

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド （円ヘッジなし）

最終期（償還日 2024年6月4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	2021年9月30日から2024年6月4日まで （当初、2031年9月30日まででしたが、2023年12月末に無期限化していました。）	
運用方針	<p>①SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド（以下「親投資信託」といいます。）受益証券を通じて、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金融機関の株式（DR（預託証券）等を含みます。）に分散投資を行い、中長期的な信託財産の成長を目指します。</p> <p>②親投資信託の組入比率は、原則として高位を基本とします。</p> <p>③親投資信託における株式等の運用指図に関する権限をアルジェブリス・インベストメンツ（US）インクに委託します。</p> <p>④実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</p>	
主要投資対象	SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし）	SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド受益証券
	SOMPOアルジェブリス・グローバル金融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金融機関の株式
主な組入制限	SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし）	<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>
	SOMPOアルジェブリス・グローバル金融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、「SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし）」は、信託約款の規定に基づき、2024年6月4日をもちまして繰上償還いたしました。ここに謹んで設定以来の運用状況と償還の内容をご報告申し上げます。
今後とも当社商品につきお引立て賜りますようお願い申し上げます。



SOMPO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



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

お問い合わせ先



リテール営業部 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 (分配額)	基準価額			株式組入比率	投資信託証券組入比率	純資産額
		税金	騰落	騰落率			
(設定日) 2021年9月30日	円 銭 10,000	円	円	%	%	%	百万円 81
1期(2022年9月30日)	11,288	0	12.9	76.1	0.7	577	
2期(2023年10月2日)	14,839	0	31.5	79.3	0.9	342	
(償還時)	(償還価額)	—	28.5	—	—	251	
3期(2024年6月4日)	19,065.58	—	28.5	—	—	251	

(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1万口当たり（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金融機関の株式（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いません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	基準価額		株式組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落	騰落率		
(期首) 2023年10月2日	円 銭 14,839	円	%	%	%
10月末	14,154	△	4.6	82.1	0.7
11月末	15,201		2.4	78.7	0.9
12月末	15,375		3.6	77.4	1.0
2024年1月末	16,024		8.0	75.2	0.5
2月末	16,580		11.7	74.1	0.5
3月末	18,055		21.7	74.0	0.6
4月末	18,680		25.9	70.3	0.6
5月末	19,071		28.5	—	—
(償還時) 2024年6月4日	(償還価額) 19,065.58		28.5	—	—

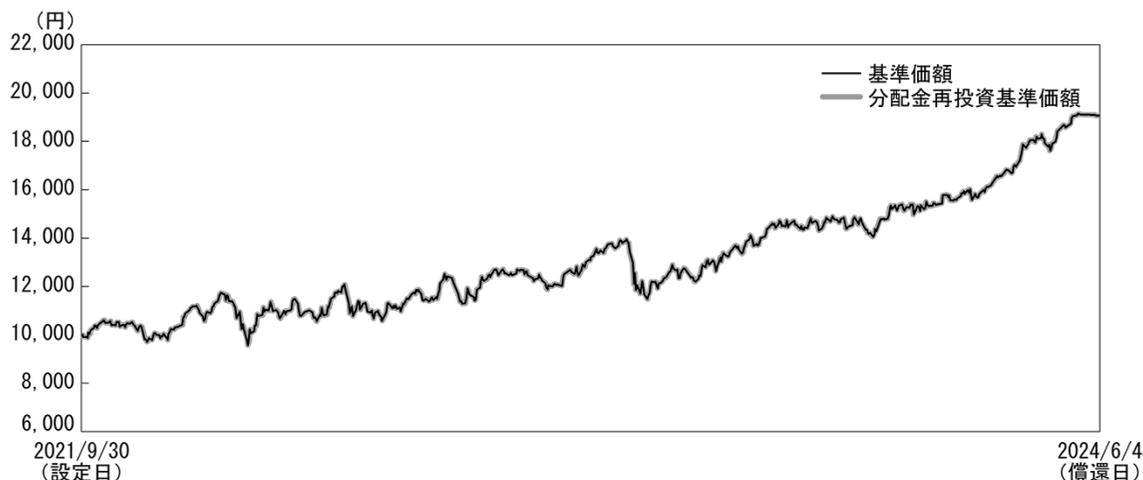
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(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金融機関の株式（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いません。

設定以来の運用経過（2021年9月30日（設定日）～2024年6月4日（償還日））

■基準価額の推移



設定日：10,000円

償還日：19,065円58銭（期中分配金合計0円）

騰落率：90.7%（分配金再投資基準価額ベース）

- ・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金融機関の株式（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

（SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし））

期を通して、投資しているSOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドが上昇したことにより、当ファンドの基準価額も上昇しました。

（SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド）

設定来の騰落率は+104.5%となりました。主要中央銀行による高金利環境などを背景に、金融株式が堅調に推移したことに加え、円安が進行したことなどがプラスに寄与しました。

■投資環境

○株式市場

2022年9月にかけて、米国をはじめ各国がインフレ抑制を優先課題とし、金融緩和から金融引き締めへと舵を切ったことで、株価は軟調に推移しました。2023年3月に、米シリコンバレー銀行の破綻など、米国中堅銀行に対する経営不安が高まったことに加え、クレディ・スイス・グループが経営危機に陥ったことを背景に株式市場が調整する局面もありましたが、各国金融当局が迅速に対応したことで投資家心理が改善しました。2023年11月には、FRB（米連邦準備理事会）の金融政策の転換に対する期待が高まり、12月にはFOMC（米連邦公開市場委員会）において、2024年の政策金利見通しの引き下げや利下げ議論も開始されたことで、米国金利の低下を背景に株式市場は上昇しました。その後2024年5月にかけて、利下げ期待とFRB高官による利下げに対する慎重発言などが交錯しながらも、堅調な米国経済や企業決算を材料に、株式市場は上昇基調となりました。

○為替市場

2022年9月にかけては、徐々に各国がインフレへの警戒を強めて金融引き締めへと舵を切る中、日本と海外の金融政策の格差が意識され、総じて円安が進行しました。2022年10月以降は、日本当局の為替介入により、円高ドル安が進行し2023年1月に一時ドル円が130円割れまで円高となりましたが、その後、米国の金融引き締めの長期化観測などを受け円安ドル高が進行しました。2023年11月から12月にかけて米国利下げ期待から円高ドル安基調に転じたものの、2024年1月以降、円安ドル高が進行し4月に一時1ドル160円台となりました。日本当局の為替介入もありましたが、その後再度円安ドル高基調となりました。

■当該投資信託のポートフォリオ

期を通してSOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドの組入比率を高位に維持しました。その後、当ファンドの繰上償還に向けて、マザーファンドを全売却しました。

（SOMPOアルジェブリス・グローバル金融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た後、当ファンドの繰上償還に向けて、キャッシュ化を進めました。

■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金融機関の株式（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。

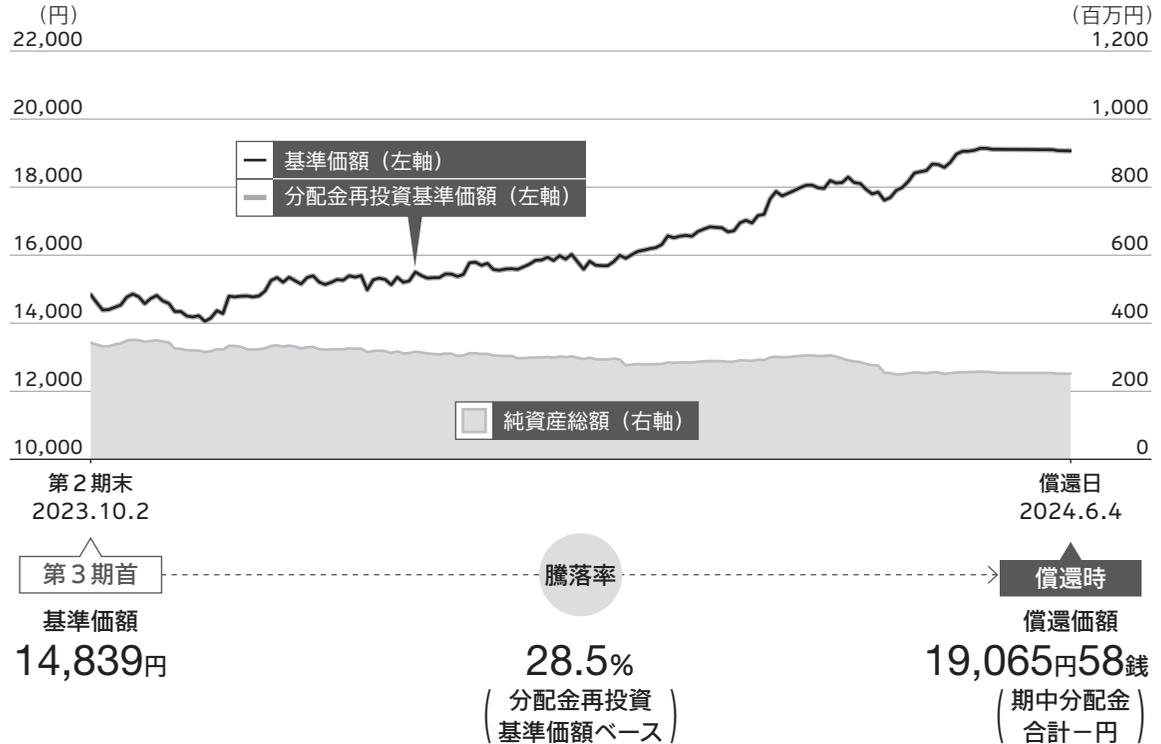
■分配金

収益分配金については、基準価額の水準等を勘案し、全運用期間を通じて分配を行いませんでした。

最終期の運用経過（2023年10月3日～2024年6月4日（償還日））

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、2023年10月2日の基準価額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金融機関の株式（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

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし）

当期は、投資しているSOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドが上昇したことにより、当ファンドの基準価額も上昇しました。

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド

期中の騰落率は+31.0%となりました。主要中央銀行による高金利環境などを背景に、金融株式が堅調に推移したことに加え、円安が進行したことなどがプラスに寄与しました。

- 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

2023年10月は、中東地域の紛争拡大や米国長期金利の上昇を背景に、株式市場は下落しました。11月に入りFRB（米連邦準備理事会）の金融政策の転換に対する期待が高まり、米国金利が低下に転じる中、株式市場は上昇しました。12月は、FOMC（米連邦公開市場委員会）において、2024年の政策金利の見通しが引き下げられ、利下げ議論が開始されたことを受け米国金利が低下し、株式市場は上昇しました。2024年1月に入り、FRB高官が早期利下げの織り込みを牽制する発言から米国金利は上昇しましたが、株式市場は堅調な決算発表等を好感し底堅く推移しました。2月はFRBの利下げへの継続的な期待を背景に株式市場は上昇し、3月は複数の米国経済指標が予想よりも強い景気を示唆する中、米国長期金利が上昇しましたが、FRB議長が改めて年内利下げの可能性を示し、投資家心理の改善から株式市場は上昇しました。4月は、市場予想を上回る米労働市場の強さが示された他、FRB高官による利下げに対する慎重発言が相次ぎ、米国長期金利が上昇し、株式市場は下落しました。5月は、市場予想を下回る米国経済指標を背景に政策金利引き下げ期待が高まったことなどから株式市場は上昇しました。

○為替市場

ドル円相場は、2023年12月にかけて米国利下げ期待が高まったことなどから、円高ドル安基調となりました。2024年1月以降も日米金利が主な材料となり、日銀の金融政策正常化観測が醸成される一方、米国の利下げ先送り観測が台頭する中、円安ドル高が進行し、4月に一時1ドル160円台となりました。その後、日本当局の為替介入もあり円高ドル安局面となりましたが、5月後半には米国金利が反発する中、再度円安ドル高基調となりました。

● 当該投資信託のポートフォリオ

期を通してSOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドの組入比率を高位に維持しました。その後、当ファンドの繰上償還に向けて、マザーファンドを全売却しました。



SOMPOアルジェブリス・グローバル金融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た後、当ファンドの繰上償還に向けて、キャッシュ化を進めました。

● 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金融機関の株式（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

該当事項はありません。

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。

<償還を迎えて>

当ファンドは、2024年6月4日をもちまして信託期間を終了し、繰上償還とさせていただくこととなりました。受益者の皆様のご愛顧に心より御礼を申し上げます。誠にありがとうございました。

● 1万口当たりの費用明細

項目	最終期 2023.10.3~2024.6.4		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	223円	1.338%	(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16,642円です。
（投信会社）	(130)	(0.784)	ファンドの運用の対価
（販売会社）	(89)	(0.532)	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)	(0.022)	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	21	0.128	(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）	(21)	(0.127)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	22	0.131	(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）	(22)	(0.131)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	262	1.577	(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）	(261)	(1.566)	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)	(0.008)	監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用
（その他）	(1)	(0.004)	信託事務の処理にかかるその他の費用等
合計	528	3.174	

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。

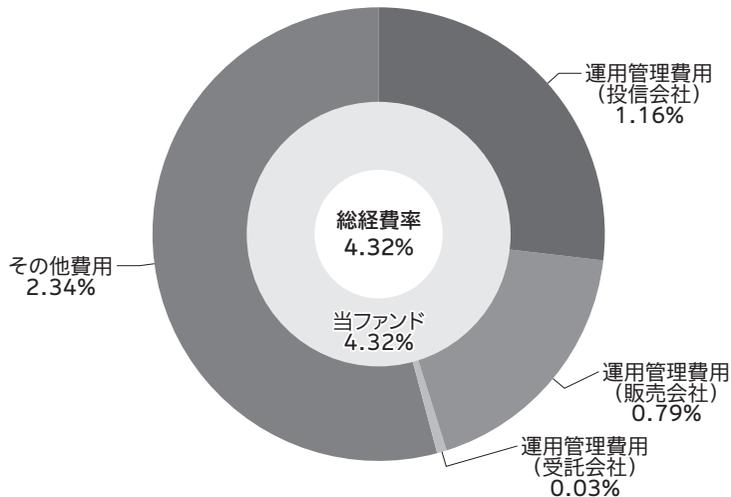
注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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4.32%**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

(2023年10月3日～2024年6月4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
SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 216,634	千円 414,104

(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

(2023年10月3日～2024年6月4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
	SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	851,025千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	227,832千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	3.73

(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

(2023年10月3日～2024年6月4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

(2023年10月3日～2024年6月4日)

期首残高 (元本)	当期設定 元本	当期解約 元本	期末残高 (元本)	取 引 の 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

（2024年6月4日現在）

2024年6月4日現在、有価証券等の組入れはございません。

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	
		口	数
SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンド			千口 216,634

（注）単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

（2024年6月4日現在）

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 254,021	% 100.0
投資信託財産総額	254,021	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況（2024年6月4日現在）

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	254,021,646
コール・ローン等	254,021,577
未収利息	69
(B) 負債	2,494,169
未払解約金	1,580,727
未払信託報酬	913,442
(C) 純資産総額(A - B)	251,527,477
元本	131,927,518
償還差益金	119,599,959
(D) 受益権総口数	131,927,518口
1万口当たり償還価額(C / D)	19,06558円58銭

（注1）信託財産に係る期首元本額230,761,530円、期中追加設定元本額11,399,273円、期中一部解約元本額110,233,285円

（注2）償還時における1口当たりの純資産総額 1.906558円

○損益の状況

（2023年10月3日～2024年6月4日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 778
受取利息	172
支払利息	△ 950
(B) 有価証券売買損益	59,595,432
売買益	74,794,522
売買損	△ 15,199,090
(C) 信託報酬等	△ 4,030,263
(D) 当期損益金(A + B + C)	55,564,391
(E) 前期繰越損益金	36,536,486
(F) 追加信託差損益金	27,499,082
(配当等相当額)	(7,744,278)
(売買損益相当額)	(19,754,804)
償還差益金(D + E + F)	119,599,959

（注1）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）SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドの信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の72の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2021年9月30日			投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024年6月4日			資産総額	254,021,646円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	2,494,169円	
				純資産総額	251,527,477円	
受益権口数	81,420,000口	131,927,518口	50,507,518口	受益権口数	131,927,518口	
元本額	81,420,000円	131,927,518円	50,507,518円	1万口当たり償還金	19,065円58銭	
毎計算期末の状況						
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金		
				金額	分配率	
第1期	511,700,353円	577,602,497円	11,288円	0円	0%	
第2期	230,761,530	342,421,587	14,839	0	0	

○償還金のお知らせ

1万口当たり償還金（税込み）	19,065円58銭
----------------	------------

○お知らせ

- ・信託期間を無期限に変更するため、投資信託約款に所要の変更を致しました（2023年12月29日）。

<訂正のお知らせとお詫び>

○「SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド（円ヘッジなし）」の第1期（2022年9月30日決算）の運用報告書（全体版）の記載内容の一部に誤りがございました。訂正内容をお知らせ致しますとともに、今回の不手際につきましては、誠に申し訳なく深くお詫び申し上げます。

<訂正箇所> <○自社による当ファンドの設定・解約状況>（9頁）の表

<訂正内容> （点線で囲ったところが訂正部分です。）

【正】

<○自社による当ファンドの設定・解約状況>

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2021年9月30日～2022年9月30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）	取引の理由
万円 〔6,000〕	万円 —	万円 〔5,000〕	万円 1,000	当初設定時における取得とその処分

【誤】

<○自社による当ファンドの設定・解約状況>

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2021年9月30日～2022年9月30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）	取引の理由
万円 〔1,000〕	万円 —	万円 〔—〕	万円 1,000	当初設定時における取得

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式 マザーファンド

繰上償還 運用報告書

最終期（償還日 2024年6月3日）

＜計算期間 2023年10月3日～2024年6月3日＞

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式マザーファンドの設定以来の運用状況と償還の内容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	2021年9月30日から2024年6月3日まで（当初、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機関の株式
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	騰落率	株組入比率	投資信託証券比率	純資産額
(設定日) 2021年9月30日	円 銭 10,000	% —	% —	% —	百万円 78
1期(2022年9月30日)	11,538	15.4	79.8	0.8	550
2期(2023年10月2日)	15,610	35.3	80.3	0.9	338
(償還時) 3期(2024年6月3日)	(償還価額) 20,445.03	31.0	—	—	245

(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金融機関の株式（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

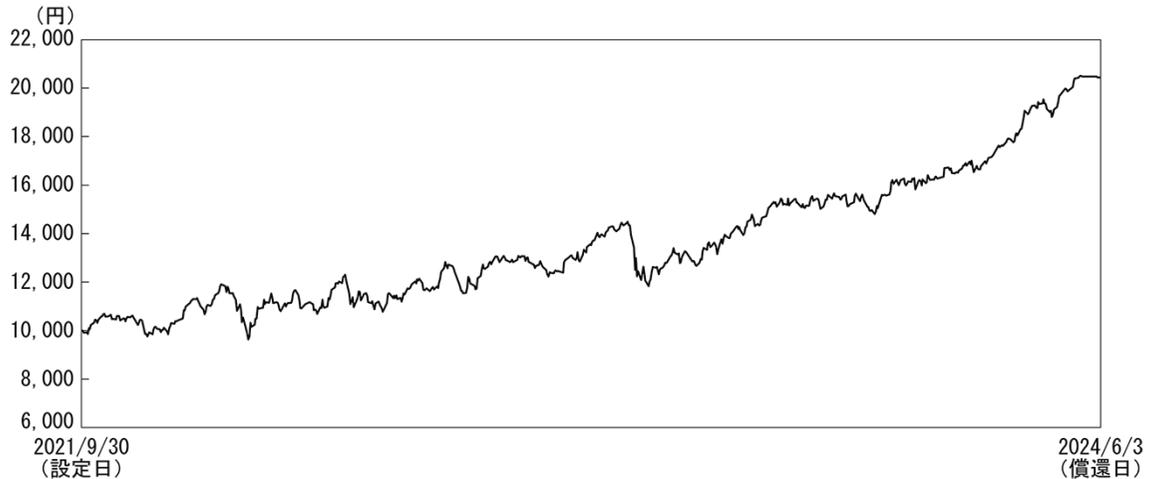
年	月	日	基 準 価 額	騰 落 率		株 組 入 比	式 率	投 証 組 入 比	信 託 券 率
	(期 首)		円 銭		%		%		%
	2023年10月	2日	15,610		—		80.3		0.9
	10月末		14,909	△	4.5		82.2		0.8
	11月末		16,063		2.9		79.6		1.0
	12月末		16,274		4.3		77.6		1.0
	2024年1月	末	17,007		8.9		77.4		0.5
	2月	末	17,642		13.0		75.9		0.5
	3月	末	19,269		23.4		76.1		0.6
	4月	末	19,979		28.0		71.0		0.6
	5月	末	20,445		31.0		—		—
	(償還時)		(償還価額)						
	2024年6月	3日	20,445.03		31.0		—		—

(注1) 騰落率は期首比。

(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金融機関の株式（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。

設定以来の運用経過（2021年9月30日（設定日）～2024年6月3日（償還日））

■ 基準価額の推移



設定日：10,000円
償還日：20,445円03銭
騰落率：104.5%

■ 基準価額の主な変動要因

設定来の騰落率は+104.5%となりました。主要中央銀行による高金利環境などを背景に、金融株式が堅調に推移したことに加え、円安が進行したことなどがプラスに寄与しました。

■投資環境

○株式市場

2022年9月にかけて、米国をはじめ各国がインフレ抑制を優先課題とし、金融緩和から金融引き締めへと舵を切ったことで、株価は軟調に推移しました。2023年3月に、米シリコンバレー銀行の破綻など、米国中堅銀行に対する経営不安が高まったことに加え、クレディ・スイス・グループが経営危機に陥ったことを背景に株式市場が調整する局面もありましたが、各国金融当局が迅速に対応したことで投資家心理が改善しました。2023年11月には、FRB（米連邦準備理事会）の金融政策の転換に対する期待が高まり、12月にはFOMC（米連邦公開市場委員会）において、2024年の政策金利見通しの引き下げや利下げ議論も開始されたことで、米国金利の低下を背景に株式市場は上昇しました。その後2024年5月にかけて、利下げ期待とFRB高官による利下げに対する慎重発言などが交錯しながらも、堅調な米国経済や企業決算を材料に、株式市場は上昇基調となりました。

○為替市場

2022年9月にかけては、徐々に各国がインフレへの警戒を強めて金融引き締めへと舵を切る中、日本と海外の金融政策の格差が意識され、総じて円安が進行しました。2022年10月以降は、日本当局の為替介入により、円高ドル安が進行し2023年1月に一時ドル円が130円割れまで円高となりましたが、その後、米国の金融引き締めの長期化観測などを受け円安ドル高が進行しました。2023年11月から12月にかけて米国利下げ期待から円高ドル安基調に転じたものの、2024年1月以降、円安ドル高が進行し4月に一時1ドル160円台となりました。日本当局の為替介入もありましたが、その後再度円安ドル高基調となりました。

■当該投資信託のポートフォリオ

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た後、当ファンドの繰上償還に向けて、キャッシュ化を進めました。

■当該投資信託のベンチマークとの差異

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金融機関の株式（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。

<償還を迎えて>

当ファンドは、2024年6月3日をもちまして信託期間を終了し、繰上償還とさせていただくこととなりました。受益者の皆様のご愛顧に心より御礼を申し上げます。誠にありがとうございました。

○1万口当たりの費用明細

(2023年10月3日~2024年6月3日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	23	0.129	(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
(株 式)	(23)	(0.129)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	23	0.133	(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
(株 式)	(23)	(0.133)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	281	1.590	(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
(保 管 費 用)	(281)	(1.587)	
(そ の 他)	(1)	(0.003)	
合 計	327	1.852	
期中の平均基準価額は17,698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

(2023年10月3日～2024年6月3日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上場	千株 1	千円 6,456	千株 1	千円 7,459
外 国	アメリカ	百株 301	千アメリカ・ドル 779	百株 484	千アメリカ・ドル 1,520
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	40	65	120	167
	イタリア	239	97	603	309
	フランス	27	62	65	224
	オランダ	25	31	93	131
	スペイン	480	108	1,287	335
	ベルギー	4	26	4	31
	アイルランド	89	57	178	125
	ギリシャ	241	50	388	96
	イギリス	823	千イギリス・ポンド 217	2,039	千イギリス・ポンド 557
	スウェーデン	8	千スウェーデン・クローナ 108	8	千スウェーデン・クローナ 113
	ノルウェー	4	千ノルウェー・クローネ 105	4	千ノルウェー・クローネ 100
	香港	38	千香港・ドル 324	38	千香港・ドル 367
韓国	—	千韓国・ウォン —	16	千韓国・ウォン 83,605	

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

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 ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	口 360	千アメリカ・ドル 6	口 1,416	千アメリカ・ドル 27

(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

(2023年10月3日～2024年6月3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	851,025千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	227,832千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	3.73

(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

(2023年10月3日～2024年6月3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6月3日現在)

2024年6月3日現在、有価証券等の組入れはございません。

外国株式

銘柄	期首(前期末)	
	株	数
(アメリカ)		百株
BANK OF NEW YORK CO INC	6	
FEDERATED HERMES INC	11	
CITIGROUP INC	17	
M & T BANK CORP	2	
FIRST HORIZON CORP	16	
UNUM GROUP	11	
EVEREST GROUP LTD	0.43	
WELLS FARGO COMPANY	5	
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	1	
WEBSTER FINANCIAL CORP	10	
Q2 HOLDINGS INC	12	
EQUITABLE HOLDINGS INC	18	
GUILD HOLDINGS CO - CLASS A	15	
STELLAR BANCORP INC	8	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	14	
FIRST BANCSHARES INC/MS	3	
BANNER CORPORATION	3	
POPULAR INC	5	
SEACOAST BANKING CORP/FL	5	
JAMES RIVER GROUP HOLDINGS L	11	
小計	株数	182
	銘柄数	20
(ユーロ…ドイツ)		
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	51	
COMMERZBANK AG	28	
小計	株数	79
	銘柄数	2
(ユーロ…イタリア)		
INTESA SANPAOLO	103	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	166	
ANIMA HOLDING SPA	67	
UNICREDIT SPA EUR	27	
小計	株数	363
	銘柄数	4
(ユーロ…フランス)		
SOCIETE GENERALE-A	22	
BNP PARIBAS	15	
小計	株数	38
	銘柄数	2
(ユーロ…オランダ)		
ABN AMRO BANK NV-CVA	33	
ING GROEP N.V.	34	
小計	株数	67
	銘柄数	2

銘柄	期首(前期末)	
	株	数
(ユーロ…スペイン)		百株
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	45	
BANCO SANTANDER SA	230	
BANCO DE SABADELL SA	530	
小計	株数	806
	銘柄数	3
(ユーロ…アイルランド)		
BANK OF IRELAND GROUP PLC	39	
AIB GROUP PLC	49	
小計	株数	89
	銘柄数	2
(ユーロ…ギリシャ)		
NATIONAL BANK OF GREECE	28	
ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	119	
小計	株数	147
	銘柄数	2
ユーロ計	株数	1,593
	銘柄数	17
(イギリス)		
STANDARD CHARTERED PLC GBP	68	
HSBC HOLDINGS PLC	48	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	210	
BARCLAYS PLC	439	
LANCASHIRE HOLDINGS LTD	60	
NATWEST GROUP PLC	108	
MAN GROUP PLC/JERSEY	73	
M&G PLC	125	
CONDUIT HOLDINGS LTD	15	
BEAZLEY PLC	65	
小計	株数	1,215
	銘柄数	10
(韓国)		
HANA FINANCIAL GROUP INC	7	
KB FINANCIAL GROUP INC	9	
小計	株数	16
	銘柄数	2
合計	株数	3,007
	銘柄数	49

(注) 株数の単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

外国投資信託証券

銘	柄	期首(前期末)	
		口	数
(アメリカ) ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN			口 1,056
合 計		口 銘	数 柄 1,056 1

○投資信託財産の構成

(2024年6月3日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 245,904	% 100.0
投資信託財産総額	245,904	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2024年6月3日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	245,904,631
コール・ローン等	245,904,564
未収利息	67
(B) 負債	0
(C) 純資産総額(A-B)	245,904,631
元本	120,275,970
償還差益金	125,628,661
(D) 受益権総口数	120,275,970口
1万口当たり償還価額(C/D)	20,445円03銭

(注1) 信託財産に係る期首元本額216,634,693円、期中追加設定元本額0円、期中一部解約元本額96,358,723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

SOMPOアルジェブリス・グローバル金融株式ファンド(円ヘッジなし) 120,275,970円

(注3) 償還時における1口当たりの純資産総額 2.044503円

○損益の状況

(2023年10月3日~2024年6月3日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	6,801,213
受取配当金	6,800,651
受取利息	1,386
その他収益金	324
支払利息	△ 1,148
(B) 有価証券売買損益	73,815,051
売買益	83,830,380
売買損	△ 10,015,329
(C) 保管費用等	△ 4,677,206
(D) 当期損益金(A+B+C)	75,939,058
(E) 前期繰越損益金	121,530,880
(F) 解約差損益金	△ 71,841,277
償還差益金(D+E+F)	125,628,661

(注) 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。