

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2024年6月17日
【計算期間】	第25特定期間（自 2023年9月20日 至 2024年3月18日）（注1） 第25期（自 2023年9月20日 至 2024年3月18日）（注2） 第22特定期間（自 2023年9月20日 至 2024年3月18日）（注3）
【ファンド名】	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・リアルコース（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）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
【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 横田 靖博
【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
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】	03 - 3212 - 8421
【縦覧に供する場所】	該当なし

（注1）「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・リアルコース（毎月分配型）」、「資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）」についての計算期間です。

（注2）「マネープール・ファンド」についての計算期間です。

（注3）「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）」についての計算期間です。

## 第一部【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】

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。

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

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・リアルコース(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)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	国内	株式
	海外	債券
追加型投信	内外	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	年1回	グローバル (日本を含む)		
一般	年2回	日本		
大型株	年4回	北米	ファミリーファン ド	あり
中小型株	年6回 (隔月)	欧州		
債券	年12回 (毎月)	アジア		
一般	日々	オセアニア		
公債	その他	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
社債	( )	アフリカ		
その他債券		中近東 (中東)		
クレジット属性 ( )		エマージング		
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				

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

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。

#### 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。

## 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」(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。

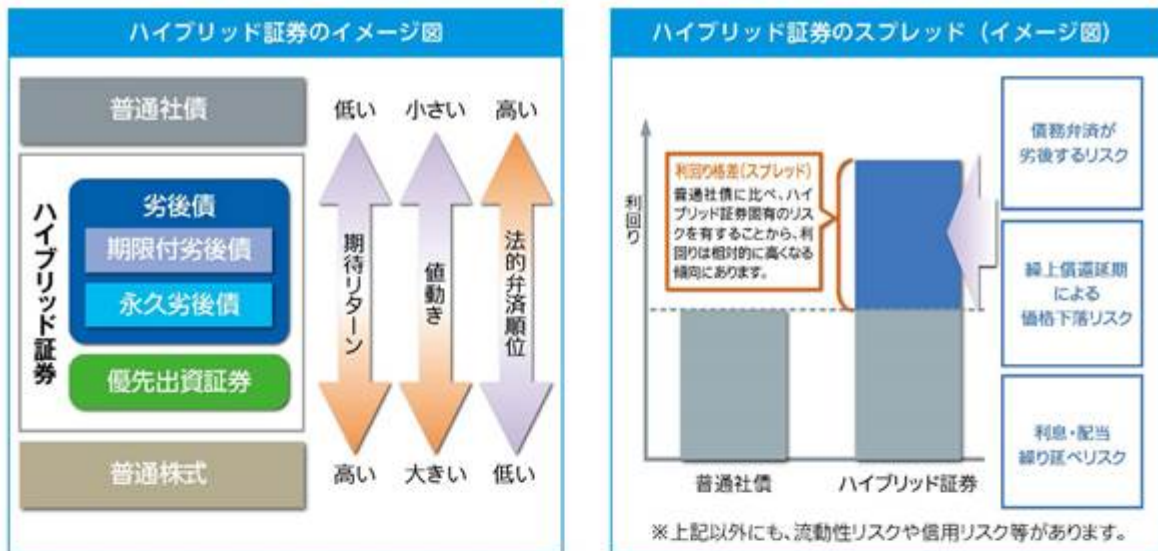
**● ハイブリッド証券とは**

- 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（2024年3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。

※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。

格付け（S&P社）と信用力		
高	投資適格債	AAA
		AA
A		
信用力	投機的格付債	BBB
		BB
		B
		CCC
		CC
低		C
		D

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8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・リアル、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 UK Limited」(アリアンツGI UK社)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 UK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 UK Limited

所在地：英国ロンドン

アリアンツGI UK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 UK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。

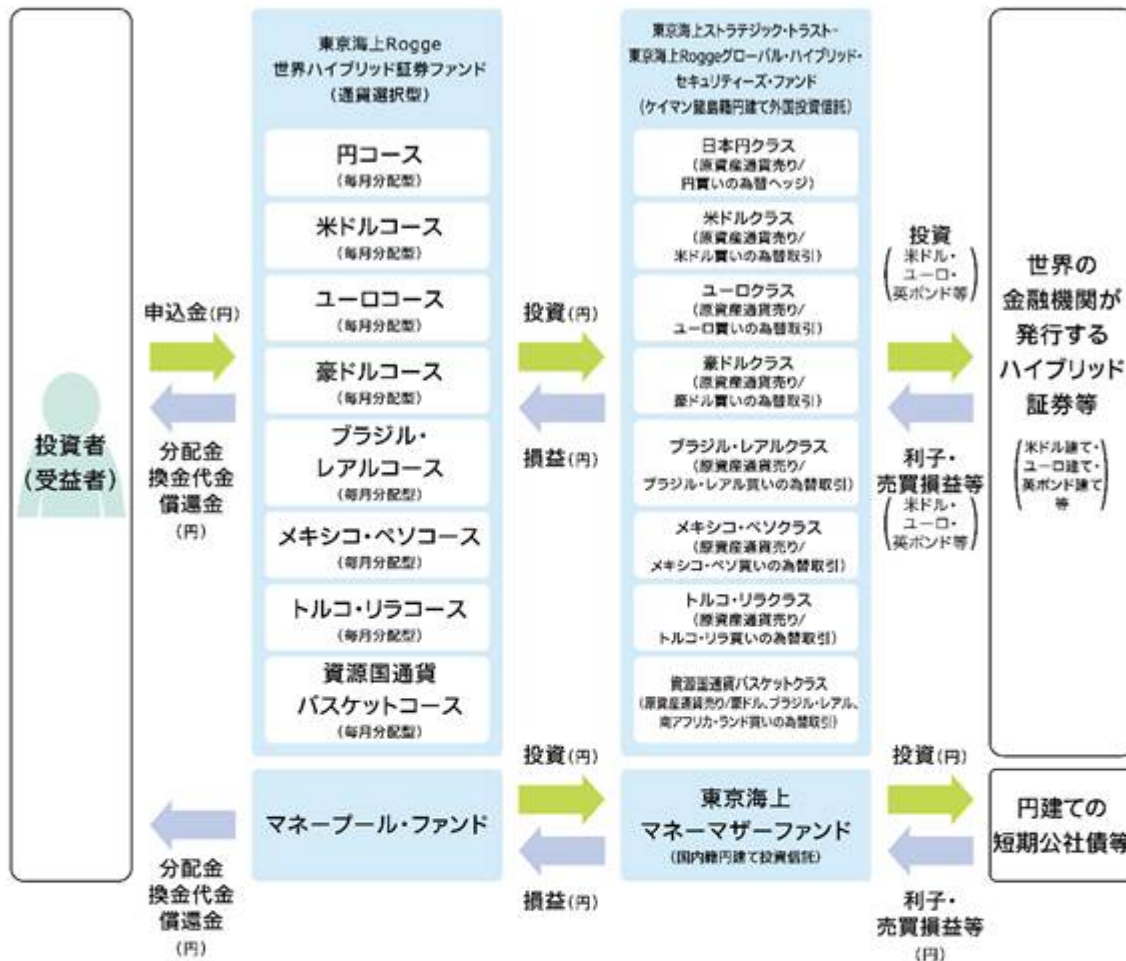
- 同チームはグローバル債券運用に特化したプロフェッショナル集団です。
- 経験豊富なシニアファンドマネージャーを中心に、グローバルに社債の調査、分析を行うアナリストチームとともに、チーム運用を行っています。

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。

### 分配金が支払われるイメージ



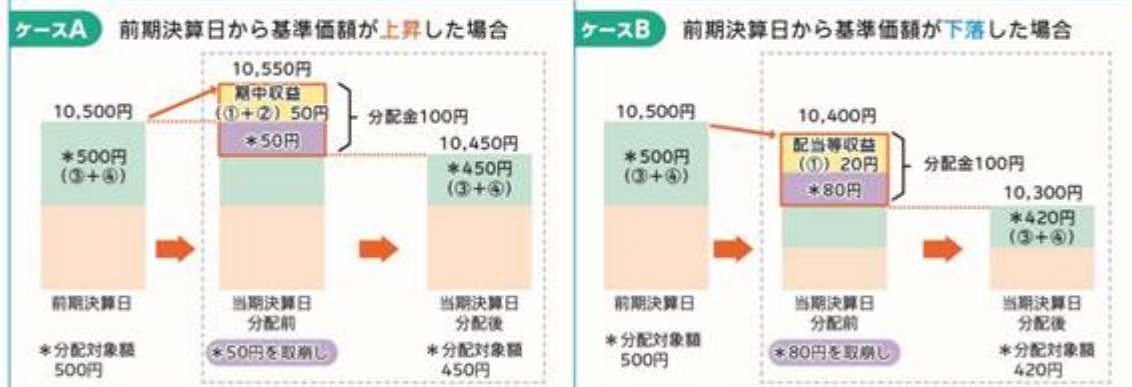
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超過して支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

※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。

### 計算期間中に発生した収益を超過して支払われる場合



①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注意ください。

- 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率が小さかった場合も同様です。



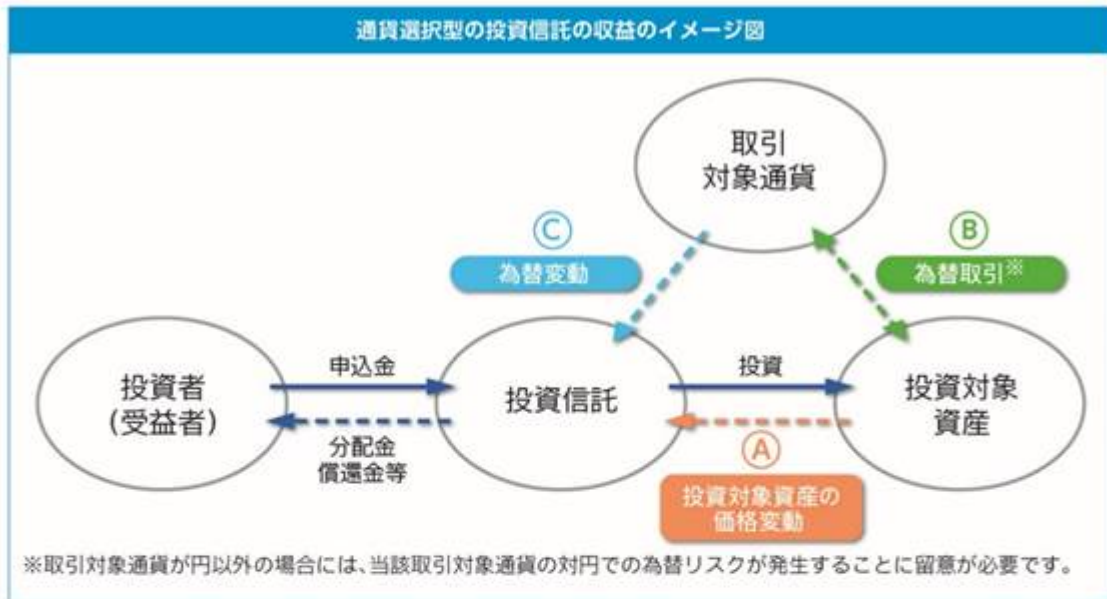
※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

**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

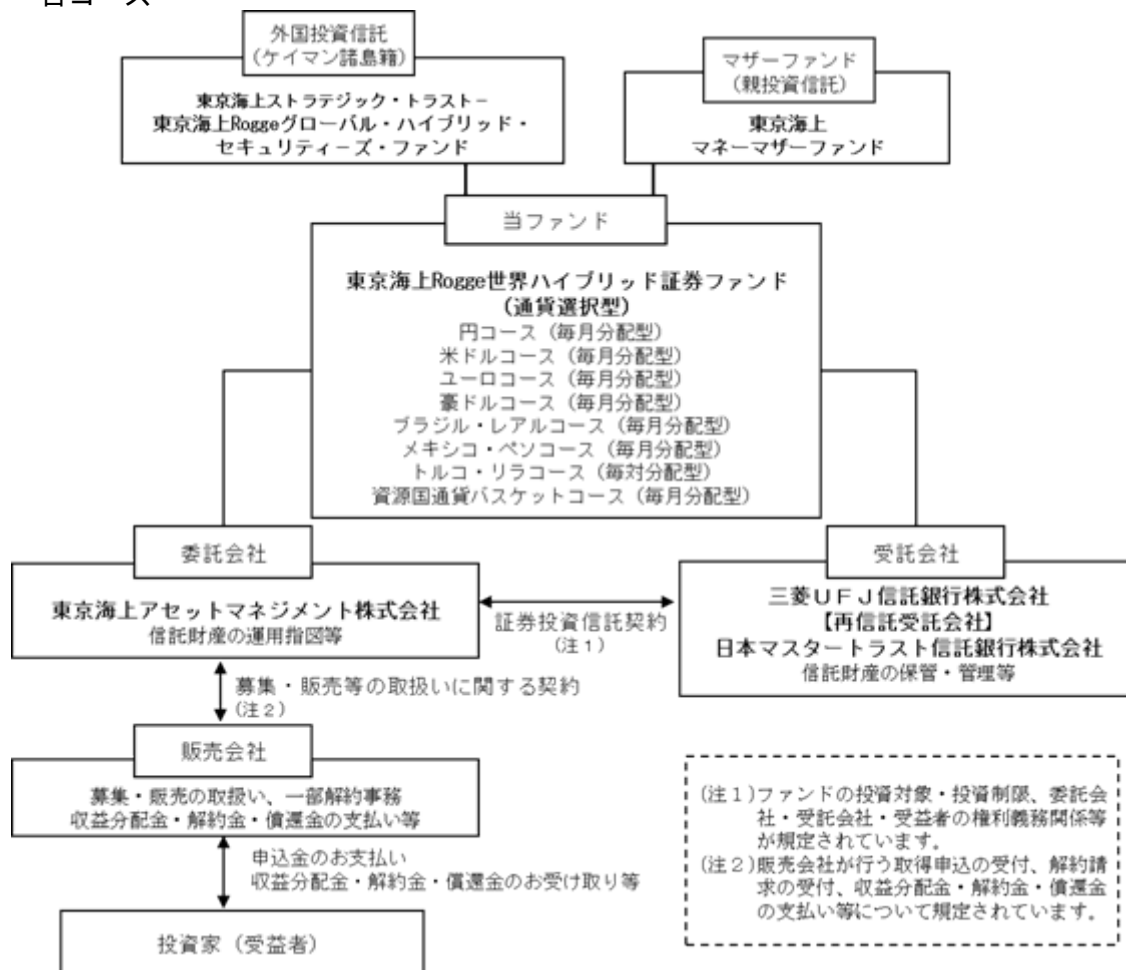
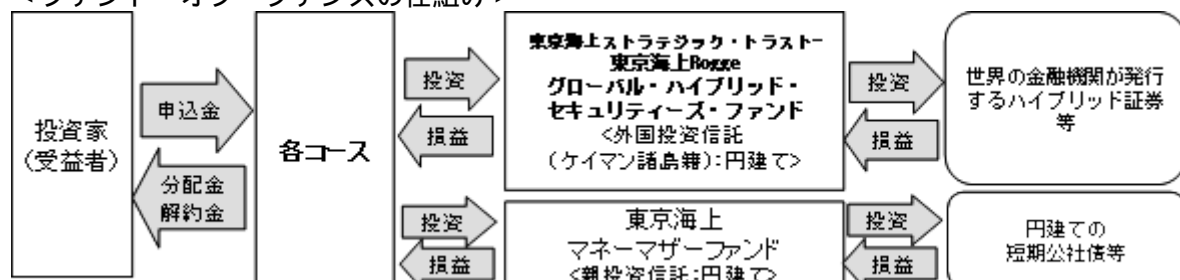
ロシア・ルーブルコース

2022年12月27日 繰上償還

**(3) 【ファンドの仕組み】**

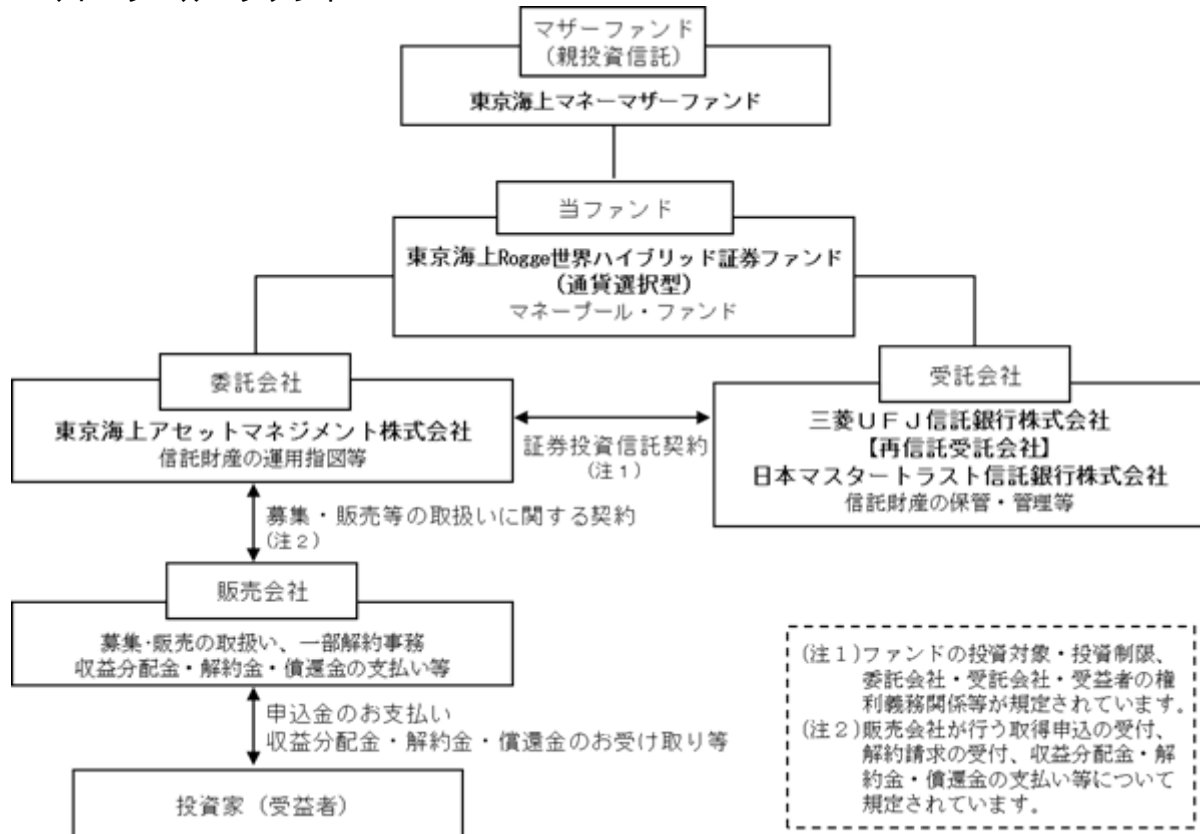
ファンドの仕組み

各コース

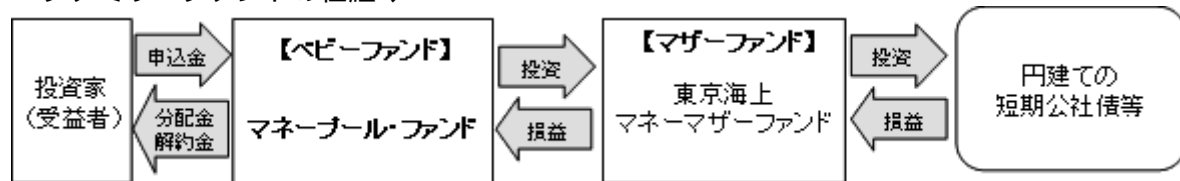
**<ファンド・オブ・ファンズの仕組み>**



## マネープール・ファンド



## &lt;ファミリーファンドの仕組み&gt;



「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。

## 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（2024年3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（2024年3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

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。

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。

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

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。

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。

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。）

有価証券

金銭債権（ に掲げるものに該当するものを除きます。 ）

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
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・リアルクラス/ メキシコ・ペソクラス/トルコ・リラクラス/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・リアルクラス＝ブラジル・リアル、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、資源国通貨バスケットクラス＝豪ドル/ブラジル・リアル/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。その他、ファンドは、ファンドの設立に係る費用（ファンドの3会計期間にわたり償却）、組入有価証券の売買委託手数料等の取引に要する費用、組入有価証券の保管に要する費用、信託財産に関する租税、監査報酬、法的費用等を負担します。
関係法人	受託会社：FirstCaribbean International Bank and Trust Company (Cayman) Limited 管理会社、保管銀行、事務代行会社：ルクセンブルク三菱UFJインベスターサービス銀行S.A. 副管理会社：MUFGL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 UK Limited

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。）

有価証券

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。）

金銭債権（ に掲げるものに該当するものを除きます。）

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券

(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

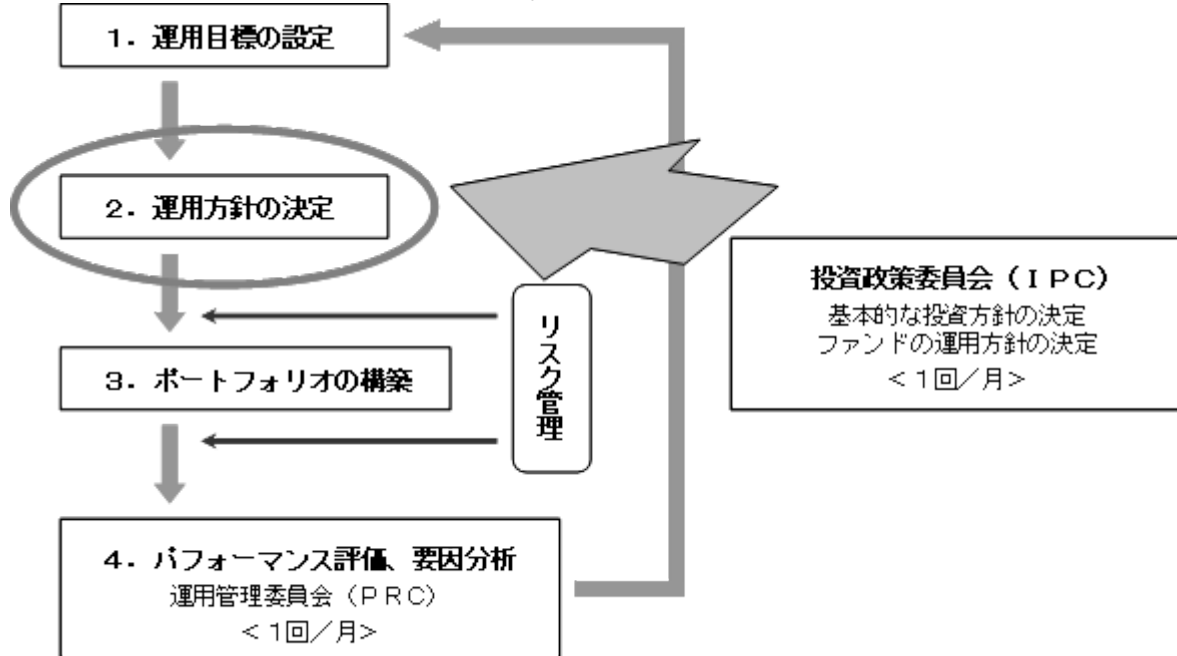
(2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

(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、2024年3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**

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。）

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。

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

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。

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るときは、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。

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。

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。

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がたい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

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は限りません。）
- 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。

#### 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。

#### 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。

#### 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。

#### 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るときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。

#### 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るときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。

#### 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。

#### 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るときは、担保の受入の指図を行うものとします。

#### 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「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。

#### 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るときは、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。

#### 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。

#### 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。

#### 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（「マネーパール・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、「マネーパール・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

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。

#### 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。

#### 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場合があります。

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場合があります。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場合があります。

#### 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

##### 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。

##### 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。

##### 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場合があります。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

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。

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。

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。

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。

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。

当ファンドは、大量の解約申込が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額が下落する可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

「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。

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。

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。

「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注意ください。

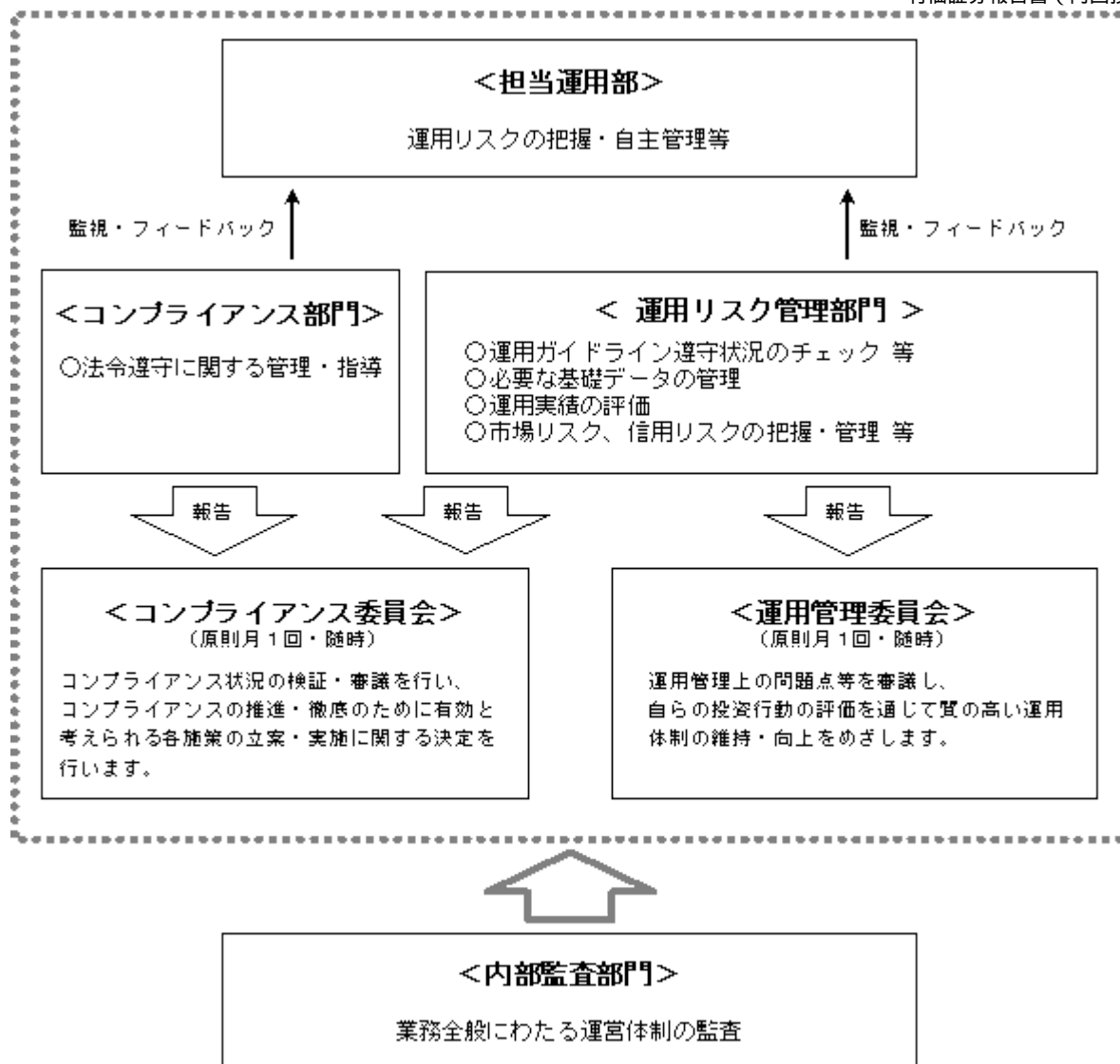
### 3. 管理体制

#### <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。(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。



#### <流動性リスク管理>

委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。

取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

## 参考情報

2019年4月～2024年3月

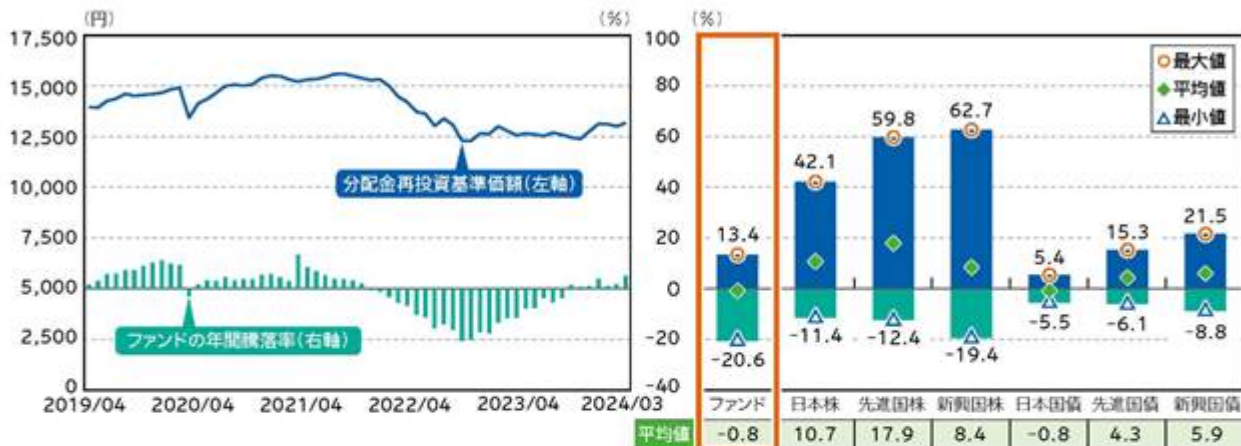
ファンドの年間騰落率および  
分配金再投資基準価額の推移

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）



## 豪ドルコース（毎月分配型）



## ブラジル・リアルコース（毎月分配型）



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）



## トルコ・リラコース（毎月分配型）



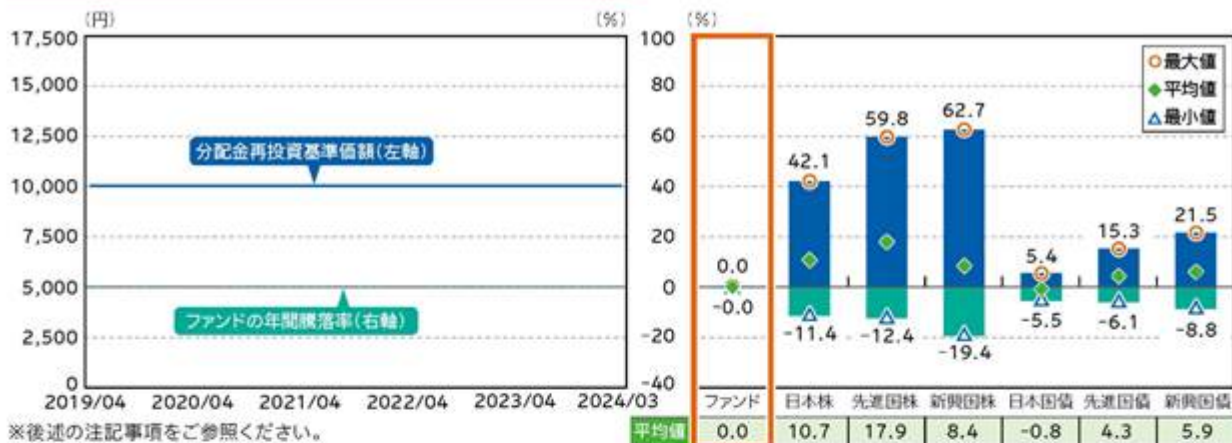
## 資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）



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。

## 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。

## 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・マーケット・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TOPIXにかかる標準または商標は、株式会社J P X 総研または株式会社J P X 総研の関連会社（以下、J P X といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXにかかる標準または商標に関するすべての権利はJ P X が有します。J P X は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P X は責任を負いません。●MSCIコクサイ指数の著作権、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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。●FTSE世界国債インデックスは、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、遅延または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。●JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバー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】

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「マネーブル・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。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

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。

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。

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 <sup>*1</sup>	販売会社 <sup>*2</sup>	受託会社 <sup>*3</sup>
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

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がかかります。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

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、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。

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 <sup>*1</sup> (税抜)	販売会社 <sup>*2</sup> (税抜)	受託会社 <sup>*3</sup> (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

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】

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。）

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。

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。

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、）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、）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）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入する等、一定の条件に該当する方が対象となります。

当ファンドは、「NISA」の対象ではありません。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、2024年3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。

## (参考情報) ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成期間(以下「当期間」といいます。)(2023年9月20日~2024年3月18日)におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

	総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
円コース (毎月分配型)	2.29%	1.02%	1.27%
米ドルコース (毎月分配型)	2.29%	1.02%	1.27%
ユーロコース (毎月分配型)	2.26%	1.02%	1.24%
豪ドルコース (毎月分配型)	2.29%	1.02%	1.27%
ブラジル・リアルコース (毎月分配型)	2.28%	1.01%	1.27%
メキシコ・ペソコース (毎月分配型)	2.29%	1.02%	1.27%
トルコ・リラコース (毎月分配型)	2.28%	1.01%	1.27%
資源国通貨バスケットコース (毎月分配型)	2.28%	1.02%	1.26%
マネープール・ファンド	0.00%	0.00%	0.00%

(比率は年率、表示桁数未満を四捨五入)

※当期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。消費税等のかかるものは消費税等を含む。)を当期間の平均受益権口数に当期間の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値です。

※その他費用には、投資先ファンドにかかる費用が含まれています。

※投資先ファンドの費用について、計上された期間が異なる場合があります。

※入手し得る情報において含まれていない費用はありません。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

※詳細につきましては、当期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 5【運用状況】

以下は2024年3月29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	5,893,179,809	99.03
親投資信託受益証券	日本	1,003,470	0.01
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		56,205,016	0.94
合計（純資産総額）		5,950,388,295	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	6,580,492,478	98.91
親投資信託受益証券	日本	10,034	0.00
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		72,401,909	1.08
合計（純資産総額）		6,652,904,421	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	2,347,992	95.93
親投資信託受益証券	日本	10,034	0.40
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		89,383	3.65
合計（純資産総額）		2,447,409	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	946,436,787	98.91
親投資信託受益証券	日本	1,003,470	0.10
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		9,424,147	0.98
合計（純資産総額）		956,864,404	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・リアルコース（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	1,487,845,706	98.20
親投資信託受益証券	日本	1,003,470	0.06
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		26,247,021	1.73
合計（純資産総額）		1,515,096,197	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	658,743,530	98.25
親投資信託受益証券	日本	10,017	0.00
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		11,705,434	1.74



合計(純資産総額)	670,458,981	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	692,020,703	97.61
親投資信託受益証券	日本	10,017	0.00
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		16,911,094	2.38
合計(純資産総額)		708,941,814	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	26,059,065	98.43
親投資信託受益証券	日本	10,034	0.03
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		405,103	1.53
合計(純資産総額)		26,474,202	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	2,202,393	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)		2,202,393	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・リアルコース（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）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	6,004,470	79.74
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		1,525,040	20.25
合計（純資産総額）		7,529,510	100.00

## (2) 【投資資産】

### 【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	854,579.4388	6,855	5,858,142,052	6,896	5,893,179,809	99.03
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	1.0121	1,003,470	1.0121	1,003,470	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	394,987.5437	16,287	6,433,162,124	16,660	6,580,492,478	98.91
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	1.0121	10,034	1.0121	10,034	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	186.63	12,405	2,315,145	12,581	2,347,992	95.93
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	1.0121	10,034	1.0121	10,034	0.40

## 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	112,296.7237	8,298	931,838,213	8,428	946,436,787	98.91
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	1.0121	1,003,470	1.0121	1,003,470	0.10

## 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアルコース(毎月分配型)

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	470,688.2968	3,094	1,456,309,590	3,161	1,487,845,706	98.20
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	991,474	1.0121	1,003,470	1.0121	1,003,470	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)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	84,205.9991	7,592	639,291,945	7,823	658,743,530	98.25
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	1.0121	10,017	1.0121	10,017	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	1,195,199.833	557	665,726,306	579	692,020,703	97.61
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	1.0121	10,017	1.0121	10,017	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	4,894.6404	5,233	25,613,653	5,324	26,059,065	98.43

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	1.0121	10,034	1.0121	10,034	0.03
---	--------------------	----	---------------	-------	--------	--------	--------	--------	------

## 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	2,176,063	1.0121	2,202,393	1.0121	2,202,393	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	99.03
親投資信託受益証券	0.01
合計	99.05

## 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	98.91
親投資信託受益証券	0.00
合計	98.91

## 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	95.93
親投資信託受益証券	0.40
合計	96.34

## 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	98.91
親投資信託受益証券	0.10
合計	99.01

## 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアルコース(毎月分配型)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.20
親投資信託受益証券	0.06
合計	98.26

## 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	98.25
親投資信託受益証券	0.00
合計	98.25

## 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	97.61
親投資信託受益証券	0.00
合計	97.61

## 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	98.43
親投資信託受益証券	0.03
合計	98.46

## 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

## 【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・リアルコース(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)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。

## 【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)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)

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208回神奈川県公募債	日本	地方債証券	0.551	2024/06/20	3,000,000	100.10	3,003,120	100.10	3,003,210	39.88
2	平成26年度第1回千葉県公募債	日本	地方債証券	0.679	2024/04/25	3,000,000	100.06	3,002,010	100.04	3,001,260	39.85

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	79.74
合計	79.74

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。

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】

【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
第21特定期間末	(2022年 3月17日)	6,617	6,790	0.7016	0.7196



第22特定期間末	(2022年 9月20日)	5,967	6,079	0.6242	0.6362
第23特定期間末	(2023年 3月17日)	5,936	6,024	0.6010	0.6100
第24特定期間末	(2023年 9月19日)	6,145	6,233	0.5941	0.6031
第25特定期間末	(2024年 3月18日)	5,934	6,015	0.6106	0.6186
2023年 3月末日		5,830		0.6024	
4月末日		5,803		0.6050	
5月末日		5,701		0.6012	
6月末日		5,491		0.5966	
7月末日		5,400		0.6019	
8月末日		6,187		0.5966	
9月末日		6,056		0.5883	
10月末日		5,974		0.5832	
11月末日		6,086		0.5999	
12月末日		6,177		0.6157	
2024年 1月末日		6,082		0.6133	
2月末日		5,976		0.6074	
3月末日		5,950		0.6141	

(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
第21特定期間末	(2022年 3月17日)	4,519	4,715	1.2601	1.3141
第22特定期間末	(2022年 9月20日)	4,884	5,082	1.3358	1.3898
第23特定期間末	(2023年 3月17日)	4,436	4,659	1.1884	1.2464
第24特定期間末	(2023年 9月19日)	6,304	6,588	1.2860	1.3520
第25特定期間末	(2024年 3月18日)	6,785	7,118	1.3207	1.3867
2023年 3月末日		4,457		1.1911	
4月末日		4,678		1.2045	

5月末日	4,864	1.2437
6月末日	5,414	1.2744
7月末日	5,656	1.2444
8月末日	6,113	1.2787
9月末日	6,345	1.2892
10月末日	6,378	1.2739
11月末日	6,474	1.2948
12月末日	6,466	1.2704
2024年 1月末日	6,732	1.3241
2月末日	6,848	1.3348
3月末日	6,652	1.3502

(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
第21特定期間末	(2022年 3月17日)	15	15	0.8676	0.9066
第22特定期間末	(2022年 9月20日)	5	5	0.8303	0.8693
第23特定期間末	(2023年 3月17日)	4	5	0.7662	0.8052
第24特定期間末	(2023年 9月19日)	3	3	0.8306	0.8696
第25特定期間末	(2024年 3月18日)	2	2	0.8649	0.9039
2023年 3月末日		4		0.7882	
4月末日		5		0.8041	
5月末日		5		0.8084	
6月末日		5		0.8400	
7月末日		3		0.8306	
8月末日		3		0.8458	
9月末日		3		0.8244	
10月末日		3		0.8183	

11月末日	3	0.8576
12月末日	1	0.8498
2024年 1月末日	2	0.8638
2月末日	2	0.8698
3月末日	2	0.8764

(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
第21特定期間末	(2022年 3月17日)	1,204	1,273	0.6208	0.6558
第22特定期間末	(2022年 9月20日)	1,058	1,096	0.6109	0.6319
第23特定期間末	(2023年 3月17日)	882	917	0.5400	0.5610
第24特定期間末	(2023年 9月19日)	915	948	0.5727	0.5937
第25特定期間末	(2024年 3月18日)	942	975	0.6052	0.6262
2023年 3月末日		890		0.5453	
4月末日		889		0.5455	
5月末日		896		0.5558	
6月末日		930		0.5808	
7月末日		916		0.5713	
8月末日		917		0.5733	
9月末日		914		0.5716	
10月末日		886		0.5620	
11月末日		935		0.5938	
12月末日		946		0.6042	
2024年 1月末日		944		0.6058	
2月末日		940		0.6034	
3月末日		956		0.6144	

(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・リアルコース(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
第21特定期間末	(2022年 3月17日)	1,129	1,297	0.1605	0.1845
第22特定期間末	(2022年 9月20日)	1,105	1,227	0.1630	0.1810
第23特定期間末	(2023年 3月17日)	990	1,115	0.1393	0.1573
第24特定期間末	(2023年 9月19日)	1,645	1,809	0.1586	0.1766
第25特定期間末	(2024年 3月18日)	1,613	1,800	0.1515	0.1695
2023年 3月末日		1,030		0.1442	
4月末日		1,103		0.1483	
5月末日		1,214		0.1511	
6月末日		1,568		0.1602	
7月末日		1,625		0.1600	
8月末日		1,643		0.1587	
9月末日		1,530		0.1537	
10月末日		1,533		0.1511	
11月末日		1,618		0.1571	
12月末日		1,607		0.1543	
2024年 1月末日		1,628		0.1556	
2月末日		1,671		0.1559	
3月末日		1,515		0.1546	

(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
第18特定期間末	(2022年 3月17日)	473	506	0.5216	0.5566
第19特定期間末	(2022年 9月20日)	531	550	0.5953	0.6163
第20特定期間末	(2023年 3月17日)	517	536	0.5823	0.6033
第21特定期間末	(2023年 9月19日)	466	482	0.7376	0.7586
第22特定期間末	(2024年 3月18日)	648	661	0.8139	0.8349
2023年 3月末日		543		0.6105	
4月末日		556		0.6236	
5月末日		594		0.6658	
6月末日		548		0.7107	
7月末日		556		0.7199	
8月末日		475		0.7423	
9月末日		455		0.7192	
10月末日		444		0.7004	
11月末日		360		0.7512	
12月末日		364		0.7569	
2024年 1月末日		621		0.7815	
2月末日		633		0.7993	
3月末日		670		0.8380	

(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
第18特定期間末	(2022年 3月17日)	1,112	1,406	0.0727	0.0907
第19特定期間末	(2022年 9月20日)	934	1,028	0.0693	0.0753
第20特定期間末	(2023年 3月17日)	770	806	0.0675	0.0705
第21特定期間末	(2023年 9月19日)	701	733	0.0670	0.0700
第22特定期間末	(2024年 3月18日)	684	715	0.0679	0.0709
2023年 3月末日		761		0.0672	
4月末日		785		0.0693	
5月末日		824		0.0734	
6月末日		702		0.0658	
7月末日		669		0.0634	
8月末日		705		0.0667	
9月末日		698		0.0666	
10月末日		687		0.0662	
11月末日		693		0.0673	
12月末日		678		0.0664	
2024年 1月末日		702		0.0692	
2月末日		703		0.0698	
3月末日		708		0.0704	

(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

第21特定期間末	(2022年 3月17日)	48	54	0.4593	0.4973
第22特定期間末	(2022年 9月20日)	27	29	0.4587	0.4767
第23特定期間末	(2023年 3月17日)	24	26	0.4093	0.4273
第24特定期間末	(2023年 9月19日)	26	27	0.4570	0.4750
第25特定期間末	(2024年 3月18日)	26	27	0.4814	0.4994
2023年 3月末日		25		0.4196	
4月末日		25		0.4244	
5月末日		25		0.4259	
6月末日		27		0.4544	
7月末日		26		0.4599	
8月末日		26		0.4584	
9月末日		26		0.4529	
10月末日		26		0.4506	
11月末日		26		0.4715	
12月末日		26		0.4721	
2024年 1月末日		26		0.4801	
2月末日		26		0.4804	
3月末日		26		0.4895	

(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
第21計算期間末	(2022年 3月17日)	2	2	1.0036	1.0036
第22計算期間末	(2022年 9月20日)	2	2	1.0038	1.0038
第23計算期間末	(2023年 3月17日)	2	2	1.0039	1.0039
第24計算期間末	(2023年 9月19日)	2	2	1.0039	1.0039
第25計算期間末	(2024年 3月18日)	2	2	1.0041	1.0041
2023年 3月末日		2		1.0038	

4月末日	2	1.0039
5月末日	2	1.0039
6月末日	2	1.0039
7月末日	2	1.0039
8月末日	2	1.0039
9月末日	2	1.0040
10月末日	2	1.0040
11月末日	2	1.0041
12月末日	2	1.0041
2024年 1月末日	2	1.0041
2月末日	2	1.0041
3月末日	2	1.0041

## 【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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	0.0180
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	0.0120
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	0.0090
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	0.0090
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	0.0080

## 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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	0.0540
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	0.0540
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	0.0580
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	0.0660
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	0.0660

## 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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	0.0390
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	0.0390
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	0.0390
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	0.0390
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	0.0350
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	0.0210
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	0.0210
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	0.0210
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	0.0210

## 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアルコース（毎月分配型）

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	0.0240
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	0.0180
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	0.0180
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	0.0180
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18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）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
第18特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	0.0350
第19特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	0.0210
第20特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	0.0210
第21特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	0.0210
第22特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	0.0210

## 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
第18特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	0.0180
第19特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	0.0060
第20特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	0.0030
第21特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	0.0030
第22特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	0.0030

## 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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	0.0380
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	0.0180
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	0.0180
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	0.0180
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18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)マネープール・ファンド  
該当事項はありません。

【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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	9.2
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	9.3
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	2.3

第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	0.3
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	4.1

(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)米ドルコース(毎月分配型)

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	1.7
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	10.3
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	6.7
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	13.8
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	7.8

(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)ユーロコース(毎月分配型)

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	6.2
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	0.2
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	3.0
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	13.5
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	8.8

(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)豪ドルコース(毎月分配型)

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	2.2
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	1.8
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	8.2
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	9.9
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	9.3

(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・リアルコース(毎月分配型)

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	3.7
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	12.8
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	3.5
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	26.8
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	6.9

(注)収益率は、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
第18特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	2.8
第19特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	18.2
第20特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	1.3
第21特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	30.3
第22特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	13.2

(注)収益率は、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
第18特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	34.5
第19特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	3.6
第20特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	1.7
第21特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	3.7
第22特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	5.8

(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)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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	0.2
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	3.8
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	6.8
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	16.1



第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	9.3
---------	-------------------------	-----

(注)収益率は、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
第21計算期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	0.0
第22計算期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	0.0
第23計算期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	0.0
第24計算期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	0.0
第25計算期間	2023年 9月20日～2024年 3月18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

第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	229,767,520	836,339,113	9,431,436,360
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	750,610,845	621,923,176	9,560,124,029
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	885,827,151	568,086,033	9,877,865,147
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	1,577,266,866	1,110,431,490	10,344,700,523
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	51,518,836	676,949,284	9,719,270,075

## 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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	128,977,503	190,945,675	3,586,460,585
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	320,783,892	250,299,744	3,656,944,733
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	703,558,500	627,530,616	3,732,972,617
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	1,635,699,901	466,574,427	4,902,098,091
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	537,214,518	301,632,527	5,137,680,082

## 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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	472,784		17,496,631
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	500,734	11,801,799	6,195,566
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	147,144	113,313	6,229,397
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	146,127	2,022,306	4,353,218
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	1,362,559	2,931,371	2,784,406

## 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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	22,521,756	99,582,208	1,940,740,596
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	13,821,688	222,083,140	1,732,479,144
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	12,147,287	109,706,013	1,634,920,418
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	11,749,551	48,838,112	1,597,831,857
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	9,491,303	49,398,220	1,557,924,940

## 東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアルコース(毎月分配型)

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	855,123,634	612,888,360	7,037,714,787
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	774,712,635	1,029,744,162	6,782,683,260
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	632,023,761	305,856,106	7,108,850,915
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	3,600,646,229	329,264,662	10,380,232,482
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	1,091,274,545	816,779,626	10,654,727,401

## 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
第18特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	38,593,766	102,970,312	907,466,737
第19特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	10,859,990	24,999,441	893,327,286
第20特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	12,726,365	16,891,017	889,162,634
第21特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	22,639,927	279,016,015	632,786,546
第22特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	332,847,740	169,166,004	796,468,282

## 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
第18特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	3,536,127,777	4,399,250,739	15,305,554,729
第19特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	2,004,579,424	3,833,216,738	13,476,917,415
第20特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	176,715,610	2,243,110,926	11,410,522,099
第21特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	289,581,299	1,225,800,565	10,474,302,833
第22特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	153,091,876	540,613,784	10,086,780,925

## 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
第21特定期間	2021年 9月18日～2022年 3月17日	16,288,060	97,720,006	105,910,074
第22特定期間	2022年 3月18日～2022年 9月20日	730,927	46,683,078	59,957,923
第23特定期間	2022年 9月21日～2023年 3月17日	2,885,507	1,994,797	60,848,633
第24特定期間	2023年 3月18日～2023年 9月19日	731,337	3,725,342	57,854,628
第25特定期間	2023年 9月20日～2024年 3月18日	1,027,172	3,147,672	55,734,128

## 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
第21計算期間	2021年 9月18日 ~ 2022年 3月17日	504,377	1,699,953	2,093,808
第22計算期間	2022年 3月18日 ~ 2022年 9月20日	75,161,345	75,161,345	2,093,808
第23計算期間	2022年 9月21日 ~ 2023年 3月17日	199,102		2,292,910
第24計算期間	2023年 3月18日 ~ 2023年 9月19日			2,292,910
第25計算期間	2023年 9月20日 ~ 2024年 3月18日		99,551	2,193,359

## &lt; 参考情報 &gt;

基準日：2024年3月29日

## 基準価額・純資産の推移

## 分配の推移

## 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。

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金	決算期	分配金
2023/04	15円	2023/11	15円
2023/05	15円	2023/12	15円
2023/06	15円	2024/01	15円
2023/07	15円	2024/02	10円
2023/08	15円	2024/03	10円
2023/09	15円		
2023/10	15円	設定来累計	6,930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
2023/04	110円	2023/11	110円
2023/05	110円	2023/12	110円
2023/06	110円	2024/01	110円
2023/07	110円	2024/02	110円
2023/08	110円	2024/03	110円
2023/09	110円		
2023/10	110円	設定来累計	11,570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

- ・「マネーボール・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：2024年3月29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
2023/04	65円	2023/11	65円
2023/05	65円	2023/12	65円
2023/06	65円	2024/01	65円
2023/07	65円	2024/02	65円
2023/08	65円	2024/03	65円
2023/09	65円	設定来累計	9,445円
2023/10	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
2023/04	35円	2023/11	35円
2023/05	35円	2023/12	35円
2023/06	35円	2024/01	35円
2023/07	35円	2024/02	35円
2023/08	35円	2024/03	35円
2023/09	35円	設定来累計	11,400円
2023/10	35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・リアルコース（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
2023/04	30円	2023/11	30円
2023/05	30円	2023/12	30円
2023/06	30円	2024/01	30円
2023/07	30円	2024/02	30円
2023/08	30円	2024/03	30円
2023/09	30円	設定来累計	13,345円
2023/10	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。

次ページへ続く

- ・「マネーパブル・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：2024年3月29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
2023/04	35円	2023/11	35円
2023/05	35円	2023/12	35円
2023/06	35円	2024/01	35円
2023/07	35円	2024/02	35円
2023/08	35円	2024/03	35円
2023/09	35円		
2023/10	35円	設定来累計	8,280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
2023/04	5円	2023/11	5円
2023/05	5円	2023/12	5円
2023/06	5円	2024/01	5円
2023/07	5円	2024/02	5円
2023/08	5円	2024/03	5円
2023/09	5円		
2023/10	5円	設定来累計	9,020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。

## 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
2023/04	30円	2023/11	30円
2023/05	30円	2023/12	30円
2023/06	30円	2024/01	30円
2023/07	30円	2024/02	30円
2023/08	30円	2024/03	30円
2023/09	30円		
2023/10	30円	設定来累計	12,315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

- ・「マネーブル・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: 2024年3月29日

## 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21期	2022/03/17	0円
第22期	2022/09/20	0円
第23期	2023/03/17	0円
第24期	2023/09/19	0円
第25期	2024/03/18	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：2024年3月29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・トラストー東京海上Rogge グローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド (日本円クラス)	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	0.9%
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 (メキシコ・ペソクラス)	98.3%
東京海上マネーマザーファンド	0.0%
短期金融資産等	1.7%
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 (米ドルクラス)	98.9%
東京海上マネーマザーファンド	0.0%
短期金融資産等	1.1%
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 (トルコ・リラクラス)	97.6%
東京海上マネーマザーファンド	0.0%
短期金融資産等	2.4%
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 (ユーロクラス)	95.9%
東京海上マネーマザーファンド	0.4%
短期金融資産等	3.7%
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 (資源国通貨バスケットクラス)	98.4%
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%

#### 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 (豪ドルクラス)	98.9%
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%

#### マネープール・ファンド

資産	比率
債券	79.7%
短期金融資産等	20.3%
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 (ブラジル・レアルクラス)	98.2%
東京海上マネーマザーファンド	0.1%
短期金融資産等	1.7%
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：2024年3月29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	65.5%
永久劣後債	12.7%
優先出資証券	3.9%
その他	17.8%

### 格付別構成

格付	比率
AAA格	—
AA格	4.6%
A格	41.8%
BBB格	53.5%
BB格以下	—
無格付	—

※+-等の符号は省略して表示しています。

### ハイブリッド証券等の属性情報

残存期間	5.90年
修正デュレーション	4.53
クーポン	3.91%
最終利回り（複利）	5.94%
平均格付	BBB+

### 通貨別構成

通貨	比率
米ドル	44.1%
ユーロ	41.7%
英ポンド	14.2%

### 組入上位10カ国

	国	比率
1	アメリカ	20.9%
2	イギリス	16.2%
3	フランス	11.7%
4	オランダ	9.2%
5	ドイツ	6.0%
6	スイス	5.2%
7	オーストラリア	4.6%
8	スペイン	4.3%
9	日本	3.8%
10	フィンランド	3.7%

### 組入上位10銘柄

組入銘柄数：100銘柄

	銘柄	証券種類	クーポン	償還日	国	格付	比率
1	UBS GROUP AG	その他	6.537%	2032/08/12	スイス	A	3.6%
2	FIFTH THIRD BANCORP	その他	4.337%	2032/04/25	アメリカ	A-	2.7%
3	GOLDMAN SACHS CAPITAL I	優先出資証券	6.345%	2034/02/15	アメリカ	BBB-	2.5%
4	BANK OF AMERICA CORP	その他	2.972%	2032/02/04	アメリカ	AA-	2.4%
5	LLOYDS BANKING GROUP PLC	期限付劣後債	1.985%	2026/09/15	イギリス	BBB+	2.4%
6	BAWAG GROUP AG	期限付劣後債	6.750%	2028/11/24	オーストリア	BBB	2.2%
7	COMMERZBANK AG	期限付劣後債	6.750%	2028/07/05	ドイツ	BBB-	2.1%
8	AUST & NZ BANKING GROUP	期限付劣後債	0.669%	2026/05/05	オーストラリア	A-	2.1%
9	NATWEST GROUP PLC	期限付劣後債	1.043%	2027/06/14	イギリス	BBB+	1.9%
10	DE VOLKSBANK NV	期限付劣後債	1.750%	2025/10/22	オランダ	BBB	1.9%

※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&amp;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208回神奈川東公募公債	0.551%	2024/06/20	39.9%
2	平成26年度第1回千葉県公募公債	0.679%	2024/04/25	39.9%
3				
4				
5				

※比率は、純資産総額に占める割合です。

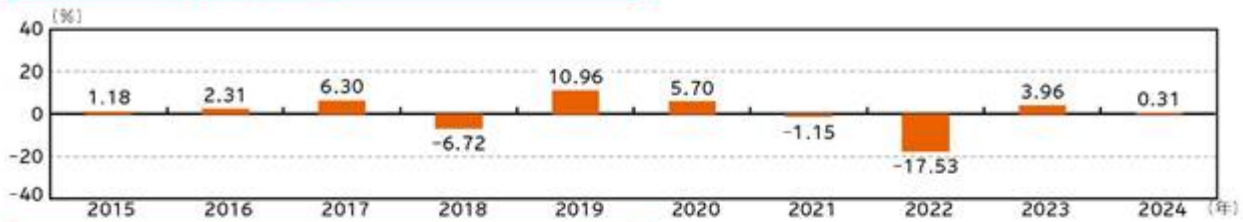
次ページへ続く

- ・「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:2024年3月29日

## 年間収益率の推移

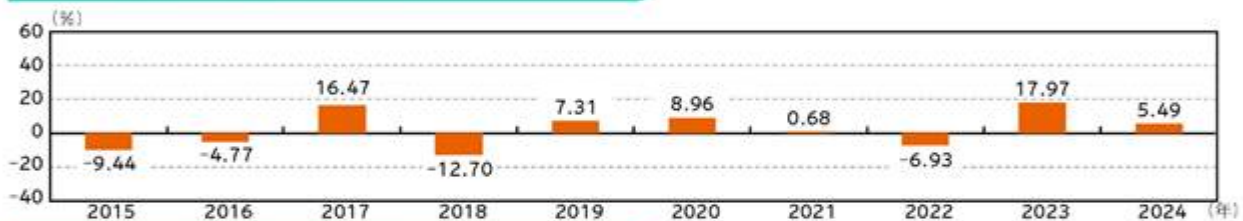
## 円コース (毎月分配型)



## 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・リアルコース (毎月分配型)



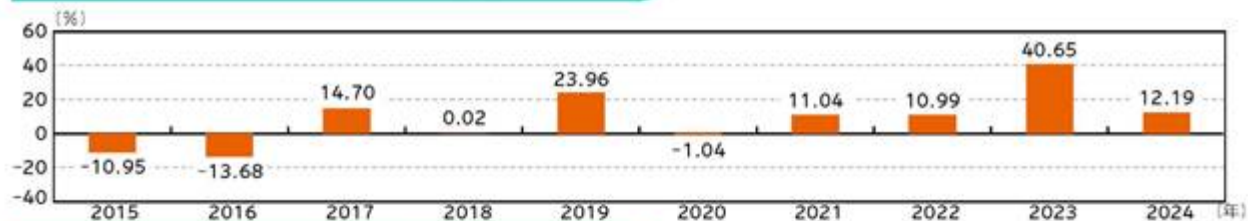
※後述の注記事項をご参照ください。

次ページへ続く

- ・「マネーパブル・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:2024年3月29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）



## 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います。

※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
- ・ルクセンブルクの銀行の休業日

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。

2024年11月5日以降は、原則として午後3時30分までに、販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とする予定です。なお、販売会社により取扱い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。

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お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。

2024年11月5日以降は、原則として午後3時30分までに、販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とする予定です。なお、販売会社により取扱い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。
- 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お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ることができます。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

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 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】

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發します。
- 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、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っ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、「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。受託会社は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、「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。

#### 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「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っ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發します。
- 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、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っ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であっても、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。

#### 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。

#### 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、知っ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、知っ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。

### 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・リアルコース(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)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(2023年9月20日から2024年3月18日まで)の財務諸表について、PwC Japan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25期計算期間(2023年9月20日から2024年3月18日まで)の財務諸表について、PwC Japan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 [2023年 9月19日現在]	当期 [2024年 3月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	133,206,598	99,277,513
投資信託受益証券	6,041,275,993	5,858,142,052
親投資信託受益証券	1,003,272	1,003,470
流動資産合計	6,175,485,863	5,958,423,035
資産合計	6,175,485,863	5,958,423,035
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	15,517,050	9,719,270
未払解約金	8,303,314	9,100,099
未払受託者報酬	140,775	115,595
未払委託者報酬	5,508,564	4,523,287
未払利息	275	7
その他未払費用	59,499	50,242
流動負債合計	29,529,477	23,508,500
負債合計	29,529,477	23,508,500
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 10,344,700,523	<sup>1</sup> 9,719,270,075
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 4,198,744,137	<sup>2</sup> 3,784,355,540
（分配準備積立金）	96,585,170	90,062,462
元本等合計	6,145,956,386	5,934,914,535
純資産合計	6,145,956,386	5,934,914,535
負債純資産合計	6,175,485,863	5,958,423,035

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	当期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	100,306,909	88,399,942
受取利息	180	181
有価証券売買等損益	54,716,670	188,866,257
<b>営業収益合計</b>	<b>45,590,419</b>	<b>277,266,380</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	42,596	6,489
受託者報酬	742,096	757,835
委託者報酬	29,038,228	29,654,443
その他費用	320,386	325,909
<b>営業費用合計</b>	<b>30,143,306</b>	<b>30,744,676</b>
営業利益又は営業損失( )	15,447,113	246,521,704
経常利益又は経常損失( )	15,447,113	246,521,704
当期純利益又は当期純損失( )	15,447,113	246,521,704
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( )	214,131	1,297,953
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,941,409,145	4,198,744,137
剰余金増加額又は欠損金減少額	443,123,068	270,249,034
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	443,123,068	270,249,034
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	628,538,046	20,719,041
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	628,538,046	20,719,041
<b>分配金</b>	<b>1,87,152,996</b>	<b>1,80,365,147</b>
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,198,744,137	3,784,355,540

## (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 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基礎と なる事項	特定期間末日の取扱い 2023年9月17日及び2024年3月17日が休日のため、前特定期 間末日を2023年9月19日とし、当特定期間末日を2024年3月 18日としております。このため、当特定期間は181日と なっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

前期	当期
自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[2023年 9月19日現在]	[2024年 3月18日現在]
1. 1 期首元本額	9,877,865,147円	10,344,700,523円
期中追加設定元本額	1,577,266,866円	51,518,836円
期中一部解約元本額	1,110,431,490円	676,949,284円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	10,344,700,523口	9,719,270,075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4,198,744,137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3,784,355,540円で あります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期
自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日



<p>1 分配金の計算過程 (2023年3月18日から2023年4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(15,648,937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(22,563,606円)及び分配準備積立金(106,123,520円)より、分配対象額は144,336,063円(1万口当たり149.83円)であり、うち14,447,822円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>1 分配金の計算過程 (2023年9月20日から2023年10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(13,363,391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(28,995,867円)及び分配準備積立金(95,616,631円)より、分配対象額は137,975,889円(1万口当たり134.61円)であり、うち15,372,664円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年4月18日から2023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(11,874,898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(22,464,583円)及び分配準備積立金(106,309,185円)より、分配対象額は140,648,666円(1万口当たり147.27円)であり、うち14,323,856円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年10月18日から2023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(17,176,056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(23,894,709円)及び分配準備積立金(97,907,674円)より、分配対象額は138,978,439円(1万口当たり136.51円)であり、うち15,270,507円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年5月18日から2023年6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(10,912,040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(17,465,079円)及び分配準備積立金(104,425,584円)より、分配対象額は132,802,703円(1万口当たり144.15円)であり、うち13,817,311円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年11月18日から2023年12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(17,401,049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(23,692,582円)及び分配準備積立金(98,567,189円)より、分配対象額は139,660,820円(1万口当たり138.79円)であり、うち15,091,673円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年6月20日から2023年7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(11,455,883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(12,651,592円)及び分配準備積立金(103,591,513円)より、分配対象額は127,698,988円(1万口当たり141.87円)であり、うち13,498,876円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年12月19日から2024年1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(6,385,108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(23,688,031円)及び分配準備積立金(100,491,422円)より、分配対象額は130,564,561円(1万口当たり130.17円)であり、うち15,044,460円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>

<p>(2023年7月19日から2023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(11,030,762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(29,183,696円)及び分配準備積立金(104,447,187円)より、分配対象額は144,661,645円(1万口当たり139.54円)であり、うち15,548,081円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(2024年1月18日から2024年2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(5,720,868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(23,365,969円)及び分配準備積立金(90,275,935円)より、分配対象額は119,362,772円(1万口当たり120.96円)であり、うち9,866,573円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年8月18日から2023年9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(12,444,073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(29,197,739円)及び分配準備積立金(99,658,147円)より、分配対象額は141,299,959円(1万口当たり136.58円)であり、うち15,517,050円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(2024年2月20日から2024年3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(10,118,945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(18,198,640円)及び分配準備積立金(89,662,787円)より、分配対象額は117,980,372円(1万口当たり121.37円)であり、うち9,719,270円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

区 分	前期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	当期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>同左</p>
--------------------------	---	-----------

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [2023年 9月19日現在]	当期 [2024年 3月18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	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(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。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
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 2023年3月18日 至 2023年9月19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	5,456,519円

親投資信託受益証券	円
合計	5,456,519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 2023年9月20日 至 2024年3月18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	37,601,495円
親投資信託受益証券	円
合計	37,601,495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 [2023年 9月19日現在]	当 期 [2024年 3月18日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 5,941円)	0.5941円 1口当たり純資産額 0.6106円 (1万口当たり純資産額 6,106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	854,579.4388	5,858,142,052	
投資信託受益証券	合計	854,579.4388	5,858,142,052	
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	1,003,470	
親投資信託受益証券	合計	991,474.0000	1,003,470	
	合計	1,846,053.4388	5,859,145,522	

##### 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 [2023年 9月19日現在]	当期 [2024年 3月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	255,079,756	129,868,244
投資信託受益証券	6,159,421,964	6,717,232,010
親投資信託受益証券	10,032	10,034
流動資産合計	6,414,511,752	6,847,110,288
資産合計	6,414,511,752	6,847,110,288
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	40,000,000	-
未払収益分配金	53,923,079	56,514,480
未払解約金	10,638,413	-
未払受託者報酬	140,403	131,855
未払委託者報酬	5,494,024	5,159,518
未払利息	527	10
その他未払費用	59,499	50,484
流動負債合計	110,255,945	61,856,347
負債合計	110,255,945	61,856,347
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,490,098,091	1,513,680,082
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,402,157,716	1,647,573,859
（分配準備積立金）	35,099,642	345,871,051
元本等合計	6,304,255,807	6,785,253,941
純資産合計	6,304,255,807	6,785,253,941
負債純資産合計	6,414,511,752	6,847,110,288

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	当期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	187,948,768	220,827,378
受取利息	304	363
有価証券売買等損益	531,995,144	320,810,048
<b>営業収益合計</b>	<b>719,944,216</b>	<b>541,637,789</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	51,424	12,201
受託者報酬	671,321	820,415
委託者報酬	26,269,220	32,103,201
その他費用	290,168	326,343
<b>営業費用合計</b>	<b>27,282,133</b>	<b>33,262,160</b>
営業利益又は営業損失（ ）	692,662,083	508,375,629
経常利益又は経常損失（ ）	692,662,083	508,375,629
当期純利益又は当期純損失（ ）	692,662,083	508,375,629
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（ ）	7,171,629	1,305,469
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	703,456,721	1,402,157,716
剰余金増加額又は欠損金減少額	409,771,807	158,890,723
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	409,771,807	158,890,723
剰余金減少額又は欠損金増加額	111,963,983	87,681,226
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	111,963,983	87,681,226
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
<b>分配金</b>	<b>1,284,597,283</b>	<b>1,332,863,514</b>
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,402,157,716	1,647,573,859

## (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 2023年 9月20日	至 2024年 3月18日
1. 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。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	特定期間末日の取扱い 2023年9月17日及び2024年3月17日が休日のため、前特定期 間末日を2023年9月19日とし、当特定期間末日を2024年3月 18日としております。このため、当特定期間は181日と なっております。	

(重要な会計上の見積りに関する注記)

前期	当期
自 2023年 3月18日	自 2023年 9月20日
至 2023年 9月19日	至 2024年 3月18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。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[2023年 9月19日現在]	[2024年 3月18日現在]
1. 1 期首元本額	3,732,972,617円	4,902,098,091円
期中追加設定元本額	1,635,699,901円	537,214,518円
期中一部解約元本額	466,574,427円	301,632,527円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	4,902,098,091口	5,137,680,082口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期
自 2023年 3月18日	自 2023年 9月20日
至 2023年 9月19日	至 2024年 3月18日
1 分配金の計算過程 (2023年3月18日から2023年4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 (26,825,020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(2,111,854,077円)及び分配準備積立金(29,675,005円)より、分配対象額は2,168,354,102円(1万口当たり5,632.38円)であり、うち42,347,722円(1万口当たり110円)を分配金額としております。	1 分配金の計算過程 (2023年9月20日から2023年10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 (30,934,281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(2,596,361,702円)及び分配準備積立金(34,825,907円)より、分配対象額は2,662,121,890円(1万口当たり5,383.76円)であり、うち54,391,797円(1万口当たり110円)を分配金額としております。

<p>(2023年4月18日から2023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          (27,721,630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(2,115,866,330円)及び分配準備積立金(31,281,246円)より、分配対象額は2,174,869,206円(1万口当たり5,593.68円)であり、うち42,768,775円(1万口当たり110円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年10月18日から2023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          (35,567,637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(134,463,919円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,596,784,714円)及び分配準備積立金(35,154,427円)より、分配対象額は2,801,970,697円(1万口当たり5,614.55円)であり、うち54,895,788円(1万口当たり110円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年5月18日から2023年6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          (28,518,496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(2,163,579,238円)及び分配準備積立金(30,966,563円)より、分配対象額は2,223,064,297円(1万口当たり5,556.20円)であり、うち44,011,396円(1万口当たり110円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年11月18日から2023年12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          (31,045,933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(2,585,982,342円)及び分配準備積立金(169,413,794円)より、分配対象額は2,786,442,069円(1万口当たり5,566.72円)であり、うち55,060,729円(1万口当たり110円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年6月20日から2023年7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          (25,920,537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(2,423,434,183円)及び分配準備積立金(29,604,033円)より、分配対象額は2,478,958,753円(1万口当たり5,509.67円)であり、うち49,492,008円(1万口当たり110円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年12月19日から2024年1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          (36,286,799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(42,612,382円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,600,730,635円)及び分配準備積立金(169,842,289円)より、分配対象額は2,849,472,105円(1万口当たり5,612.12円)であり、うち55,850,571円(1万口当たり110円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年7月19日から2023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          (33,890,077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(2,524,696,960円)及び分配準備積立金(30,649,233円)より、分配対象額は2,589,236,270円(1万口当たり5,471.49円)であり、うち52,054,303円(1万口当たり110円)を分配金額としております。</p>	<p>(2024年1月18日から2024年2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          (35,397,370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(130,935,596円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,599,048,793円)及び分配準備積立金(210,058,275円)より、分配対象額は2,975,440,034円(1万口当たり5,828.96円)であり、うち56,150,149円(1万口当たり110円)を分配金額としております。</p>



<p>(2023年8月18日から2023年9月19日までの分配金計算期間)</p> <p>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(33,415,284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(2,597,900,320円)及び分配準備積立金(31,096,946円)より、分配対象額は2,662,412,550円(1万口当たり5,431.14円)であり、うち53,923,079円(1万口当たり110円)を分配金額としております。</p>	<p>(2024年2月20日から2024年3月18日までの分配金計算期間)</p> <p>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(31,776,168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(2,593,310,897円)及び分配準備積立金(344,920,963円)より、分配対象額は2,970,008,028円(1万口当たり5,780.82円)であり、うち56,514,480円(1万口当たり110円)を分配金額としております。</p>
--	---

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

区 分	前期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	当期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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

## ・ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [2023年 9月19日現在]	当期 [2024年 3月18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 2023年3月18日 至 2023年9月19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	89,804,610円
親投資信託受益証券	円
合計	89,804,610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 2023年9月20日 至 2024年3月18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	6,598,865円
親投資信託受益証券	円
合計	6,598,865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 [2023年 9月19日現在]		当期 [2024年 3月18日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2860円 12,860円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3207円 13,207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	412,429.0545	6,717,232,010	
投資信託受益証券	合計	412,429.0545	6,717,232,010	
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	10,034	
親投資信託受益証券	合計	9,915.0000	10,034	
	合計	422,344.0545	6,717,242,044	

##### 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 [2023年 9月19日現在]	当期 [2024年 3月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	88,824	103,154
投資信託受益証券	3,548,715	2,315,145
親投資信託受益証券	10,032	10,034
流動資産合計	3,647,571	2,428,333
資産合計	3,647,571	2,428,333
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	28,295	18,098
未払受託者報酬	93	54
未払委託者報酬	3,233	1,971
その他未払費用	33	-
流動負債合計	31,654	20,123
負債合計	31,654	20,123
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 4,353,218	<sup>1</sup> 2,784,406
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 737,301	<sup>2</sup> 376,196
（分配準備積立金）	41,390	17,010
元本等合計	3,615,917	2,408,210
純資産合計	3,615,917	2,408,210
負債純資産合計	3,647,571	2,428,333

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	当期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	61,702	36,751
有価証券売買等損益	599,681	206,432
営業収益合計	661,383	243,183
<b>営業費用</b>		
支払利息	6	-
受託者報酬	626	386
委託者報酬	23,391	14,716
その他費用	186	91
営業費用合計	24,209	15,193
営業利益又は営業損失（ ）	637,174	227,990
経常利益又は経常損失（ ）	637,174	227,990
当期純利益又は当期純損失（ ）	637,174	227,990
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（ ）	12,335	1,304
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,456,596	737,301
剰余金増加額又は欠損金減少額	344,398	470,616
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	344,398	470,616
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	28,736	198,589
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	28,736	198,589
分配金	1 221,206	1 137,608
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	737,301	376,196

## (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 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基礎と なる事項	特定期間末日の取扱い 2023年9月17日及び2024年3月17日が休日のため、前特定期 間末日を2023年9月19日とし、当特定期間末日を2024年3月 18日としております。このため、当特定期間は181日と なっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

前期	当期
自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[2023年 9月19日現在]	[2024年 3月18日現在]
1. 1 期首元本額	6,229,397円	4,353,218円
期中追加設定元本額	146,127円	1,362,559円
期中一部解約元本額	2,022,306円	2,931,371円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	4,353,218口	2,784,406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737,301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376,196円でありま す。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期
自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日

<p>1 分配金の計算過程 (2023年3月18日から2023年4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(11,509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(1,854,105円)及び分配準備積立金(50,104円)より、分配対象額は1,915,718円(1万口当たり3,073.18円)であり、うち40,518円(1万口当たり65円)を分配金額としております。</p>	<p>1 分配金の計算過程 (2023年9月20日から2023年10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(4,955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(1,165,739円)及び分配準備積立金(41,390円)より、分配対象額は1,212,084円(1万口当たり2,772.67円)であり、うち28,414円(1万口当たり65円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年4月18日から2023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(10,409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(1,861,250円)及び分配準備積立金(52,263円)より、分配対象額は1,923,922円(1万口当たり3,024.53円)であり、うち41,346円(1万口当たり65円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年10月18日から2023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(7,652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(1,148,042円)及び分配準備積立金(41,974円)より、分配対象額は1,197,668円(1万口当たり2,725.09円)であり、うち28,567円(1万口当たり65円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年5月18日から2023年6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(11,221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(1,830,669円)及び分配準備積立金(53,131円)より、分配対象額は1,895,021円(1万口当たり2,977.16円)であり、うち41,373円(1万口当たり65円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年11月18日から2023年12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(4,524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(1,130,843円)及び分配準備積立金(43,034円)より、分配対象額は1,178,401円(1万口当たり2,670.34円)であり、うち28,683円(1万口当たり65円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年6月20日から2023年7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(10,696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(1,799,987円)及び分配準備積立金(54,805円)より、分配対象額は1,865,488円(1万口当たり2,928.96円)であり、うち41,399円(1万口当たり65円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年12月19日から2024年1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(3,220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(491,383円)及び分配準備積立金(19,125円)より、分配対象額は513,728円(1万口当たり2,621.87円)であり、うち12,735円(1万口当たり65円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年7月19日から2023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(7,495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(1,205,477円)及び分配準備積立金(40,366円)より、分配対象額は1,253,338円(1万口当たり2,881.20円)であり、うち28,275円(1万口当たり65円)を分配金額としております。</p>	<p>(2024年1月18日から2024年2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(5,135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(811,056円)及び分配準備積立金(19,406円)より、分配対象額は835,597円(1万口当たり2,572.72円)であり、うち21,111円(1万口当たり65円)を分配金額としております。</p>

<p>(2023年8月18日から2023年9月19日までの分配金計算期間)</p> <p>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(4,407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(1,184,631円)及び分配準備積立金(41,336円)より、分配対象額は1,230,374円(1万口当たり2,826.34円)であり、うち28,295円(1万口当たり65円)を分配金額としております。</p>	<p>(2024年2月20日から2024年3月18日までの分配金計算期間)</p> <p>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(4,380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(681,453円)及び分配準備積立金(16,806円)より、分配対象額は702,639円(1万口当たり2,523.47円)であり、うち18,098円(1万口当たり65円)を分配金額としております。</p>
--	--

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

区 分	前期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	当期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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



## ・ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [2023年 9月19日現在]	当期 [2024年 3月18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 2023年3月18日 至 2023年9月19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	18,949円
親投資信託受益証券	円
合計	18,949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 2023年9月20日 至 2024年3月18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	28,181円
親投資信託受益証券	円
合計	28,181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 [2023年 9月19日現在]		当期 [2024年 3月18日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8306円 8,306円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8649円 8,649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	186.6300	2,315,145	
投資信託受益証券	合計	186.6300	2,315,145	
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	10,034	
親投資信託受益証券	合計	9,915.0000	10,034	
	合計	10,101.6300	2,325,179	

##### 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 [2023年 9月19日現在]	当期 [2024年 3月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	15,526,370	10,268,112
投資信託受益証券	904,966,867	937,744,263
親投資信託受益証券	1,003,272	1,003,470
流動資産合計	921,496,509	949,015,845
資産合計	921,496,509	949,015,845
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	5,592,411	5,452,737
未払受託者報酬	20,762	18,286
未払委託者報酬	812,481	715,488
未払利息	32	-
その他未払費用	9,016	7,935
流動負債合計	6,434,702	6,194,446
負債合計	6,434,702	6,194,446
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sub>1</sub> 1,597,831,857	<sub>1</sub> 1,557,924,940
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sub>2</sub> 682,770,050	<sub>2</sub> 615,103,541
（分配準備積立金）	15,816,166	19,138,956
元本等合計	915,061,807	942,821,399
純資産合計	915,061,807	942,821,399
負債純資産合計	921,496,509	949,015,845

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	当期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	14,519,512	13,799,969
受取利息	15	18
有価証券売買等損益	77,330,343	74,777,594
<b>営業収益合計</b>	<b>91,849,870</b>	<b>88,577,581</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	3,981	958
受託者報酬	117,164	115,951
委託者報酬	4,584,751	4,537,178
その他費用	50,844	50,331
<b>営業費用合計</b>	<b>4,756,740</b>	<b>4,704,418</b>
営業利益又は営業損失（ ）	87,093,130	83,873,163
経常利益又は経常損失（ ）	87,093,130	83,873,163
当期純利益又は当期純損失（ ）	87,093,130	83,873,163
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（ ）	95,961	46,048
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	752,123,863	682,770,050
剰余金増加額又は欠損金減少額	21,375,146	20,603,350
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	21,375,146	20,603,350
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	5,147,034	3,945,740
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	5,147,034	3,945,740
<b>分配金</b>	<b>1 33,871,468</b>	<b>1 32,910,312</b>
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	682,770,050	615,103,541

## (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 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基礎と なる事項	特定期間末日の取扱い 2023年9月17日及び2024年3月17日が休日のため、前特定期 間末日を2023年9月19日とし、当特定期間末日を2024年3月 18日としております。このため、当特定期間は181日と なっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

前期	当期
自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[2023年 9月19日現在]	[2024年 3月18日現在]
1. 1 期首元本額	1,634,920,418円	1,597,831,857円
期中追加設定元本額	11,749,551円	9,491,303円
期中一部解約元本額	48,838,112円	49,398,220円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	1,597,831,857口	1,557,924,940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682,770,050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615,103,541円であ ります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期
自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日

<p>1 分配金の計算過程 (2023年3月18日から2023年4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(2,396,726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(438,362,546円)及び分配準備積立金(12,472,263円)より、分配対象額は453,231,535円(1万口当たり2,781.53円)であり、うち5,702,985円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>1 分配金の計算過程 (2023年9月20日から2023年10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(1,623,745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(399,732,461円)及び分配準備積立金(15,584,948円)より、分配対象額は416,941,154円(1万口当たり2,645.09円)であり、うち5,516,956円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年4月18日から2023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(2,310,471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(434,869,617円)及び分配準備積立金(13,239,565円)より、分配対象額は450,419,653円(1万口当たり2,760.69円)であり、うち5,710,384円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年10月18日から2023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(2,285,625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(395,477,218円)及び分配準備積立金(16,420,557円)より、分配対象額は414,183,400円(1万口当たり2,624.57円)であり、うち5,523,306円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年5月18日から2023年6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(2,370,491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(425,611,268円)及び分配準備積立金(13,733,615円)より、分配対象額は441,715,374円(1万口当たり2,740.38円)であり、うち5,641,506円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年11月18日から2023年12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(2,173,511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(389,229,866円)及び分配準備積立金(17,009,019円)より、分配対象額は408,412,396円(1万口当たり2,603.43円)であり、うち5,490,582円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年6月20日から2023年7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(1,645,663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(419,154,833円)及び分配準備積立金(14,392,240円)より、分配対象額は435,192,736円(1万口当たり2,715.65円)であり、うち5,608,816円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年12月19日から2024年1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(2,171,059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(383,717,207円)及び分配準備積立金(17,524,564円)より、分配対象額は403,412,830円(1万口当たり2,582.32円)であり、うち5,467,688円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>

<p>(2023年7月19日から2023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(1,614,036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(414,849,014円)及び分配準備積立金(15,236,644円)より、分配対象額は431,699,694円(1万口当たり2,690.72円)であり、うち5,615,366円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>(2024年1月18日から2024年2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(2,121,758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(379,227,197円)及び分配準備積立金(18,088,685円)より、分配対象額は399,437,640円(1万口当たり2,560.93円)であり、うち5,459,043円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年8月18日から2023年9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(2,247,813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(409,176,360円)及び分配準備積立金(15,166,184円)より、分配対象額は426,590,357円(1万口当たり2,669.79円)であり、うち5,592,411円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>(2024年2月20日から2024年3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(2,084,652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(374,911,263円)及び分配準備積立金(18,612,228円)より、分配対象額は395,608,143円(1万口当たり2,539.30円)であり、うち5,452,737円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

区 分	前期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	当期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>同左</p>
--------------------------	---	-----------

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [2023年 9月19日現在]	当期 [2024年 3月18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	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(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。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
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 2023年3月18日 至 2023年9月19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	12,782,687円



親投資信託受益証券	円
合計	12,782,687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 2023年9月20日 至 2024年3月18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	7,345,551円
親投資信託受益証券	円
合計	7,345,551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 [2023年 9月19日現在]	当 期 [2024年 3月18日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 5,727円)	0.5727円 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 6,052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	113,008.4675	937,744,263	
投資信託受益証券	合計	113,008.4675	937,744,263	
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	1,003,470	
親投資信託受益証券	合計	991,474.0000	1,003,470	
	合計	1,104,482.4675	938,747,733	

##### 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・リアルコース(毎月分配型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 [2023年 9月19日現在]	当期 [2024年 3月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	55,226,493	50,088,027
投資信託受益証券	1,622,215,856	1,456,309,590
親投資信託受益証券	1,003,272	1,003,470
未収入金	-	140,000,000
流動資産合計	1,678,445,621	1,647,401,087
資産合計	1,678,445,621	1,647,401,087
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	31,140,697	31,964,182
未払解約金	-	299,999
未払受託者報酬	36,886	31,981
未払委託者報酬	1,443,398	1,251,291
未払利息	114	3
その他未払費用	16,022	13,888
流動負債合計	32,637,117	33,561,344
負債合計	32,637,117	33,561,344
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sub>1</sub> 10,380,232,482	<sub>1</sub> 10,654,727,401
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	<sub>2</sub> 8,734,423,978	<sub>2</sub> 9,040,887,658
(分配準備積立金)	36,027,800	46,983,687
元本等合計	1,645,808,504	1,613,839,743
純資産合計	1,645,808,504	1,613,839,743
負債純資産合計	1,678,445,621	1,647,401,087

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	当期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	62,003,347	65,688,473
受取利息	74	80
有価証券売買等損益	264,887,043	55,093,932
<b>営業収益合計</b>	<b>326,890,464</b>	<b>120,782,485</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	14,102	3,356
受託者報酬	176,468	201,077
委託者報酬	6,905,329	7,868,117
その他費用	76,637	87,341
<b>営業費用合計</b>	<b>7,172,536</b>	<b>8,159,891</b>
営業利益又は営業損失（ ）	319,717,928	112,622,594
経常利益又は経常損失（ ）	319,717,928	112,622,594
当期純利益又は当期純損失（ ）	319,717,928	112,622,594
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（ ）	935,496	747,927
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,118,493,812	8,734,423,978
剰余金増加額又は欠損金減少額	279,993,964	688,455,961
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	279,993,964	688,455,961
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	3,051,198,889	921,635,963
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	3,051,198,889	921,635,963
<b>分配金</b>	<b>1 163,507,673</b>	<b>1 186,654,199</b>
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,734,423,978	9,040,887,658

## (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 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基礎と なる事項	特定期間末日の取扱い 2023年9月17日及び2024年3月17日が休日のため、前特定期 間末日を2023年9月19日とし、当特定期間末日を2024年3月 18日としております。このため、当特定期間は181日と なっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

前期	当期
自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[2023年 9月19日現在]	[2024年 3月18日現在]
1. 1 期首元本額	7,108,850,915円	10,380,232,482円
期中追加設定元本額	3,600,646,229円	1,091,274,545円
期中一部解約元本額	329,264,662円	816,779,626円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	10,380,232,482口	10,654,727,401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8,734,423,978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9,040,887,658円で あります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期
自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日

<p>1 分配金の計算過程 (2023年3月18日から2023年4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(8,428,437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(1,249,310,998円)及び分配準備積立金(27,103,239円)より、分配対象額は1,284,842,674円(1万口当たり1,800.62円)であり、うち21,406,513円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>1 分配金の計算過程 (2023年9月20日から2023年10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(9,639,969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(1,645,157,726円)及び分配準備積立金(34,206,731円)より、分配対象額は1,689,004,426円(1万口当たり1,684.61円)であり、うち30,077,865円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年4月18日から2023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(8,406,380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(1,277,743,719円)及び分配準備積立金(27,959,554円)より、分配対象額は1,314,109,653円(1万口当たり1,782.02円)であり、うち22,122,419円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年10月18日から2023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(10,777,566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(1,657,742,276円)及び分配準備積立金(38,816,278円)より、分配対象額は1,707,336,120円(1万口当たり1,665.22円)であり、うち30,758,375円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年5月18日から2023年6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(10,802,985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(1,658,657,803円)及び分配準備積立金(28,709,154円)より、分配対象額は1,698,169,942円(1万口当たり1,763.39円)であり、うち28,889,957円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年11月18日から2023年12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(9,564,620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(1,656,041,911円)及び分配準備積立金(39,219,418円)より、分配対象額は1,704,825,949円(1万口当たり1,644.50円)であり、うち31,100,097円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年6月20日から2023年7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(9,794,678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(1,681,551,114円)及び分配準備積立金(29,856,256円)より、分配対象額は1,721,202,048円(1万口当たり1,743.40円)であり、うち29,617,680円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年12月19日から2024年1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(10,761,366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(1,647,467,179円)及び分配準備積立金(43,409,769円)より、分配対象額は1,701,638,314円(1万口当たり1,624.82円)であり、うち31,417,871円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>

<p>(2023年7月19日から2023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(10,898,822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(1,697,783,302円)及び分配準備積立金(34,513,714円)より、分配対象額は1,743,195,838円(1万口当たり1,724.19円)であり、うち30,330,407円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>(2024年1月18日から2024年2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(10,387,941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(1,622,604,541円)及び分配準備積立金(43,258,163円)より、分配対象額は1,676,250,645円(1万口当たり1,604.78円)であり、うち31,335,809円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年8月18日から2023年9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(11,168,699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(1,723,406,257円)及び分配準備積立金(35,239,333円)より、分配対象額は1,769,814,289円(1万口当たり1,704.96円)であり、うち31,140,697円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>(2024年2月20日から2024年3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(9,670,191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(1,629,927,300円)及び分配準備積立金(47,968,223円)より、分配対象額は1,687,565,714円(1万口当たり1,583.85円)であり、うち31,964,182円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

区 分	前期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	当期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	同左
-------------------	---	----

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [2023年 9月19日現在]	当期 [2024年 3月18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	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(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。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
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 2023年3月18日 至 2023年9月19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	61,100,791円

親投資信託受益証券	円
合計	61,100,791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 2023年9月20日 至 2024年3月18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	8,194,683円
親投資信託受益証券	円
合計	8,194,683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 [2023年 9月19日現在]	当 期 [2024年 3月18日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 1,586円)	0.1586円 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 1,515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	470,688.2968	1,456,309,590	
投資信託受益証券 合計		470,688.2968	1,456,309,590	
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	1,003,470	
親投資信託受益証券 合計		991,474.0000	1,003,470	
合計		1,462,162.2968	1,457,313,060	

##### 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 [2023年 9月19日現在]	当期 [2024年 3月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	9,404,130	12,265,665
投資信託受益証券	459,955,690	639,291,945
親投資信託受益証券	10,015	10,017
流動資産合計	469,369,835	651,567,627
資産合計	469,369,835	651,567,627
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,214,752	2,787,638
未払受託者報酬	10,618	12,304
未払委託者報酬	415,433	481,501
未払利息	19	-
その他未払費用	4,601	5,338
流動負債合計	2,645,423	3,286,781
負債合計	2,645,423	3,286,781
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 632,786,546	<sup>1</sup> 796,468,282
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 166,062,134	<sup>2</sup> 148,187,436
（分配準備積立金）	25,114,580	48,239,922
元本等合計	466,724,412	648,280,846
純資産合計	466,724,412	648,280,846
負債純資産合計	469,369,835	651,567,627

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	当期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	19,953,850	16,165,582
受取利息	16	15
有価証券売買等損益	127,170,763	52,836,257
<b>営業収益合計</b>	<b>147,124,629</b>	<b>69,001,854</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	4,744	1,066
受託者報酬	68,947	59,719
委託者報酬	2,697,664	2,336,849
その他費用	29,871	25,880
<b>営業費用合計</b>	<b>2,801,226</b>	<b>2,423,514</b>
営業利益又は営業損失( )	144,323,403	66,578,340
経常利益又は経常損失( )	144,323,403	66,578,340
当期純利益又は当期純損失( )	144,323,403	66,578,340
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( )	5,547,258	983,547
期首剰余金又は期首欠損金( )	371,404,815	166,062,134
剰余金増加額又は欠損金減少額	90,400,070	42,070,899
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	90,400,070	42,070,899
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	7,741,667	76,455,268
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	7,741,667	76,455,268
<b>分配金</b>	<b>16,091,867</b>	<b>13,335,726</b>
期末剰余金又は期末欠損金( )	166,062,134	148,187,436

## (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 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基礎と なる事項	特定期間末日の取扱い 2023年9月17日及び2024年3月17日が休日のため、前特定期 間末日を2023年9月19日とし、当特定期間末日を2024年3月 18日としております。このため、当特定期間は181日と なっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

前期	当期
自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[2023年 9月19日現在]	[2024年 3月18日現在]
1. 1 期首元本額	889,162,634円	632,786,546円
期中追加設定元本額	22,639,927円	332,847,740円
期中一部解約元本額	279,016,015円	169,166,004円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	632,786,546口	796,468,282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166,062,134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148,187,436円であ ります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期
自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日

<p>1 分配金の計算過程 (2023年3月18日から2023年4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(3,724,810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(163,689,766円)及び分配準備積立金(33,156,201円)より、分配対象額は200,570,777円(1万口当たり2,250.86円)であり、うち3,118,777円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>1 分配金の計算過程 (2023年9月20日から2023年10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(2,320,606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(116,961,470円)及び分配準備積立金(25,114,580円)より、分配対象額は144,396,656円(1万口当たり2,279.61円)であり、うち2,216,977円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年4月18日から2023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(3,717,373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(163,910,361円)及び分配準備積立金(33,697,349円)より、分配対象額は201,325,083円(1万口当たり2,257.56円)であり、うち3,121,215円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年10月18日から2023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(2,602,418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(115,897,403円)及び分配準備積立金(24,762,218円)より、分配対象額は143,262,039円(1万口当たり2,286.37円)であり、うち2,193,048円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年5月18日から2023年6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(3,235,429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(142,130,931円)及び分配準備積立金(29,147,457円)より、分配対象額は174,513,817円(1万口当たり2,264.53円)であり、うち2,697,228円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年11月18日から2023年12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(1,691,690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(88,914,829円)及び分配準備積立金(19,276,399円)より、分配対象額は109,882,918円(1万口当たり2,286.58円)であり、うち1,681,930円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年6月20日から2023年7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(2,901,966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(142,463,395円)及び分配準備積立金(29,685,658円)より、分配対象額は175,051,019円(1万口当たり2,267.10円)であり、うち2,702,448円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年12月19日から2024年1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(1,997,974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(89,059,123円)及び分配準備積立金(19,286,159円)より、分配対象額は110,343,256円(1万口当たり2,293.11円)であり、うち1,684,173円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>

<p>(2023年7月19日から2023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(2,602,258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(117,989,577円)及び分配準備積立金(24,703,398円)より、分配対象額は145,295,233円(1万口当たり2,272.81円)であり、うち2,237,447円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>(2024年1月18日から2024年2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(3,263,991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(12,697,275円)、投資信託約款に規定される収益調整金(159,537,753円)及び分配準備積立金(19,306,873円)より、分配対象額は194,805,892円(1万口当たり2,459.68円)であり、うち2,771,960円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年8月18日から2023年9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(2,541,421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(116,818,894円)及び分配準備積立金(24,787,911円)より、分配対象額は144,148,226円(1万口当たり2,277.97円)であり、うち2,214,752円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>(2024年2月20日から2024年3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(3,279,861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(15,251,520円)、投資信託約款に規定される収益調整金(160,638,464円)及び分配準備積立金(32,496,179円)より、分配対象額は211,666,024円(1万口当たり2,657.53円)であり、うち2,787,638円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

区 分	前期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	当期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>同左</p>
--------------------------	---	-----------

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [2023年 9月19日現在]	当期 [2024年 3月18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	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(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。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
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 2023年3月18日 至 2023年9月19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	7,829,887円

親投資信託受益証券	円
合計	7,829,887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 2023年9月20日 至 2024年3月18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	15,662,316円
親投資信託受益証券	円
合計	15,662,316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 [2023年 9月19日現在]	当 期 [2024年 3月18日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 7,376円)	0.7376円 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 8,139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	84,205.9991	639,291,945	
投資信託受益証券 合計		84,205.9991	639,291,945	
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	10,017	
親投資信託受益証券 合計		9,898.0000	10,017	
合計		94,103.9991	639,301,962	

##### 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 [2023年 9月19日現在]	当期 [2024年 3月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	22,441,666	24,280,257
投資信託受益証券	685,057,459	665,726,306
親投資信託受益証券	10,015	10,017
流動資産合計	707,509,140	690,016,580
<b>資産合計</b>	<b>707,509,140</b>	<b>690,016,580</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	5,237,151	5,043,390
未払解約金	306,154	-
未払受託者報酬	15,989	13,439
未払委託者報酬	625,671	525,820
未払利息	46	1
その他未払費用	6,939	5,829
流動負債合計	6,191,950	5,588,479
<b>負債合計</b>	<b>6,191,950</b>	<b>5,588,479</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sub>1</sub> 10,474,302,833	<sub>1</sub> 10,086,780,925
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sub>2</sub> 9,772,985,643	<sub>2</sub> 9,402,352,824
（分配準備積立金）	133,962,955	170,330,001
元本等合計	701,317,190	684,428,101
<b>純資産合計</b>	<b>701,317,190</b>	<b>684,428,101</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>707,509,140</b>	<b>690,016,580</b>



## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	当期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	77,754,314	77,904,332
受取利息	18	33
有価証券売買等損益	43,795,792	34,331,151
<b>営業収益合計</b>	<b>33,958,540</b>	<b>43,573,214</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	5,134	1,716
受託者報酬	95,094	86,916
委託者報酬	3,720,917	3,400,943
その他費用	41,253	37,698
<b>営業費用合計</b>	<b>3,862,398</b>	<b>3,527,273</b>
営業利益又は営業損失( )	30,096,142	40,045,941
経常利益又は経常損失( )	30,096,142	40,045,941
当期純利益又は当期純損失( )	30,096,142	40,045,941
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( )	1,610,443	132,567
期首剰余金又は期首欠損金( )	10,639,972,396	9,772,985,643
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,137,901,289	504,125,028
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,137,901,289	504,125,028
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	270,195,179	142,701,983
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	270,195,179	142,701,983
<b>分配金</b>	<b>1 32,425,942</b>	<b>1 30,703,600</b>
期末剰余金又は期末欠損金( )	9,772,985,643	9,402,352,824

## (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 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基礎と なる事項	特定期間末日の取扱い 2023年9月17日及び2024年3月17日が休日のため、前特定期 間末日を2023年9月19日とし、当特定期間末日を2024年3月 18日としております。このため、当特定期間は181日と なっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

前期	当期
自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[2023年 9月19日現在]	[2024年 3月18日現在]
1. 1 期首元本額	11,410,522,099円	10,474,302,833円
期中追加設定元本額	289,581,299円	153,091,876円
期中一部解約元本額	1,225,800,565円	540,613,784円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	10,474,302,833口	10,086,780,925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9,772,985,643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9,402,352,824円で あります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期
自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日

<p>1 分配金の計算過程 (2023年3月18日から2023年4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(12,652,699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(1,874,006,788円)及び分配準備積立金(103,935,845円)より、分配対象額は1,990,595,332円(1万口当たり1,758.15円)であり、うち5,660,995円(1万口当たり5円)を分配金額としております。</p>	<p>1 分配金の計算過程 (2023年9月20日から2023年10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(12,256,641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(1,724,080,687円)及び分配準備積立金(132,747,128円)より、分配対象額は1,869,084,456円(1万口当たり1,797.86円)であり、うち5,198,008円(1万口当たり5円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年4月18日から2023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(13,205,569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(1,876,466,565円)及び分配準備積立金(110,879,562円)より、分配対象額は2,000,551,696円(1万口当たり1,764.80円)であり、うち5,667,876円(1万口当たり5円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年10月18日から2023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(12,564,093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(1,714,411,385円)及び分配準備積立金(138,817,750円)より、分配対象額は1,865,793,228円(1万口当たり1,805.01円)であり、うち5,168,297円(1万口当たり5円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年5月18日から2023年6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(11,817,351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(1,759,136,647円)及び分配準備積立金(110,515,001円)より、分配対象額は1,881,468,999円(1万口当たり1,770.95円)であり、うち5,311,983円(1万口当たり5円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年11月18日から2023年12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(12,303,830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(1,702,045,838円)及び分配準備積立金(144,883,219円)より、分配対象額は1,859,232,887円(1万口当たり1,812.01円)であり、うち5,130,235円(1万口当たり5円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年6月20日から2023年7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(12,025,522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(1,745,198,008円)及び分配準備積立金(115,163,662円)より、分配対象額は1,872,387,192円(1万口当たり1,777.38円)であり、うち5,267,219円(1万口当たり5円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年12月19日から2024年1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(12,457,026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(1,694,410,926円)及び分配準備積立金(150,920,175円)より、分配対象額は1,857,788,127円(1万口当たり1,819.20円)であり、うち5,105,982円(1万口当たり5円)を分配金額としております。</p>

<p>(2023年7月19日から2023年8月17日までの分配金計算期間)</p> <p>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(12,355,912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(1,750,070,967円)及び分配準備積立金(121,833,672円)より、分配対象額は1,884,260,551円(1万口当たり1,784.07円)であり、うち5,280,718円(1万口当たり5円)を分配金額としております。</p>	<p>(2024年1月18日から2024年2月19日までの分配金計算期間)</p> <p>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(12,724,963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(1,678,817,513円)及び分配準備積立金(156,345,496円)より、分配対象額は1,847,887,972円(1万口当たり1,826.78円)であり、うち5,057,688円(1万口当たり5円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年8月18日から2023年9月19日までの分配金計算期間)</p> <p>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(12,464,124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(1,736,841,631円)及び分配準備積立金(126,735,982円)より、分配対象額は1,876,041,737円(1万口当たり1,791.06円)であり、うち5,237,151円(1万口当たり5円)を分配金額としております。</p>	<p>(2024年2月20日から2024年3月18日までの分配金計算期間)</p> <p>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(12,593,919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(1,674,860,477円)及び分配準備積立金(162,779,472円)より、分配対象額は1,850,233,868円(1万口当たり1,834.30円)であり、うち5,043,390円(1万口当たり5円)を分配金額としております。</p>

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

区 分	前期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	当期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	同左
-------------------	---	----

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [2023年 9月19日現在]	当期 [2024年 3月18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	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(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。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
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 2023年3月18日 至 2023年9月19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	12,859,440円

親投資信託受益証券	円
合計	12,859,440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 2023年9月20日 至 2024年3月18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	23,903,997円
親投資信託受益証券	円
合計	23,903,997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 [2023年 9月19日現在]	当 期 [2024年 3月18日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 670円)	0.0670円 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 679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	1,195,199.8330	665,726,306	
投資信託受益証券 合計		1,195,199.8330	665,726,306	
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	10,017	
親投資信託受益証券 合計		9,898.0000	10,017	
合計		1,205,097.8330	665,736,323	

##### 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 [2023年 9月19日現在]	当期 [2024年 3月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	667,346	608,917
投資信託受益証券	25,960,785	26,400,422
親投資信託受益証券	10,032	10,034
流動資産合計	26,638,163	27,019,373
資産合計	26,638,163	27,019,373
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	173,563	167,202
未払受託者報酬	597	525
未払委託者報酬	23,398	20,337
未払利息	1	-
その他未払費用	231	224
流動負債合計	197,790	188,288
負債合計	197,790	188,288
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sub>1</sub> 57,854,628	<sub>1</sub> 55,734,128
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sub>2</sub> 31,414,255	<sub>2</sub> 28,903,043
（分配準備積立金）	599,705	658,692
元本等合計	26,440,373	26,831,085
純資産合計	26,440,373	26,831,085
負債純資産合計	26,638,163	27,019,373

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	当期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	1,139,680	1,066,510
有価証券売買等損益	2,934,450	1,439,639
営業収益合計	4,074,130	2,506,149
<b>営業費用</b>		
支払利息	90	12
受託者報酬	3,373	3,302
委託者報酬	131,817	129,270
その他費用	1,349	1,323
営業費用合計	136,629	133,907
営業利益又は営業損失（ ）	3,937,501	2,372,242
経常利益又は経常損失（ ）	3,937,501	2,372,242
当期純利益又は当期純損失（ ）	3,937,501	2,372,242
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（ ）	9,558	19,433
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	35,941,475	31,414,255
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,084,141	1,713,888
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,084,141	1,713,888
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	415,305	545,907
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	415,305	545,907
分配金	1,069,559	1,009,578
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	31,414,255	28,903,043



## (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 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基礎と なる事項	特定期間末日の取扱い 2023年9月17日及び2024年3月17日が休日のため、前特定期 間末日を2023年9月19日とし、当特定期間末日を2024年3月 18日としております。このため、当特定期間は181日と なっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

前期	当期
自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[2023年 9月19日現在]	[2024年 3月18日現在]
1. 1 期首元本額	60,848,633円	57,854,628円
期中追加設定元本額	731,337円	1,027,172円
期中一部解約元本額	3,725,342円	3,147,672円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	57,854,628口	55,734,128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31,414,255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28,903,043円であ ります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期
自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日

<p>1 分配金の計算過程 (2023年3月18日から2023年4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(191,929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(18,097,109円)及び分配準備積立金(525,184円)より、分配対象額は18,814,222円(1万口当たり3,085.59円)であり、うち182,922円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>1 分配金の計算過程 (2023年9月20日から2023年10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(163,088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(17,104,800円)及び分配準備積立金(599,705円)より、分配対象額は17,867,593円(1万口当たり3,080.67円)であり、うち173,995円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年4月18日から2023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(172,836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(17,769,709円)及び分配準備積立金(522,728円)より、分配対象額は18,465,273円(1万口当たり3,084.46円)であり、うち179,595円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年10月18日から2023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(173,950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(16,416,419円)及び分配準備積立金(592,389円)より、分配対象額は17,182,758円(1万口当たり3,081.88円)であり、うち167,261円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年5月18日から2023年6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(188,479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(17,777,089円)及び分配準備積立金(545,902円)より、分配対象額は18,511,470円(1万口当たり3,085.87円)であり、うち179,962円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年11月18日から2023年12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(153,837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(16,455,467円)及び分配準備積立金(599,078円)より、分配対象額は17,208,382円(1万口当たり3,079.40円)であり、うち167,645円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年6月20日から2023年7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(168,655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(17,805,103円)及び分配準備積立金(554,419円)より、分配対象額は18,528,177円(1万口当たり3,083.95円)であり、うち180,237円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>(2023年12月19日から2024年1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(170,374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(16,334,080円)及び分配準備積立金(608,242円)より、分配対象額は17,112,696円(1万口当たり3,080.08円)であり、うち166,676円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>

<p>(2023年7月19日から2023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(161,410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(17,089,857円)及び分配準備積立金(549,907円)より、分配対象額は17,801,174円(1万口当たり3,081.89円)であり、うち173,280円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>(2024年1月18日から2024年2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(168,984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(16,349,870円)及び分配準備積立金(608,630円)より、分配対象額は17,127,484円(1万口当たり3,080.46円)であり、うち166,799円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>
<p>(2023年8月18日から2023年9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(177,424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(17,089,775円)及び分配準備積立金(566,917円)より、分配対象額は17,834,116円(1万口当たり3,082.55円)であり、うち173,563円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>(2024年2月20日から2024年3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(159,412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(16,363,010円)及び分配準備積立金(638,615円)より、分配対象額は17,161,037円(1万口当たり3,079.08円)であり、うち167,202円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

区 分	前期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	当期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>同左</p>
--------------------------	---	-----------

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [2023年 9月19日現在]	当期 [2024年 3月18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	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(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。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
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 2023年3月18日 至 2023年9月19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	535,165円

親投資信託受益証券	円
合計	535,165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 2023年9月20日 至 2024年3月18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	40,360円
親投資信託受益証券	円
合計	40,360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 [2023年 9月19日現在]	当 期 [2024年 3月18日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 4,570円)	0.4570円 1口当たり純資産額 0.4814円 (1万口当たり純資産額 4,814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	5,044.9881	26,400,422	
投資信託受益証券	合計	5,044.9881	26,400,422	
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	10,034	
親投資信託受益証券	合計	9,915.0000	10,034	
	合計	14,959.9881	26,410,456	

##### 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24期 [2023年 9月19日現在]	第25期 [2024年 3月18日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	2,301,897	2,202,393
流動資産合計	2,301,897	2,202,393
資産合計	2,301,897	2,202,393
<b>負債の部</b>		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,292,910	1 2,193,359
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,987	9,034
（分配準備積立金）	11,947	15,606
元本等合計	2,301,897	2,202,393
純資産合計	2,301,897	2,202,393
負債純資産合計	2,301,897	2,202,393

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第24期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	第25期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	-	455
<b>営業収益合計</b>	-	455
<b>営業費用</b>		
営業費用合計	-	-
営業利益又は営業損失（ ）	-	455
経常利益又は経常損失（ ）	-	455
当期純利益又は当期純損失（ ）	-	455
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（ ）	-	18
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	8,987	8,987
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
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	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	390
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	390
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（ ）	8,987	9,034

## (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25期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間末日の取扱い 2023年9月17日及び2024年3月17日が休日のため、前計算期間末日を2023年9月19日とし、当計算期間末日を2024年3月18日としております。このため、当計算期間は181日となっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第24期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	第25期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第24期 [2023年 9月19日現在]	第25期 [2024年 3月18日現在]
1. 1 期首元本額	2,292,910円	2,292,910円
期中追加設定元本額	円	円
期中一部解約元本額	円	99,551円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	2,292,910口	2,193,359口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第24期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	第25期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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(3,035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(81,727円)及び分配準備積立金(8,912円)より、分配対象額は93,674円(1万口当たり408.52円)であります。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(4,178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(78,179円)及び分配準備積立金(11,428円)より、分配対象額は93,785円(1万口当たり427.57円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項



区 分	第24期 自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	第25期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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

## ・ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第24期 [2023年 9月19日現在]	第25期 [2024年 3月18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24期（自 2023年3月18日 至 2023年9月19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	円
合計	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25期（自 2023年9月20日 至 2024年3月18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	434円
合計	434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24期 [2023年 9月19日現在]		第25期 [2024年 3月18日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0039円 10,039円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0041円 10,041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	2,176,063	2,202,393	
親投資信託受益証券 合計		2,176,063	2,202,393	
合計		2,176,063	2,202,393	

## 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・リアルコース（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、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・リアルコース（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）、資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）、マネーパール・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2023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

	2023年2月28日現在 金額（円）
<b>資産：</b>	
投資有価証券（取得原価）	28,920,432,128
未実現利益	243,916,872
投資有価証券（時価）	29,164,349,000
現預金	517,899,229
ブローカーへの預け金	9,535,050
未収利息	413,946,093
追加設定に係る未収入金	113,000,000
為替予約取引に係る未実現利益	275,362,107
その他資産	6
資産合計	30,494,091,485
<b>負債：</b>	
未払費用	93,949,342
未払金	148,417,830
為替予約取引に係る未実現損失	492,982,474
負債合計	735,349,646
<b>純資産総額</b>	<b>29,758,741,839</b>

**各通貨クラスの基準価額**

Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund

AUD Class Units	7,415
Resources Currency Basket Class Units	4,656
BRL Class Units	2,559
EUR Class Units	10,530
JPY Class Units	6,844
MXN Class Units	5,839
TRY Class Units	665
USD Class Units	14,636

**(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。

2023年2月28日現在の為替レートは下記のとおりです。

1 JPY =	0.010887 AUD
1 JPY =	0.038327 BRL
1 JPY =	0.006923 EUR
1 JPY =	0.006064 GBP
1 JPY =	0.134530 MXN
1 JPY =	0.550894 RUB
1 JPY =	0.138597 TRY
1 JPY =	0.007341 USD
1 JPY =	0.134759 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**

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 (%)
<b>AUSTRALIA</b>					
AUST & NZ BANKING GROUP FLT 05/05/31	EUR	4,500,000	569,080,991	557,125,571	1.86%
COMMONWEALTH BANK AUST 3.784% 03/14/32	USD	2,350,000	270,103,592	270,040,469	0.91%
MACQUARIE GROUP LTD FLT 06/21/28	USD	2,800,000	330,918,000	358,923,272	1.21%
NATIONAL AUSTRALIA BANK FLT 09/15/31	GBP	1,200,000	182,332,560	165,225,318	0.56%
WESTPAC BANKING CORP FLT 05/13/31	EUR	1,850,000	243,337,069	229,332,744	0.77%
			1,595,772,212	1,580,647,374	5.31%
<b>AUSTRIA</b>					
BAWAG GROUP AG FLT 03/26/29	EUR	4,000,000	504,988,434	552,657,627	1.85%
UNIQA INSURANCE GROUP AG FLT 12/09/41	EUR	600,000	76,560,702	61,590,893	0.21%
VOLKSBANK WIEN AG 0.875% 03/23/26	EUR	1,800,000	232,917,327	230,682,549	0.78%
			814,466,463	844,931,069	2.84%
<b>BELGIUM</b>					
AGEAS FLT 07/02/49	EUR	700,000	88,603,733	86,683,656	0.29%
AGEAS FLT PERP	EUR	1,400,000	172,214,561	150,836,882	0.51%
BELFIUS BANK SA/NV FLT 04/06/34	EUR	2,000,000	259,281,359	225,481,110	0.76%
			520,099,653	463,001,648	1.56%
<b>BRITISH VIRGIN ISLANDS</b>					
HUARONG FINANCE 2019 3.625% 09/30/30	USD	1,300,000	136,649,924	130,596,131	0.44%
			136,649,924	130,596,131	0.44%
<b>CANADA</b>					
BANK OF NOVA SCOTIA FLT 10/27/81	USD	2,200,000	246,202,000	229,504,567	0.77%
			246,202,000	229,504,567	0.77%
<b>CAYMAN ISLANDS</b>					
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD 4.250% 04/15/26	USD	700,000	73,198,199	88,483,853	0.30%
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD 4.375% 05/01/26	USD	655,000	74,560,989	83,050,125	0.28%
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD 5.500% 01/15/26	USD	570,000	67,854,754	75,115,992	0.25%
			215,613,942	246,649,970	0.83%
<b>CZECH REPUBLIC</b>					
RAIFFEISENBANK AS FLT 06/09/28	EUR	1,400,000	186,801,417	153,371,131	0.52%
			186,801,417	153,371,131	0.52%
<b>DENMARK</b>					
DANSKE BANK A/S FLT 05/15/31	EUR	3,000,000	380,237,162	374,758,359	1.26%

DANSKE BANK A/S FLT 06/21/29	EUR	2,250,000	279,812,950	312,960,743	1.05%
JYSKE BANK A/S FLT 01/28/31	EUR	2,250,000	272,639,083	283,510,462	0.95%
			932,689,195	971,229,564	3.26%
<b>FINLAND</b>					
NORDEA BANK ABP FLT 08/18/31	EUR	2,900,000	382,614,869	363,339,399	1.22%
NORDEA BANK ABP FLT 12/09/32	GBP	800,000	121,374,419	107,066,987	0.36%
SAMPO OYJ FLT 09/03/52	EUR	1,550,000	194,383,740	171,353,948	0.58%
			698,373,028	641,760,334	2.16%
<b>FRANCE</b>					
AXA SA FLT PERP	GBP	2,850,000	518,437,744	465,181,002	1.56%
BANQUE FED CRED MUTUEL 1.125% 11/19/31	EUR	1,800,000	233,816,478	186,514,194	0.63%
BNP PARIBAS FLT 05/24/31	GBP	1,000,000	153,807,644	142,790,601	0.48%
BNP PARIBAS FLT 08/31/33	EUR	2,300,000	295,992,597	260,011,764	0.87%
BPCE SA FLT 01/13/42	EUR	1,200,000	154,129,967	145,703,695	0.49%
CNP ASSURANCES FLT 07/27/50	EUR	2,000,000	284,996,619	281,311,563	0.95%
CREDIT AGRICOLE ASSRNCES FLT 01/29/48	EUR	2,000,000	272,543,704	252,908,769	0.85%
CREDIT AGRICOLE SA FLT 12/09/31	GBP	1,200,000	186,641,192	165,941,127	0.56%
CREDIT AGRICOLE SA FLT PERP	EUR	1,400,000	174,581,833	175,296,362	0.59%
CREDIT AGRICOLE SA FLT PERP	EUR	1,100,000	151,820,295	160,548,313	0.54%
GROUPE ACM FLT 04/21/42	EUR	2,500,000	304,417,434	264,717,065	0.89%
LA BANQUE POSTALE FLT 08/02/32	EUR	3,000,000	379,425,930	349,425,008	1.17%
MUTUELLE ASSURANCE FLT 06/21/52	EUR	1,900,000	231,308,527	190,276,110	0.64%
SOCIETE GENERALE FLT 06/30/31	EUR	3,100,000	394,254,254	386,683,864	1.30%
			3,736,174,218	3,427,309,437	11.52%
<b>GERMANY</b>					
DEUTSCHE BANK AG FLT 02/17/32	EUR	1,300,000	164,493,469	140,065,992	0.47%
DEUTSCHE BANK NY FLT 01/14/32	USD	1,700,000	197,265,212	182,631,472	0.61%
HANNOVER RE FLT 10/09/39	EUR	1,700,000	198,098,357	190,528,193	0.64%
LANDBK HESSEN-THUERINGEN FLT 09/15/32	EUR	1,700,000	243,859,823	232,199,849	0.78%
LB BADEN-WUERTTEMBERG 3.625% 06/16/25	EUR	1,980,000	275,882,567	277,708,022	0.94%
TALANX AG FLT 12/01/42	EUR	1,000,000	128,134,748	106,528,601	0.36%
			1,207,734,176	1,129,662,129	3.80%
<b>HONG KONG</b>					
AIA GROUP LTD FLT 09/09/33	EUR	1,300,000	170,273,198	148,966,959	0.50%
AIA GROUP LTD FLT PERP	USD	1,800,000	199,243,925	213,498,787	0.72%
			369,517,123	362,465,746	1.22%
<b>IRELAND</b>					
BANK OF IRELAND GROUP FLT 10/14/29	EUR	3,600,000	443,282,715	492,868,439	1.66%
ZURICH FINANCE IRELAND FLT 04/19/51	USD	1,800,000	187,560,000	194,136,124	0.65%
ZURICH FINANCE IRELAND FLT 05/02/52	USD	1,637,000	188,303,125	176,606,548	0.59%

			819,145,841	863,611,111	2.90%
<b>ISRAEL</b>					
BANK HAPOALIM FLT 01/21/32	USD	3,300,000	375,226,500	384,327,611	1.29%
			375,226,500	384,327,611	1.29%
<b>ITALY</b>					
ASSICURAZIONI GENERALI FLT 06/08/48	EUR	2,550,000	378,289,811	364,239,972	1.22%
			378,289,811	364,239,972	1.22%
<b>JAPAN</b>					
DAI-ICHI LIFE INSURANCE FLT PERP	USD	4,760,000	549,013,560	634,619,582	2.13%
MITSUI SUMITOMO INSURANC FLT PERP	USD	3,100,000	343,774,504	406,339,157	1.37%
SOMPO JAPAN INSURANCE FLT 03/28/73	USD	1,290,000	125,730,568	175,444,988	0.59%
SUMITOMO MITSUI FINL GRP 3.202% 09/17/29	USD	2,730,000	292,888,035	317,932,632	1.07%
			1,311,406,667	1,534,336,359	5.16%
<b>LUXEMBOURG</b>					
SWISS RE FINANCE LUX FLT PERP	USD	1,800,000	191,312,364	227,465,938	0.76%
			191,312,364	227,465,938	0.76%
<b>NETHERLANDS</b>					
ABN AMRO BANK NV FLT 03/13/37	USD	3,000,000	340,365,000	309,886,946	1.04%
AEGON NV FLT PERP	USD	2,000,000	186,437,645	223,083,964	0.75%
ARGENTUM (SWISS RE LTD) FLT PERP	USD	1,800,000	192,480,207	226,277,639	0.76%
ASR NEDERLAND NV FLT 05/02/49	EUR	2,250,000	283,695,075	281,619,168	0.95%
COOPERATIEVE RABOBANK UA FLT 04/06/33	USD	400,000	48,806,000	47,347,359	0.16%
COOPERATIEVE RABOBANK UA FLT 11/30/32	EUR	1,300,000	177,460,473	176,798,414	0.59%
COOPERATIEVE RABOBANK UA FLT PERP	EUR	1,200,000	145,657,442	155,208,617	0.52%
DE VOLKSBANK NV FLT 10/22/30	EUR	3,800,000	479,510,697	497,770,671	1.67%
DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 01/15/32	EUR	1,000,000	124,200,604	103,970,155	0.35%
ELM BV(HELVETIA SCHWEIZ) FLT 09/29/47	EUR	950,000	115,872,577	124,505,439	0.42%
ING GROEP NV FLT 03/28/33	USD	840,000	100,459,142	102,790,867	0.35%
ING GROEP NV FLT 05/26/31	EUR	1,200,000	141,564,503	157,112,836	0.53%
ING GROEP NV FLT 06/09/32	EUR	500,000	66,582,328	60,944,137	0.20%
NN GROUP NV FLT PERP	EUR	3,300,000	461,773,159	460,457,890	1.55%
			2,864,864,852	2,927,774,102	9.84%
<b>NORWAY</b>					
DNB BANK ASA FLT PERP	USD	2,000,000	218,496,472	256,366,655	0.86%
			218,496,472	256,366,655	0.86%
<b>OTHER</b>					
BANQUE OUEST AFRICAINE D 2.750% 01/22/33	EUR	400,000	49,925,955	43,482,221	0.15%
			49,925,955	43,482,221	0.15%



**PERU**

BANCO DE CREDITO DEL PER FLT 07/01/30	USD	2,650,000	306,319,106	326,858,109	1.10%
			306,319,106	326,858,109	1.10%

**SOUTH KOREA**

HANWHA LIFE INSURANCE FLT 02/04/32	USD	3,000,000	341,805,000	361,266,249	1.21%
			341,805,000	361,266,249	1.21%

**SPAIN**

BANCO SANTANDER SA 3.125% 01/19/27	EUR	3,000,000	364,610,750	408,133,242	1.37%
BANCO SANTANDER SA FLT 10/04/32	GBP	900,000	135,117,430	121,286,264	0.41%
CAIXABANK SA FLT 06/18/31	EUR	2,900,000	370,654,538	364,540,324	1.22%
MAPFRE SA 2.875% 04/13/30	EUR	700,000	93,697,233	85,025,462	0.29%
MAPFRE SA FLT 03/31/47	EUR	600,000	71,996,318	83,043,302	0.28%
			1,036,076,269	1,062,028,594	3.57%

**SWEDEN**

SWEDBANK AB FLT 08/23/32	EUR	650,000	88,638,977	86,714,613	0.29%
			88,638,977	86,714,613	0.29%

**SWITZERLAND**

CREDIT SUISSE GROUP AG FLT 06/09/28	GBP	2,800,000	382,293,771	362,182,302	1.22%
UBS GROUP AG FLT PERP	USD	1,700,000	184,074,201	212,973,569	0.72%
ZUERCHER KANTONALBANK FLT 04/13/28	EUR	1,850,000	249,978,198	242,000,544	0.81%
			816,346,170	817,156,415	2.75%

**UNITED KINGDOM**

AVIVA PLC FLT 06/03/55	GBP	2,000,000	285,230,621	257,645,437	0.87%
BARCLAYS PLC FLT PERP	GBP	900,000	147,317,310	148,591,479	0.50%
HSBC BANK PLC FLT PERP	USD	2,300,000	197,620,996	244,761,328	0.82%
HSBC HOLDINGS PLC 6.000% 03/29/40	GBP	800,000	141,259,280	120,888,024	0.41%
HSBC HOLDINGS PLC 6.800% 06/01/38	USD	3,050,000	430,633,498	433,269,456	1.45%
HSBC HOLDINGS PLC FLT 06/15/27	EUR	1,500,000	205,538,777	206,174,111	0.69%
LLOYDS BANKING GROUP PLC FLT 12/15/31	GBP	2,150,000	313,028,408	302,599,851	1.02%
LLOYDS BANKING GROUP PLC FLT PERP	GBP	1,300,000	190,305,323	200,897,433	0.68%
M&G PLC FLT 10/20/51	GBP	1,250,000	188,771,192	185,854,166	0.62%
NATWEST GROUP PLC FLT 09/14/32	EUR	3,550,000	463,380,567	416,811,531	1.40%
NATWEST GROUP PLC FLT 11/28/31	GBP	500,000	76,971,853	69,863,010	0.23%
PHOENIX GRP HLD PLC 4.375% 01/24/29	EUR	2,870,000	380,970,967	385,053,461	1.29%
RL FINANCE BONDS N03 6.125% 11/13/28	GBP	400,000	76,129,201	64,354,895	0.22%
RL FINANCE NO 4 PLC FLT 10/07/49	GBP	1,200,000	156,582,293	150,102,016	0.50%
SANTANDER UK GROUP HLDGS 5.625% 09/15/45	USD	1,500,000	194,703,578	171,578,450	0.58%
STANDARD CHARTERED PLC 4.300% 02/19/27	USD	2,400,000	239,684,025	315,610,427	1.06%
STANDARD CHARTERED PLC 5.300% 01/09/43	USD	1,150,000	139,193,730	139,539,177	0.47%

VIRGIN MONEY UK PLC FLT 08/19/31	GBP	1,100,000	169,641,846	153,776,243	0.52%
			3,996,963,465	3,967,370,495	13.33%
<b>UNITED STATES OF AMERICA</b>					
AVIATION CAPITAL GROUP 3.500% 11/01/27	USD	1,372,000	152,550,606	164,053,129	0.55%
BANK OF AMERICA CORP 7.750% 05/14/38	USD	2,950,000	496,152,228	473,275,036	1.59%
BANK OF AMERICA CORP FLT 02/04/33	USD	2,250,000	258,591,351	250,660,647	0.84%
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 1.650% 06/12/29	USD	3,350,000	404,299,247	396,002,310	1.33%
CHUBB INA HOLDINGS INC 2.500% 03/15/38	USD	1,350,000	176,023,539	152,548,184	0.51%
CITIGROUP INC 8.125% 07/15/39	EUR	1,030,000	169,137,062	176,958,740	0.59%
COREBRIDGE FINANCIAL INC 3.650% 04/05/27	EUR	650,000	78,783,299	82,568,161	0.28%
FIFTH THIRD BANCORP FLT 04/25/33	USD	2,600,000	332,007,000	326,469,362	1.10%
GLOBAL ATLANTIC FIN CO 3.125% 06/15/31	USD	1,300,000	143,461,410	134,142,786	0.45%
GOLDMAN SACHS CAPITAL I 6.345% 02/15/34	USD	5,150,000	718,749,937	731,553,226	2.45%
HARTFORD FINL SVCS GRP FLT 02/12/47	USD	1,090,000	117,643,047	128,504,550	0.43%
HSBC BANK USA NA 7.000% 01/15/39	USD	2,000,000	275,456,810	306,105,590	1.03%
HUNTINGTON BANCSHARES FLT 05/17/33	USD	1,750,000	228,208,750	228,566,018	0.77%
JACKSON FINANCIAL INC 3.125% 11/23/31	USD	2,500,000	285,483,367	272,087,453	0.91%
JPMORGAN CHASE & CO FLT 05/13/31	USD	3,400,000	360,570,015	389,109,560	1.31%
LIBERTY MUTUAL GROUP INC FLT 12/15/51	USD	1,416,000	157,588,776	160,814,067	0.54%
METLIFE INC 6.400% 12/15/36	USD	2,000,000	253,434,756	273,014,689	0.92%
NASDAQ INC 3.250% 04/28/50	USD	900,000	95,011,345	82,575,696	0.28%
PRINCIPAL FINANCIAL GRP FLT 05/15/55	USD	1,850,000	188,914,600	249,099,776	0.84%
PRUDENTIAL FINANCIAL INC FLT 06/15/43	USD	4,150,000	390,045,442	563,879,019	1.89%
SYNOVUS BANK GA FLT 10/29/30	USD	1,750,000	183,408,741	218,233,457	0.73%
			5,465,521,328	5,760,221,456	19.34%
<b>TOTAL INVESTMENTS IN SECURITIES</b>			28,920,432,128	29,164,349,000	98.00%

## 「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	[2023年 9月19日現在]	[2024年 3月18日現在]
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,619,009	1,525,786
地方債証券		6,002,100	6,001,980
特殊債券			3,000,600
未収利息		3,115	2,862
前払費用		5,292	291
流動資産合計		8,629,516	10,531,519
資産合計		8,629,516	10,531,519
負債の部			
流動負債			
未払金			3,002,010
未払利息		5	
流動負債合計		5	3,002,010
負債合計		5	3,002,010
純資産の部			
元本等			
元本	1	8,527,678	7,439,598
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		101,833	89,911
元本等合計		8,629,511	7,529,509
純資産合計		8,629,511	7,529,509
負債純資産合計		8,629,516	10,531,519

## (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 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	地方債証券及び特殊債券 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 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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。	同左
--	----

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	[2023年 9月19日現在]	[2024年 3月18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	8,527,678円	8,527,678円
同期中における追加設定元本額	円	円
同期中における一部解約元本額	円	1,088,080円
同期末における元本額	8,527,678円	7,439,598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・リアルコース(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	2,274,827円	2,176,063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 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	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	8,527,678円	7,439,598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	8,527,678口	7,439,598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)

・金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2023年 3月18日 至 2023年 9月19日	自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2023年 9月19日現在]	[2024年 3月18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 2023年3月18日 至 2023年9月19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	1,830円
合計	1,830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(2023年8月16日から2023年9月19日まで)を指しております。

(自 2023年9月20日 至 2024年3月18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	60円
特殊債券	2,640円
合計	2,580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(2023年8月16日から2024年3月18日まで)を指しております。

(1口当たり情報に関する注記)

[2023年 9月19日現在]		[2024年 3月18日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0119円 10,119円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0121円 10,121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77回神奈川県公募公債(5年)	3,000,000	2,999,970	
	平成26年度第1回千葉県公募公債	3,000,000	3,002,010	
地方債証券 合計		6,000,000	6,001,980	
特殊債券	第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	3,000,000	3,000,600	
特殊債券 合計		3,000,000	3,000,600	
合計		9,000,000	9,002,580	

## 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）

2024年3月29日 現在

種類	金額
資産総額	5,963,055,054 円
負債総額	12,666,759 円
純資産総額（ - ）	5,950,388,295 円
発行済数量	9,690,359,722 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.6141 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）

2024年3月29日 現在

種類	金額
資産総額	6,943,803,706 円
負債総額	290,899,285 円
純資産総額（ - ）	6,652,904,421 円
発行済数量	4,927,432,220 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.3502 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）

2024年3月29日 現在

種類	金額
資産総額	2,448,153 円
負債総額	744 円
純資産総額（ - ）	2,447,409 円
発行済数量	2,792,611 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.8764 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）

2024年3月29日 現在

種類	金額
資産総額	958,374,255 円
負債総額	1,509,851 円
純資産総額（ - ）	956,864,404 円
発行済数量	1,557,369,953 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.6144 円

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアルコース（毎月分配型）

2024年3月29日 現在

種類	金額
資産総額	1,518,066,984 円
負債総額	2,970,787 円



純資産総額( - )	1,515,096,197 円
発行済数量	9,798,202,833 口
1 単位当たり純資産額( / )	0.1546 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)

2024年3月29日 現在

種類	金額
資産総額	670,662,954 円
負債総額	203,973 円
純資産総額( - )	670,458,981 円
発行済数量	800,053,707 口
1 単位当たり純資産額( / )	0.8380 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)

2024年3月29日 現在

種類	金額
資産総額	710,656,117 円
負債総額	1,714,303 円
純資産総額( - )	708,941,814 円
発行済数量	10,064,452,886 口
1 単位当たり純資産額( / )	0.0704 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)

2024年3月29日 現在

種類	金額
資産総額	27,354,588 円
負債総額	880,386 円
純資産総額( - )	26,474,202 円
発行済数量	54,086,344 口
1 単位当たり純資産額( / )	0.4895 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

2024年3月29日 現在

種類	金額
資産総額	2,202,393 円
負債総額	円
純資産総額( - )	2,202,393 円
発行済数量	2,193,359 口
1 単位あたり純資産額( / )	1.0041 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

2024年3月29日 現在

種類	金額
資産総額	7,529,510 円
負債総額	円
純資産総額( - )	7,529,510 円
発行済数量	7,439,598 口
1 単位あたり純資産額( / )	1.0121 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

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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、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。

上記の振替について、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る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てします。）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。

## 第二部【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】

2024年3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。

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。

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。

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。

売買の執行はトレーディング部が行います。

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。

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。

2024年3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	172	3,579,362
単位型公社債投資信託	2	2,651
単位型株式投資信託	16	81,381
合計	190	3,663,396

### 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。  
また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57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38期事業年度(2022年4月1日から2023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。  
また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人による中間監査を受けております。

なお、従来、当社が監査証明を受けているPwCあらた有限責任監査法人は、2023年12月1日付でPwC京都監査法人と合併、名称を変更しPwC Japan有限責任監査法人となりました。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	21,389,756	20,784,858
前払費用	319,734	427,401
未収委託者報酬	2,902,834	3,200,726
未収収益	2,610,213	3,021,468
未収入金	1,692	4
その他の流動資産	22,412	18,592
流動資産計	27,246,644	27,453,052
固定資産		
有形固定資産	* 1 459,081	* 1 433,750
建物	342,403	307,934
器具備品	116,678	125,816
無形固定資産	228,727	348,422
電話加入権	3,795	3,795
ソフトウェア	188,720	314,954
ソフトウェア仮勘定	36,211	29,672
投資その他の資産	3,576,825	3,508,324
投資有価証券	42,253	48,291
関係会社株式	1,673,049	1,668,529
その他の関係会社有価証券	521,200	520,000
長期前払費用	40,588	30,700
敷金	474,324	474,324
その他長期差入保証金	21,230	21,230
繰延税金資産	804,178	954,048
投資損失引当金	-	208,800
固定資産計	4,264,634	4,290,497
資産合計	31,511,279	31,743,550
負債の部		
流動負債		
未払金	3,183,398	3,477,655
未払手数料	1,306,204	1,464,843
その他未払金	1,877,194	2,012,811
未払費用	398,447	335,471
未払消費税等	277,096	266,103
未払法人税等	1,152,000	1,210,000
預り金	46,775	60,297
前受収益	2,286	2,579
賞与引当金	287,955	288,706
その他の流動負債	7	8
流動負債計	5,347,968	5,640,822
固定負債		
退職給付引当金	845,039	886,720
固定負債計	845,039	886,720
負債合計	6,193,007	6,527,543
純資産の部		
株主資本	25,312,741	25,210,382
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	22,912,741	22,810,382
利益準備金	500,000	500,000
その他利益剰余金	22,412,741	22,310,382
繰越利益剰余金	22,412,741	22,310,382

評価・換算差額等	5,529	5,624
その他有価証券評価差額金	5,529	5,624
純資産合計	25,318,271	25,216,006
負債・純資産合計	31,511,279	31,743,550

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	18,065,913	16,696,838
運用受託報酬	10,405,866	11,663,951
投資助言報酬	66,255	92,682
その他営業収益	532,829	661,029
営業収益計	29,070,864	29,114,502
営業費用		
支払手数料	8,365,057	7,669,451
広告宣伝費	216,312	206,908
調査費	6,860,898	7,435,066
調査費	2,728,988	2,823,854
委託調査費	4,131,910	4,611,211
委託計算費	115,017	119,180
営業雑経費	259,680	265,287
通信費	38,574	60,267
印刷費	175,527	160,147
協会費	24,866	23,883
諸会費	11,208	12,732
図書費	9,504	8,256
営業費用計	15,816,967	15,695,895
一般管理費		
給料	3,925,627	3,883,418
役員報酬	128,277	83,430
給料・手当	2,779,798	2,848,648
賞与	1,017,551	951,339
交際費	4,546	13,259
寄付金	2,632	4,696
旅費交通費	17,590	140,480
租税公課	167,411	174,372
不動産賃借料	468,092	468,091
退職給付費用	161,994	163,194
賞与引当金繰入	287,955	288,706
固定資産減価償却費	165,703	165,502
法定福利費	630,892	629,504
福利厚生費	12,315	10,617
諸経費	487,975	503,320
一般管理費計	6,332,736	6,445,164
営業利益	6,921,159	6,973,442
営業外収益		
受取利息	206	189
受取配当金	* 1 5,672	* 1 4,304
雑益	13,622	13,722
営業外収益計	19,500	18,216
営業外費用		
為替差損	66,106	54,263
雑損	23,333	9,120
営業外費用計	89,440	63,383
経常利益	6,851,219	6,928,275
特別利益		

投資有価証券売却益	-	480
特別利益計	-	480
特別損失		
固定資産除却損	610	190
投資有価証券評価損	-	501
投資損失引当金繰入額	-	208,800
その他特別損失	-	392
特別損失計	610	209,884
税引前当期純利益	6,850,609	6,718,870
法人税、住民税及び事業税	2,169,313	2,220,524
法人税等調整額	69,337	149,911
法人税等合計	2,099,975	2,070,612
当期純利益	4,750,633	4,648,257

**(3)【株主資本等変動計算書】**

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		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	22,599,322
当期変動額						
剰余金の配当						4,937,214
特別償却準備金の取崩					0	0
当期純利益						4,750,633
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	186,580
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	-	22,412,741

	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	23,099,322	25,499,322	6,393	6,393	25,505,715
当期変動額					
剰余金の配当	4,937,214	4,937,214			4,937,214
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	4,750,633	4,750,633			4,750,633
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)			863	863	863
当期変動額合計	186,580	186,580	863	863	187,444
当期末残高	22,912,741	25,312,741	5,529	5,529	25,318,271

第38期(自 2022年4月1日 至 2023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
				繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	22,412,741
当期変動額					
剰余金の配当					4,750,617
当期純利益					4,648,257
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	-	102,359
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	22,310,382

	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	22,912,741	25,312,741	5,529	5,529	25,318,271
当期変動額					
剰余金の配当	4,750,617	4,750,617			4,750,617
当期純利益	4,648,257	4,648,257			4,648,257
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			94	94	94
当期変動額合計	102,359	102,359	94	94	102,264
当期末残高	22,810,382	25,210,382	5,624	5,624	25,216,006

## 注記事項

## （重要な会計方針）

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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

市場価格のない株式等以外のもの

当事業年度末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）

市場価格のない株式等

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ェアについては、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。

##### 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。

##### 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日から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。

#### (3) 投資損失引当金

関係会社等への投資に係る損失に備えるため、当該会社の財政状態等を勘案して必要と認められる額を計上しております。

### 4. 収益及び費用の計上基準

当社は、顧客への投資運用業及び投資助言・代理業に関するサービスから生じる委託者報酬、運用受託報酬等により収益を獲得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

#### (1) 運用報酬

投資運用・助言サービスのうち運用資産残高等を基礎として算定される報酬（運用報酬）については、当該サービスに係る履行義務は日々充足されると判断し、運用期間にわたり収益として認識しております。確定した報酬は、月次、年4回、年2回もしくは年1回受け取ります。

#### (2) 成功報酬

成功報酬は、契約上定められる超過収益の達成等により履行義務を充足し、報酬額及び支払われることが確定した時点で収益として認識しております。確定した報酬は、履行義務充足時点から短期間で支払いを受けます。

#### （重要な会計上の見積り）

第37期 2022年3月31日現在	第38期 2023年3月31日現在
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。	同左

#### （貸借対照表関係）

第37期 2022年3月31日現在	第38期 2023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。	* 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 182,121千円	建物 217,486千円
器具備品 501,021千円	器具備品 477,945千円

#### （損益計算書関係）

第37期 自 2021年4月1日 至 2022年3月31日	第38期 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日
<p>* 1 . 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。</p> <p style="text-align: center;">関係会社からの受取配当金 2,000千円</p> <p>上記のほか、関係会社に対する営業外収益のうち、雑益の合計額は営業外収益の総額の100分の10を超えており、その金額は8,520千円であります。</p>	<p>* 1 . 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。</p> <p style="text-align: center;">関係会社からの受取配当金 3,605千円</p> <p>上記のほか、関係会社に対する営業外収益のうち、雑益の合計額は営業外収益の総額の100分の10を超えており、その金額は9,067千円であります。</p>

## (株主資本等変動計算書関係)

第37期(自 2021年4月1日 至 2022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	2021年4月1日 現在	増加	減少	2022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

2021年6月30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	4,937,214千円
(ロ) 1株当たり配当額	128,909円
(ハ) 基準日	2021年3月31日
(ニ) 効力発生日	2021年6月30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

2022年6月30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	4,750,617千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	124,037円
(ニ) 基準日	2022年3月31日
(ホ) 効力発生日	2022年6月30日

第38期(自 2022年4月1日 至 2023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	2022年4月1日 現在	増加	減少	2023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

2022年6月30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	4,750,617千円
(ロ) 1株当たり配当額	124,037円
(ハ) 基準日	2022年3月31日
(ニ) 効力発生日	2022年6月30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

2023年6月29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	4,648,241千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	121,364円
(ニ) 基準日	2023年3月31日
(ホ) 効力発生日	2023年6月29日

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

第37期 自 2021年4月1日 至 2022年3月31日	第38期 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日
<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p> <p>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>(1) 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク 同左</p> <p>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 同左</p> <p>市場リスク 同左</p> <p>流動性リスク 同左</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

## 第37期（2022年3月31日現在）

2022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。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
投資有価証券			
その他有価証券	42,253	42,253	-
敷金	474,324	474,362	37
資産計	516,578	516,616	37

(注1) 以下の金融商品については、現金であること、及び短期で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

現金・預金  
未収委託者報酬  
未収収益  
未収入金  
預り金  
未払金  
未払費用

(注2) 関係会社株式及びその他の関係会社有価証券(持分相当額を純額で計上する組合等への出資1,200千円を除く)については、市場価格のない株式等に該当することから、時価を注記しておりません。これらの貸借対照表計上額は、それぞれ以下のとおりです。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額
関係会社株式	
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	520,000

(注3) その他の関係会社有価証券のうち1,200千円については、貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資に該当するため、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日改正)の第24-16項を適用し、時価に関する注記を省略しております。

(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

(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
投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	-	21,628	538	-
合計	-	21,628	538	-

第38期(2023年3月31日現在)

2023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。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
投資有価証券			
その他有価証券	48,291	48,291	-
敷金	474,324	475,064	739
資産計	522,615	523,355	739

(注1) 以下の金融商品については、現金であること、及び短期で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

現金・預金  
未収委託者報酬  
未収収益  
未収入金  
預り金  
未払金  
未払費用

(注2) 関係会社株式及びその他の関係会社有価証券については、市場価格のない株式等に該当することから、時価を注記しておりません。これらの貸借対照表計上額は、それぞれ以下のとおりです。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額
関係会社株式	
子会社株式	1,640,302
関連会社株式	28,227
その他の関係会社有価証券	520,000

(注3) 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

(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
投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	1,679	18,855	995	995
合計	1,679	18,855	995	995

## 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

第37期（2022年3月31日現在）

金融商品の時価を時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

- レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

## (1)時価で貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
投資有価証券 其他有価証券	-	42,253	-	42,253
資産計	-	42,253	-	42,253

## (2)時価で貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

(単位：千円)

	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
敷金	-	474,362	-	474,362
資産計	-	474,362	-	474,362

(注)時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

投資有価証券

投資信託は基準価額を用いて評価しており、活発な市場における相場価格とはいえないことから、レベル2の時価に分類しております。

敷金

敷金は、回収可能性を反映した将来キャッシュ・フローを残存期間に対応する国債の利回り等で割り引いた現在価値により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

第38期（2023年3月31日現在）

金融商品の時価を時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

- レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

## (1)時価で貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
投資有価証券 其他有価証券	-	48,291	-	48,291
資産計	-	48,291	-	48,291

## (2)時価で貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

(単位：千円)

	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
敷金	-	475,064	-	475,064

資産計	-	475,064	-	475,064
-----	---	---------	---	---------

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

投資有価証券

投資信託は基準価額を用いて評価しており、活発な市場における相場価格とはいえないことから、レベル2の時価に分類しております。

敷金

敷金は、回収可能性を反映した将来キャッシュ・フローを残存期間に対応する国債の利回り等で割り引いた現在価値により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

(有価証券関係)

第37期 2022年3月31日現在				第38期 2023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				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 521,200千円)は、市場価格のない株式等又は貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資に該当することから、記載しておりません。				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28,227千円)並びにその他の関係会社有価証券(貸借対照表計上額 520,000千円)は、市場価格のない株式等に該当することから、記載しておりません。			
2. その他有価証券 (単位:千円)				2. その他有価証券 (単位:千円)			
	貸借対照表計上額	取得原価	差額		貸借対照表計上額	取得原価	差額
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	37,421	28,638	8,783	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	27,605	18,645	8,960
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	4,832	5,645	813	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	20,685	21,539	853
合計	42,253	34,283	7,970	合計	48,291	40,184	8,106
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。				3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 同左			
				4. 減損処理を行った有価証券 当事業年度において、有価証券について501千円(その他有価証券の証券投資信託501千円)減損処理を行っております。			

(収益認識関係)

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

(単位:千円)

	運用報酬	成功報酬	合計
--	------	------	----



委託者報酬	18,065,913	-	18,065,913
運用受託報酬	10,155,263	250,602	10,405,866
投資助言報酬	66,255	-	66,255
その他営業収益	532,829	-	532,829
合計	28,820,261	250,602	29,070,864

2. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

顧客との契約から生じた債権等

顧客との契約から生じた債権（期首残高） 5,349,421千円

顧客との契約から生じた債権（期末残高） 5,513,048千円

（\*）なお、当事業年度の期首及び期末において、顧客との契約から生じた契約資産及び契約負債はありません。

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

（単位：千円）

	運用報酬	成功報酬	合計
委託者報酬	16,696,838	-	16,696,838
運用受託報酬	11,529,748	134,202	11,663,951
投資助言報酬	92,682	-	92,682
その他営業収益	661,029	-	661,029
合計	28,980,299	134,202	29,114,502

2. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

顧客との契約から生じた債権等

顧客との契約から生じた債権（期首残高） 5,513,048千円

顧客との契約から生じた債権（期末残高） 6,222,195千円

（\*）なお、当事業年度の期首及び期末において、顧客との契約から生じた契約資産及び契約負債はありません。

（退職給付関係）

第37期（自 2021年4月1日 至 2022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	800,611千円
勤務費用	69,820千円

利息費用	3,143千円
数理計算上の差異の発生額	9,121千円
退職給付の支払額	29,833千円
退職給付債務の期末残高	852,862千円

## (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	852,862千円
未積立退職給付債務	852,862千円
未認識数理計算上の差異	7,823千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	845,039千円
退職給付引当金	845,039千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	845,039千円

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	69,820千円
利息費用	3,143千円
数理計算上の差異の費用処理額	267千円
その他	10,130千円
確定給付制度に係る退職給付費用	82,826千円

## (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、79,167千円であります。

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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	852,862千円
勤務費用	70,929千円
利息費用	3,351千円
数理計算上の差異の発生額	24,231千円
退職給付の支払額	33,244千円

退職給付債務の期末残高	869,667千円
-------------	-----------

(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	869,667千円
未積立退職給付債務	869,667千円
未認識数理計算上の差異	17,052千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	886,720千円
退職給付引当金	886,720千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	886,720千円

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	70,929千円
利息費用	3,351千円
数理計算上の差異の費用処理額	644千円
その他	6,556千円
確定給付制度に係る退職給付費用	81,482千円

(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	0.8%
-----	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、81,712千円であります。

（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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
繰延税金資産		
退職給付引当金	258,750千円	271,513千円
未払金	3,366千円	2,092千円
賞与引当金	88,171千円	88,401千円
未払法定福利費	11,424千円	11,663千円
未払事業所税	3,958千円	3,929千円
未払事業税	61,773千円	64,984千円
未払調査費	90,375千円	102,531千円
減価償却超過額	53,430千円	24,211千円
繰延資産超過額	8,569千円	9,605千円
未払確定拠出年金	2,038千円	2,120千円
未収実績連動報酬	31,195千円	48,549千円
投資損失引当金	-	63,934千円
未払費用	195,620千円	267,102千円
繰延税金資産小計	808,674千円	960,642千円

評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	808,674千円	960,642千円
繰延税金負債		
前払費用	2,055千円	4,110千円
その他有価証券評価差額金	2,440千円	2,482千円
繰延税金負債合計	4,495千円	6,593千円
繰延税金資産の純額	804,178千円	954,048千円

## 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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023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

## 3. 法人税及び地方法人税に関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度からグループ通算制度を適用しているため、法人税及び地方法人税の会計処理またはこれらに関する税効果会計の会計処理および開示については、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月12日)を当事業年度の期首から適用しています。

## (セグメント情報等)

第37期 自 2021年4月1日 至 2022年3月31日	第38期 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日
<p>[セグメント情報]</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>[セグメント情報]</p> <p>同左</p>

## [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
26,067,627	3,003,236	29,070,864

(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

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

4,883,617千円

## (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

(単位：千円)

日本	その他	合計
25,542,522	3,571,980	29,114,502

(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

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

3,989,751千円

## (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37期（自 2021年4月1日 至 2022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38期（自 2022年4月1日 至 2023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37期 自 2021年 4月 1日 至 2022年 3月31日	
1 株当たり純資産額	661,051円47銭
1 株当たり当期純利益金額	124,037円43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	25,318,271千円
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	25,318,271千円
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	4,750,633千円
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	4,750,633千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

第38期 自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日	
1 株当たり純資産額	658,381円38銭
1 株当たり当期純利益金額	121,364円43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	25,216,006千円
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	25,216,006千円
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	4,648,257千円
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	4,648,257千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間 (2023年9月30日現在)		
資産の部		
流動資産		
現金・預金		17,035,638
前払費用		389,252
未収委託者報酬		3,391,959
未収収益		4,101,522
未収入金		56,743
その他の流動資産		25,714
流動資産計		25,000,830
固定資産		
有形固定資産	* 1	686,176
建物		459,184
器具備品		226,992
無形固定資産		404,235
電話加入権		3,795
ソフトウェア		379,399
ソフトウェア仮勘定		21,041
投資その他の資産		3,812,118
投資有価証券		46,106
関係会社株式		1,668,529
その他の関係会社有価証券		530,000
長期前払費用		22,304
敷金		474,324
その他長期差入保証金		21,230
繰延税金資産		1,258,424
投資損失引当金		208,800
固定資産計		4,902,530
資産合計		29,903,361
負債の部		
流動負債		
未払金		3,694,268
未払手数料		1,546,039
その他未払金		2,148,229
未払費用		342,443
未払消費税等	* 2	233,391
未払法人税等		1,355,000
預り金		61,660
前受収益		13,302
賞与引当金		569,018
その他の流動負債		35



流動負債計	6,269,121
固定負債	
退職給付引当金	914,386
固定負債計	914,386
負債合計	7,183,508
純資産の部	
株主資本	22,712,318
資本金	2,000,000
資本剰余金	400,000
その他資本剰余金	400,000
利益剰余金	20,312,318
利益準備金	500,000
その他利益剰余金	19,812,318
繰越利益剰余金	19,812,318
評価・換算差額等	7,534
その他有価証券評価差額金	7,534
純資産合計	22,719,853
負債・純資産合計	29,903,361

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	8,494,444
運用受託報酬	6,212,505
投資助言報酬	50,944
その他営業収益	332,443
営業収益計	15,090,338
営業費用	
支払手数料	3,930,561
広告宣伝費	96,009
調査費	4,039,695
調査費	1,610,330
委託調査費	2,429,365
委託計算費	59,548
営業雑経費	133,241
通信費	29,396
印刷費	76,803
協会費	12,345
諸会費	9,611
図書費	5,084
営業費用計	8,259,058
一般管理費	
給料	1,675,634
役員報酬	41,325
給料・手当	1,488,342
賞与	145,966
交際費	10,489
寄付金	7,593
旅費交通費	78,583
租税公課	90,871

不動産賃借料		234,045
退職給付費用		88,001
賞与引当金繰入		569,018
固定資産減価償却費	* 1	107,128
法定福利費		343,406
福利厚生費		10,622
諸経費		403,938
一般管理費計		3,619,333
営業利益		3,211,946
営業外収益		
受取利息		68
受取配当金		955
雑益		7,395
営業外収益計		8,419
営業外費用		
為替差損		58,090
雑損		14,371
営業外費用計		72,462
経常利益		3,147,903
特別利益		
投資有価証券売却益		829
その他特別利益		402
特別利益計		1,232
特別損失		
固定資産除却損		30,348
特別損失計		30,348
税引前中間純利益		3,118,787
法人税、住民税及び事業税		1,273,828
法人税等調整額		305,218
法人税等合計		968,609
中間純利益		2,150,177

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30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
				繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	22,310,382
当中間期変動額					
剰余金の配当					4,648,241
中間純利益					2,150,177
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	-	-	2,498,063
当中間期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	19,812,318

	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	22,810,382	25,210,382	5,624	5,624	25,216,006
当中間期変動額					
剰余金の配当	4,648,241	4,648,241			4,648,241
中間純利益	2,150,177	2,150,177			2,150,177
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)			1,910	1,910	1,910
当中間期変動額合計	2,498,063	2,498,063	1,910	1,910	2,496,153
当中間期末残高	20,312,318	22,712,318	7,534	7,534	22,719,853

## 注記事項

## (重要な会計方針)

当中間会計期間 自 2023年4月1日 至 2023年9月30日
<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(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</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 中間会計期間末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) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p> <p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(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。</p> <p>(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ェアについては、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。</p> <p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 賞与引当金 従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当中間会計期間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。 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中間会計期間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。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法</p>

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。

### (3) 投資損失引当金

関係会社等への投資に係る損失に備えるため、当該会社の財政状態等を勘案して必要と認められる額を計上しております。

## 4. 収益及び費用の計上基準

当社は、顧客への投資運用業及び投資助言・代理業に関するサービスから生じる委託者報酬、運用受託報酬等により収益を獲得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

### (1) 運用報酬

投資運用・助言サービスのうち運用資産残高等を基礎として算定される報酬(運用報酬)については、当該サービスに係る履行義務は日々充足されると判断し、運用期間にわたり収益として認識しております。確定した報酬は、月次、年4回、年2回もしくは年1回受け取ります。

### (2) 成功報酬

成功報酬は、契約上定められる超過収益の達成等により履行義務を充足し、報酬額及び支払われることが確定した時点で収益として認識しております。確定した報酬は、履行義務充足時点から短期間で支払いを受けます。

### (中間貸借対照表関係)

	当中間会計期間 (2023年9月30日現在)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	建物	221,024千円
	器具備品	422,332千円

### (中間損益計算書関係)

	当中間会計期間 自 2023年4月1日 至 2023年9月30日	
1 減価償却実施額	有形固定資産	56,407千円
	無形固定資産	50,721千円

### (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 自 2023年4月1日 至 2023年9月30日				
1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項				
株式の種類	当事業年度期首 (株)	当中間会計期間 増加 (株)	当中間会計期間 減少 (株)	当中間会計期間末 (株)
普通株式	38,300	-	-	38,300
2. 配当に関する事項				

## 配当金支払額

2023年6月29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・・・・・・・・・・4,648,241千円
- (ロ) 1株当たり配当額・・・・・・・・・・121,364円
- (ハ) 基準日・・・・・・・・・・2023年3月31日
- (ニ) 効力発生日・・・・・・・・・・2023年6月29日

## (金融商品関係)

当中間会計期間（2023年9月30日現在）

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

2023年9月30日現在における中間貸借対照表計上額、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。

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
投資有価証券			
その他有価証券	46,106	46,106	-
敷金	474,324	473,425	899
資産計	520,430	519,531	899

(注1) 以下の金融商品については、現金であること、及び短期で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

- 現金・預金
- 未収委託者報酬
- 未収収益
- 未収入金
- 預り金
- 未払金
- 未払費用

(注2) 関係会社株式及びその他の関係会社有価証券については、市場価格のない株式等に該当することから、時価を注記しておりません。これらの中間貸借対照表計上額は、それぞれ以下のとおりです。

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額
関係会社株式	
子会社株式	1,640,302
関連会社株式	28,227
その他の関係会社有価証券	530,000

## 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

- レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

## (1)時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
投資有価証券				
その他有価証券	-	46,106	-	46,106
資産計	-	46,106	-	46,106

## (2)時価で中間貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

(単位：千円)

	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
敷金	-	473,425	-	473,425
資産計	-	473,425	-	473,425

(注)時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

投資有価証券

投資信託は基準価額を用いて評価しており、活発な市場における相場価格とはいえないことから、レベル2の時価に分類しております。

敷金

敷金は、回収可能性を反映した将来キャッシュ・フローを残存期間に対応する国債の利回り等で割り引いた現在価値により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

(有価証券関係)

当中間会計期間(2023年9月30日現在)

その他有価証券

(単位：千円)

	種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
中間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	34,038	21,163	12,875
中間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	12,067	14,082	2,015
合計		46,106	35,245	10,860

(収益認識関係)

当中間会計期間(自2023年4月1日至2023年9月30日)

1.顧客との契約から生じる収益を分解した情報

(単位：千円)

	運用報酬	成功報酬	合計
委託者報酬	8,494,444	-	8,494,444
運用受託報酬	6,151,982	60,523	6,212,505
投資助言報酬	50,944	-	50,944
その他営業収益	332,443	-	332,443
合計	15,029,814	60,523	15,090,338

2.顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

顧客との契約から生じた債権等

顧客との契約から生じた債権(期首残高) 6,222,195千円

顧客との契約から生じた債権(期末残高) 7,493,481千円

(\*)なお、当中間会計期間の期首及び期末において、顧客との契約から生じた契約資産及び契約負債はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自2023年4月1日至2023年9月30日)

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。

## [関連情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

## 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中間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
13,272,571	1,817,766	15,090,338

(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中間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

投資信託の名称	委託者報酬	関連するセグメント名
東京海上・円資産バランスファンド (毎月決算型)	1,662,509千円	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

## (1 株当たり情報)

当中間会計期間 自 2023年4月1日 至 2023年9月30日	
1株当たり純資産額	593,207円66銭
1株当たり中間純利益金額	56,140円40銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間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いません。	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	22,719,853千円
純資産の部の合計額から控除する金額	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額	22,719,853千円
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数	38,300株
1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益金額	2,150,177千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	2,150,177千円
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。

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。)

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。)

通常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。

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。

上記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(2023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(2023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。

( ) 2023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【参考情報】

当計算期間において、当ファンドに係る以下の書類を関東財務局長宛に提出しております。

書類名	提出年月日
有価証券届出書	2023年12月15日
有価証券報告書	2023年12月15日
臨時報告書	2023年9月28日
	2023年12月27日

# 独立監査人の監査報告書

2023年6月5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 公認会計士 奈良 昌彦  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅  
業務執行社員

## 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2022年4月1日から2023年3月31日までの第38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2023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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

## 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、継続企業的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. 上記の監査報告書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

2024年5月24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 Japan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2023年9月20日から2024年3月18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2024年3月18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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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. 上記の監査報告書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

2024年5月24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 Japan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2023年9月20日から2024年3月18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2024年3月18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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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. 上記の監査報告書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

2024年5月24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 Japan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2023年9月20日から2024年3月18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2024年3月18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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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. 上記の監査報告書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

2024年5月24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 Japan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2023年9月20日から2024年3月18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2024年3月18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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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. 上記の監査報告書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

2024年5月24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 Japan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・リアルコース（毎月分配型）の2023年9月20日から2024年3月18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・リアルコース（毎月分配型）の2024年3月18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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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、継続企業的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. 上記の監査報告書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

2024年5月24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 Japan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2023年9月20日から2024年3月18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2024年3月18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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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、継続企業的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. 上記の監査報告書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

2024年5月24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 Japan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2023年9月20日から2024年3月18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2024年3月18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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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. 上記の監査報告書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

2024年5月24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 Japan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2023年9月20日から2024年3月18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2024年3月18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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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、継続企業的前提下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. 上記の監査報告書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

2024年5月24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 Japan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2023年9月20日から2024年3月18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2024年3月18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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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. 上記の監査報告書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。

## 独立監査人の中間監査報告書

2023年12月5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 Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 久保直毅  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 石井章悟  
業務執行社員

## 中間監査意見

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2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、中間監査の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。

## 中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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。

中間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中間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中間財務諸表の作成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。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の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。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・ 中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。