

第4期

運用報告書(全体版)

グローバル仮想世界株式 戦略ファンド (愛称 フューチャーメタバース)

【2024年3月19日決算】

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。
皆様の「グローバル仮想世界株式戦略ファンド(愛称 フューチャーメタバース)」は、2024年3月19日に第4期決算を迎えましたので、期中の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。

今後とも、一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

SBI 岡三アセットマネジメント

〒104-0031 東京都中央区京橋2-2-1

お問い合わせは弊社投信営業部へ

フリーダイヤル ☎ 0120-048-214 (営業日の9:00~17:00)

お取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

[ホームページ]

<https://www.sbiokasan-am.co.jp>

※アクセスにかかる通信料はお客様のご負担となります。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | | |
|--------|---|--|
| 商品分類 | 追加型投信/内外/株式 | |
| 信託期間 | 2022年3月22日から2045年3月17日までです。 | |
| 運用方針 | 投資信託証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の取引所等に上場している仮想世界関連企業の株式(預託証券(DR)を含みます。)に投資します。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 | |
| 主要投資対象 | 当ファンド | グローバルメタバースファンド(円建て、ヘッジなしクラス)および日本マネー・マザーファンドを主要投資対象とします。 |
| | グローバルメタバースファンド(円建て、ヘッジなしクラス) | 日本を含む世界各国の取引所等に上場している仮想世界関連企業の株式(預託証券(DR)を含みます。)を主要投資対象とします。 |
| | 日本マネー・マザーファンド | わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 | |
| 分配方針 | 年2回、3月および9月の各月の19日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として、以下の方針に基づき、収益分配を行います。 分配対象収益の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。繰越分を含めた配当等収益には、マザーファンドの配当等収益のうち、投資信託財産に帰属すべき配当等収益を含むものとします。 分配金額は、委託会社が分配可能額、基準価額水準等を勘案のうえ決定します。分配可能額が少額の場合や基準価額水準によっては、収益分配を行わないことがあります。 | |

○設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (円ベース) | | MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (配当込み) [円換算後] | | 債 組 入 比 率 | 投 資 信 託 組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|---------------------|-------------|-------------|------------------|------------------------------------|--------|---|-------------|-----------------------|--------------------------------------|------------------|
| | (分配落) | 税 分 配 | み 金 騰 落 | 期 騰 落 | 中 率 | (参考指数) | 期 騰 落 | | | |
| (設定日) 2022年3月22日 | 円 10,000 | 円 - | % - | ポイント 687.83 | % - | ポイント - | % - | % - | % - | 百万円 5,634 |
| 1期(2022年9月20日) | 8,200 | 0 | △18.0 | 707.60 | 2.9 | - | - | 0.1 | 98.4 | 9,074 |
| 2期(2023年3月20日) | 8,261 | 0 | 0.7 | 670.03 | △5.3 | - | - | 0.1 | 98.8 | 9,059 |
| 3期(2023年9月19日) | 11,505 | 0 | 39.3 | 826.81 | 23.4 | - | - | 0.2 | 98.5 | 9,218 |
| 4期(2024年3月19日) | 14,744 | 0 | 28.2 | - | - | 263,087.0414 | - | 0.1 | 98.7 | 9,525 |

(注) 基準価額および分配金(税引前)は1万口当たり、基準価額の騰落率は分配金(税引前)込み。

(注) 設定日の基準価額および純資産総額は当初設定元本。

(注) MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (円ベース) およびMSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (配当込み) [円換算後] は当ファンドの参考指数であり、ベンチマークではありません。MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (円ベース) は当該日前営業日の現地終値です。MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (配当込み) [円換算後] は、当該日前営業日の現地終値を為替レート (対顧客電信売買相場の当日 (東京) の仲値) を乗じて当社が算出しています。

(注) 2023年12月29日にMSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (円ベース) からMSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (配当込み) [円換算後] に参考指数を変更いたしました。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、債券組入比率は実質比率を記載しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (円ベース) | | MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (配当込み) [円換算後] | | 債 組 入 比 率 | 投 資 信 託 組 入 比 率 |
|--------------------|-------------|-----------|------------------------------------|--------|---|--------|-----------------------|--------------------------------------|
| | 騰 落 率 | (参考指数) | 騰 落 率 | (参考指数) | 騰 落 率 | | | |
| (期首) 2023年9月19日 | 円 11,505 | % - | ポイント 826.81 | % - | ポイント - | % - | % 0.2 | % 98.5 |
| 9月末 | 11,303 | △1.8 | 808.16 | △2.3 | - | - | 0.2 | 98.5 |
| 10月末 | 10,804 | △6.1 | 779.30 | △5.7 | - | - | 0.2 | 98.5 |
| 11月末 | 12,598 | 9.5 | 840.28 | 1.6 | - | - | 0.2 | 98.5 |
| 12月末 | 12,761 | 10.9 | - | - | 235,247.1805 | - | 0.2 | 98.9 |
| 2024年1月末 | 13,886 | 20.7 | - | - | 247,919.8547 | - | 0.1 | 98.7 |
| 2月末 | 14,818 | 28.8 | - | - | 260,555.4390 | - | 0.1 | 99.2 |
| (期末) 2024年3月19日 | 円 14,744 | % 28.2 | ポイント - | % - | ポイント 263,087.0414 | % - | % 0.1 | % 98.7 |

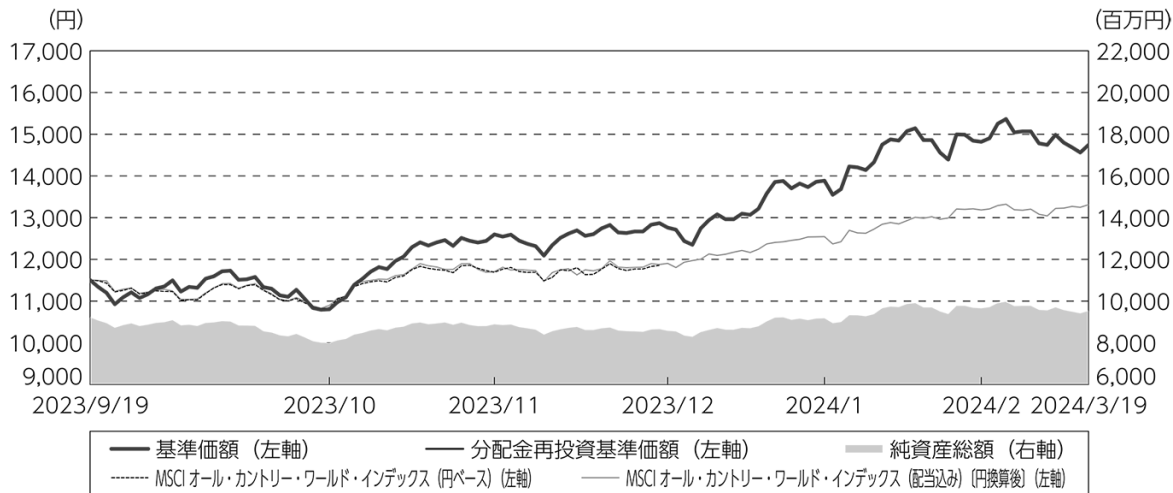
(注) 騰落率は期首比。

MSCI指数はMSCI Inc. が算出している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. 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。

運用経過

期中の基準価額等の推移

（2023年9月20日～2024年3月19日）



期首：11,505円

期末：14,744円（既払分配金（税引前）：0円）

騰落率：28.2%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 参考指数は、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（円ベース）およびMSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み）〔円換算後〕です。
- (注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、期首（2023年9月19日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 2023年12月29日にMSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（円ベース）からMSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み）〔円換算後〕に参考指数を変更いたしました。そのため、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（円ベース）の推移は2023年12月28日までを記載、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み）〔円換算後〕の推移は見やすさの観点から期首（2023年9月19日）より記載しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

〇基準価額の主な変動要因

当ファンドの主要投資対象である「グローバルメタバースファンド（円建て、ヘッジなしクラス）」における主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・米国のエヌビディアやカナダのセレスティカなどの株価上昇が、主なプラス要因となりました。
- ・米ドルや台湾ドルなど投資国の通貨が対円で上昇したことが、主なプラス要因となりました。

(主なマイナス要因)

- ・米国のファストリーや台湾のトライポッド・テクノロジーなどの株価下落が、主なマイナス要因となりました。

投資環境

（2023年9月20日～2024年3月19日）

当期のグローバル株式市場は上昇しました。2023年12月に開催された米連邦公開市場委員会（FOMC）においては2024年中の利下げ開始が示唆され、米連邦準備制度理事会（FRB）による金融引き締めに対する警戒感が和らいだことなどを背景に、株価は上昇基調となりました。2024年の年明け後も、米大手半導体企業が生成AI（人工知能）関連需要を背景に市場予想を大幅に上回る決算を発表したことを受けて、生成AIへの注目が高まり、テクノロジー株主導で株価は堅調に推移しました。生成AIはメタバース関連でも活用されることが見込まれており、当ファンドの組入銘柄にとって追い風となりました。

国内短期金融市場では、2023年10月末の日銀の金融政策決定会合を前に金融政策の修正観測が広がったことから、1年国債利回りは0%近辺まで上昇しましたが、11月に入ってから国内外の主要経済指標が軟調な結果となったことを受け、1年国債利回りは-0.10%近辺まで低下しました。その後、日銀がマイナス金利政策の解除に前向きとの見方が強まるなか、1年国債利回りは徐々に上昇する動きとなり、2024年2月下旬に0%を上回る展開となりました。加えて、日銀が3月19日の金融政策決定会合でマイナス金利政策を解除し、政策金利を0～0.1%に引き上げたことから、1年国債利回りは0.07%で期末を迎えました。

当ファンドのポートフォリオ

（2023年9月20日～2024年3月19日）

<グローバル仮想世界株式戦略ファンド（愛称 フューチャーメタバース）>

「グローバルメタバースファンド（円建て、ヘッジなしクラス）」、「日本マネー・マザーファンド」を主要投資対象とし、「グローバルメタバースファンド（円建て、ヘッジなしクラス）」を高位に組み入れて運用を行いました。

○グローバルメタバースファンド（円建て、ヘッジなしクラス）

メタバースの普及に伴い中長期的な業績成長が期待できる銘柄に積極的な投資を実施しました。ハイテク製品やインターネット空間における技術革新が牽引する領域であることから、業種別では情報技術、コミュニケーション・サービス等の組入比率が高位となりました。また、グローバルな投資機会を幅広く追求した結果、米国、欧州、アジアの各地域に分散されたポートフォリオを構築しました。

実質組入外貨建資産につきましては、運用の基本方針に則り、為替ヘッジは行いませんでした。

○日本マネー・マザーファンド

わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とした運用を行いました。当期中は、政府保証債を組み入れました。

当ファンドのベンチマークとの差異

（2023年9月20日～2024年3月19日）

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。参考指数は、2023年12月28日まではMSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（円ベース）でしたが、2023年12月29日以降は、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み）〔円換算後〕に変更いたしました。このため、当期中に参考指数が変更となったことからファンドとの比較ができないため、「基準価額と参考指数の対比（騰落率）」の掲載は行っておりません。

分配金

（2023年9月20日～2024年3月19日）

当ファンドは年2回、3月および9月の各月の19日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、収益分配を行います。分配対象収益の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。分配金額は、委託会社が分配可能額、基準価額水準等を勘案して決定します。

当期の分配につきましては、投資信託財産の成長を重視し、見送りとさせていただきます。

なお、収益分配に充てなかった留保益につきましては、運用の基本方針と同一の運用を行います。

（単位：円、1万口当たり・税引前）

| 項 目 | 第4期 |
|--------------------|---------------------------|
| | 2023年9月20日～ 2024年3月19日 |
| 当期分配金 （対基準価額比率） | — —% |
| 当期の収益 | — |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 4,875 |

（注）対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

（投資環境の見通し）

米国の金融政策が利下げ開始時期を模索するフェーズに入ったと見られるなか、米国経済は底堅く推移しており、「景気後退なきインフレ（物価上昇）退治」が達成されることへの期待感が高まっています。AIの普及拡大は、マクロ経済の観点では生産性の改善を通じてインフレ抑制要因にもなることから、特定のセクターや個別企業の枠を超え株式市場の中期的な上昇要因になる可能性があると考えています。一方で、2024年11月には米国の大統領選挙が控えており、結果次第では世界の地政学情勢に大きな影響を与える可能性がある点には留意が必要と考えます。

＜グローバル仮想世界株式戦略ファンド（愛称 フューチャーメタバース）＞

「グローバルメタバースファンド（円建て、ヘッジなしクラス）」を高位に組み入れて運用を行います。

○グローバルメタバースファンド（円建て、ヘッジなしクラス）

メタバース関連企業の中期的な成長性は高いと考えられ、足元でも着実な取り組みの進展が見られます。上述のような変動性が高まる投資環境は、魅力的なメタバース関連企業に割安な価格で投資する好機であり、長期的なリターン獲得の可能性は高まっていると考えています。メタバースは構造的な長期成長テーマであり、メタバースを実現させる革新的な技術を提供する企業や、メタバースにより恩恵を受ける先進的な企業に焦点を当てて投資を行います。

株式への投資割合は、原則として高位を維持します。

また、実質組入外貨建資産につきましては、運用の基本方針に則り、為替ヘッジは行わない方針です。

○日本マネー・マザーファンド

国内短期金融市場では、追加利上げ観測が根強いことから1年国債利回りが上昇する場面もあると見ています。ただ、日銀が追加利上げを急がない考えを示していることから、1年国債利回りは0～0.1%程度を中心に推移する展開を想定しています。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年9月20日～2024年3月19日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 | % | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (24) | (0.191) | 委託した資金の運用の対価 |
| （ 販 売 会 社 ） | (56) | (0.438) | 交付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、購入後の情報提供等の対価 |
| （ 受 託 会 社 ） | (2) | (0.016) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) そ の 他 費 用 | 1 | 0.007 | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 監 査 費 用 ） | (1) | (0.007) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.000) | その他は、金銭信託支払手数料 |
| 合 計 | 83 | 0.652 | |
| 期中の平均基準価額は、12,695円です。 | | | |

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

(注) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

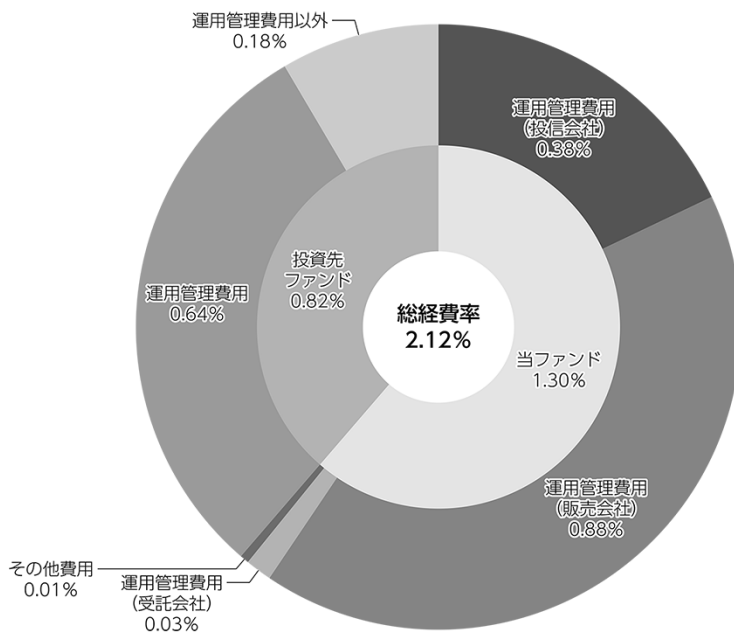
(注) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は2.12%です。



(単位: %)

| | |
|----------------------|------|
| 総経費率(①+②+③) | 2.12 |
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.30 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.64 |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.18 |

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

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

○売買及び取引の状況

（2023年9月20日～2024年3月19日）

投資信託証券

| 銘 | 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|----|------------------------------|--------|---------|--------------|-----------------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 国内 | グローバルメタバースファンド(円建て、ヘッジなしクラス) | 口 — | 千円 — | 口 155,179 | 千円 1,935,000 |

(注) 金額は受渡代金。

(注) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

（2023年9月20日～2024年3月19日）

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

（2024年3月19日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 | | 末 |
|---|------------------------------|---------|---------|-----------|------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| | | 口 | 口 | 千円 | % |
| | グローバルメタバースファンド(円建て、ヘッジなしクラス) | 776,488 | 621,309 | 9,404,138 | 98.7 |
| | 合 計 | 776,488 | 621,309 | 9,404,138 | 98.7 |

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨て。

親投資信託残高

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 | | 末 |
|---|---------------|---------|--------|--------|--------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 千円 |
| | | 千口 | 千口 | 千円 | 千円 |
| | 日本マネー・マザーファンド | 17,416 | 17,416 | 17,681 | 17,681 |

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

（2024年3月19日現在）

| 項 目 | 当 期 | 末 |
|---------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 9,404,138 | 98.1 |
| 日本マネー・マザーファンド | 17,681 | 0.2 |
| コール・ローン等、その他 | 167,688 | 1.7 |
| 投資信託財産総額 | 9,589,507 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年3月19日現在）

| 項目 | 当期末 |
|--------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 9,589,507,505 |
| コール・ローン等 | 167,687,333 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 9,404,138,775 |
| 日本マネー・マザーファンド(評価額) | 17,681,397 |
| (B) 負債 | 64,222,829 |
| 未払解約金 | 6,019,270 |
| 未払信託報酬 | 57,615,769 |
| 未払利息 | 7 |
| その他未払費用 | 587,783 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 9,525,284,676 |
| 元本 | 6,460,657,114 |
| 次期繰越損益金 | 3,064,627,562 |
| (D) 受益権総口数 | 6,460,657,114口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,744円 |

- (注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1,4744円です。
 (注) 当ファンドの期首元本額は8,012,654,766円、期中追加設定元本額は142,835,747円、期中一部解約元本額は1,694,833,399円です。

○損益の状況（2023年9月20日～2024年3月19日）

| 項目 | 当期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 12,763 |
| 受取利息 | 308 |
| 支払利息 | △ 13,071 |
| (B) 有価証券売買損益 | 2,132,957,048 |
| 売買益 | 2,280,325,983 |
| 売買損 | △ 147,368,935 |
| (C) 信託報酬等 | △ 58,212,602 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 2,074,731,683 |
| (E) 前期繰越損益金 | 1,053,767,698 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 63,871,819 |
| (配当等相当額) | (21,566,959) |
| (売買損益相当額) | (△ 85,438,778) |
| (G) 計(D+E+F) | 3,064,627,562 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 3,064,627,562 |
| 追加信託差損益金 | △ 63,871,819 |
| (配当等相当額) | (21,567,028) |
| (売買損益相当額) | (△ 85,438,847) |
| 分配準備積立金 | 3,128,499,381 |

- (注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 (注) 収益分配金

| 決算期 | 第4期 |
|------------------------------|----------------|
| (a) 配当等収益(費用控除後) | 30,837円 |
| (b) 有価証券等損益額(費用控除後、繰越欠損金補填後) | 2,074,700,846円 |
| (c) 信託約款に規定する収益調整金 | 21,567,028円 |
| (d) 信託約款に規定する分配準備積立金 | 1,053,767,698円 |
| 分配対象収益(a+b+c+d) | 3,150,066,409円 |
| 分配対象収益(1万口当たり) | 4,875円 |
| 分配金額 | 0円 |
| 分配金額(1万口当たり) | 0円 |

〈お知らせ〉

2024年1月から開始されるNISA成長投資枠への対応を目的として、デリバティブ取引に係る利用目的の明確化および信託期間の延長に関する投資信託約款の変更を行いました。(実施日:2023年12月19日)

用語解説

○資産、負債、元本及び基準価額の状況は、期末における資産、負債、元本及び基準価額の計算過程を表しています。主な項目の説明は次の通りです。

| 項目 | 説明 |
|---------------------|---|
| 資産 | ファンドが保有する財産の合計です。 |
| コール・ローン等 | 金融機関向けの安全性の高い短期貸付運用などの残高です。 |
| 各種有価証券等(評価額) | 組入れた株式・債券・ファンドなどの評価金額です。 |
| 未収入金 | 入金が予定されている有価証券の売却代金などです。 |
| 未収配当金 | 入金が予定されている株式の配当金等です。 |
| 未収利息 | 入金が予定されているコール・ローン等の利息や債券の利息の合計です。 |
| 負債 | 支払いが予定されている金額の合計です。 |
| 未払収益分配金 | 期末時点で支払いが予定されている収益分配金です。 |
| 未払解約金 | 支払いが予定されている解約金です。 |
| 未払信託報酬 | 支払いが予定されている信託報酬の額です。 |
| その他未払費用 | 支払いが予定されている監査費用、その他の費用です。 |
| 純資産総額(資産－負債) | ファンドが保有する財産の合計から支払いが予定されている金額の合計を差し引いたものです。 |
| 元本 | ファンド全体の元本残高です。 |
| 次期繰越損益金 | 純資産総額と元本の差額(翌期に繰り越す損益金の合計額)です。 |
| 受益権総口数 | 受益者が保有する受益権口数の合計です。 |
| 1(万)口当たり基準価額 | 1(万)口当たりのファンドの時価です。 |

用語解説

○損益の状況は、期中にファンドがどのような収益や損失を計上したかを表しています。主な項目の説明は次の通りです。

| 項目 | 説明 |
|-----------------|---|
| 配当等収益 | ファンドが受取った配当金・利息等の合計です。 |
| 受取配当金 | 保有する株式等の配当金等です。 |
| 受取利息 | 債券、コール・ローン等の利息等です。 |
| 有価証券売買損益 | 有価証券の売買損益と期末の評価損益の合計額です。 |
| 売買益 | 売買益と期末評価益の合計です。 |
| 売買損 | 売買損と期末評価損の合計です。 |
| 信託報酬等 | 信託報酬のほか保管費用、監査費用、その他の費用と、それに掛かる消費税等相当額です。 |
| 当期損益金 | 当期における収支合計です。 |
| 前期繰越損益金 | 前期分の分配準備積立金と繰越損益金の合計額から当期中の解約に対する持分を控除した金額です。 |
| 追加信託差損益金 | 受益者がファンドに払い込んだ金額と元本との差額です。 |
| (配当等相当額) | 配当等に相当する額です。 |
| (売買損益相当額) | 売買損益に相当する額です。 |
| 計 | 収益分配前の期中の収支の総合計です。 |
| 収益分配金 | 期中の分配可能額から受益者に支払われる分配金です。 |
| 次期繰越損益金 | 翌期に繰り越す損益金の合計です。 |
| 追加信託差損益金 | 翌期に繰り越す追加信託差損益金です。 |
| (配当等相当額) | 配当等に相当する額です。 |
| (売買損益相当額) | 売買損益に相当する額です。 |
| 分配準備積立金 | 翌期に繰り越す分配準備積立金の額です。 |
| 繰越損益金 | 翌期に繰り越す損益金の額です。 |

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2024年3月19日現在）

<日本マネー・マザーファンド>

下記は、日本マネー・マザーファンド全体（612,383千円）の内容です。

国内公社債

(A) 国内（邦貨建）公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 | | 末 | | | | |
|-----------------|----------------------------|----------------------------|---------------------|--------------------|---------------|---------------|---------------------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| 特殊債券 (除く金融債) | 千円 460,000 (460,000) | 千円 460,545 (460,545) | % 74.1 (74.1) | % — (—) | % — (—) | % — (—) | % 74.1 (74.1) |
| 合 計 | 460,000 (460,000) | 460,545 (460,545) | 74.1 (74.1) | — (—) | — (—) | — (—) | 74.1 (74.1) |

(注) ()内は非上場債券で内書きです。

(注) 組入比率は、当ファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 国内（邦貨建）公社債 銘柄別開示

| 銘 柄 | 当 期 | | 末 | |
|----------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| 第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.645 | 60,000 | 60,010 | 2024/3/29 |
| 第218回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.66 | 70,000 | 70,092 | 2024/5/31 |
| 第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.601 | 60,000 | 60,130 | 2024/7/31 |
| 第6回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年) | 0.001 | 70,000 | 69,991 | 2024/9/27 |
| 第59回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.669 | 60,000 | 60,027 | 2024/4/12 |
| 第61回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.644 | 90,000 | 90,136 | 2024/6/14 |
| 第65回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.539 | 50,000 | 50,155 | 2024/10/16 |
| 合 計 | | 460,000 | 460,545 | |

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

<参考情報>

グローバルメタバースファンド（円建て、ヘッジなしクラス）

<当ファンドの仕組みは次の通りです>

| | |
|---------|---|
| シェアクラス | 円建て、ヘッジなしクラス |
| ファンドの形態 | ケイマン籍円建て外国投資信託 |
| 運用会社 | ニューバーガー・バーマン・インベストメント・アドバイザーズ・エル・エル・シー |
| 基本方針 | 投資信託財産の中長期的な成長を目指します。 |
| 投資対象 | 主として、日本を含む世界各国の取引所等に上場している仮想世界関連企業 [※] の株式（預託証券（DR）を含みます。）に投資します。 [※] 仮想世界関連企業とは、インターネット等を活用した仮想空間で展開されるバーチャル経済圏の拡大によって、業績面で恩恵を受ける企業をいいます。 |
| 投資態度 | ①投資銘柄は、仮想世界関連企業の中から、ファンダメンタルズ分析を通じて成長性や株価バリュエーションを精査した上で選定します。 ②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 |
| 主な投資制限 | ①デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。 ②レバレッジを活用した取引（レンディング、レポ取引を含む）及び売建て（ショート）取引は行いません。 |
| 運用報酬 | 純資産総額×年率0.65% |
| その他費用 | 運用資産の管理・保管業務等および監査業務の対価としての事務管理費用、有価証券の売買にかかる費用、臨時で発生する費用、租税等がかかります。 |

グローバルメタバースファンド

以下は、グローバルメタバースファンドの監査済報告書の一部を、SBI岡三アセットマネジメントが翻訳したものです。SBI岡三アセットマネジメントは正確性、完全性を保証するものではありません。

損益計算書

自 2022年3月22日 至 2023年6月30日
(単位：米ドル)

| | |
|------------------------|--------------------|
| 収益 | |
| 受取配当金 (124,084ドル源泉税控除) | 582,070 |
| 受取利息 | 64,190 |
| 雑収入 | 104 |
| 収益合計 | 646,364 |
| 費用 | |
| 運用報酬 | 534,678 |
| 事務管理報酬 | 50,959 |
| 監査報酬 | 35,001 |
| 名義書換代理人費用 | 15,898 |
| 受託者報酬 | 15,288 |
| その他費用 | 10,002 |
| 保管費用 | 6,370 |
| 費用合計 | 668,196 |
| 投資純損益 | △ 21,832 |
| 実現損益 | |
| 投資有価証券 | △13,675,328 |
| 外貨取引および為替予約取引 | △ 88,921 |
| 実現純損益 | △13,764,249 |
| 未実現損益 | |
| 投資有価証券 | 11,737,866 |
| 外貨取引および為替予約取引 | △ 2,121 |
| 未実現純損益 | 11,735,745 |
| 実現純損益および未実現純損益 | △ 2,028,504 |
| 当期純損益 | △ 2,050,336 |

**Global Metaverse Fund
Schedule of Investments
As of June 30, 2023**

(Expressed in United States Dollars)

| Shares | Security Description | Fair Value |
|---------|---|-------------------|
| | COMMON STOCKS (96.8%) | |
| | CHINA (4.2%) | |
| | ELECTRONICS (2.1%) | |
| 881,100 | Zhejiang Crystal-Optech Co. Ltd. Class A | \$ 1,446,054 |
| | INTERNET (1.4%) | |
| 54,900 | Baidu, Inc. Class A | 930,319 |
| | MISCELLANEOUS MANUFACTURERS (0.7%) | |
| 51,800 | Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. | 516,559 |
| | TOTAL CHINA (Cost \$3,330,131) | 2,892,932 |
| | FRANCE (2.6%) | |
| | SEMICONDUCTORS (1.6%) | |
| 6,579 | SOITEC | 1,112,081 |
| | SOFTWARE (1.0%) | |
| 15,298 | Dassault Systemes SE | 677,974 |
| | TOTAL FRANCE (Cost \$1,733,670) | 1,790,055 |
| | GERMANY (5.5%) | |
| | COMPUTERS (1.7%) | |
| 32,748 | Jenoptik AG | 1,123,188 |
| | SEMICONDUCTORS (3.8%) | |
| 77,439 | AIXTRON SE | 2,626,427 |
| | TOTAL GERMANY (Cost \$3,066,559) | 3,749,615 |
| | HONG KONG (1.6%) | |
| | ELECTRONICS (1.6%) | |
| 602,000 | Cowell e Holdings, Inc. | 1,112,311 |
| | TOTAL HONG KONG (Cost \$1,057,449) | 1,112,311 |
| | ITALY (1.1%) | |
| | SEMICONDUCTORS (1.1%) | |
| 93,473 | Technoprobe SpA | 738,261 |
| | TOTAL ITALY (Cost \$729,828) | 738,261 |
| | JAPAN (6.2%) | |
| | HOME FURNISHINGS (3.2%) | |
| 24,700 | Sony Group Corp. | 2,215,396 |
| | SOFTWARE (2.0%) | |
| 28,700 | Square Enix Holdings Co. Ltd. | 1,327,884 |
| | TOYS/GAMES/HOBBIES (1.0%) | |
| 29,500 | Bandai Namco Holdings, Inc. | 677,755 |
| | TOTAL JAPAN (Cost \$4,473,714) | 4,221,035 |
| | NETHERLANDS (2.3%) | |
| | ENTERTAINMENT (0.3%) | |
| 8,352 | Universal Music Group NV | 185,413 |
| | SEMICONDUCTORS (2.0%) | |
| 12,445 | BE Semiconductor Industries NV | 1,348,122 |
| | TOTAL NETHERLANDS (Cost \$1,311,965) | 1,533,535 |
| | SOUTH KOREA (1.5%) | |
| | SEMICONDUCTORS (1.5%) | |
| 11,724 | SK Hynix, Inc. | 1,024,971 |
| | TOTAL SOUTH KOREA (Cost \$824,666) | 1,024,971 |
| | TAIWAN (17.3%) | |
| | COMPUTERS (3.0%) | |
| 89,000 | Gigabyte Technology Co. Ltd. | 695,692 |
| 959,000 | Inventec Corp. | 1,329,935 |
| | TOTAL TAIWAN (Cost \$1,009,621) | 2,025,627 |
| | ELECTRONICS (7.4%) | |
| 516,000 | Gold Circuit Electronics Ltd. | 2,418,413 |
| 67,000 | Jentech Precision Industrial Co. Ltd. | 1,387,275 |
| 318,000 | Tripod Technology Corp. | 1,260,730 |
| | TOTAL ELECTRONICS (Cost \$3,066,559) | 5,066,418 |
| | MISCELLANEOUS MANUFACTURERS (1.5%) | |
| 79,000 | Genius Electronic Optical Co. Ltd. | 1,004,270 |
| | SEMICONDUCTORS (4.9%) | |
| 10,000 | eMemory Technology, Inc. | 709,448 |
| 20,000 | Global Unichip Corp. | 1,030,464 |
| 46,000 | Novatek Microelectronics Corp. | 629,803 |
| 42,000 | WinWay Technology Co. Ltd. | 1,048,955 |
| | TOTAL MISCELLANEOUS MANUFACTURERS (Cost \$1,004,270) | 3,418,670 |
| | TELECOMMUNICATIONS (0.5%) | |
| 183,000 | HTC Corp. | 335,440 |
| | TOTAL TAIWAN (Cost \$10,009,621) | 11,850,425 |
| | UNITED STATES (52.4%) | |
| | COMPUTERS (4.7%) | |
| 5,530 | Apple, Inc. | 1,072,654 |
| 7,010 | CrowdStrike Holdings, Inc. Class A | 1,029,559 |
| 4,304 | Super Micro Computer, Inc. | 1,072,772 |
| | TOTAL UNITED STATES (Cost \$1,072,654) | 3,174,985 |

The accompanying notes are an integral part of these financial statements.

Global Metaverse Fund
Schedule of Investments (continued)
As of June 30, 2023

(Expressed in United States Dollars)

| <u>Shares</u> | <u>Security Description</u> | <u>Fair Value</u> |
|-------------------------|--|-----------------------------------|
| | COMMON STOCKS (96.8%) (continued) | |
| | UNITED STATES (52.4%) (continued) | |
| | HEALTHCARE-PRODUCTS (2.5%) | |
| 4,997 | Penumbra, Inc. | \$ 1,719,268 |
| | INTERNET (6.9%) | |
| 9,772 | Meta Platforms, Inc. Class A | 2,804,369 |
| 2,979 | Palo Alto Networks, Inc. | 761,164 |
| 17,276 | Wayfair, Inc. Class A | 1,123,113 |
| | | 4,688,646 |
| | MEDIA (1.9%) | |
| 14,590 | Walt Disney Co. | 1,302,595 |
| | SEMICONDUCTORS (10.7%) | |
| 10,258 | Ambarella, Inc. | 858,287 |
| 1,246 | Broadcom, Inc. | 1,080,818 |
| 10,912 | Lattice Semiconductor Corp. | 1,048,316 |
| 8,083 | NVIDIA Corp. | 3,419,271 |
| 1,583 | QUALCOMM, Inc. | 188,440 |
| 11,626 | Rambus, Inc. | 746,040 |
| | | 7,341,172 |
| | SOFTWARE (24.2%) | |
| 5,058 | Adobe, Inc. | 2,473,311 |
| 7,571 | ANSYS, Inc. | 2,500,474 |
| 44,360 | Bentley Systems, Inc. Class B | 2,405,643 |
| 3,052 | Microsoft Corp. | 1,039,328 |
| 59,340 | ROBLOX Corp. Class A | 2,391,402 |
| 3,221 | Synopsys, Inc. | 1,402,456 |
| 12,138 | Take-Two Interactive Software, Inc. | 1,786,228 |
| 58,758 | Unity Software, Inc. | 2,551,272 |
| | | 16,550,114 |
| | TELECOMMUNICATIONS (1.5%) | |
| 58,186 | Credo Technology Group Holding Ltd. | 1,008,945 |
| | TOTAL UNITED STATES (Cost \$26,385,716) | 35,785,725 |
| | URUGUAY (2.1%) | |
| | COMPUTERS (2.1%) | |
| 8,039 | Globant S.A. | 1,444,769 |
| | TOTAL URUGUAY (Cost \$1,482,449) | 1,444,769 |
| | TOTAL COMMON STOCKS (Cost \$54,405,768) | 66,143,634 |
| Principal Amount | Security Description | % of Net Assets Fair Value |
| | SHORT-TERM INVESTMENTS (3.5%) | |
| | TIME DEPOSITS (3.5%) | |
| | CAYMAN ISLANDS (0.0%)* | |
| HKD | Brown Brothers Harriman & Co. 3.47% due 07/03/2023 | \$ 0** |
| | TOTAL CAYMAN ISLANDS (Cost \$0) | 0** |
| | JAPAN (0.0%)* | |
| EUR | Sumitomo Mitsui Banking Corp. 2.37% due 07/03/2023 | 203 |
| | TOTAL JAPAN (Cost \$203) | 203 |
| | SINGAPORE (3.5%) | |
| USD | DBS Bank Ltd. 4.32% due 07/03/2023 | 2,412,334 |
| | TOTAL SINGAPORE (Cost \$2,412,334) | 2,412,334 |
| | SWEDEN (0.0%)* | |
| NOK | Skandinaviska Enskilda Banken 2.60% due 07/03/2023 | 22 |
| | TOTAL SWEDEN (Cost \$22) | 22 |
| | TOTAL TIME DEPOSITS (Cost \$2,412,559) | 2,412,559 |
| | TOTAL SHORT-TERM INVESTMENTS (Cost \$2,412,559) | 2,412,559 |
| | TOTAL INVESTMENTS (Cost \$56,818,327) | 100.3% \$ 68,556,193 |
| | LIABILITIES IN EXCESS OF CASH AND OTHER ASSETS | (0.3)% (210,519) |
| | NET ASSETS | 100.0% \$ 68,345,674 |

* A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than 0.05%.

** Amount is less than \$0.50.

The accompanying notes are an integral part of these financial statements.

日本マネー・マザーファンド
第18期 運用状況のご報告
決算日：2023年10月10日

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とし、安定した収益の確保を図ることを目的として安定運用を行います。 |
| 主要投資対象 | わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | 株式および外貨建資産への投資は行いません。 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純資産額 |
|-------------------|-------------|-----------|-----------|-------|--------|------------|
| | | 騰 | 落 | | | |
| 14期 (2019年10月10日) | 円 10,180 | % △0.1 | % 97.5 | | % — | 百万円 680 |
| 15期 (2020年10月12日) | 10,172 | △0.1 | 88.9 | | — | 429 |
| 16期 (2021年10月11日) | 10,166 | △0.1 | 92.3 | | — | 445 |
| 17期 (2022年10月11日) | 10,159 | △0.1 | 85.6 | | — | 446 |
| 18期 (2023年10月10日) | 10,153 | △0.1 | 89.5 | | — | 424 |

(注) 基準価額は1万口当たり。

(注) 当ファンドは、特定の指数を上回るまたは連動する成果を目指した運用を行っていません。そのため、特定のベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

(注) 債券先物比率=買建比率-売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

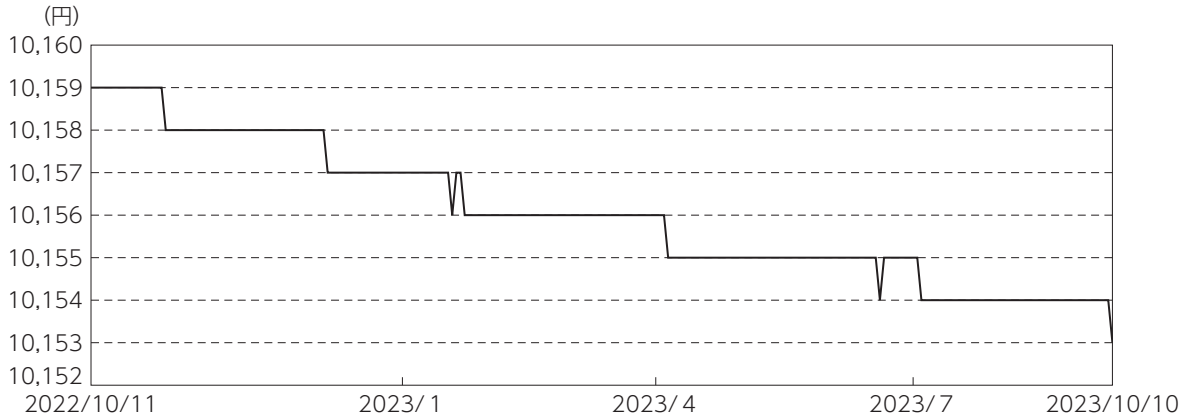
| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|---------------------|-------------|--------|-----------|-------|--------|
| | | 騰 | 落 | | |
| (期首) 2022年10月11日 | 円 10,159 | % — | % 85.6 | | % — |
| 10月末 | 10,159 | 0.0 | 94.9 | | — |
| 11月末 | 10,158 | △0.0 | 94.8 | | — |
| 12月末 | 10,158 | △0.0 | 85.9 | | — |
| 2023年1月末 | 10,157 | △0.0 | 73.4 | | — |
| 2月末 | 10,156 | △0.0 | 63.7 | | — |
| 3月末 | 10,156 | △0.0 | 62.9 | | — |
| 4月末 | 10,156 | △0.0 | 75.5 | | — |
| 5月末 | 10,155 | △0.0 | 86.6 | | — |
| 6月末 | 10,155 | △0.0 | 85.9 | | — |
| 7月末 | 10,155 | △0.0 | 81.0 | | — |
| 8月末 | 10,154 | △0.0 | 81.3 | | — |
| 9月末 | 10,154 | △0.0 | 89.5 | | — |
| (期末) 2023年10月10日 | 10,153 | △0.1 | 89.5 | | — |

(注) 騰落率は期首比。

運用経過

期中の基準価額の推移

(2022年10月12日～2023年10月10日)



○基準価額の主な変動要因

当ファンドにおける主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・特にありません。

(主なマイナス要因)

- ・日銀のマイナス金利政策の影響により、市中金利がマイナス圏で推移したことが、マイナス要因となりました。

投資環境

(2022年10月12日～2023年10月10日)

短期金融市場では、日銀が2022年12月の金融政策決定会合において金融緩和政策の一部修正を行ったことから、1年国債利回りが一時プラス圏に上昇する場面が見られました。しかし、2023年1月の金融政策決定会合において、マイナス金利を含む金融緩和政策の継続を決定したことから、1年国債利回りは再度マイナス圏へ低下しました。その後、植田日銀新総裁が就任した後の金融政策決定会合において、現状の金融緩和政策の維持が決定されたことから、1年国債利回りが-0.1%台半ばへ低下しました。ただ、7月の金融政策決定会合において、長短金利操作（YCC、イールドカーブ・コントロール）の運用柔軟化が決定されたことを受け、金融緩和の修正期待が高まったことから、1年国債利回りは-0.06%近辺まで上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

(2022年10月12日～2023年10月10日)

わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とした運用を行いました。当期間中は、政府保証債を組み入れました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2022年10月12日～2023年10月10日)

当ファンドはベンチマークおよび参考指数がないため、本項目は記載していません。

今後の運用方針**(投資環境の見通し)**

国内短期金融市場は、当面日銀によるマイナス金利政策の継続が見込まれますが、日銀の植田総裁はマイナス金利解除のための物価・賃金データが2023年末までに揃う可能性があると言っていることから、日銀の利上げリスクが意識される展開を想定しています。こうした投資環境の中、1年国債利回りは0%をやや下回る水準で推移すると予想します。

(運用方針)

わが国の公社債および短期金融商品を主要投資対象とし、安定した収益確保を目的に運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2022年10月12日～2023年10月10日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|--------------------------|---------------|-----------------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 (そ の 他) | 円 0 (0) | % 0.002 (0.002) | (a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、金銭信託支払手数料 |
| 合 計 | 0 | 0.002 | |

期中の平均基準価額は、10,156円です。

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

(注) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2022年10月12日～2023年10月10日)

公社債

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|--------|------|---------------|----------------------|
| 国 内 | 特殊債券 | 千円 456,094 | 千円 — (456,100) |

(注) 金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）

(注) 単位未満は切捨て。

(注) () 内は償還等による増減分です。

○利害関係人との取引状況等

(2022年10月12日～2023年10月10日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2023年10月10日現在)

国内公社債

(A) 国内（邦貨建）公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 | | | 末 | | | |
|------------------------|----------------------|----------------------|----------------|--------------------|-------------------|----------|----------------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 | | |
| | | | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 特 殊 債 券 (除 く 金 融 債) | 379,000 (379,000) | 379,809 (379,809) | 89.5 (89.5) | — (—) | — (—) | — (—) | 89.5 (89.5) |
| 合 計 | 379,000 (379,000) | 379,809 (379,809) | 89.5 (89.5) | — (—) | — (—) | — (—) | 89.5 (89.5) |

(注) ()内は非上場債券で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 国内（邦貨建）公社債 銘柄別開示

| 銘 柄 | 当 期 | | | 末 |
|----------------------------|-------|---------|---------|-------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券（除く金融債） | % | 千円 | 千円 | |
| 第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.669 | 50,000 | 50,050 | 2023/11/30 |
| 第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.693 | 50,000 | 50,081 | 2023/12/28 |
| 第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.747 | 64,000 | 64,153 | 2024/ 1 /31 |
| 第211回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.66 | 45,000 | 45,121 | 2024/ 2 /29 |
| 第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.645 | 60,000 | 60,179 | 2024/ 3 /29 |
| 第59回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 0.669 | 60,000 | 60,213 | 2024/ 4 /12 |
| 第16回政府保証民間都市開発債券 | 0.699 | 50,000 | 50,010 | 2023/10/20 |
| 合 計 | | 379,000 | 379,809 | |

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年10月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|---------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 千円 379,809 | % 89.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 44,453 | 10.5 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 424,262 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年10月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|---------------|
| (A) 資産 | 424,262,538 円 |
| コール・ローン等 | 43,980,682 |
| 公社債(評価額) | 379,809,145 |
| 未収利息 | 405,914 |
| 前払費用 | 66,797 |
| (B) 負債 | 877 |
| 未払利息 | 41 |
| その他未払費用 | 836 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 424,261,661 |
| 元本 | 417,847,995 |
| 次期繰越損益金 | 6,413,666 |
| (D) 受益権総口数 | 417,847,995口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,153円 |

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1.0153円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は439,685,657円、期中追加設定元本額は55,640,772円、期中一部解約元本額は77,478,434円です。

(注) 当親ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、以下の通りです。

| | |
|------------------------------------|--------------|
| アジア・オセアニア好配当成長株オープン (毎月分配型) | 185,091,215円 |
| 米国短期ハイ・イールド債券オープン | 113,984,849円 |
| 新興国連続増配成長株オープン | 39,895,881円 |
| 世界半導体関連フォーカスファンド | 27,575,340円 |
| PIMCOダイナミック・マルチアセット戦略ファンド(資産成長型) | 21,240,275円 |
| グローバル仮想世界株式戦略ファンド(愛称 フェューチャーメタバース) | 17,416,664円 |
| PIMCOダイナミック・マルチアセット戦略ファンド(年2回決算型) | 8,820,553円 |
| アジア・オセアニア好配当成長株オープン(1年決算型) | 3,823,218円 |

○損益の状況 (2022年10月12日～2023年10月10日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-------------|
| (A) 配当等収益 | 2,482,864 円 |
| 受取利息 | 2,512,687 |
| 支払利息 | △ 29,823 |
| (B) 有価証券売買損益 | △2,690,220 |
| 売買損 | △2,690,220 |
| (C) その他費用等 | △ 6,792 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 214,148 |
| (E) 前期繰越損益金 | 6,990,152 |
| (F) 追加信託差損益金 | 859,228 |
| (G) 解約差損益金 | △1,221,566 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 6,413,666 |
| 次期繰越損益金(H) | 6,413,666 |

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<お知らせ>

- ・SBI岡三アセットマネジメント株式会社への商号変更等に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。(実施日:2023年7月1日)
- ・2024年1月から開始されるNISA成長投資枠への対応を目的として、デリバティブ取引に係る利用目的の明確化に関する投資信託約款の変更を行いました。(実施日:2023年7月8日)