

## 次世代金融テクノロジー 株式ファンド 〈愛称〉 ブロックチェーン・金融革命

第1期（決算日 2020年1月28日）

### ■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	2019年1月30日から2026年1月28日まで	
運用方針	<p>①主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している次世代金融テクノロジー関連企業の株式（DR（預託証券）等を含みます。）※に分散投資を行います。</p> <p>※当ファンドにおいて次世代金融テクノロジー関連企業とは、金融とテクノロジーの融合によって生まれる新しい金融サービスを提供する企業や、こうしたサービスに不可欠となる技術や製品を提供する企業をいいます。</p> <p>②運用にあたっては、ニューバーガー・パーマン株式会社の投資助言をもとに、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメントが投資判断を行います。</p> <p>③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。</p>	
主要投資対象	次世代金融テクノロジー株式ファンド	次世代金融テクノロジー株式マザーファンド受益証券
	次世代金融テクノロジー株式マザーファンド	日本を含む世界の金融商品取引所に上場している株式
主な組入制限	次世代金融テクノロジー株式ファンド	<p>①株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p>
	次世代金融テクノロジー株式マザーファンド	<p>①株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>
分配方針	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当収入と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>②収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。</p>	

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、「次世代金融テクノロジー株式ファンド」は、このたび第1期の決算を行いましたので、運用状況をご報告申し上げます。今後とも引き続きお引立て賜りますようお願い申し上げます。



損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント

東京都中央区日本橋二丁目2番16号 共立日本橋ビル

URL <https://www.sjnk-am.co.jp/>

お問い合わせ先



クライアントサービス第二部 0120-69-5432

（受付時間 営業日の午前9時～午後5時）

## ○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	額			株式組入比率	投資信託組入比率	純資産額
		税金	騰落	騰落率			
(設定日)	円	円	円	%	%	百万円	
2019年1月30日	10,000	—	—	—	—	722	
1期(2020年1月28日)	13,208	0	32.1	90.7	3.0	4,041	

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 基準価額及び分配金は1万円当たり(以下同じ)。

(注3) 株式組入比率および投資信託証券組入比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注4) 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している次世代金融テクノロジー関連企業の株式(DR(預託証券)等を含みます。)に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	額			株式組入比率	投資信託組入比率	騰落率
		騰落	騰落率	騰落率			
(設定日)	円	円	%	%	%	%	
2019年1月30日	10,000	—	—	—	—	—	
1月末	10,000	0.0	2.8	—	—	—	
2月末	10,798	8.0	88.0	3.8	—	—	
3月末	11,118	11.2	90.4	2.9	—	—	
4月末	11,733	17.3	87.7	2.9	—	—	
5月末	11,241	12.4	91.0	2.9	—	—	
6月末	11,636	16.4	89.1	2.9	—	—	
7月末	12,123	21.2	92.0	3.1	—	—	
8月末	11,617	16.2	90.2	3.0	—	—	
9月末	11,613	16.1	92.0	3.1	—	—	
10月末	11,991	19.9	93.0	3.1	—	—	
11月末	12,499	25.0	92.8	3.1	—	—	
12月末	12,860	28.6	92.2	3.0	—	—	
(期末)							
2020年1月28日	13,208	32.1	90.7	3.0	—	—	

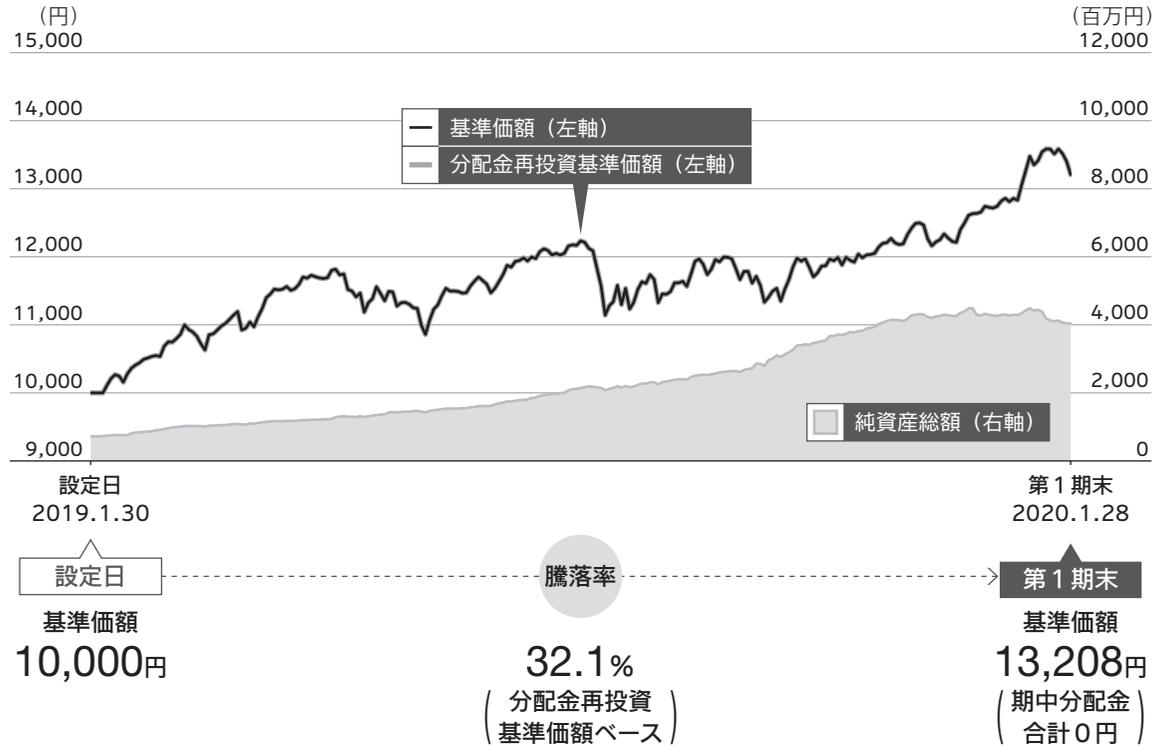
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比。

(注2) 株式組入比率および投資信託証券組入比率はマザーファンドへの投資割合に応じて算出された当ファンドベースの組入比率。

(注3) 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している次世代金融テクノロジー関連企業の株式(DR(預託証券)等を含みます。)に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## 運用経過

## ● 基準価額の推移



- 分配金再投資基準価額の推移は、設定時の基準価額（10,000円）をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 分配金再投資基準価額は、収益分配金（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。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- 当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している次世代金融テクノロジー関連企業の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ● 基準価額の主な変動要因

### 次世代金融テクノロジー株式ファンド

当期は、投資している次世代金融テクノロジー株式マザーファンドが上昇したため、当ファンドの基準価額も上昇しました。

### 次世代金融テクノロジー株式マザーファンド

期中の騰落率は+36.0%となりました。保有株式の上昇がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

● 本報告書では、ベビーファンドとマザーファンドを下記の様に統一して表記しています。

 ベビーファンド    マザーファンド

## ● 投資環境

### ○株式市場

グローバル株式市場は上昇しました。期初から2019年央にかけては、米国が中国製品への関税引き上げを打ち出したことで米中通商摩擦が再燃したことなどが嫌気され下落する場面もありましたが、米国と中国との通商交渉進展による貿易摩擦問題緩和への期待や、FRB（米連邦準備理事会）が利上げを見送りハト派的な姿勢が示され、利下げを織り込む動きが強まったことなどがポジティブな要因となり、堅調な展開となりました。

その後も、米国の企業決算発表に堅調な内容が多かったほか、米国による中国製品への関税引き上げが一部延期されるなど米中通商協議進展への期待が高まったことなどを背景に期末にかけて上昇基調が続きました。

### ○為替市場

為替市場は、米中通商摩擦への懸念から投資家センチメントが悪化したことに加えて、欧州や中国をはじめとして景気鈍化への懸念が強まったことで、米国金融政策について利下げへの期待が高まり米国金利の低下が進んだことなどを背景に、ドル円相場は2019年8月にかけて円高が進みました。一方その後は緩やかに円安に転じました。

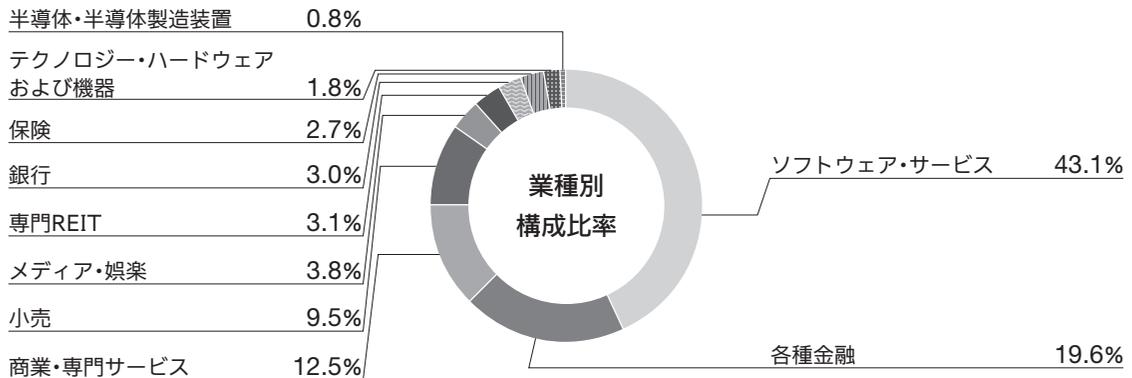
## ● 当該投資信託のポートフォリオ

期を通して次世代金融テクノロジー株式マザーファンドの組入比率を高位に維持しました。

### 次世代金融テクノロジー株式マザーファンド

期を通して株式および外国投資証券の組入比率を高位に維持しました。期末の組入比率は、96.6%です。

当ファンドは設定以降、速やかにポートフォリオを構築しました。主な銘柄としては、各種産業調査や金融情報などを提供するIHSマーケット（IHS Markit）、住宅ローン会社向けにIT支援サービスを提供するブラック・ナイト（Black Knight）、個人信用情報（クレジットスコア）提供会社であるトランスユニオン（TransUnion）等を購入しました。



注1. 比率は、第1期末における株式の評価総額に対する比率。

注2. 端数処理の関係上、構成比合計が100%にならない場合があります。

## ● 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している次世代金融テクノロジー関連企業の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ● 分配金

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、分配は行いませんでした。なお、収益分配に充てなかった収益は、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて引き続き元本と同一の運用を行います。

分配原資の内訳 (単位：円、1万口当たり・税引前)

項目	第1期 2019.1.30~2020.1.28
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	3,207

注1. 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

注2. 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税引前）に合致しない場合があります。

注3. 当期分配金の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、ファンドの収益率とは異なります。

中長期的な観点から、複利効果による資産の成長を目指すために分配を抑えるファンドです。

## ● 今後の運用方針

### 次世代金融テクノロジー株式ファンド

引き続き、次世代金融テクノロジー株式マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界の次世代金融テクノロジー関連企業の株式を主要な投資対象とし、信託財産の中長期的成長を目指します。

### 次世代金融テクノロジー株式マザーファンド

引き続き、普及が期待される次世代の金融サービスや、こうしたサービスに不可欠な技術や製品を提供することで高い成長が期待される世界の次世代金融テクノロジー関連企業を厳選し、分散投資を行うことで、信託財産の中長期的成長を目指します。

## ● 1万口当たりの費用明細

項目	第1期 2019.1.30~2020.1.28		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	207円	1.788%	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 (年率) × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は11,602円です。
( 投信会社 )	( 102 )	( 0.878 )	ファンドの運用の対価
( 販売会社 )	( 102 )	( 0.878 )	購入後の情報提供、運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
( 受託会社 )	( 4 )	( 0.033 )	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	32	0.272	(b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
( 株式 )	( 31 )	( 0.271 )	
( 投資信託証券 )	( 0 )	( 0.001 )	
(c) 有価証券取引税	6	0.054	(c) 有価証券取引税 = $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
( 株式 )	( 6 )	( 0.054 )	
( 投資信託証券 )	( 0 )	( 0.000 )	
(d) その他費用	12	0.102	(d) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
( 保管費用 )	( 11 )	( 0.091 )	有価証券等の保管等のために、海外の銀行等に支払う費用
( 監査費用 )	( 1 )	( 0.009 )	監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用
( その他 )	( 0 )	( 0.002 )	信託事務の処理にかかるその他の費用等
合計	257	2.216	

注1. 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

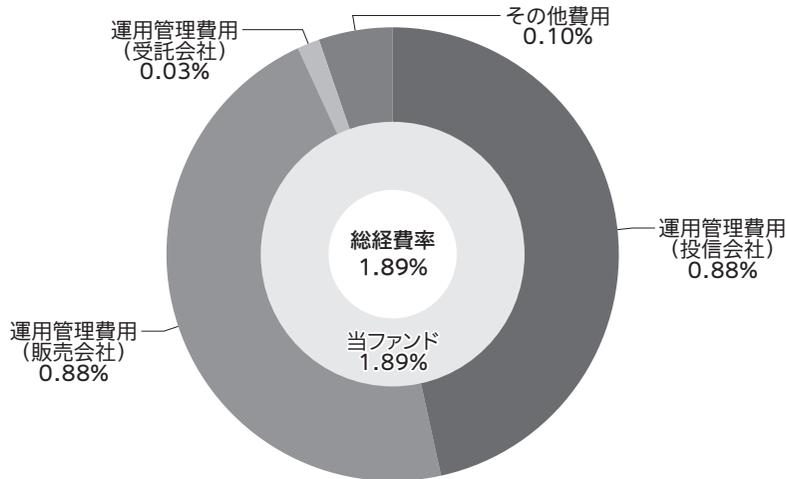
注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

注3. 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## (参考情報)

## ○総経費率

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1.89%**です。



注1. 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2. 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3. 各比率は、年率換算した値です。

注4. 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ます。

注5. 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

(2019年1月30日～2020年1月28日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
次世代金融テクノロジー株式マザーファンド	3,346,515 千口	3,843,381 千円	465,863 千口	633,240 千円

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 金額は受渡代金。

## ○株式売買比率

(2019年1月30日～2020年1月28日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	次世代金融テクノロジー株式マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	5,353,046千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,000,369千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.67	

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注3) 邦貨換算金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年1月30日～2020年1月28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。

## ○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2019年1月30日～2020年1月28日)

設定時残高 (元本)	当期設定 元本	当期解約 元本	期末残高 (元本)	取 引 理 由
万円 1,000	万円 -	万円 -	万円 1,000	当初設定時における取得

## ○組入資産の明細

(2020年1月28日現在)

## 親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
		千口	千円
次世代金融テクノロジー株式マザーファンド		2,880,651	3,917,397

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 当ファンドは、当期末において、直接投資をする株式及び新株予約権証券の組入はありません。

## ○投資信託財産の構成

(2020年1月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
次世代金融テクノロジー株式マザーファンド	3,917,397	95.0
コール・ローン等、その他	204,732	5.0
投資信託財産総額	4,122,129	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 次世代金融テクノロジー株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(3,734,227千円)の投資信託財産総額(3,917,372千円)に対する比率は、95.3%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、当期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.87円、1ユーロ=119.94円、1イギリス・ポンド=142.14円、1オーストラリア・ドル=73.49円、1香港・ドル=14.00円、1シンガポール・ドル=80.19円、1韓国・ウォン=0.0926円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年1月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,122,129,845
コール・ローン等	204,732,043
次世代金融テクノロジー株式会社マザーファンド(評価額)	3,917,397,802
(B) 負債	80,944,767
未払解約金	50,317,439
未払信託報酬	30,480,142
未払利息	409
その他未払費用	146,777
(C) 純資産総額(A-B)	4,041,185,078
元本	3,059,700,682
次期繰越損益金	981,484,396
(D) 受益権総口数	3,059,700,682口
1万円当たり基準価額(C/D)	13,208円

(注1) 信託財産に係る期首元本額722,722,371円、期中追加設定元本額3,390,718,493円、期中一部解約元本額1,053,740,182円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額 1.3208円

## ○損益の状況 (2019年1月30日～2020年1月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 68,793
支払利息	△ 68,793
(B) 有価証券売買損益	554,062,753
売買益	705,675,330
売買損	△151,612,577
(C) 信託報酬等	△ 42,069,938
(D) 当期損益金(A+B+C)	511,924,022
(E) 追加信託差損益金	469,560,374
(配当等相当額)	(△ 72,462)
(売買損益相当額)	( 469,632,836)
(F) 計(D+E)	981,484,396
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	981,484,396
追加信託差損益金	469,560,374
(配当等相当額)	( 1,959,790)
(売買損益相当額)	( 467,600,584)
分配準備積立金	511,924,022

(注1) 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2) 信託報酬等には、消費税相当額を含めて表示しております。

(注3) 追加信託差損益金とは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程(2019年1月30日～2020年1月28日)は以下の通りです。

項 目	2019年1月30日～ 2020年1月28日
a. 配当等収益(費用控除後)	14,743,529円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	497,180,493円
c. 信託約款に規定する収益調整金	469,560,374円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	0円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	981,484,396円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	3,207円
g. 分配金	0円

## ○お知らせ

・投資信託の監査にかかる費用を適切に反映させるため、2020年1月から、監査費用の徴収方法を変更することと致しました。

# 次世代金融テクノロジー株式会社マザーファンド

## 運用報告書

第1期（決算日 2020年1月28日）

＜計算期間 2019年1月30日～2020年1月28日＞

次世代金融テクノロジー株式会社マザーファンドの第1期の運用状況をご報告申し上げます。

### ■当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	無期限
運用方針	信託財産の中長期的な成長を図ることを目的とします。
主要投資対象	日本を含む世界の金融商品取引所に上場している株式
主な組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

### ○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		株 組 入 比	式 率	投 証 資 信 託 純 資 産 組 入 比 率 総 額	純 資 産 額
		期 騰 落	中 率				
(設定日)	円		%		%	%	百万円
2019年1月30日	10,000		—		—	—	711
1期(2020年1月28日)	13,599		36.0	93.6		3.1	3,917

(注1) 基準価額は1万円当たり（以下同じ）。

(注2) 当ファンドは、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している次世代金融テクノロジー関連企業の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年	月	日	基 準	価 額		株 組	入 比	式 率	投 証 組	資 入 比	信 託 券 率
				騰 落	率						
		(設定日)	円		%			%			%
		2019年1月30日	10,000		—			—			—
		1月末	10,001		0.0			2.8			—
		2月末	10,865		8.7			88.9			3.8
		3月末	11,205		12.1			94.5			3.1
		4月末	11,867		18.7			90.6			3.0
		5月末	11,346		13.5			94.7			3.0
		6月末	11,787		17.9			95.0			3.1
		7月末	12,341		23.4			94.9			3.2
		8月末	11,799		18.0			94.2			3.1
		9月末	11,820		18.2			94.1			3.1
		10月末	12,256		22.6			94.3			3.1
		11月末	12,813		28.1			94.5			3.2
		12月末	13,215		32.2			95.0			3.1
		(期 末)									
		2020年1月28日	13,599		36.0			93.6			3.1

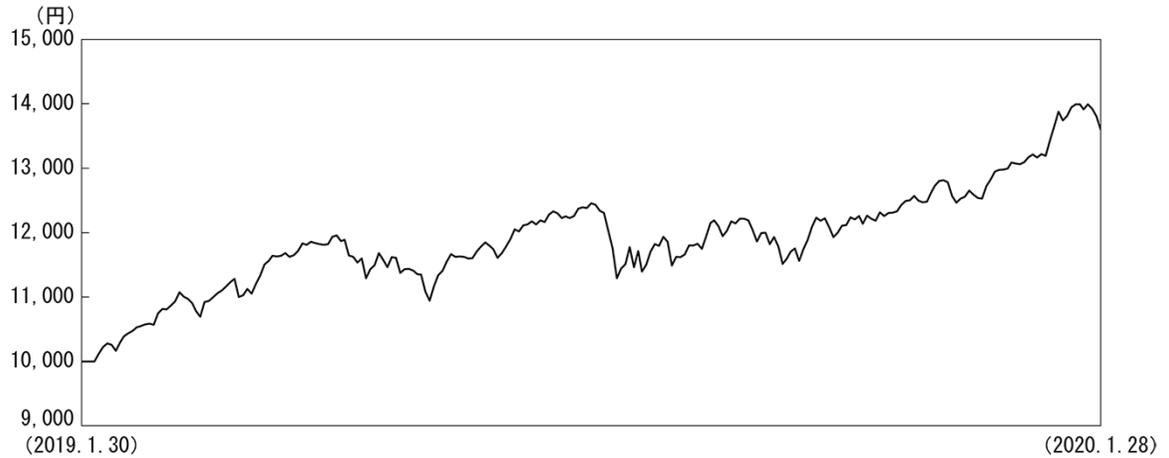
(注1) 騰落率は設定日比。

(注2) 当ファンドは、主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場している次世代金融テクノロジー関連企業の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行います。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は記載しておりません。

## ○運用経過

(2019年1月30日～2020年1月28日)

## ■基準価額の推移



設定日：10,000円  
期 末：13,599円  
騰落率： 36.0%

P 2～P 7をご参照下さい。

## ○1万口当たりの費用明細

(2019年1月30日~2020年1月28日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	円 33 (33) (0)	% 0.281 (0.280) (0.001)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	7 (7) (0)	0.056 (0.056) (0.000)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	11 (11) (0)	0.096 (0.094) (0.002)	(c) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券等の保管等のために、海外の銀行等に支払う費用 信託事務の処理にかかるその他の費用等
合 計	51	0.433	
期中の平均基準価額は11,776円です。			

(注1) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## ○売買及び取引の状況

(2019年1月30日～2020年1月28日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上場	千株 47	千円 112,612	千株 8	千円 19,981
外	アメリカ	百株 3,727 ( 120)	千アメリカ・ドル 28,085 ( -)	百株 1,404 ( 0.01)	千アメリカ・ドル 8,672 ( -)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	イタリア	526	548	90	110
	フランス	233	1,153	39	226
	オランダ	144	1,303	22	249
国	イギリス	735	千イギリス・ポンド 417	171	千イギリス・ポンド 100
	オーストラリア	111	千オーストラリア・ドル 866	18	千オーストラリア・ドル 154
	香港	4,881	千香港・ドル 17,380	823	千香港・ドル 2,518
	シンガポール	439	千シンガポール・ドル 1,105	56	千シンガポール・ドル 145
	韓国	572	千韓国・ウォン 2,061,001	100	千韓国・ウォン 528,580

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(注3) ( ) 内は、株式分割、株式転換、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## 投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外国	アメリカ EQUINIX INC	口 2,560	千アメリカ・ドル 1,244	口 710	千アメリカ・ドル 378

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ○株式売買比率

(2019年1月30日～2020年1月28日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	5,353,046千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,000,369千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.67

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注3) 邦貨換算金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年1月30日～2020年1月28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

(2020年1月28日現在)

## 国内株式

銘 柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
証券、商品先物取引業 (100.0%)	千株	千円
SBIホールディングス	39.4	94,441
合 計	株 数 ・ 金 額 39	94,441
	銘 柄 数 < 比 率 >	< 2.4% >

(注1) 銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注2) 合計欄の&lt; &gt;内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## 外国株式

銘柄	株数	当期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MOODY'S CORP	14	380	41,384	各種金融
SALESFORCE.COM INC	66	1,196	130,241	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	13	722	78,697	各種金融
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	106	1,554	169,256	ソフトウェア・サービス
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	126	1,243	135,427	各種金融
MASTERCARD INC-CLASS A	23	751	81,819	ソフトウェア・サービス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	56	725	79,038	ソフトウェア・サービス
MSCI INC	25	709	77,243	各種金融
VISA INC-CLASS A SHARES	70	1,411	153,705	ソフトウェア・サービス
EPAM SYSTEMS INC	32	741	80,756	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	26	541	58,916	ソフトウェア・サービス
CORELOGIC INC	125	573	62,455	ソフトウェア・サービス
WEX INC	55	1,247	135,854	ソフトウェア・サービス
ANAPLAN INC	64	366	39,912	ソフトウェア・サービス
BLACK KNIGHT INC	204	1,331	144,998	ソフトウェア・サービス
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	60	1,238	134,888	小売
TRANSUNION	159	1,474	160,515	商業・専門サービス
SQUARE INC-A	72	515	56,080	ソフトウェア・サービス
S&P GLOBAL INC	25	732	79,782	各種金融
AMAZON.COM INC	4	747	81,412	小売
APPLE INC	6	203	22,199	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INTUIT INC	43	1,237	134,693	ソフトウェア・サービス
XILINX INC	28	278	30,308	半導体・半導体製造装置
MERCADOLIBRE INC	7	477	51,965	小売
VERISK ANALYTICS INC	29	482	52,476	商業・専門サービス
IHS MARKIT LTD	187	1,487	161,932	商業・専門サービス
LEXINFINTECH HOLDINGS LTD ADR	726	1,014	110,415	各種金融
DOCUSIGN INC	69	502	54,744	ソフトウェア・サービス
LENDING TREE INC	10	311	33,906	銀行
小計	株数・金額	2,442	24,203	2,635,027
	銘柄数<比率>	29	-	<67.3%>
(ユーロ…イタリア)			千ユーロ	
NEXI SPA	435	552	66,275	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	435	552	66,275
	銘柄数<比率>	1	-	<1.7%>
(ユーロ…フランス)				
EDENRED	88	426	51,209	商業・専門サービス
WORLDLINE SA	104	691	82,928	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	193	1,118	134,138
	銘柄数<比率>	2	-	<3.4%>
(ユーロ…オランダ)				
PROSUS NV	115	753	90,380	小売
ADYEN NV	5	443	53,233	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	121	1,197	143,613
	銘柄数<比率>	2	-	<3.7%>
ユーロ計	株数・金額	750	2,868	344,027
	銘柄数<比率>	5	-	<8.8%>

銘柄	株数	当期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス) NETWORK INTERNATIONAL HOLDIN	百株 564	千イギリス・ポンド 318	千円 45,319	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 564	318	45,319	
	銘柄数<比率>	1	<1.2%>	
(オーストラリア) ASX LTD	93	千オーストラリア・ドル 795	58,432	各種金融
小計	株数・金額 93	795	58,432	
	銘柄数<比率>	1	<1.5%>	
(香港) PING AN INSURANCE GROUP CO-H CHINA RENAISSANCE HOLDINGS LIMITED TENCENT HOLDINGS LTD	780 3,195 83	千香港・ドル 7,398 4,683 3,202	103,576 65,574 44,829	保険 各種金融 メディア・娯楽
小計	株数・金額 4,058	15,284	213,980	
	銘柄数<比率>	3	<5.5%>	
(シンガポール) DBS GROUP HOLDINGS LTD	383	千シンガポール・ドル 1,003	80,467	銀行
小計	株数・金額 383	1,003	80,467	
	銘柄数<比率>	1	<2.1%>	
(韓国) NICE INFORMATION SERVICE CO NAVER CORP SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	330 59 82	千韓国・ウォン 508,585 1,085,922 502,572	47,094 100,556 46,538	商業・専門サービス メディア・娯楽 テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額 472	2,097,079	194,189	
	銘柄数<比率>	3	<5.0%>	
合計	株数・金額 8,764	—	3,571,444	
	銘柄数<比率>	43	<91.2%>	

(注1) 邦貨換算金額は期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。

(注2) 邦貨換算金額の< >内は純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切捨て。

## 外国投資信託証券

銘柄	口数	当期末		比率
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) EQUINIX INC	口 1,850	千アメリカ・ドル 1,098	千円 119,627	% 3.1
合計	口数・金額 1,850	1,098	119,627	
	銘柄数<比率>	1	<3.1%>	

(注1) 邦貨換算金額は期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。

(注2) 比率は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2020年1月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	3,665,886	93.6
投資証券	119,627	3.1
コール・ローン等、その他	131,859	3.3
投資信託財産総額	3,917,372	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産(3,734,227千円)の投資信託財産総額(3,917,372千円)に対する比率は、95.3%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、当期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.87円、1ユーロ=119.94円、1イギリス・ポンド=142.14円、1オーストラリア・ドル=73.49円、1香港・ドル=14.00円、1シンガポール・ドル=80.19円、1韓国・ウォン=0.0926円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年1月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,917,372,823
コール・ローン等	131,502,422
株式(評価額)	3,665,886,004
投資証券(評価額)	119,627,172
未収配当金	357,225
(B) 負債	177
未払利息	177
(C) 純資産総額(A-B)	3,917,372,646
元本	2,880,651,373
次期繰越損益金	1,036,721,273
(D) 受益権総口数	2,880,651,373口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,599円

(注1) 信託財産に係る期首元本額711,881,535円、期中追加設定元本額2,634,633,525円、期中一部解約元本額465,863,687円

(注2) 期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託ごとの元本の内訳

次世代金融テクノロジー株式会社マザーファンド 2,880,651,373円

(注3) 期末における1口当たりの純資産総額 1.3599円

## ○損益の状況 (2019年1月30日～2020年1月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	16,082,424
受取配当金	16,112,546
支払利息	△ 30,122
(B) 有価証券売買損益	693,186,050
売買益	726,832,614
売買損	△ 33,646,564
(C) 保管費用等	△ 2,037,363
(D) 当期損益金(A+B+C)	707,231,111
(E) 追加信託差損益金	496,866,475
(F) 解約差損益金	△ 167,376,313
(G) 計(D+E+F)	1,036,721,273
次期繰越損益金(G)	1,036,721,273

(注1) 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2) 追加信託差損益金とは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) 解約差損益金とは、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。