況は次のとおりです。
なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

「Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund」の状況

当投資信託は、ケイマンの法律に基づき設立された複数の通貨クラスを持つ円建て外国投資信託です。同ファンドの財務書類は、ルクセンブルグにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠して作成され、独立監査人の監査を受けております。以下に記載した情報は、委託会社が同投資信託の管理会社であるMitsubishi UFJ Investor Services & Banking (Luxembourg) S.A.から入手した2021年2月28日現在の財務書類の一部を抜粋・翻訳したものです。
なお、開示情報につきましては、各通貨クラスを合算した単位（Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund）の純資産計算書、重要な会計方針に関する注記、及び投資有価証券明細表を掲載しております。

(1)純資産計算書

	2021年2月28日現在 金額（円）
資産：	
投資有価証券（取得原価）	35,328,338,693
未実現利益	2,315,556,543
投資有価証券（時価）	37,643,895,236
現預金	495,002,159
ブローカーへの預け金	6,392,400
未収利息	428,208,111
追加設定に係る未収入金	50,437,337
為替予約取引に係る未実現利益	512,760,192
資産合計	39,136,695,435
負債：	
未払費用	69,924,365
未払解約金	20,000,000
為替予約取引に係る未実現損失	819,873,610
その他負債	11,440,691
負債合計	921,238,666
純資産総額	38,215,456,769

各通貨クラスの基準価額

Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund

AUD Class Units	8,429
Resources Currency Basket Class Units	5,001
BRL Class Units	2,271
EUR Class Units	11,675
JPY Class Units	8,863
MXN Class Units	5,154
RUB Class Units	3,585
TRY Class Units	1,576
USD Class Units	14,617

(2)重要な会計方針に関する注記

当財務書類は、ルクセンブルグにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠して作成しております。

現金及び現金同等物

現金及び現金同等物は当座預金の現金から成っております。

有価証券の評価

株式市場に上場又は組織的市場で取引されている有価証券については、当該株式市場又は組織的市場における入手可能な最終相場にて評価しています。ただし、関連する株式市場以外又は店頭市場においてプレミアム価格やディスカウント価格により取得又は取引された銘柄については、評価日におけるプレミアムやディスカウントの水準を考慮して評価します。
非上場有価証券については、ファンドマネジャーが適切だと判断する、直近に行われた同銘柄又は類似した銘柄の取引や、ブローカーや評価機関から入手した評価情報を考慮に入れ、ファンドマネジャーが誠実に判断した公正な市場価格にて評価しています。

有価証券取引

有価証券取引は約定日に計上しています。オプション、先物及び債券の実現損益は、平均原価法を用いて算出しています。

外貨取引

当ファンドの基準通貨は日本円です。

外貨建資産及び負債は期末日現在に適用される為替レートで日本円に換算しています。外貨取引については、約定日に適用される為替レートで日本円に換算しています。

2021年2月28日現在の為替レートは下記のとおりです。

1 USD =	1.291656 AUD	1 JPY =	0.009386 USD
1 USD =	5.573050 BRL	1 JPY =	0.006714 GBP
1 USD =	6.460000 CNY	1 JPY =	0.007733 EUR
1 USD =	0.823859 EUR	1 JPY =	0.012124 AUD
1 USD =	0.715256 GBP		
1 USD =	14,240.000000 IDR		
1 USD =	106.540000 JPY		
1 USD =	20.910500 MXN		
1 USD =	74.537500 RUB		
1 USD =	7.418000 TRY		
1 USD =	15.146250 ZAR		

利息配当の認識

受取利息については発生主義に基づき計上しています。

(3)投資有価証券明細表

2021年2月28日現在
（単位：円）

株式以外の有価証券

発行国 銘柄名	通貨	額面金額	簿価金額	評価金額	投資比率(%)
AUSTRALIA					
AUSTRALIA AND NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD.FRN 05/05/2031	EUR	4,500,000	569,080,991	579,173,776	1.52%
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA FRN 09/12/2034	USD	3,400,000	363,970,009	383,466,654	1.00%
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD. 2.332% 08/21/2030	USD	3,600,000	381,852,016	374,925,768	0.98%
			1,314,903,016	1,337,566,198	3.50%
AUSTRIA					
BAWAG GROUP AG FRN 03/26/2029	EUR	4,000,000	504,988,434	534,725,799	1.40%
ERSTE GROUP BANK AG FRN PERPETUAL	EUR	1,200,000	164,173,234	162,576,320	0.43%
ERSTE GROUP BANK AG FRN PERPETUAL	EUR	1,600,000	198,086,195	215,193,848	0.56%
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG FRN 06/18/2032	EUR	1,800,000	218,898,549	249,672,163	0.65%
UNIQA INSURANCE GROUP AG 1.375% 07/09/2030	EUR	1,900,000	229,657,266	264,714,850	0.69%
VOLKSBANK WIEN AG FRN 10/06/2027	EUR	1,100,000	136,932,717	144,543,148	0.38%
			1,452,736,395	1,571,426,128	4.11%
BELGIUM					
AGEAS FRN 07/02/2049	EUR	1,700,000	215,180,494	247,776,228	0.65%
AGEAS SA FRN PERPETUAL	EUR	1,400,000	172,214,561	186,705,037	0.49%
KBC GROUP NV FRN 09/18/2029	EUR	900,000	117,137,187	120,949,939	0.32%
KBC GROUP NV FRN 12/03/2029	EUR	3,000,000	351,000,708	386,298,189	1.00%

			855,532,950	941,729,393	2.46%
BRITISH VIRGIN ISLANDS					
CHINA HUARONG INTERNATIONAL HOLDINGS 3.625% 09/30/2030	USD	1,300,000	136,649,924	139,907,796	0.37%
PEAK REINSURANCE COMPANY FRN PERPETUAL	USD	1,750,000	184,730,007	196,788,970	0.51%
			321,379,931	336,696,766	0.88%
CANADA					
BANK OF MONTREAL FRN 12/15/2032	USD	3,710,000	418,246,836	441,959,820	1.16%
			418,246,836	441,959,820	1.16%
CAYMAN ISLANDS					
AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD. 2.125% 02/21/2026	USD	3,250,000	332,732,013	332,920,722	0.87%
AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD. 4.25% 04/15/2026	USD	700,000	73,198,199	78,902,033	0.21%
AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD. 4.375% 05/01/2026	USD	655,000	74,560,989	73,995,845	0.19%
AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD. 5.5% 01/15/2026	USD	570,000	67,854,754	67,154,623	0.18%
MAR SUKUK LTD. 2.21% 09/02/2025	USD	2,000,000	212,289,999	219,250,798	0.57%
QNB FINANCE LTD 2.75% 02/12/2027	USD	2,300,000	251,941,731	257,272,048	0.67%
XLIT LTD FRN 06/29/2047	EUR	1,200,000	147,662,895	174,030,302	0.46%
			1,160,240,580	1,203,526,371	3.15%
CHINA					
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP. FRN 06/24/2030	USD	5,250,000	563,136,140	568,899,631	1.49%
			563,136,140	568,899,631	1.49%
DENMARK					
DANSKE BANK A/S FRN 05/15/2031	EUR	3,000,000	380,237,162	384,075,208	1.01%
DANSKE BANK A/S FRN 06/21/2029	EUR	2,250,000	279,812,950	306,861,543	0.80%
JYSKE BANK A/S FRN 01/28/2031	EUR	2,250,000	272,639,083	291,102,821	0.76%
			932,689,195	982,039,572	2.57%
FINLAND					
SAMPO OYJ FRN 09/03/2052	EUR	1,550,000	194,383,740	210,984,603	0.55%
			194,383,740	210,984,603	0.55%
FRANCE					
AXA SA FRN PERPETUAL	GBP	4,700,000	854,967,509	808,685,487	2.11%
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 2.375% 03/24/2026	EUR	2,600,000	341,110,482	365,825,558	0.96%
BNP PARIBAS SA 4.375% 09/28/2025	USD	5,650,000	646,514,116	676,021,074	1.77%
BPCE SA 4.5% 03/15/2025	USD	6,240,000	692,056,012	741,256,060	1.94%
CNP ASSURANCES FRN 07/27/2050	EUR	2,300,000	274,710,913	307,324,567	0.80%
CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA FRN 01/29/2048	EUR	2,000,000	272,543,704	274,953,881	0.72%
CRÉDIT AGRICOLE S.A. FRN PERPETUAL	EUR	1,400,000	174,581,833	196,231,654	0.51%
CREDIT AGRICOLE SA 4.375% 03/17/2025	USD	6,400,000	777,075,880	758,728,449	1.99%

LA BANQUE POSTALE FRN 08/02/2032	EUR	3,000,000	379,425,930	381,382,802	1.00%
LA MONDIALE 0.75% 04/20/2026	EUR	1,400,000	173,043,965	181,851,206	0.48%
			4,586,030,344	4,692,260,738	12.28%
GERMANY					
DEUTSCHE BANK AG FRN 02/17/2032	EUR	1,300,000	164,493,469	167,449,678	0.44%
DEUTSCHE BANK AG FRN 09/03/2026	EUR	3,300,000	412,439,286	439,932,546	1.15%
HANNOVER RUECK SE FRN 10/09/2039	EUR	1,700,000	198,098,357	219,001,236	0.57%
LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 3.625% 06/16/2025	EUR	1,980,000	275,882,567	282,694,716	0.74%
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN FRN 05/26/2049	EUR	2,000,000	267,453,226	299,107,944	0.78%
MUNICH REINSURANCE COMPANY FRN 05/26/2041	EUR	700,000	86,490,485	90,677,570	0.24%
			1,404,857,390	1,498,863,690	3.92%
IRELAND					
AIB GROUP PLC 1.25% 05/28/2024	EUR	1,000,000	120,565,623	133,781,025	0.35%
AIB GROUP PLC FRN 05/30/2031	EUR	1,550,000	190,410,454	210,271,025	0.55%
BANK OF IRELAND GROUP PLC FRN 10/14/2029	EUR	3,600,000	443,282,716	477,407,796	1.25%
ZURICH FINANCE FRN 04/19/2051	USD	1,800,000	187,560,000	188,789,946	0.49%
			941,818,793	1,010,249,792	2.64%
ITALY					
ASSICURAZIONI GENERALI FRN 06/08/2048	EUR	2,550,000	378,289,811	392,310,712	1.03%
ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.124% 10/01/2030	EUR	800,000	94,550,296	108,965,628	0.29%
UNICREDIT SPA FRN 09/23/2029	EUR	4,550,000	562,443,768	586,262,168	1.53%
			1,035,283,875	1,087,538,508	2.85%
JAPAN					
DAI-ICHI LIFE INSURANCE CO LTD/THE FRN PERPETUAL	USD	6,910,000	796,992,374	817,039,944	2.13%
MITSUI SUMITOMO INSURANCE CO LTD FRN PERPETUAL	USD	3,100,000	343,774,504	381,915,645	1.00%
NIPPON LIFE INSURANCE FRN 01/21/2051	USD	3,000,000	311,805,000	312,144,090	0.82%
SOMPO JAPAN NIPPONKOA INSURANCE INC FRN 03/28/2073	USD	1,290,000	125,730,568	148,104,430	0.39%
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 3.202% 09/17/2029	USD	2,730,000	292,888,035	306,775,270	0.80%
			1,871,190,481	1,965,979,379	5.14%
JERSEY					
HASTINGS GROUP FINANCE PLC 3% 05/24/2025	GBP	2,800,000	368,529,829	445,168,014	1.16%
			368,529,829	445,168,014	1.16%
LUXEMBOURG					
SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG SA FRN PERPETUAL	USD	1,800,000	191,312,364	199,799,577	0.52%
			191,312,364	199,799,577	0.52%

MEXICO					
BANCO SANTANDER (MEXICO) S.A. 5.375% 04/17/2025	USD	4,850,000	583,481,444	588,677,291	1.54%
			583,481,444	588,677,291	1.54%
NETHERLANDS					
AEGON NV FRN PERPETUAL	USD	2,000,000	186,437,645	190,706,601	0.50%
ARGENTUM NETHERLANDS B.V. FRN PERPETUAL	USD	1,800,000	192,480,207	196,090,706	0.51%
ASR NEDERLAND NV FRN 05/02/2049	EUR	2,250,000	283,695,075	323,938,342	0.85%
COÖPERATIEVE RABOBANK FRN PERPETUAL	EUR	1,200,000	145,657,442	171,108,221	0.45%
DIGITAL DUTCH FINCO B.V. 1% 01/15/2032	EUR	1,000,000	124,200,604	127,374,599	0.33%
ELM BV FOR HELVETIA SCHWEIZERISCHE VERSICHERUNGSGESELLSCHAFT AG FRN 09/29/2047	EUR	950,000	115,872,577	138,243,280	0.36%
ING GROEP NV FRN 05/26/2031	EUR	1,200,000	141,564,503	164,250,733	0.43%
NN GROUP NV FRN PERPETUAL	EUR	3,300,000	461,773,159	485,176,606	1.27%
VOLKSBANK NV FRN 10/22/2030	EUR	3,800,000	479,510,696	516,441,750	1.35%
			2,131,191,908	2,313,330,838	6.05%
NORWAY					
DNB BANK ASA FRN PERPETUAL	USD	2,000,000	218,496,472	223,910,858	0.59%
			218,496,472	223,910,858	0.59%
SINGAPORE					
DBS GROUP HOLDINGS LTD FRN 04/11/2028	EUR	3,700,000	483,456,916	488,171,487	1.28%
DBS GROUP HOLDINGS LTD FRN PERPETUAL	USD	1,800,000	201,762,010	197,954,730	0.52%
UNITED OVERSEAS BANK LTD FRN 04/15/2029	USD	2,000,000	222,085,615	229,455,199	0.60%
			907,304,541	915,581,416	2.40%
SPAIN					
BANCO SANTANDER SA 3.125% 01/19/2027	EUR	3,000,000	364,610,750	437,050,430	1.15%
MAPFRE SA FRN 03/31/2047	EUR	600,000	71,996,318	89,329,686	0.23%
			436,607,068	526,380,116	1.38%
SUPRANATIONAL					
BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEVELOPPEMENT 2.75% 01/22/2033	EUR	400,000	49,925,955	53,358,263	0.14%
			49,925,955	53,358,263	0.14%
SWITZERLAND					
CREDIT SUISSE GROUP AG FRN 06/09/2028	GBP	2,800,000	382,293,772	431,688,311	1.13%
UBS GROUP AG FRN PERPETUAL	USD	1,700,000	184,074,201	193,243,851	0.51%
			566,367,973	624,932,162	1.64%
UNITED KINGDOM					
AVIVA PLC FRN 06/03/2055	GBP	2,000,000	285,230,621	321,981,025	0.84%
BARCLAYS PLC FRN 02/07/2028	EUR	1,550,000	193,290,076	205,318,071	0.54%

HSBC BANK PLC FRN PERPETUAL	USD	2,300,000	197,620,996	217,898,699	0.57%
HSBC HOLDINGS FRN PERPETUAL	USD	1,750,000	183,481,597	189,346,085	0.50%
HSBC HOLDINGS PLC 6.8% 06/01/2038	USD	3,050,000	430,633,498	471,091,916	1.23%
HSBC HOLDINGS PLC 6% 03/29/2040	GBP	800,000	141,259,280	165,092,992	0.43%
LLOYDS BANK PLC FRN PERPETUAL	GBP	1,300,000	190,305,323	199,355,895	0.52%
M&G PLC FRN 07/20/2055	GBP	1,200,000	187,906,361	203,602,257	0.53%
M&G PLC FRN 10/20/2051	GBP	1,250,000	188,771,192	215,103,856	0.56%
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY FRN 07/18/2030	USD	2,400,000	259,334,521	287,182,407	0.75%
PHOENIX GROUP HOLDINGS FRN 09/04/2031	USD	600,000	64,575,003	68,251,655	0.18%
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC 4.375% 01/24/2029	EUR	2,870,000	380,970,967	430,986,542	1.13%
RL FINANCE BONDS NO 4 PLC FRN 10/07/2049	GBP	1,200,000	156,582,293	194,116,298	0.51%
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC FRN 05/18/2029	USD	2,500,000	275,799,985	310,697,277	0.81%
SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC5.625% 09/15/2045	USD	1,500,000	194,703,578	203,239,967	0.53%
STANDARD CHARTERED PLC 4.3% 02/19/2027	USD	5,950,000	594,216,645	700,492,886	1.84%
STANDARD CHARTERED PLC 5.3% 01/09/2043	USD	1,150,000	139,193,730	149,735,365	0.39%
VIRGIN MONEY UK FRN 06/22/2025	GBP	2,650,000	381,572,058	411,546,294	1.08%
ZURICH FINANCE UK PLC FRN 10/29/2049	GBP	760,000	128,521,899	122,292,791	0.32%
			4,573,969,623	5,067,332,278	13.26%

UNITED STATES OF AMERICA

AMERICAN HOMES 4 RENT LP 4.25% 02/15/2028	USD	3,150,000	355,353,340	376,641,648	0.99%
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP FRN 04/01/2048	USD	1,600,000	184,324,937	193,781,772	0.51%
ATHENE GLOBAL FUNDING 2.45% 08/20/2027	USD	4,700,000	494,950,896	519,430,552	1.36%
AVIATION CAPITAL GROUP 3.5% 11/01/2027	USD	1,372,000	152,550,606	152,515,322	0.40%
AVIATION CAPITAL GROUP CORP. 4.875% 10/01/2025	USD	1,828,000	211,978,802	215,163,510	0.56%
BANK OF AMERICA CORP 7.75% 05/14/2038	USD	2,950,000	496,152,228	501,855,836	1.31%
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 1.65% 06/12/2029	EUR	2,100,000	254,547,631	288,047,095	0.75%
CHUBB INA HOLDINGS INC 2.5% 03/15/2038	EUR	2,600,000	339,008,298	409,511,591	1.07%
CITIGROUP INC 8.125% 07/15/2039	USD	1,030,000	169,137,062	184,568,059	0.48%
CNA FINANCIAL 2.05% 08/15/2030	USD	4,100,000	436,147,216	429,562,890	1.12%
DIGITAL REALTY TRUST LP 4.45% 07/15/2028	USD	3,400,000	374,346,143	422,153,459	1.10%
DISCOVER BANK FRN 08/09/2028	USD	5,250,000	583,763,733	595,002,677	1.56%
EQUITABLE HOLDINGS INC 5% 04/20/2048	USD	1,850,000	206,726,207	245,570,967	0.64%
FIRST HORIZON BANK 5.75% 05/01/2030	USD	1,550,000	186,916,888	203,666,766	0.53%
GOLDMAN SACHS CAPITAL I 6.345% 02/15/2034	USD	5,150,000	718,749,937	764,120,599	2.01%
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE FRN 02/12/2047	USD	1,740,000	187,797,158	175,248,606	0.46%
HSBC BANK USA NA 7% 01/15/2039	USD	3,000,000	413,185,215	482,290,601	1.26%
JPMORGAN CHASE & CO. FRN 05/13/2031	USD	3,400,000	360,570,015	377,504,249	0.99%
LEXINGTON REALTY TRUST 2.7% 09/15/2030	USD	1,350,000	143,416,924	144,864,570	0.38%
METLIFE INC 6.4% 12/15/2036	USD	2,000,000	253,434,756	268,480,801	0.70%
MORGAN STANLEY 3.95% 04/23/2027	USD	3,010,000	332,483,716	362,406,572	0.95%
NASDAQ INC 3.25% 04/28/2050	USD	900,000	95,011,345	95,297,260	0.25%

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC. FRN 05/15/2055	USD	1,850,000	188,914,600	193,896,142	0.51%
PRUDENTIAL FINANCIAL INC FRN 06/15/2043	USD	4,150,000	390,045,442	474,231,596	1.24%
SYNOVUS BANK GA FRN 10/29/2030	USD	1,750,000	183,408,741	198,030,693	0.52%
TRUIST BANK FRN 09/17/2029	USD	5,000,000	535,800,014	561,860,001	1.47%
			8,248,721,850	8,835,703,834	23.12%
TOTAL INVESTMENTS IN SECURITIES			**35,328,338,693**	**37,643,895,236**	**98.50%**

「東京海上マネーマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区　　分	注記番号	[2021年 3月17日現在] 金額（円）	[2021年 9月17日現在] 金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		7,132,508	3,634,915
地方債証券		5,001,400	7,998,840
未収利息		16,020	1,048
前払費用		15,189	1,775
流動資産合計		12,165,117	11,636,578
資産合計		12,165,117	11,636,578
負債の部			
流動負債			
未払利息		4	3
流動負債合計		4	3
負債合計		4	3
純資産の部			
元本等			
元本	※1	12,025,416	11,504,340
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		139,697	132,235
元本等合計		12,165,113	11,636,575
純資産合計		12,165,113	11,636,575
負債純資産合計		12,165,117	11,636,578

(2) 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	地方債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	[2021年 3月17日現在]	[2021年 9月17日現在]
1.※1　本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	14,203,918円	12,025,416円
同期中における追加設定元本額	4,461,888円	80,592,476円
同期中における一部解約元本額	6,640,390円	81,113,552円
同期末における元本額	12,025,416円	11,504,340円
元本の内訳＊		
東京海上・東南アジア株式ファンド	1,100,000円	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	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	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）米ドルコース（毎月分配型）	9,915円	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	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）豪ドルコース（毎月分配型）	991,474円	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	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）資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）	9,915円	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）マネープール・ファンド	3,784,623円	3,263,547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	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	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	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	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	9,896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	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	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	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	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	494,511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	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	9,890円
計	12,025,416円	11,504,340円
2.※1　本書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	12,025,416口	11,504,340口

（注）＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

区　分	自 2020年 9月18日 至 2021年 3月17日	自 2021年 3月18日 至 2021年 9月17日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2．　金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

3．　金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　分	[2021年 3月17日現在]	[2021年 9月17日現在]
1．　貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．　時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
（自 2020年9月18日　至 2021年3月17日）
売買目的有価証券

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額
地方債証券	△16,000円
合計	△16,000円

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年8月18日から2021年3月17日まで)を指しております。

（自 2021年3月18日　至 2021年9月17日）
売買目的有価証券

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額
地方債証券	1,400円
合計	1,400円

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2021年8月17日から2021年9月17日まで)を指しております。

（1口当たり情報に関する注記）

[2021年 3月17日現在]	[2021年 9月17日現在]
1口当たり純資産額　1.0116円 （1万口当たり純資産額　10,116円）	1口当たり純資産額　1.0115円 （1万口当たり純資産額　10,115円）

(3) 附属明細表
第1　有価証券明細表
(1)株式
該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備　考
地方債証券	第１３回せたがや区民債	5,000,000	4,999,200	
	第１４回なごやか市民債	3,000,000	2,999,640	
地方債証券　合計		8,000,000	7,998,840	
合計		8,000,000	7,998,840	

第2　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

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）

2021年9月30日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	7,819,421,624 円
Ⅱ　負債総額	20,965,703 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	7,798,455,921 円
Ⅳ　発行済数量	9,917,319,591 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.7863 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）

2021年9月30日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	4,952,629,254 円
Ⅱ　負債総額	1,787,415 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,950,841,839 円
Ⅳ　発行済数量	3,653,483,905 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3551 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）

2021年9月30日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	16,532,253 円
Ⅱ　負債総額	6,007 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	16,526,246 円
Ⅳ　発行済数量	17,097,112 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9666 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）

2021年9月30日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	1,354,261,719 円
Ⅱ　負債総額	6,340,567 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,347,921,152 円
Ⅳ　発行済数量	2,009,662,343 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.6707 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）

2021年9月30日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	1,199,987,644 円
Ⅱ　負債総額	1,071,742 円

Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,198,915,902 円
Ⅳ　発行済数量	6,848,401,416 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.1751 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）

2021年9月30日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	542,217,057 円
Ⅱ　負債総額	202,259 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	542,014,798 円
Ⅳ　発行済数量	955,478,411 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.5673 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）

2021年9月30日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	2,244,168,002 円
Ⅱ　負債総額	5,370,928 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,238,797,074 円
Ⅳ　発行済数量	16,500,201,527 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.1357 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）

2021年9月30日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	288,766,939 円
Ⅱ　負債総額	103,907 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	288,663,032 円
Ⅳ　発行済数量	691,005,432 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.4177 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）

2021年9月30日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	90,848,630 円
Ⅱ　負債総額	33,536 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	90,815,094 円
Ⅳ　発行済数量	185,610,541 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.4893 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）マネープール・ファンド

2021年9月30日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	3,301,072 円
Ⅱ　負債総額	― 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,301,072 円
Ⅳ　発行済数量	3,289,384 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0036 円

（ご参考：親投資信託の現況）
東京海上マネーマザーファンド

2021年9月30日 現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	11,636,879 円
Ⅱ　負債総額	5 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	11,636,874 円
Ⅳ　発行済数量	11,504,335 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0115 円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、振替受益権となり、委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

１．名義書換
該当事項はありません。

２．受益者に対する特典
特典はありません。

３．内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

４．受益権の譲渡
①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
②上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
③上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

５．受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

６．受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

７．償還金
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）にお支払いします。

８．質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

2021年９月末日現在、資本金の額は20億円です。なお、会社の発行可能株式総数は160,000株であり、38,300株を発行済みです。

委託会社業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役の選任は株主総会において、議決権を行使することができる株主の３分の１以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもってこれを行い、累積投票によらないものとします。取締役の任期は、選任後１年内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役中より代表取締役を選任します。

投資信託の投資運用の意思決定プロセスは以下の通りです。

①運用本部で運用計画案、収益分配方針案等の運用の基本方針案を作成します。
②運用の基本方針は、運用本部長を委員長とする投資政策委員会で投資環境見通し等をふまえて決定されます。
③決定された運用の基本方針に基づき、具体的運用計画を策定し、運用を行います。
④売買の執行はトレーディング部が行います。
⑤運用部門とは独立した運用リスク管理部門にて運用評価、ガイドライン遵守状況のチェックを行い、運用リスク管理部門担当役員を委員長としリスク管理部を事務局とする運用管理委員会に結果報告します。
⑥運用管理委員会から投資政策委員会へ運用評価、ガイドライン遵守状況がフィードバックされ次の基本方針決定に生かされます。

２【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

2021年９月末日現在、委託会社が運用を行っている証券投資信託（親投資信託を除きます。）は次の通りです。

	本数	純資産総額（百万円）
追加型公社債投資信託	0	0
追加型株式投資信託	170	2,925,642
単位型公社債投資信託	2	5,195
単位型株式投資信託	11	39,647
合計	183	2,970,485

3【委託会社等の経理状況】

１．　当社の財務諸表は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第２条により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

２．　当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第36期事業年度（2020年４月１日から2021年３月31日まで）の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

（単位：千円）

	第35期 （2020年３月31日現在）		第36期 （2021年３月31日現在）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		19,928,671		22,550,090
前払費用		207,883		235,902
未収委託者報酬		2,864,007		2,973,733
未収収益		2,126,212		2,375,688
未収入金		101,676		3,865
その他の流動資産		22,090		21,479
流動資産計		25,250,541		28,160,759
固定資産				
有形固定資産	＊1	576,200	＊1	530,601
建物		388,342		354,556
器具備品		187,858		176,045
無形固定資産		5,385		137,430
電話加入権		3,795		3,795
ソフトウエア		-		89,839
ソフトウエア仮勘定		1,590		43,795
投資その他の資産		2,987,389		3,057,965
投資有価証券		65,610		49,477
関係会社株式		1,673,049		1,673,049
その他の関係会社有価証券		31,200		71,200
長期前払費用		32,906		45,424
敷金		450,632		474,324
その他長期差入保証金		10,030		10,030
繰延税金資産		723,961		734,459
固定資産計		3,568,975		3,725,997
資産合計		28,819,517		31,886,757
負債の部				
流動負債				
未払金		2,555,940		2,979,963
未払手数料		1,315,027		1,349,326
その他未払金		1,240,912		1,630,636
未払費用		544,639		429,654
未払消費税等		367,506		468,610
未払法人税等		1,347,000		1,378,000
預り金		43,576		45,524
前受収益		3,128		2,329
賞与引当金		244,679		273,836
その他の流動負債		-		946
流動負債計		5,106,470		5,578,864
固定負債				
退職給付引当金		750,413		802,176
固定負債計		750,413		802,176
負債合計		5,856,883		6,381,041
純資産の部				
株主資本		22,965,811		25,499,322
資本金		2,000,000		2,000,000
資本剰余金		400,000		400,000
その他資本剰余金		400,000		400,000
利益剰余金		20,565,811		23,099,322
利益準備金		500,000		500,000
その他利益剰余金		20,065,811		22,599,322
特別償却準備金		0		0
繰越利益剰余金		20,065,811		22,599,322

評価・換算差額等	△ 3,177	6,393
その他有価証券評価差額金	△ 3,177	6,393
純資産合計	22,962,634	25,505,715
負債・純資産合計	28,819,517	31,886,757

(2)【損益計算書】

（単位：千円）

	第35期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）		第36期 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	
営業収益				
委託者報酬		16,536,369		17,997,091
運用受託報酬		9,077,029		9,745,973
投資助言報酬		60,786		59,827
その他営業収益		412,354		453,173
営業収益計		26,086,540		28,256,066
営業費用				
支払手数料		7,818,291		8,444,858
広告宣伝費		254,153		233,667
調査費		5,425,141		6,150,198
調査費		2,525,312		2,540,308
委託調査費		2,899,828		3,609,889
委託計算費		122,584		118,443
営業雑経費		285,550		278,728
通信費		35,052		44,106
印刷費		205,117		189,670
協会費		24,696		26,080
諸会費		12,157		10,102
図書費		8,525		8,768
営業費用計		13,905,720		15,225,895
一般管理費				
給料		3,509,999		3,799,821
役員報酬		112,566		129,108
給料・手当		2,541,727		2,761,131
賞与		855,706		909,581
交際費		17,797		4,415
寄付金		5,833		3,449
旅費交通費		174,094		13,735
租税公課		164,117		170,294
不動産賃借料		375,694		375,691
退職給付費用		466,387		156,614
賞与引当金繰入		244,679		273,836
固定資産減価償却費		118,517		139,782
法定福利費		580,893		596,481
福利厚生費		9,971		10,114
諸経費		482,967		394,336
一般管理費計		6,150,953		5,938,574
営業利益		6,029,866		7,091,595
営業外収益				
受取利息		434		455
受取配当金	＊１	4,704	＊１	7,512
匿名組合投資利益	＊１	39,334	＊１	60,878
雑益		10,094		9,958
営業外収益計		54,568		78,804
営業外費用				
為替差損		15,577		44,450
雑損		5,174		5,811
営業外費用計		20,752		50,261
経常利益		6,063,682		7,120,138

特別損失		
器具備品除却損	545	0
特別損失計	545	0
税引前当期純利益	6,063,137	7,120,138
法人税、住民税及び事業税	2,044,481	2,197,641
法人税等調整額	△ 188,875	△ 14,721
法人税等合計	1,855,605	2,182,919
当期純利益	4,207,531	4,937,219

(3)【株主資本等変動計算書】

第35期（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金	
					特別償却準備金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	16	17,875,907
当期変動額						
剰余金の配当						△ 2,017,644
特別償却準備金の取崩					△ 16	16
当期純利益						4,207,531
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	△ 16	2,189,903
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	0	20,065,811

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
	利益剰余金合計				
当期首残高	18,375,924	20,775,924	2,096	2,096	20,778,021
当期変動額					
剰余金の配当	△ 2,017,644	△ 2,017,644			△ 2,017,644
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	4,207,531	4,207,531			4,207,531
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			△ 5,273	△ 5,273	△ 5,273
当期変動額合計	2,189,887	2,189,887	△ 5,273	△ 5,273	2,184,613
当期末残高	20,565,811	22,965,811	△ 3,177	△ 3,177	22,962,634

第36期（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金	
					特別償却準備金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	0	20,065,811
当期変動額						
剰余金の配当						△ 2,403,708
特別償却準備金の取崩					△ 0	0
当期純利益						4,937,219
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	△ 0	2,533,511
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	0	22,599,322

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
	利益剰余金合計				
当期首残高	20,565,811	22,965,811	△ 3,177	△ 3,177	22,962,634
当期変動額					
剰余金の配当	△ 2,403,708	△ 2,403,708			△ 2,403,708
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	4,937,219	4,937,219			4,937,219
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			9,570	9,570	9,570
当期変動額合計	2,533,511	2,533,511	9,570	9,570	2,543,081
当期末残高	23,099,322	25,499,322	6,393	6,393	25,505,715

注記事項

（重要な会計方針）

第36期
自　2020年４月１日
至　2021年３月31日

１．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券

移動平均法による原価法

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法
（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価を把握することが極めて困難と認められるもの

移動平均法による原価法

２．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、2016年４月１日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。また、取得価額が10万円以上20万円未満の少額減価償却資産については、一括償却資産として３年間で均等償却する方法を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウエアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

３．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当期負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

① 退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。

② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。
過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理しております。

４．消費税等の会計処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

（重要な会計上の見積り）

第36期 自　2020年４月１日 至　2021年３月31日
当事業年度の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌事業年度の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

（未適用の会計基準等）

第36期 自　2020年４月１日 至　2021年３月31日
・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号　平成30年３月30日） ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号　平成30年３月30日） (1) 概要 収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の５つのステップを適用し認識されます。 ステップ1 ： 顧客との契約を識別する。 ステップ2 ： 契約における履行義務を識別する。 ステップ3 ： 取引価格を算定する。 ステップ4 ： 契約における履行義務に取引価格を配分する。 ステップ5 ： 履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。 (2) 適用予定日 2022年３月期の期首より適用予定であります。 (3) 当該会計基準等の適用による影響 影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（貸借対照表関係）

第35期 2020年３月31日現在	第36期 2021年３月31日現在
＊１．有形固定資産の減価償却累計額は次のとおりであります。 建物　114,303千円 器具備品　364,003千円	＊１．有形固定資産の減価償却累計額は次のとおりであります。 建物　148,089千円 器具備品　458,314千円

（損益計算書関係）

第35期 自　2019年４月１日 至　2020年３月31日	第36期 自　2020年４月１日 至　2021年３月31日
＊１．関係会社との主な取引高は次のとおりであります。 関係会社からの受取配当金　2,400千円 関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配　39,334千円	＊１．関係会社との主な取引高は次のとおりであります。 関係会社からの受取配当金　2,000千円 関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配　60,878千円

（株主資本等変動計算書関係）

第35期（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

１．発行済株式に関する事項

（単位：株）

株式の種類	2019年４月１日現在	増加	減少	2020年３月31日現在
普通株式	38,300	-	-	38,300

２．配当に関する事項

(1)　配当金支払額

2019年６月28日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額　2,017,644千円
(ロ) １株当たり配当額　52,680円
(ハ) 基準日　2019年３月31日
(ニ) 効力発生日　2019年６月28日

(2)　基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2020年６月26日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額　2,403,708千円
(ロ) 配当の原資　繰越利益剰余金
(ハ) １株当たり配当額　62,760円
(ニ) 基準日　2020年３月31日
(ホ) 効力発生日　2020年６月26日

第36期（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

１．発行済株式に関する事項

（単位：株）

株式の種類	2020年４月１日現在	増加	減少	2021年３月31日現在
普通株式	38,300	-	-	38,300

２．配当に関する事項

(1) 配当金支払額

2020年６月26日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	**2,403,708千円**
(ロ) １株当たり配当額	**62,760円**
(ハ) 基準日	**2020年３月31日**
(ニ) 効力発生日	**2020年６月26日**

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2021年６月30日の定時株主総会において、次のとおり配当を提案する予定であります。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	**4,937,214千円**
(ロ) 配当の原資	**繰越利益剰余金**
(ハ) １株当たり配当額	**128,909円**
(ニ) 基準日	**2021年３月31日**
(ホ) 効力発生日	**2021年６月30日**

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

第35期 **自　2019年４月１日** **至　2020年３月31日**	**第36期** **自　2020年４月１日** **至　2021年３月31日**
(1) 金融商品に対する取組方針 **当社の資本は本来の事業目的のために使用することを基本とし、資産の運用に際しては、資産運用リスクを極力最小限に留めることを基本方針としております。**	**(1) 金融商品に対する取組方針** **同左**
(2) 金融商品の内容及びそのリスク **営業債権である未収収益は顧客の信用リスクに晒されており、未収委託者報酬は市場リスクに晒されております。投資有価証券は、主にファンドの自己設定に関連する投資信託であり、基準価額の変動リスクに晒されております。** **営業債務である未払金は、ほとんど１年以内の支払期日であり、流動性リスクに晒されております。**	**(2) 金融商品の内容及びそのリスク** **同左**
(3) 金融商品に係るリスク管理体制 **① 信用リスク** **未収収益については、管理部門において取引先ごとに期日及び残高を把握することで、回収懸念の早期把握や軽減を図っております。**	**(3) 金融商品に係るリスク管理体制** **① 信用リスク** **同左**
② 市場リスク **未収委託者報酬には、運用資産の悪化から回収できず当社が損失を被るリスクが存在しますが、過去の回収実績からリスクは僅少であると判断しております。** **投資有価証券については、管理部門において定期的に時価を把握する体制としております。**	**② 市場リスク** **同左**
③ 流動性リスク **当社は、日々資金残高管理を行っており流動性リスクを管理しております。**	**③ 流動性リスク** **同左**

２．金融商品の時価等に関する事項

第35期（2020年３月31日現在）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません（（注2）参照）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(＊)	時価(＊)	差額
(1)現金・預金	19,928,671	19,928,671	-
(2)未収委託者報酬	2,864,007	2,864,007	-
(3)未収収益	2,126,212	2,126,212	-
(4)未収入金	101,676	101,676	-
(5)投資有価証券			
その他有価証券	65,610	65,610	-
(6)預り金	(43,576)	(43,576)	-
(7)未払金	(2,555,940)	(2,555,940)	-
(8)未払費用	(544,639)	(544,639)	-
(9)未払消費税等	(367,506)	(367,506)	-
(10)未払法人税等	(1,347,000)	(1,347,000)	-

(＊)負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

第36期（2021年３月31日現在）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません（（注2）参照）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(＊)	時価(＊)	差額
(1)現金・預金	22,550,090	22,550,090	-
(2)未収委託者報酬	2,973,733	2,973,733	-
(3)未収収益	2,375,688	2,375,688	-
(4)未収入金	3,865	3,865	-
(5)投資有価証券			
その他有価証券	49,477	49,477	-
(6)預り金	(45,524)	(45,524)	-
(7)未払金	(2,979,963)	(2,979,963)	-
(8)未払費用	(429,654)	(429,654)	-
(9)未払消費税等	(468,610)	(468,610)	-
(10)未払法人税等	(1,378,000)	(1,378,000)	-

(＊)負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

第35期 2020年３月31日現在	第36期 2021年３月31日現在
(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益、(4) 未収入金、 (6) 預り金、 (7) 未払金、 (8) 未払費用、(9) 未払消費税等及び(10) 未払法人税等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。 (5) 投資有価証券 時価の算定方法につきましては「重要な会計方針」の「１．有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益、(4) 未収入金、 (6) 預り金、 (7) 未払金、 (8) 未払費用、(9) 未払消費税等及び(10) 未払法人税等 同左 (5) 投資有価証券 同左

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

第35期 2020年３月31日現在	第36期 2021年３月31日現在

以下については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。	以下については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	1,640,302
関連会社株式	32,747
その他の関係会社有価証券	31,200
敷金	450,632
その他長期差入保証金	10,030

（単位：千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	1,640,302
関連会社株式	32,747
その他の関係会社有価証券	71,200
敷金	474,324
その他長期差入保証金	10,030

（注3）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

第35期 2020年３月31日現在	第36期 2021年３月31日現在
該当事項はありません。	同左

（注4）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

第35期（2020年３月31日現在）

（単位：千円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 10年以内	10年超
預金	19,928,370	-	-	-
未収委託者報酬	2,864,007	-	-	-
未収収益	2,126,212	-	-	-
未収入金	101,676	-	-	-
投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	2,247	21,678	22,121	-
合計	25,022,515	21,678	22,121	-

第36期（2021年３月31日現在）

（単位：千円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 10年以内	10年超
預金	22,549,627	-	-	-
未収委託者報酬	2,973,733	-	-	-
未収収益	2,375,688	-	-	-
未収入金	3,865	-	-	-
投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	8,474	16,416	5,279	-
合計	27,911,389	16,416	5,279	-

（有価証券関係）

第35期 2020年３月31日現在	第36期 2021年３月31日現在

１．子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額　子会社株式1,640,302千円、関連会社株式32,747千円）並びにその他の関係会社有価証券（貸借対照表計上額　31,200千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

２．その他有価証券

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
①貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 証券投資信託	32,071	27,816	4,254
②貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 証券投資信託	33,538	42,372	△8,834
合計	65,610	70,189	△4,579

３．当事業年度中に売却したその他有価証券

該当事項はありません。

１．子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額　子会社株式1,640,302千円、関連会社株式32,747千円）並びにその他の関係会社有価証券（貸借対照表計上額　71,200千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

２．その他有価証券

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
①貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 証券投資信託	37,407	27,442	9,964
②貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 証券投資信託	12,070	12,820	△749
合計	49,477	40,262	9,214

３．当事業年度中に売却したその他有価証券

同左

（退職給付関係）

第35期
自　2019年４月１日
至　2020年３月31日

１．採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員の退職給付に備えるため、非積立型の確定給付制度及び確定拠出年金制度を採用しております。

退職一時金制度（非積立型制度であります。）では、当社従業員を制度対象として、給与と勤続年数に基づき算出した一時金を支給しております。受入出向者については退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれております。貸借対照表上は出向期間３年以下の出向者に係る金額が退職給付引当金に、出向期間３年超の出向者に係る金額がその他未払金にそれぞれ含まれております。

当社は当事業年度より退職給付債務の計算方法を簡便法から原則法に変更しております。

２．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	378,099千円
簡便法から原則法への変更に伴う費用処理額	319,413千円
勤務費用	70,137千円
利息費用	1,378千円
数理計算上の差異の発生額	△11,130千円
退職給付の支払額	△9,404千円
確定拠出年金制度への移管額	△9,212千円
退職給付債務の期末残高	739,283千円

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	-
年金資産	-
	-
非積立型制度の退職給付債務	739,283千円
未積立退職給付債務	739,283千円
未認識数理計算上の差異	11,130千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	750,413千円
退職給付引当金	750,413千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	750,413千円

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	70,137千円
利息費用	1,378千円
簡便法から原則法への変更に伴う費用処理額	319,413千円
その他	9,272千円
確定給付制度に係る退職給付費用	400,202千円

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表しております。）

割引率	0.4%

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、66,184千円であります。

第36期
自　2020年４月１日
至　2021年３月31日

１．採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員の退職給付に備えるため、非積立型の確定給付制度及び確定拠出年金制度を採用しております。

退職一時金制度（非積立型制度であります。）では、当社従業員を制度対象として、給与と勤続年数に基づき算出した一時金を支給しております。受入出向者については退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれております。貸借対照表上は出向期間３年以下の出向者に係る金額が退職給付引当金に、出向期間３年超の出向者に係る金額がその他未払金にそれぞれ含まれております。

２．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	739,283千円
勤務費用	69,269千円
利息費用	2,907千円
数理計算上の差異の発生額	8,451千円
退職給付の支払額	△19,300千円
退職給付債務の期末残高	800,611千円

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	-
年金資産	-
	-
非積立型制度の退職給付債務	800,611千円
未積立退職給付債務	800,611千円
未認識数理計算上の差異	1,565千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	802,176千円
退職給付引当金	802,176千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	802,176千円

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	69,269千円
利息費用	2,907千円
数理計算上の差異の費用処理額	△1,113千円
その他	12,353千円
確定給付制度に係る退職給付費用	83,417千円

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表しております。）

割引率	0.4%

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、73,196千円であります。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第35期 （2020年３月31日現在）	第36期 （2021年３月31日現在）
繰延税金資産		
退職給付引当金	229,776千円	245,626千円
未払金	3,802千円	3,859千円
賞与引当金	74,920千円	83,848千円
未払法定福利費	9,935千円	10,817千円
未払事業所税	3,672千円	3,840千円
未払事業税	70,737千円	81,915千円
未払調査費	82,822千円	79,792千円
減価償却超過額	124,870千円	86,208千円
繰延資産超過額	3,293千円	6,297千円
未払確定拠出年金	1,666千円	1,901千円

未収実績連動報酬	21,260千円	31,761千円
その他有価証券評価差額金	1,402千円	-
未払費用	95,799千円	101,413千円
繰延税金資産小計	723,961千円	737,281千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	723,961千円	737,281千円
繰延税金負債		
特別償却準備金	0千円	0千円
その他有価証券評価差額金	-	2,821千円
繰延税金負債合計	0千円	2,821千円
繰延税金資産の純額	723,961千円	734,459千円

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

第35期 （2020年３月31日現在）	第36期 （2021年３月31日現在）
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。	同左

（セグメント情報等）

第35期 自　2019年４月１日 至　2020年３月31日	第36期 自　2020年４月１日 至　2021年３月31日
[セグメント情報] 当社は「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として運用（投資運用業）を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。 当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。	[セグメント情報] 同左

[関連情報] １．製品及びサービスごとの情報 単一のサービス区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。 ２．地域ごとの情報 (1) 営業収益 （単位：千円） 日本 | その他 | 合計 23,387,535 | 2,699,004 | 26,086,540 (注) 営業収益は顧客の所在地を基準とし、国ごとに分類しております。 (2) 有形固定資産 本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。 ３．主要な顧客ごとの情報 (1) 投資信託の名称 東京海上・円資産バランスファンド（毎月決算型） (2) 委託者報酬 5,339,902千円 (3) 関連するセグメント名 投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメント	[関連情報] １．製品及びサービスごとの情報 同左 ２．地域ごとの情報 (1) 営業収益 本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。 (2) 有形固定資産 同左 ３．主要な顧客ごとの情報 (1) 投資信託の名称 東京海上・円資産バランスファンド（毎月決算型） (2) 委託者報酬 5,399,003千円 (3) 関連するセグメント名 投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメント

（関連当事者情報）
第35期（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）
１．関連当事者との取引
(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等
重要な取引はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
重要な取引はありません。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等
重要な取引はありません。

(4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
重要な取引はありません。

２．親会社又は重要な関連会社に関する情報
(1) 親会社情報
東京海上ホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報
重要な関連会社はありません。

第36期（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）
１．関連当事者との取引
(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等
重要な取引はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
重要な取引はありません。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等
重要な取引はありません。

(4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
重要な取引はありません。

２．親会社又は重要な関連会社に関する情報

(1) 親会社情報
東京海上ホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報
重要な関連会社はありません。

（１株当たり情報）

第35期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	
１株当たり純資産額	599,546円59銭
１株当たり当期純利益金額	109,857円21銭
なお、潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
（注）１株当たり純資産額の算定上の基礎	
貸借対照表の純資産の部の合計額	22,962,634千円
純資産の部の合計額から控除する金額	－
普通株式に係る当期末の純資産額	22,962,634千円
１株当たり純資産額の算定に用いられた当期末の普通株式の数	38,300株
１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益金額	4,207,531千円
普通株主に帰属しない金額	－
普通株式に係る当期純利益金額	4,207,531千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

第36期 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	
１株当たり純資産額	665,945円58銭
１株当たり当期純利益金額	128,909円11銭

なお、潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注）１株当たり純資産額の算定上の基礎

貸借対照表の純資産の部の合計額	25,505,715千円
純資産の部の合計額から控除する金額	－
普通株式に係る当期末の純資産額	25,505,715千円
１株当たり純資産額の算定に用いられた当期末の普通株式の数	38,300株

１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎

損益計算書上の当期純利益金額	4,937,219千円
普通株主に帰属しない金額	－
普通株式に係る当期純利益金額	4,937,219千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

①自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

②運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

③通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。

④委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

⑤上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

提出日現在、訴訟事件その他委託会社等に重要な影響を及ぼした事実、及び重要な影響を与えることが予想される事実はありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

- 名称　三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社
  （再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）
- 資本金の額　324,279百万円（2021年３月末日現在）
- 事業の内容　銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

＜参考情報：再信託受託会社の概要＞

- 名称　日本マスタートラスト信託銀行株式会社
- 資本金の額　10,000百万円（2021年３月末日現在）
- 事業の内容　銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額（※）	事業の内容
三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

（※）2021年３月末日現在

２【関係業務の概要】

受託会社は、信託財産の保管・管理等を行います。また、当ファンドにかかる信託事務の一部につき日本マスタートラスト信託銀行株式会社に委託することがあります。
販売会社は、募集・販売の取扱い、一部解約事務および収益分配金・解約金・償還金の支払い等を行います。

３【資本関係】

資本関係はありません。

第３【その他】

１．目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案を使用し、委託会社の名称、ファンドの基本的性格等を記載することがあります。
２．目論見書の表紙に委託会社の金融商品取引業者登録番号および目論見書の使用を開始する日を記載する場合があります。
３．請求目論見書に当ファンドの約款を添付します。
４．目論見書の別称として「投資信託説明書（目論見書）」、「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用することがあります。
５．目論見書は電子媒体として使用されたり、インターネット等に掲載されることがあります。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年６月３日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　奈良昌彦　㊞

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　久保直毅　㊞

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント株式会社の2020年４月１日から2021年３月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント株式会社の2021年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠
当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に

注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注）　1．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年11月４日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　久保　直毅

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上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）の2021年３月18日から2021年９月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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）の2021年９月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠
当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年11月４日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　久保　直毅

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上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）の2021年３月18日から2021年９月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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）の2021年９月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠
当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注）　１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年11月４日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　久保　直毅

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上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）の2021年３月18日から2021年９月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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）の2021年９月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠
当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注）　１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年11月４日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　久保　直毅

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上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）の2021年３月18日から2021年９月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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）の2021年９月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠
当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注）　１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年11月４日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　久保　直毅

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上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）の2021年３月18日から2021年９月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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）の2021年９月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠
当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注）　１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年11月４日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　久保　直毅

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上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）の2021年３月18日から2021年９月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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）の2021年９月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠
当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年11月４日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　久保　直毅

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上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）の2021年３月18日から2021年９月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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）の2021年９月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠
当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注）　１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年11月４日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　久保　直毅

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上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）の2021年３月18日から2021年９月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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）の2021年９月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠
当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年11月４日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　久保　直毅

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上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）の2021年３月18日から2021年９月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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）の2021年９月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠
当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注）　1．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年11月４日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　久保　直毅

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンドの2021年３月18日から2021年９月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンドの2021年９月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠
当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注）　１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。