

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	信託期間は2024年2月9日から無期限です。												
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。												
主要運用対象	フランクリン・テンプレルトン・ジャパン株式会社が運用を行う「フランクリン・テンプレルトン・イノベーション世界株式ファンド(適格機関投資家専用)」(以下「主要投資対象ファンド」といいます。))を主要投資対象とします。												
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。株式への直接投資は行いません。外貨建資産への直接投資は行いません。ただし、主要投資対象ファンドを通じた実質投資割合には制限を設けません。デリバティブの直接利用は行いません。また、主要投資対象ファンドを通じたデリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定します。												
分配方針	原則として、年6回(1月、3月、5月、7月、9月、11月の各7日(休業日の場合は翌営業日))決算を行います。分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。))等の全額とします。決算日の前営業日の基準価額(1万口当たり。既払分配金は加算しません。))の水準に応じて、以下の金額の分配を目指します。 <table><tr><th>決算日の前営業日の基準価額</th><th>分配金額(1万口当たり、税引前)</th></tr><tr><td>11,000円未満</td><td>基準価額の水準等を勘案して決定</td></tr><tr><td>11,000円以上12,000円未満</td><td>200円</td></tr><tr><td>12,000円以上13,000円未満</td><td>300円</td></tr><tr><td>13,000円以上14,000円未満</td><td>400円</td></tr><tr><td>14,000円以上</td><td>500円</td></tr></table> ※基準価額の水準に応じて、分配金額は変動します。また、基準価額が上記表に記載された基準価額の水準に一度でも到達すれば、その水準に応じた分配を継続するということではありません。 ※毎決算日の前営業日から当該決算日までに基準価額が急激に変動した場合等、基準価額水準や市況動向等によっては、委託会社の判断で上記とは異なる分配金額となる場合や分配金が支払われない場合があります。 ※分配金を支払うことにより基準価額は下落します。このため、基準価額に影響を与え、次期以降の分配金額は変動する場合があります。 ※上記表に記載された基準価額及び分配金額は、将来の運用の成果について示唆あるいは保証するものではありません。また、将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。 分配金額については、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、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	決算日の前営業日の基準価額	分配金額(1万口当たり、税引前)	11,000円未満	基準価額の水準等を勘案して決定	11,000円以上12,000円未満	200円	12,000円以上13,000円未満	300円	13,000円以上14,000円未満	400円	14,000円以上	500円
決算日の前営業日の基準価額	分配金額(1万口当たり、税引前)												
11,000円未満	基準価額の水準等を勘案して決定												
11,000円以上12,000円未満	200円												
12,000円以上13,000円未満	300円												
13,000円以上14,000円未満	400円												
14,000円以上	500円												

イノベーション・インサイト
世界株式戦略ファンド
(予想分配金提示型・奇数月決算型)

運用報告書(全体版)

第3期(決算日 2024年 7月8日)
第4期(決算日 2024年 9月9日)
第5期(決算日 2024年11月7日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

■口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
■当運用報告書についてのお問い合わせ
フリーダイヤル:0120-668001
(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

設定以来の運用実績

作成期	決 算 期	基 準 価 額			債 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		(分配落)	税 分 配 込 金	期 騰 落 中 率			
第1	設定日(2024年 2月9日)	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	百万円 0.5
	第1期(2024年 3月7日)	10,135	0	1.4	—	84.3	123
	第2期(2024年 5月7日)	10,439	0	3.0	0.0	96.0	359
第2	第3期(2024年 7月8日)	11,848	200	15.4	0.0	96.8	472
	第4期(2024年 9月9日)	9,494	0	△19.9	0.0	96.1	407
	第5期(2024年11月7日)	11,389	200	22.1	0.0	97.9	491

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

当作成期中の基準価額の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		債 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
			騰 落 率		
第3期	(期 首)2024年 5月7日	円 10,439	% —	% 0.0	% 96.0
	5月末	10,699	2.5	0.0	98.1
	6月末	11,772	12.8	0.0	96.3
	(期 末)2024年 7月8日	12,048	15.4	0.0	96.8
第4期	(期 首)2024年 7月8日	11,848	—	0.0	96.8
	7月末	10,238	△13.6	0.0	97.8
	8月末	10,152	△14.3	0.0	96.0
	(期 末)2024年 9月9日	9,494	△19.9	0.0	96.1
第5期	(期 首)2024年 9月9日	9,494	—	0.0	96.1
	9月末	10,341	8.9	0.0	98.0
	10月末	11,362	19.7	0.0	98.0
	(期 末)2024年11月7日	11,589	22.1	0.0	97.9

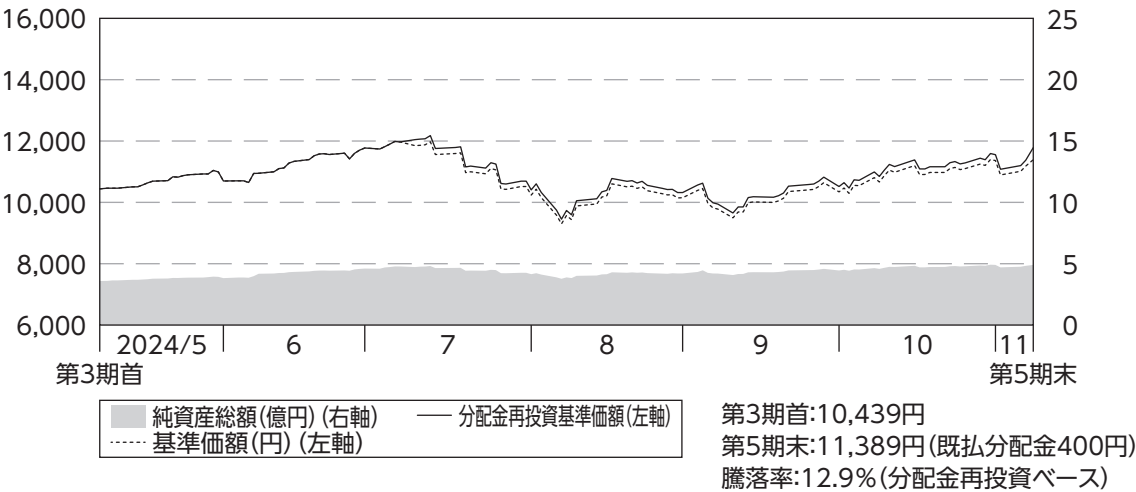
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

当作成期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、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。
- (注2) 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、ファンドの購入金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。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2024年5月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当ファンドの主な投資対象である「フランクリン・テンプルトン・イノベーション世界株式ファンド(適格機関投資家専用)」の基準価額が上昇したことから、当ファンドの基準価額(分配金再投資ベース)も上昇しました。

組入ファンド	投資資産	当作成対象 期間末組入比率	騰落率
フランクリン・テンプルトン・イノベーション世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	世界のイノベーション企業の株式	97.9%	13.9%
マネープールマザーファンド	わが国の公社債等	0.0%	0.1%

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

投資環境

当作成期の米国株式市場は上昇しました。AI(人工知能)関連の需要拡大や好業績期待を背景に大型ハイテク株主導で7月上旬にかけて上昇しました。その後は、対中輸出規制の強化検討の報道や、市場予想を下回る雇用統計を受けて景気の先行きへの懸念が強まるなかで8月上旬にかけて軟調に推移しました。当作成期末にかけては、FRB(米連邦準備理事会)が0.5%の大幅利下げを決定したほか、雇用統計の改善を受けて景気の先行きへの懸念が後退し堅調に推移しました。

当作成期の欧州株式市場は総じて下落しました。欧州議会選挙やフランス下院の解散・総選挙などを受けた政治リスクの高まりのほか、米国で景気の先行きへの懸念が強まって8月上旬にかけて下落しました。その後は、ECB(欧州中央銀行)による追加利下げや中国当局による景気刺激策が好感されたものの、中東情勢の緊迫化や軟調な企業決算などを受けて軟調に推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

○当ファンド

「フランクリン・テンプルトン・イノベーション世界株式ファンド(適格機関投資家専用)」の組入比率を高位に保つ運用を行いました。

・フランクリン・テンプルトン・イノベーション世界株式ファンド(適格機関投資家専用)

イノベーション企業(人々の生活を変革する製品、アイデア、サービス、技術、ビジネスモデル等を有すると考えられる企業)の中から持続的な成長性が期待できる銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築しました。当作成期末時点では、エヌビディア(米国、情報技術)、アマゾン・ドット・コム(米国、一般消費財・サービス)等を組み入れ上位としました。国別では米国を組み入れの中心とし、セクター別では情報技術、一般消費財・サービスを上位としました。

<投資対象ファンドについては、運用会社からの情報に基づき掲載しています。>

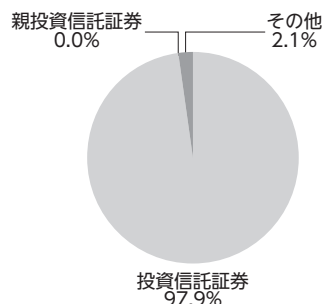
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

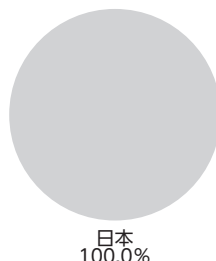
	当作成期末
	2024年11月7日
フランクリン・テンプルトン・イノベーション世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	97.9%
マネープールマザーファンド	0.0%
その他	2.1%
組入ファンド数	2

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

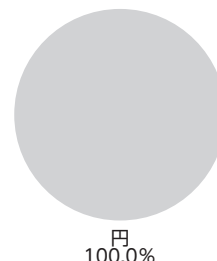
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきます。

なお、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、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目	第3期	第4期	第5期
	2024年5月8日～ 2024年7月8日	2024年7月9日～ 2024年9月9日	2024年9月10日～ 2024年11月7日
当期分配金 (円)	200	－	200
(対基準価額比率) (%)	(1.660)	(－)	(1.726)
当期の収益 (円)	199	－	0
当期の収益以外 (円)	0	－	199
翌期繰越分配対象額 (円)	1,848	1,577	1,388

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)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)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3)－印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

○当ファンド

フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社が運用を行う「フランクリン・テンプルトン・イノベーション世界株式ファンド(適格機関投資家専用)」への投資を通じて、主として米国を中心に日本を含む世界各国の金融商品取引所等に上場(上場予定を含みます。)している株式(預託証書(DR)を含みます。)に投資します。

・フランクリン・テンプルトン・イノベーション世界株式ファンド(適格機関投資家専用)

主に「フランクリン・テンプルトン・イノベーション世界株式マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主として米国を中心に世界の金融商品取引所に上場している株式に投資することにより、信託財産の長期的な成長を目指します。

・マネープールマザーファンド

主としてわが国の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当作成期		項目の概要
	(2024年5月8日～2024年11月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	64円	0.599%	(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10,760円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付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 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(18)	(0.166)	
(販売会社)	(45)	(0.416)	
(受託会社)	(2)	(0.017)	
(b) 売買委託手数料	－	－	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{\text{〔期中の売買委託手数料〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(－)	(－)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(商品)	(－)	(－)	
(先物・オプション)	(－)	(－)	
(c) 有価証券取引税	－	－	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{\text{〔期中の有価証券取引税〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(－)	(－)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(公社債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(d) その他費用	0	0.003	(d) その他費用＝ $\frac{\text{〔期中のその他費用〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}} \times 10,000$ 保管費用は、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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(－)	(－)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(－)	(－)	
合計	64	0.602	

(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。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

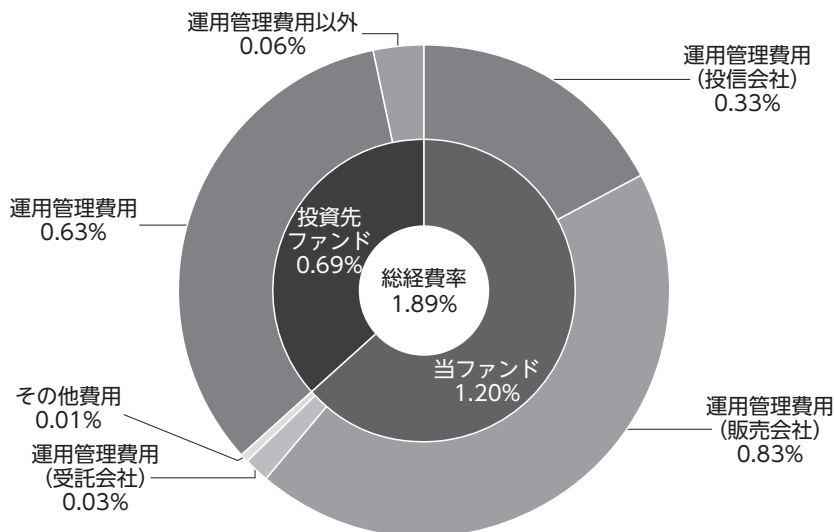
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません(マザーファンドを除く)。

<参考情報>

総経費率

当作成期中の運用・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1.89%です。



総経費率(①+②+③)	1.89%
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	0.63%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

(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、売買委託手数料及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、当ファンドが組み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)投資先ファンドの費用は投資先運用会社等から提供された入手可能なデータや情報を基に三井住友トラスト・アセットマネジメントが作成しています。

(注8)投資先ファンドの運用管理費用の比率は、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率を乗じて算出した概算値を使用している場合があります。

(注9)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。

売買および取引の状況

<投資信託受益証券>

		当 作 成 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国内	フランクリン・テンブルトン・イノベーション世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	千口 51,572	千円 89,000	千口 5,353	千円 9,549

(注) 金額は受渡代金です。

利害関係人※との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

区 分	当 作 成 期					
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
投資信託受益証券	百万円 89	百万円 89	% 100.0	百万円 9	百万円 9	% 100.0
金 銭 信 託	0.014609	0.014609	100.0	0.014609	0.014609	100.0
コール・ローン	1,469	316	21.5	1,463	314	21.5

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<マネープールマザーファンド>

区 分	当 作 成 期					
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 116	百万円 116	% 100.0	百万円 116	百万円 116	% 100.0
コール・ローン	10,156,714	2,179,038	21.5	10,145,022	2,175,242	21.4

<平均保有割合 0.0%>

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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

当作成期首残高 (元)	当 作 成 期 設 定 元	当 作 成 期 解 約 元	当作成期末残高 (元)	取 引 の 理 由
千円 500	千円 —	千円 500	千円 —	当初設定時における取得およびその解約

組入資産の明細

<当ファンドが組み入れた邦貨建ファンドの明細>

フ ァ ン ド 名	当 作 成 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
株式ファンド	千口	千円	%
フランクリン・テンブルトン・イノベーション世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	252, 873	481, 193	97. 9

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<親投資信託残高>

種 類	前作成期末	当 作 成 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
マ ネ ー プ ー ル マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 9	千口 9	千円 10

(注) 親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、178, 557, 840千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 481, 193	% 96. 0
マ ネ ー プ ー ル マ ザ ー フ ァ ン ド	10	0. 0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	20, 084	4. 0
投 資 信 託 財 産 総 額	501, 287	100. 0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	第 3 期 末 2024年7月8日現在	第 4 期 末 2024年9月9日現在	第 5 期 末 2024年11月7日現在
(A) 資 産	481,730,958円	408,602,927円	501,287,857円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	23,726,170	16,874,385	20,084,139
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	457,994,743	391,718,439	481,193,592
マネーブルマザーファンド(評価額)	10,002	10,003	10,007
未 収 利 息	43	100	119
(B) 負 債	8,820,118	883,151	9,522,055
未 払 収 益 分 配 金	7,982,676	—	8,636,072
未 払 信 託 報 酬	833,605	879,103	881,922
そ の 他 未 払 費 用	3,837	4,048	4,061
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	472,910,840	407,719,776	491,765,802
元 本	399,133,847	429,437,119	431,803,639
次 期 繰 越 損 益 金	73,776,993	△21,717,343	59,962,163
(D) 受 益 権 総 口 数	399,133,847口	429,437,119口	431,803,639口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C/D)	11,848円	9,494円	11,389円

■損益の状況

項 目	第 3 期 自 2024年5月8日 至 2024年7月8日	第 4 期 自 2024年7月9日 至 2024年9月9日	第 5 期 自 2024年 9月10日 至 2024年11月 7日
(A) 配 当 等 収 益	1,476円	3,419円	3,513円
受 取 利 息	1,476	3,419	3,513
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	61,779,452	△96,192,902	90,948,164
売 買 益 損	61,779,452	82,764	91,024,374
信 託 報 酬 等	△837,442	△96,275,666	△76,210
(C) 信 託 報 酬 等	△837,442	△883,151	△885,983
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	60,943,486	△97,072,634	90,065,694
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	6,871,957	59,759,095	△37,230,992
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	13,944,226	15,596,196	15,763,533
(配 当 等 相 当 額)	(3,135,647)	(7,989,973)	(8,495,533)
(売 買 損 益 相 当 額)	(10,808,579)	(7,606,223)	(7,268,000)
(G) 計 (D+E+F)	81,759,669	△21,717,343	68,598,235
(H) 収 益 分 配 金	△7,982,676	0	△8,636,072
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	73,776,993	△21,717,343	59,962,163
追 加 信 託 差 損 益 金	13,944,226	15,596,196	15,763,533
(配 当 等 相 当 額)	(3,135,647)	(7,989,973)	(8,495,533)
(売 買 損 益 相 当 額)	(10,808,579)	(7,606,223)	(7,268,000)
分 配 準 備 積 立 金	59,832,767	59,759,095	50,994,335
繰 越 損 益 金	—	△97,072,634	△6,795,705

(注1) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (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) (F) 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し引いた差額分をいいます。

＜注記事項＞

※当ファンドの第3期首元本額は344,318,108円、第3～5期中追加設定元本額は88,937,872円、第3～5期中一部解約元本額は1,452,341円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 3 期	第 4 期	第 5 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	1,476円	－円	3,513円
(B) 有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)	60,942,010円	－円	－円
(C) 収益調整金額	13,944,226円	7,989,973円	8,967,828円
(D) 分配準備積立金額	6,871,957円	59,759,095円	59,626,894円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	81,759,669円	67,749,068円	68,598,235円
(F) 期末残存口数	399,133,847口	429,437,119口	431,803,639口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	2,048円	1,577円	1,588円
(H) 分配金額(1万口当たり)	200円	－円	200円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	7,982,676円	－円	8,636,072円

分配金のお知らせ

	第3期	第4期	第5期
1 万 口 当 た り 分 配 金	200円	0円	200円

(注)分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

【分配金の課税上の取扱いについて】

- ・収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

- A. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、
- B. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

- ・課税上の詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めいたします。
- ・税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になる場合があります。

お知らせ

該当事項はありません。

組入投資信託証券の内容

■フランクリン・テンプルトン・イノベーション世界株式ファンド（適格機関投資家専用）

●ファンドの概要

運 用 会 社	フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社
主な投資対象・投資地域	米国を中心に世界の金融商品取引所に上場している株式
運用の基本方針等	この投資信託は、主として米国を中心に世界の金融商品取引所に上場している株式に投資することにより、信託財産の長期的な成長を目指します。

●損益の状況

項 目	第 2 期 自 2023年10月21日 至 2024年10月21日
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	6,350,691,071円
売 買 益	6,854,018,258
売 買 損	△503,327,187
(B) 信 託 報 酬 等	△143,218,943
(C) 当 期 損 益 金 (A+B)	6,207,472,128
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	833,301,073
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,902,589,370
(配 当 等 相 当 額)	(512,564,256)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,390,025,114)
(F) 計 (C+D+E)	10,943,362,571
次 期 繰 越 損 益 金 (F)	10,943,362,571
追 加 信 託 差 損 益 金	3,902,589,370
(配 当 等 相 当 額)	(515,534,571)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,387,054,799)
分 配 準 備 積 立 金	7,040,773,201

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

種 類	第1期末	第2期末	
	口 数	口 数	評 価 額
フランクリン・テンブルトン・イノベーション世界株式マザーファンド	千口 9,434,232	千口 13,607,833	千円 24,754,009

下記は、フランクリン・テンブルトン・イノベーション世界株式マザーファンド全体の内容です。

<外国株式>

銘 柄	第1期末		第2期末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千ドル	千円	
ADMA BIOLOGICS INC	—	8	13	1,945	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	—	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	38	154	2,410	360,273	半導体・半導体製造装置
AEROVIRONMENT INC	—	2	51	7,683	資本財
AIRBNB INC-CLASS A	3	—	—	—	消費者サービス
ALPHABET INC-CL A	254	448	7,326	1,094,864	メディア・娯楽
AMAZON.COM INC	391	640	12,101	1,808,285	一般消費財・サービス流通・小売り
AMPHENOL CORP-CL A	19	76	516	77,237	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANALOG DEVICES INC	78	127	2,919	436,318	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	19	—	—	—	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	97	160	3,761	562,067	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPFOLIO INC - A	—	13	266	39,884	ソフトウェア・サービス
APPROVIN CORP-CLASS A	—	42	620	92,703	ソフトウェア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	4	19	766	114,555	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARM HOLDINGS PLC	10	5	91	13,697	半導体・半導体製造装置
ARRAY TECHNOLOGIES INC	31	—	—	—	資本財
ASCENDIS PHARMA A/S - ADR	—	6	90	13,490	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR	98	62	488	72,973	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ATLASSIAN CORP-CL A	19	—	—	—	ソフトウェア・サービス
AXON ENTERPRISE INC	31	59	2,598	388,361	資本財
BAKER HUGHES CO	77	65	238	35,659	エネルギー
BOOKING HOLDINGS INC	1	2	1,152	172,287	消費者サービス
BOSTON SCIENTIFIC CORP	—	23	205	30,742	ヘルスケア機器・サービス
BROADCOM INC	3	442	7,963	1,190,047	半導体・半導体製造装置
CADENCE DESIGN SYS INC	90	127	3,302	493,467	ソフトウェア・サービス
CELESTICA INC	—	19	115	17,193	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DAYFORCE INC	7	—	—	—	商業・専門サービス
CLEARWATER ANALYTICS HDS-A	—	6	17	2,677	ソフトウェア・サービス
CRINETICS PHARMACEUTICALS IN	—	21	127	19,125	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	1	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	58	86	2,377	355,229	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DATADOG INC - CLASS A	39	26	342	51,117	ソフトウェア・サービス
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	28	54	579	86,532	ソフトウェア・サービス
DEXCOM INC	11	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
DOORDASH INC - A	3	46	708	105,898	消費者サービス
DUOLINGO	6	6	193	28,945	消費者サービス
DOXIMITY INC-CLASS A	—	7	33	4,966	ヘルスケア機器・サービス
ASPEN TECHNOLOGY INC	7	1	33	5,073	ソフトウェア・サービス
ENERSYS	3	—	—	—	資本財
ENTEGRIS INC	38	13	137	20,516	半導体・半導体製造装置
META PLATFORMS INC-A	31	137	7,939	1,186,346	メディア・娯楽
FAIR ISAAC CORP	1	3	653	97,609	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	13	13	106	15,854	資本財
GARTNER INC	2	9	490	73,249	ソフトウェア・サービス
GLOBUS MEDICAL INC - A	—	2	16	2,471	ヘルスケア機器・サービス
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	6	124	18,592	ソフトウェア・サービス

銘	柄	第1期末		第2期末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千ドル	千円	
HAEMONETICS CORP/MASS		13	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
HARROW INC		—	3	21	3,152	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HEALTH EQUITY INC		13	31	279	41,729	ヘルスケア機器・サービス
HEICO CORP		13	—	—	—	資本財
HUBSPOT INC		23	19	1,026	153,386	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC		28	28	1,297	193,845	ヘルスケア機器・サービス
INSMED INC		—	18	140	20,996	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INSPIRE MEDICAL SYSTEMS INC		18	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP		18	29	67	10,153	半導体・半導体製造装置
INTRA-CELLULAR THERAPIES INC		—	10	83	12,443	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC		39	64	3,929	587,254	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC		39	67	3,502	523,400	ヘルスケア機器・サービス
KLA CORP		21	31	2,163	323,336	半導体・半導体製造装置
KLAVIYO INC-A		18	27	101	15,137	ソフトウェア・サービス
KRYSTAL BIOTECH INC		0.61	9	178	26,615	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LAM RESEARCH CORP		20	—	—	—	半導体・半導体製造装置
LAM RESEARCH CORP		—	320	2,332	348,477	半導体・半導体製造装置
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP		38	—	—	—	半導体・半導体製造装置
LIFE360 INC		—	11	52	7,888	ソフトウェア・サービス
LIGAND PHARMACEUTICALS		—	4	50	7,567	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELI LILLY AND COMPANY		15	47	4,340	648,550	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MSCI INC		9	4	298	44,610	金融サービス
MANHATTAN ASSOCIATES INC		7	20	611	91,327	ソフトウェア・サービス
MASTERCARD INC - A		66	108	5,619	839,696	金融サービス
MERCADOLIBRE INC		7	12	2,653	396,559	一般消費財・サービス流通・小売り
MICROSOFT CORP		174	287	12,040	1,799,149	ソフトウェア・サービス
MOBILEYE GLOBAL INC-A		21	—	—	—	自動車・自動車部品
MONGODB INC		31	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC		20	32	2,933	438,421	半導体・半導体製造装置
MOODY'S CORP		3	10	490	73,355	金融サービス
NATERA INC		7	64	791	118,209	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETFLIX INC		—	3	295	44,175	メディア・娯楽
NEXTRACKER INC-CL A		19	—	—	—	資本財
NOVO-NORDISK A/S-SPONS ADR		—	22	267	39,986	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NVIDIA CORP		148	1,275	17,605	2,630,829	半導体・半導体製造装置
OCEANEERING INTL INC		54	62	150	22,476	エネルギー
ORACLE CORP		3	—	—	—	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC		42	64	2,402	359,029	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC		11	—	—	—	商業・専門サービス
PAYLOCITY HOLDING CORP		11	—	—	—	商業・専門サービス
PROCORE TECHNOLOGIES INC		38	—	—	—	ソフトウェア・サービス
PROCEPT BIOROBOTICS CORP		—	40	282	42,222	ヘルスケア機器・サービス
QUANTA SERVICES INC		39	45	1,432	214,002	資本財
REPLIGEN CORP		5	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROBLOX CORP -CLASS A		—	3	14	2,225	メディア・娯楽
ROPER TECHNOLOGIES INC		19	12	721	107,739	ソフトウェア・サービス
SPS COMMERCE INC		5	8	161	24,058	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE INC		39	26	768	114,775	ソフトウェア・サービス
SAMSARA INC-CL A		—	13	66	9,929	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD		117	—	—	—	エネルギー
SEA LTD-ADR		—	4	39	5,911	メディア・娯楽
SERVICENOW INC		45	67	6,195	925,731	ソフトウェア・サービス
SHOCKWAVE MEDICAL INC		2	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A		11	—	—	—	ソフトウェア・サービス

銘	柄	第1期末		第2期末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千ドル	千円	
STRYKER CORP		3	3	125	18,720	ヘルスケア機器・サービス
SYNOPSYS INC		48	64	3,255	486,490	ソフトウェア・サービス
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR		—	32	649	97,088	半導体・半導体製造装置
TEMPUS AI INC		—	26	129	19,316	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA INC		105	86	1,907	284,973	自動車・自動車部品
TRADE DESK INC/THE -CLASS A		14	13	160	23,939	メディア・娯楽
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC		39	44	2,695	402,812	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A		97	129	1,727	258,084	金融サービス
TRANSMEDICS GROUP INC		—	9	121	18,180	ヘルスケア機器・サービス
TRANSUNION		1	—	—	—	商業・専門サービス
TYLER TECHNOLOGIES INC		9	10	601	89,951	ソフトウェア・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC		127	195	1,548	231,384	運輸
UNITED THERAPEUTICS CORP		—	8	302	45,144	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC		19	13	751	112,354	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A		17	3	81	12,170	ヘルスケア機器・サービス
VERALTO CORP		18	—	—	—	商業・専門サービス
VERISK ANALYTICS INC		2	6	181	27,153	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		—	3	152	22,735	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERTIV HOLDINGS CO-A		—	7	80	11,993	資本財
VISA INC-CLASS A SHARES		39	63	1,855	277,240	金融サービス
WORKDAY INC-CLASS A		38	6	162	24,294	ソフトウェア・サービス
NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A		—	36	52	7,790	銀行
TECHNIPFMC PLC		49	81	208	31,180	エネルギー
SPOTIFY TECHNOLOGY SA		—	5	200	30,006	メディア・娯楽
MONDAY.COM LTD		30	31	913	136,569	ソフトウェア・サービス
WIX.COM LTD		—	2	35	5,311	ソフトウェア・サービス
ASML HOLDING NV-NY REG SHS		30	44	3,241	484,399	半導体・半導体製造装置
MERUS NV		—	18	98	14,684	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAKEMYTRIP LTD		—	28	292	43,757	消費者サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	3,521	6,851	157,826	23,584,031	
	銘 柄 数 < 比 率 >	94	102	—	<95.3%>	
(カナダ)				千カナダドル		
CONSTELLATION SOFTWARE INC		1	4	2,153	233,029	ソフトウェア・サービス
LUMINE GROUP INC		19	28	95	10,335	ソフトウェア・サービス
SHOPIFY INC - CLASS A		194	306	3,501	378,920	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	216	340	5,750	622,285	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<2.5%>	
(オランダ)				千ユーロ		
ASM INTERNATIONAL NV		9	13	680	110,512	半導体・半導体製造装置
ARGENX SE		11	6	338	54,999	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADYEN NV		2	—	—	—	金融サービス
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	24	19	1,019	165,512	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	2	—	<0.7%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
PRO MEDICUS LTD		—	32	619	62,048	ヘルスケア機器・サービス
XERO LTD		7	—	—	—	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	7	32	619	62,048	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.3%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	3,770	7,244	—	24,433,878	
	銘 柄 数 < 比 率 >	101	108	—	<98.7%>	

(注1) 邦貨換算金額は、当該日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) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

マネープールマザーファンド

運用報告書

第14期（決算日 2023年11月20日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2010年2月26日から無期限です。
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。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。また、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等にも投資します。
組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		債 券 組 入 率 比	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額 総
		期 騰 落 中 率			
第10期(2019年11月20日)	円 10,024	% △0.1	% —	% —	百万円 544,455
第11期(2020年11月20日)	10,019	△0.0	—	—	486,701
第12期(2021年11月22日)	10,015	△0.0	—	—	358,814
第13期(2022年11月21日)	10,011	△0.0	—	—	371,933
第14期(2023年11月20日)	10,006	△0.0	—	—	236,294

(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		債 券 組 入 率 比	債 券 先 物 率 比
		騰 落 率		
(当 期 首) 2022年11月21日	円 10,011	% —	% —	% —
11月末	10,011	0.0	—	—
12月末	10,010	△0.0	—	—
2023年 1月末	10,010	△0.0	—	—
2月末	10,010	△0.0	—	—
3月末	10,010	△0.0	—	—
4月末	10,010	△0.0	—	—
5月末	10,009	△0.0	—	—
6月末	10,008	△0.0	—	—
7月末	10,008	△0.0	—	—
8月末	10,007	△0.0	—	—
9月末	10,007	△0.0	—	—
10月末	10,006	△0.0	—	—
(当 期 末) 2023年11月20日	10,006	△0.0	—	—

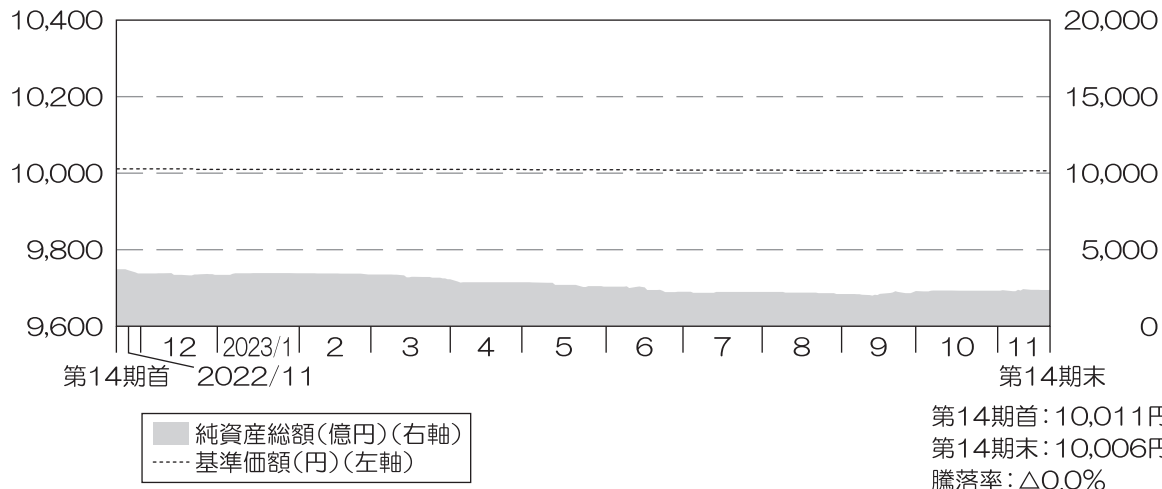
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

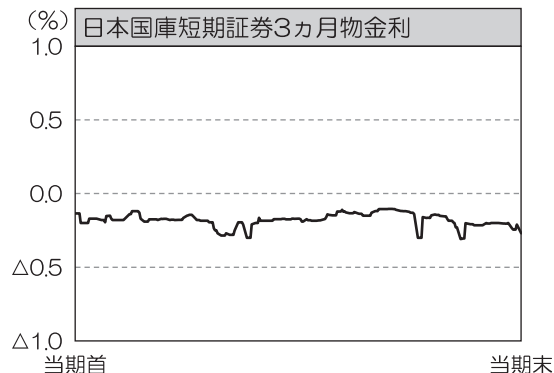
基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

日銀のマイナス金利政策が継続される中、3ヵ月国債利回りは期を通じてマイナス圏で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は概ね△0.09～0.00%近辺で推移しました。このような状況の中、基準価額は小幅に下落しました。

投資環境



日銀のマイナス金利政策が継続される中、3ヵ月国債利回りはマイナス圏での推移となりました。

また、無担保コール翌日物金利は概ね $\Delta 0.09 \sim 0.00\%$ 近辺で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

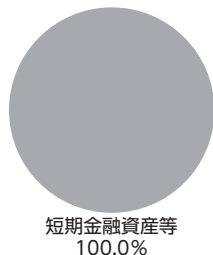
当ファンドの主要投資対象である短期国債利回りが、マイナス金利水準で推移したため、期間中の新規組み入れを見送り、コール等での運用としました。期末時点での債券組入比率は0%となりました。

当ファンドの組入資産の内容

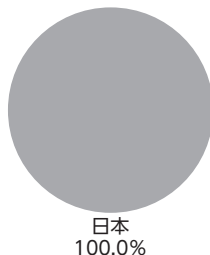
○上位10銘柄

当期末における該当事項はありません。

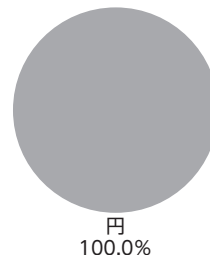
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注)比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

今後の運用方針

今後の運用にあたりましては、引き続き運用の基本方針に従い、主としてわが国の公社債を投資対象とし、安定した収益の確保を目指して運用を行います。ポートフォリオにつきましては、金利動向やマーケット環境を踏まえながら、債券組入比率の向上を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年11月22日～2023年11月20日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	－円	－%	(a) 売買委託手数料＝ $\frac{\text{〔期中の売買委託手数料〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(－)	(－)	
（新株予約権証券）	(－)	(－)	
（オプション証券等）	(－)	(－)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
（商品）	(－)	(－)	
（先物・オプション）	(－)	(－)	
(b) 有価証券取引税	－	－	(b) 有価証券取引税＝ $\frac{\text{〔期中の有価証券取引税〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(－)	(－)	
（新株予約権証券）	(－)	(－)	
（オプション証券等）	(－)	(－)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(－)	(－)	
（公社債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(c) その他費用	0	0.000	(c) その他費用＝ $\frac{\text{〔期中のその他費用〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}} \times 10,000$ 保管費用は、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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
（保管費用）	(－)	(－)	
（監査費用）	(－)	(－)	
（その他）	(0)	(0.000)	
合計	0	0.000	

(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(10,008円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

当期中における該当事項はありません。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 2,743	百万円 2,743	% 100.0	百万円 2,743	百万円 2,743	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	68,107,751	6,936,530	10.2	68,243,391	6,936,530	10.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

当期末における該当事項はありません。

投資信託財産の構成

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 236,294,933	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	236,294,933	100.0

※ 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。

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2023年11月20日現在
(A) 資 産	236,294,933,614円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	236,294,933,614
(B) 負 債	168,372
未 払 解 約 金	312
未 払 利 息	168,060
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	236,294,765,242
元 本	236,149,122,113
次 期 繰 越 損 益 金	145,643,129
(D) 受 益 権 総 口 数	236,149,122,113口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,006円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年11月22日 至 2023年11月20日
(A) 配 当 等 収 益	△136,362,073円
受 取 利 息	1,349,312
支 払 利 息	△137,711,385
(B) そ の 他 費 用	△8,267
(C) 当 期 損 益 金 (A+B)	△136,370,340
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	419,101,500
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	157,694,376
(F) 解 約 差 損 益 金	△294,782,407
(G) 計 (C+D+E+F)	145,643,129
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	145,643,129

(注1) (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し引いた差額分をいいます。
(注2) (F) 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。

＜注記事項＞

※当ファンドの期首元本額は371,514,353,891円、期中追加設定元本額は203,687,601,171円、期中一部解約元本額は339,052,832,949円です。
※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

TOPIXベアファンドF2 (建玉数量固定型／リセットあり) (適格機関投資家専用)	29,984,348,102円
TOPIXベアファンドR2 (建玉比率非調整型／リセット型) (適格機関投資家専用)	22,126,405,859円
TOPIXベアファンドF9 (建玉数量固定型／リセットありZ) (適格機関投資家専用)	20,952,134,762円
TOPIXベアファンドF10 (建玉数量固定型／リセットありZ) (適格機関投資家専用)	19,600,709,531円
TOPIXベアファンドF4 (建玉数量固定型／リセットありZ) (適格機関投資家専用)	19,193,884,540円
TOPIXベアファンドF5 (建玉数量固定型／リセットありZ) (適格機関投資家専用)	15,283,093,910円
TOPIXベアファンドF8 (建玉数量固定型／リセットありZ) (適格機関投資家専用)	14,267,456,713円
TOPIXベアファンドF6 (建玉数量固定型／リセットありZ) (適格機関投資家専用)	14,207,510,680円
TOPIXベアファンドF3 (建玉数量固定型／リセットありZ) (適格機関投資家専用)	13,350,760,490円
ダイナミック・マルチエクスポート・コントロールファンド (適格機関投資家専用)	11,680,434,693円
TOPIXベアファンドF7 (建玉数量固定型／リセットありZ) (適格機関投資家専用)	11,569,885,014円
TOPIXベアファンドF (建玉数量固定型／リセットあり) (適格機関投資家専用)	11,549,438,116円
TOPIXベアファンドR (建玉比率非調整型／リセット型) (適格機関投資家専用)	11,335,004,900円
ダイナミック・為替エクスポート・コントロール債券ファンド (適格機関投資家専用)	5,243,994,378円
ダイナミック・エクスポート・コントロール株式ファンド (適格機関投資家専用)	3,602,226,083円
リスクプレミアムαファンド (適格機関投資家専用)	2,995,805,872円
225ベアファンド8 (建玉比率非調整型／リセット型) (適格機関投資家専用)	2,930,619,829円
225ベアファンド10 (建玉比率非調整型／リセット型) (適格機関投資家専用)	2,196,843,214円
TOPIXベアファンド2 (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	1,990,042,460円
225ベアファンド7 (建玉比率非調整型／リセット型) (適格機関投資家専用)	1,604,724,257円
225ベアファンド6 (建玉比率非調整型／リセット型) (適格機関投資家専用)	298,332,775円
私募マネーボールファンドAL (適格機関投資家専用)	159,522,532円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (ブラジル・レアルコース)	5,182,333円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (ブラジル・レアルコース)	4,087,676円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (円コース)	4,005,348円
国内債券SMTBセレクション (SMA専用)	1,992,033円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (円コース)	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	1,005,802円
SuMi TRUST マルチストラテジー／SMARS (SMA専用)	1,004,876円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	812,319円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジなし)	796,655円

バンクローン・オープン（為替ヘッジなし）	696, 865円
TOPIXベアファンドF14（建玉数量固定型／リセットありZ）（適格機関投資家専用）	299, 821円
TOPIXベアファンドF12（建玉数量固定型／リセットありZ）（適格機関投資家専用）	299, 821円
TOPIXベアファンドF13（建玉数量固定型／リセットありZ）（適格機関投資家専用）	299, 821円
TOPIXベアファンドF11（建玉数量固定型／リセットありZ）（適格機関投資家専用）	299, 790円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（アジア通貨コース）	298, 995円
債券総合型ファンド（為替ヘッジなし）	210, 100円
債券総合型ファンド（為替ヘッジあり）	105, 486円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（米ドルコース）	99, 941円
MLP関連証券ファンド（為替ヘッジあり）	49, 791円
バンクローン・オープン（為替ヘッジあり）	19, 911円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり（奇数月決算型）	9, 994円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし（奇数月決算型）	9, 994円
半導体関連 世界株式戦略ファンド	9, 993円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド（資産成長型）	9, 990円
リアルアセット関連証券ファンド（毎月決算型）	9, 990円
リアルアセット関連証券ファンド（年2回決算型）	9, 990円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド（予想分配金提示型）	9, 990円
DC脱炭素関連 世界株式戦略ファンド	9, 987円
DC次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9, 987円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド（資産成長型）	9, 983円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド（予想分配金提示型）	9, 983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド（予想分配金提示型）	9, 983円
MSIMグローバル株式コンセントレイト・ファンド（SMA専用）	9, 979円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9, 972円
国内株式絶対収益追求型ファンド	9, 972円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり（年1回決算型）	9, 970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし（毎月決算型）	9, 970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし（年1回決算型）	9, 970円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（トルコ・リラコース）	9, 963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（メキシコ・ペソコース）	9, 963円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9, 962円
債券総合型ファンド（為替ヘッジあり）（年2回決算型）	9, 961円
債券総合型ファンド（為替ヘッジなし）（年2回決算型）	9, 961円
バンクローン・オープン（豪ドルコース）（SMA専用）	9, 961円
バンクローン・オープン（円コース）（SMA専用）	9, 961円
バンクローン・オープン（米ドルコース）（SMA専用）	9, 961円
ブルーベイ クレジットLSファンド（SMA専用）	9, 957円
債券コア・セクション	9, 956円
債券コア戦略ファンド	9, 953円
国内株式SMTBセクション（SMA専用）	9, 953円
外国債券SMTBセクション（SMA専用）	9, 952円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	9, 951円
外国株式SMTBセクション（SMA専用）	9, 951円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり（毎月決算型）	9, 950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし（毎月決算型）	9, 950円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4, 989円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり（毎月決算型）	4, 985円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし（年2回決算型）	1, 990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり（年2回決算型）	1, 990円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン（年2回決算型）	1, 990円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジあり）（年2回決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジなし）（毎月決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジあり）（毎月決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジなし）（年2回決算型）	997円

お知らせ

当ファンドの運用実態を踏まえ、デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

（変更日：2023年7月8日）