

【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12月17日
【計算期間】	第26特定期間（自 2024年3月19日 至 2024年9月17日）（注1） 第26期（自 2024年3月19日 至 2024年9月17日）（注2） 第23特定期間（自 2024年3月19日 至 2024年9月17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

各コースは、追加型投信 / 内外 / 債券に属し、マネープール・ファンドは、追加型投信 / 国内 / 債券に属します。

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

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）。

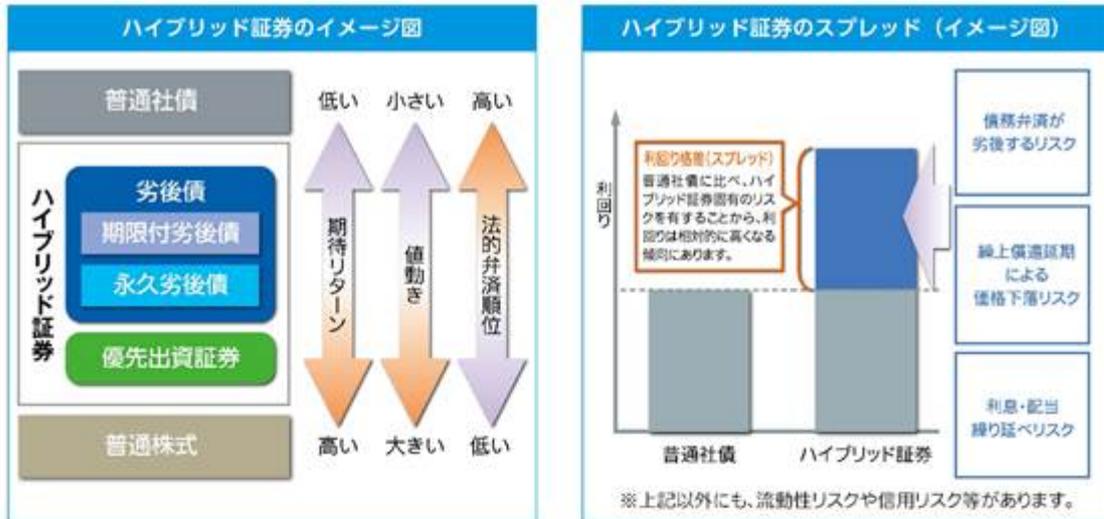
- 各コースは、世界の金融機関が発行するハイブリッド証券等を主要投資対象とする円建ての外国投資信託「東京海上ストラテジック・トラストー東京海上 Rogge グローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド」(以下「外国投資信託」といいます。)と、円建ての国内籍の投資信託である「東京海上マネーマザーファンド」を投資対象とするファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。
- 「マネープール・ファンド」は、円建ての短期公社債等を実質的な投資対象とし、安定した収益の確保を図ることを目的として運用を行います。

● 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、普通社債等と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9月末時点）のいずれかより投資適格相当以上の格付けを取得しているハイブリッド証券等に限りします。

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

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

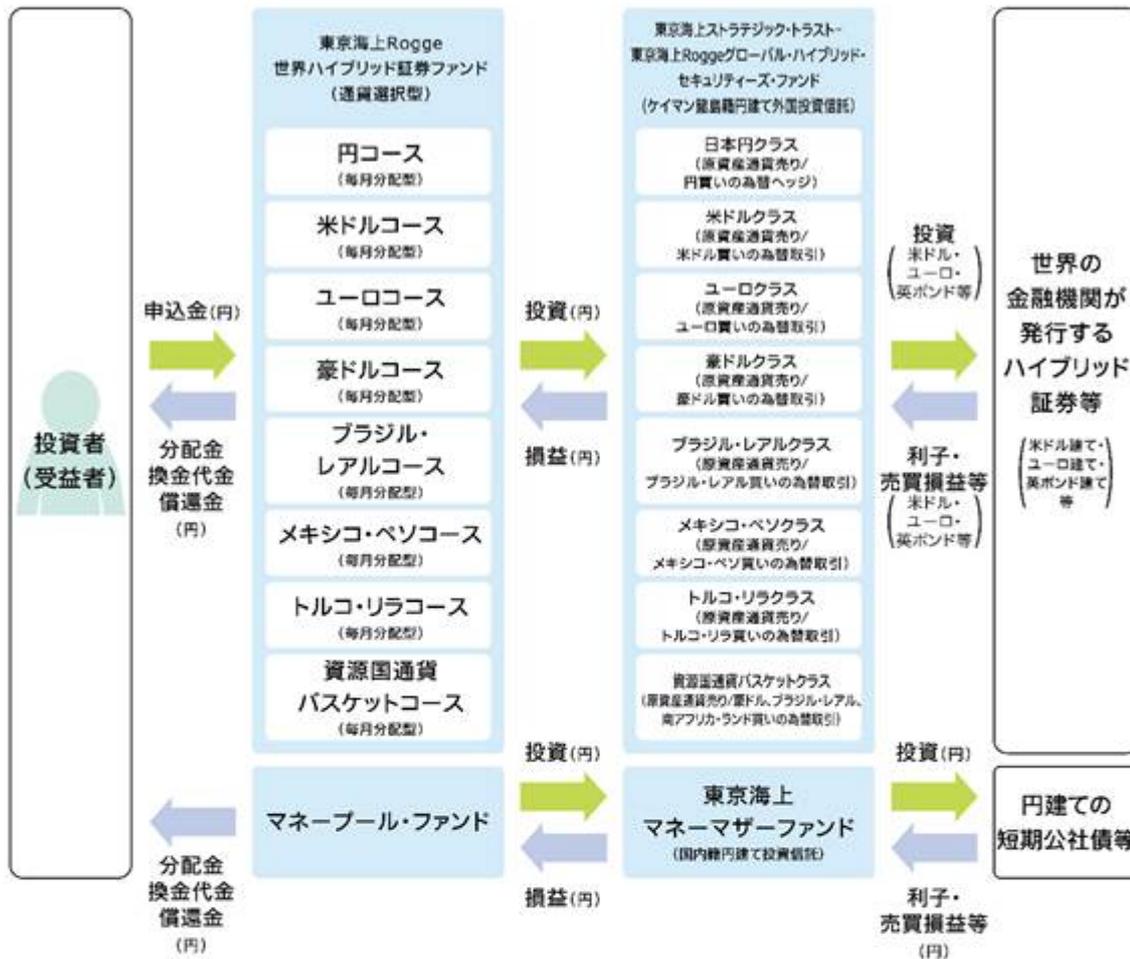
- 同チームはグローバル債券運用に特化したプロフェッショナル集団です。
- 経験豊富なシニアファンドマネージャーを中心に、グローバルに社債の調査、分析を行うアナリストチームとともに、チーム運用を行っています。

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、米ドル建て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



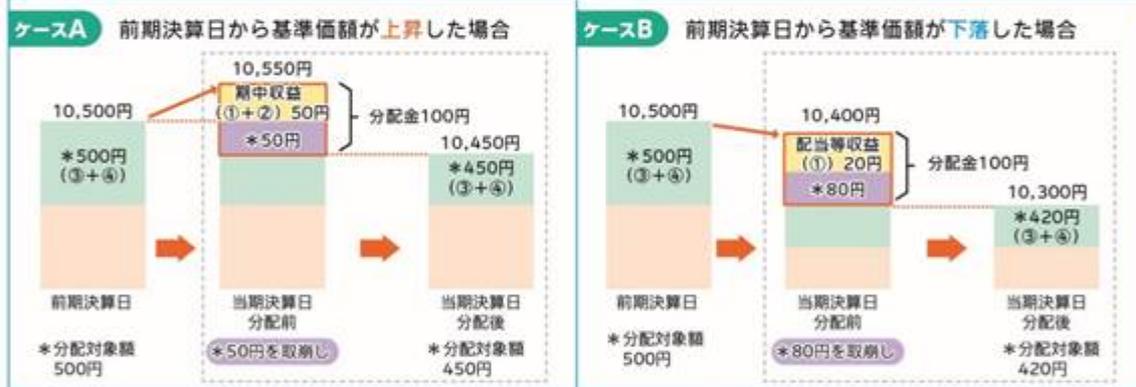
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

※分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

分配対象額とは、

①配当等収益(経費控除後) ②評価益を含む売買益(経費控除後) ③分配準備積立金 ④収益調整金 です。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



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。



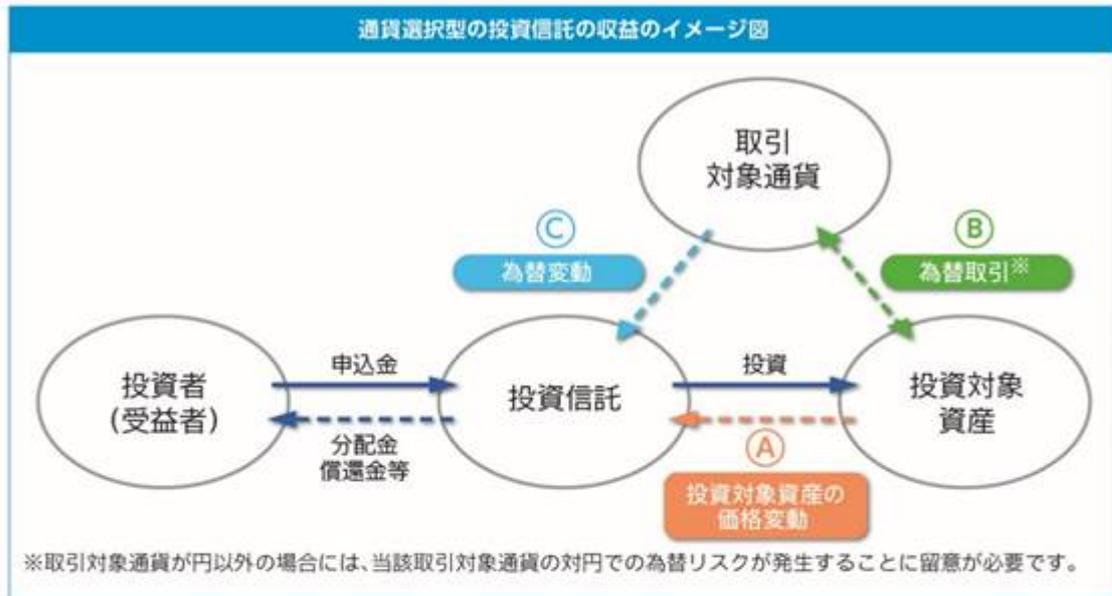
※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

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に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 信託契約締結、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 信託契約締結、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

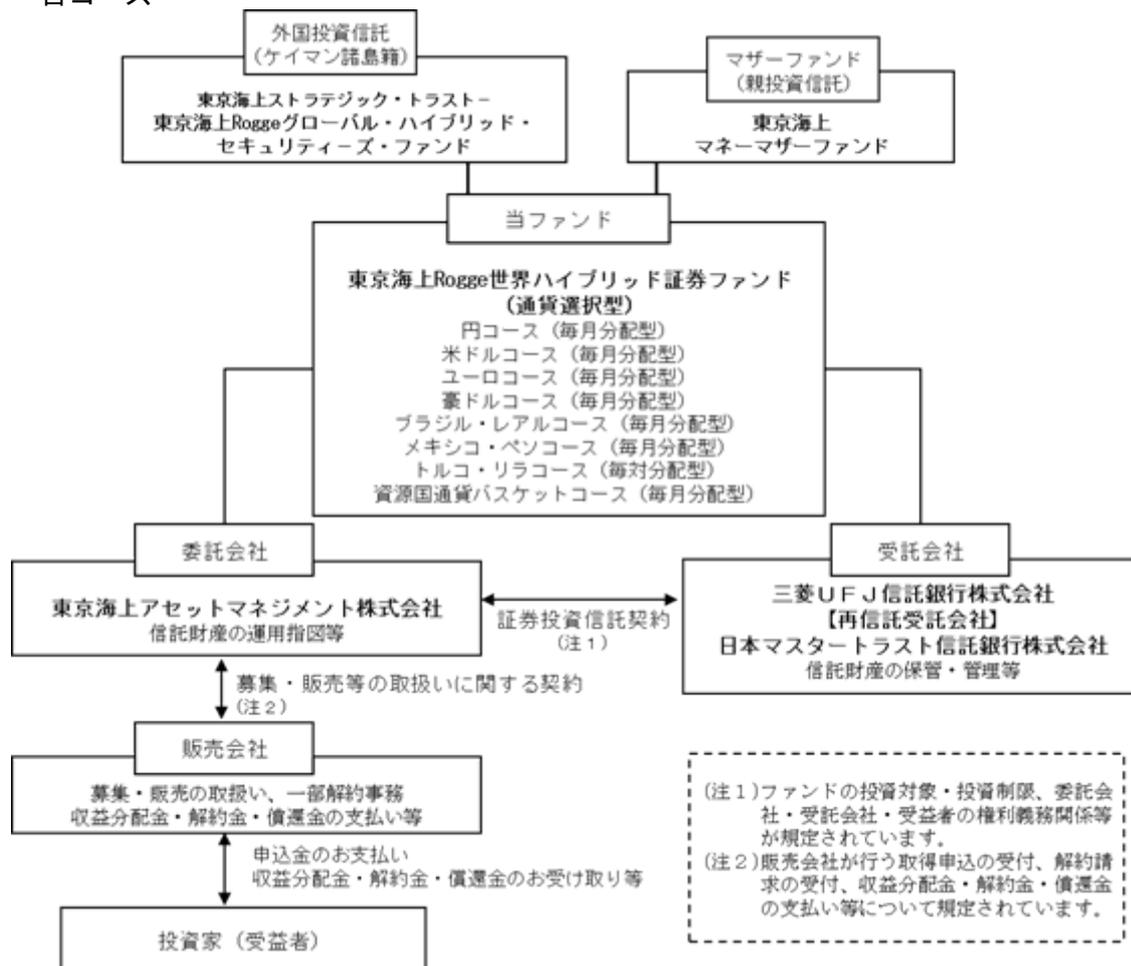
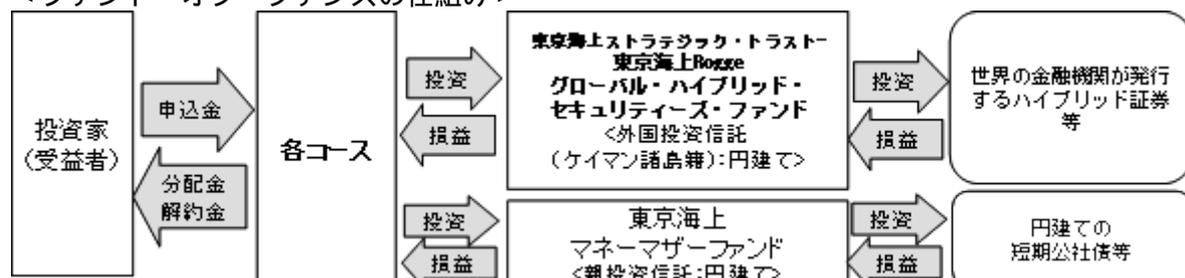
ロシア・ルーブルコース

2022年12月27日 繰上償還

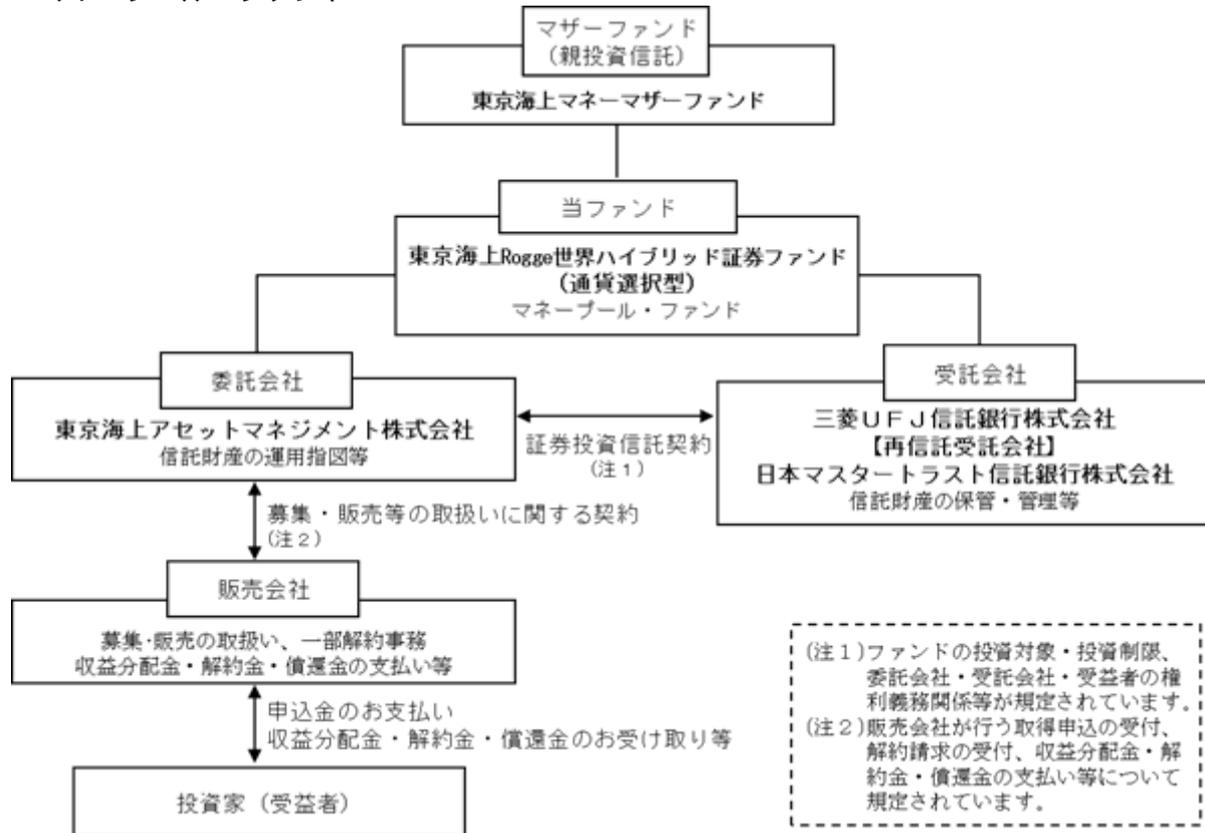
(3) 【ファンドの仕組み】

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



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9月末日現在）
- ・会社の沿革

- 1985年12月 東京海上グループ（現：東京海上日動グループ）等の出資により、資産運用ビジネスの戦略的位置付けで、東京海上エム・シー投資顧問株式会社の社名にて資本金2億円で設立
- 1987年2月 投資顧問業者として登録
- 同年6月 投資一任業務認可取得
- 1991年4月 国内および海外年金の運用受託を開始
- 1998年5月 東京海上アセットマネジメント投信株式会社に社名変更し、投資信託法上の委託会社としての免許取得
- 2007年9月 金融商品取引業者として登録
- 2014年4月 東京海上アセットマネジメント株式会社に社名変更
- 2018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9月末日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

各コース

1．基本方針

当ファンドは、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

当ファンドは、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」といいます。）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でき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：CIBC Caribbean 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インバ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でき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	<ul style="list-style-type: none"> 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。 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10%、合計で20%以内とすることとし、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。
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でき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せん。）

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せん。）

(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せん。）

(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。

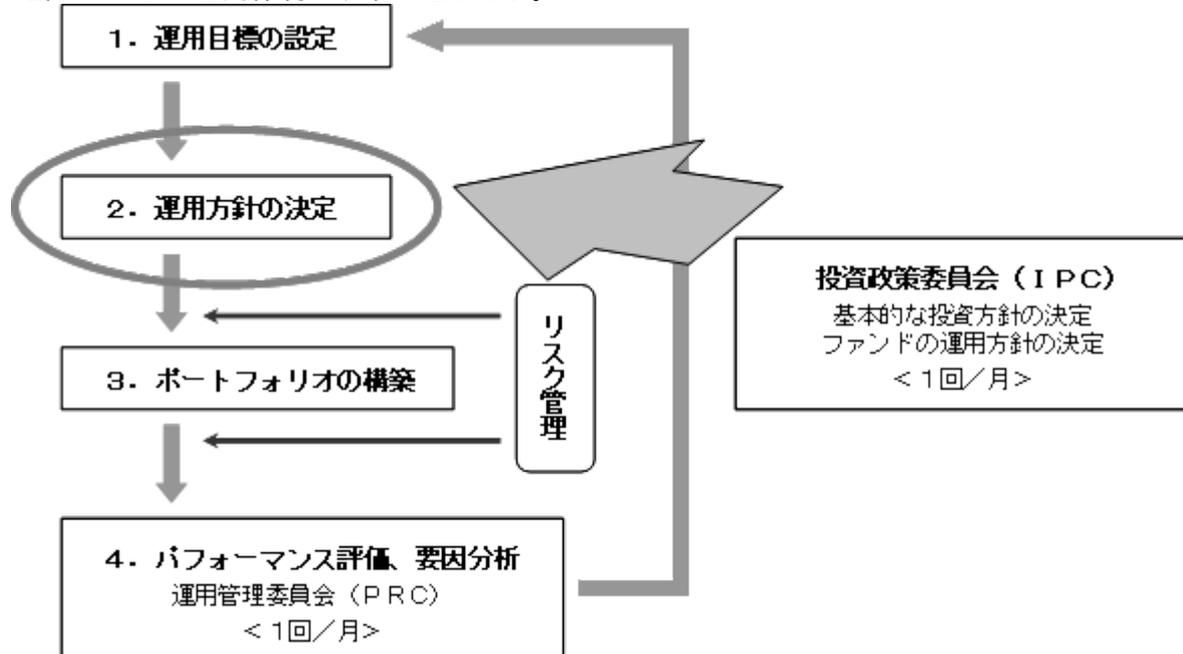
(1) 預金

(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（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9月末日現在）

(4)【分配方針】

各コース

毎決算時に、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。

収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

マネーブル・ファンド

毎決算時に、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。

収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(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）

- 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）

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）

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）

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）

- 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る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)

- 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)

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

先物取引等(約款)

- 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)

- 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)

- 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)

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)

- 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)

- 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します。

有価証券の借入(約款)

- 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)

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)

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

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)

- 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。

基準価額の変動要因

- ・投資する有価証券等の値動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本は保証されているものではなく、投資元本を割り込むことがあります。
- ・運用による損益は、全て投資者に帰属します。
- ・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ます。

各コース

価格変動リスク

<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・リアル、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ないものではありません。また、原資産通貨の金利が各コース通貨の金利より高い場合、これらの金利差相当分のコストがかかります。ただし、為替市場における需給の影響等によっては、金利差相当分以上のコストがかかる場合があります。

各コースの主要投資対象である外国投資信託の組入資産は、米ドルやユーロ等複数の通貨（原資産通貨）で構成されています。外国投資信託における米ドル建以外の組入資産に関しては、原則として原資産通貨売り／米ドル買いの為替取引を行った上で、各クラス（「日本円クラス」を除く）で

は米ドル売り/各コースの通貨買いの為替取引を行い、「日本円クラス」では米ドル売り/円買いの為替ヘッジを行います。その際、取引のタイミングや金額のずれが生じる場合があります、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ことがあります。

また、投資対象国・地域には新興国が含まれています。新興国を取巻く社会的・経済的環境は不透明な場合もあり、金融危機、デフォルト(債務不履行)、重大な政策変更や様々な規制の新たな導入等による投資環境の変化が、先進国への投資に比べてより大きなリスク要因となることがあります。さらに、新興国においては市場規模が小さく流動性が低い場合があります、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

投資対象とする外国投資信託を通じて、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、マネーボール・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ことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

なお、各コースが実質的に投資対象とするハイブリッド証券は、比較的流動性が低いため、より流動性の高い資産への投資を行うファンドと比べて、基準価額への影響度合いが大きくなる可能性があります。

2. その他の留意事項

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において、他のベビーファンドの資金変動等による売買等が発生した場合等には、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が存続しないこととなる場合は、当該コース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。

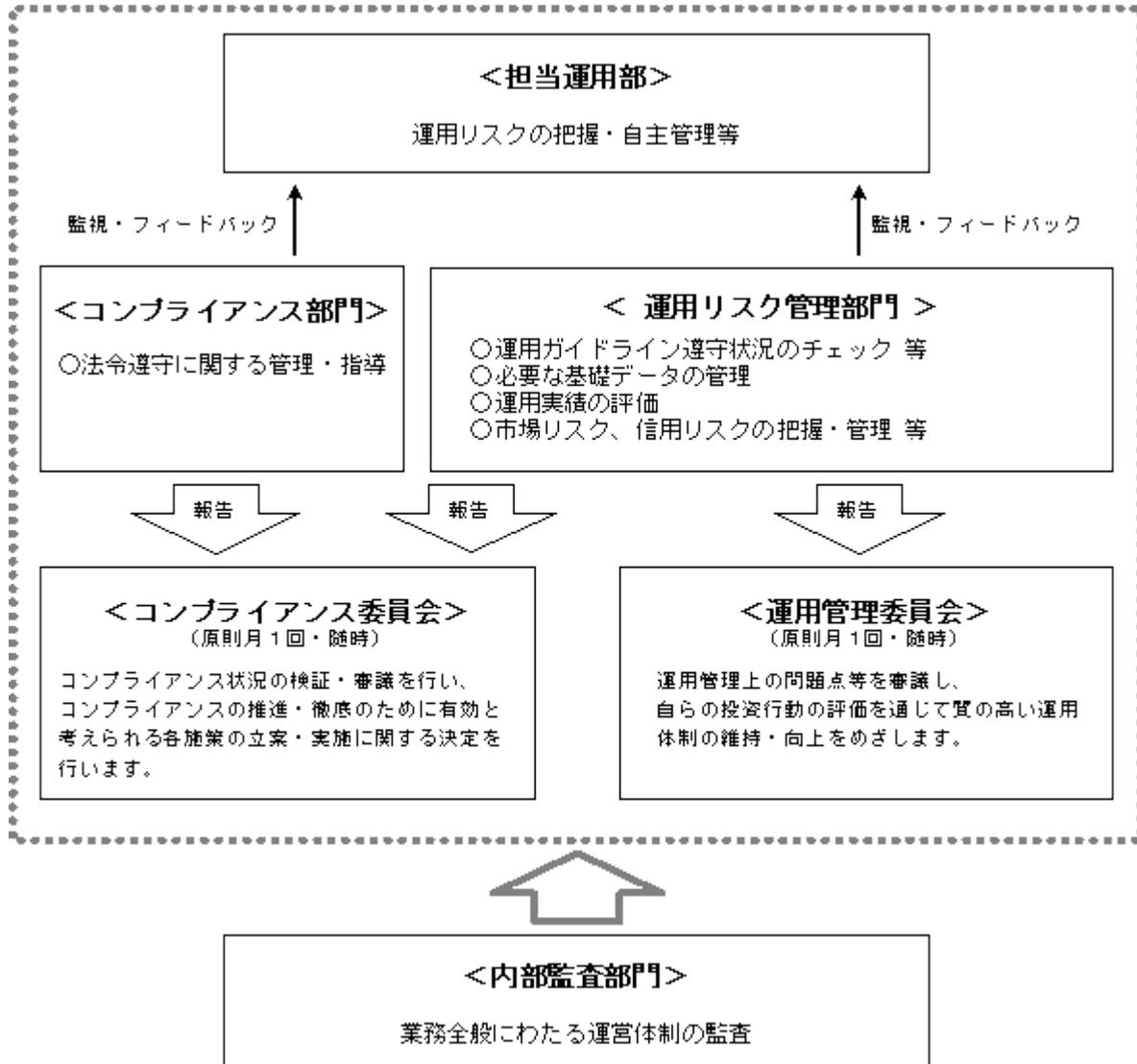
3. 管理体制

< 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。

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10月～2024年9月

ファンドの年間騰落率および
分配金再投資基準価額の推移

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

ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較

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

円コース（毎月分配型）



※後述の注記事項をご参照ください。

米ドルコース（毎月分配型）



※後述の注記事項をご参照ください。

次ページへ続く

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

ユーロコース（毎月分配型）



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



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といたします。）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、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。●JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバー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%）を上限として販売会社が定める率を乗じて得た額とします。ただし、各コースから「マネープール・ファンド」へのスイッチングの場合は無手数料とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。申込手数料には、消費税等が含まれます。

申込手数料は、商品の説明、購入に関する事務コスト等の対価として、申込時にご負担いただくものです。

分配金再投資コースの収益分配金を再投資する場合は、無手数料とします。

(2)【換金（解約）手数料】

換金（解約）手数料

ありません。

信託財産留保額

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。

信託報酬の配分については以下の通りとします。

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

*1 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価

*2 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価

*3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

（ ）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が別途かかります。なお、当ファンドが上記の各投資信託の受益証券を取得するに際しては、申込手数料はかかりません。

マネープール・ファンド

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営業日間の当ファンドまたは当ファンドが投資するマザーファンドの日々の基準価額算出に用いたコール・ローンのオーバーナイト物レートの最低レート（以下、「コールレート」といいます。）に応じて以下に定める率とします。

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

* 1 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価

* 2 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価

* 3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

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（消費税等相当額を含みます。）、外国における資産の保管等に要する費用等は、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。

投資対象とする投資信託証券において諸費用等がかかります。

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

(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。)(2024年3月19日~2024年9月17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)	2.22%	1.02%	1.20%
米ドルコース (毎月分配型)	2.22%	1.02%	1.20%
ユーロコース (毎月分配型)	2.20%	1.02%	1.18%
豪ドルコース (毎月分配型)	2.22%	1.02%	1.20%
ブラジル・リアルコース (毎月分配型)	2.22%	1.02%	1.20%
メキシコ・ペソコース (毎月分配型)	2.22%	1.02%	1.20%
トルコ・リラコース (毎月分配型)	2.22%	1.02%	1.20%
資源国通貨バスケットコース (毎月分配型)	2.21%	1.02%	1.19%
マネープール・ファンド	0.03%	0.03%	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9月30日現在の運用状況です。

また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）円コース（毎月分配型）

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン	4,732,030,580	99.23
親投資信託受益証券	日本	1,003,768	0.02
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		35,596,741	0.74
合計（純資産総額）		4,768,631,089	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	6,586,762,827	98.75
親投資信託受益証券	日本	10,037	0.00
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		82,792,779	1.24
合計（純資産総額）		6,669,565,643	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	14,412,571	98.17
親投資信託受益証券	日本	10,037	0.06
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		258,220	1.75
合計（純資産総額）		14,680,828	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	873,871,638	99.12
親投資信託受益証券	日本	1,003,768	0.11
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		6,700,982	0.76
合計（純資産総額）		881,576,388	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	1,125,133,647	98.05
親投資信託受益証券	日本	1,003,768	0.08
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		21,356,860	1.86
合計（純資産総額）		1,147,494,275	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	603,357,270	98.59
親投資信託受益証券	日本	10,020	0.00
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		8,591,059	1.40

合計(純資産総額)	611,958,349	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	689,821,278	99.25
親投資信託受益証券	日本	10,020	0.00
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		5,142,275	0.73
合計(純資産総額)		694,973,573	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	34,520,605	97.07
親投資信託受益証券	日本	10,037	0.02
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		1,030,210	2.89
合計(純資産総額)		35,560,852	100.00

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

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	3,811,684	100.00
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		145	0.00
合計(純資産総額)		3,811,539	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(%)
国債証券	日本	5,999,601	65.63
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		3,141,186	34.36
合計(純資産総額)		9,140,787	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	677,359.0868	6,958	4,713,064,525	6,986	4,732,030,580	99.23
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	1.0124	1,003,768	1.0124	1,003,768	0.02

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	409,344.5297	15,761	6,451,679,132	16,091	6,586,762,827	98.75
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	1.0124	10,037	1.0124	10,037	0.00

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)ユーロコース(毎月分配型)

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund EUR Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	1,133.9553	12,358	14,013,419	12,710	14,412,571	98.17
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	1.0124	10,037	1.0124	10,037	0.06

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)豪ドルコース(毎月分配型)

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund AUD Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	99,905.2977	8,307	829,913,307	8,747	873,871,638	99.12
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	1.0124	1,003,768	1.0124	1,003,768	0.11

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	398,700.7965	2,701	1,076,890,851	2,822	1,125,133,647	98.05
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	1.0124	1,003,768	1.0124	1,003,768	0.08

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)メキシコ・ペソコース(毎月分配型)

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund MXN Class Units	ケイマン	投資信託受益証券	91,821.2251	6,529	599,500,778	6,571	603,357,270	98.59
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	1.0124	10,020	1.0124	10,020	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	1,165,238.6461	575	670,012,221	592	689,821,278	99.25
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	1.0124	10,020	1.0124	10,020	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	6,530.5723	5,025	32,816,125	5,286	34,520,605	97.07
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	1.0124	10,037	1.0124	10,037	0.02

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

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	東京海上マネーマ ザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	3,764,999	1.0124	3,811,685	1.0124	3,811,684	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	99.23
親投資信託受益証券	0.02
合計	99.25

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)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	98.75
親投資信託受益証券	0.00
合計	98.75

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)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	98.17
親投資信託受益証券	0.06
合計	98.24

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	99.12
親投資信託受益証券	0.11
合計	99.23

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	98.05
親投資信託受益証券	0.08
合計	98.13

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	98.59
親投資信託受益証券	0.00
合計	98.59

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	99.25
親投資信託受益証券	0.00
合計	99.26

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)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	97.07
親投資信託受益証券	0.02
合計	97.10

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)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・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。

(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1243回国庫短期証券	日本	国債証券	-	2024/10/15	3,000,000	99.98	2,999,430	99.99	2,999,907	32.81
2	第1253回国庫短期証券	日本	国債証券	-	2024/12/02	3,000,000	99.97	2,999,301	99.98	2,999,694	32.81

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(%)
国債証券	65.63
合計	65.63

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
第26特定期間末	(2024年 9月17日)	4,759	4,808	0.6174	0.6234
2023年 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	
4月末日		4,832		0.6030	
5月末日		4,817		0.6067	
6月末日		4,793		0.6077	
7月末日		4,794		0.6123	
8月末日		4,767		0.6151	
9月末日		4,768		0.6196	

(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
第26特定期間末	(2024年 9月17日)	6,598	6,944	1.2503	1.3163
2023年 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	
4月末日		7,353		1.3751	
5月末日		7,349		1.3752	
6月末日		7,535		1.4091	
7月末日		7,215		1.3661	
8月末日		6,792		1.2918	
9月末日		6,669		1.2755	

(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
第26特定期間末	(2024年 9月17日)	14	14	0.8285	0.8675
2023年 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	
4月末日		2		0.8816	
5月末日		15		0.8940	
6月末日		15		0.9044	
7月末日		15		0.8834	
8月末日		14		0.8548	
9月末日		14		0.8513	

(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
第26特定期間末	(2024年 9月17日)	837	868	0.5908	0.6118
2023年 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	
4月末日	958		0.6265	
5月末日	966		0.6386	
6月末日	986		0.6570	
7月末日	903		0.6264	
8月末日	873		0.6164	
9月末日	881		0.6216	

(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
第26特定期間末	(2024年 9月17日)	1,120	1,291	0.1208	0.1388
2023年 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	
4月末日		1,512		0.1522	
5月末日		1,386		0.1487	
6月末日		1,322		0.1419	
7月末日		1,237		0.1335	
8月末日		1,164		0.1248	
9月末日		1,147		0.1260	

(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
第23特定期間末	(2024年 9月17日)	607	625	0.7020	0.7230
2023年 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	
4月末日		702		0.8328	
5月末日		726		0.8509	
6月末日		692		0.8113	
7月末日		698		0.7770	
8月末日		611		0.6999	
9月末日		611		0.7062	

(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
第23特定期間末	(2024年 9月17日)	684	712	0.0746	0.0776
2023年 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	
4月末日		706		0.0739	
5月末日		738		0.0774	
6月末日		754		0.0797	
7月末日		751		0.0794	
8月末日		712		0.0750	
9月末日		694		0.0767	

(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
第26特定期間末	(2024年 9月17日)	33	34	0.4614	0.4794
2023年 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	
4月末日		26		0.4972	
5月末日		36		0.5013	
6月末日		36		0.5072	
7月末日		35		0.4886	
8月末日		34		0.4745	
9月末日		35		0.4845	

(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
第26計算期間末	(2024年 9月17日)	3	3	1.0043	1.0043
2023年 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	
4月末日		2		1.0041	
5月末日		2		1.0042	
6月末日		3		1.0042	
7月末日		4		1.0041	
8月末日		3		1.0042	
9月末日		3		1.0042	

【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
第26特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	0.0060

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
第26特定期間	2024年 3月19日 ~ 2024年 9月17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
第26特定期間	2024年 3月19日 ~ 2024年 9月17日	0.0390

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)豪ドルコース(毎月分配型)

期	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第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
第26特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17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
第26特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	0.0180

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)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
第23特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17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
第23特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17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
第26特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	0.0180

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）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
第26特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	2.1

(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
第26特定期間	2024年 3月19日 ~ 2024年 9月17日	0.3

(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)ユーロコース(毎月分配型)

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
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
第26特定期間	2024年 3月19日 ~ 2024年 9月17日	0.3

(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)豪ドルコース(毎月分配型)

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
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
第26特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	1.1

(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）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
第26特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	8.4

(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
第23特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	11.2

(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
第23特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	14.3

(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）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
第26特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	0.4

(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
第26計算期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	0.0

(4)【設定及び解約の実績】

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)円コース(毎月分配型)

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第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
第26特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	25,912,481	2,036,314,882	7,708,867,674

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
第26特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	713,415,075	573,258,012	5,277,837,145

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
第26特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	14,337,893		17,122,299

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
第26特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	7,865,652	148,634,640	1,417,155,952

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
第26特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	991,721,106	2,372,223,738	9,274,224,769

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
第23特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	113,258,940	44,420,202	865,307,020

東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド(通貨選択型)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

第23特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	169,393,206	1,085,869,549	9,170,304,582
---------	-------------------------	-------------	---------------	---------------

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
第26特定期間	2024年 3月19日～2024年 9月17日	20,118,432	2,719,097	73,133,463

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
第26計算期間	2024年 3月19日 ~ 2024年 9月17日	1,848,173	246,102	3,795,430

< 参考情報 >

基準日：2024年9月30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
2023/10	15円	2024/05	10円
2023/11	15円	2024/06	10円
2023/12	15円	2024/07	10円
2024/01	15円	2024/08	10円
2024/02	10円	2024/09	10円
2024/03	10円	設定来累計	6,990円
2024/04	10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
2023/10	110円	2024/05	110円
2023/11	110円	2024/06	110円
2023/12	110円	2024/07	110円
2024/01	110円	2024/08	110円
2024/02	110円	2024/09	110円
2024/03	110円	設定来累計	12,230円
2024/04	110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9月30日

ユーロコース（毎月分配型）



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。

※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2011年11月8日です。

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金	決算期	分配金
2023/10	65円	2024/05	65円
2023/11	65円	2024/06	65円
2023/12	65円	2024/07	65円
2024/01	65円	2024/08	65円
2024/02	65円	2024/09	65円
2024/03	65円	設定来累計	9,835円
2024/04	65円		

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

豪ドルコース（毎月分配型）



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。

※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2011年11月8日です。

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金	決算期	分配金
2023/10	35円	2024/05	35円
2023/11	35円	2024/06	35円
2023/12	35円	2024/07	35円
2024/01	35円	2024/08	35円
2024/02	35円	2024/09	35円
2024/03	35円	設定来累計	11,610円
2024/04	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
2023/10	30円	2024/05	30円
2023/11	30円	2024/06	30円
2023/12	30円	2024/07	30円
2024/01	30円	2024/08	30円
2024/02	30円	2024/09	30円
2024/03	30円	設定来累計	13,525円
2024/04	30円		

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

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9月30日

メキシコ・ペソコース（毎月分配型）



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

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金	決算期	分配金
2023/10	35円	2024/05	35円
2023/11	35円	2024/06	35円
2023/12	35円	2024/07	35円
2024/01	35円	2024/08	35円
2024/02	35円	2024/09	35円
2024/03	35円		
2024/04	35円	設定来累計	8,490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
2023/10	5円	2024/05	5円
2023/11	5円	2024/06	5円
2023/12	5円	2024/07	5円
2024/01	5円	2024/08	5円
2024/02	5円	2024/09	5円
2024/03	5円		
2024/04	5円	設定来累計	9,050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
2023/10	30円	2024/05	30円
2023/11	30円	2024/06	30円
2023/12	30円	2024/07	30円
2024/01	30円	2024/08	30円
2024/02	30円	2024/09	30円
2024/03	30円		
2024/04	30円	設定来累計	12,495円

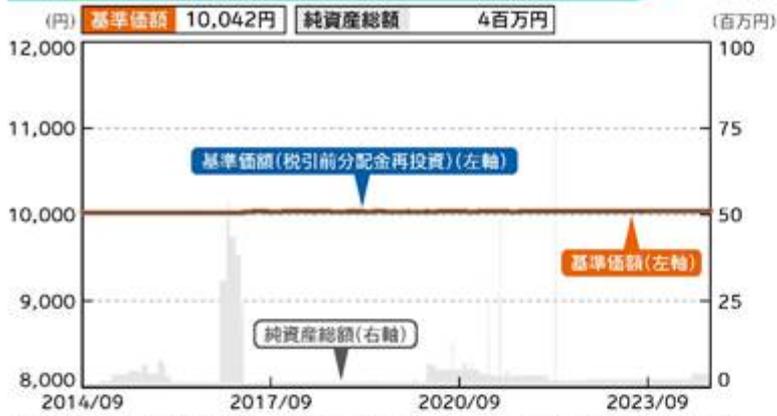
※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

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9月30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
第26期	2024/09/17	0円
設定来累計		分配実績なし

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

次ページへ続く

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

基準日：2024年9月30日

主要な資産の状況

資産構成

円コース（毎月分配型）

資産	比率
東京海上ストラテジック・トラスト-東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド（日本円クラス）	99.2%
東京海上マネーマザーファンド	0.0%
短期金融資産等	0.7%
合計	100.0%

メキシコ・ペソコース（毎月分配型）

資産	比率
東京海上ストラテジック・トラスト-東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド（メキシコ・ペソクラス）	98.6%
東京海上マネーマザーファンド	0.0%
短期金融資産等	1.4%
合計	100.0%

米ドルコース（毎月分配型）

資産	比率
東京海上ストラテジック・トラスト-東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド（米ドルクラス）	98.8%
東京海上マネーマザーファンド	0.0%
短期金融資産等	1.2%
合計	100.0%

トルコ・リラコース（毎月分配型）

資産	比率
東京海上ストラテジック・トラスト-東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド（トルコ・リラクラス）	99.3%
東京海上マネーマザーファンド	0.0%
短期金融資産等	0.7%
合計	100.0%

ユーロコース（毎月分配型）

資産	比率
東京海上ストラテジック・トラスト-東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド（ユーロクラス）	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	1.8%
合計	100.0%

資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）

資産	比率
東京海上ストラテジック・トラスト-東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド（資源国通貨バスケットクラス）	97.1%
東京海上マネーマザーファンド	0.0%
短期金融資産等	2.9%
合計	100.0%

豪ドルコース（毎月分配型）

資産	比率
東京海上ストラテジック・トラスト-東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド（豪ドルクラス）	99.1%
東京海上マネーマザーファンド	0.1%
短期金融資産等	0.8%
合計	100.0%

マネープール・ファンド

資産	比率
債券	65.6%
短期金融資産等	34.4%
合計	100.0%

ブラジル・リアルコース（毎月分配型）

資産	比率
東京海上ストラテジック・トラスト-東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド（ブラジル・リアルクラス）	98.1%
東京海上マネーマザーファンド	0.1%
短期金融資産等	1.9%
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9月30日

東京海上ストラテジック・トラストー東京海上Roggeグローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンドの資産状況

※基準価額算定の基準で記載しています。

証券種別構成

証券種類	比率
期限付劣後債	62.6%
永久劣後債	12.8%
優先出資証券	3.9%
その他	20.6%

格付別構成

格付	比率
AAA格	-
AA格	4.3%
A格	44.1%
BBB格	51.0%
BB格以下	0.5%
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	5.66年
修正デュレーション	4.36
クーポン	3.97%
最終利回り（複利）	4.98%
平均格付	BBB+

通貨別構成

通貨	比率
米ドル	45.5%
ユーロ	39.6%
英ポンド	14.8%

組入上位10カ国

	国	比率
1	アメリカ	22.6%
2	イギリス	15.0%
3	フランス	13.2%
4	オランダ	8.0%
5	ドイツ	6.0%
6	スイス	5.4%
7	スペイン	4.6%
8	オーストラリア	4.5%
9	日本	3.9%
10	オーストリア	3.3%

組入上位10銘柄

組入銘柄数：99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	3.7%
2	FIFTH THIRD BANCORP	その他	4.337%	2032/04/25	アメリカ	A-	2.9%
3	GOLDMAN SACHS CAPITAL I	優先出資証券	6.345%	2034/02/15	アメリカ	BBB-	2.7%
4	LLOYDS BANKING GROUP PLC	期限付劣後債	1.985%	2026/09/15	イギリス	BBB+	2.6%
5	SOCIETE GENERALE	期限付劣後債	1.125%	2026/06/30	フランス	BBB	2.1%
6	NATWEST GROUP PLC	期限付劣後債	1.043%	2027/06/14	イギリス	BBB+	2.1%
7	BANK OF AMERICA CORP	その他	2.972%	2032/02/04	アメリカ	AA-	2.0%
8	NORDEA BANK ABP	期限付劣後債	1.625%	2027/09/09	フィンランド	A	1.8%
9	AXA SA	永久劣後債	5.453%	2026/03/04	フランス	A-	1.8%
10	BAWAG GROUP AG	期限付劣後債	6.750%	2028/11/24	オーストリア	BBB	1.8%

※比率は、保有するハイブリッド証券等の時価総額に占める割合です。

※国は、発行体のリスク所在国（資本関連を含む）を記載しています。

※「組入上位10銘柄」の償還日は、繰上償還条項が付与されている銘柄は基準日以降最初の繰上償還予定日を表示しています（一部銘柄を除く）。

※「ハイブリッド証券等の属性情報」は、保有する各ハイブリッド証券等の数値を加重平均した数値です。保有するハイブリッド証券等の時価評価額を基に計算しています。残存期間、修正デュレーション、最終利回りは、繰上償還条項が付与されている銘柄は基準日以降最初の繰上償還予定日を使用して計算しています（一部銘柄を除く）。平均格付は、格付毎に点数化し、加重平均した結果を四捨五入して表示しており、ファンドの格付ではありません。

また、保有するハイブリッド証券等のうち、格付が取得できない場合は、除外して計算しています。

(注)格付はMoody's社、S&P社、Fitch社のうち、原則として上位の格付を集計、記載しています。

東京海上マネーマザーファンドの資産状況

組入上位10銘柄

組入銘柄数：2銘柄

	銘柄	クーポン	償還日	比率
1	第1243回国庫短期証券	0.000%	2024/10/15	32.8%
2	第1253回国庫短期証券	0.000%	2024/12/02	32.8%
3				
4				
5				

※比率は、純資産総額に占める割合です。

次ページへ続く

- ・「マネーブル・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9月30日

年間収益率の推移

円コース（毎月分配型）



米ドルコース（毎月分配型）



ユーロコース（毎月分配型）



豪ドルコース（毎月分配型）



ブラジル・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9月30日

メキシコ・ペソコース (毎月分配型)



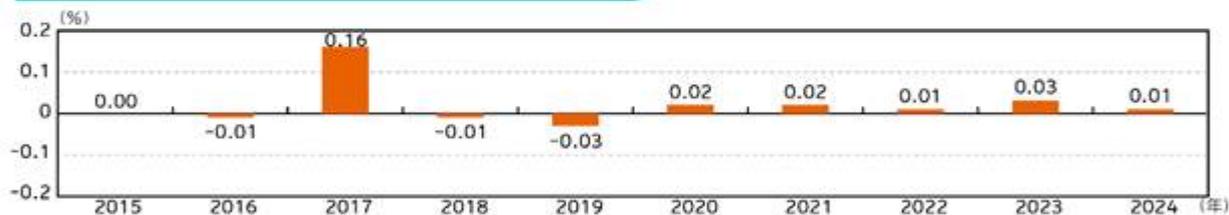
トルコ・リラコース (毎月分配型)



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、お申込み日が以下に該当する日には、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。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

e. 取得申込の受付は、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。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（営業日の9時～17時）

ホームページ

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

g. 申込手数料は、前記「第1ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (1) 申込手数料」をご覧ください。

h. 上記にかかわらず、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます（本書において、同じ。）。）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（スイッチングを含みます。）の受付を中止すること、および既に受け付けた取得申込（スイッチングを含みます。）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、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、解約請求日が以下に該当する日には、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
- ・ルクセンブルクの銀行の休業日

「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。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。
- 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。

(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、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- e. 上記c. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- f. 上記c. からe. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときおよび上記b. の規定に基づいて信託契約を解約する場合には適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記c. からe. までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。
- h. 上記g. の規定にかかわらず、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、信託は、「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. の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a. の併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- 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、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b. からe. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a. からf. までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、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

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、販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

マネープール・ファンド

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、販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

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。

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。

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。

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。

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(2024年3月19日から2024年9月17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26期計算期間(2024年3月19日から2024年9月17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 [2024年 3月18日現在]	当期 [2024年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	99,277,513	58,405,155
投資信託受益証券	5,858,142,052	4,713,064,525
親投資信託受益証券	1,003,470	1,003,768
未収利息	-	347
流動資産合計	5,958,423,035	4,772,473,795
資産合計	5,958,423,035	4,772,473,795
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	9,719,270	7,708,867
未払解約金	9,100,099	1,517,466
未払受託者報酬	115,595	95,872
未払委託者報酬	4,523,287	3,751,603
未払利息	7	-
その他未払費用	50,242	41,672
流動負債合計	23,508,500	13,115,480
負債合計	23,508,500	13,115,480
純資産の部		
元本等		
元本	₁ 9,719,270,075	₁ 7,708,867,674
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	₂ 3,784,355,540	₂ 2,949,509,359
（分配準備積立金）	90,062,462	73,574,866
元本等合計	5,934,914,535	4,759,358,315
純資産合計	5,934,914,535	4,759,358,315
負債純資産合計	5,958,423,035	4,772,473,795

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日	当期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
営業収益		
受取配当金	88,399,942	56,194,321
受取利息	181	28,724
有価証券売買等損益	188,866,257	59,922,771
営業収益合計	277,266,380	116,145,816
営業費用		
支払利息	6,489	4
受託者報酬	757,835	634,405
委託者報酬	29,654,443	24,824,580
その他費用	325,909	275,726
営業費用合計	30,744,676	25,734,715
営業利益又は営業損失（ ）	246,521,704	90,411,101
経常利益又は経常損失（ ）	246,521,704	90,411,101
当期純利益又は当期純損失（ ）	246,521,704	90,411,101
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（ ）	1,297,953	1,751,987
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,198,744,137	3,784,355,540
剰余金増加額又は欠損金減少額	270,249,034	805,074,599
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	270,249,034	805,074,599
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	20,719,041	10,118,004
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	20,719,041	10,118,004
分配金	1,80,365,147	1,48,769,528
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,784,355,540	2,949,509,359

(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 2024年 3月19日 至 2024年 9月17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 2024年3月17日が休日のため、前特定期間末日を2024年3月 18日としております。このため、当特定期間は183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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会 計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な 影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記 を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[2024年 3月18日現在]	[2024年 9月17日現在]
1. 1 期首元本額	10,344,700,523円	9,719,270,075円
期中追加設定元本額	51,518,836円	25,912,481円
期中一部解約元本額	676,949,284円	2,036,314,882円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	9,719,270,075口	7,708,867,674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3,784,355,540円で あります。	純資産額が元本総額を 下回っており、その差 額は2,949,509,359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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日

<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>1 分配金の計算過程 (2024年3月19日から2024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(6,025,971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(17,891,579円)及び分配準備積立金(88,305,273円)より、分配対象額は112,222,823円(1万口当たり117.69円)であり、うち9,533,944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>(2024年4月18日から2024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(8,607,219円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(15,030,308円)及び分配準備積立金(71,045,214円)より、分配対象額は94,682,741円(1万口当たり118.46円)であり、うち7,991,566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>(2024年5月18日から2024年6月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,847,979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(14,925,131円)及び分配準備積立金(70,938,959円)より、分配対象額は90,712,069円(1万口当たり114.58円)であり、うち7,915,318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>(2024年6月18日から2024年7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(8,082,274円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(10,929,035円)及び分配準備積立金(71,281,465円)より、分配対象額は90,292,774円(1万口当たり114.87円)であり、うち7,859,273円(1万口当たり10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>(2024年7月18日から2024年8月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,117,216円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(10,829,738円)及び分配準備積立金(70,568,399円)より、分配対象額は88,515,353円(1万口当たり114.04円)であり、うち7,760,560円(1万口当たり10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>	<p>(2024年8月20日から2024年9月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(8,009,287円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(6,942,467円)及び分配準備積立金(73,274,446円)より、分配対象額は88,226,200円(1万口当たり114.42円)であり、うち7,708,867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 9月20日 至 2024年 3月18日	当期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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 [2024年 3月18日現在]	当期 [2024年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<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。

当期（自 2024年3月19日 至 2024年9月17日）
売買目的有価証券

種 類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	33,190,595円
親投資信託受益証券	199円
合計	33,190,794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 [2024年 3月18日現在]	当 期 [2024年 9月17日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 6,106円)	0.6106円 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 6,174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	677,359.0868	4,713,064,525	
投資信託受益証券 合計		677,359.0868	4,713,064,525	
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	1,003,768	
親投資信託受益証券 合計		991,474.0000	1,003,768	
合計		1,668,833.0868	4,714,068,293	

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 [2024年 3月18日現在]	当期 [2024年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	129,868,244	165,722,078
投資信託受益証券	6,717,232,010	6,500,653,715
親投資信託受益証券	10,034	10,037
未収利息	-	984
流動資産合計	6,847,110,288	6,666,386,814
資産合計	6,847,110,288	6,666,386,814
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	56,514,480	58,056,208
未払解約金	-	4,066,797
未払受託者報酬	131,855	136,310
未払委託者報酬	5,159,518	5,333,767
未払利息	10	-
その他未払費用	50,484	52,287
流動負債合計	61,856,347	67,645,369
負債合計	61,856,347	67,645,369
純資産の部		
元本等		
元本	5,137,680,082	5,277,837,145
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,647,573,859	1,320,904,300
（分配準備積立金）	345,871,051	777,508,890
元本等合計	6,785,253,941	6,598,741,445
純資産合計	6,785,253,941	6,598,741,445
負債純資産合計	6,847,110,288	6,666,386,814

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日	当期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
営業収益		
受取配当金	220,827,378	225,085,756
受取利息	363	65,187
有価証券売買等損益	320,810,048	216,578,292
営業収益合計	541,637,789	8,572,651
営業費用		
支払利息	12,201	4
受託者報酬	820,415	903,307
委託者報酬	32,103,201	35,346,729
その他費用	326,343	329,949
営業費用合計	33,262,160	36,579,989
営業利益又は営業損失()	508,375,629	28,007,338
経常利益又は経常損失()	508,375,629	28,007,338
当期純利益又は当期純損失()	508,375,629	28,007,338
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()	1,305,469	3,665,503
期首剰余金又は期首欠損金()	1,402,157,716	1,647,573,859
剰余金増加額又は欠損金減少額	158,890,723	249,870,891
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	158,890,723	249,870,891
剰余金減少額又は欠損金増加額	87,681,226	198,778,013
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	87,681,226	198,778,013
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	1,332,863,514	1,346,089,596
期末剰余金又は期末欠損金()	1,647,573,859	1,320,904,300

(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 2024年 3月19日 至 2024年 9月17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 2024年3月17日が休日のため、前特定期間末日を2024年3月 18日としております。このため、当特定期間は183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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会 計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な 影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記 を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[2024年 3月18日現在]	[2024年 9月17日現在]
1. 1 期首元本額	4,902,098,091円	5,137,680,082円
期中追加設定元本額	537,214,518円	713,415,075円
期中一部解約元本額	301,632,527円	573,258,012円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	5,137,680,082口	5,277,837,145口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期	当期
自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
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。	1 分配金の計算過程 (2024年3月19日から2024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 (34,522,298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(148,991,947円)、投資信 託約款に規定される収益調整金(2,499,401,320 円)及び分配準備積立金(330,326,999円)より、 分配対象額は3,013,242,564円(1万口当 たり6,039.61円)であり、うち54,880,189円(1万口 あたり110円)を分配金額としております。

<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)</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(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>(2024年4月18日から2024年5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(36,432,052円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(130,100,096円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,658,982,897円)及び分配準備積立金(476,159,374円)より、分配対象額は3,301,674,419円(1万口当たり6,244.59円)であり、うち58,159,493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)</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(31,045,933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>(2024年5月18日から2024年6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(36,297,069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(85,508,291円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,671,881,422円)及び分配準備積立金(607,643,559円)より、分配対象額は3,401,330,341円(1万口当たり6,362.61円)であり、うち58,803,660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)</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(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>(2024年6月18日から2024年7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(36,142,298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(106,299,430円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,628,801,993円)及び分配準備積立金(687,742,025円)より、分配対象額は3,458,985,746円(1万口当たり6,521.15円)であり、うち58,346,560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)</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(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>(2024年7月18日から2024年8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(30,892,367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(2,587,518,160円)及び分配準備積立金(783,801,478円)より、分配対象額は3,402,212,005円(1万口当たり6,469.91円)であり、うち57,843,486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>	<p>(2024年8月20日から2024年9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(31,722,930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(2,579,390,419円)及び分配準備積立金(777,452,982円)より、分配対象額は3,388,566,331円(1万口当たり6,420.35円)であり、うち58,056,208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 9月20日 至 2024年 3月18日	当期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

・ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [2024年 3月18日現在]	当期 [2024年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

当期（自 2024年3月19日 至 2024年9月17日）

売買目的有価証券

種 類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	280,054,810円
親投資信託受益証券	2円
合計	280,054,808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 [2024年 3月18日現在]		当期 [2024年 9月17日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3207円 13,207円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2503円 12,503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	412,451.8568	6,500,653,715	
投資信託受益証券	合計	412,451.8568	6,500,653,715	
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	10,037	
親投資信託受益証券	合計	9,915.0000	10,037	
	合計	422,366.8568	6,500,663,752	

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 [2024年 3月18日現在]	当期 [2024年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	103,154	284,715
投資信託受益証券	2,315,145	14,013,419
親投資信託受益証券	10,034	10,037
未収利息	-	1
流動資産合計	2,428,333	14,308,172
資産合計	2,428,333	14,308,172
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	18,098	111,294
未払受託者報酬	54	291
未払委託者報酬	1,971	11,466
その他未払費用	-	116
流動負債合計	20,123	123,167
負債合計	20,123	123,167
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 2,784,406	¹ 17,122,299
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	² 376,196	² 2,937,294
（分配準備積立金）	17,010	354,257
元本等合計	2,408,210	14,185,005
純資産合計	2,408,210	14,185,005
負債純資産合計	2,428,333	14,308,172

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日	当期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
営業収益		
受取配当金	36,751	122,728
受取利息	-	156
有価証券売買等損益	206,432	701,723
営業収益合計	243,183	578,839
営業費用		
受託者報酬	386	1,269
委託者報酬	14,716	49,379
その他費用	91	440
営業費用合計	15,193	51,088
営業利益又は営業損失()	227,990	629,927
経常利益又は経常損失()	227,990	629,927
当期純利益又は当期純損失()	227,990	629,927
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()	1,304	-
期首剰余金又は期首欠損金()	737,301	376,196
剰余金増加額又は欠損金減少額	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	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	198,589	1,453,761
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	198,589	1,453,761
分配金	137,608	477,410
期末剰余金又は期末欠損金()	376,196	2,937,294

(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 2024年 3月19日 至 2024年 9月17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 2024年3月17日が休日のため、前特定期間末日を2024年3月 18日としております。このため、当特定期間は183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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会 計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な 影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記 を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[2024年 3月18日現在]	[2024年 9月17日現在]
1. 1 期首元本額	4,353,218円	2,784,406円
期中追加設定元本額	1,362,559円	14,337,893円
期中一部解約元本額	2,931,371円	円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	2,784,406口	17,122,299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376,196円でありま す。	純資産額が元本総額を 下回っており、その差 額は2,937,294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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日

<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>1 分配金の計算過程 (2024年3月19日から2024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(3,807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(669,548円)及び分配準備積立金(17,010円)より、分配対象額は690,365円(1万口当たり2,472.09円)であり、うち18,151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>(2024年4月18日から2024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(4,578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(656,184円)及び分配準備積立金(18,025円)より、分配対象額は678,787円(1万口当たり2,423.45円)であり、うち18,205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>(2024年5月18日から2024年6月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(19,936円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,945,446円)及び分配準備積立金(18,402円)より、分配対象額は3,983,784円(1万口当たり2,370.23円)であり、うち109,248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>(2024年6月18日から2024年7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(27,674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(316,334円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,878,580円)及び分配準備積立金(21,531円)より、分配対象額は4,244,119円(1万口当たり2,508.54円)であり、うち109,969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>(2024年7月18日から2024年8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(14,649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(3,815,552円)及び分配準備積立金(340,162円)より、分配対象額は4,170,363円(1万口当たり2,452.17円)であり、うち110,543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>	<p>(2024年8月20日から2024年9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(16,510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(3,741,108円)及び分配準備積立金(346,308円)より、分配対象額は4,103,926円(1万口当たり2,396.82円)であり、うち111,294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 9月20日 至 2024年 3月18日	当期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

・ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [2024年 3月18日現在]	当期 [2024年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

当期（自 2024年3月19日 至 2024年9月17日）

売買目的有価証券

種 類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	455,850円
親投資信託受益証券	2円
合計	455,848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 [2024年 3月18日現在]		当期 [2024年 9月17日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8649円 8,649円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8285円 8,285円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
投資信託 受益証券	Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund EUR Class Units	1,133.9553	14,013,419	
投資信託受益証券	合計	1,133.9553	14,013,419	
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	10,037	
親投資信託受益証券	合計	9,915.0000	10,037	
	合計	11,048.9553	14,023,456	

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）豪ドルコース（毎月分配型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 [2024年 3月18日現在]	当期 [2024年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,268,112	12,003,436
投資信託受益証券	937,744,263	829,913,307
親投資信託受益証券	1,003,470	1,003,768
未収利息	-	71
流動資産合計	949,015,845	842,920,582
資産合計	949,015,845	842,920,582
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	5,452,737	4,960,045
未払受託者報酬	18,286	17,339
未払委託者報酬	715,488	678,519
その他未払費用	7,935	7,528
流動負債合計	6,194,446	5,663,431
負債合計	6,194,446	5,663,431
純資産の部		
元本等		
元本	₁ 1,557,924,940	₁ 1,417,155,952
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	₂ 615,103,541	₂ 579,898,801
（分配準備積立金）	19,138,956	19,933,004
元本等合計	942,821,399	837,257,151
純資産合計	942,821,399	837,257,151
負債純資産合計	949,015,845	842,920,582

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日	当期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
営業収益		
受取配当金	13,799,969	12,759,418
受取利息	18	6,242
有価証券売買等損益	74,777,594	7,169,342
営業収益合計	88,577,581	19,935,002
営業費用		
支払利息	958	-
受託者報酬	115,951	118,572
委託者報酬	4,537,178	4,639,776
その他費用	50,331	51,482
営業費用合計	4,704,418	4,809,830
営業利益又は営業損失（ ）	83,873,163	15,125,172
経常利益又は経常損失（ ）	83,873,163	15,125,172
当期純利益又は当期純損失（ ）	83,873,163	15,125,172
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（ ）	46,048	1,546,010
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	682,770,050	615,103,541
剰余金増加額又は欠損金減少額	20,603,350	55,590,722
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	20,603,350	55,590,722
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	3,945,740	2,949,152
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	3,945,740	2,949,152
分配金	1 32,910,312	1 31,015,992
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	615,103,541	579,898,801

(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 2024年 3月19日 至 2024年 9月17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 2024年3月17日が休日のため、前特定期間末日を2024年3月 18日としております。このため、当特定期間は183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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会 計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な 影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記 を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[2024年 3月18日現在]	[2024年 9月17日現在]
1. 1 期首元本額	1,597,831,857円	1,557,924,940円
期中追加設定元本額	9,491,303円	7,865,652円
期中一部解約元本額	49,398,220円	148,634,640円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	1,557,924,940口	1,417,155,952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615,103,541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579,898,801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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日

<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>1 分配金の計算過程 (2024年3月19日から2024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(1,569,648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(364,211,127円)及び分配準備積立金(18,769,893円)より、分配対象額は384,550,668円(1万口当たり2,514.57円)であり、うち5,352,471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>(2024年4月18日から2024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(2,148,777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(356,972,767円)及び分配準備積立金(18,614,106円)より、分配対象額は377,735,650円(1万口当たり2,493.76円)であり、うち5,301,494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>(2024年5月18日から2024年6月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(1,878,368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(349,862,386円)及び分配準備積立金(19,047,721円)より、分配対象額は370,788,475円(1万口当たり2,471.27円)であり、うち5,251,332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>(2024年6月18日から2024年7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(2,035,600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(336,511,655円)及び分配準備積立金(18,869,772円)より、分配対象額は357,417,027円(1万口当たり2,450.23円)であり、うち5,105,433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>(2024年7月18日から2024年8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(1,211,259円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(328,953,344円)及び分配準備積立金(19,202,765円)より、分配対象額は349,367,368円(1万口当たり2,423.64円)であり、うち5,045,217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>	<p>(2024年8月20日から2024年9月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(1,296,837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(319,164,308円)及び分配準備積立金(19,344,744円)より、分配対象額は339,805,889円(1万口当たり2,397.78円)であり、うち4,960,045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 9月20日 至 2024年 3月18日	当期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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 [2024年 3月18日現在]	当期 [2024年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<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。

当期（自 2024年3月19日 至 2024年9月17日）

売買目的有価証券

種 類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	24,576,704円
親投資信託受益証券	199円
合計	24,576,505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 [2024年 3月18日現在]	当 期 [2024年 9月17日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 6,052円)	0.6052円 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 5,908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	99,905.2977	829,913,307	
投資信託受益証券	合計	99,905.2977	829,913,307	
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	1,003,768	
親投資信託受益証券	合計	991,474.0000	1,003,768	
	合計	1,091,379.2977	830,917,075	

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 [2024年 3月18日現在]	当期 [2024年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	50,088,027	41,727,326
投資信託受益証券	1,456,309,590	1,106,334,892
親投資信託受益証券	1,003,470	1,003,768
未収入金	140,000,000	-
未収利息	-	247
流動資産合計	1,647,401,087	1,149,066,233
資産合計	1,647,401,087	1,149,066,233
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	31,964,182	27,822,674
未払解約金	299,999	205,134
未払受託者報酬	31,981	23,482
未払委託者報酬	1,251,291	918,804
未払利息	3	-
その他未払費用	13,888	10,192
流動負債合計	33,561,344	28,980,286
負債合計	33,561,344	28,980,286
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 10,654,727,401	¹ 9,274,224,769
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	² 9,040,887,658	² 8,154,138,822
（分配準備積立金）	46,983,687	52,670,098
元本等合計	1,613,839,743	1,120,085,947
純資産合計	1,613,839,743	1,120,085,947
負債純資産合計	1,647,401,087	1,149,066,233

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日	当期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
営業収益		
受取配当金	65,688,473	55,855,271
受取利息	80	15,634
有価証券売買等損益	55,093,932	163,974,400
営業収益合計	120,782,485	108,103,495
営業費用		
支払利息	3,356	-
受託者報酬	201,077	172,166
委託者報酬	7,868,117	6,736,760
その他費用	87,341	74,762
営業費用合計	8,159,891	6,983,688
営業利益又は営業損失（ ）	112,622,594	115,087,183
経常利益又は経常損失（ ）	112,622,594	115,087,183
当期純利益又は当期純損失（ ）	112,622,594	115,087,183
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（ ）	747,927	2,197,080
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	8,734,423,978	9,040,887,658
剰余金増加額又は欠損金減少額	688,455,961	2,022,630,758
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	688,455,961	2,022,630,758
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	921,635,963	851,806,567
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	921,635,963	851,806,567
分配金	1 186,654,199	1 171,185,252
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,040,887,658	8,154,138,822

(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 2024年 3月19日 至 2024年 9月17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 2024年3月17日が休日のため、前特定期間末日を2024年3月 18日としております。このため、当特定期間は183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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会 計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な 影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記 を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[2024年 3月18日現在]	[2024年 9月17日現在]
1. 1 期首元本額	10,380,232,482円	10,654,727,401円
期中追加設定元本額	1,091,274,545円	991,721,106円
期中一部解約元本額	816,779,626円	2,372,223,738円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	10,654,727,401口	9,274,224,769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9,040,887,658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8,154,138,822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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日

<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>1 分配金の計算過程 (2024年3月19日から2024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(8,586,644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(1,483,551,787円)及び分配準備積立金(42,693,932円)より、分配対象額は1,534,832,363円(1万口当たり1,562.62円)であり、うち29,466,158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>(2024年4月18日から2024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(9,769,929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(1,486,657,612円)及び分配準備積立金(46,182,105円)より、分配対象額は1,542,609,646円(1万口当たり1,542.40円)であり、うち30,003,695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>(2024年5月18日から2024年6月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,908,766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(1,366,959,381円)及び分配準備積立金(42,440,679円)より、分配対象額は1,417,308,826円(1万口当たり1,520.92円)であり、うち27,955,944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>(2024年6月18日から2024年7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(8,441,875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(1,353,149,395円)及び分配準備積立金(44,901,444円)より、分配対象額は1,406,492,714円(1万口当たり1,499.93円)であり、うち28,131,003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>(2024年7月18日から2024年8月19日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,771,540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(1,314,751,443円)及び分配準備積立金(47,683,447円)より、分配対象額は1,370,206,430円(1万口当たり1,478.32円)であり、うち27,805,778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>	<p>(2024年8月20日から2024年9月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,771,294円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,293,683,464円)及び分配準備積立金(49,535,916円)より、分配対象額は1,350,990,674円(1万口当たり1,456.70円)であり、うち27,822,674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 9月20日 至 2024年 3月18日	当期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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 [2024年 3月18日現在]	当期 [2024年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<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。

当期（自 2024年3月19日 至 2024年9月17日）

売買目的有価証券

種 類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	62,570,795円
親投資信託受益証券	199円
合計	62,570,596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 [2024年 3月18日現在]	当 期 [2024年 9月17日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 1,515円)	0.1515円 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 1,208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	409,601.9593	1,106,334,892	
投資信託受益証券	合計	409,601.9593	1,106,334,892	
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	1,003,768	
親投資信託受益証券	合計	991,474.0000	1,003,768	
	合計	1,401,075.9593	1,107,338,660	

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 [2024年 3月18日現在]	当期 [2024年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,265,665	11,584,838
投資信託受益証券	639,291,945	599,500,778
親投資信託受益証券	10,017	10,020
未収入金	-	6,000,000
未収利息	-	68
流動資産合計	651,567,627	617,095,704
資産合計	651,567,627	617,095,704
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,787,638	3,028,574
未払解約金	-	6,129,186
未払受託者報酬	12,304	12,433
未払委託者報酬	481,501	486,440
その他未払費用	5,338	5,392
流動負債合計	3,286,781	9,662,025
負債合計	3,286,781	9,662,025
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 796,468,282	¹ 865,307,020
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	² 148,187,436	² 257,873,341
（分配準備積立金）	48,239,922	82,216,246
元本等合計	648,280,846	607,433,679
純資産合計	648,280,846	607,433,679
負債純資産合計	651,567,627	617,095,704

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日	当期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
営業収益		
受取配当金	16,165,582	21,833,222
受取利息	15	6,458
有価証券売買等損益	52,836,257	101,791,164
営業収益合計	69,001,854	79,951,484
営業費用		
支払利息	1,066	-
受託者報酬	59,719	86,775
委託者報酬	2,336,849	3,395,406
その他費用	25,880	37,640
営業費用合計	2,423,514	3,519,821
営業利益又は営業損失（ ）	66,578,340	83,471,305
経常利益又は経常損失（ ）	66,578,340	83,471,305
当期純利益又は当期純損失（ ）	66,578,340	83,471,305
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（ ）	983,547	3,121,163
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	166,062,134	148,187,436
剰余金増加額又は欠損金減少額	42,070,899	8,064,771
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	42,070,899	8,064,771
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	76,455,268	19,404,528
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	76,455,268	19,404,528
分配金	13,335,726	17,996,006
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	148,187,436	257,873,341

(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 2024年 3月19日 至 2024年 9月17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 2024年3月17日が休日のため、前特定期間末日を2024年3月 18日としております。このため、当特定期間は183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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会 計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な 影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記 を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[2024年 3月18日現在]	[2024年 9月17日現在]
1. 1 期首元本額	632,786,546円	796,468,282円
期中追加設定元本額	332,847,740円	113,258,940円
期中一部解約元本額	169,166,004円	44,420,202円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	796,468,282口	865,307,020口
3. 2 元本の欠損	純資産額が元本総額を 下回っており、その差 額は148,187,436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257,873,341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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日

<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>1 分配金の計算過程 (2024年3月19日から2024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(3,138,362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(4,549,754円)、投資信託約款に規定される収益調整金(161,618,477円)及び分配準備積立金(48,239,922円)より、分配対象額は217,546,515円(1万口当たり2,718.61円)であり、うち2,800,710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>(2024年4月18日から2024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(3,528,966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(31,868,891円)、投資信託約款に規定される収益調整金(176,287,140円)及び分配準備積立金(52,765,119円)より、分配対象額は264,450,116円(1万口当たり3,098.91円)であり、うち2,986,751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>(2024年5月18日から2024年6月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(2,982,550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(176,118,362円)及び分配準備積立金(84,973,327円)より、分配対象額は264,074,239円(1万口当たり3,098.92円)であり、うち2,982,505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>(2024年6月18日から2024年7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(3,705,121円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(190,346,155円)及び分配準備積立金(84,784,325円)より、分配対象額は278,835,601円(1万口当たり3,105.65円)であり、うち3,142,390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>(2024年7月18日から2024年8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(3,073,235円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(185,149,533円)及び分配準備積立金(82,882,739円)より、分配対象額は271,105,507円(1万口当たり3,105.85円)であり、うち3,055,076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>	<p>(2024年8月20日から2024年9月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,174,331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(183,654,909円)及び分配準備積立金(82,070,489円)より、分配対象額は268,899,729円(1万口当たり3,107.55円)であり、うち3,028,574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 9月20日 至 2024年 3月18日	当期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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 [2024年 3月18日現在]	当期 [2024年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<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。

当期（自 2024年3月19日 至 2024年9月17日）

売買目的有価証券

種 類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	43,155,976円
親投資信託受益証券	2円
合計	43,155,974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 [2024年 3月18日現在]	当 期 [2024年 9月17日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 8,139円)	0.8139円 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 7,020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	91,821.2251	599,500,778	
投資信託受益証券 合計		91,821.2251	599,500,778	
親投資信託 受益証券	東京海上マネーマザーファンド	9,898.000	10,020	
親投資信託受益証券 合計		9,898.0000	10,020	
合計		101,719.2251	599,510,798	

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 [2024年 3月18日現在]	当期 [2024年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	24,280,257	13,865,735
投資信託受益証券	665,726,306	674,977,679
親投資信託受益証券	10,017	10,020
未収入金	-	25,000,000
未収利息	-	82
流動資産合計	690,016,580	713,853,516
資産合計	690,016,580	713,853,516
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	5,043,390	4,585,152
未払解約金	-	24,657,338
未払受託者報酬	13,439	14,287
未払委託者報酬	525,820	559,107
未払利息	1	-
その他未払費用	5,829	6,193
流動負債合計	5,588,479	29,822,077
負債合計	5,588,479	29,822,077
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 10,086,780,925	¹ 9,170,304,582
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	² 9,402,352,824	² 8,486,273,143
（分配準備積立金）	170,330,001	196,645,921
元本等合計	684,428,101	684,031,439
純資産合計	684,428,101	684,031,439
負債純資産合計	690,016,580	713,853,516

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日	当期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
営業収益		
受取配当金	77,904,332	77,502,203
受取利息	33	7,280
有価証券売買等損益	34,331,151	21,251,376
営業収益合計	43,573,214	98,760,859
営業費用		
支払利息	1,716	-
受託者報酬	86,916	91,858
委託者報酬	3,400,943	3,594,497
その他費用	37,698	39,843
営業費用合計	3,527,273	3,726,198
営業利益又は営業損失（ ）	40,045,941	95,034,661
経常利益又は経常損失（ ）	40,045,941	95,034,661
当期純利益又は当期純損失（ ）	40,045,941	95,034,661
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（ ）	132,567	1,447,050
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	9,772,985,643	9,402,352,824
剰余金増加額又は欠損金減少額	504,125,028	1,007,519,028
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	504,125,028	1,007,519,028
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	142,701,983	156,628,029
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	142,701,983	156,628,029
分配金	1 30,703,600	1 28,398,929
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,402,352,824	8,486,273,143

(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 2024年 3月19日 至 2024年 9月17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 2024年3月17日が休日のため、前特定期間末日を2024年3月 18日としております。このため、当特定期間は183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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会 計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な 影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記 を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[2024年 3月18日現在]	[2024年 9月17日現在]
1. 1 期首元本額	10,474,302,833円	10,086,780,925円
期中追加設定元本額	153,091,876円	169,393,206円
期中一部解約元本額	540,613,784円	1,085,869,549円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	10,086,780,925口	9,170,304,582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9,402,352,824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8,486,273,143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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日

<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>1 分配金の計算過程 (2024年3月19日から2024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(12,389,890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(1,585,365,175円)及び分配準備積立金(160,930,018円)より、分配対象額は1,758,685,083円(1万口当たり1,842.29円)であり、うち4,773,021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>(2024年4月18日から2024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(12,615,465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(1,587,800,599円)及び分配準備積立金(168,410,818円)より、分配対象額は1,768,826,882円(1万口当たり1,850.50円)であり、うち4,779,265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>(2024年5月18日から2024年6月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(12,487,428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(1,588,494,594円)及び分配準備積立金(175,450,512円)より、分配対象額は1,776,432,534円(1万口当たり1,858.56円)であり、うち4,778,989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>(2024年6月18日から2024年7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(12,600,908円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,573,135,426円)及び分配準備積立金(181,063,407円)より、分配対象額は1,766,799,741円(1万口当たり1,866.89円)であり、うち4,731,874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) 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>(2024年7月18日から2024年8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(12,393,808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(1,580,525,137円)及び分配準備積立金(188,561,439円)より、分配対象額は1,781,480,384円(1万口当たり1,874.98円)であり、うち4,750,628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) 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>	<p>(2024年8月20日から2024年9月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(12,219,609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(1,525,844,007円)及び分配準備積立金(189,011,464円)より、分配対象額は1,727,075,080円(1万口当たり1,883.31円)であり、うち4,585,152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 9月20日 至 2024年 3月18日	当期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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 [2024年 3月18日現在]	当期 [2024年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<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。

当期（自 2024年3月19日 至 2024年9月17日）

売買目的有価証券

種 類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	19,732,825円
親投資信託受益証券	2円
合計	19,732,823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 [2024年 3月18日現在]	当 期 [2024年 9月17日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 679円)	0.0679円 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 746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	1,173,874.2247	674,977,679	
投資信託受益証券 合計		1,173,874.2247	674,977,679	
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	10,020	
親投資信託受益証券 合計		9,898.0000	10,020	
合計		1,183,772.2247	674,987,699	

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 [2024年 3月18日現在]	当期 [2024年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	608,917	1,165,652
投資信託受益証券	26,400,422	32,816,125
親投資信託受益証券	10,034	10,037
未収利息	-	6
流動資産合計	27,019,373	33,991,820
資産合計	27,019,373	33,991,820
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	167,202	219,400
未払受託者報酬	525	693
未払委託者報酬	20,337	27,138
その他未払費用	224	290
流動負債合計	188,288	247,521
負債合計	188,288	247,521
純資産の部		
元本等		
元本	₁ 55,734,128	₁ 73,133,463
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	₂ 28,903,043	₂ 39,389,164
（分配準備積立金）	658,692	726,453
元本等合計	26,831,085	33,744,299
純資産合計	26,831,085	33,744,299
負債純資産合計	27,019,373	33,991,820

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日	当期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
営業収益		
受取配当金	1,066,510	1,254,306
受取利息	-	454
有価証券売買等損益	1,439,639	1,884,294
営業収益合計	2,506,149	629,534
営業費用		
支払利息	12	-
受託者報酬	3,302	4,113
委託者報酬	129,270	161,053
その他費用	1,323	1,706
営業費用合計	133,907	166,872
営業利益又は営業損失()	2,372,242	796,406
経常利益又は経常損失()	2,372,242	796,406
当期純利益又は当期純損失()	2,372,242	796,406
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()	19,433	29,172
期首剰余金又は期首欠損金()	31,414,255	28,903,043
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,713,888	1,412,961
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,713,888	1,412,961
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	545,907	9,878,121
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	545,907	9,878,121
分配金	1,009,578	1,195,383
期末剰余金又は期末欠損金()	28,903,043	39,389,164

(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 2024年 3月19日 至 2024年 9月17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 2024年3月17日が休日のため、前特定期間末日を2024年3月 18日としております。このため、当特定期間は183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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会 計上の見積りが、翌特定期間の財務諸表に重要な 影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記 を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前期	当期
	[2024年 3月18日現在]	[2024年 9月17日現在]
1. 1 期首元本額	57,854,628円	55,734,128円
期中追加設定元本額	1,027,172円	20,118,432円
期中一部解約元本額	3,147,672円	2,719,097円
2. 1 特定期間末日における受益権の総数	55,734,128口	73,133,463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28,903,043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39,389,164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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日

<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>1 分配金の計算過程 (2024年3月19日から2024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(148,786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(15,853,771円)及び分配準備積立金(637,677円)より、分配対象額は16,640,234円(1万口当たり3,076.58円)であり、うち162,259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>(2024年4月18日から2024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(166,465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(15,570,961円)及び分配準備積立金(666,718円)より、分配対象額は16,404,144円(1万口当たり3,077.83円)であり、うち159,892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>(2024年5月18日から2024年6月17日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(198,604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(21,396,746円)及び分配準備積立金(673,291円)より、分配対象額は22,268,641円(1万口当たり3,075.24円)であり、うち217,236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>(2024年6月18日から2024年7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(221,966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(21,435,120円)及び分配準備積立金(690,865円)より、分配対象額は22,347,951円(1万口当たり3,075.78円)であり、うち217,971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)</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(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>(2024年7月18日から2024年8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(196,115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(21,501,639円)及び分配準備積立金(694,752円)より、分配対象額は22,392,506円(1万口当たり3,072.70円)であり、うち218,625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)</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(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>	<p>(2024年8月20日から2024年9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(200,607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(21,543,769円)及び分配準備積立金(708,679円)より、分配対象額は22,453,055円(1万口当たり3,070.13円)であり、うち219,400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 9月20日 至 2024年 3月18日	当期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

<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 [2024年 3月18日現在]	当期 [2024年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<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。

当期（自 2024年3月19日 至 2024年9月17日）

売買目的有価証券

種 類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	1,358,359円
親投資信託受益証券	2円
合計	1,358,357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 [2024年 3月18日現在]		当期 [2024年 9月17日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.4814円 4,814円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.4614円 4,614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	6,530.5723	32,816,125	
投資信託受益証券	合計	6,530.5723	32,816,125	
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	10,037	
親投資信託受益証券	合計	9,915.0000	10,037	
	合計	16,445.5723	32,826,162	

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25期 [2024年 3月18日現在]	第26期 [2024年 9月17日現在]
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	2,202,393	3,812,163
流動資産合計	2,202,393	3,812,163
資産合計	2,202,393	3,812,163
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	-	14
未払委託者報酬	-	464
流動負債合計	-	478
負債合計	-	478
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,193,359	1 3,795,430
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	9,034	16,255
(分配準備積立金)	15,606	16,713
元本等合計	2,202,393	3,811,685
純資産合計	2,202,393	3,811,685
負債純資産合計	2,202,393	3,812,163

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第25期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日	第26期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
営業収益		
有価証券売買等損益	455	971
営業収益合計	455	971
営業費用		
受託者報酬	-	14
委託者報酬	-	464
営業費用合計	-	478
営業利益又は営業損失()	455	493
経常利益又は経常損失()	455	493
当期純利益又は当期純損失()	455	493
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	11
期首剰余金又は期首欠損金()	8,987	9,034
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	7,761
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	-	7,761
剰余金減少額又は欠損金増加額	390	1,022
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	390	1,022
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()	9,034	16,255

(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26期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17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 2024年3月17日が休日のため、前計算期間末日を2024年3月18日としております。このため、当計算期間は183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25期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日	第26期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第25期 [2024年 3月18日現在]	第26期 [2024年 9月17日現在]
1. 1 期首元本額	2,292,910円	2,193,359円
期中追加設定元本額	円	1,848,173円
期中一部解約元本額	99,551円	246,102円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	2,193,359口	3,795,430口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第25期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日	第26期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
1 分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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。	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(2,057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(147,779円)及び分配準備積立金(14,656円)より、分配対象額は164,492円(1万口当たり433.38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25期 自 2023年 9月20日 至 2024年 3月18日	第26期 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

・ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第25期 [2024年 3月18日現在]	第26期 [2024年 9月17日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

第26期（自 2024年3月19日 至 2024年9月17日）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,128円
合計	1,128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25期 [2024年 3月18日現在]		第26期 [2024年 9月17日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0041円 10,041円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0043円 10,043円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
親投資信託 受益証券	東京海上マネーマザーファンド	3,765,472	3,812,163	
親投資信託受益証券 合計		3,765,472	3,812,163	
合計		3,765,472	3,812,163	

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）、マネーボール・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2024年2月29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

	2024年2月29日現在 金額（円）
資産：	
投資有価証券（取得原価）	28,372,567,362
未実現利益	3,387,650,258
投資有価証券（時価）	31,760,217,620
現預金	549,275,637
未収利息	410,054,069
追加設定に係る未収入金	29,000,000
為替予約取引に係る未実現利益	89,373,993
前払費用	1,040,405
資産合計	32,838,961,724
負債：	
未払費用	79,340,373
ブローカーからの借越	5,986,800
未払解約金	50,000,000
為替予約取引に係る未実現損失	221,616,662
負債合計	356,943,835
純資産総額	32,482,017,889

各通貨クラスの基準価額

Tokio Marine Rogge Global Hybrid Securities Fund

AUD Class Units	8,209
Resources Currency Basket Class Units	5,194
BRL Class Units	3,113
EUR Class Units	12,302
JPY Class Units	6,822
MXN Class Units	7,418
TRY Class Units	576
USD Class Units	16,298

(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。

2024年2月29日現在の為替レートは下記のとおりです。

1 JPY =	0.010261	AUD
1 JPY =	0.033197	BRL
1 JPY =	0.006174	EUR
1 JPY =	0.005282	GBP
1 JPY =	0.114028	MXN
1 JPY =	0.208591	TRY
1 JPY =	0.006681	USD
1 JPY =	0.128174	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

2024年2月29日現在
(単位：円)

株式以外の有価証券

発行国 銘柄名	通貨	額面金額	簿価金額	評価金額	投資 比率 (%)
------------	----	------	------	------	-----------------

AUSTRALIA

AUST & NZ BANKING GROUP FLT 05/05/31	EUR	4,500,000	569,080,991	670,436,613	2.06%
COMMONWEALTH BANK AUST 3.784% 03/14/32	USD	2,350,000	270,103,592	306,315,038	0.94%
NATIONAL AUSTRALIA BANK FLT 09/15/31	GBP	1,200,000	182,332,560	201,878,573	0.62%
WESTPAC BANKING CORP FLT 05/13/31	EUR	1,850,000	243,337,069	274,929,176	0.85%
			1,264,854,212	1,453,559,400	4.47%

AUSTRIA

BAWAG GROUP AG FLT 02/24/34	EUR	4,000,000	652,969,896	661,288,855	2.03%
UNIQA INSURANCE GROUP AG FLT 12/09/41	EUR	600,000	76,560,702	79,705,237	0.25%
			729,530,598	740,994,092	2.28%

BELGIUM

AGEAS FLT 07/02/49	EUR	700,000	88,603,733	104,758,926	0.32%
BELFIUS BANK SA/NV FLT 04/06/34	EUR	2,000,000	259,281,359	270,877,122	0.84%
			347,885,092	375,636,048	1.16%

BERMUDA

AEGON LTD FLT PERP	USD	2,000,000	186,437,645	242,452,319	0.75%
			186,437,645	242,452,319	0.75%

CANADA

BANK OF NOVA SCOTIA FLT 10/27/81	USD	2,200,000	246,202,000	258,212,061	0.79%
			246,202,000	258,212,061	0.79%

CAYMAN ISLANDS

AVOLON HOLDINGS FNDG LTD 6.375% 05/04/28	USD	2,100,000	310,603,919	318,843,802	0.98%
			310,603,919	318,843,802	0.98%

CZECH REPUBLIC

RAIFFEISENBANK AS FLT 06/09/28	EUR	1,400,000	186,801,417	199,695,178	0.61%
			186,801,417	199,695,178	0.61%

DENMARK

DANSKE BANK A/S FLT 05/15/31	EUR	3,000,000	380,237,162	452,027,923	1.39%
JYSKE BANK A/S FLT 01/28/31	EUR	2,250,000	272,639,083	340,197,808	1.05%
			652,876,245	792,225,731	2.44%

FINLAND

NORDEA BANK ABP FLT 08/18/31	EUR	2,900,000	382,614,869	429,488,249	1.32%
NORDEA BANK ABP FLT 12/09/32	GBP	3,200,000	479,761,168	517,069,146	1.59%
SAMPO OYJ FLT 09/03/52	EUR	1,550,000	194,383,740	209,871,427	0.65%
			1,056,759,777	1,156,428,822	3.56%

FRANCE

AXA SA FLT PERP	GBP	2,850,000	518,437,745	543,082,866	1.66%
AXA SA FLT PERP	EUR	1,000,000	160,350,086	165,808,337	0.51%
BANQUE FED CRED MUTUEL 1.125% 11/19/31	EUR	1,800,000	233,816,478	230,043,377	0.71%
BNP PARIBAS FLT 05/24/31	GBP	1,000,000	153,807,644	171,723,545	0.53%

BNP PARIBAS FLT 08/31/33	EUR	2,300,000	295,992,597	317,094,336	0.98%
CREDIT AGRICOLE ASSRNCES FLT 01/29/48	EUR	2,000,000	272,543,704	301,088,755	0.93%
CREDIT AGRICOLE SA FLT 12/09/31	GBP	1,200,000	186,641,192	201,403,428	0.62%
CREDIT AGRICOLE SA FLT PERP	EUR	1,400,000	174,581,833	207,556,768	0.64%
CREDIT AGRICOLE SA FLT PERP	EUR	1,400,000	199,915,510	236,280,159	0.73%
GROUPE ACM FLT 04/21/42	EUR	2,900,000	351,430,526	375,713,369	1.16%
LA BANQUE POSTALE FLT 08/02/32	EUR	3,000,000	379,425,930	427,754,833	1.32%
MUTUELLE ASSURANCE FLT 06/21/52	EUR	1,900,000	231,308,527	237,298,966	0.73%
SOCIETE GENERALE FLT 06/30/31	EUR	3,100,000	394,254,254	462,643,715	1.42%
			3,552,506,026	3,877,492,454	11.94%

GERMANY

COMMERZBANK AG FLT 10/05/33	EUR	3,900,000	611,619,212	666,491,470	2.05%
DEUTSCHE BANK AG FLT 02/17/32	EUR	2,100,000	258,168,804	278,258,007	0.86%
DEUTSCHE BANK NY FLT 01/14/32	USD	1,700,000	197,265,212	207,965,488	0.64%
HANNOVER RE FLT 10/09/39	EUR	1,700,000	198,098,357	231,686,056	0.71%
LANDBK HESSEN-THUERINGEN FLT 09/15/32	EUR	1,700,000	243,859,823	253,078,965	0.78%
TALANX AG FLT 12/01/42	EUR	1,000,000	128,134,748	131,735,773	0.41%
			1,637,146,156	1,769,215,759	5.45%

HONG KONG

AIA GROUP LTD FLT 09/09/33	EUR	1,300,000	170,273,198	177,792,701	0.55%
AIA GROUP LTD FLT PERP	USD	1,800,000	199,243,925	251,066,941	0.77%
			369,517,123	428,859,642	1.32%

IRELAND

ZURICH FINANCE IRELAND FLT 04/19/51	USD	1,800,000	187,560,000	219,977,811	0.68%
ZURICH FINANCE IRELAND FLT 05/02/52	USD	1,637,000	188,303,125	202,021,793	0.62%
			375,863,125	421,999,604	1.30%

ITALY

ASSICURAZIONI GENERALI FLT 06/08/48	EUR	2,550,000	378,289,811	423,817,437	1.30%
			378,289,811	423,817,437	1.30%

JAPAN

DAI-ICHI LIFE INSURANCE FLT PERP	USD	4,760,000	549,013,560	706,306,299	2.18%
MITSUI SUMITOMO INSURANC FLT PERP	USD	3,100,000	343,774,504	449,091,458	1.38%
			892,788,064	1,155,397,757	3.56%

LUXEMBOURG

AROUNDTOWN SA FLT PERP	EUR	800,000	64,625,666	63,399,399	0.20%
			64,625,666	63,399,399	0.20%

NETHERLANDS

ABN AMRO BANK NV FLT 03/13/37	USD	3,000,000	340,365,000	355,421,858	1.09%
ASR NEDERLAND NV FLT 05/02/49	EUR	2,250,000	283,695,075	340,152,911	1.05%
COOPERATIEVE RABOBANK UA FLT 11/30/32	EUR	1,300,000	177,460,473	206,890,120	0.64%
COOPERATIEVE RABOBANK UA FLT PERP	EUR	1,200,000	145,657,442	181,471,327	0.56%
DE VOLKSBANK NV FLT 10/22/30	EUR	3,800,000	479,510,697	583,653,845	1.79%

DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 01/15/32	EUR	1,000,000	124,200,604	126,920,817	0.39%
ELM BV(HELVETIA SCHWEIZ) FLT 09/29/47	EUR	950,000	115,872,577	146,043,694	0.45%
ING GROEP NV FLT 03/28/33	USD	840,000	100,459,142	115,600,178	0.36%
ING GROEP NV FLT 05/26/31	EUR	1,200,000	141,564,503	185,072,770	0.57%
ING GROEP NV FLT 06/09/32	EUR	500,000	66,582,328	72,058,018	0.22%
NN GROUP NV FLT PERP	EUR	3,300,000	461,773,159	533,716,695	1.64%
			2,437,141,000	2,847,002,233	8.76%

PERU

BANCO DE CREDITO DEL PER FLT 07/01/30	USD	2,650,000	306,319,106	376,989,564	1.16%
			306,319,106	376,989,564	1.16%

SOUTH KOREA

HANWHA LIFE INSURANCE FLT 02/04/32	USD	3,000,000	341,805,000	413,822,074	1.27%
			341,805,000	413,822,074	1.27%

SPAIN

BANCO BILBAO VIZCAYA ARG FLT 11/15/34	USD	1,600,000	240,800,000	255,461,881	0.79%
BANCO SANTANDER SA FLT 10/04/32	GBP	1,600,000	236,594,823	261,808,199	0.81%
CAIXABANK SA FLT 06/18/31	EUR	2,900,000	370,654,538	436,719,745	1.33%
MAPFRE SA 2.875% 04/13/30	EUR	700,000	93,697,233	103,186,608	0.32%
MAPFRE SA FLT 03/31/47	EUR	600,000	71,996,318	96,370,019	0.30%
			1,013,742,912	1,153,546,452	3.55%

SWEDEN

SWEDBANK AB FLT 08/23/32	EUR	1,050,000	148,002,966	164,284,992	0.51%
			148,002,966	164,284,992	0.51%

SWITZERLAND

UBS GROUP AG FLT 08/12/33	USD	7,162,000	1,091,941,544	1,115,585,796	3.43%
UBS GROUP AG FLT PERP	USD	550,000	84,218,648	90,924,619	0.28%
			1,176,160,192	1,206,510,415	3.71%

UNITED KINGDOM

AVIVA PLC FLT 06/03/55	GBP	2,000,000	285,230,621	305,944,818	0.94%
HSBC HOLDINGS PLC 6.000% 03/29/40	GBP	800,000	141,259,280	147,319,964	0.45%
HSBC HOLDINGS PLC FLT PERP	USD	1,900,000	260,806,177	293,259,656	0.90%
LLOYDS BANKING GROUP PLC FLT 12/15/31	GBP	4,350,000	663,857,453	735,997,327	2.28%
LLOYDS BANKING GROUP PLC FLT PERP	GBP	1,300,000	190,305,323	239,365,333	0.74%
LLOYDS BANKING GROUP PLC FLT PERP	USD	1,500,000	203,526,424	221,018,437	0.68%
M&G PLC FLT 10/20/51	GBP	1,250,000	188,771,192	222,528,724	0.69%
NATWEST GROUP PLC FLT 09/14/32	EUR	4,150,000	542,594,982	591,553,363	1.82%
NATWEST GROUP PLC FLT 11/28/31	GBP	500,000	76,971,853	84,684,729	0.26%
PHOENIX GRP HLD PLC 4.375% 01/24/29	EUR	2,870,000	380,970,967	455,881,823	1.40%
RL FINANCE BONDS N03 6.125% 11/13/28	GBP	400,000	76,129,201	75,929,740	0.23%
RL FINANCE BONDS N06 FLT PERP	GBP	1,700,000	291,245,445	346,945,559	1.07%
RL FINANCE NO 4 PLC FLT 10/07/49	GBP	1,200,000	156,582,293	183,367,168	0.56%
SANTANDER UK GROUP HLDGS 5.625% 09/15/45	USD	1,500,000	194,703,578	178,591,482	0.55%

STANDARD CHARTERED PLC 4.300% 02/19/27	USD	2,400,000	239,684,025	345,803,615	1.06%
STANDARD CHARTERED PLC 5.300% 01/09/43	USD	1,150,000	139,193,730	156,011,708	0.48%
VIRGIN MONEY UK PLC FLT 08/19/31	GBP	1,100,000	169,641,846	187,112,882	0.58%
			4,201,474,390	4,771,316,328	14.69%
UNITED STATES OF AMERICA					
AVIATION CAPITAL GROUP 3.500% 11/01/27	USD	1,372,000	152,550,606	189,262,103	0.58%
BANK OF AMERICA CORP 7.750% 05/14/38	USD	2,950,000	496,152,228	528,906,714	1.63%
BANK OF AMERICA CORP FLT 02/04/33	USD	6,050,000	725,098,191	759,550,643	2.34%
CAPITAL ONE FINANCIAL CO FLT 02/01/34	USD	3,200,000	444,177,635	473,080,768	1.46%
CHUBB INA HOLDINGS INC 2.500% 03/15/38	EUR	1,350,000	176,023,539	187,766,370	0.58%
CITIGROUP INC 8.125% 07/15/39	USD	1,530,000	264,630,744	290,125,731	0.89%
FIFTH THIRD BANCORP FLT 04/25/33	USD	6,200,000	805,536,057	840,523,845	2.59%
GOLDMAN SACHS CAPITAL I 6.345% 02/15/34	USD	5,150,000	718,749,937	789,453,950	2.43%
HARTFORD FINL SVCS GRP FLT 02/12/47	USD	1,090,000	117,643,047	141,320,285	0.44%
HSBC BANK USA NA 7.000% 01/15/39	USD	2,500,000	353,538,974	426,990,475	1.31%
HUNTINGTON BANCSHARES FLT 05/17/33	USD	1,750,000	228,208,750	247,530,252	0.76%
JACKSON FINANCIAL INC 3.125% 11/23/31	USD	2,500,000	285,483,367	309,682,796	0.95%
JPMORGAN CHASE & CO FLT 05/13/31	USD	3,400,000	360,570,015	442,256,048	1.36%
LIBERTY MUTUAL GROUP INC FLT 12/15/51	USD	2,016,000	226,817,222	263,716,145	0.81%
METLIFE INC 6.400% 12/15/36	USD	2,700,000	355,553,168	409,377,409	1.26%
NASDAQ INC 3.250% 04/28/50	USD	900,000	95,011,345	91,072,348	0.28%
NEW YORK LIFE INSURANCE 6.750% 11/15/39	USD	1,500,000	254,635,661	255,065,676	0.79%
PRUDENTIAL FINANCIAL INC FLT 03/15/44	USD	1,100,000	140,199,730	164,637,000	0.51%
STATE STREET CORP FLT PERP	USD	750,000	111,245,963	112,293,664	0.35%
SYNOVUS BANK GA FLT 10/29/30	USD	1,750,000	183,408,741	225,903,835	0.70%
			6,495,234,920	7,148,516,057	22.02%
TOTAL INVESTMENTS IN SECURITIES			28,372,567,362	31,760,217,620	97.78%

「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	[2024年 3月18日現在]	[2024年 9月17日現在]
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,525,786	3,141,410
国債証券			5,999,160
地方債証券		6,001,980	
特殊債券		3,000,600	
未収利息		2,862	18
前払費用		291	
流動資産合計		10,531,519	9,140,588
資産合計		10,531,519	9,140,588
負債の部			
流動負債			
未払金		3,002,010	
流動負債合計		3,002,010	
負債合計		3,002,010	
純資産の部			
元本等			
元本	1	7,439,598	9,029,007
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		89,911	111,581
元本等合計		7,529,509	9,140,588
純資産合計		7,529,509	9,140,588
負債純資産合計		10,531,519	9,140,588

(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 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。	同左

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[2024年 3月18日現在]	[2024年 9月17日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	8,527,678円	7,439,598円
同期中における追加設定元本額	円	1,833,566円
同期中における一部解約元本額	1,088,080円	244,157円
同期末における元本額	7,439,598円	9,029,007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	2,176,063円	3,765,472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・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	7,439,598円	9,029,007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	7,439,598口	9,029,007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 9月20日 至 2024年 3月18日	自 2024年 3月19日 至 2024年 9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2024年 3月18日現在]	[2024年 9月17日現在]
-----	-----------------	-----------------

1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

(自 2024年3月19日 至 2024年9月17日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	429円
合計	429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(2024年8月16日から2024年9月17日まで)を指しております。

(1口当たり情報に関する注記)

[2024年 3月18日現在]		[2024年 9月17日現在]	
1口当たり純資産額	1.0121円	1口当たり純資産額	1.0124円
(1万口当たり純資産額)	(10,121円)	(1万口当たり純資産額)	(10,124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
国債証券	第1243回国庫短期証券	3,000,000	2,999,778	
	第1253回国庫短期証券	3,000,000	2,999,382	
国債証券	合計	6,000,000	5,999,160	
	合計	6,000,000	5,999,160	

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9月30日 現在

種類	金額
資産総額	4,770,963,032 円
負債総額	2,331,943 円
純資産総額（ - ）	4,768,631,089 円
発行済数量	7,696,008,014 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.6196 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9月30日 現在

種類	金額
資産総額	6,730,327,191 円
負債総額	60,761,548 円
純資産総額（ - ）	6,669,565,643 円
発行済数量	5,229,083,939 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.2755 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9月30日 現在

種類	金額
資産総額	14,686,168 円
負債総額	5,340 円
純資産総額（ - ）	14,680,828 円
発行済数量	17,245,409 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.8513 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9月30日 現在

種類	金額
資産総額	881,893,781 円
負債総額	317,393 円
純資産総額（ - ）	881,576,388 円
発行済数量	1,418,303,148 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.6216 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9月30日 現在

種類	金額
資産総額	1,147,913,297 円
負債総額	419,022 円

純資産総額(-)	1,147,494,275 円
発行済数量	9,105,025,906 口
1 単位当たり純資産額(/)	0.1260 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9月30日 現在

種類	金額
資産総額	612,184,674 円
負債総額	226,325 円
純資産総額(-)	611,958,349 円
発行済数量	866,580,225 口
1 単位当たり純資産額(/)	0.7062 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9月30日 現在

種類	金額
資産総額	697,937,771 円
負債総額	2,964,198 円
純資産総額(-)	694,973,573 円
発行済数量	9,056,282,617 口
1 単位当たり純資産額(/)	0.0767 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9月30日 現在

種類	金額
資産総額	35,573,682 円
負債総額	12,830 円
純資産総額(-)	35,560,852 円
発行済数量	73,404,000 口
1 単位当たり純資産額(/)	0.4845 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9月30日 現在

種類	金額
資産総額	3,811,684 円
負債総額	145 円
純資産総額(-)	3,811,539 円
発行済数量	3,795,430 口
1 単位当たり純資産額(/)	1.0042 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9月30日 現在

種類	金額
資産総額	9,140,787 円
負債総額	円
純資産総額(-)	9,140,787 円
発行済数量	9,028,534 口
1 単位当たり純資産額(/)	1.0124 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9月末日現在、資本金の額は20億円です。なお、会社の発行可能株式総数は160,000株であり、38,300株を発行済みです。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

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

	本数	純資産総額（百万円）
追加型公社債投資信託	0	0
追加型株式投資信託	167	2,876,490
単位型公社債投資信託	1	2,685
単位型株式投資信託	17	83,359
合計	185	2,962,536

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第39期事業年度(2023年4月1日から2024年3月31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。

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京都監査法人与合併、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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	20,784,858	20,242,052
前払費用	427,401	523,560
未収委託者報酬	3,200,726	3,523,505
未収収益	3,021,468	4,088,251
未収入金	4	-
その他の流動資産	18,592	26,495
流動資産計	27,453,052	28,403,865
固定資産		
有形固定資産	* 1 433,750	* 1 631,543
建物	307,934	434,854
器具備品	125,816	196,689
無形固定資産	348,422	397,761
電話加入権	3,795	3,795
ソフトウェア	314,954	372,797
ソフトウェア仮勘定	29,672	21,168
投資その他の資産	3,508,324	3,566,905
投資有価証券	48,291	49,108
関係会社株式	1,668,529	1,668,529
その他の関係会社有価証券	520,000	80,000
長期前払費用	30,700	16,227
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	954,048	1,257,485
投資損失引当金	208,800	-
固定資産計	4,290,497	4,596,210
資産合計	31,743,550	33,000,075
負債の部		
流動負債		
未払金	3,477,655	4,260,390
未払手数料	1,464,843	1,583,647
その他未払金	2,012,811	2,676,743
未払費用	335,471	321,531
未払消費税等	266,103	420,603
未払法人税等	1,210,000	1,391,000
預り金	60,297	72,829
前受収益	2,579	2,583
賞与引当金	288,706	296,807
その他の流動負債	8	24
流動負債計	5,640,822	6,765,771
固定負債		
退職給付引当金	886,720	927,210
固定負債計	886,720	927,210
負債合計	6,527,543	7,692,982
純資産の部		
株主資本		
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	22,810,382	22,896,494
利益準備金	500,000	500,000
その他利益剰余金	22,310,382	22,396,494
繰越利益剰余金	22,310,382	22,396,494

評価・換算差額等	5,624	10,599
その他有価証券評価差額金	5,624	10,599
純資産合計	25,216,006	25,307,093
負債・純資産合計	31,743,550	33,000,075

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	16,696,838	16,958,564
運用受託報酬	11,663,951	13,291,669
投資助言報酬	92,682	107,390
その他営業収益	661,029	678,515
営業収益計	29,114,502	31,036,140
営業費用		
支払手数料	7,669,451	7,801,482
広告宣伝費	206,908	203,242
調査費	7,435,066	8,650,200
調査費	2,823,854	3,298,847
委託調査費	4,611,211	5,351,353
委託計算費	119,180	116,944
営業雑経費	265,287	263,317
通信費	60,267	57,380
印刷費	160,147	157,178
協会費	23,883	24,327
諸会費	12,732	15,737
図書費	8,256	8,693
営業費用計	15,695,895	17,035,188
一般管理費		
給料	3,883,418	4,075,417
役員報酬	83,430	82,371
給料・手当	2,848,648	3,010,062
賞与	951,339	982,983
交際費	13,259	25,693
寄付金	4,696	9,893
旅費交通費	140,480	162,304
租税公課	174,372	246,078
不動産賃借料	468,091	468,091
退職給付費用	163,194	178,404
賞与引当金繰入	288,706	296,807
固定資産減価償却費	165,502	247,247
法定福利費	629,504	686,198
福利厚生費	10,617	14,385
諸経費	503,320	642,231
一般管理費計	6,445,164	7,052,753
営業利益	6,973,442	6,948,198
営業外収益		
受取利息	189	185
受取配当金	* 1 4,304	1,238
雑益	13,722	15,069
営業外収益計	18,216	16,493
営業外費用		
為替差損	54,263	80,542
雑損	9,120	15,415
営業外費用計	63,383	95,958
経常利益	6,928,275	6,868,734
特別利益		

投資有価証券売却益	480	829
その他特別利益	-	402
特別利益計	480	1,232
特別損失		
固定資産除却損	190	30,348
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	382
特別損失計	209,884	30,731
税引前当期純利益	6,718,870	6,839,235
法人税、住民税及び事業税	2,220,524	2,410,514
法人税等調整額	149,911	305,632
法人税等合計	2,070,612	2,104,882
当期純利益	4,648,257	4,734,352

(3) 【株主資本等変動計算書】

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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	22,310,382
当期変動額					
剰余金の配当					4,648,241
当期純利益					4,734,352
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	-	-	86,111
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	22,396,494

	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
当期変動額					
剰余金の配当	4,648,241	4,648,241			4,648,241
当期純利益	4,734,352	4,734,352			4,734,352
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			4,974	4,974	4,974
当期変動額合計	86,111	86,111	4,974	4,974	91,086
当期末残高	22,896,494	25,296,494	10,599	10,599	25,307,093

注記事項

（重要な会計方針）

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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翌事業年度から費用処理しております。

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により費用処理しております。

4. 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38期 2023年3月31日現在	第39期 2024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38期 2023年3月31日現在	第39期 2024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 217,486千円	建物 245,354千円
器具備品 477,945千円	器具備品 481,065千円

(損益計算書関係)

第38期 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日	第39期 自 2023年4月1日 至 2024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="padding-left: 2em;">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>	<p>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9,623千円であります。</p>

(株主資本等変動計算書関係)

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) 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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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	2023年4月1日 現在	増加	減少	2024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

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

(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

2024年6月26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	3,787,448千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	98,889円
(ニ) 基準日	2024年3月31日
(ホ) 効力発生日	2024年6月26日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

第38期 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日	第39期 自 2023年4月1日 至 2024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

第39期(2024年3月31日現在)

2024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	49,108	49,108	-
敷金	474,324	472,538	1,786
資産計	523,432	521,646	1,786

(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
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	80,000

(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	-	18,872	1,912	1,101
合計	-	18,872	1,912	1,101

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 その他有価証券	-	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。

第39期(2024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			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券 其他有価証券	-	49,108	-	49,108
資産計	-	49,108	-	49,108

(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			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
敷金	-	472,538	-	472,538
資産計	-	472,538	-	472,538

(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38期 2023年3月31日現在	第39期 2024年3月31日現在
<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</p> <p>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。</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</p> <p>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 80,000千円)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。</p>
<p>2. 其他有価証券</p> <p>(単位：千円)</p>	<p>2. 其他有価証券</p> <p>(単位：千円)</p>

区分	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	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	20,685	21,539	853
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。

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。

区分	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	37,893	20,877	17,015
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	11,214	12,953	1,738
合計	49,108	33,831	15,277

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券
(単位：千円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	5,767	829	-
合計	5,767	829	-

4. 減損処理を行った有価証券
該当事項はありません。

(収益認識関係)

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。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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	16,958,564	-	16,958,564
運用受託報酬	12,488,818	802,851	13,291,669
投資助言報酬	107,390	-	107,390
その他営業収益	678,515	-	678,515
合計	30,233,289	802,851	31,036,140

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） 6,222,195千円

顧客との契約から生じた債権（期末残高） 7,611,757千円

（*）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。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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	869,667千円
勤務費用	73,630千円
利息費用	6,822千円
数理計算上の差異の発生額	29,062千円
退職給付の支払額	38,184千円
退職給付債務の期末残高	940,999千円

(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	940,999千円
未積立退職給付債務	940,999千円
未認識数理計算上の差異	13,789千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	927,210千円
退職給付引当金	927,210千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	927,210千円

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	73,630千円
利息費用	6,822千円
数理計算上の差異の費用処理額	1,778千円
その他	10,687千円

確定給付制度に係る退職給付費用

89,362千円

(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 0.9%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、89,041千円であります。

(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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
繰延税金資産		
退職給付引当金	271,513千円	283,911千円
未払金	2,092千円	3,362千円
賞与引当金	88,401千円	90,882千円
未払法定福利費	11,663千円	12,359千円
未払事業所税	3,929千円	4,097千円
未払事業税	64,984千円	73,982千円
未払調査費	102,531千円	108,813千円
減価償却超過額	24,211千円	7,259千円
繰延資産超過額	9,605千円	12,236千円
未払確定拠出年金	2,120千円	2,331千円
未収実績連動報酬	48,549千円	264,384千円
投資損失引当金	63,934千円	-
未払費用	267,102千円	404,707千円
繰延税金資産小計	960,642千円	1,268,329千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	960,642千円	1,268,329千円
繰延税金負債		
前払費用	4,110千円	6,166千円
その他有価証券評価差額金	2,482千円	4,677千円
繰延税金負債合計	6,593千円	10,844千円
繰延税金資産の純額	954,048千円	1,257,485千円

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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024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、前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）を前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38期 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日	第39期 自 2023年4月1日 至 2024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>[関連情報]</p> <p>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。</p> <p>2. 地域ごとの情報 (1) 営業収益</p> <p style="text-align: right;">（単位：千円）</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>日本</th> <th>その他</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: right;">25,542,522</td> <td style="text-align: right;">3,571,980</td> <td style="text-align: right;">29,114,502</td> </tr> </tbody> </table> <p>(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。</p> <p>(2) 有形固定資産 本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております</p> <p>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）</p> <p>(2) 委託者報酬 3,989,751千円</p> <p>(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</p>	日本	その他	合計	25,542,522	3,571,980	29,114,502	<p>[セグメント情報]</p> <p>同左</p> <p>[関連情報]</p> <p>1. 製品及びサービスごとの情報 同左</p> <p>2. 地域ごとの情報 (1) 営業収益</p> <p style="text-align: right;">（単位：千円）</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>日本</th> <th>その他</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: right;">27,411,151</td> <td style="text-align: right;">3,624,988</td> <td style="text-align: right;">31,036,140</td> </tr> </tbody> </table> <p>(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。</p> <p>(2) 有形固定資産 同左</p> <p>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）</p> <p>(2) 委託者報酬 3,106,318千円</p> <p>(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</p>	日本	その他	合計	27,411,151	3,624,988	31,036,140
日本	その他	合計											
25,542,522	3,571,980	29,114,502											
日本	その他	合計											
27,411,151	3,624,988	31,036,140											

（関連当事者情報）

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。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権 の所有 割合	関連当 事者との 関係	取引の 内容	取引金額	科目	期末残高
同一の 親会社 をもつ 会社	東京海上 日動火災 保険 株式会社	東京都 千代田区	101,994,694 千円	損害 保険業	なし	投資信託 の取扱 役員 の兼任	投資信託 に係る 事務代行 手数料の 支払	1,337,087 千円	未払 手数料	450,379 千円

(注) * 取引価格については、市場実勢等を勘案し、交渉の上決定しております。

* 取引金額には、消費税等は含まれておりません。

- (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いません。	
(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

第39期	
自 2023年4月1日	
至 2024年3月31日	
1株当たり純資産額	660,759円61銭
1株当たり当期純利益金額	123,612円34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	25,307,093千円
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	25,307,093千円
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	4,734,352千円
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	4,734,352千円
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(2024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(2024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。

() 2024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	2024年6月17日
有価証券報告書	2024年6月17日
臨時報告書	2024年3月28日
	2024年6月26日

独立監査人の監査報告書

2024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 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

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 石井章悟

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2024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実務責任

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。

監査役の実務責任は、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11月22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 奈良 将太郎

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2024年3月19日から2024年9月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）円コース（毎月分配型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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11月22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 奈良 将太郎
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、「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2024年3月19日から2024年9月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）米ドルコース（毎月分配型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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11月22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 奈良 将太郎

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2024年3月19日から2024年9月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）ユーロコース（毎月分配型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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11月22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 奈良 将太郎

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2024年3月19日から2024年9月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）豪ドルコース（毎月分配型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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11月22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 奈良 将太郎

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2024年3月19日から2024年9月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアルコース（毎月分配型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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11月22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 奈良 将太郎

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2024年3月19日から2024年9月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）メキシコ・ペソコース（毎月分配型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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11月22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 奈良 将太郎

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2024年3月19日から2024年9月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）トルコ・リラコース（毎月分配型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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11月22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 奈良 将太郎

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2024年3月19日から2024年9月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）資源国通貨バスケットコース（毎月分配型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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11月22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 奈良 将太郎

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2024年3月19日から2024年9月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上Rogge世界ハイブリッド証券ファンド（通貨選択型）マネープール・ファンドの2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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。