

## 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	2032年6月4日まで（2021年1月21日設定）	
運用方針	サイバーセキュリティ株式マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の金融商品取引所に上場しているサイバーセキュリティ関連企業の株式に投資を行います。なお、当ファンドにおいて、サイバーセキュリティ関連企業とは、サイバー攻撃に対するセキュリティ技術を有し、これを活用した製品・サービスを提供するテクノロジー関連の企業等をいいます。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。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。マザーファンドの株式等の運用にあたっては、ヴォヤ・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシーに運用指図に関する権限を委託します。	
主要運用対象	ベビーファンド	サイバーセキュリティ株式マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	日本を含む世界のサイバーセキュリティ関連企業の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。原則として、決算日の前営業日の基準価額に応じ、提示された金額の分配をめざします。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。また、決算日にかけて基準価額が急激に変動し、提示された分配金額が分配対象額を超える場合等には、当該分配金額としないことや分配を行わないことがあります。なお、第2計算期末までの間は、収益の分配は行いません。	

## 運用報告書（全体版）

## サイバーセキュリティ 株式オープン（為替ヘッジなし） 予想分配金提示型



第36期（決算日：2024年1月9日）  
 第37期（決算日：2024年2月6日）  
 第38期（決算日：2024年3月6日）  
 第39期（決算日：2024年4月8日）  
 第40期（決算日：2024年5月7日）  
 第41期（決算日：2024年6月6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、お手持ちの「サイバーセキュリティ株式オープン（為替ヘッジなし）予想分配金提示型」は、去る6月6日に第41期の決算を行いましたので、法令に基づいて第36期～第41期の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。



### 三菱UFJアセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号  
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用  
フリーダイヤル **0120-151034**  
 （受付時間：営業日の9:00～17:00、  
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

# ファンドマネージャーのコメント

当期間の運用に主眼をおいたポイントをご説明させていただきます。

## ■ポートフォリオ概況

当期間は投資家心理が改善し、テクノロジー関連銘柄は上昇しました。高グロースのテクノロジー銘柄を取り巻く環境は、金利情勢の安定化や、良好なファンダメンタルズ（基礎的条件）によりバリュエーション（投資価値基準）が以前の高水準から低下するなど、2022年や2023年初めと比較して大幅に改善しました。一方で、テクノロジー銘柄の中でも半導体のパフォーマンスが他の産業と比較して大幅に上回るなど、産業によって異なる値動きとなりました。そのような中、当ファンドでは銘柄選択や企業調査を重視したアプローチを行い、高グロース銘柄を選好しました。引き続き、サイバーセキュリティ分野は急速に成長し、テクノロジーの他の分野よりも成長を実現していく可能性が高いと考えています。

## ■運用のポイント

サイバー攻撃に対するセキュリティ技術を有し、これを活用した製品・サービスを提供するテクノロジー関連の企業への投資を行っています。銘柄選定に当たっては、セキュリティが脆弱な企業からの需要増加の恩恵を受ける企業をはじめ、IoT（モノのインターネット）やクラウド・コンピューティングなどの分野でのセキュリティ関連企業、サイバーセキュリティに関するコンサルティングサービスを提供する企業などに注目しています。世界でのサイバー攻撃の増加や、脅威の継続により、セキュリティソリューションへの投資が急増しています。加えて、米証券取引委員会（SEC）の新しい規制やAI関連技術の進化などもサイバーセキュリティ関連企業にとって追い風となっています。このような環境の改善を受けて、当戦略で投資するサイバーセキュリティ関連企業は着実な成長を達成できるものと考えています。また、M&A（合併と買収）活動が活発になっており、このトレンドは今後も続くと考えています。

## ■運用環境見通しおよび今後の運用方針

サイバーセキュリティ産業は、一時的ではなく、今後も成長が継続すると考えています。絶えず変化する環境やテクノロジーの影響を受け、長期的に成長が見込まれる産業です。サイバー犯罪の高度化やクラウド技術の活用などにより、新しいセキュリティ対策が必要となるため、従来のセキュリティ企業は、新しいテクノロジーの開発や、中小企業の買収などを進めています。新興のセキュリティ企業は、クラウドデータを保護するソリューションの設計などを行い、急速に成長しています。魅力的な製品やサービスを提供し、効率的なビジネス・モデルを有するサイバーセキュリティ企業は、将来的に、売上高や収益性の大幅な拡大を期待できるとみています。サイバーセキュリティへの支出は今後も継続して必要となり、このようなポジティブな要因によって、今後数年にわたり、サイバーセキュリティ産業のリーダー的地位にいる企業は、魅力的な売上高成長を達成することができるとみています。テクノロジー関連株式は短期的に値動きが大きくなることもあるものの、最終的には業績の伸びが長期的な株価上昇の牽引役と考えています。そこに十分な投資機会があると考えており、我々のリサーチ重視のボトムアップ・プロセスはこの投資テーマで作り出される価値を捉える最も効果的な手段であると考えています。



ヴォヤ・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー  
リード・ポートフォリオ・マネージャー

エリック・ソード

上記は、ヴォヤ・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシーの資料を基に、三菱UFJアセットマネジメントが作成したものです。

## 本資料の表記にあたって

- ・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。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

## ○最近30期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額			株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金 騰 落 中 率			
	円		円		%	%	百万円
12期(2022年1月6日)	10,406		200	△ 2.1	96.3	—	58,246
13期(2022年2月7日)	9,828		0	△ 5.6	95.5	—	59,732
14期(2022年3月7日)	9,322		0	△ 5.1	94.2	—	58,320
15期(2022年4月6日)	10,426		100	12.9	95.4	—	69,629
16期(2022年5月6日)	9,226		0	△11.5	93.0	—	64,288
17期(2022年6月6日)	8,755		0	△ 5.1	94.8	—	62,780
18期(2022年7月6日)	8,670		0	△ 1.0	95.2	—	62,801
19期(2022年8月8日)	9,156		0	5.6	94.8	—	66,769
20期(2022年9月6日)	8,516		0	△ 7.0	94.3	—	62,615
21期(2022年10月6日)	8,855		0	4.0	95.8	—	65,715
22期(2022年11月7日)	7,781		0	△12.1	93.8	—	57,529
23期(2022年12月6日)	7,673		0	△ 1.4	95.3	—	56,737
24期(2023年1月6日)	6,911		0	△ 9.9	94.3	—	50,566
25期(2023年2月6日)	7,907		0	14.4	95.8	—	57,527
26期(2023年3月6日)	8,111		0	2.6	96.8	—	58,903
27期(2023年4月6日)	7,829		0	△ 3.5	96.5	—	56,450
28期(2023年5月8日)	7,850		0	0.3	96.7	—	55,959
29期(2023年6月6日)	9,376		0	19.4	97.4	—	65,742
30期(2023年7月6日)	9,732		0	3.8	96.4	—	67,290
31期(2023年8月7日)	9,486		0	△ 2.5	96.1	—	63,291
32期(2023年9月6日)	10,218		100	8.8	96.9	—	67,466
33期(2023年10月6日)	9,760		0	△ 4.5	97.1	—	63,211
34期(2023年11月6日)	10,085		0	3.3	97.2	—	63,455
35期(2023年12月6日)	10,976		200	10.8	98.1	—	65,005
36期(2024年1月9日)	11,131		100	2.3	95.7	—	62,857
37期(2024年2月6日)	12,145		300	11.8	97.3	—	66,203
38期(2024年3月6日)	11,984		300	1.1	97.5	—	65,559
39期(2024年4月8日)	11,847		200	0.5	96.0	—	65,231
40期(2024年5月7日)	11,465		200	△ 1.5	96.6	—	62,320
41期(2024年6月6日)	11,187		100	△ 1.6	95.8	—	60,299

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○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		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率	率		
第36期	(期 首) 2023年12月 6 日	円 10,976	% —	% 98.1	% —
	12月末	11,412	4.0	98.1	—
	(期 末) 2024年 1 月 9 日	11,231	2.3	95.7	—
第37期	(期 首) 2024年 1 月 9 日	11,131	—	95.7	—
	1月末	12,420	11.6	96.9	—
	(期 末) 2024年 2 月 6 日	12,445	11.8	97.3	—
第38期	(期 首) 2024年 2 月 6 日	12,145	—	97.3	—
	2月末	12,558	3.4	97.8	—
	(期 末) 2024年 3 月 6 日	12,284	1.1	97.5	—
第39期	(期 首) 2024年 3 月 6 日	11,984	—	97.5	—
	3月末	12,109	1.0	96.9	—
	(期 末) 2024年 4 月 8 日	12,047	0.5	96.0	—
第40期	(期 首) 2024年 4 月 8 日	11,847	—	96.0	—
	4月末	11,842	△ 0.0	98.1	—
	(期 末) 2024年 5 月 7 日	11,665	△ 1.5	96.6	—
第41期	(期 首) 2024年 5 月 7 日	11,465	—	96.6	—
	5月末	11,195	△ 2.4	97.2	—
	(期 末) 2024年 6 月 6 日	11,287	△ 1.6	95.8	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

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

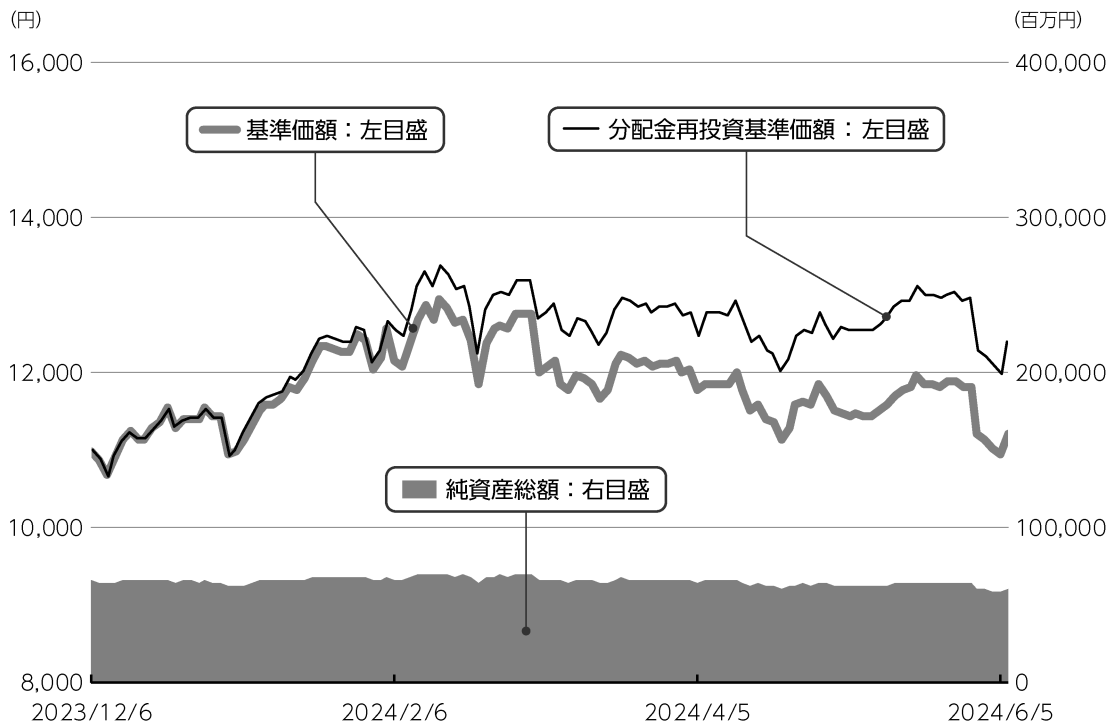
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第36期～第41期：2023年12月7日～2024年6月6日

## ▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



第36期首	10,976円
第41期末	11,187円
既払分配金	1,200円
騰落率	12.8%
	(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。  
 ※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

### 基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ12.8%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

## ▶ 基準価額の主な変動要因

### 上昇要因

個別銘柄（NVIDIA CORPやBROADCOM INCなど）の株価上昇や、米ドルが円に対して上昇したことなどが、基準価額の上昇要因となりました。

第36期～第41期：2023年12月7日～2024年6月6日

## 投資環境について

### ▶ 株式市況

テクノロジーセクターの株価は、上昇しました。

米国でのインフレ圧力の根強さが確認され、利下げ観測の後退や金利上昇への警戒感から一時的に下落する局面もありましたが、米国において底堅い経済指標が発表されたことや一部企業が良好な決算を発表したことなどを受けて、上昇しま

した。

### ▶ 為替市況

当ファンドの主要投資先通貨である米ドルは対円で上昇しました。

日米の中央銀行による金融政策の公表を受け、日米の金利差が開いた状況が続くとの見方が強まったことなどから、米ドルは対円で上昇しました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

### ▶ サイバーセキュリティ株式オープン（為替ヘッジなし）予想分配金提示型

サイバーセキュリティ株式マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、実質的な運用はマザーファンドで行いました。実質組入外貨建資産については為替ヘッジを行いませんでした。

### ▶ サイバーセキュリティ株式マザーファンド

日本を含む世界のサイバーセキュリティ関連企業の株式に投資を行いました。なお、当ファンドにおいて、サイバーセキュリティ関連企業とは、サイバー攻撃に対するセキュリティ技術を有し、これを活用した製品・サービスを提供するテクノロジー関連の企業等をいいます。株式

等への投資にあたっては、サイバーセキュリティの需要拡大および技術向上の恩恵を享受すると考えられる企業の株式の中から、持続的な利益成長性、市場優位性、財務健全性、株価水準等を考慮して組入銘柄を選定しました。

銘柄選定に当たっては、セキュリティが脆弱な企業からの需要増加の恩恵を受ける企業をはじめ、IoTやクラウド・コンピューティングなどの分野でのセキュリティ関連企業、サイバーセキュリティに関するコンサルティングサービスを提供する企業などに注目しました。なお、株式等の運用にあたっては、ヴォヤ・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシーに運用指図に関する権限を委託しています。

銘柄入替のポイントは、決算内容が良好であったことに加え、利益率が改善すると判断したことなどから、AMAZON.COM INCを新規購入しました。株価はすでにファンダメンタルズを

織り込んだと判断したことや競合他社の生成AIツールとの競争などを背景とした業績見通しの悪化懸念などから、ADOBE INCを全売却しました。

## ▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

## ▶ 分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し決定します。原則として、決算日の前営業日の基準価額に応じた分配をめざします。この結果、次表の通りとさせていただきます。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いて運用します。

## 分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第36期 2023年12月7日~ 2024年1月9日	第37期 2024年1月10日~ 2024年2月6日	第38期 2024年2月7日~ 2024年3月6日	第39期 2024年3月7日~ 2024年4月8日	第40期 2024年4月9日~ 2024年5月7日	第41期 2024年5月8日~ 2024年6月6日
当期分配金 (対基準価額比率)	<b>100</b> (0.890%)	<b>300</b> (2.411%)	<b>300</b> (2.442%)	<b>200</b> (1.660%)	<b>200</b> (1.715%)	<b>100</b> (0.886%)
当期の収益	100	300	123	61	—	—
当期の収益以外	—	—	177	138	200	100
翌期繰越分配対象額	2,228	3,228	3,051	2,914	2,714	2,614

(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 （作成対象期間末での見解です。）

### ▶ サイバーセキュリティ株式オープン （為替ヘッジなし）予想分配金提示型

引き続き、サイバーセキュリティ株式マザーファンドを主要投資対象とし、実質的な運用はマザーファンドで行います。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。

### ▶ サイバーセキュリティ株式マザーファンド

サイバーセキュリティ関連銘柄は、短期的に値動きが大きくなることがあるものの、個人・企業・国のサイバーセキュリティへの関心やテクノロジーの発展に伴う長期的な需要が見込まれ、同ビジネスを営む企業への投資妙味は大きいと見ています。

当ファンドの運用については、引き続き、サイバー攻撃に対するセキュリティ技術を有し、これを活用した製品・サービスを提供するテクノロジー関連の企業への投資を行います。銘柄選定に当たっては、セキュリティが脆弱な企業からの需要増加の恩恵を受ける企業をはじめ、IoTやクラウド・コンピューティングなどの分野でのセキュリティ関連企業、サイバーセキュリティに関するコンサルティングサービスを提供する企業などに注目しています。

株式等の運用にあたっては、ヴォヤ・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシーに運用指図に関する権限を委託します。

2023年12月7日～2024年6月6日

## ▶ 1万口当たりの費用明細

項目	第36期～第41期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	110	0.935	(a) 信託報酬 = 作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (作成期中の日数 ÷ 年間日数)
( 投 信 会 社 )	(62)	(0.522)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
( 販 売 会 社 )	(45)	(0.385)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
( 受 託 会 社 )	(3)	(0.028)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	3	0.024	(b) 売買委託手数料 = 作成期中の売買委託手数料 ÷ 作成期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
( 株 式 )	(3)	(0.024)	
(c) 有価証券取引税	1	0.007	(c) 有価証券取引税 = 作成期中の有価証券取引税 ÷ 作成期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
( 株 式 )	(1)	(0.007)	
(d) その他費用	1	0.009	(d) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数
( 保 管 費 用 )	(1)	(0.007)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
( 監 査 費 用 )	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合 計	115	0.975	

作成期中の平均基準価額は、11,816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。

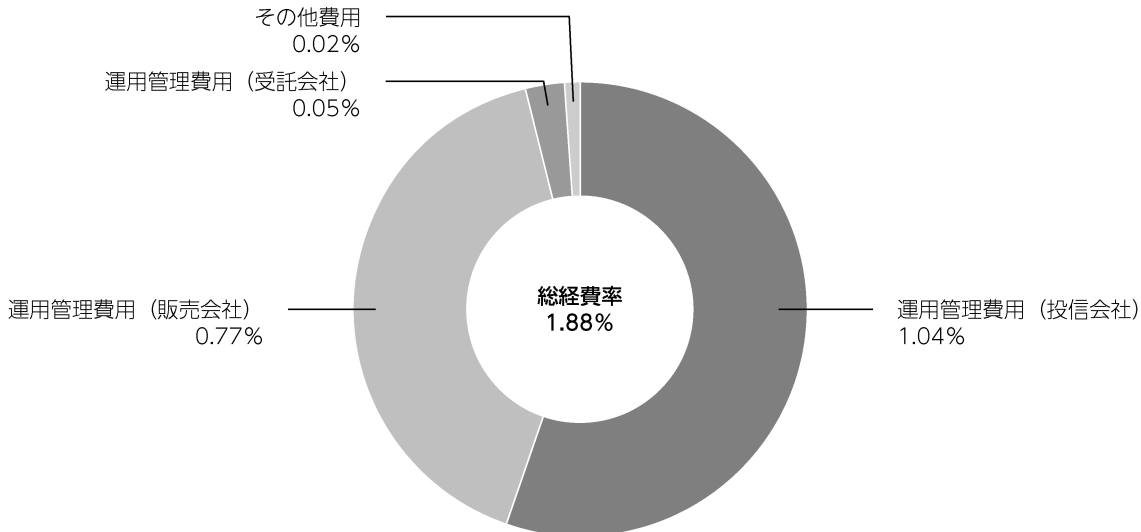
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

## （参考情報）

### ■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成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1.88%**です。



(注) 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、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前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

(2023年12月7日～2024年6月6日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第36期～第41期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
サイバーセキュリティ株式マザーファンド	1,379,365	5,609,000	5,011,868	20,127,000

## ○株式売買比率

(2023年12月7日～2024年6月6日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第36期～第41期	
	サイバーセキュリティ株式マザーファンド	
(a) 当作成期中の株式売買金額	352,802,857千円	
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	497,574,996千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.70	

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年12月7日～2024年6月6日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;サイバーセキュリティ株式オープン（為替ヘッジなし）予想分配金提示型&gt;

該当事項はございません。

&lt;サイバーセキュリティ株式マザーファンド&gt;

区 分	第36期～第41期					
	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	132,283	—	—	220,519	71	0.0
為替直物取引	19,612	5,157	26.3	103,514	28,662	27.7

平均保有割合 12.8%

※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該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	第36期～第41期
売買委託手数料総額 (A)	15,865千円
うち利害関係人への支払額 (B)	10千円
(B) / (A)	0.1%

(注) 売買委託手数料総額は、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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2024年6月6日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第35期末	第41期末	
	口 数	口 数	評 価 額
サイバーセキュリティ株式マザーファンド	千口 18,057,695	千口 14,425,192	千円 59,025,004

○投資信託財産の構成

(2024年6月6日現在)

項 目	第41期末	
	評 価 額	比 率
サイバーセキュリティ株式マザーファンド	千円 59,025,004	% 96.8
コール・ローン等、その他	1,950,380	3.2
投資信託財産総額	60,975,384	100.0

(注) サイバーセキュリティ株式マザーファンドにおいて、作成期末における外貨建純資産（464,376,440千円）の投資信託財産総額（471,778,513千円）に対する比率は98.4%です。

(注) 外貨建資産は、作成期末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。なお、作成期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=155.78円	1 イギリスポンド=199.45円	
------------------	-------------------	--

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第36期末	第37期末	第38期末	第39期末	第40期末	第41期末
	2024年1月9日現在	2024年2月6日現在	2024年3月6日現在	2024年4月8日現在	2024年5月7日現在	2024年6月6日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	63,630,272,888	68,169,658,149	67,661,054,496	66,550,880,124	63,645,836,838	60,975,384,911
コール・ローン等	2,014,786,807	2,551,846,487	2,882,368,477	2,696,753,305	2,072,304,135	1,950,377,388
サイバーセキュリティ株式マザーファンド(評価額)	61,615,486,081	65,467,811,662	64,778,686,019	63,854,121,904	61,573,529,081	59,025,004,136
未収入金	—	150,000,000	—	—	—	—
未収利息	—	—	—	4,915	3,622	3,387
(B) 負債	773,214,113	1,965,830,790	2,101,598,593	1,318,948,642	1,325,249,620	675,862,850
未払収益分配金	564,723,832	1,635,381,732	1,641,159,963	1,101,260,314	1,087,133,784	539,007,222
未払解約金	96,312,393	235,078,350	359,132,087	106,071,184	143,639,273	40,556,889
未払信託報酬	111,939,943	95,168,907	101,090,927	111,381,288	94,276,926	96,095,256
未払利息	907	276	1,549	—	—	—
その他未払費用	237,038	201,525	214,067	235,856	199,637	203,483
(C) 純資産総額(A－B)	62,857,058,775	66,203,827,359	65,559,455,903	65,231,931,482	62,320,587,218	60,299,522,061
元本	56,472,383,201	54,512,724,423	54,705,332,111	55,063,015,709	54,356,689,224	53,900,722,262
次期繰越損益金	6,384,675,574	11,691,102,936	10,854,123,792	10,168,915,773	7,963,897,994	6,398,799,799
(D) 受益権総口数	56,472,383,201口	54,512,724,423口	54,705,332,111口	55,063,015,709口	54,356,689,224口	53,900,722,262口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,131円	12,145円	11,984円	11,847円	11,465円	11,187円

○損益の状況

項 目	第36期	第37期	第38期	第39期	第40期	第41期
	2023年12月7日～ 2024年1月9日	2024年1月10日～ 2024年2月6日	2024年2月7日～ 2024年3月6日	2024年3月7日～ 2024年4月8日	2024年4月9日～ 2024年5月7日	2024年5月8日～ 2024年6月6日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 5,595	△ 2,470	△ 2,604	17,702	17,720	19,709
受取利息	—	153	—	18,805	17,720	19,709
支払利息	△ 5,595	△ 2,623	△ 2,604	△ 1,103	—	—
(B) 有価証券売買損益	1,531,058,835	7,182,271,372	774,182,245	452,662,815	△ 879,421,165	△ 866,170,952
売買益	1,633,386,586	7,443,847,997	870,734,519	467,326,652	35,773,558	21,126,487
売買損	△ 102,327,751	△ 261,576,625	△ 96,552,274	△ 14,663,837	△ 915,194,723	△ 887,297,439
(C) 信託報酬等	△ 112,176,981	△ 95,370,432	△ 101,304,994	△ 111,617,144	△ 94,476,563	△ 96,298,739
(D) 当期損益金 (A + B + C)	1,418,876,259	7,086,898,470	672,874,647	341,063,373	△ 973,880,008	△ 962,449,982
(E) 前期繰越損益金	2,027,118,232	2,738,260,429	7,861,600,788	6,706,800,604	5,778,905,185	3,610,726,836
(F) 追加信託差損益金	3,503,404,915	3,501,325,769	3,960,808,320	4,222,312,110	4,246,006,601	4,289,530,167
(配当等相当額)	( 9,704,713,007)	( 9,411,506,122)	( 9,801,948,606)	( 10,098,229,619)	( 10,060,686,398)	( 10,072,304,816)
(売買損益相当額)	(△6,201,308,092)	(△ 5,910,180,353)	(△ 5,841,140,286)	(△ 5,875,917,509)	(△ 5,814,679,797)	(△ 5,782,774,649)
(G) 計 (D + E + F)	6,949,399,406	13,326,484,668	12,495,283,755	11,270,176,087	9,051,031,778	6,937,807,021
(H) 収益分配金	△ 564,723,832	△ 1,635,381,732	△ 1,641,159,963	△ 1,101,260,314	△ 1,087,133,784	△ 539,007,222
次期繰越損益金 (G + H)	6,384,675,574	11,691,102,936	10,854,123,792	10,168,915,773	7,963,897,994	6,398,799,799
追加信託差損益金	3,503,404,915	3,501,325,769	3,960,808,320	4,222,312,110	4,246,006,601	4,289,530,167
(配当等相当額)	( 9,705,268,436)	( 9,411,578,711)	( 9,802,551,263)	( 10,098,806,712)	( 10,060,820,535)	( 10,072,381,751)
(売買損益相当額)	(△6,201,863,521)	(△ 5,910,252,942)	(△ 5,841,742,943)	(△ 5,876,494,602)	(△ 5,814,813,934)	(△ 5,782,851,584)
分配準備積立金	2,881,270,659	8,189,777,167	6,893,315,472	5,946,603,663	4,691,771,401	4,017,528,490
繰越損益金	—	—	—	—	△ 973,880,008	△ 1,908,258,858

(注) (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) (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) (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>

- ①作成期首（前作成期末）元本額 59,227,576,602円  
 作成期中追加設定元本額 8,052,886,640円  
 作成期中一部解約元本額 13,379,740,980円  
 また、1口当たり純資産額は、作成期末1,1187円です。

②分配金の計算過程

項 目	2023年12月7日～ 2024年1月9日	2024年1月10日～ 2024年2月6日	2024年2月7日～ 2024年3月6日	2024年3月7日～ 2024年4月8日	2024年4月9日～ 2024年5月7日	2024年5月8日～ 2024年6月6日
費用控除後の配当等収益額	43,123,221円	11,234,923円	17,611,140円	21,716,135円	—円	—円
費用控除後・繰越欠損金繰填後の有価証券売買等損益額	1,375,753,038円	7,075,663,547円	655,263,507円	319,347,238円	—円	—円
収益調整金額	9,705,268,436円	9,411,578,711円	9,802,551,263円	10,098,806,712円	10,060,820,535円	10,072,381,751円
分配準備積立金額	2,027,118,232円	2,738,260,429円	7,861,600,788円	6,706,800,604円	5,778,905,185円	4,556,535,712円
当ファンドの分配対象収益額	13,151,262,927円	19,236,737,610円	18,337,026,698円	17,146,670,689円	15,839,725,720円	14,628,917,463円
1万円当たり収益分配対象額	2,328円	3,528円	3,351円	3,114円	2,914円	2,714円
1万円当たり分配金額	100円	300円	300円	200円	200円	100円
収益分配金金額	564,723,832円	1,635,381,732円	1,641,159,963円	1,101,260,314円	1,087,133,784円	539,007,222円

③「サイバーセキュリティ株式マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の60以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

## ○分配金のお知らせ

	第36期	第37期	第38期	第39期	第40期	第41期
1万口当たり分配金（税込み）	100円	300円	300円	200円	200円	100円

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、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）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者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、その後の個々の受益者の個別元本となります。

\*三菱UFJアセットマネジメントでは本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ（<https://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。



## サイバーセキュリティ株式マザーファンド

### 《第14期》決算日2024年6月6日

〔計算期間：2023年12月7日～2024年6月6日〕

「サイバーセキュリティ株式マザーファンド」は、6月6日に第14期の決算を行いました。  
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	<p>主として日本を含む世界の金融商品取引所に上場しているサイバーセキュリティ関連企業の株式に投資を行います。なお、当ファンドにおいて、サイバーセキュリティ関連企業とは、サイバー攻撃に対するセキュリティ技術を有し、これを活用した製品・サービスを提供するテクノロジー関連の企業等をいいます。</p> <p>株式等への投資にあたっては、サイバーセキュリティの需要拡大および技術向上の恩恵を享受すると考えられる企業の株式の中から、持続的な利益成長性、市場優位性、財務健全性、株価水準等を考慮して組入銘柄を選定します。</p> <p>株式等の運用にあたっては、ヴォヤ・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシーに運用指図に関する権限を委託します。</p> <p>株式等の組入比率は高位を維持することを基本とします。</p> <p>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。</p>
主 要 運 用 対 象	日本を含む世界のサイバーセキュリティ関連企業の株式を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	<p>株式への投資割合に制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合に制限を設けません。</p>

### ○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰 落	中 率			
	円		%	%	%	百万円
10期(2022年6月6日)	27,115	△16.6		95.0	—	491,154
11期(2022年12月6日)	23,968	△11.6		95.6	—	417,462
12期(2023年6月6日)	29,573	23.4		97.6	—	477,384
13期(2023年12月6日)	35,944	21.5		98.3	—	492,596
14期(2024年6月6日)	40,918	13.8		97.8	—	471,778

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年	月	日	基準価額		株組入比率	株式先物比率
			円	騰落率		
	(期首)					
	2023年12月6日		35,944	—	98.3	—
	12月末		37,419	4.1	98.2	—
	2024年1月末		41,167	14.5	97.1	—
	2月末		42,760	19.0	98.2	—
	3月末		42,274	17.6	97.2	—
	4月末		42,115	17.2	98.3	—
	5月末		40,553	12.8	97.4	—
	(期末)					
	2024年6月6日		40,918	13.8	97.8	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

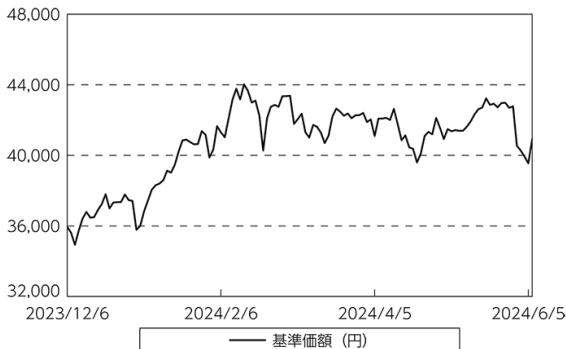
## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

## ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ13.8%の上昇となりました。

基準価額等の推移



## ●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

個別銘柄 (NVIDIA CORPやBROADCOM INCなど) の株価上昇や、米ドルが円に対して上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。

## ●投資環境について

## ◎株式市況

- ・テクノロジーセクターの株価は、上昇しました。
- ・米国でのインフレ圧力の根強さが確認され、利下げ観測の後退や金利上昇への警戒感から一時的に下落する局面もありましたが、米国において底堅い経済指標が発表されたことや一部企業が良好な決算を発表したことなどを受けて、上昇しました。

## ◎為替市況

- ・当ファンドの主要投資先通貨である米ドルは対円で上昇しました。
- ・日米の中央銀行による金融政策の公表を受け、日米の金利差が開いた状況が続くとの見方が強まったことなどから、米ドルは対円で上昇しました。

**●当該投資信託のポートフォリオについて**

- ・日本を含む世界のサイバーセキュリティ関連企業の株式に投資を行いました。なお、当ファンドにおいて、サイバーセキュリティ関連企業とは、サイバー攻撃に対するセキュリティ技術を有し、これを活用した製品・サービスを提供するテクノロジー関連の企業等をいいます。
- ・株式等への投資にあたっては、サイバーセキュリティの需要拡大および技術向上の恩恵を享受すると考えられる企業の株式の中から、持続的な利益成長性、市場優位性、財務健全性、株価水準等を考慮して組入銘柄を選定しました。
- ・銘柄選定にあたっては、セキュリティが脆弱な企業からの需要増加の恩恵を受ける企業をはじめ、IOTやクラウド・コンピューティングなどの分野でのセキュリティ関連企業、サイバーセキュリティに関するコンサルティングサービスを提供する企業などに注目しました。なお、株式等の運用にあたっては、ヴォヤ・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシーに運用指図に関する権限を委託しています。

- ・銘柄入替のポイントは、決算内容が良好であったことに加え、利益率が改善すると判断したことなどから、AMAZON.COM INCを新規購入しました。株価はすでにファンダメンタルズを織り込んだと判断したことや競合他社の生成AIツールとの競争などを背景とした業績見通しの悪化懸念などから、ADOBE INCを全売却しました。

**○今後の運用方針**

- ・サイバーセキュリティ関連銘柄は、短期的に値動きが大きくなることがあるものの、個人・企業・国のサイバーセキュリティへの関心やテクノロジーの発展に伴う長期的な需要が見込まれ、同ビジネスを営む企業への投資妙味は大きいと見ています。当ファンドの運用については、引き続き、サイバー攻撃に対するセキュリティ技術を有し、これを活用した製品・サービスを提供するテクノロジー関連の企業への投資を行います。銘柄選定にあたっては、セキュリティが脆弱な企業からの需要増加の恩恵を受ける企業をはじめ、IOTやクラウド・コンピューティングなどの分野でのセキュリティ関連企業、サイバーセキュリティに関するコンサルティングサービスを提供する企業などに注目しています。
- ・株式等の運用にあたっては、ヴォヤ・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシーに運用指図に関する権限を委託します。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年12月7日～2024年6月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 ( 株 式 )	円 10 (10)	% 0.024 (0.024)	(a) 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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 ( 株 式 )	3 ( 3 )	0.007 (0.007)	(b) 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 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 )	3 ( 3 )	0.007 (0.007)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
合 計	16	0.038	
期中の平均基準価額は、40,744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12月7日～2024年6月6日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上場	千株 —	千円 —	千株 267	千円 2,192,940
外国	アメリカ	百株 90,369	千アメリカドル 865,195	百株 120,452	千アメリカドル 1,375,653
	イギリス	30,529	千イギリスポンド 13,327	1,121	千イギリスポンド 662
	韓国	—	千韓国ウォン —	14,344	千韓国ウォン 104,854,756

(注) 金額は受渡代金。

## ○株式売買比率

(2023年12月7日～2024年6月6日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	353,848,319千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	497,574,996千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.71

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年12月7日～2024年6月6日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	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	$\frac{D}{C}$
株式	132,715	—	—	221,133	71	0.0
為替直物取引	19,612	5,157	26.3	103,514	28,662	27.7

## 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	124,506千円
うち利害関係人への支払額 (B)	78千円
(B) / (A)	0.1%

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

## ○組入資産の明細

(2024年6月6日現在)

## 国内株式

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	金 額	株 数	評 価 額
情報・通信業 (100.0%)	千株	千円	千株	千円
トレンドマイクロ	563.1		295.2	2,084,702
合 計	株 数	金 額	株 数	評 価 額
銘 柄 数 < 比 率 >	1		1	< 0.4% >

(注) 銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

## 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 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	千アメリカドル	千円	
ADVANCED MICRO DEVICES	3,540	2,740	45,538	7,094,048	半導体・半導体製造装置
ACCENTURE PLC-CL A	1,202	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MICRON TECHNOLOGY INC	8,102	2,260	30,228	4,708,993	半導体・半導体製造装置
WESTERN DIGITAL CORP	8,455	12,186	93,717	14,599,250	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CADENCE DESIGN SYS INC	1,511	1,855	54,989	8,566,305	ソフトウェア・サービス
CACI INTERNATIONAL INC -CL A	—	688	29,178	4,545,404	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	16,023	6,686	30,770	4,793,441	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MICROSOFT CORP	3,187	2,767	117,337	18,278,844	ソフトウェア・サービス
ORACLE CORP	674	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LAM RESEARCH CORP	—	411	39,971	6,226,791	半導体・半導体製造装置
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,822	3,318	51,039	7,950,997	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE INC	1,761	3,000	70,964	11,054,914	ソフトウェア・サービス
SYNOPSYS INC	—	686	40,381	6,290,660	ソフトウェア・サービス
AMAZON.COM INC	—	3,761	68,195	10,623,529	一般消費財・サービス流通・小売り
VERISIGN INC	1,443	—	—	—	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	1,357	871	106,684	16,619,299	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	11,022	3,320	30,126	4,693,176	ソフトウェア・サービス
ADOBE INC	1,549	—	—	—	ソフトウェア・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	—	2,437	32,489	5,061,240	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LEIDOS HOLDINGS INC	—	2,005	29,211	4,550,634	商業・専門サービス
FORTINET INC	10,108	11,640	69,503	10,827,276	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	2,109	1,502	105,769	16,476,740	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL C	3,789	—	—	—	メディア・娯楽
PALO ALTO NETWORKS INC	6,282	5,813	171,736	26,753,082	ソフトウェア・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	6,041	5,264	124,970	19,467,920	ソフトウェア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	3,945	1,719	51,169	7,971,201	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TWILIO INC - A	9,905	—	—	—	ソフトウェア・サービス
QUALYS INC	3,402	2,953	40,110	6,248,471	ソフトウェア・サービス
RAPID7 INC	5,856	4,182	15,118	2,355,172	ソフトウェア・サービス
VARONIS SYSTEMS INC	15,389	10,184	43,640	6,798,269	ソフトウェア・サービス
OKTA INC	10,477	15,589	137,980	21,494,677	ソフトウェア・サービス
ZSCALER INC	9,278	7,151	124,846	19,448,565	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	1,728	1,431	202,235	31,504,291	半導体・半導体製造装置
ELASTIC NV	2,847	3,164	33,931	5,285,838	ソフトウェア・サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	—	4,848	66,742	10,397,128	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MONGODB INC	1,990	1,421	33,164	5,166,385	ソフトウェア・サービス
TENABLE HOLDINGS INC	24,513	19,521	80,544	12,547,230	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,560	5,809	198,776	30,965,451	ソフトウェア・サービス
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	3,758	5,551	85,175	13,268,649	商業・専門サービス
DATADOG INC - CLASS A	8,126	7,736	85,473	13,314,995	ソフトウェア・サービス
DYNATRACE INC	12,937	14,476	67,578	10,527,385	ソフトウェア・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	21,807	16,775	117,176	18,253,725	ソフトウェア・サービス
SMARTSHEET INC-CLASS A	12,181	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3,672	2,653	35,633	5,550,936	ソフトウェア・サービス
JFROG LTD	11,930	15,813	51,028	7,949,282	ソフトウェア・サービス
CONFLUENT INC-CLASS A	8,573	7,442	19,618	3,056,241	ソフトウェア・サービス

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) SENTINELONE INC -CLASS A RUBRIK INC-A	百株 28,865 —	百株 44,346 5,659	千アメリカドル 76,896 17,770	千円 11,978,915 2,768,266	ソフトウェア・サービス ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 301,735	271,652	2,927,420	456,033,634	
	銘柄数<比率>	40	41	—	<96.7%>
(イギリス) DARKTRACE PLC	—	29,407	千イギリスポンド 17,056	3,401,923	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 —	29,407	17,056	3,401,923	
	銘柄数<比率>	—	1	—	<0.7%>
(韓国) SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	14,344	—	千韓国ウォン —	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額 14,344	—	—	—	
	銘柄数<比率>	1	—	—	<—%>
合計	株数・金額 316,080	301,059	—	459,435,557	
	銘柄数<比率>	41	42	—	<97.4%>

(注) 邦貨換算金額は、期末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) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

## ○投資信託財産の構成

(2024年6月6日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
株式	千円 461,520,260	% 97.8
コール・ローン等、その他	10,258,253	2.2
投資信託財産総額	471,778,513	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(464,376,440千円)の投資信託財産総額(471,778,513千円)に対する比率は98.4%です。

(注) 外貨建資産は、期末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。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=155.78円	1 イギリスポンド=199.45円	
------------------	-------------------	--



## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年6月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	471,778,513,887
コール・ローン等	10,228,334,850
株式(評価額)	461,520,260,194
未収配当金	29,909,607
未収利息	9,236
(B) 負債	0
(C) 純資産総額(A-B)	471,778,513,887
元本	115,298,821,106
次期繰越損益金	356,479,692,781
(D) 受益権総口数	115,298,821,106口
1万口当たり基準価額(C/D)	40,918円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 137,044,681,616円  
 期中追加設定元本額 4,388,174,641円  
 期中一部解約元本額 26,134,035,151円  
 また、1口当たり純資産額は、期末4.0918円です。

## ②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

サイバーセキュリティ株式オープン(為替ヘッジなし)	82,542,126,344円
サイバーセキュリティ株式オープン(為替ヘッジあり)	15,337,870,296円
サイバーセキュリティ株式オープン(為替ヘッジなし) 予想分配金提示型	14,425,192,858円
サイバーセキュリティ株式オープン(為替ヘッジあり) 予想分配金提示型	1,788,787,523円
三菱UFJ国際サイバーセキュリティ株式オープン(為替ヘッジなし)(FOFs用)(適格機関投資家限定)	1,182,831,466円
サイバーセキュリティ株式オープン<隔月決算型>(為替ヘッジなし) 予想分配金提示型	22,012,619円
合計	115,298,821,106円

## ○損益の状況 (2023年12月7日~2024年6月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,011,820,248
受取配当金	890,173,213
受取利息	120,584,780
その他収益金	1,221,228
支払利息	△ 158,973
(B) 有価証券売買損益	65,926,100,074
売買益	100,342,663,442
売買損	△ 34,416,563,368
(C) 保管費用等	△ 34,438,908
(D) 当期損益金(A+B+C)	66,903,481,414
(E) 前期繰越損益金	355,551,550,857
(F) 追加信託差損益金	12,951,625,359
(G) 解約差損益金	△ 78,926,964,849
(H) 計(D+E+F+G)	356,479,692,781
次期繰越損益金(H)	356,479,692,781

- (注) (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) (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) (G) 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。