

グローバル複合戦略ポートフォリオ（G）

第5期（決算日：2025年10月27日）

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。

さて、「グローバル複合戦略ポートフォリオ（G）」は、2025年10月27日に第5期の決算を行いましたので、ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

《当ファンドの仕組み》

商品分類	追加型投信／内外／資産複合
信託期間	原則として無期限（2020年10月20日設定）
運用方針	当ファンドは、委託会社が開発した計量モデルに基づく市場中立型マルチ戦略により、主として国内外の株価指数先物取引、国債先物取引、通貨先物取引、有価証券指数等先物取引および商品先物取引等を利用しつつ、国内外の公社債等に投資して、株式市場との連動性は低位に維持しながら、長期的に日本円短期金利を上回る投資成果の獲得を目指して運用を行います。また、外貨建資産の一部については、為替ヘッジ比率をコントロールし、対円での為替ヘッジを行う場合があります。
主要投資対象	国内外の金融商品取引所に上場している株価指数先物取引、国債先物取引、通貨先物取引、有価証券指数等先物取引および国内外の商品取引所に上場している商品先物取引等ならびに国内外の公社債等を主要投資対象とします。
組入制限	①国内外の上場株価指数先物取引、上場国債先物取引、上場通貨先物取引、上場有価証券指数等先物取引および上場商品先物取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。 ②国内外の公社債等の投資割合には制限を設けません。 ③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ⑤外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定します。 ⑥1発行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従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
分配方針	原則として、年1回の決算時（毎年10月25日。ただし、休業日の場合は翌営業日。）に収益分配を行います。 ○分配対象額の範囲は、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。 ○分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配を行わないことがあります。 ○収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、運用の基本方針に則した運用を行います。 ※ 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

株式会社sustenキャピタル・マネジメント

東京都港区虎ノ門一丁目3番1号 東京虎ノ門グローバルスクエア

【問い合わせ先】 電話番号 03-6810-7856（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）
ホームページ <https://susten.jp/>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			債券 組入 比率	株式 先物 比率	債券 先物 比率	その他 先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	分配金 (税引前)	期 中 騰落率					
(設定日)	円	円	%	%	%	%	%	百万円
2020年10月20日	10,000	—	—	—	—	—	—	180
第1期 2021年10月25日	9,663	0	△3.4	74.8	30.5	635.4	△13.9	912
第2期 2022年10月25日	7,268	0	△24.8	66.9	28.4	165.9	△33.6	1,109
第3期 2023年10月25日	5,915	0	△18.6	45.9	29.5	475.8	△30.9	965
第4期 2024年10月25日	5,855	0	△1.0	31.0	△4.5	585.6	△36.3	1,226
第5期 2025年10月27日	6,144	0	4.9	35.2	22.7	214.1	△259.1	1,086

(注1) 基準価額および分配金は1万口当たりです。

(注2) 株式先物比率、債券先物比率およびその他先物比率は買建比率－売建比率です。

(注3) 当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数は設定していません。

(注4) 設定日の基準価額は当初設定元本、設定日の純資産総額は当初設定元本総額です。

当期中の基準価額等の推移

年月日	基準価額		債券組入 比率	株式先物 比率	債券先物 比率	その他 先物 比率
		騰落率				
(期 首)	円	%	%	%	%	%
2024年10月25日	5,855	—	31.0	△4.5	585.6	△36.8
10月末	5,823	△0.5	31.6	△4.8	595.6	△35.9
11月末	5,742	△1.9	31.6	△10.6	558.6	△70.4
12月末	5,669	△3.2	34.4	△3.5	574.0	△72.2
2025年1月末	5,569	△4.9	34.3	△19.3	501.1	△67.4
2月末	5,622	△4.0	32.7	17.4	387.4	△44.6
3月末	5,634	△3.8	33.3	15.2	441.0	△41.9
4月末	5,798	△1.0	31.6	21.3	334.6	△21.4
5月末	5,516	△5.8	33.8	33.0	236.0	△27.1
6月末	5,390	△7.9	35.7	39.5	265.4	△23.7
7月末	5,394	△7.9	—	33.5	296.2	△29.8
8月末	5,703	△2.6	35.2	25.6	240.8	△263.1
9月末	5,857	0.0	35.3	26.3	240.3	△259.5
(期 末)						
2025年10月27日	6,144	4.9	35.2	22.7	214.1	△259.1

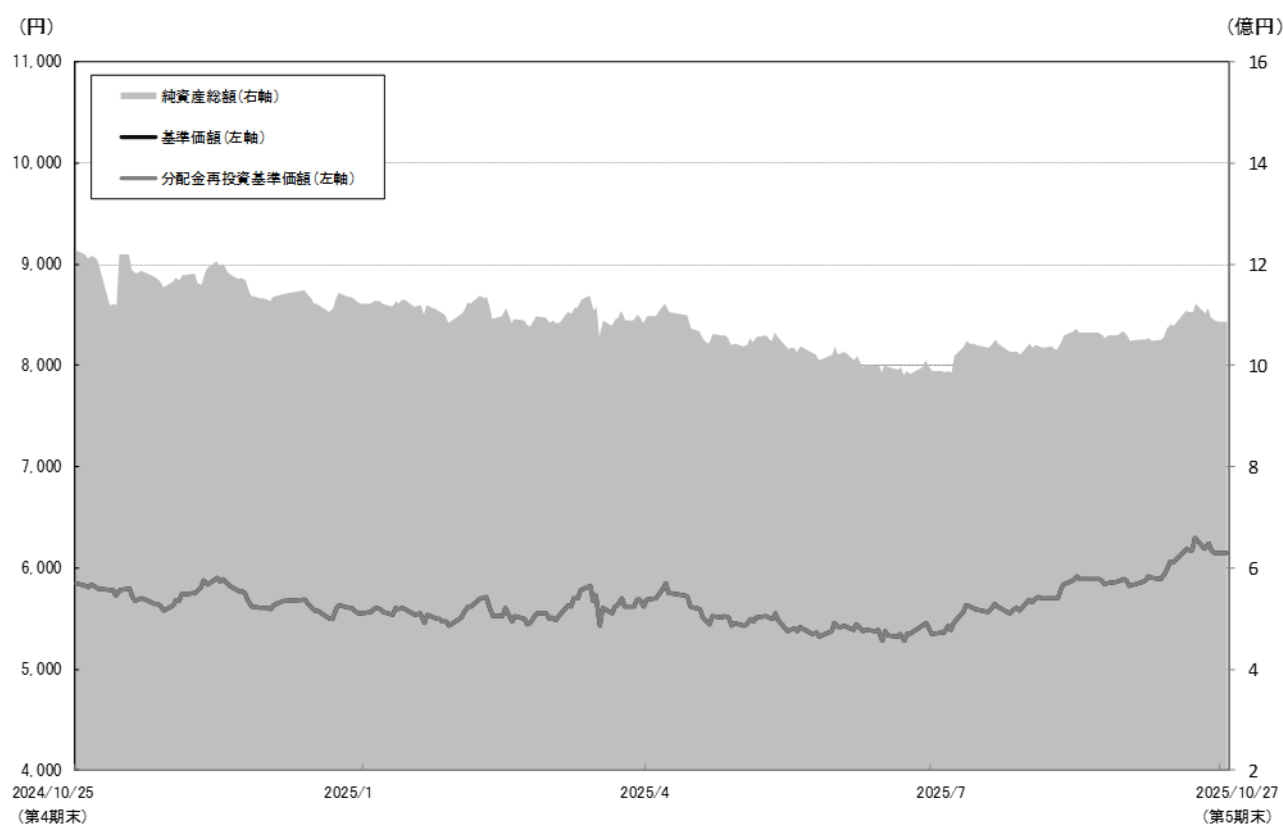
(注1) 基準価額は1万口当たり、分配金（税引前）込みです。騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率、債券先物比率およびその他先物比率は買建比率－売建比率です。

(注3) 当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数は設定していません。

運用経過

《基準価額等の推移》（2024年10月26日～2025年10月27日）



期 首	:	5,855 円
期 末	:	6,144 円
既払分配金（税引前）	:	0 円
騰 落 率	:	4.9%

- （注1） 分配金再投資基準価額および騰落率は、分配金（税引前）を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2） ファンドの購入価額により課税条件が異なるため、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- （注3） 当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数は設定していません。
- （注4） 基準価額は1万口当たりの価額です。騰落率は小数点以下第2位を四捨五入しています。

《基準価額の主な変動要因》

株式、債券、通貨などへの機動的配分を通じてオルタナティブ・リスク・プレミアム（ARP）の獲得を目指すグローバル複合戦略ポートフォリオ（G）は、当期は4.9%の上昇となりました。機械学習戦略や価格動向の観点からモメンタム戦略などに基づき取引を行った金や米国株がプラス寄与しました。一方で、機械学習戦略に基づき取引を行った原油がマイナスに寄与しました。

《投資環境》

＜株式市場＞

米国株式は、期を通して上昇しました。期の前半では、米国連邦公開市場委員会（FOMC）が2025年の利下げペース鈍化を示唆したこと、トランプ政権の大規模な関税政策により景気後退懸念が高まったことなどの理由により、値動きが不安定となる局面がありました。5月以降は、米連邦準備制度理事会（FRB）の利下げ観測の高まりやトランプ政権の関税政策の不透明感後退などの理由により、上昇しました。セクター別では、情報技術やコミュニケーション・サービスが堅調な企業決算により大きく上昇し市場をけん引しました。

先進国では欧州株式や日本株式が米国との貿易摩擦緩和などから上昇しました。欧州株式は、ドイツが積極的な財政政策に転じたことも好感されました。日本株式は、政権交代に伴う国内の政治的な期待に支えられ、期の後半に大きく上昇しました。新興国では、中国株式が政策面の支援やハイテク部門の業績拡大に対する期待などから大きく上昇しました。

＜債券市場＞

米国では、トランプ政権の大型減税や関税政策に伴うインフレ再燃・財政規律への懸念と労働市場の減速が併存し、FRBの利下げ観測の強弱に大きく左右され、国債利回りが上昇と低下を繰り返す展開となりました。インフレ上昇が限定的となる中で雇用の維持に係るリスクが相対的に高まり、FRBが利下げ再開へと踏み切った中で、期を通じて国債利回りは低下（債券価格が上昇）しました。

欧州では、期の前半は景気悪化懸念から欧州中央銀行（ECB）による利下げが期の半ばまで継続し利回りが低下しましたが、後半は欧州域内の財政拡大による債務増加懸念などから利回りが上昇する局面が目立ち、期を通じて国債利回りは上昇しました。日本では、物価や賃金の上昇が続く中、1月に日銀が政策金利の引き上げを行ったことやその後の追加利上げ観測により、国債利回りは上昇しました。

＜外国為替市場＞

期を通じて、日銀の利上げ観測、FRBの利下げペース見通し、トランプ政権の関税政策の不確実性に大きく影響を受ける展開となりました。期の前半は、日銀の利上げやトランプ政権の関税政策に伴うリスクオフの円買いにより、1ドル140円台まで円高・ドル安が進行しました。後半は、日本の政局不透明感、および貿易摩擦緩和に伴うリスク選好の流れを受け、円安基調に転換し、期間終盤まで円安・ドル高が進行したことで、結果的に期初とほぼ同等の1ドル150円近辺の水準に戻りました。

《当ファンドのポートフォリオ》

委託会社が開発した計量モデルに基づく市場中立型マルチ戦略により、主として国内外の株価指数先物取引、国債先物取引、通貨先物取引、有価証券指数等先物取引、商品先物取引、金利オプション取引等を利用しつつ、米国の公社債に投資して、株式市場との連動性は低位に維持しながら、長期的に日本円短期金利を上回る投資成果の獲得を目指して運用を行いました。個別の投資対象銘柄等の選定にあたっては、取引コスト、流動性等を総合的に勘案し決定いたしました。また、外貨建資産の一部については、為替ヘッジ比率をコントロールし、対円での為替ヘッジを行いました。

《当ファンドとベンチマークとの差異》

当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数は設定していません。

分配金について

収益分配方針に基づき、基準価額水準、市況動向等を勘案して、以下の通りといたしました。

なお、収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づき運用いたします。

＜分配原資の内訳（1 万口当たり、税引前）＞

項 目	当期
	（2024 年 10 月 26 日～2025 年 10 月 27 日）
当期分配金 （対基準価額比率）	－円 （－％）
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	709 円

（注1） 当期分配金の対基準価額比率とは、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2） 当期の収益および当期の収益以外は、小数点以下切捨てで算出しているため、これらを合計した額と当期分配金（税引前）の額が一致しない場合があります。

《今後の運用方針》

委託会社が開発した計量モデルに基づく市場中立型マルチ戦略により、主として国内外の株価指数先物取引、国債先物取引、通貨先物取引、有価証券指数等先物取引および商品先物取引等を利用しつつ、国内外の公社債等に投資して、株式市場との連動性は低位に維持しながら、長期的に日本円短期金利を上回る投資成果の獲得を目指して運用を行います。個別の投資対象銘柄等の選定にあたっては、取引コスト、流動性等を総合的に勘案し決定いたします。また、外貨建資産の一部については、為替ヘッジ比率をコントロールし、対円での為替ヘッジを行う場合があります。

1万口当たりの費用明細

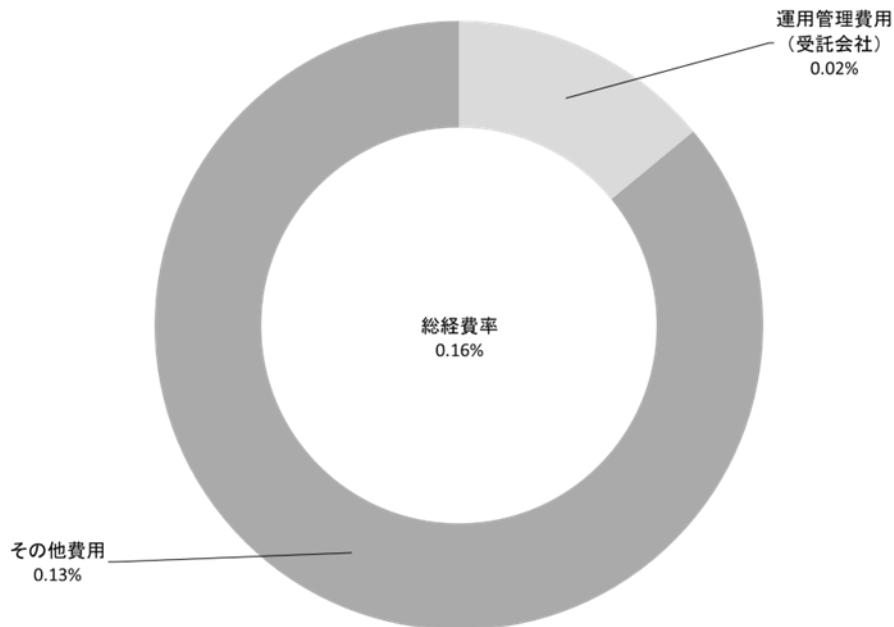
項 目	当期		項目の概要
	(2024 年 10 月 26 日 ～2025 年 10 月 27 日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	1 円	0.022%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は 5,637 円です。
（投信会社）	—	—	投信会社：委託した資金の運用等の対価
（販売会社）	—	—	販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(1)	(0.022)	受託会社：運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料 （先物・オプション）	21 (21)	0.364 (0.364)	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有価証券取引税	—	—	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用 （保管費用） （監査費用） （その他）	8 (0) (5) (3)	0.135 (0.004) (0.087) (0.044)	(d) その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金、資産の移転等に要する費用 監査費用：監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 その他：信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	29	0.521	

（注1）各金額（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ており、円未満を四捨五入しています。

（注2）各比率は、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、小数点以下第4位を四捨五入しています。

（参考情報） 《総経費率》

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及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 0.16%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、小数点以下第 3 位を四捨五入しています。
- （注4） 上記の前提条件で算出した参考値であり、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 10 月 26 日～2025 年 10 月 27 日）

《公社債》

種類			買付額	売付額
外 国	米 国	国債証券	千米ドル 7,395	千米ドル — (7,500)

（注1）金額は受渡し代金です（経過利子分は含まれていません）。

（注2）売付の（ ）内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれていません。

（注3）金額の単位未満は切捨てしています。

派生商品の取引状況等

（2024 年 10 月 26 日～2025 年 10 月 27 日）

《A 先物取引の銘柄別取引状況・残高状況》

銘柄別			買建		売建		当期末評価額		
			新 規 買付額	決済額	新 規 売付額	決済額	買建額	売建額	評価 損益
国 内	株 式	TOPIX 先物	百万円 192	百万円 304	百万円 332	百万円 247	百万円 —	百万円 99	百万円 △5
外 国	株 式	S&P500 EMINI FUT	1,133	1,016	—	—	313	—	6
		S&P/TSE 60 IX FUT	280	286	444	401	—	117	△3
		SPI 200 FUTURES	389	332	286	339	45	—	0
		FTSE 100 INDEX FUTURE	95	98	430	477	—	39	△1
		DAX MINI FUTURE	660	655	178	209	43	—	0
		DJ EURO STOXX 50	649	573	370	435	101	—	3
	債 券	US 5YR NOTE CBT	688	804	1,991	1,753	—	235	△0
		US 2YR NOTE CBT	15,427	18,902	—	—	2,140	—	4
		US 10YR NOTE FUT	3,623	3,946	65	65	572	—	7
		US LONG BOND CBT	488	590	247	196	—	54	△1
		CAN 10YR BOND FUT	1,823	1,852	117	51	—	67	△0
		AUST 10Y BOND FUT	1,146	1,091	929	927	34	—	0
		LONG GILT FUTURE	1,291	1,227	178	196	76	—	2
		EURO-BOBL FUTURE	1,868	1,952	485	276	—	210	0
		EURO-BUND FUTURE	1,631	1,812	281	284	69	—	△0
	通 貨	AUDUSD CURRENCY FUT	103	158	910	825	—	99	△0
		BP CURRENCY FUT	1,479	1,683	95	84	—	12	0
		C\$ CURRENCY FUT	234	241	932	886	—	43	0

グローバル複合戦略ポートフォリオ（G）

		EURO FX CURR FUT	380	384	675	752	—	22	△0
		JPN YEN CURR FUT	—	—	1,974	1,793	—	377	16
		NEW ZEALAND \$ FUT	—	—	946	980	—	8	0
		CHF CURRENCY FUT	88	89	1,562	1,749	—	72	0
	商品	WTI CRUDE FUTURE	332	321	991	869	—	225	△7
		BRENT CRUDE FUTR	1,053	1,069	291	295	89	—	3
		GOLD 100 OZ FUTR	1,332	1,320	—	—	253	—	42
		COPPER FUTURE	490	522	397	396	—	19	△0
		NATURAL GAS FUTR	113	101	692	705	—	103	△3
		PLATINUM FUTURE	—	—	872	960	—	61	2
		LOW SULPHUR GASOIL FUTR	718	638	569	649	118	—	9
		SILVER FUTURE	731	641	148	159	111	—	△3
	金利	3 MONTH SOFR FUT	—	—	2,243	—	—	2,338	△1
	有価証券指数等	CBOE VIX FUTURE	985	1,022	1,129	1,182	—	—	—

＜B オプションの銘柄別取引状況・残高状況＞

銘柄別			コール プット 別	買建				売建				作成期末評価額		
				新 規 買付額	決済額	権利 行使	権利 放棄	新 規 売付額	決済額	権利 被行使	義務 消滅	買建額	売建額	評価 損益
外国	金利	3 Month SOFR Opt	コール	百万円 85	百万円 —	百万円 —	百万円 —	百万円 —	百万円 —	百万円 —	百万円 —	百万円 121	百万円 —	百万円 15

（注1） 外国先物取引、オプション取引の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の日本の対顧客直物電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計額です。

（注2） 金額は受渡し代金です。単位未満は切捨てしています。

利害関係人との取引状況等

（2024 年 10 月 26 日～2025 年 10 月 27 日）

該当事項はありません。

なお、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。

第一種および第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己取引状況

（2024 年 10 月 26 日～2025 年 10 月 27 日）

該当事項はありません。

自社による当ファンドの設定・解約状況

（2024 年 10 月 26 日～2025 年 10 月 27 日）

該当事項はありません。

組入資産の明細

（2025 年 10 月 27 日現在）

（1）公社債

A 外国（外貨建）公社債 種類別開示

区分	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		
		外貨建金額	邦貨換算 金額			5年 以上	2年 以上	2年 未満
米 国	千米ドル 2,500	千米ドル 2,495	千円 381,825	% 35.2	% —	% —	% —	% 35.2
合 計	—	—	381,825	35.2	—	—	—	35.2

（注1） 邦貨換算金額は、当期末の時価を日本の対顧客直物電信売買相場の仲値で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で、小数点以下第 2 位を四捨五入しています。

（注3） 金額の単位未満は切捨てしています。

B 外国（外貨建）公社債 銘柄別開示

銘柄	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建 金額	邦貨換算 金額	
（米国） US T BILL 11/12/25	国債証券	% —	千米ドル 2,500	千米ドル 2,495	千円 381,825	2025/11/12
合 計			2,500	2,495	381,825	

（注1） 邦貨換算金額は、当期末の時価を日本の対顧客直物電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

（注2） 金額の単位未満は切捨てしています。

（2）先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		買建額	売建額
国 内	TOPIX 先物 2025 年 12 月	百万円 —	百万円 99
外 国	S&P500 EMINI FUT Dec25	百万円 313	百万円 —
	S&P/TSE 60 IX FUT Dec25	—	117
	SPI 200 FUTURES Dec25	45	—
	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec25	—	39
	DAX MINI FUTURE Dec25	43	—
	DJ EURO STOXX 50 Dec25	101	—

グローバル複合戦略ポートフォリオ（G）

銘柄別	買建額	売建額
US 5YR NOTE CBT Dec25	—	235
US 2YR NOTE CBT Dec25	2,140	—
US 10YR NOTE FUT Dec25	572	—
US LONG BOND CBT Dec25	—	54
CAN 10YR BOND FUT Dec25	—	67
AUST 10Y BOND FUT Dec25	34	—
LONG GILT FUTURE Dec25	76	—
EURO-BOBL FUTURE Dec25	—	210
EURO-BUND FUTURE Dec25	69	—
WTI CRUDE FUTURE Dec25	—	225
BRENT CRUDE FUTR Jan26	89	—
GOLD 100 OZ FUTR Dec25	253	—
COPPER FUTURE Mar26	—	19
NATURAL GAS FUTR Dec25	—	103
PLATINUM FUTURE Jan26	—	61
LOW SULPHUR GASOIL FUTR Dec25	118	—
3 MONTH SOFR FUT Dec26	—	1,150
3 MONTH SOFR FUT Mar27	—	1,187
SILVER FUTURE Dec25	111	—
AUDUSD CURRENCY Fut Dec25	—	99
BP CURRENCY FUT Dec25	—	12
C\$ CURRENCY FUT Dec25	—	43
EURO FX CURR FUT Dec25	—	22
JPN YEN CURR FUT Dec25	—	377
NEW ZEALAND \$ FUT Dec25	—	8
CHF CURRENCY FUT Dec25	—	72

（注1） 外国先物取引の金額は、当期末の時価を日本の対顧客直物電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

（注2） 金額の単位未満は切捨てしています。

（３）オプションの銘柄別期末残高

銘柄			コール・ プット別	当期末	
				買建額	売建額
外国	金利			百万円	百万円
		3 Month SOFR Opt Sep26	コール	10	—
		3 Month SOFR Opt Dec26	コール	35	—
		3 Month SOFR Opt Mar27	コール	38	—
		3 Month SOFR Opt Jun27	コール	19	—
		3 Month SOFR Opt Sep27	コール	17	—

（注１）外国オプションの金額は、当期末の時価を日本の対顧客直物電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

（注２）金額の単位未満は切捨てしています。

※ 当ファンドは株式投資信託ですが、期末時点で株式、新株予約権証券及び株式の性質を有するオプション証券等の組入れはありません。

投資信託財産の構成

（2025 年 10 月 27 日現在）

項 目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公 社 債	381,825	32.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	779,551	67.1
投 資 信 託 財 産 総 額	1,161,377	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨てしています。

（注２）外貨建資産は、当期末の時価を日本の対顧客直物電信売買相場の仲値で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米ドル＝153.00 円、１カナダ・ドル＝109.38 円、１オーストラリア・ドル＝99.97 円、１イギリス・ポンド＝203.84 円、１ユーロ＝178.00 円です。

（注３）当期末における外貨建資産（1,034,989 千円）の投資信託財産総額（1,161,377 千円）に対する比率は 89.1%です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況並びに損益の状況

《資産、負債、元本及び基準価額の状況》

(2025 年 10 月 27 日現在)

項 目	当期末
(A) 資産	2,139,129,096 円
コール・ローン等	126,803,026
公社債（評価額）	381,825,524
コール・オプション（買）	121,016,306
未収入金	1,083,213,191
差入委託証拠金	426,271,049
(B) 負債	1,052,982,138
未払金	1,051,869,819
未払解約金	522,792
未払信託報酬	116,527
その他未払費用	473,000
(C) 純資産総額（A-B）	1,086,146,958
元本	1,767,870,150
次期繰越損益金	△ 681,723,192
(D) 受益権総口数	1,767,870,150 口
1 万口当り基準価額 （C/D）	6,144 円

(注) 期首元本額 2,094,007,133 円
 期中追加設定元本額 791,747,185 円
 期中一部解約元本額 1,117,884,168 円

《損益の状況》

(2024 年 10 月 26 日
～2025 年 10 月 27 日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	28,012,900 円
受取利息	18,585,851
その他収益金	9,427,049
(B) 有価証券売買損益	△ 32,811,856
売買益	109,798,277
売買損	△ 142,610,133
(C) 先物取引等損益	69,884,747
取引益	807,055,788
取引損	△ 737,171,041
(D) 信託報酬等	△ 1,733,692
(E) 当期損益金（A+B+C+D）	63,352,099
(F) 前期繰越損益金	△ 126,427,878
(G) 追加信託差損益金	△ 618,647,413
（配当等相当額）	(74,424,322)
（売買損益相当額）	(△ 693,071,735)
(H) 合計（E+F+G）	△ 681,723,192
次期繰越損益金（H）	△ 681,723,192
追加信託差損益金	△ 618,647,413
（配当等相当額）	(74,424,322)
（売買損益相当額）	(△ 693,071,735)
分配準備積立金	50,990,374
繰越損益金	△ 114,066,153

(注1) 有価証券売買損益には、期末の評価換えによるものを含まず。
 (注2) 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3) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
 (注4) 分配金の計算過程

(a) 経費控除後の配当等収益	27,266,719 円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0 円
(c) 収益調整金	74,424,322 円
(d) 分配準備積立金	23,723,655 円
(e) 当期分配対象額 （a+b+c+d）	125,414,696 円
(f) 1 万口当たり当期分配対象額	709.41 円
(g) 分配金	0 円
(h) 1 万口当たり分配金	0 円

お知らせ

該当事項はありません。