■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	単位型投信／海外／資産複合	
信託期間	2023年７月31日から2033年７月20日まで	
運用方針	①担保付スワップ取引への投資を活用して、「当初１年間最安値指数値参照型・世界株式インデックス連動戦略」に連動する投資成果を目指します。 ②担保付スワップ取引とは別に、設定当初、主に米ドル建ての残存期間10年程度の米国国債に投資し、原則持ち切り運用を行うことで、安定した収益を享受することを目指します。 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。	
主要投資対象	世界株式インデックス戦略ファンド（資産成長型）２０２３－０７	「世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）」および「ＳＯＭＰＯマネープールマザーファンド」
	世界株式インデックス戦略ファンド２０２３－０８（適格機関投資家向け）	オンバランスでは設定当初に主に米ドル建ての残存期間およそ10年の米国国債に投資を行い、オフバランスでは担保付スワップ取引（米ドル建て）を主要取引対象とします。
	ＳＯＭＰＯマネープールマザーファンド	わが国の公社債等
主な組入制限	世界株式インデックス戦略ファンド（資産成長型）２０２３－０７	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ③デリバティブの直接利用は行いません。 ④株式への直接投資は行いません。
	世界株式インデックス戦略ファンド２０２３－０８（適格機関投資家向け）	①デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③株式への投資割合には制限を設けません。
	ＳＯＭＰＯマネープールマザーファンド	①株式への投資は、転換社債の転換及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得したものに限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ②外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	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。 ①分配対象額の範囲は、元本超過額、または経費控除後の配当等収益のいずれか多い額とします。 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。	

運用報告書（全体版）

世界株式インデックス戦略ファンド（資産成長型）２０２３－０７

〈愛称〉ベスト・エントリー ２０２３－０７

第２期（決算日　2025年７月22日）

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、「世界株式インデックス戦略ファンド（資産成長型）２０２３－０７」は、このたび第２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。
今後とも引続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株式会社
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.sompo-am.co.jp/
お問い合わせ先
TEL 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				受益者利回り	債券組入比率	投資信託証券組入比率	元本残存率
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落額	期中騰落率				
(設定日)	円	円	円	%	%	%	%	%
2023年7月31日	10,000	－	－	－	－	－	－	100.0
1期(2024年7月22日)	11,967	0	1,967	19.7	20.1	0.2	96.9	80.8
2期(2025年7月22日)	11,291	0	△ 676	△ 5.6	6.5	0.9	97.7	22.6

(注１) 基準価額の騰落額及び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) 受益者利回りは、基準価額（分配金込み）の当初元本（10,000円）に対する騰落率を年率換算したものです。
(注４) 債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５) 投資信託証券組入比率は「世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）」の組入比率。
(注６) 当ファンドは、世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）の投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券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。

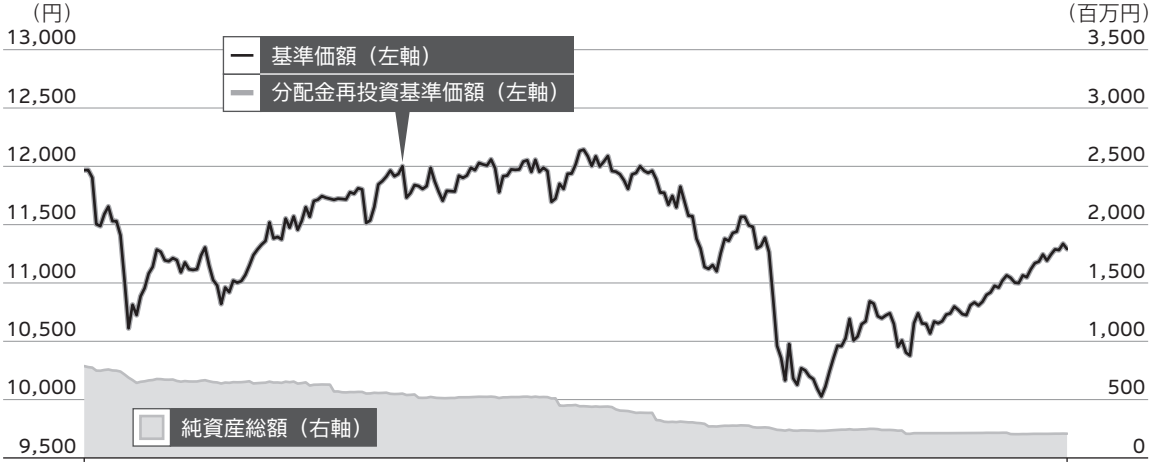
○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		債券組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		
(期　首)	円	%	%	%
2024年７月22日	11,967	－	0.2	96.9
７月末	11,530	△ 3.7	0.7	97.9
８月末	11,118	△ 7.1	0.8	97.0
９月末	11,382	△ 4.9	0.7	97.2
10月末	11,802	△ 1.4	0.8	97.2
11月末	11,705	△ 2.2	0.6	97.1
12月末	12,052	0.7	0.6	97.3
2025年１月末	12,041	0.6	0.7	97.1
２月末	11,648	△ 2.7	0.6	96.9
３月末	11,297	△ 5.6	0.8	96.9
４月末	10,458	△12.6	1.1	96.8
５月末	10,653	△11.0	0.8	96.9
６月末	11,065	△ 7.5	0.7	97.0
(期　末)				
2025年７月22日	11,291	△ 5.6	0.9	97.7

(注１) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。
(注２) 債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) 投資信託証券組入比率は「世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）」の組入比率。
(注４) 当ファンドは、世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）の投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券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



第２期首	騰落率	第２期末
基準価額 11,967円	△5.6% （分配金再投資基準価額ベース）	基準価額 11,291円 （期中分配金合計０円）

- 分配金再投資基準価額の推移は、2024年７月22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。
- 単位型投資信託は実際には分配金は再投資されませんのでご留意ください。
- 当ファンドは、世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）の投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券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

世界株式インデックス戦略ファンド（資産成長型）２０２３－０７

主要投資対象である「世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）」投資信託証券の基準価額が下落したことから、当期の基準価額は下落しました。主要投資対象である「世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）」投資信託証券においては、主に保有する米ドル建て米国国債の円高要因により、ファンド全体でマイナスとなりました。

- 本報告書では、ベビーファンド、マザーファンド及びマザーファンド以外の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　マザーファンド以外のファンド

投資環境

海外株式市場は上昇しました。期初からFRB（米連邦準備理事会）による利下げ決定などから上昇基調が続きました。期中にトランプ政権の関税政策発動による世界的な景気悪化懸念の高まりから、大きく下落する場面もありましたが、期末にかけては関税交渉の進展期待や中東での暫定的な停戦合意などから、再び上昇基調となりました。

国内株式市場は概ね横ばいとなりました。期初に歴史的な急落を記録し、その後に持ち直した国内株式市場は、2025年４月にトランプ関税政策を懸念して再び急落しました。その後、期末にかけては、関税交渉の進展期待などから上昇基調で推移しました。

米国債券利回りは、上昇（価格は下落）しました。米国経済が堅調に推移する中、期初から期央にかけて利回りは上昇しました。期央以降はトランプ政権による関税政策の先行き景気悪化の懸念などが金利低下（価格は上昇）圧力となった一方、関税政策に対する懸念の緩和などが金利上昇圧力となりました。

為替は、円高ドル安となりました。

バークレイズ・世界株式指数RC15%の推移

（出所：Bloomberg）

注１．当ファンドは世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）を通して、当初１年間最安値指数値参照型・世界株式インデックス戦略に連動する投資成果を目指しています。その戦略が参照する世界株式インデックスがバークレイズ・世界株式指数RC15%です。

注２．バークレイズ・世界株式指数RC15%は、米国・欧州・日本の株価指数先物取引を実質的な投資対象とします。それぞれの投資比率は、米国70%・欧州15%・日本15%とし、一定のルールに基づき日次でリバランスします。また、欧州および日本の株価指数先物取引の損益は、日次で米ドル建てに転換します。指数の変動率（ボラティリティ）が年率15%となるように投資比率を最大100%までの範囲内で調整します。

当該投資信託のポートフォリオ

期を通じて、主要投資対象である「世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）」投資信託証券の投資比率を高位に維持しました。

世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）

米ドル建て米国国債を保有すると同時に、当初１年間最安値指数値参照型・世界株式インデックス連動戦略に連動した担保付スワップ取引を行いました。

ＳＯＭＰＯマネープールマザーファンド

コール・ローンや、残存期間１年未満の公社債を中心とした運用を行いました。

当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドは、世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）の投資比率を可能な限り高位に保ちますが、本投資信託証券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、当期は分配を行いませんでした。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。

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

世界株式インデックス戦略ファンド（資産成長型）２０２３－０７

引き続き、「世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）」投資信託証券の組入比率を高位に保ち、信託財産の中長期的な成長を目指します。

世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）

引き続き、米ドル建て米国国債を保有すると同時に、当初１年間最安値指数値参照型・世界株式インデックス連動戦略に連動した担保付スワップ取引を行い、信託財産の成長を目指して運用を行います。

ＳＯＭＰＯマネープールマザーファンド

安全性、流動性の高いコール・ローンや、残存期間１年未満の公社債を中心とした運用を行う方針です。

1万口当たりの費用明細

項目	第２期 2024.7.23～2025.7.22		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	**135円**	**1.188%**	**(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率（年率）× 期中の日数／年間の日数** **期中の平均基準価額は11,395円です。**
（投信会社）	（ 44）	（0.385）	ファンドの運用の対価
（販売会社）	（ 88）	（0.770）	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) その他費用	**1**	**0.012**	**(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）	（0.011）	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）	（0.001）	信託事務の処理にかかるその他の費用等
合計	**136**	**1.200**	

注１．期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は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、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。

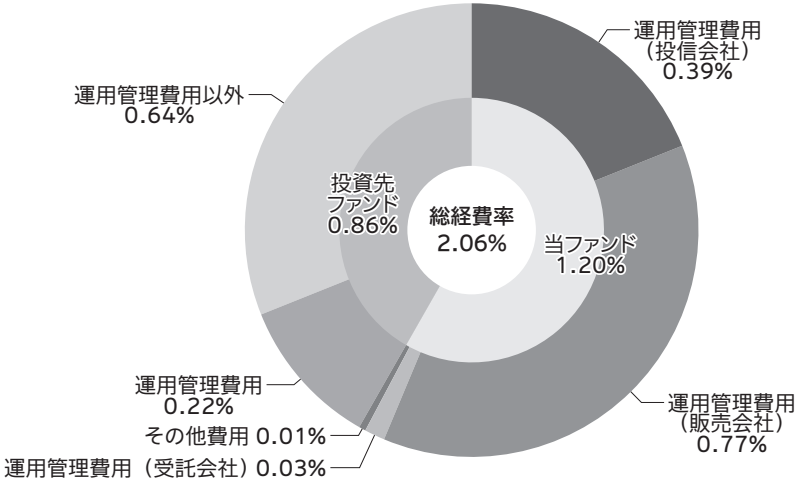
注３．比率欄は「１万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

注４．各項目の費用は、このファンドが組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。

（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2.06%**です。



（単位：%）

総経費率(①＋②＋③)	**2.06**
①当ファンドの費用の比率	1.20
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.22
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.64

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．投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
注５．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６．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７．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

（2024年７月23日～2025年７月22日）

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）	口 －	千円 －	口 452,005,856	千円 530,060

（注１） 金額は受渡代金。
（注２） 単位未満は切捨て。

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マネープールマザーファンド	千口 －	千円 －	千口 6,028	千円 6,000

（注１） 単位未満は切捨て。
（注２） 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

（2024年７月23日～2025年７月22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

（2024年７月23日～2025年７月22日）

当期首残高（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

（2025年７月22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	%
世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）	627,100,804	175,094,948	203,215	97.7
合計	627,100,804	175,094,948	203,215	97.7

（注） 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
	千口	千口	千円
ＳＯＭＰＯマネープールマザーファンド	8,147	2,119	2,112

（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れはありません。

○投資信託財産の構成

（2025年７月22日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	203,215	97.2
ＳＯＭＰＯマネープールマザーファンド	2,112	1.0
コール・ローン等、その他	3,793	1.8
投資信託財産総額	209,120	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

（2025年７月22日現在）

項目	当期末
	円
(A) 資産	209,120,171
コール・ローン等	3,792,432
投資信託受益証券(評価額)	203,215,196
ＳＯＭＰＯマネープールマザーファンド(評価額)	2,112,507
未収利息	36
(B) 負債	1,225,998
未払信託報酬	1,211,579
その他未払費用	14,419
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	207,894,173
元本	184,119,078
次期繰越損益金	23,775,095
(D) 受益権総口数	184,119,078口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	11,291円

（注１）2023年７月31日設定、設定当初元本額813,908,733円、当期首元本額657,874,166円、元本残存率（期末元本額の設定当初元本額に対する割合）22.6%
（注２）期末における１口当たりの純資産総額　1.1291円

○損益の状況

（2024年７月23日～2025年７月22日）

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	21,217
受取利息	21,217
(B) 有価証券売買損益	78,053,473
売買益	78,055,192
売買損	△ 1,719
(C) 有価証券評価差損益	△107,324,644
(D) 信託報酬等	△ 5,222,374
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	△ 34,472,328
(F) 前期繰越損益金	129,392,799
(G) 解約差損益金	△ 71,145,376
(H) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	23,775,095
(I) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｈ＋Ｉ)	23,775,095

（注１）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２）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。
（注３）計算期間末における元本超過額は23,775,095円、分配可能額は△2,495,109円ですが、当期に分配した金額はありません。

○お知らせ

・投資信託及び投資法人に関する法律第14条の改正に伴い、投資信託約款の「運用報告書に記載すべき事項」を「運用状況に係る情報」に変更するなどの必要があるため、投資信託約款に所要の変更を致しました（2025年４月１日）。

＜参考情報＞組入れ投資信託証券の内容

■主要投資対象の投資信託証券の概要

名称	世界株式インデックス戦略ファンド 2023-08（適格機関投資家向け）
形態	国内籍私募投資信託（円建て）
運用の基本方針	①スワップ取引への投資を通じて、バークレイズ・バンク・ピーエルシー（英国バークレイズ銀行）が提供する当初１年間最安値指数値参照型・世界株式インデックス連動戦略（以下「当戦略」）のパフォーマンスに連動する投資成果を目指します。 ②当戦略は世界株式インデックスを原資産とした１年間のルックバック・オプション取引を用いて、当ファンドの設定後１年間における日次で観測された指数値の最安値を基準値として、世界株式インデックスのパフォーマンスの獲得を目指す約10年間の取引を戦略化したものです。 ③世界株式インデックスは、バークレイズ世界株式RC15％インデックスとします。当インデックスは日・米・欧の株価指数先物取引を実質的な投資対象とし、変動率が年率15％となるようにエクスポージャーを最大100％までの範囲内で調整します。 ④設定当初、スワップ取引の米ドル建ての想定元本（円換算後）が当ファンドの受益権総口数に対して概ね100％となるようにします。設定後、原則として受益権1口に対するスワップ取引の米ドル建て想定元本は概ね設定当初の水準を維持することを目指して運用を行います。但し設定後の運用状況や市場環境等に応じ、その水準を見直すことがあります。 ⑤設定当初、当ファンドの現金部分は主に米ドル建ての残存期間10年程度の米国国債に投資を行い、原則として持ち切り運用を行うことで、安定した収益を享受することを目指します。また米国国債から受け取った利子等は、米ドル建ての短期金融資産（短期米国国債等）に投資を行う場合があります。 ⑥外貨建て資産、スワップ取引の評価損益に対しては、対円での為替ヘッジを行いません。 ⑦スワップ取引の評価損益等のエクスポージャーに対応し、日次でスワップ取引相手先と担保の授受を行います。スワップ取引相手先のエクスポージャー(無担保エクスポージャー)の純資産総額に対する割合は原則として10％未満になるように管理します。 ⑧市場動向や当ファンドの資金事情等によっては、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	①デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③株式への投資割合には制限を設けません。
決算日	原則、毎年７月７日（休業日の場合は翌営業日）
信託報酬等	純資産総額に対して年率0.231％（税抜0.21％） ※上記のほか、以下の費用がかかります。 各項目について消費税および地方消費税がかかる場合には、当該消費税等を含みます。 その他の費用については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。 ■スワップ取引の管理費用 ■スワップ取引が内包する資産の取引コスト及びリバランスコスト ■スワップ取引の一部または全部解約費用 ■ファンド監査費用 ■有価証券取引に伴う手数料等（売買委託手数料、保管手数料等） ■法令で定める価格等調査にかかる費用 ■信託財産に関する租税 ■信託事務の処理等に要する諸費用 ■受託者の立替えた立替金の利息、現金担保を受け入れた場合の利息等 ※英国バークレイズ銀行は、バークレイズ・グループ所定の方式に基づき、スワップ取引に係る媒介業務への対価をグループ会社に支払います。
信託財産留保額	・解約申込受付日が2023年８月１日から2024年８月１日までの場合：換金請求受付日の翌営業日の基準価額に0.30％を乗じた額 ・解約申込受付日が2024年８月２日以降の場合：ありません。
申込・解約手数料	ありません。
委託会社	バークレイズ投信投資顧問株式会社

※当ファンドが主要投資対象とする投資信託証券の名称及びその運用会社の名称等は今後変更となる場合があります。

（ご参考）費用明細（2024年７月９日～2025年７月７日）

項　目	比　率
運用管理費用	0.23%
その他費用	0.66%
トータルエクスペンスレシオ	0.89%

※トータルエクスペンスレシオはバークレイズ投信投資顧問株式会社から入手したものを掲載しています。
※各比率は、年率換算した値です。

組入上位10銘柄

基準日：2025年７月７日

	銘柄名	国	組入比率
1	US TREASURY 3.375	米国	85.9%
2	US T-BILL 250904	米国	4.4%
3			
4			
5			
6			
7			
8			
9			
10			
組入銘柄数		2銘柄	

注１．比率は純資産総額に対する評価額の割合です。
注２．バークレイズ投信投資顧問株式会社が作成したデータを掲載しています。

ＳＯＭＰＯマネープールマザーファンド

運用報告書

第６期（決算日　2024年10月18日）

＜計算期間　2023年10月19日～2024年10月18日＞

ＳＯＭＰＯマネープールマザーファンドの第６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	安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債等
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得したものに限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の５％以下とします。 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		債券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		
	円	%	%	百万円
２期(2020年10月19日)	9,981	△0.1	－	168
３期(2021年10月18日)	9,972	△0.1	－	332
４期(2022年10月18日)	9,962	△0.1	－	166
５期(2023年10月18日)	9,951	△0.1	－	100
６期(2024年10月18日)	9,949	△0.0	42.5	94

（注１）基準価額は１万口当たり（以下同じ）。

（注２）当ファンドは、わが国の公社債等に投資を行い、安定した収益の確保を目指しますが、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

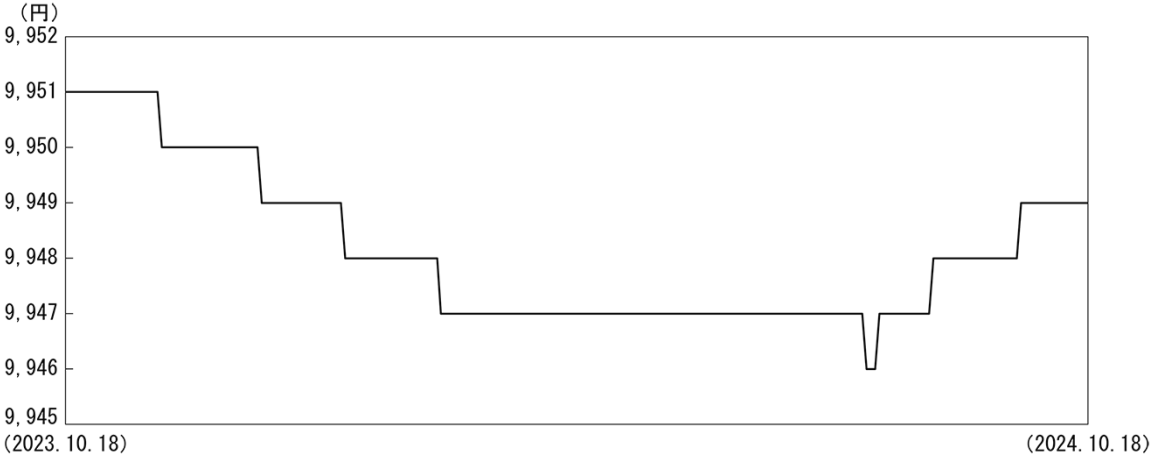
年　月　日	基準価額		債券組入比率
		騰落率	
（期　首）	円	%	%
2023年10月18日	9,951	－	－
10月末	9,951	0.0	－
11月末	9,950	△0.0	－
12月末	9,949	△0.0	－
2024年１月末	9,948	△0.0	－
２月末	9,948	△0.0	－
３月末	9,947	△0.0	12.0
４月末	9,947	△0.0	60.5
５月末	9,947	△0.0	51.3
６月末	9,947	△0.0	50.4
７月末	9,946	△0.1	61.8
８月末	9,948	△0.0	65.2
９月末	9,949	△0.0	56.5
（期　末）			
2024年10月18日	9,949	△0.0	42.5

（注１）騰落率は期首比。
（注２）当ファンドは、わが国の公社債等に投資を行い、安定した収益の確保を目指しますが、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

（2023年10月19日～2024年10月18日）

■基準価額の推移



期　首：9,951円
期　末：9,949円
騰落率：△0.0%

■基準価額の主な変動要因

2024年３月まで短期金融資産の利回りがマイナス圏で推移したことから、当期末の基準価額は期首の水準を小幅に下回りました。

■投資環境

2024年３月までは日銀のマイナス金利政策が継続したことから、無担保コールレート（オーバーナイト物）は、概ね－0.1％～0.0％の範囲で推移しました。

マイナス金利政策解除後は、概ね0.05％～0.15％の範囲で推移しましたが、７月の政策金利引上げ後は、概ね0.20％～0.25％の範囲で推移しました。

■当該投資信託のポートフォリオ

2024年３月までは短期金融市場において国債の利回りがマイナスであったため、比較的マイナス幅が小さいコール・ローン運用を中心に行いました。４月以降は、コール・ローンや、残存期間１年未満の公社債を中心とした運用を行いました。

■当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドは、わが国の公社債等に投資を行い、安定した収益の確保を目指しますが、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。

■今後の運用方針

安全性、流動性の高いコール・ローンや、残存期間１年未満の公社債を中心とした運用を行う方針です。

○１万口当たりの費用明細

（2023年10月19日～2024年10月18日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	3	0.032	(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）	(3)	(0.032)	信託事務の処理にかかるその他の費用等
合計	3	0.032	
期中の平均基準価額は9,948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19日～2024年10月18日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	169,988	－ (130,000)

（注１）金額は受渡代金（経過利子分は含まれておりません）。
（注２）（　）内は償還等による増減分です。
（注３）単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

（2023年10月19日～2024年10月18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10月18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	%	%	%	%	%
国債証券	40,000	39,997	42.5	－	－	－	42.5
	(40,000)	(39,997)	(42.5)	(－)	(－)	(－)	(42.5)
合計	40,000	39,997	42.5	－	－	－	42.5
	(40,000)	(39,997)	(42.5)	(－)	(－)	(－)	(42.5)

（注１）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注２）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。
（注３）（　）内は非上場債で内書き。
（注４）当マザーファンドは、当期末において、株式及び新株予約権証券の組入れはありません。

（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
国債証券	%	千円	千円	
第1249回国庫短期証券	－	20,000	19,998	2024/11/11
第1253回国庫短期証券	－	20,000	19,998	2024/12/２
合計		40,000	39,997	

（注）額面金額・評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

（2024年10月18日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	39,997	42.5
コール・ローン等、その他	54,108	57.5
投資信託財産総額	94,105	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10月18日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	94,105,248
コール・ローン等	54,107,645
公社債(評価額)	39,997,440
未収利息	163
(B) 負債	0
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	94,105,248
元本	94,586,271
次期繰越損益金	△ 481,023
(D) 受益権総口数	94,586,271口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	9,949円

(注１) 信託財産に係る期首元本額101,006,335円、期中追加設定元本額46,873,490円、期中一部解約元本額53,293,554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

世界株式インデックス戦略ファンド(資産成長型) ２０２３－０７	8,147,479円
世界株式インデックス戦略ファンド(償還条項付) ２０２３－０７	7,574,845円
東洋・中国Ａ株ファンドＤＤ「華夏」２０２０	16,286,625円
東洋・中国Ａ株ファンド「創新」２０２１(限定追加型)	27,036,732円
東洋・中国Ａ株オープン「創新」	3,332,864円
米国株式プレミアムキャリー戦略ファンド	10,130,717円
東洋・インドネシア株式ファンド	22,077,009円

(注３) 期末における１口当たりの純資産総額　0.9949円
(注４) 期末における元本の欠損金額　481,023円

○損益の状況 (2023年10月19日～2024年10月18日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	△ 2,006
受取利息	10,449
支払利息	△ 12,455
(B) 有価証券売買損益	9,440
売買益	9,440
(C) 保管費用等	△ 28,613
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△ 21,179
(E) 前期繰越損益金	△489,908
(F) 追加信託差損益金	△243,490
(G) 解約差損益金	273,554
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	△481,023
次期繰越損益金(Ｈ)	△481,023

(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。