

世界銀行債券ファンド（毎月分配型） ＜愛称 ワールドサポーター＞

運用報告書（全体版）

第203期（決算日 2024年5月13日）第205期（決算日 2024年7月12日）第207期（決算日 2024年9月12日）
第204期（決算日 2024年6月12日）第206期（決算日 2024年8月13日）第208期（決算日 2024年10月15日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。

「世界銀行債券ファンド（毎月分配型）」は、2024年10月15日に第208期の決算を行ないましたので、第203期から第208期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

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／海外／債券
信託期間	2007年6月21日から原則無期限です。
運用方針	主として投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。）に投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	「ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA」受益証券 「マネー・オープン・マザーファンド」受益証券 上記の投資信託証券を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。外貨建資産への直接投資は行ないません。
分配方針	第1計算期は収益分配を行ないません。第2計算期以降、毎決算時、基準価額水準などを勘案して、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。

<940860>

日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号
www.nikkoam.com/

当運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター 電話番号：0120-25-1404
午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近30期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額			債 組 入 比	券 率	投 資 信 託 組 入 比	純 資 産 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金					
	円		円		%	%	%	百万円	
179期(2022年5月12日)	2,247		10		△0.7	—	98.5	9,998	
180期(2022年6月13日)	2,334		10		4.3	—	98.6	10,278	
181期(2022年7月12日)	2,254		10		△3.0	—	98.5	9,869	
182期(2022年8月12日)	2,251		10		0.3	—	98.6	9,796	
183期(2022年9月12日)	2,367		10		5.6	—	98.5	10,214	
184期(2022年10月12日)	2,336		10		△0.9	—	98.6	9,989	
185期(2022年11月14日)	2,309		10		△0.7	—	98.5	9,778	
186期(2022年12月12日)	2,243		10		△2.4	—	98.5	9,472	
187期(2023年1月12日)	2,233		10		0.0	—	98.7	9,394	
188期(2023年2月13日)	2,198		10		△1.1	—	98.6	9,199	
189期(2023年3月13日)	2,262		10		3.4	—	98.4	9,431	
190期(2023年4月12日)	2,289		5		1.4	—	98.6	9,528	
191期(2023年5月12日)	2,331		5		2.1	—	98.6	9,558	
192期(2023年6月12日)	2,452		5		5.4	—	98.6	9,875	
193期(2023年7月12日)	2,488		5		1.7	—	98.6	9,886	
194期(2023年8月14日)	2,559		5		3.1	—	98.5	10,003	
195期(2023年9月12日)	2,545		5		△0.4	—	98.7	9,857	
196期(2023年10月12日)	2,558		5		0.7	—	98.5	9,823	
197期(2023年11月13日)	2,644		5		3.6	—	98.5	10,050	
198期(2023年12月12日)	2,593		5		△1.7	—	98.3	9,759	
199期(2024年1月12日)	2,630		5		1.6	—	98.3	9,761	
200期(2024年2月13日)	2,668		5		1.6	—	98.2	9,780	
201期(2024年3月12日)	2,652		5		△0.4	—	98.2	9,563	
202期(2024年4月12日)	2,746		5		3.7	—	98.3	9,833	
203期(2024年5月13日)	2,782		5		1.5	0.1	98.4	9,904	
204期(2024年6月12日)	2,740		5		△1.3	0.1	98.2	9,668	
205期(2024年7月12日)	2,816		5		3.0	0.1	98.3	9,869	
206期(2024年8月13日)	2,605		5		△7.3	0.1	98.5	9,063	
207期(2024年9月12日)	2,504		5		△3.7	0.1	98.5	8,649	
208期(2024年10月15日)	2,653		5		6.2	0.1	98.6	9,100	

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 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。

(注) 複数の投資信託に分散投資を行なうため、適切なベンチマークおよび参考指数はございません。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準	価 額		債 券 組 入 比	投 資 信 託 組 入 比	券 率 %	託 券 率 %
			騰 落	率				
第203期	(期 首) 2024年 4 月12日	円 2,746		% —			% —	98.3
	4 月末	2,776		1.1		0.1		98.6
	(期 末) 2024年 5 月13日	2,787		1.5		0.1		98.4
第204期	(期 首) 2024年 5 月13日	2,782		—		0.1		98.4
	5 月末	2,793		0.4		0.1		98.7
	(期 末) 2024年 6 月12日	2,745		△1.3		0.1		98.2
第205期	(期 首) 2024年 6 月12日	2,740		—		0.1		98.2
	6 月末	2,786		1.7		0.1		98.5
	(期 末) 2024年 7 月12日	2,821		3.0		0.1		98.3
第206期	(期 首) 2024年 7 月12日	2,816		—		0.1		98.3
	7 月末	2,680		△4.8		0.1		98.4
	(期 末) 2024年 8 月13日	2,610		△7.3		0.1		98.5
第207期	(期 首) 2024年 8 月13日	2,605		—		0.1		98.5
	8 月末	2,570		△1.3		0.1		98.4
	(期 末) 2024年 9 月12日	2,509		△3.7		0.1		98.5
第208期	(期 首) 2024年 9 月12日	2,504		—		0.1		98.5
	9 月末	2,587		3.3		0.1		98.6
	(期 末) 2024年10月15日	2,658		6.2		0.1		98.6

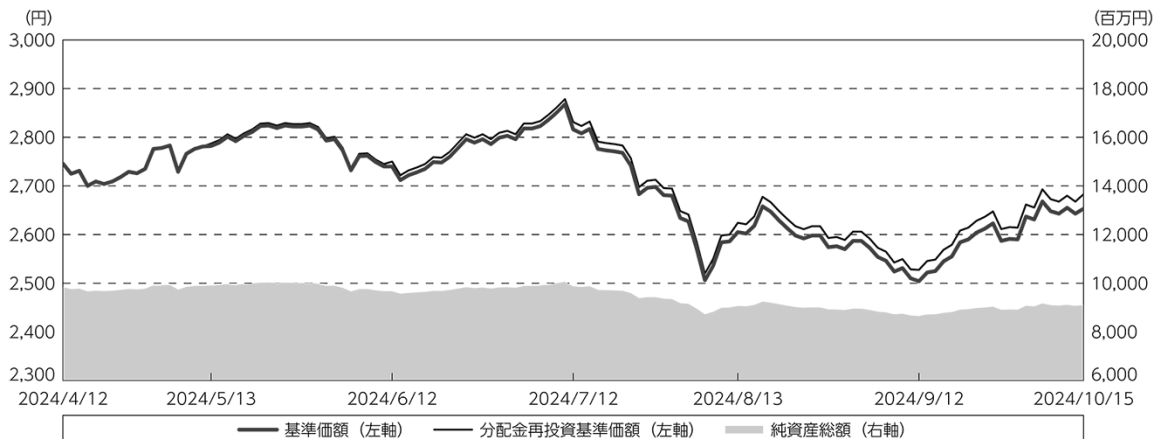
(注) 期末の基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注) 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。

○運用経過

(2024年4月13日～2024年10月15日)

作成期間中の基準価額等の推移



第203期首：2,746円

第208期末：2,653円 (既払分配金(税込み)：30円)

騰落率：△ 2.3% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)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) 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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額は、作成期首(2024年4月12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。
- (注) 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。
- (注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主として、世界銀行が発行する新興国通貨建て債券を投資対象とする投資信託証券に投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行なっております。当作成期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

＜値上がり要因＞

- ・高利回りの新興国通貨建て世界銀行債券からの利息収入を得たこと。
- ・南アフリカランドなどポートフォリオの組入通貨の一部が対円で上昇したこと。
- ・メキシコ、南アフリカ、ポーランド、コロンビアなどの債券市場が好調に推移したこと。

＜値下がり要因＞

- ・当ファンドの基準通貨である円が主要通貨に対して上昇するなか、メキシコペソ、ブラジルレアル、コロンビアペソ、インドルピーなど、ポートフォリオの組入通貨の一部が対円で下落したこと。

投資環境

（債券市況）

2024年第1～第3四半期は、世界的に金融政策が緩和へと大きく方向転換しました。米国連邦準備制度理事会（FRB）や欧州中央銀行（ECB）などの中央銀行は、経済成長やインフレに対する懸念を受けて、利下げを開始しました。期間中の世界経済は、底堅さの兆しが見られる地域がある一方、経済成長の減速に直面した地域もあるなど、国や地域によってまちまちとなりました。インフレ率は、米国やユーロ圏などの主要地域を中心に鈍化の兆しが見られ、各国の中央銀行は金融政策の緩和を進めました。FRBは9月に利下げサイクルを開始し、政策金利の指標であるフェデラルファンド（FF）金利の誘導目標を0.50%引き下げました。ECBはFRBに先駆けて利下げを開始しましたが、今後も追加利下げを実施する可能性を示しました。一方、日銀は7月に市場の予想外となる政策金利の引き上げを実施しました。日銀の政策金利の引き上げを受けて、円は主要通貨に対して大幅に上昇する一方、アメリカドルはFRBの利下げを受けて、主要通貨に対して下落しました。米国国債利回りは、金融政策の緩和を受けて総じて低下（債券価格は上昇）しました。第4四半期を見通すと、各国の中央銀行は金融緩和を継続すると予想されますが、経済指標やインフレ動向によってペースは異なるとみられます。世界経済は成長が続く可能性が高いものの、ペースは地域によってばらつきが見られるかもしれません。市場のボラティリティ（変動性）については、地政学的緊張の継続や貿易摩擦、経済の不透明感などにより継続することが予想されます。

新興国市場では、メキシコの中央銀行が、インフレ率が予想以上に急速に減速したことや経済成長の鈍化見通しを受けて、2024年9月に2会合連続となる利下げを実施し、政策金利を10.50%に引き下げました。短期金融市場では、世界の主要国の中央銀行が同時期に金融緩和を進めていることが追い風となり、今後も追加利下げが実施される可能性が示唆されています。政治面では、10月にメキシコ初の女性大統領であるシェインバウム氏が就任しました。同大統領は、ロペスオブラドル前大統領の路線を継承することを公約としています。6月の選挙で勝利したシェインバウム氏は、高い期待を背負って大統領に就任しますが、同国に蔓延する麻薬カルテル関連の暴力や大幅な財政赤字をはじめとする大きな課題に直面しています。こうした状況があるにもかかわらず、数ヶ月にわたって資金流出が続いていたメキシコの債券市場には投資家が回帰しつつあります。ブラジルでは、2024年9月に中央銀行が市場予想通り0.25%の利上げを実施し、政策金利を10.75%へと引き上げました。財政支出の拡大や経済活動の底堅い推移を受けてインフレ見通しに依然として不透明感があることから、金融政策のさらなる引き締めが予想されています。インドネシアでは、FRBによる金融緩和サイクルの開始など外部環境がより良好となるなか、中央銀行が利下げを実施しました。また、2024年9月の消費者物価指数（CPI）の上昇率が前月比マイナス0.12%と市場予想を下回ったことを受けて、追加利下げが行なわれる可能性があります。南アフリカでは、総選挙が終了し国民統一政府（GNU）が始動すると、市場で好感されて同国通貨が上昇し、国内の債券利回りが低下しました。国内資産に対するリスク回避姿勢の後退やインフレ見通しの改善を受けて、中央銀行は2024年9月に利下げを実施して政策金利を8.00%へと引き下げました。FRBの大幅な利下げを受けて外部環境が追い風となるなか、さらなる利下げの実施が見込まれています。

（国内短期金利市況）

無担保コール翌日物金利は、期間の初めの0.08%近辺から、日銀が2024年7月の金融政策決定会合において政策金利を引き上げたことなどから、0.23%近辺で期間末を迎えました。

国庫短期証券（TB）3ヵ月物金利は、期間の初めの0.00%近辺から、日銀による利上げなどを受けて上昇したものの、0.00%近辺で期間末を迎えました。

当ファンドのポートフォリオ

（当ファンド）

当ファンドは、収益性を追求するため、「ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA」受益証券を高位に組み入れ、「マネー・オープン・マザーファンド」受益証券への投資を抑制しました。

（ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA）

新興国通貨建ての世界銀行の短期債券を中心に分散投資を行ないました。期間末時点では、メキシコペソ、インドネシアルピア、ポーランドズロチ、ブラジルレアル、インドルピー、南アフリカランド、チリペソ、中国人民元、コロンビアペソなどの通貨建ての世界銀行債券に投資を行なっています。期間中、ファンダメンタルズ（経済の基礎的条件）面の追い風が強く、インカム創出力が魅力的な水準にあるとみられる通貨の投資比率を高位に維持しました。

期間中、為替エクスポージャーを小幅に変更しました。南アフリカの総選挙が良好な結果となったことを受けて、リスクプレミアムが低下したため、南アフリカランドのエクスポージャーを引き上げました。また、最近では、地政学的状況の悪化を受けて、ポーランドズロチのエクスポージャーを引き下げました。欧州域内では経済成長のペースが停滞気味であり、ECBの利下げと相まって、ポーランドズロチを含む欧州通貨に下落圧力がかかることが予想されます。中南米では、極めて高い実質利回りにより優れた防御効果をもたらすブラジルレアルを引き続き選好しています。加えて、ブラジルの中央銀行は2024年9月に利上げを実施し、インフレ懸念に対処しようとしています。メキシコペソについては、足元ではボラティリティが高まっているものの、ファンダメンタルズが引き続き堅固であり、外部環境が良好なことから、配分を概ね維持しました。

（マネー・オープン・マザーファンド）

運用の基本方針に従い、国庫短期証券の購入や現先取引、コール・ローンや金銭信託などを通じて、元本の安全性を重視した運用を行ないました。

当ファンドは、原則として世界銀行が発行する債券でポートフォリオを構築しており、その運用方針においてESG（環境・社会・ガバナンス（企業統治））を主要な要素としていることから、日興アセットマネジメントが「金融商品取引業者等向けの総合的な監督指針」を踏まえて定めた「ESG投信」です。世界銀行は、発行する債券を通じて調達した資金で、貧困削減と持続的成長の実現に向け、主に新興国に対して融資や政策助言などを提供しています。

ESGを主要な要素として選定した投資対象への投資比率は100%（当期末、組入債券の純資産比）としました。

日興アセットマネジメントのESG投資の詳細につきましては、以下のWEBサイトをご参照ください。

<https://www.nikkoam.com/sustainability>

日興アセットマネジメントヨーロッパリミテッドは日興アセットマネジメントのグループ会社として、同グループのステュワードシップ方針に基づき、ステュワードシップ責任を果たしています。日興アセットマネジメントグループ（以下、「当社グループ」）では、ESG要素の考慮について、お客様に対する受託者責任の不可欠な一部と考えています。ESG課題に関する投資先企業とのエンゲージメント（目的を持った建設的な対話）および議決権行使は、株式運用におけるステュワードシップ活動の主な手段であり、当社グループは議決権行使がお客様の利益に資するよう、細心の注意を払いました。債券運用においては、発行体とのエ

ンゲージメントなど、他のステュワードシップ手段を用いることで、積極的な投資家となることをめざしました。当社グループのステュワードシップ方針の詳細は、ホームページでご確認いただけます。
<https://www.nikkoam.com/about/stewardshipcode/policy>

当ファンドの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存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

分配金

分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案し、以下のとおりといたしました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第203期	第204期	第205期	第206期	第207期	第208期
	2024年4月13日～ 2024年5月13日	2024年5月14日～ 2024年6月12日	2024年6月13日～ 2024年7月12日	2024年7月13日～ 2024年8月13日	2024年8月14日～ 2024年9月12日	2024年9月13日～ 2024年10月15日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.179%	5 0.182%	5 0.177%	5 0.192%	5 0.199%	5 0.188%
当期の収益	5	5	5	5	5	5
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	95	96	98	99	99	102

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)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) 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

(当ファンド)

引き続き、「ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA」受益証券を原則として高位に組み入れ、「マネー・オープン・マザーファンド」受益証券への投資を抑制する方針です。

(ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA)

新興国市場の見通しは、特に現地通貨建て債券の金利において、引き続き慎重ながらも前向きな見方をしています。FRBが2024年9月の米国連邦公開市場委員会(FOMC)で0.50%の大幅な利下げに踏み切ったことによって、FRBの緩和サイクル入りが決定的になったという強力なメッセージが市場に送られました。FRBによる利下げ開始決定に追随して、南アフリカやインドネシアを含む複数の新興国の中央銀行も利下げに踏み切りました。チリ、ハンガリー、メキシコなど、既に利下げを行なっている新興国の中央銀行は、米国金利の低下やアメリカドル安など外部環境が改善するなかで、さらなる政策金利の引き下げを継続しています。

中国では経済活動が急激に低迷し、株式市場が落ち込むなかで、中国当局は、中国人民銀行（PBOC）と金融規制当局が合同記者会見で発表した大型景気刺激策の実施により景気悪化に歯止めをかけるために協調して取り組む方針を示しました。この景気刺激策は、金利引き下げ、流動性の供給、株式市場の支援策などから構成され、具体的には、主要短期金利の一つである7日物リバースレポ金利を0.20%引き下げること、市中銀行の預金準備率を0.50%引き下げること、既存住宅ローンの金利を平均で0.50%引き下げることなどが含まれています。強力な金融緩和策の実施によって、中国経済の成長低迷を急速に回復させる必要があるとの中国政府の思惑が浮き彫りになっています。中国の動きによって、コモディティに対する需要が世界的に改善するとの期待の高まりを背景に複数のコモディティ関連通貨が力強いパフォーマンスを示しました。しかし、足元で中東地域の地政学的紛争が激化していることで、今後のリスクセンチメントの見通しに不透明感が強まっています。今のところ、中東の紛争は中東地域内に限定されると予想されていますが、より広範な地域への波及は依然としてテールリスク（確率は低いですが、発生すると大きな損失を出すリスク）として存在しています。

引き続き、新興国通貨建ての世界銀行の短期債券に分散投資を行なっていく方針です。原則として、中・長期的に高いリターンが予想される主要新興国の投資比率を高位に維持していく方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

（マネー・オープン・マザーファンド）

引き続き、安定した収益の確保をめざして安定運用を行なう方針です。主要投資対象は、わが国の国債および格付の高い公社債とし、それらの現先取引なども活用する方針です。また、コール・ローンや金銭信託などに投資することもあります。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2024年 4 月13日～2024年10月15日）

項 目	第203期～第208期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 14	% 0.504	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	（ 4 ）	（ 0.151 ）	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	（ 9 ）	（ 0.336 ）	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
（ 受 託 会 社 ）	（ 0 ）	（ 0.017 ）	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	0	0.018	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	（ 0 ）	（ 0.002 ）	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ 印 刷 費 用 等 ）	（ 0 ）	（ 0.016 ）	印刷費用等は、法定開示資料の印刷に係る費用など
合 計	14	0.522	
作成期間の平均基準価額は、2,698円です。			

(注) 作成期間の費用（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た結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託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。

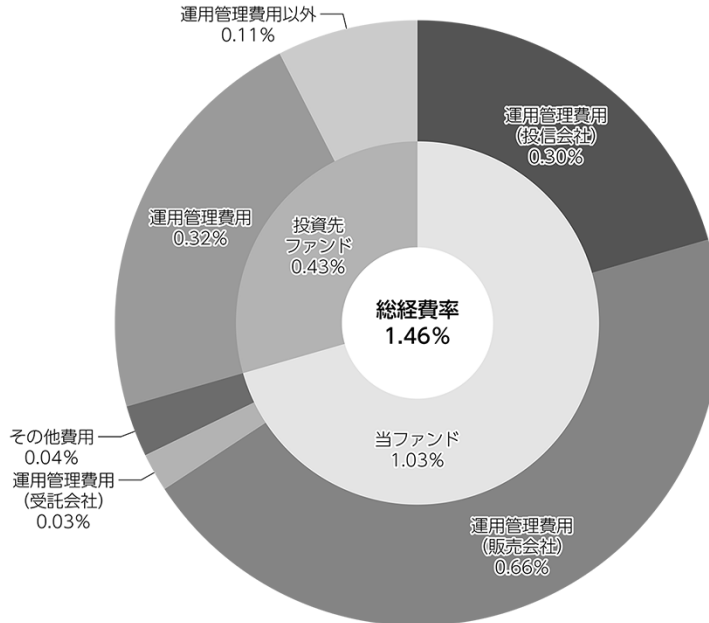
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(注) この他にファンドが投資対象とする投資先においても信託報酬等が発生する場合があります。

（参考情報）

○総経費率

作成期間の運用・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。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.46%です。



(単位:%)

総経費率(①+②+③)	1.46
①当ファンドの費用の比率	1.03
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.32
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.11

(注) 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) 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) 「その他費用」には保管費用が含まれる場合があります。なお、「その他費用」の内訳は「1万口当たりの費用明細」にてご確認いただけますが、期中の費用の総額と年率換算した値は一致しないことがあります。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 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（親投資信託を除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託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) 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) 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4月13日～2024年10月15日)

投資信託証券

銘柄		第203期～第208期			
		買付		売却	
		口数	金額	口数	金額
国内	ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA	千口 82,863	千円 26,193	千口 1,113,217	千円 380,075

(注) 金額は受け渡し代金。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄		第203期～第208期			
		設定		解約	
		口数	金額	口数	金額
	マネー・オープン・マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 357	千円 362

○利害関係人との取引状況等

(2024年4月13日～2024年10月15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。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2024年4月13日～2024年10月15日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2024年4月13日～2024年10月15日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2024年10月15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	第202期末	第208期末		
		口数	口数	評価額	比率
		千口	千口	千円	%
ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA		27,813,458	26,783,104	8,972,340	98.6
合	計	27,813,458	26,783,104	8,972,340	98.6

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

親投資信託残高

銘	柄	第202期末	第208期末	
		口数	口数	評価額
		千口	千口	千円
マネー・オープン・マザーファンド		9,000	8,642	8,779

(注) 親投資信託の2024年10月15日現在の受益権総口数は、282,649千口です。

○投資信託財産の構成

(2024年10月15日現在)

項	目	第208期末	
		評価額	比率
		千円	%
投資信託受益証券		8,972,340	98.2
マネー・オープン・マザーファンド		8,779	0.1
コール・ローン等、その他		156,749	1.7
投資信託財産総額		9,137,868	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第203期末	第204期末	第205期末	第206期末	第207期末	第208期末
	2024年5月13日現在	2024年6月12日現在	2024年7月12日現在	2024年8月13日現在	2024年9月12日現在	2024年10月15日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	9,937,105,348	9,704,058,498	9,904,773,349	9,096,475,073	8,678,910,537	9,137,868,198
コール・ローン等	177,070,057	196,208,952	196,376,539	157,431,371	151,413,510	156,747,802
投資信託受益証券(評価額)	9,750,897,123	9,498,710,430	9,699,257,693	8,929,903,094	8,518,590,603	8,972,340,146
マネー・オープン・マザーファンド(評価額)	9,137,775	9,138,675	9,138,675	9,139,575	8,778,385	8,779,249
未収入金	—	—	—	—	127,047	—
未収利息	393	441	442	1,033	992	1,001
(B) 負債	32,289,501	35,859,804	34,993,739	32,978,705	29,098,511	37,109,284
未払収益分配金	17,801,485	17,644,743	17,525,834	17,394,829	17,274,181	17,154,995
未払解約金	5,970,854	9,635,995	8,748,174	6,404,464	3,286,135	10,459,377
未払信託報酬	8,225,546	8,039,004	7,934,102	8,140,440	7,277,400	7,983,422
その他未払費用	291,616	540,062	785,629	1,038,972	1,260,795	1,511,490
(C) 純資産総額(A－B)	9,904,815,847	9,668,198,694	9,869,779,610	9,063,496,368	8,649,812,026	9,100,758,914
元本	35,602,971,789	35,289,487,055	35,051,669,333	34,789,659,443	34,548,362,718	34,309,990,061
次期繰越損益金	△25,698,155,942	△25,621,288,361	△25,181,889,723	△25,726,163,075	△25,898,550,692	△25,209,231,147
(D) 受益権総口数	35,602,971,789口	35,289,487,055口	35,051,669,333口	34,789,659,443口	34,548,362,718口	34,309,990,061口
1万口当たり基準価額(C/D)	2,782円	2,740円	2,816円	2,605円	2,504円	2,653円

(注) 当ファンドの第203期首元本額は35,810,976,678円、第203～208期中追加設定元本額は360,635,467円、第203～208期中一部解約元本額は1,861,622,084円です。

(注) 1口当たり純資産額は、第203期0.2782円、第204期0.2740円、第205期0.2816円、第206期0.2605円、第207期0.2504円、第208期0.2653円です。

(注) 2024年10月15日現在、純資産総額は元本額を下回っており、その差額は25,209,231,147円です。

○損益の状況

項 目	第203期	第204期	第205期	第206期	第207期	第208期
	2024年4月13日～ 2024年5月13日	2024年5月14日～ 2024年6月12日	2024年6月13日～ 2024年7月12日	2024年7月13日～ 2024年8月13日	2024年8月14日～ 2024年9月12日	2024年9月13日～ 2024年10月15日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	27,700,327	27,507,995	27,312,913	27,139,947	26,981,014	26,783,231
受取配当金	27,689,051	27,497,957	27,302,731	27,120,136	26,955,140	26,755,171
受取利息	11,276	10,038	10,182	19,811	25,874	28,060
(B) 有価証券売買損益	127,372,840	△ 151,108,293	264,870,553	△ 733,039,066	△ 352,881,576	509,061,452
売買益	127,766,163	925,636	266,095,615	3,910,401	629,322	511,449,941
売買損	△ 393,323	△ 152,033,929	△ 1,225,062	△ 736,949,467	△ 353,510,898	△ 2,388,489
(C) 信託報酬等	△ 8,517,162	△ 8,323,999	△ 8,215,385	△ 8,429,037	△ 7,535,394	△ 8,266,450
(D) 当期繰越損益金 (A+B+C)	146,556,005	△ 131,924,297	283,968,081	△ 714,328,156	△ 333,435,956	527,578,233
(E) 前期繰越損益金	△ 8,273,569,272	△ 8,055,785,292	△ 8,136,770,928	△ 7,796,680,902	△ 8,453,629,853	△ 8,734,838,139
(F) 追加信託差損益金	△17,553,341,190	△17,415,934,029	△17,311,561,042	△17,197,759,188	△17,094,210,702	△16,984,816,246
(配当等相当額)	(240,712,939)	(238,807,903)	(237,365,510)	(235,808,886)	(234,376,222)	(232,871,537)
(売買損益相当額)	(△17,794,054,129)	(△17,654,741,932)	(△17,548,926,552)	(△17,433,568,074)	(△17,328,586,924)	(△17,217,687,783)
(G) 計(D+E+F)	△25,680,354,457	△25,603,643,618	△25,164,363,889	△25,708,768,246	△25,881,276,511	△25,192,076,152
(H) 収益分配金	△ 17,801,485	△ 17,644,743	△ 17,525,834	△ 17,394,829	△ 17,274,181	△ 17,154,995
次期繰越損益金 (G+H)	△25,698,155,942	△25,621,288,361	△25,181,889,723	△25,726,163,075	△25,898,550,692	△25,209,231,147
追加信託差損益金	△17,553,341,190	△17,415,934,029	△17,311,561,042	△17,197,759,188	△17,094,210,702	△16,984,816,246
(配当等相当額)	(240,712,939)	(238,807,903)	(237,365,510)	(235,808,886)	(234,376,222)	(232,871,537)
(売買損益相当額)	(△17,794,054,129)	(△17,654,741,932)	(△17,548,926,552)	(△17,433,568,074)	(△17,328,586,924)	(△17,217,687,783)
分配準備積立金	100,317,911	100,760,866	108,937,871	109,235,061	110,449,449	118,793,185
繰越損益金	△ 8,245,132,663	△ 8,306,115,198	△ 7,979,266,552	△ 8,637,638,948	△ 8,914,789,439	△ 8,343,208,086

(注) 損益の状況の中で(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) 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) 損益の状況の中で(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) 分配金の計算過程(2024年4月13日～2024年10月15日)は以下の通りです。

項 目	2024年4月13日～ 2024年5月13日	2024年5月14日～ 2024年6月12日	2024年6月13日～ 2024年7月12日	2024年7月13日～ 2024年8月13日	2024年8月14日～ 2024年9月12日	2024年9月13日～ 2024年10月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	26,179,499円	19,184,255円	26,545,035円	18,711,423円	19,446,304円	26,370,623円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	240,712,939円	238,807,903円	237,365,510円	235,808,886円	234,376,222円	232,871,537円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	91,939,897円	99,221,354円	99,918,670円	107,918,467円	108,277,326円	109,577,557円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	358,832,335円	357,213,512円	363,829,215円	362,438,776円	362,099,852円	368,819,717円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	100円	101円	103円	104円	104円	107円
g. 分配金	17,801,485円	17,644,743円	17,525,834円	17,394,829円	17,274,181円	17,154,995円
h. 分配金(1万円当たり)	5円	5円	5円	5円	5円	5円

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○分配金のお知らせ

	第203期	第204期	第205期	第206期	第207期	第208期
1 万口当たり分配金（税込み）	5円	5円	5円	5円	5円	5円

○お知らせ

約款変更について

2024年4月13日から2024年10月15日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

当ファンドの主要投資対象先の直近の運用状況について、法令および諸規則に基づき、次ページ以降にご報告申し上げます。

種類・項目	ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA
	ケイマン籍円建外国投資信託
運用の基本方針	
基本方針	リスクを抑制しながら安定的な収益の獲得をめざします。
主な投資対象	世界銀行が発行する新興国通貨建て債券を主な投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 世界銀行が発行する新興国通貨建て債券を主な投資対象とすることで、安定的な収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。 各通貨への投資比率は、各国の経済状況、金利水準、市場の流動性などに基づき決定します。 組み入れる債券は、原則として残存期間が3年以下(変動利付債の場合は10年以下)のものとなります。 ファンドの流動性を確保するため、一部米ドルやユーロなどの主要国通貨建ての債券に投資することがあります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 原則として純資産総額の50%以上を有価証券に投資します。 株式への投資は行ないません。
収益分配	原則として毎月6日(休日の場合は翌営業日)に分配を行ないます。
ファンドに係る費用	
信託報酬など	<p>純資産総額に対して年率0.323%程度(国内における消費税等相当額はかかりません。)</p> <p>※当該外国投資信託の純資産総額が200億円、為替相場が1米ドル=120円の場合の概算値です。</p> <p>※当該外国投資信託の信託報酬率の内訳は、純資産総額に対し年率0.30%~0.32%と、固定報酬として年額5,000米ドル(純資産総額に対し年率0.003%相当)です。</p> <p>※純資産総額や為替相場などにより円換算後の信託報酬率は変動します。</p>
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	事務管理費用、資産の保管費用、有価証券売買時の売買委託手数料、設立に係る費用、法律顧問費用、監査費用、信託財産に関する租税など。
その他	
投資顧問会社	日興アセットマネジメント ヨーロッパリミテッド
管理会社	日興AMグローバル・ケイマン・リミテッド
信託期間	2106年12月31日まで
決算日	原則として、毎年2月末日

◆投資ポートフォリオ

ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド (クラス別)

SHARE CLASS	CURRENCY	TOTAL NET ASSETS (Balance)
A	JPY	9,587,530,107 (100%)

ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド

2024年2月29日現在

社債等	元本金額	公正価値JPY	純資産に 占める 割合 (%)
国際機関			
BRL IBRD 0% 14-NOV-24	2,740,000	77,464,160	0.81
INR IBRD 6% 16-JAN-25	537,100,000	962,873,144	10.04
CLP IBRD 5.7% 07-FEB-25	1,970,000,000	305,825,107	3.19
IDR IBRD 5.5% 04-MAR-25	100,000,000,000	946,424,890	9.87
INR IBRD 0% 27-MAR-25	115,000,000	192,645,147	2.01
INR IBRD 0% 25-APR-25	64,000,000	106,572,472	1.11
PLN IBRD 0.33% 25-JUN-25	15,000,000	519,370,348	5.42
BRL IBRD 0% 30-JUN-25	20,000,000	533,405,465	5.56
BRL IBRD 5% 22-JAN-26	27,000,000	764,239,506	7.97
ZAR IBRD 4.5% 22-JAN-26	58,180,000	423,718,927	4.42
IDR IBRD 4.6% 09-FEB-26	33,400,000,000	310,434,423	3.24
INR IBRD 4.9% 12-FEB-26	30,000,000	52,326,172	0.55
COP IBRD 3.375% 17-FEB-26	20,000,000,000	681,114,273	7.10
MXN IBRD 8.5% 06-APR-26	85,000,000	725,522,295	7.57
IDR IBRD 4.5% 15-APR-26	12,800,000,000	118,407,188	1.24
PLN IBRD 5.37% 27-JUL-26	24,400,000	907,950,673	9.47
MXN IBRD 6.25% 07-OCT-26	84,000,000	681,117,843	7.10
ZAR IBRD 8.25% 21-DEC-26	81,500,000	632,942,290	6.60
国際機関合計 (取得原価 : 8,213,859,739円)		8,942,354,323	93.27

	公正価値JPY	純資産に 占める 割合(%)
投資合計(公正価値)(取得原価: 8,213,859,739円)	<u>8,942,354,323</u>	<u>93.27</u>
社債等合計(取得原価: 8,213,859,739円)	<u>8,942,354,323</u>	<u>93.27</u>
純金融資産合計	<u>8,942,354,323</u>	<u>93.27</u>
その他純資産	<u>645,175,784</u>	<u>6.73</u>
純資産合計	<u>9,587,530,107</u>	<u>100.00</u>

IBRD = 国際復興開発銀行

デリバティブ商品とヘッジ活動

当ファンドは、その取り組むデリバティブ商品やヘッジ活動についての情報開示に関し、FASB会計基準編纂書に記される権威あるガイダンスを採用している。このガイダンスはデリバティブおよびヘッジ活動についての高度な開示を必要とし、それによって財務報告の透明性を高めている。このガイダンスの目的は、なぜ、どのようにデリバティブ商品が使われているか、デリバティブ商品や関連したヘッジがどのように会計処理されているか、そしてデリバティブ商品や関連したヘッジが財務状況や業績、キャッシュフローに関係するとすればどのような影響を与えているかについて、財務諸表のユーザーに対し理解を深めるための目安を示すことである。

このガイダンスを採用することで、資産負債計算書、損益計算書あるいは純資産変動計算書には何らの影響もなかった。当ファンドはいかなるデリバティブ商品もこのガイドの示すところのヘッジ商品として指定していない。

当ファンドは主に外貨のキャッシュフロー管理のための短期的なヘッジとして為替先渡契約に投資しており、主なリスク・エクスポージャーは外国為替リスクである。当ファンドが保有する為替先渡契約は外貨現金エクスポージャーの管理のためおよびリスク・ヘッジ目的で使用される。ただし、ASC第815号の要件に基づく会計目的上、これらのデリバティブはヘッジとみなされない。これらのデリバティブ商品の公正価値の変動額は、損益計算書においてデリバティブに係る実現利益（損失）または未実現評価益（評価損）の純変動額として反映されている。

デリバティブ商品とヘッジ活動（続き）

以下の表は2024年2月29日に終了した年度に係る損益計算書に含まれるデリバティブに係る純利益を示している。

	実現利益 日本円	純未実現 利益／損失 の変動額 日本円	合計 日本円	当期中 平均活動額* 日本円
為替先渡契約	9,452,190	-	9,452,190	36,500,637

*日本円に転換された各契約の平均想定エクスポージャーを用いて計算された購入活動額に基づく当期中平均活動額

◆損益計算書

ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド

2024年2月29日に終了した会計年度

	2024 JPY
投資収益	
利息収入	680,938,444
投資収益合計	<u>680,938,444</u>
費用	
管理報酬	4,352,345
運用報酬	24,178,599
受託者報酬	700,412
専門家報酬	9,076,825
保管費用	2,210,450
その他費用	1,483,181
費用合計	<u>42,001,812</u>
投資純利益	<u>638,936,632</u>
実現純利益および未実現評価益の変動額	
実現利益	
投資有価証券	823,245,822
外国為替取引および為替先渡契約	27,164,170
実現純利益	<u>850,409,992</u>
未実現評価益の変動額	
投資有価証券	493,473,306
外貨換算	33,028,479
未実現評価益の純変動額	<u>526,501,785</u>
実現純利益および未実現評価益の変動額	<u>1,376,911,777</u>
運用による純資産の純増加額	<u>2,015,848,409</u>

マネー・オープン・マザーファンド

運用報告書

第21期（決算日 2024年 1月15日）
 (2023年 1月17日～2024年 1月15日)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2003年3月28日から原則無期限です。
運用方針	公社債への投資により、安定した収益の確保をめざして安定運用を行いません。
主要運用対象	わが国の国債および格付の高い公社債を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資は行いません。

フ ァ ン ド 概 要

わが国の国債および格付の高い公社債に投資を行ない、利息等収益の確保をめざして安定運用を行いません。
 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		債 組 入 比	券 率	純 資 産 額
		期 騰 落	中 率			
	円		%		%	百万円
17期(2020年1月15日)	10,162		△0.0		—	696
18期(2021年1月15日)	10,159		△0.0		—	521
19期(2022年1月17日)	10,158		△0.0		—	398
20期(2023年1月16日)	10,155		△0.0		—	316
21期(2024年1月15日)	10,152		△0.0		—	293

(注) 元本の安全性を優先した運用を行なっているため、ベンチマークおよび適切な参考指数となる指標はございません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額	
		騰 落	率
(期 首)	円		%
2023年1月16日	10,155		—
1月末	10,155		0.0
2月末	10,155		0.0
3月末	10,155		0.0
4月末	10,155		0.0
5月末	10,154		△0.0
6月末	10,154		△0.0
7月末	10,153		△0.0
8月末	10,153		△0.0
9月末	10,153		△0.0
10月末	10,152		△0.0
11月末	10,152		△0.0
12月末	10,152		△0.0
(期 末)			
2024年1月15日	10,152		△0.0

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2023年1月17日～2024年1月15日)

基準価額の推移

期間の初め10,155円の基準価額は、期間末に10,152円となり、騰落率は $\Delta 0.0\%$ となりました。

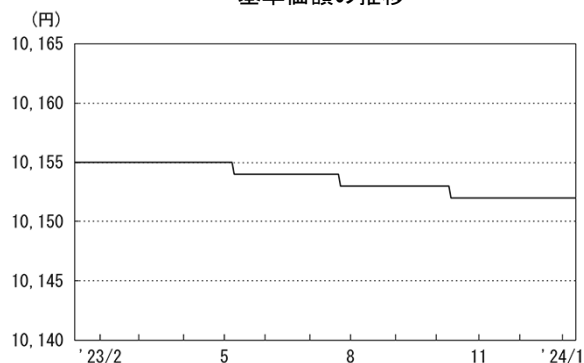
基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

<値下がり要因>

- ・無担保コール翌日物金利がマイナス圏で推移したこと。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2023/01/16	2023/01/17	2023/10/12	2024/01/15
10,155円	10,155円	10,152円	10,152円

(国内短期金利市況)

無担保コール翌日物金利は、期間の初めの -0.03% 近辺から、日銀によるマイナス金利政策の下でコール市場でもマイナス圏での取引が続き、 -0.01% 近辺で期間末を迎えました。

国庫短期証券（TB）3ヵ月物金利は、期間の初めの -0.19% 近辺から、日銀による国債買入れの継続などを受けてマイナス圏での推移が続き、 -0.22% 近辺で期間末を迎えました。

ポートフォリオ

運用の基本方針に従い、国庫短期証券の購入や現先取引、コールローンや金銭信託などを通じて、元本の安全性を重視した運用を行ないました。

○今後の運用方針

引き続き、安定した収益の確保をめざして安定運用を行なう方針です。主要投資対象は原則として、わが国の国債および格付の高い公社債とし、それらの現先取引なども活用する方針です。また、コールローンや金銭信託などに投資することもあります。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

○1万口当たりの費用明細

(2023年1月17日～2024年1月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、10,153円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2023年1月17日～2024年1月15日)

該当事項はございません。

○利害関係人との取引状況等

(2023年1月17日～2024年1月15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。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2023年1月17日～2024年1月15日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2024年1月15日現在)

2024年1月15日現在、有価証券等の組入れはございません。

○投資信託財産の構成

(2024年1月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	293,708	100.0
投資信託財産総額	293,708	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年1月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	293,708,776
コール・ローン等	293,708,776
(B) 負債	198,597
未払解約金	198,565
未払利息	32
(C) 純資産総額(A-B)	293,510,179
元本	289,106,290
次期繰越損益金	4,403,889
(D) 受益権総口数	289,106,290口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,152円

(注) 当ファンドの期首元本額は311,251,070円、期中追加設定元本額は8,857,811円、期中一部解約元本額は31,002,591円です。

(注) 2024年1月15日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・グローバル3倍3分法ファンド(1年決算型)	153,800,333円
・グローバル3倍3分法ファンド(隔月分配型)	68,175,020円
・日興ビムコ・ハインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(株ドルコース)	13,739,040円
・日興ビムコ・ハインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(トルコリラコース)	9,629,170円
・世界銀行債券ファンド(毎月分配型)	9,000,074円
・資源ファンド(株式と通貨)ブラジルリアル・コース	7,904,694円
・日興・GS世界ソブリン・ファンド(毎月分配型)	6,352,120円
・グローバル3倍3分法(適格機関投資家専用)	5,642,457円
・高金利先進国債券オープン(毎月分配型)	5,477,282円
・資源ファンド(株式と通貨)南アフリカランド・コース	2,481,609円
・日興ビムコ・ハインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(ブラジルリアルコース)	2,121,761円
・日興ビムコ・ハインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(円ヘッジコース)	2,048,723円
・資源ファンド(株式と通貨)オーストラリアドル・コース	1,047,314円
・高金利先進国債券オープン(資産成長型)	538,501円
・グローバル3倍3分法オープン(適格機関投資家専用)	469,797円
・日興・世界ソブリン・ファンドVA(適格機関投資家転売制限付)	460,360円
・上場インデックスファンド中国A株(ハンダ)E Fund CSI300	198,295円
・上場インデックスファンド海外債券(FI SE WGBI)毎月分配型	19,740円

(注) 1口当たり純資産額は1.0152円です。

○損益の状況 (2023年1月17日～2024年1月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 83,775
支払利息	△ 83,775
(B) 保管費用等	△ 385
(C) 当期損益金(A+B)	△ 84,160
(D) 前期繰越損益金	4,826,068
(E) 追加信託差損益金	136,117
(F) 解約差損益金	△ 474,136
(G) 計(C+D+E+F)	4,403,889
次期繰越損益金(G)	4,403,889

(注) 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し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で(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。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2023年1月17日から2024年1月15日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

- 当ファンドについて、新NISA制度における成長投資枠の要件に適合させるため、投資対象ファンドにて行なうデリバティブ取引の利用目的を明確化するべく、2023年10月11日付けにて信託約款の一部に所要の変更を行ないました。(付表、第14条、第15条、第16条)

寄付についてのご報告

「世界銀行債券ファンド（毎月分配型）＜愛称 ワールドサポーター＞」は、2024年10月15日に第208期の決算を迎えました。

目論見書記載の通り、当ファンドでご負担いただいた当期間の信託報酬のうち、日々の純資産総額に年率0.05%を乗じた金額、総額2,404,071円を、国際開発協会（International Development Association、通称IDA：アイダ）に寄付させていただきます。ワールドサポーターを通じたこれまでの寄付金の総額は累計で、555,945,606円となっています。

IDAは、世界銀行の名で知られる国際復興開発銀行（IBRD）の姉妹機関として1960年に設立されました。途上国の中でも特に貧しい国々を支援するため、経済成長の促進、不平等の是正、生活水準向上等を実現すべく超長期で無利子の融資や贈与を行なっています。

日興アセットマネジメントは、今後もワールドサポーターを通じて、世界の子どもたちに笑顔をもたらす新興国支援の取組みを応援してまいります。

引き続きワールドサポーターをみなさまの資産形成のツールとして末長くご愛顧いただきますよう、よろしくお願い申し上げます。