

デジタル・トランスフォーメーション株式ファンド（予想分配金提示型） 〈愛称 ゼロ・CONTACT（予想分配金提示型）〉

運用報告書（全体版）

第38期（決算日 2024年7月8日）第40期（決算日 2024年9月9日）第42期（決算日 2024年11月7日）
第39期（決算日 2024年8月7日）第41期（決算日 2024年10月7日）第43期（決算日 2024年12月9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。

「デジタル・トランスフォーメーション株式ファンド（予想分配金提示型）」は、2024年12月9日に第43期の決算を行ないましたので、第38期から第43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／内外／株式	
信託期間	2021年5月14日から2030年6月7日までです。	
運用方針	主として、「グローバル・デジタル・トランスフォーメーション株式マザーファンド」受益証券に投資を行ない、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	デジタル・トランスフォーメーション株式ファンド（予想分配金提示型）	「グローバル・デジタル・トランスフォーメーション株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
	グローバル・デジタル・トランスフォーメーション株式マザーファンド	日本を含む世界の金融商品取引所上場株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。
組入制限	デジタル・トランスフォーメーション株式ファンド（予想分配金提示型）	株式への実質投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	グローバル・デジタル・トランスフォーメーション株式マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎決算時、原則として分配対象額のなかから、基準価額水準、市況動向などを勘案して分配を行なう方針です。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。	

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/

<645030>

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。

2025年9月1日、日興アセットマネジメント株式会社は「アモヴァ・アセットマネジメント株式会社」に社名変更します。
社名変更後URL：www.amova-am.com

●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			株組 入比	式率 %	純資 産額
		税分	込配	み金 期騰落			
	円		円			%	百万円
14期(2022年7月7日)	4,269		0	△ 3.4		97.5	1,597
15期(2022年8月8日)	4,871		0	14.1		97.5	1,847
16期(2022年9月7日)	4,133		0	△15.2		97.2	1,616
17期(2022年10月7日)	4,229		0	2.3		97.6	1,670
18期(2022年11月7日)	3,826		0	△ 9.5		96.1	1,530
19期(2022年12月7日)	3,677		0	△ 3.9		96.7	1,429
20期(2023年1月10日)	3,429		0	△ 6.7		97.3	1,378
21期(2023年2月7日)	4,417		0	28.8		97.1	1,781
22期(2023年3月7日)	4,391		0	△ 0.6		96.8	1,749
23期(2023年4月7日)	4,219		0	△ 3.9		96.9	1,667
24期(2023年5月8日)	4,154		0	△ 1.5		97.3	1,631
25期(2023年6月7日)	4,869		0	17.2		96.9	1,875
26期(2023年7月7日)	5,116		0	5.1		96.9	2,018
27期(2023年8月7日)	5,362		0	4.8		94.7	2,215
28期(2023年9月7日)	5,370		0	0.1		97.2	2,138
29期(2023年10月10日)	4,931		0	△ 8.2		97.0	1,961
30期(2023年11月7日)	5,191		0	5.3		97.3	2,059
31期(2023年12月7日)	6,043		0	16.4		96.4	2,501
32期(2024年1月9日)	6,260		0	3.6		96.5	2,871
33期(2024年2月7日)	6,416		0	2.5		97.1	2,921
34期(2024年3月7日)	6,855		0	6.8		97.3	2,961
35期(2024年4月8日)	6,941		0	1.3		97.1	2,848
36期(2024年5月7日)	6,947		0	0.1		97.2	2,662
37期(2024年6月7日)	6,805		0	△ 2.0		97.2	2,411
38期(2024年7月8日)	7,242		0	6.4		96.3	2,242
39期(2024年8月7日)	5,812		0	△19.7		96.2	1,749
40期(2024年9月9日)	6,003		0	3.3		96.5	1,715
41期(2024年10月7日)	7,091		0	18.1		96.8	1,951
42期(2024年11月7日)	8,216		0	15.9		96.8	2,096
43期(2024年12月9日)	9,549		0	16.2		96.2	2,458

(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」は実質比率を記載しております。

(注) ファンドの商品性格に適合する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		株 組 入 比 率
			騰 落 率	式 率	
第38期	(期 首) 2024年6月7日	円 6,805	% —	% 97.2	
	6月末	7,131	4.8	96.8	
	(期 末) 2024年7月8日	7,242	6.4	96.3	
第39期	(期 首) 2024年7月8日	7,242	—	96.3	
	7月末	6,450	△10.9	96.9	
	(期 末) 2024年8月7日	5,812	△19.7	96.2	
第40期	(期 首) 2024年8月7日	5,812	—	96.2	
	8月末	6,446	10.9	96.8	
	(期 末) 2024年9月9日	6,003	3.3	96.5	
第41期	(期 首) 2024年9月9日	6,003	—	96.5	
	9月末	6,832	13.8	96.9	
	(期 末) 2024年10月7日	7,091	18.1	96.8	
第42期	(期 首) 2024年10月7日	7,091	—	96.8	
	10月末	7,745	9.2	96.8	
	(期 末) 2024年11月7日	8,216	15.9	96.8	
第43期	(期 首) 2024年11月7日	8,216	—	96.8	
	11月末	8,823	7.4	96.5	
	(期 末) 2024年12月9日	9,549	16.2	96.2	

(注) 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、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。

○運用経過

(2024年6月8日～2024年12月9日)

作成期間中の基準価額等の推移



第38期首：6,805円

第43期末：9,549円（既払分配金(税込み)：0円）

騰落率：40.3%（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6月7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、「グローバル・デジタル・トランスフォーメーション株式マザーファンド」受益証券に投資を行ない、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＞

- ・人工知能（AI）や半導体への期待を背景に米国の主要株価指数が過去最高値を更新するなど、先進国において株式市場が好調に推移したこと。
- ・クラウドベースのソリューションへの継続的な移行や、AIと機械学習における進歩およびコスト削減が見られたこと。
- ・暗号通貨市場が急上昇したこと。

＜値下がり要因＞

- ・中国の景気後退や中東情勢の悪化に対する懸念が市場の重しとなったこと。
- ・一部の企業で冴えない業績を背景に株価が低迷したこと。

投資環境

（株式市況）

米国連邦準備制度理事会（FRB）が2024年9月に利下げを実施して他の主要中央銀行に続くなか、株式市場はほぼ全地域で上昇しました。インフレ指標は、消費者物価指数（CPI）が予想の範囲内にとどまるなど、鈍化しています。日銀が利上げを実施して顕著に例外的な動きを見せると、世界のボラティリティ（変動性）が一時的に高まりました。期間末にかけては、米国の大統領選挙の結果を受けて、規制の緩和や税負担の軽減に対する期待が市場全体の追い風となり、市場は大幅に上昇しました。

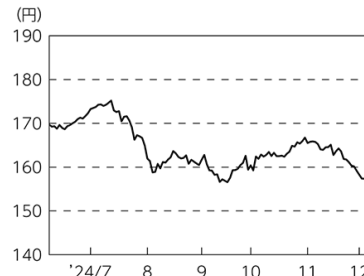
（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、右記の推移となりました。

円／アメリカドルの推移



円／ユーロの推移



当ファンドのポートフォリオ

（当ファンド）

当ファンドは、「グローバル・デジタル・トランスフォーメーション株式マザーファンド」受益証券を高位に組み入れて運用を行ないました。

（グローバル・デジタル・トランスフォーメーション株式マザーファンド）

期間中の主な投資行動としては、ギットラボ（ソフトウェア・サービス）を新規に組み入れました。AIによってコーディング（プログラミング言語を使用して指示や命令文を作成すること）スキルはすでに一般利用化されており、専門の開発者の生産性を何倍にも高めているとともに、あらゆるスキルレベルの人々がソフトウェア・アプリケーションを作成できるようになっています。これをきっかけとして、AIエージェントが人間によるコーディングの生産性を高めるだけでなく、独自にコードやアプリケーションを作成して人間の代わりにより複雑なタスクを実行するAI革命がさらに広がっていくと考えています。こうした流れを受けて今後使用されるソフトウェアの数が急激に増加し、それによってコーディング・エージェント自体への需要とともに、開発・セキュリティ・運用プラットフォームへの需要が高まっていくとみられます。生成AIによる生産性向上を活かし、より多くの開発者がより多くのコードを作成するようになるにつれ、特に独自のAI

コーディング・エージェント・ツールを開発する同社は、ユーザーベースと1ユーザー当たり平均収益の両方を急速に拡大していくことができる見通しです。A I の普及に予想以上の時間がかかる場合でも、顧客の間で開発・セキュリティ・運用ツールの調達先ベンダーをより少数へと整理統合しようとする傾向が見られており、足元ではそうした流れが追い風となっています。

また、Rubrik（ソフトウェア・サービス）を新規に組み入れました。同社は世界中のデータを安全に守ることを使命としており、先進的なゼロトラストデータセキュリティ・プラットフォームによって、サイバーレジリエンス（強韌性）を実現しています。同社のプラットフォームは、クラウド上での利用を前提としたSaaS（ソフトウェアサービス）型アーキテクチャを活用して、企業向けシステムやクラウドベースのアプリケーション、SaaSソリューションなどの様々な環境にわたってデータを保護するように構築されています。ランサムウェアを中心とした高度なサイバー攻撃を防御するだけでなく、そうした攻撃から復旧することを目的としています。この分野は従来型のサイバーセキュリティ対策やバックアップ・システムでは不十分であることが多いことから、極めて重要な機能といえます。

一方、ズーム・コミュニケーションズ（ソフトウェア・サービス）を全売却しました。無料アカウントから有料アカウントへの誘導に苦戦していることや、A I サポート型ドキュメント機能の提供開始が遅れていることなどから、プロダクト・リーダーシップおよび実行力の各評価スコアを最近引き下げました。より確信度の高い銘柄へ投資するために、同社の保有を解消しました。

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38期	第39期	第40期	第41期	第42期	第43期
	2024年6月8日～ 2024年7月8日	2024年7月9日～ 2024年8月7日	2024年8月8日～ 2024年9月9日	2024年9月10日～ 2024年10月7日	2024年10月8日～ 2024年11月7日	2024年11月8日～ 2024年12月9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	1,003	1,003	1,004	1,005	1,980	3,294

（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、ファンドの基本方針に則り、「グローバル・デジタル・トランスフォーメーション株式マザーファンド」受益証券を原則として高位に組み入れて運用を行ないます。

（グローバル・デジタル・トランスフォーメーション株式マザーファンド）

世界経済はオフラインからオンラインへ、対面からデジタルへと移行しつつあります。娯楽と仕事の両面において成長を牽引するのは、「ゼロ・CONTACT（非接触型）」やフリクションレス（手間やストレスがない状態）であるとみています。この長期的なトレンドはモバイル・インターネットから始まり、新型コロナウイルスが世界中で感染拡大する間に加速し、消費者や企業の行動様式を恒久的に変化させたと考えています。

世界の最大手企業2,000社にとって、最も緊急を要する取り組みは「デジタル・トランスフォーメーション（DX）」、つまりクラウドやモバイル・コンピューティングをベースにデジタル・ワークフローを活用するプラットフォームへと事業を再構築することです。テクノロジーは、手作業を自動化することで農業や製造業をすでに大きく変化させており、長期的な生産性の向上をもたらしています。

当ファンドでは、今後数十年の間にクラウド・コンピューティングやAIのようなテクノロジーによって、データ収集、分析、営業およびマーケティング、顧客サービスなどその他の頭脳労働が自動化されるとみています。「SaaS」を用いたビジネスモデルの追い風を活かして、DX関連のソフトウェア市場は、クラウド・コンピューティングやAIの採用がドライバーとなり、2023年の2,000億アメリカドルから今後10年間で約14兆アメリカドルに成長するとみられます。

また、ストリーミングによって、消費者はビデオ、オーディオ、ゲームの膨大なコンテンツ・ライブラリーにアクセスできます。ストリーミングはコンテンツ配信における主要なテクノロジーになり、視聴習慣の新しい形態になると考えています。ユーザーはオンデマンドのエンターテインメントをあらゆる形態で視聴することを期待しています。世界のストリーミングの売上は、2023年の推定1,120億ドルから10年余りの間に3,000億アメリカドルを超える規模になるとみられ、今後5年間で3倍超に拡大する可能性もあると予想しています。

主として、日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場されている、生活や社会のデジタル化に関連するビジネスを行なう企業の株式に投資を行ない、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。

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、よろしくごお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2024年 6 月 8 日～2024年12月 9 日）

項 目	第38期～第43期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	66	0.912	(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 ）	(32)	(0.446)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(32)	(0.446)	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 ）	(1)	(0.020)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	1	0.017	(b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 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 ）	(1)	(0.017)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	(c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 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 ）	(0)	(0.001)	
(d) そ の 他 費 用	4	0.056	(d) 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
（ 保 管 費 用 ）	(0)	(0.006)	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 ）	(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 ）	(4)	(0.048)	印刷費用等は、法定開示資料の印刷に係る費用、運用において利用する指数の 標章使用料など
合 計	71	0.986	
作成期間の平均基準価額は、7,237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。

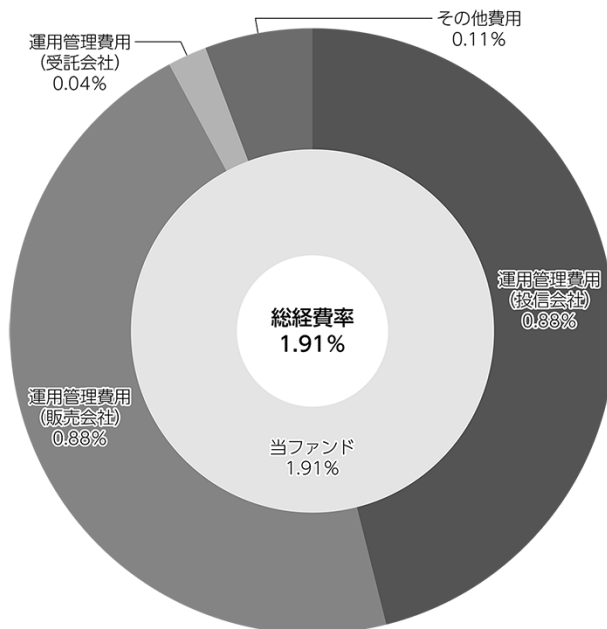
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

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1.91%です。



(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」にてご確認ください。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(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6月8日～2024年12月9日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第38期～第43期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
グローバル・デジタル・トランスフォーメーション株式マザーファンド	千口 97,978	千円 117,584	千口 835,327	千円 826,679

○株式売買比率

(2024年6月8日～2024年12月9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38期～第43期	
	グローバル・デジタル・トランスフォーメーション株式マザーファンド	
(a) 当作成期中の株式売買金額	134,677,502千円	
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	272,032,682千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.49	

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

(2024年6月8日～2024年12月9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6月8日～2024年12月9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6月8日～2024年12月9日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2024年12月9日現在)

親投資信託残高

銘	柄	第37期末		第43期末		
		口	数	口	数	評 価 額
			千口		千口	千円
グローバル・デジタル・トランスフォーメーション株式マザーファンド			2,533,716		1,796,367	2,393,299

(注) 親投資信託の2024年12月9日現在の受益権総口数は、247,610,221千口です。

○投資信託財産の構成

(2024年12月9日現在)

項	目	第43期末	
		評 価 額	比 率
		千円	%
グローバル・デジタル・トランスフォーメーション株式マザーファンド		2,393,299	96.2
コール・ローン等、その他		94,965	3.8
投資信託財産総額		2,488,264	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) グローバル・デジタル・トランスフォーメーション株式マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産（329,605,740千円）の投資信託財産総額（332,902,671千円）に対する比率は99.0%です。

(注) 外貨建資産は、当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。1アメリカドル=149.85円、1ユーロ=158.20円、1香港ドル=19.26円、1南アフリカランド=8.31円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第38期末	第39期末	第40期末	第41期末	第42期末	第43期末
	2024年7月8日現在	2024年8月7日現在	2024年9月9日現在	2024年10月7日現在	2024年11月7日現在	2024年12月9日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	2,324,746,838	1,757,892,716	1,722,270,173	1,960,777,041	2,104,114,704	2,488,264,240
コール・ローン等	56,325,167	53,163,205	48,769,629	50,664,888	54,740,520	67,950,188
<small>ファンド・デジタル・トランスフォーメーション株式ファンド</small>	2,187,349,501	1,704,729,164	1,667,685,780	1,910,111,825	2,049,373,831	2,393,299,913
未収入金	81,072,040	—	5,814,447	—	—	27,013,698
未収利息	130	347	317	328	353	441
(B) 負債	82,082,040	8,320,904	6,705,063	9,755,761	7,544,233	29,741,532
未払解約金	78,350,155	4,910,122	3,129,925	6,517,596	3,715,686	25,095,257
未払信託報酬	3,535,336	3,053,131	3,055,099	2,582,039	3,011,317	3,634,344
その他未払費用	196,549	357,651	520,039	656,126	817,230	1,011,931
(C) 純資産総額(A－B)	2,242,664,798	1,749,571,812	1,715,565,110	1,951,021,280	2,096,570,471	2,458,522,708
元本	3,096,843,747	3,010,138,983	2,857,780,815	2,751,400,544	2,551,846,544	2,574,594,522
次期繰越損益金	△ 854,178,949	△1,260,567,171	△1,142,215,705	△ 800,379,264	△ 455,276,073	△ 116,071,814
(D) 受益権総口数	3,096,843,747口	3,010,138,983口	2,857,780,815口	2,751,400,544口	2,551,846,544口	2,574,594,522口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,242円	5,812円	6,003円	7,091円	8,216円	9,549円

(注) 当ファンドの第38期首元本額は3,544,193,530円、第38～43期中追加設定元本額は259,105,817円、第38～43期中一部解約元本額は1,228,704,825円です。

(注) 1口当たり純資産額は、第38期0.7242円、第39期0.5812円、第40期0.6003円、第41期0.7091円、第42期0.8216円、第43期0.9549円です。

(注) 2024年12月9日現在、純資産総額は元本額を下回っており、その差額は116,071,814円です。

○損益の状況

項 目	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期	第43期
	2024年6月8日～ 2024年7月8日	2024年7月9日～ 2024年8月7日	2024年8月8日～ 2024年9月9日	2024年9月10日～ 2024年10月7日	2024年10月8日～ 2024年11月7日	2024年11月8日～ 2024年12月9日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	4,182	5,463	10,560	8,689	9,924	15,570
受取利息	4,182	5,463	10,560	8,689	9,924	15,570
(B) 有価証券売買損益	139,055,510	△ 427,055,741	57,044,048	301,850,432	288,962,102	341,946,002
売買益	145,365,137	3,729,448	68,156,255	310,503,680	298,243,978	354,214,490
売買損	△ 6,309,627	△ 430,785,189	△ 11,112,207	△ 8,653,248	△ 9,281,876	△ 12,268,488
(C) 信託報酬等	△ 3,731,885	△ 3,222,870	△ 3,224,947	△ 2,725,590	△ 3,178,730	△ 3,836,402
(D) 当期繰越益金(A+B+C)	135,327,807	△ 430,273,148	53,829,661	299,133,531	285,793,296	338,125,170
(E) 前期繰越損益金	△ 88,115,924	45,787,714	△ 363,045,426	△ 297,339,287	1,645,852	268,683,596
(F) 追加信託差損益金	△ 901,390,832	△ 876,081,737	△ 832,999,940	△ 802,173,508	△ 742,715,221	△ 722,880,580
(配当等相当額)	(263,663,163)	(256,383,539)	(243,642,465)	(234,625,357)	(218,037,149)	(241,300,031)
(売買損益相当額)	(△1,165,053,995)	(△1,132,465,276)	(△1,076,642,405)	(△1,036,798,865)	(△960,752,370)	(△964,180,611)
(G) 計(D+E+F)	△ 854,178,949	△ 1,260,567,171	△ 1,142,215,705	△ 800,379,264	△ 455,276,073	△ 116,071,814
(H) 収益分配金	0	0	0	0	0	0
次期繰越損益金(G+H)	△ 854,178,949	△ 1,260,567,171	△ 1,142,215,705	△ 800,379,264	△ 455,276,073	△ 116,071,814
追加信託差損益金	△ 901,390,832	△ 876,081,737	△ 832,999,940	△ 802,173,508	△ 742,715,221	△ 722,880,580
(配当等相当額)	(263,663,301)	(256,383,767)	(243,643,033)	(234,625,693)	(218,037,425)	(241,306,708)
(売買損益相当額)	(△1,165,054,133)	(△1,132,465,504)	(△1,076,642,973)	(△1,036,799,201)	(△960,752,646)	(△964,187,288)
分配準備積立金	47,211,883	45,787,714	43,508,356	42,121,005	287,439,148	606,808,766
繰越損益金	-	△ 430,273,148	△ 352,724,121	△ 40,326,761	-	-

(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) 親投資信託の信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要した費用のうち、2024年6月8日～2024年12月9日の期間に当ファンドが負担した費用は6,135,854円です。

(注) 分配金の計算過程(2024年6月8日～2024年12月9日)は以下の通りです。

項 目	2024年6月8日～ 2024年7月8日	2024年7月9日～ 2024年8月7日	2024年8月8日～ 2024年9月9日	2024年9月10日～ 2024年10月7日	2024年10月8日～ 2024年11月7日	2024年11月8日～ 2024年12月9日
a. 配当等収益(経費控除後)	132,059円	0円	273,898円	283,734円	3,726円	109,717円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越大損金補填後)	46,056,137円	0円	0円	0円	248,797,973円	338,015,453円
c. 信託約款に定める収益調整金	263,663,301円	256,383,767円	243,643,033円	234,625,693円	218,037,425円	241,306,708円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	1,023,687円	45,787,714円	43,234,458円	41,837,271円	38,637,449円	268,683,596円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	310,875,184円	302,171,481円	287,151,389円	276,746,698円	505,476,573円	848,115,474円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,003円	1,003円	1,004円	1,005円	1,980円	3,294円
g. 分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0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38期	第39期	第40期	第41期	第42期	第43期
1 万口当たり分配金（税込み）	0円	0円	0円	0円	0円	0円

○お知らせ

約款変更について

2024年6月8日から2024年12月9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。

その他の変更について

日興アセットマネジメント株式会社は、2025年9月1日よりアモーヴァ・アセットマネジメント株式会社に社名変更します。また、ホームページアドレスも「www.amova-am.com」へ変更となります。

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。

グローバル・デジタル・トランスフォーメーション株式マザーファンド

運用報告書

第4期（決算日 2024年6月7日）
（2023年6月8日～2024年6月7日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2020年7月31日から原則無期限です。
運用方針	主として、日本を含む世界の金融商品取引所上場株式に投資を行ない、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	日本を含む世界の金融商品取引所上場株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

ファンド概要

主として、日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場されている、生活や社会のデジタル化に関連するビジネスを行なう企業の株式に投資を行ない、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。
株式の銘柄選定にあたっては、各企業の成長性、収益性、財務健全性、流動性などを勘案して行ないます。
株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。
外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。
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。

日興アセットマネジメント

<639137>

【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。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		株 組 入 比 率	純 資 産 額
		期 騰 落	中 率		
(設定日)	円		%	%	百万円
2020年7月31日	10,000		—	—	88,245
1期(2021年6月7日)	13,252		32.5	99.6	630,087
2期(2022年6月7日)	5,751		△56.6	99.4	218,775
3期(2023年6月7日)	6,437		11.9	99.3	237,849
4期(2024年6月7日)	9,300		44.5	99.4	283,511

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) ファンドの商品性格に適合する適切なベンチマークおよび参考指数はございません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		株 組 入 比 率
		騰 落	率	
(期 首)	円		%	%
2023年6月7日	6,437		—	99.3
6月末	6,854		6.5	99.7
7月末	7,532		17.0	99.7
8月末	6,937		7.8	99.7
9月末	6,492		0.9	99.6
10月末	6,019		△ 6.5	99.6
11月末	7,975		23.9	99.4
12月末	8,812		36.9	99.5
2024年1月末	8,647		34.3	99.5
2月末	9,268		44.0	99.6
3月末	9,701		50.7	99.5
4月末	9,310		44.6	99.1
5月末	9,008		39.9	99.5
(期 末)				
2024年6月7日	9,300		44.5	99.4

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2023年6月8日～2024年6月7日)

基準価額の推移

期間の初め6,437円の基準価額は、期間末に9,300円となり、騰落率は+44.5%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。

<値上がり要因>

- ・人工知能（AI）が様々な業種に浸透し、イノベーションの促進や効率性の向上、複雑な課題への対処に役立てられ、幅広い業種の保有銘柄が恩恵を受けたこと。
- ・暗号資産市場が上昇基調となり、関連企業に対する追い風となったこと。
- ・世界の株式市場が好調に推移したこと。
- ・アメリカドルなど主要通貨に対して円安が進んだこと。

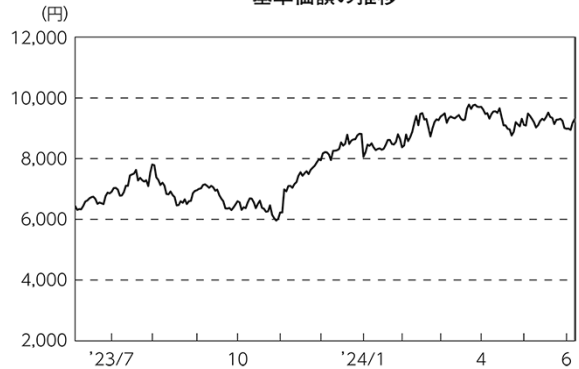
<値下がり要因>

- ・米国連邦準備制度理事会（FRB）議長が高金利政策の長期化を示唆するなど、市場で高金利の長期化懸念が広がったこと。
- ・一部の保有銘柄において業績が市場予想を下回り、株価が低迷したこと。
- ・世界の株式市場において、中小型銘柄よりも大型銘柄が相対的に大きく上昇したこと。

(株式市況)

世界の主要株式市場は、強弱入り混じる経済の兆候やFRBの次の政策動向を巡る見通しに左右される展開となり、ボラティリティ（価格変動性）の高い市場環境となりました。経済指標や雇用指標が堅調を維持する一方、インフレ指標は徐々に減速し始めました。高金利が長期にわたって継続するとの懸念や消費者心理が低迷するかもしれないとの懸念が重しとなったものの、株式市場は逆風を乗り越って上昇しました。米国の超大型テクノロジー企業を中心とした収益の底堅さが追い風となりました。

基準価額の推移



期 首	期中高値	期中安値	期 末
2023/06/07	2024/03/22	2023/10/30	2024/06/07
6,437円	9,778円	5,960円	9,300円

(為替市況)

期間中における主要通貨（対円）は、下記の推移となりました。



ポートフォリオ

期間中の当ファンドの基準価額は、上昇しました。アクティブ運用を行なう当ファンドでは、マクロ経済の状況を引き続き見通してポジションを適宜縮小・集約していく方針です。通常、市場が大幅に下落する局面でポートフォリオを集約し、市場が拡大する局面で銘柄数を増加しますが、足元の保有銘柄数を考慮すると、ポートフォリオをさらに集約することは考えていません。

期間中の主な投資行動としては、北米および国際的に、開発者やIT運用チーム、ビジネスユーザーを対象としたモニタリング・分析プラットフォームをクラウドで提供するデータドッグ（ソフトウェア・サービス）を、新規に組み入れました。生成AIによって生産性が向上し、開発者がコードを展開するペースが加速するなか、AIで動作するツールを中心として当社が提供する製品・サービスの重要性はますます高まるとみられます。当ファンドでは、既存のアプリケーションが引き続きクラウドへと移行し、またAIが新たなソフトウェアの作成ペースを加速させて獲得可能な市場が成長するなか、当社製品は価値を捉える競争力があると評価しています。

また、ペイパル・ホールディングス（金融サービス）も新規に組み入れました。自社ブランド決済（自社のブランディング要素を反映させてカスタマイズした、ウェブページなどでの決済プロセス）の部門が、後払い決済サービスを提供する競合他社に押されていることを受けて、投資家からの評価が過度に低くなっているとみています。当ファンドでは、ソフトウェア開発企業出身で経験豊富な最高経営責任者（CEO）を中心に、同部門の復活に注力するとともに、その他の決済部門を徐々に収益化していくと考えています。当ファンドのモデルにおける中期的に保守的な売上高成長と利益率の穏やかな上昇予想によると、現在の株価は健全な水準にあると考えています。

一方、トゥイリオ（ソフトウェア・サービス）を全売却しました。AI関連企業としての可能性の多くは、保有する膨大なデータを新しいAI製品に活用する能力にかかっていますが、共同創設者がCEOを辞任して以降、長期的なAI戦略は不透明感が強まり、確信度の低迷につながりました。

○今後の運用方針

世界経済はオフラインからオンラインへ、対面からデジタルへと移行しつつあります。娯楽と仕事の両面において成長を牽引するのは、「ゼロ・コンタクト（非接触型）」やフリクションレス（手間やストレスがない状態）であるとみています。この長期的なトレンドはモバイル・インターネットから始まり、新型コロナウイルスが世界中で感染拡大する間に加速し、消費者や企業の行動様式を恒久的に変化させたと考えています。

世界の最大手企業2,000社にとって、最も緊急を要する取り組みは「デジタル・トランスフォーメーション（DX）」、つまりクラウドやモバイル・コンピューティングをベースにデジタル・ワークフローを活用するプラットフォームへと事業を再構築することです。テクノロジーは、手作業を自動化することで農業や製造業をすでに大きく変化させており、長期的な生産性の向上をもたらしています。

当ファンドでは、今後数十年の間にクラウド・コンピューティングやAIのようなテクノロジーによって、データ収集、分析、営業およびマーケティング、顧客サービスなどその他の頭脳労働が自動化されるとみています。「SaaS」を用いたビジネスモデルの追い風を活かして、DX関連のソフトウェア市場は、クラウド・コンピューティングやAIの採用がドライバーとなり、2023年の2,000億アメリカドルから今後10年間で約14兆アメリカドルに成長するとみられます。

また、ストリーミングによって、消費者はビデオ、オーディオ、ゲームの膨大なコンテンツ・ライブラリーにアクセスできます。ストリーミングはコンテンツ配信における主要なテクノロジーになり、視聴習慣の新しい形態になると考えています。ユーザーはオンデマンドのエンターテインメントをあらゆる形態で視聴することを期待しています。世界のストリーミングの売上は、2023年の推定1,120億アメリカドルから10年余りの間に3,000億アメリカドルを超える規模になるとみられ、今後5年間で3倍超に拡大する可能性もあると予想しています。

主として、日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場されている、生活や社会のデジタル化に関連するビジネスを行なう企業の株式に投資を行ない、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。

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 6 月 8 日～2024年 6 月 7 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 3 (3)	% 0.034 (0.034)	(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 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
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式)	0 (0)	0.000 (0.000)	(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
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	1 (1)	0.011 (0.011)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、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
合 計	4	0.045	
期中の平均基準価額は、8,046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 6 月 8 日～2024年 6 月 7 日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上場	千株 280	千円 137,403	千株 804	千円 742,559
外国	アメリカ	百株 214,440	千アメリカドル 584,332	百株 233,395	千アメリカドル 936,989
	ユーロ オランダ	79	千ユーロ 8,281	50	千ユーロ 6,372
	南アフリカ	—	千南アフリカランド —	2,025	千南アフリカランド 26,005

(注) 金額は受け渡し代金。

○株式売買比率

(2023年6月8日～2024年6月7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	230,341,596千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	270,911,586千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.85

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

(2023年6月8日～2024年6月7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6月8日～2024年6月7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6月7日現在)

国内株式

銘 柄	期首(前期末)	当 期		末
	株 数	株 数	評 価	額
その他製品 (57.2%)	千株	千株		千円
任天堂	351.5	287.9		2,520,564
情報・通信業 (42.8%)				
LINEヤフー	5,460	4,999.5		1,888,311
合 計	株 数 ・ 金 額	5,811	5,287	4,408,875
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	< 1.6% >

(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	株数	当 期 末		業 種 等		
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額 千アメリカドル		邦貨換算金額 千円	
(アメリカ)	百株	百株				
CLOUDFLARE INC-CLASS A	6,245	5,853	41,706	6,498,285	ソフトウェア・サービス	
GENIUS SPORTS LTD	55,929	85,296	47,339	7,375,940	消費者サービス	
IBOTTA INC-CL A	—	382	2,972	463,185	メディア・娯楽	
NEXTDOOR HOLDINGS INC	83,887	89,181	21,046	3,279,310	メディア・娯楽	
NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	24,172	23,746	28,828	4,491,797	銀行	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	18,310	30,748	73,150	11,397,592	ソフトウェア・サービス	
PAGERDUTY INC	16,382	14,119	27,956	4,355,940	ソフトウェア・サービス	
PINTEREST INC- CLASS A	7,191	12,984	55,483	8,644,876	メディア・娯楽	
PURE STORAGE INC - CLASS A	2,277	7,150	45,792	7,134,970	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ROBLOX CORP -CLASS A	22,079	34,058	121,382	18,912,684	メディア・娯楽	
SERVICENOW INC	—	122	8,589	1,338,267	ソフトウェア・サービス	
SEA LTD-ADR	411	—	—	—	メディア・娯楽	
SHOPIFY INC - CLASS A	22,161	15,201	93,430	14,557,369	ソフトウェア・サービス	
SNAP INC - A	18,001	13,751	20,902	3,256,758	メディア・娯楽	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	—	1,544	49,351	7,689,459	メディア・娯楽	
BLOCK INC	16,283	14,087	93,543	14,575,016	金融サービス	
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	—	1,126	18,252	2,843,869	半導体・半導体製造装置	
TELADOC HEALTH INC	12,360	3,290	3,629	565,527	ヘルスケア機器・サービス	
THE WALT DISNEY CO.	926	956	9,677	1,507,882	メディア・娯楽	
TOAST INC-CLASS A	3,469	19,822	44,839	6,986,370	金融サービス	
TWILIO INC - A	10,887	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
UIPATH INC - CLASS A	45,334	34,785	42,611	6,639,317	ソフトウェア・サービス	
UNITY SOFTWARE INC	27,256	37,025	66,756	10,401,269	ソフトウェア・サービス	
2U INC	18,756	—	—	—	消費者サービス	
ADVANCED MICRO DEVICES	2,248	1,266	21,115	3,290,008	半導体・半導体製造装置	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	19,564	5,699	146,533	22,831,351	金融サービス	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	2,188	1,696	57,776	9,002,191	ソフトウェア・サービス	
DATADOG INC-CLASS A	—	1,502	16,466	2,565,621	ソフトウェア・サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	—	2,793	18,723	2,917,278	金融サービス	
META PLATFORMS INC-CLASS A	—	1,281	63,292	9,861,623	メディア・娯楽	
GLOBAL-E ONLINE LTD	6,132	5,368	16,185	2,521,818	一般消費財・サービス流通・小売り	
MERCADOLIBRE INC	329	312	50,688	7,897,735	一般消費財・サービス流通・小売り	
MICROSOFT CORP	361	347	14,770	2,301,364	ソフトウェア・サービス	
NETFLIX INC	601	54	3,522	548,780	メディア・娯楽	
DRAFTKINGS INC-CL A	40,729	21,449	80,563	12,552,522	消費者サービス	
NVIDIA CORP	1,615	287	34,767	5,417,134	半導体・半導体製造装置	
OKTA INC	415	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
ROKU INC	17,774	17,405	100,902	15,721,540	メディア・娯楽	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	38,363	46,431	106,652	16,617,578	金融サービス	
STONECO LTD-A	22,488	—	—	—	金融サービス	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	2,794	4,425	43,006	6,700,854	メディア・娯楽	
VERACYTE INC	1,250	1,136	2,433	379,130	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	14,177	7,713	48,678	7,584,628	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	583,361	564,407	1,743,321	271,626,855	
	銘柄 数 < 比 率 >	36	38	—	< 95.8% >	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
(ユーロ…オランダ) ADYEN NV	百株 173	百株 202	千ユーロ 24,905	千円 4,226,259	金融サービス
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	173 202	24,905 -	4,226,259 <1.5%>	
(南アフリカ) DISCOVERY LTD			千南アフリカランド 203,074	1,669,275	保険
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	20,600 1	18,574 1	203,074 -	1,669,275 <0.6%>
合 計	株数・金額 銘柄数<比率>	604,135 38	583,184 40	- -	277,522,390 <97.9%>

(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7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 281,931,265	% 98.9
コール・ローン等、その他	3,162,782	1.1
投資信託財産総額	285,094,047	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産(279,758,561千円)の投資信託財産総額(285,094,047千円)に対する比率は98.1%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。1アメリカドル=155.81円、1ユーロ=169.69円、1香港ドル=19.95円、1南アフリカランド=8.22円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年6月7日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	285,950,608,612	
コール・ローン等	2,489,357,299	
株式(評価額)	281,931,265,942	
未収入金	1,485,392,180	
未収配当金	44,592,707	
未収利息	484	
(B) 負債	2,439,478,103	
未払金	1,533,836,164	
未払解約金	905,641,939	
(C) 純資産総額(A-B)	283,511,130,509	
元本	304,859,306,065	
次期繰越損益金	△ 21,348,175,556	
(D) 受益権総口数	304,859,306,065口	
1万口当たり基準価額(C/D)	9,300円	

(注) 当ファンドの期首元本額は369,515,210,852円、期中追加設定元本額は1,312,286,999円、期中一部解約元本額は65,968,191,786円です。

(注) 2024年6月7日現在の元本の内訳は以下の通りです。

- ・デジタル・トランスフォーメーション株式ファンド 299,452,265,775円
- ・グローバル・イノベーション株式ファンド(適格機関投資家向け) 2,873,324,172円
- ・デジタル・トランスフォーメーション株式ファンド(予想分配金提示型) 2,533,716,118円

(注) 1口当たり純資産額は0.9300円です。

(注) 2024年6月7日現在、純資産総額は元本額を下回っており、その差額は21,348,175,556円です。

○損益の状況 (2023年6月8日～2024年6月7日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	166,691,437	
受取配当金	166,650,820	
受取利息	87,195	
支払利息	△ 46,578	
(B) 有価証券売買損益	99,057,371,273	
売買益	128,625,833,736	
売買損	△ 29,568,462,463	
(C) 保管費用等	△ 31,341,361	
(D) 当期損益金(A+B+C)	99,192,721,349	
(E) 前期繰越損益金	△131,665,374,362	
(F) 追加信託差損益金	△ 262,447,847	
(G) 解約差損益金	11,386,925,304	
(H) 計(D+E+F+G)	△ 21,348,175,556	
次期繰越損益金(H)	△ 21,348,175,556	

(注) 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) 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) 損益の状況の中で(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。

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し処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2023年6月8日から2024年6月7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、当該ファンドにて行なうデリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的を明確化するべく、2023年9月8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19条、第20条、第21条、第26条)