

## 受益者の皆さまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、お手持ちの「あおぞら・新グローバル・プレミアム・ファンド “愛称 ろくよん”」は、去る4月22日に第1期の決算を行いましたので、法令に基づいて運用状況をまとめてご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

### ■本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／資産複合
信託期間	原則として無期限
運用方針	日本を含む世界の株式および債券に広く分散投資を行うことで、インカムゲインの獲得と信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。
主要投資対象	以下の指定投資信託証券を主要投資対象とします。 ・アイルランド籍外国証券投資法人（円建） ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・コア・エクイティ・ファンド ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー エマージング・マーケット・バリュー・ファンド ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・ショート・フィクスト・インカム・ファンド
運用方法	①主として、日本を含む世界の株式（新興国の株式を含みます。）（以下「グローバル株式」といいます。）を主要投資対象とする別に定める投資信託証券および日本を含む世界の債券（以下「グローバル債券」といいます。）を主要投資対象とする別に定める投資信託証券に投資を行います。 ②投資信託証券の組入比率は原則として高位を保ちます。なお、投資対象資産毎の投資信託証券への配分比率は下記の通りとすることを基本とします。 ・グローバル株式を投資対象とする投資信託証券への配分比率の合計：純資産総額の概ね60%程度とします。 ・グローバル債券を投資対象とする投資信託証券への配分比率の合計：純資産総額の概ね40%程度とします。
分配方針	分配対象額の範囲は、経費控除後の継越分を含めた利子・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。収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等は分配を行わない場合があります。

# あおぞら・新グローバル・ プレミアム・ファンド

愛称

# ろくよん

## 運用報告書（全体版）

### 第1期

決算日  
第1期 2024年4月22日



# あおぞら投信株式会社

東京都千代田区麹町6-1-1

### ■ホームページアドレス

<https://www.aozora-im.co.jp/>

### ■お問い合わせ先

〈お問い合わせ窓口〉

050-3199-6343

受付時間：  
営業日の午前9時から  
午後5時まで

\*お取引内容等につきましては、ご購入された販売会社にお問い合わせください。

## ■設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税分 配込 金	期騰 落中 率	投 資 券 比 率	純 資 産 額
(設定期) (2024年1月31日)	円 10,000	円 —	% —	% —	百万円 439
1期 (2024年4月22日)	10,439	0	4.4	99.0	2,225

(注1) 設定期の基準価額は設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注3) 本ファンドは複数の投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。本ファンドは、日本を含む世界の株式および債券に、市場における代表的なインデックスよりも広く分散投資を行うことを基本としております。このため、本ファンドの収益率を測る適切なインデックスが存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

## ■当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額			投 資 券 比 率
	騰	落	率	
(設定日) 2024年1月31日	円 10,000		% —	% —
1月末	10,000		0.0	—
2月末	10,336		3.4	98.9
3月末	10,602		6.0	99.1
(期末) 2024年4月22日	10,439		4.4	99.0

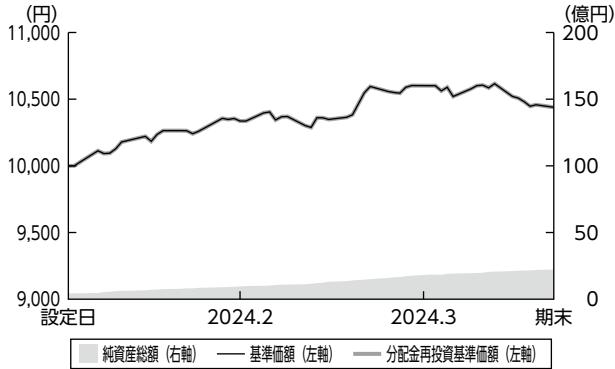
(注1) 設定期の基準価額は、設定価額を記載しています。

(注2) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。

(注3) 本ファンドは複数の投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。本ファンドは、日本を含む世界の株式および債券に、市場における代表的なインデックスよりも広く分散投資を行うことを基本としております。このため、本ファンドの収益率を測る適切なインデックスが存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

## ■運用経過（2024年1月31日～2024年4月22日）

### 基準価額の推移



**第1期首：10,000円  
第1期末：10,439円（既払分配金0円）  
騰落率：4.4%（分配金再投資ベース）**

- \*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。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- \*分配金再投資基準価額は、設定日（2024年1月31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。
- \*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。

### 基準価額の主な変動要因

本ファンドの基準価額は、当期末において10,439円となり、当期のリターンは4.4%（信託報酬控除後）の上昇となりました。

労働市場のひっ迫やインフレ高止まりへの警戒から、先進国債券利回りが上昇したことがマイナス要因となりました。一方で、米景気のソフトランディング（軟着陸）や半導体需要増への期待、堅調な欧米主要企業決算を背景に、先進国株式市場および新興国株式市場が上昇したことがプラス要因となりました。また、ドル円為替レートをはじめ、円安が進んだことも基準価額のプラス要因となりました。

### 投資環境

当期の先進国株式市場は上昇しました。生成AI（人工知能）向け半導体需要の期待からハイテク株を中心買いが広がる中、米景気のソフトランディング期待が高まったほか、堅調な欧米主要企業の決算発表や中国の景気下支え策への期待を背景に、欧米の主要株価指数が過去最高値を更新するなど、当期初から上昇しました。その後も、F R B（米連邦準備理事会）が5会合連続で利上げを見送り、政策金利見通しが年3回の利下げ予想に維持されると、米景気のソフトランディング期待が一段と強まることに加えて、ラガルドE C B（欧州中央銀行）総裁が6月利下げ開始を示唆したことでも好感され、欧米株式市場は上昇基調を維持しました。ただ、期末にかけては、中東情勢の緊迫化やインフレ高止まりへの警戒、半導体需要への過度な期待の後退、F R BおよびE C B高官から利下げ慎重発言が相次ぐ中、早期利下げ観測の後退が重石となり、先進国株式市場は上げ幅を縮小する展開となりました。

新興国株式市場は上昇しました。生成AI関連需要増への期待に加えて、中国の春節休暇中の消費が好調だったことが追い風となる中、中国が経済成長率目標を5%前後に据え置くと、追加の景気刺激策への期待から、上昇しました。ただ、中国の不動産不況の再燃や、欧米金利の上昇に伴う新興市場からの資金流出懸

念に加えて、半導体需要への過度な期待の後退が重石となり、当期末にかけて上昇幅を縮小する展開となりました。

先進国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。米国では、米労働市場の底堅さが確認されたほか、米CPI（消費者物価指数）とPPI（卸売物価指数）の伸びが市場予想ほど鈍化しなかったことを受けて、FRBの早期利下げ観測が後退し、利回りが上昇しました。その後、FRBが政策金利見通しの年3回利下げ予想を維持したことに加えて、FRBがインフレ指標として重要視する米コアPCE（個人消費支出）デフレータの伸びが鈍化したことを受け、利回りは上昇幅を縮小する場面もありました。しかし、期末にかけては、インフレ高止まりに対する懸念から利下げ開始を先送りするとの見方が強まる中、米国債券利回りは上昇基調を維持しました。欧州では、域内景気の減速懸念が根強いものの、 ECB高官から早期利下げ観測をけん制する発言が相次ぎ、利回りは上昇して始まりました。その後、ECBが2024-25インフレ率見通しを引き下げたことに加えて、ラガルドECB総裁が6月利下げ開始を示唆したこと受けて、利回りは上昇幅を縮小しました。また、スイス中央銀行が主要中央銀行に先陣を切って利下げを実施したことに加え、英イングランド銀行の早期利下げ観測が強まったことも利回り低下要因となりました。ただ、インフレ高止まりを背景とする米国債券利回り上昇が欧州債券利回りにも波及し、期末にかけて利回りが上昇しました。

為替市場でドル円為替レートは円安が進みました。インフレ高止まりや堅調な米経済指標を受けて、FRBの早期利下げ観測が後退し、当期初から円安基調となりました。その後、日銀の政策修正観測が強まると、円が買い戻される場面もありましたが、注目された日銀の金融政策決定会合で、マイナス金利解除やイールドカーブ・コントロール（YCC、長短金利操作）撤廃が決定された一方で、緩和的な金融政策が維持されると、日米金利差拡大が意識され、当期末にかけて154円台まで円安が進みました。

## 当該投資信託のポートフォリオ

本ファンドでは当初の運用方針通り、3つの組入れファンド（先進国株式：ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・コア・エクイティ・ファンド、新興国株式：同エマージング・マーケット・バリュー・ファンド、先進国債券：同グローバル・ショート・フィクスト・インカム・ファンド）への投資を通じて日本を含む世界の株式（新興国の株式を含みます。）および債券に広く分散投資を行うことで、インカムゲインの獲得と信託財産の成長を図ることを目的として運用を行いました。

2024年1月31日設定以降、概ね先進国株式50%、新興国株式10%、先進国債券40%となっています。

組入れファンドにおける当期の運用状況は以下の通りです。

### <ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・コア・エクイティ・ファンド>

投資対象銘柄において、3つの側面（=ディメンション、相対株価が低いこと、時価総額が下位であること、収益力が高いこと）に対する傾斜度合いを相対的に高めながら、広範に分散投資することによって、期待リターンの向上を目指しました。2024年3月末時点での先進26ヶ国の8,253銘柄に分散投資しています。

## &lt;ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー エマージング・マーケット・バリュー・ファンド&gt;

投資対象銘柄において、3つの側面（＝ディメンション、相対株価が低いこと、時価総額が下位であること、収益力が高いこと）に対する傾斜度合いを相対的に高めながら、広範に分散投資することによって、期待リターンの向上を目指しました。2024年3月末時点での新興24ヶ国の3,240銘柄に分散投資しています。

## &lt;ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・ショート・フィクスト・インカム・ファンド&gt;

投資対象銘柄において、2つの側面（＝ディメンション、期間プレミアム<sup>\*①</sup>、クレジット・プレミアム<sup>\*②</sup>）に着目しながら、期待リターンの最大化を目指しました。2024年3月末時点での先進15ヶ国の251銘柄に為替をヘッジした上で分散投資しています。

\*①期間プレミアム：債券の償還期限の長さを源泉とする期待収益、\*②クレジット・プレミアム：債券発行体の信用度を源泉とする期待収益

**当該投資信託のベンチマークとの差異**

本ファンドは運用の目標となるベンチマークや参考指数がないため、本項目は記載しておりません。

**分配金（1万口当たり、税引前）**

本ファンドの収益分配方針に従い、基準価額水準、市場動向等を勘案し、当期は無分配といたしました。留保益の運用については、委託会社の判断に基づき、元本部分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)

	第1期	
	自 2024年1月31日 至 2024年4月22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		439

(注1) 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、ファンドの收益率とは異なります。

(注2) 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**

概ね先進国株式50%、新興国株式10%、先進国債券40%の組入比率を維持します。

## ■ 1万口当たりの費用明細 (2024年1月31日～2024年4月22日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 17	% 0.170	(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10,312円です。
(投信会社)	(8)	(0.079)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(9)	(0.085)	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)	(0.006)	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	4	0.043	(b) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]}$
(監査費用)	(3)	(0.035)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(1)	(0.008)	目論見書等の法定書類の作成・印刷・届出および交付に係る費用ならびにファンドの計理業務およびこれらに付随する業務に係る費用
合計	21	0.213	

(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、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

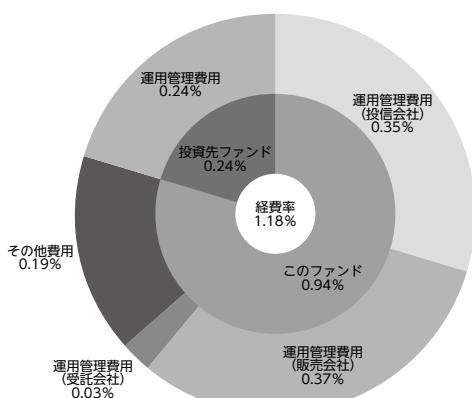
(注3) 「比率」欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、本ファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

### (参考情報)

#### 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経費率（年率）は1.18%です。



経費率 (①+②)	1.18%
①このファンドの費用の比率	0.94%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.24%
(注1) ①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。	
②の費用は、各月末の投資先ファンドの保有比率に当該投資先ファンドの運用管理費用率を乗じて算出した概算値です。	
各費用は、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含みません。	
各比率は、年率換算した値です。	
投資先ファンドとは、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。）です。	
①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。	
①の費用と②の費用は、計上された期間が異なる場合があります。	
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1月31日～2024年4月22日）

### 投資信託証券、投資証券

銘柄名	買付			売付		
	口数	金額	千円	口数	金額	千円
外アイルランド	ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・ショート・フィクスト・インカム・ファンド	1,098,833	898,218	□	—	—
	ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・コア・エクイティ・ファンド	407,464	1,064,257	—	—	—
	ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー エマージング・マーケット・バリュー・ファンド	148,392	217,046	—	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■利害関係人との取引状況等（2024年1月31日～2024年4月22日）

### (1) 利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

### (2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当期中における売買委託手数料の支払いはありません。

## ■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1月31日～2024年4月22日）

該当事項はございません。

## ■委託会社による自社が設定する投資信託の受益証券の自己取引状況（2024年1月31日～2024年4月22日）

該当事項はございません。

## ■組入資産の明細（2024年4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

ファンド名	当期末			
	口数	評価額	比率	率
（アイルランド）	ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・ショート・フィクスト・インカム・ファンド	1,098,833	893,867	40.2
	ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・コア・エクイティ・ファンド	407,464	1,085,136	48.8
	ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー エマージング・マーケット・バリュー・ファンド	148,392	224,336	10.1
合計		1,654,690	2,203,339	99.0

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 比率欄は純資産総額に対する比率。

## ■投資信託財産の構成

2024年4月22日現在

項 目	当期 末	
	評 価 額 千円	比 率 %
投 資 証 券	2,203,339	96.0
コ ー ル ・ 口 一 ナ 等 、 そ の 他	91,594	4.0
投 資 信 託 財 産 総 額	2,294,933	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4月22日) 現在

項 目	当期 末
(A) 資 産	2,294,933,254円
コ ー ル ・ 口 一 ナ 等	91,593,417
投 資 証 券(評価額)	2,203,339,812
未 収 利 息	25
(B) 負 債	69,576,124
未 払 金	67,000,000
未 払 信 託 報 酬	2,132,453
そ の 他 未 払 費 用	443,671
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,225,357,130
元 本	2,131,689,319
次 期 繰 越 損 益 金	93,667,811
(D) 受 益 権 総 口 数	2,131,689,319口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,439円

(注1) 当初設定元本額 439,176,646円、期中追加設定元本額 1,697,761,488円、期中一部解約元本額5,248,815円。

(注2) 1口当たり純資産額は、1.0439円です。

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンド監査は終了しておりません。

## ■損益の状況

自2024年1月31日 至2024年4月22日

項 目	当期
(A) 配 当 等 収 益	4,506,613円
受 取 配 当 金	4,520,446
受 取 利 息	903
支 払 利 息	△ 14,736
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	23,674,908
売 買	28,167,971
賣 買	△ 4,493,063
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,576,124
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	25,605,397
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	68,062,414
(配 当 等 相 当 額)	( 4,160,266)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 63,902,148)
(F) 計 (D+E)	93,667,811
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(F+G)	93,667,811
追 加 信 託 差 損 益 金	68,062,414
(配 当 等 相 当 額)	( 4,160,266)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 63,902,148)
分 配 準 備 積 立 金	25,605,397

(注1) 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2) 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3) 損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差引いた差額分をいいます。

(注4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,094,691円)、費用控除後の有価証券等損益額(21,510,706円)、および信託約款に規定する収益調整金(68,062,414円)より分配対象収益は93,667,811円(10,000口当たり439円)ですが、当期に分配した金額はありません。

## ■分配金のお知らせ

	第	1	期
1万口当たり分配金(税込み)			0円

(注1) 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

(注2) 分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合

分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。

(注3) 分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。

## お知らせ

該当事項はございません。

## ■指定投資信託証券の運用状況

(注1) 指定投資信託証券の運用状況データは2024年3月29日現在のものです。本データは、ディメンショナル・ファンド・アドバイザーズからの情報を基に委託会社が作成したものです。

(注2) 各項目の比率は、指定投資信託証券の資産総額に対する割合です。また、各項目の比率は小数点以下第2位を四捨五入しているため、合計が100%にならない場合があります。以下、本ページにおいて同じ。

### ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・コア・エクイティ・ファンド

#### ○組入上位5銘柄

銘柄名		国	業種	比率
1	マイクロソフト	米国	情報技術	2.9%
2	アップル	米国	情報技術	2.8%
3	エヌビディア	米国	情報技術	2.1%
4	アマゾン・ドット・コム	米国	一般消費財・サービス	1.5%
5	アルファベット	米国	コミュニケーション・サービス	1.4%
組入銘柄数			8,253銘柄	

#### ○国別構成比

国	比率
米国	69.1%
日本	7.0%
英国	4.0%
カナダ	3.3%
フランス	2.7%
その他	13.9%
合計	100.0%

(注) 国は組入銘柄のリスク所在国を示しています。(該当投資顧問会社による定義)

### ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー エマージング・マーケット・バリュー・ファンド

#### ○組入上位5銘柄

銘柄名		国	業種	比率
1	リライアンス・インダストリーズ	インド	エネルギー	3.4%
2	ブラジル石油公社	ブラジル	エネルギー	2.9%
3	サムスン電子	韓国	情報技術	2.2%
4	中国建設銀行	中国	金融	2.1%
5	鴻海精密工業	台湾	情報技術	1.8%
組入銘柄数			3,240銘柄	

#### ○国別構成比

国	比率
中国	22.4%
台湾	19.1%
インド	19.1%
韓国	12.7%
ブラジル	5.0%
その他	21.7%
合計	100.0%

(注) 国は組入銘柄のリスク所在国を示しています。(該当投資顧問会社による定義)

### ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・ショート・フィクスト・インカム・ファンド

#### ○利回り・特性値

最終利回り	5.02%
平均クーポン	2.12%
平均残存期間	0.21年
平均デュレーション	0.20年
平均格付	A A

(注1) 最終利回りは、実際の投資家利回りとは異なります。なお、ヘッジコストは-4.97%程度です。

(注2) デュレーションとは、金利の変化に対する債券の価格感応度を示す指標で、単位は「年」で表示されます。この値が長い(短い)ほど、金利の変化に対する債券価格の変動率が大きく(小さく)なります。

(注3) 平均格付とは、基準日時点での保有債券に係る該当投資顧問会社が定義した信用格付を加重平均したものであり、指定投資信託証券に係る信用格付ではありません。

#### ○種別構成比

債券種別	比率
国債／政府機関債	70.2%
社債	9.6%
その他	20.3%

#### ○格付構成比

格付	比率
A A A	43.9%
A A	54.1%
A	2.0%
B B B	-
その他	-

(注) 格付構成は、主要な格付機関のデータを基に該当投資顧問会社が定義した分類によるものです。

#### ○国別構成比

国	比率
カナダ	19.2%
英國	19.2%
米国	10.3%
国際機関	9.6%
オーストラリア	9.5%
オランダ	6.0%
その他	26.2%
合計	100.0%

(注) 国は組入銘柄の発行体の所在国を示しています。(該当投資顧問会社による定義)

## ○銘柄数

銘柄数

251

## <指定投資信託証券の概要>

ファンド名	ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・コア・エクイティ・ファンド
ファンド形態	アイルランド籍外国証券投資法人（円建て）
投資目的	中長期的な値上がり益の最大化を目指します。
主な投資対象	主に、投資可能と判断される先進国の株式に投資します。その際、割安と判断する株式や時価総額の比較的小さい小型株により比重をおきます。
主な投資制限	①先進国的主要市場で取引されている先進国の株式を主要投資対象とします。 ②先進国で取引されている株式のうち、新興国の株式と判断される株式への投資割合は、原則として信託財産の資産総額の20%を超えないものとします。 ③リスク管理等を目的として、金融派生商品に投資することができます。その際、為替予約取引および先物取引以外の金融派生商品の利用を目指すものではありません。また実質的な投資比率が資産総額の100%を超えるような取引は行いません。
投資顧問会社	ディメンショナル・ファンズ・アドバイザーズ・リミテッド
管理会社	ディメンショナル・アイルランド・リミテッド
決算日	毎年11月30日

## ■損益計算書／保有有価証券明細

「ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・コア・エクイティ・ファンド」は本ファンドの設定日（2024年1月31日）以降、決算日が到来していないため、開示できる情報はありません。

ファンド名	ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー エマージング・マーケット・バリュー・ファンド
ファンド形態	アイルランド籍外国証券投資法人（円建て）
投資目的	中長期的な値上がり益の最大化を目指します。 主に、投資可能と判断される新興国（下記の投資対象国・地域リスト参照）の上場株式に投資します。その際、主に対象銘柄の時価総額と比較して資産価値が高いと判断される割安株に着目します。加えて、投資顧問会社の判断により預託証券（ADR等）も投資対象に含めることができます。なお、預託証券（ADR等）は以下の投資対象国・地域リスト以外の国・地域を含む場合があります。
主な投資対象	「投資対象国・地域リスト」 ブラジル、チリ、中国、コロンビア、チェコ、エジプト、ギリシャ、ハンガリー、インド、インドネシア、クウェート、マレーシア、メキシコ、ペルー、フィリピン、ポーランド、カタール、サウジアラビア、南アフリカ、韓国、台湾、タイ、トルコ、アラブ首長国連邦 ※投資顧問会社は上記リストを隨時見直しできるものとし、ファンドの決算報告書類においてその見直し内容を開示するものとします。
主な投資制限	リスク管理等を目的として、金融派生商品に投資することができます。その際、為替予約取引および先物取引以外の金融派生商品の利用を目指すものではありません。また実質的な投資比率が資産総額の100%を超えるような取引は行いません。
投資顧問会社	ディメンショナル・ファンズ・アドバイザーズ・リミテッド
管理会社	ディメンショナル・アイルランド・リミテッド
決算日	毎年11月30日

### ■損益計算書／保有有価証券明細

「ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー エマージング・マーケット・バリュー・ファンド」は本ファンドの設定日（2024年1月31日）以降、決算日が到来していないため、開示できる情報はありません。

ファンド名	ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・ショート・フィクスト・インカム・ファンド
ファンド形態	アイルランド籍外国証券投資法人（円建て）
投資目的	投資元本の保全を目指しながら、金利収入獲得の最大化を目指します。
主な投資対象	主として国債、政府機関・国際機関債や投資適格の社債などの先進国の固定金利／変動金利中短期公社債（残存年限5年以内）に為替をヘッジした上で投資することで、為替レートの変動による影響を抑えつつ、安定した収益を目指します。
主な投資制限	<p>①コマーシャル・ペーパーへの投資にあたっては、投資顧問会社において原則Prime 1以上と評価される発行体に投資するものとします。</p> <p>②その他の公社債への投資にあたっては、投資顧問会社において原則AA-以上と評価される発行体に投資するものとします。格付がないものについては、運用会社がこれらと同等以上と判断するものとします。</p> <p>③リスク管理等を目的として、金融派生商品に投資することがあります。その際、為替予約取引および先物取引以外の金融派生商品の利用を目指すものではありません。また実質的な投資比率が資産総額の100%を超えるような取引は行いません。</p>
投資顧問会社	ディメンショナル・ファンズ・アドバイザーズ・リミテッド
管理会社	ディメンショナル・アイルランド・リミテッド
決算日	毎年11月30日

### ■損益計算書／保有有価証券明細

「ディメンショナル・ファンズ・ピーエルシー グローバル・ショート・フィクスト・インカム・ファンド」は本ファンドの設定日（2024年1月31日）以降、決算日が到来していないため、開示できる情報はありません。