

ダイワ・グローバル
IoT関連株ファンド
- AI新時代 -
(為替ヘッジあり / 為替ヘッジなし)

運用報告書 (全体版)
第12期

(決算日 2023年4月13日)

(作成対象期間 2022年10月14日~2023年4月13日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、世界のIoT関連企業の株式に投資し、信託財産の成長をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。

ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先 (コールセンター)

TEL 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

<https://www.daiwa-am.co.jp/>

<2716>

<2717>

★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 | 2017年4月21日~2027年4月13日 | |
| 運用方針 | 信託財産の成長をめざして運用を行ないます。 | |
| 主要投資対象 | 為替ヘッジあり | イ. グローバルIoT関連株ファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用) の受益証券 ロ. ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券 |
| | 為替ヘッジなし | イ. グローバルIoT関連株ファンド (為替ヘッジなし) (適格機関投資家専用) の受益証券 ロ. ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券 |
| 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。 | |
| 分配方針 | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等とし、原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。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。 | |

為替ヘッジあり

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | MSCI AC World指数 (配当込み、米ドルベース) | | 公社債 組入比率 | 投資信託 組入比率 | 純資産 総額 |
|--------------------|-------------|------------|-----------|----------------------------------|-----------|-------------|--------------|---------------|
| | (分配落) | 税込み 分配金 | 期中 騰落率 | (参考指数) | 期中 騰落率 | | | |
| 8 期末(2021年 4 月13日) | 円 16,298 | 円 1,700 | % 16.5 | 17,048 | % 18.2 | % - | % 99.1 | 百万円 19,359 |
| 9 期末(2021年10月13日) | 16,091 | 650 | 2.7 | 17,718 | 3.9 | - | 98.4 | 17,542 |
| 10期末(2022年 4 月13日) | 13,421 | 0 | △16.6 | 17,293 | △ 2.4 | - | 99.4 | 12,993 |
| 11期末(2022年10月13日) | 10,793 | 0 | △19.6 | 13,972 | △19.2 | - | 99.4 | 9,660 |
| 12期末(2023年 4 月13日) | 12,250 | 0 | 13.5 | 16,618 | 18.9 | - | 99.1 | 10,664 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCI AC World指数 (配当込み、米ドルベース) は、MSCI Inc. (「MSCI」) の承諾を得て、MSCI AC World指数 (配当込み、米ドルベース) の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCI AC World指数 (配当込み、米ドルベース) は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。 (<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>)

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

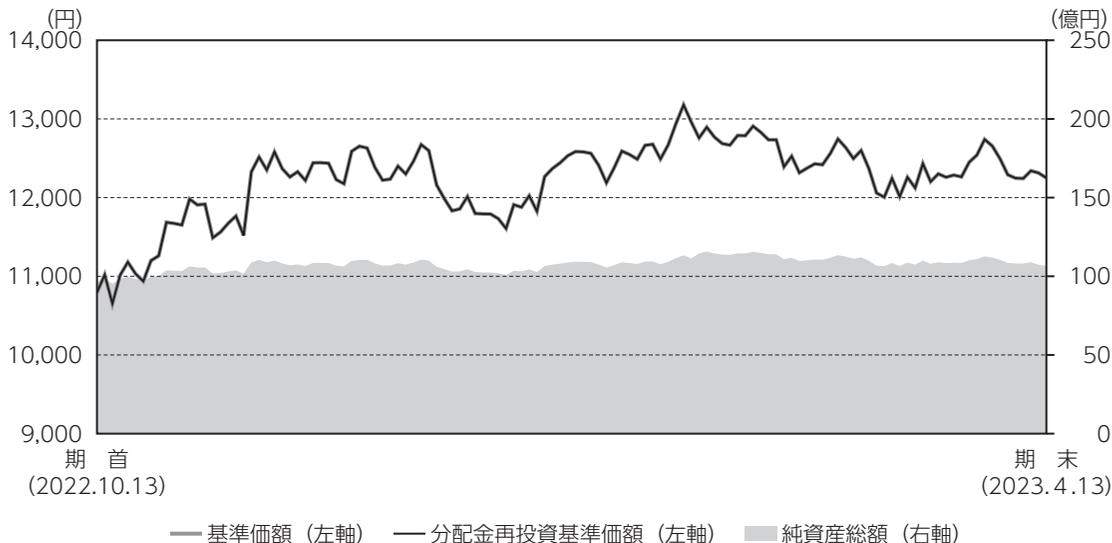
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- * 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はありません。
- * 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります (分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります)。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、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

■ 基準価額・騰落率

期首：10,793円

期末：12,250円 (分配金0円)

騰落率：13.5% (分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

当作成期の基準価額は、グローバル株式市況が上昇したことがプラス要因となり、上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ・グローバルIOT関連株ファンドーA I新時代ー (為替ヘッジあり)

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | MSCI AC World指数 (配当込み、米ドルベース) | | 公 社 債 組 入 比 | 投 資 信 託 受 組 証 券 | 入 益 証 比 入 率 |
|-------------------|---------|--------|----------------------------------|--------|----------------|--------------------|----------------|
| | 円 | 騰 落 率 | (参考指数) | 騰 落 率 | | | |
| (期首) 2022年10月13日 | 10,793 | % - | 13,972 | % - | % - | % - | 99.4 |
| 10月末 | 11,982 | 11.0 | 14,958 | 7.1 | - | - | 99.2 |
| 11月末 | 12,176 | 12.8 | 15,715 | 12.5 | - | - | 98.9 |
| 12月末 | 11,910 | 10.3 | 15,480 | 10.8 | - | - | 99.4 |
| 2023年 1 月末 | 12,490 | 15.7 | 16,427 | 17.6 | - | - | 99.2 |
| 2 月末 | 12,375 | 14.7 | 16,114 | 15.3 | - | - | 99.3 |
| 3 月末 | 12,541 | 16.2 | 16,402 | 17.4 | - | - | 99.2 |
| (期末) 2023年 4 月13日 | 12,250 | 13.5 | 16,618 | 18.9 | - | - | 99.1 |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

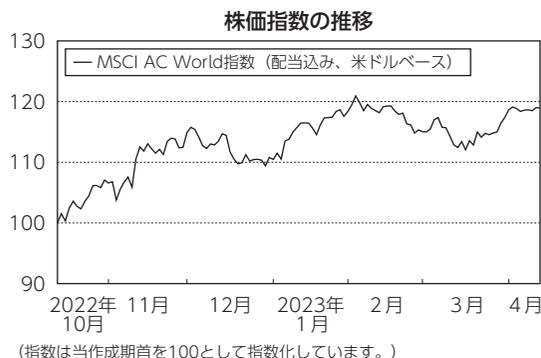
投資環境について

(2022.10.14~2023.4.13)

■グローバル株式市況

グローバル株式市況は上昇しました。

グローバル株式市況は、当作成期首より2022年11月末にかけて、英国ではスナク新政権の下での財政再建期待が強まったことや、欧米金利の上昇一服、米国の市場予想を下回るインフレ率などが好感され、上昇しました。年末にかけては、企業業績の悪化懸念などから下落しました。2023年2月上旬にかけては、米国で利上げ幅の縮小観測が広がったことや、米国大手ハイテク企業を中心に打ち出された人員削減策などが支援材料となり、上昇しました。その後は、金利が上昇したことや米国地方銀行の経営破綻を受けて一時下落する場面も見られましたが、米国金融当局が銀行向けの流動性供給や破綻した銀行の預金保護を発表したことで、当作成期末にかけて株価は堅調に推移しました。



前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

IOT関連株ファンド（為替ヘッジあり）の組入比率を、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

※IOT関連株ファンド（為替ヘッジあり）：グローバルIOT関連株ファンド（為替ヘッジあり）
（適格機関投資家専用）

■IOT関連株ファンド（為替ヘッジあり）

当ファンドは、幅広いIOT（モノのインターネット）関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の3つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行います。

今後も、IOTはDX（デジタルトランスフォーメーション）の中心的存在であるため、IOTテーマの長期的な見通しは明るいと考えます。引き続き、高い成長が期待されるIOT関連銘柄に投資を行うことで、ファンドの成長をめざしてまいります。

また、保有する実質外貨建資産について、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

ポートフォリオについて

(2022.10.14～2023.4.13)

■当ファンド

当ファンドは、ＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジあり）とダイワ・マネー・マザーファンドへ投資するファンド・オブ・ファンズです。当作成期は、ＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジあり）を高位に組み入れました。

■ＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジあり）

当ファンドは、幅広いＩｏＴ（モノのインターネット）関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の３つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行いました。

ポートフォリオにおいては、オートメーションや電動化などの恩恵を受ける電気部品・設備、ＩｏＴ関連産業からの投資拡大の恩恵を受ける半導体、より高度な医療を実現するためにさまざまな場面でＩｏＴの活用が期待されるヘルスケア機器などの組入比率を高位としました。代表的な組入銘柄は、ビル、電力、データセンター、機械等に使用されるインダストリアルＩｏＴテクノロジーを保持するシュナイダーエレクトリック、電子計器および電気機械装置メーカーのアメテック、総合電機メーカーの日立製作所としました。

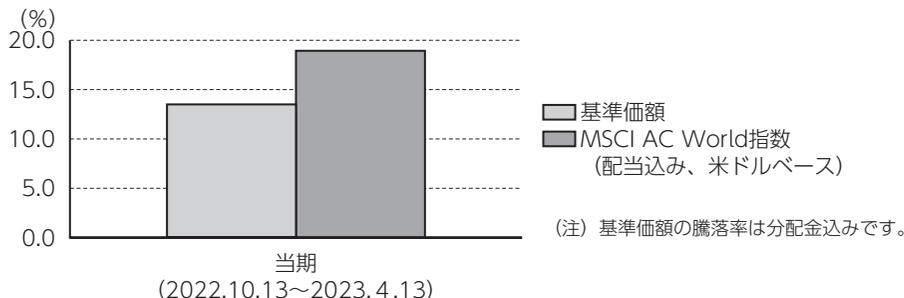
また、保有する実質外貨建資産について、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、コール・ローン等による運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、基準価額の水準等を勘案し、収益分配を見送らせていただきました。
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳 (1万口当り)

| 項目 | 当 期 | |
|-----------------|----------------------------|--|
| | 2022年10月14日 ~2023年4月13日 | |
| 当期分配金 (税込み) (円) | — | |
| 対基準価額比率 (%) | — | |
| 当期の収益 (円) | — | |
| 当期の収益以外 (円) | — | |
| 翌期繰越分配対象額 (円) | 5,824 | |

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の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、ファンドの収益率とは異なります。

(注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



今後の運用方針

■当ファンド

ＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジあり）の組入比率を、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

■ＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジあり）

当ファンドは、幅広いＩｏＴ（モノのインターネット）関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の３つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行います。

今後も、ＩｏＴはDX（デジタルトランスフォーメーション）の中心的存在であるため、ＩｏＴテーマの長期的な見通しは明るいと考えます。引き続き、高い成長が期待されるＩｏＴ関連銘柄に投資を行うことで、ファンドの成長をめざしてまいります。

また、保有する実質外貨建資産について、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

1万口当りの費用の明細

| 項目 | 当期 (2022.10.14~2023.4.13) | | 項目の概要 |
|---------|------------------------------|---------|-------------------------------------------------------------------------|
| | 金額 | 比率 | |
| 信託報酬 | 75円 | 0.614% | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12,245円です。 |
| (投信会社) | (24) | (0.192) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価 |
| (販売会社) | (50) | (0.411) | 販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| (受託会社) | (1) | (0.011) | 受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| 売買委託手数料 | － | － | 売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成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 |
| 有価証券取引税 | － | － | 有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成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 |
| その他費用 | 1 | 0.004 | その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数 |
| (監査費用) | (1) | (0.004) | 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 |
| 合計 | 76 | 0.618 | |

(注1) 当作成期中の費用(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、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

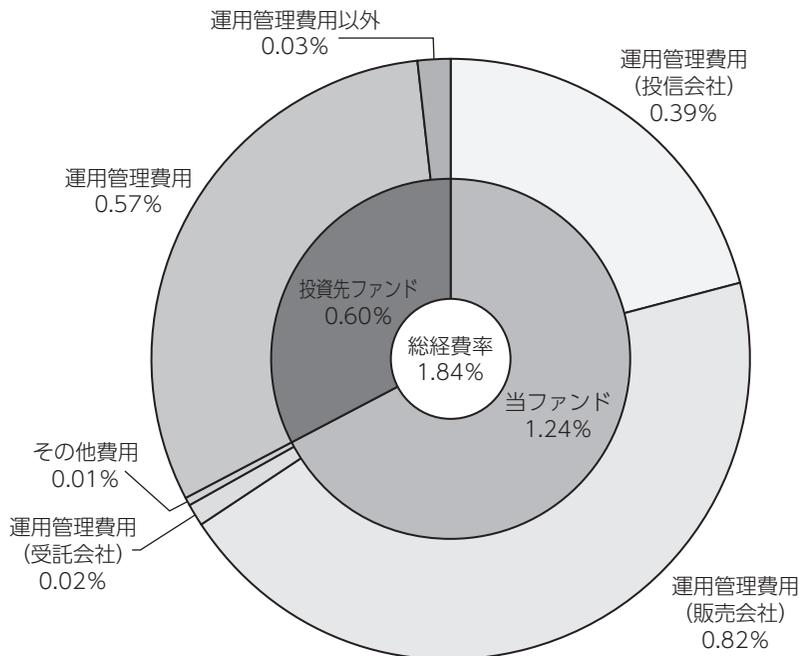
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

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を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.84%です。



| | |
|----------------------|-------|
| 総経費率 (①+②+③) | 1.84% |
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.24% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.57% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.03% |

(注1) 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2) 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3) 投資先ファンドにおいて、上記以外に含まれていない費用は認識しておりません。

(注4) 各比率は、年率換算した値です。

(注5) ①の費用は、1万口当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6) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注7) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注8) 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異なります。

■売買および取引の状況

投資信託受益証券

(2022年10月14日から2023年4月13日まで)

| 国 | 内 | 買 付 | | 売 付 | |
|---|-------------------------------------------------|-------------|---------|-------------|---------|
| | | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| | | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| | グローバルIOT 関連株ファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用) | 325,541.673 | 575,000 | 565,864.402 | 947,000 |

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| ファンド名 | 当 期 末 | | |
|-------------------------------------------------------|---------------------|------------------|-----------|
| | □ 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| 国内投資信託受益証券 グローバルIOT関連株ファンド (為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用) | 千口 6,244,875.058 | 千円 10,566,328 | % 99.1 |

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

| 種 類 | 期 首 | | | 当 期 末 | | |
|-----------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | □ 数 | 評 価 額 | 比 率 | □ 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| ダイワ・マネー・マザーファンド | 千口 977 | 千円 977 | 千円 993 | 千口 977 | 千円 993 | 千円 993 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年4月13日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-----------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資信託受益証券 | 千円 10,566,328 | % 97.1 |
| ダイワ・マネー・マザーファンド | 993 | 0.0 |
| コール・ローン等、その他 | 316,402 | 2.9 |
| 投資信託財産総額 | 10,883,724 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年4月13日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------|-----------------|
| (A) 資産 | 10,883,724,570円 |
| コール・ローン等 | 129,402,342 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 10,566,328,598 |
| ダイワ・マネー・マザーファンド(評価額) | 993,630 |
| 未収入金 | 187,000,000 |
| (B) 負債 | 219,334,882 |
| 未払解約金 | 152,853,121 |
| 未払信託報酬 | 66,039,613 |
| その他未払費用 | 442,148 |
| (C) 純資産総額(A - B) | 10,664,389,688 |
| 元本 | 8,705,827,428 |
| 次期繰越損益金 | 1,958,562,260 |
| (D) 受益権総口数 | 8,705,827,428口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 12,250円 |

* 期首における元本額は8,950,017,983円、当作成期間中における追加設定元本額は546,388,078円、同解約元本額は790,578,633円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,250円です。

■損益の状況

当期 自2022年10月14日 至2023年4月13日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|------------------|
| (A) 配当等収益 | △ 23,331円 |
| 受取利息 | 1,356 |
| 支払利息 | △ 24,687 |
| (B) 有価証券売買損益 | 1,230,241,920 |
| 売買益 | 1,337,316,939 |
| 売買損 | △ 107,075,019 |
| (C) 信託報酬等 | △ 66,481,761 |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | 1,163,736,828 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 889,631,949 |
| (F) 追加信託差損益金 | 1,684,457,381 |
| (配当等相当額) | (1,471,834,251) |
| (売買損益相当額) | (212,623,130) |
| (G) 合計(D + E + F) | 1,958,562,260 |
| 次期繰越損益金(G) | 1,958,562,260 |
| 追加信託差損益金 | 1,684,457,381 |
| (配当等相当額) | (1,471,834,251) |
| (売買損益相当額) | (212,623,130) |
| 分配準備積立金 | 3,386,269,280 |
| 繰越損益金 | △3,112,164,401 |

(注1) 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おります。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程（総額）」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 0円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 1,684,457,381 |
| (d) 分配準備積立金 | 3,386,269,280 |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 5,070,726,661 |
| (f) 分配金 | 0 |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e - f) | 5,070,726,661 |
| (h) 受益権総口数 | 8,705,827,428口 |

為替ヘッジなし

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | MSCI AC World指数 (配当込み、円換算) | | 公社債率 組入比率 | 投資信託 組入比率 | 純資産額 |
|-------------------|-------------|------------|-----------|-------------------------------|-----------|--------------|--------------|---------------|
| | (分配落) | 税込み 分配金 | 期中 騰落率 | (参考指数) | 期中 騰落率 | | | |
| 8期末(2021年4月13日) | 円 16,780 | 円 1,700 | % 21.7 | 17,090 | % 22.9 | % - | % 99.3 | 百万円 71,828 |
| 9期末(2021年10月13日) | 16,663 | 1,200 | 6.5 | 18,395 | 7.6 | - | 99.0 | 64,256 |
| 10期末(2022年4月13日) | 15,340 | 0 | △ 7.9 | 19,873 | 8.0 | - | 99.1 | 53,632 |
| 11期末(2022年10月13日) | 14,633 | 0 | △ 4.6 | 18,782 | △ 5.5 | - | 99.2 | 46,017 |
| 12期末(2023年4月13日) | 15,487 | 100 | 6.5 | 20,268 | 7.9 | - | 97.3 | 44,504 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCI AC World指数 (配当込み、円換算) は、MSCI Inc. (「MSCI」) の承諾を得て、MSCI AC World指数 (配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCI AC World指数 (配当込み、米ドルベース) は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。 (<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>)

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

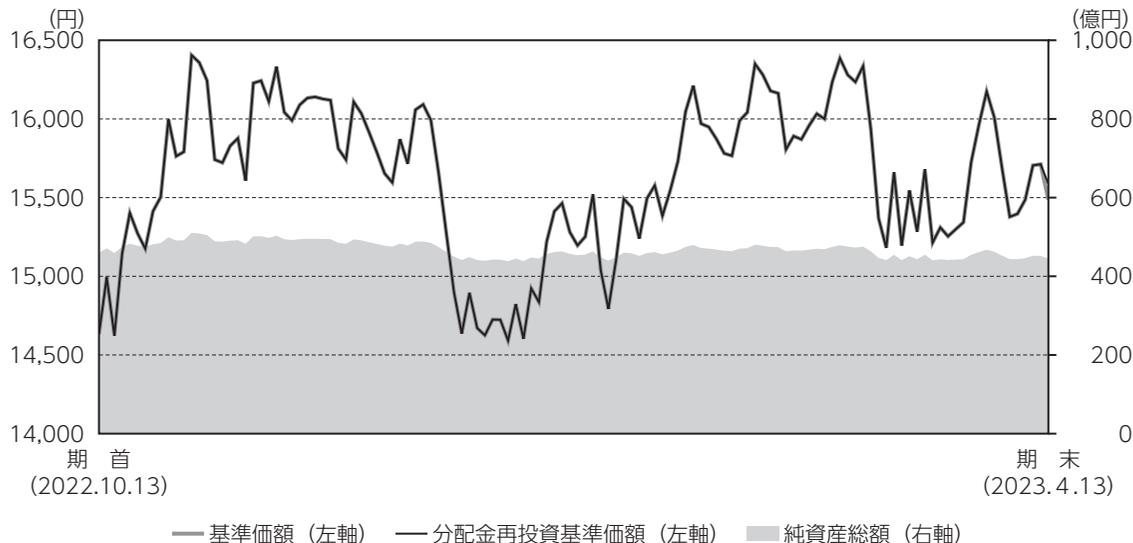
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*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。

*分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります(分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります)。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、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

■ 基準価額・騰落率

期首：14,633円

期末：15,487円 (分配金100円)

騰落率：6.5% (分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

当作成期の基準価額は、米ドルが対円で下落(円高)したことはマイナス要因となりましたが、グローバル株式市場が上昇したことがプラス要因となり、上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | MSCI AC World指数 (配当込み、円換算) | | 公 社 債 組 入 比 率 | 投 資 信 託 受 組 証 券 入 証 率 |
|-------------------|-------------|--------|-------------------------------|--------|------------------|-----------------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | (参考指数) | 騰 落 率 | | |
| (期首) 2022年10月13日 | 円 14,633 | % - | 18,782 | % - | % - | % 99.2 |
| 10月末 | 16,405 | 12.1 | 20,288 | 8.0 | - | 99.1 |
| 11月末 | 15,741 | 7.6 | 19,965 | 6.3 | - | 98.4 |
| 12月末 | 14,823 | 1.3 | 18,793 | 0.1 | - | 99.4 |
| 2023年 1 月末 | 15,385 | 5.1 | 19,607 | 4.4 | - | 99.1 |
| 2 月末 | 15,958 | 9.1 | 20,097 | 7.0 | - | 99.1 |
| 3 月末 | 15,963 | 9.1 | 20,036 | 6.7 | - | 99.3 |
| (期末) 2023年 4 月13日 | 15,587 | 6.5 | 20,268 | 7.9 | - | 97.3 |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

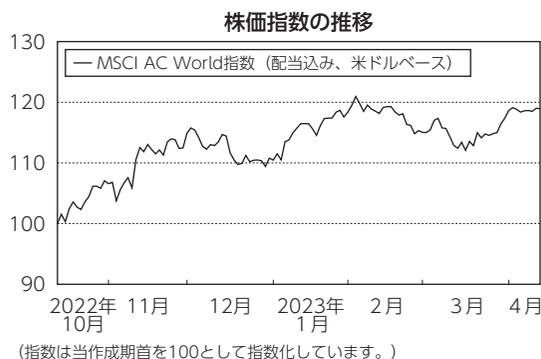
投資環境について

(2022.10.14~2023.4.13)

■グローバル株式市況

グローバル株式市況は上昇しました。

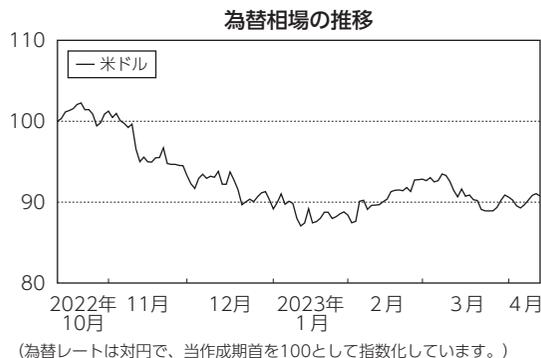
グローバル株式市況は、当作成期首より2022年11月末にかけて、英国ではスナク新政権の下での財政再建期待が強まったことや、欧米金利の上昇一服、米国の市場予想を下回るインフレ率などが好感され、上昇しました。年末にかけては、企業業績の悪化懸念などから下落しました。2023年2月上旬にかけては、米国で利上げ幅の縮小観測が広がったことや、米国大手ハイテク企業を中心に打ち出された人員削減策などが支援材料となり、上昇しました。その後は、金利が上昇したことや米国地方銀行の経営破綻を受けて一時下落する場面も見られましたが、米国金融当局が銀行向けの流動性供給や破綻した銀行の預金保護を発表したことで、当作成期末にかけて株価は堅調に推移しました。



■為替相場

米ドル為替相場は対円で下落しました。

米ドル対円為替相場は、当作成期首より一時的に円安米ドル高が引き続き進行したものの、日銀の大規模な円買い米ドル売り介入や米国のインフレ率の低下期待などから米国金利が低下したことで日米金利差の縮小が意識され、円高米ドル安に転じました。2022年12月は、日銀が想定外の政策修正を行ったことで金融緩和政策の転換などが意識され、日本の長期金利が大きく上昇するとともにさらに円高米ドル安が進行しました。2023年1月には、日銀が金融緩和政策の維持を決定したことで一時的に円安米ドル高が進行する局面もありましたが、日米金利差の縮小などにより、円高米ドル安基調が継続しました。しかし2月に入り、堅調な米国の経済指標を受けて米国金利が大きく上昇したことで、円安米ドル高に転じました。3月は、信用不安の拡大により米国金利が大きく低下したことや、リスク回避による円買い需要の高まりなどから円高米ドル安となり、当作成期末を迎えました。



前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

ＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジなし）の組入比率を、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

※ＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジなし）：グローバルＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジなし）
（適格機関投資家専用）

■ＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジなし）

当ファンドは、幅広いＩｏＴ（モノのインターネット）関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の３つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行います。

今後も、ＩｏＴはDX（デジタルトランスフォーメーション）の中心的存在であるため、ＩｏＴテーマの長期的な見通しは明るいと考えます。引き続き、高い成長が期待されるＩｏＴ関連銘柄に投資を行うことで、ファンドの成長をめざしてまいります。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

ポートフォリオについて

(2022.10.14～2023.4.13)

■当ファンド

当ファンドは、ＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジなし）とダイワ・マネー・マザーファンドへ投資するファンド・オブ・ファンズです。当作成期は、ＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジなし）を高位に組み入れました。

■ＩｏＴ関連株ファンド（為替ヘッジなし）

当ファンドは、幅広いＩｏＴ（モノのインターネット）関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の３つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行いました。

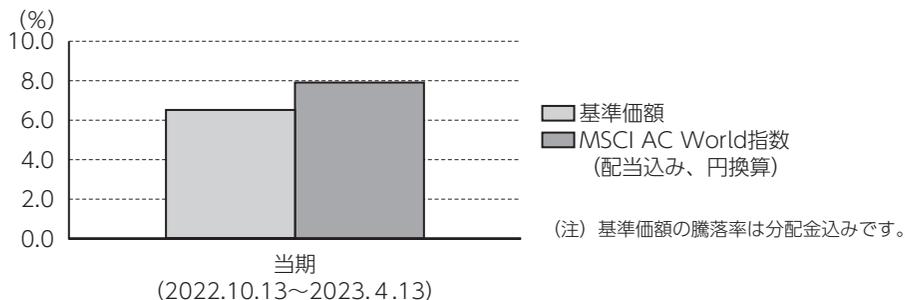
ポートフォリオにおいては、オートメーションや電動化などの恩恵を受ける電気部品・設備、ＩｏＴ関連産業からの投資拡大の恩恵を受ける半導体、より高度な医療を実現するためにさまざまな場面でＩｏＴの活用が期待されるヘルスケア機器などの組入比率を高位としました。代表的な組入銘柄は、ビル、電力、データセンター、機械等に使用されるインダストリアルＩｏＴテクノロジーを保持するシュナイダーエレクトリック、電子計器および電気機械装置メーカーのアメテック、総合電機メーカーの日立製作所としました。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、コール・ローン等による運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期の1万口当り分配金(税込み)は下記「分配原資の内訳(1万口当り)」の「当期分配金(税込み)」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程(1万口当り)」をご参照ください。
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳(1万口当り)

| 項 目 | 当 期 | |
|-----------------------|----------------------------|------------|
| | 2022年10月14日 ~2023年4月13日 | |
| 当期分配金(税込み) (円) | | 100 |
| 対基準価額比率 (%) | | 0.64 |
| 当期の収益 (円) | | - |
| 当期の収益以外 (円) | | 100 |
| 翌期繰越分配対象額 (円) | | 6,537 |

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の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、ファンドの収益率とは異なります。

(注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

■収益分配金の計算過程(1万口当り)

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------------|------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 0.00円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0.00 |
| (c) 収益調整金 | 2,602.04 |
| (d) 分配準備積立金 | ✓ 4,035.72 |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 6,637.76 |
| (f) 分配金 | 100.00 |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e - f) | 6,537.76 |

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

IoT関連株ファンド（為替ヘッジなし）の組入比率を、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

■IoT関連株ファンド（為替ヘッジなし）

当ファンドは、幅広いIoT（モノのインターネット）関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の3つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行います。

今後も、IoTはDX（デジタルトランスフォーメーション）の中心的存在であるため、IoTテーマの長期的な見通しは明るいと考えます。引き続き、高い成長が期待されるIoT関連銘柄に投資を行うことで、ファンドの成長をめざしてまいります。

■ダイワ・マネー・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

1万口当りの費用の明細

| 項目 | 当期 (2022.10.14~2023.4.13) | | 項目の概要 |
|---------|------------------------------|---------|-------------------------------------------------------------------------|
| | 金額 | 比率 | |
| 信託報酬 | 96円 | 0.614% | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は15,638円です。 |
| (投信会社) | (30) | (0.192) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価 |
| (販売会社) | (64) | (0.411) | 販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| (受託会社) | (2) | (0.011) | 受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| 売買委託手数料 | － | － | 売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成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 |
| 有価証券取引税 | － | － | 有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成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 |
| その他費用 | 0 | 0.002 | その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数 |
| (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 |
| 合計 | 96 | 0.617 | |

(注1) 当作成期中の費用(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、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

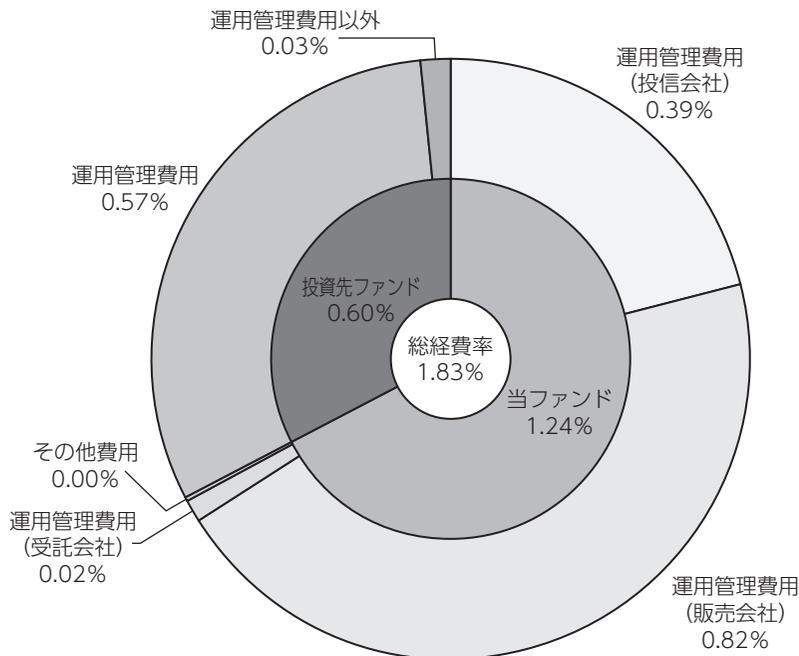
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

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を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.83%です。



| | |
|----------------------|-------|
| 総経費率 (①+②+③) | 1.83% |
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.24% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.57% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.03% |

(注1) 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2) 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3) 投資先ファンドにおいて、上記以外に含まれていない費用は認識しておりません。

(注4) 各比率は、年率換算した値です。

(注5) ①の費用は、1万口当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6) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注7) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注8) 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異なります。

■売買および取引の状況
投資信託受益証券

(2022年10月14日から2023年4月13日まで)

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|----|-------------------------------------|-----|-----|---------------|-----------|
| | | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| | | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 国内 | グローバルIOT関連株ファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用) | - | - | 2,508,547.194 | 5,670,000 |

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| ファンド名 | 当 期 末 | | |
|-------------------------------------------------------|----------------------|------------------|-----------|
| | □ 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| 国内投資信託受益証券 グローバルIOT関連株ファンド (為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用) | 千口 19,223,268.107 | 千円 43,306,178 | % 97.3 |

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

| 種 類 | 当 期 末 | | |
|-----------------|-------|-----|-------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| ダイワ・マネー・マザーファンド | 977 | 977 | 993 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年4月13日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-----------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 43,306,178 | 95.8 |
| ダイワ・マネー・マザーファンド | 993 | 0.0 |
| コール・ローン等、その他 | 1,894,309 | 4.2 |
| 投資信託財産総額 | 45,201,481 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年4月13日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------|-----------------|
| (A) 資産 | 45,201,481,107円 |
| コール・ローン等 | 1,894,309,086 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 43,306,178,391 |
| ダイワ・マネー・マザーファンド(評価額) | 993,630 |
| (B) 負債 | 696,899,885 |
| 未払収益分配金 | 287,373,798 |
| 未払解約金 | 120,846,843 |
| 未払信託報酬 | 287,593,199 |
| その他未払費用 | 1,086,045 |
| (C) 純資産総額(A - B) | 44,504,581,222 |
| 元本 | 28,737,379,872 |
| 次期繰越損益金 | 15,767,201,350 |
| (D) 受益権総口数 | 28,737,379,872口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 15,487円 |

* 期首における元本額は31,448,054,400円、当作成期間中における追加設定元本額は333,238,248円、同解約元本額は3,043,912,776円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は15,487円です。

■損益の状況

当期 自2022年10月14日 至2023年4月13日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|------------------|
| (A) 配当等収益 | △ 103,694円 |
| 受取利息 | 6,787 |
| 支払利息 | △ 110,481 |
| (B) 有価証券売買損益 | 2,995,494,487 |
| 売買益 | 3,306,259,112 |
| 売買損 | △ 310,764,625 |
| (C) 信託報酬等 | △ 288,679,244 |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | 2,706,711,549 |
| (E) 前期繰越損益金 | 5,870,262,359 |
| (F) 追加信託差損益金 | 7,477,601,240 |
| (配当等相当額) | (5,238,035,645) |
| (売買損益相当額) | (2,239,565,595) |
| (G) 合計(D + E + F) | 16,054,575,148 |
| (H) 収益分配金 | △ 287,373,798 |
| 次期繰越損益金(G + H) | 15,767,201,350 |
| 追加信託差損益金 | 7,477,601,240 |
| (配当等相当額) | (5,238,035,645) |
| (売買損益相当額) | (2,239,565,595) |
| 分配準備積立金 | 11,310,233,048 |
| 繰越損益金 | △ 3,020,632,938 |

- (注1) 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おります。
- (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
- (注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程 (総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------------|-----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 0円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 7,477,601,240 |
| (d) 分配準備積立金 | 11,597,606,846 |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 19,075,208,086 |
| (f) 分配金 | 287,373,798 |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e - f) | 18,787,834,288 |
| (h) 受益権総口数 | 28,737,379,872口 |

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)

100円

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

- ・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)」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち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)、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金 (特別分配金) が発生した場合は、分配金発生時における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。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ・グローバルIoT関連株ファンドーA | 新時代ー（為替ヘッジあり／為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ・マネー・マザーファンド」の決算日（2022年12月9日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2023年4月13日）現在におけるダイワ・マネー・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・マネー・マザーファンドの主要な売買銘柄

2022年10月14日～2023年4月13日における主要な売買銘柄はありません。

■組入資産明細表

2023年4月13日現在、有価証券等の組み入れはありません。

ダイワ・マネー・マザーファンド

運用報告書 第18期 (決算日 2022年12月9日)

(作成対象期間 2021年12月10日～2022年12月9日)

ダイワ・マネー・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

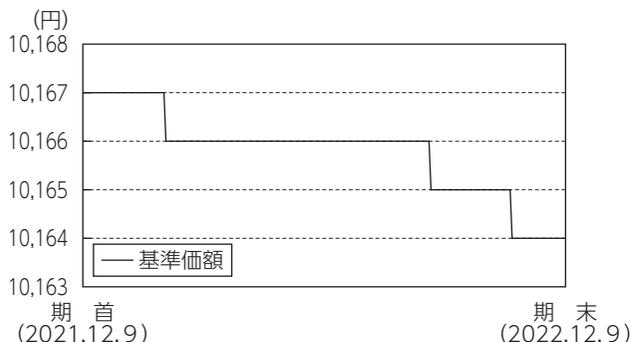
| | |
|--------|------------------------------------------|
| 運用方針 | 主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | 本邦通貨表示の公社債 |
| 株式組入制限 | 純資産総額の30%以下 |

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



| 年 月 日 | 基準 価 額 | | 公 社 債 組 入 比 率 |
|----------------|--------|------|---------------|
| | 騰 落 率 | | |
| (期首)2021年12月9日 | 円 | % | % |
| 12月9日 | 10,167 | - | - |
| 12月末 | 10,167 | 0.0 | - |
| 2022年1月1日 | 10,167 | 0.0 | - |
| 2月末 | 10,166 | △0.0 | - |
| 3月末 | 10,166 | △0.0 | - |
| 4月末 | 10,166 | △0.0 | - |
| 5月末 | 10,166 | △0.0 | - |
| 6月末 | 10,166 | △0.0 | - |
| 7月末 | 10,166 | △0.0 | - |
| 8月末 | 10,165 | △0.0 | - |
| 9月末 | 10,165 | △0.0 | - |
| 10月末 | 10,164 | △0.0 | - |
| 11月末 | 10,164 | △0.0 | - |
| (期末)2022年12月9日 | 10,164 | △0.0 | - |

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。
 (注3) 当ファンドは、利息収入の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,167円 期末：10,164円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

コール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

◆ 投資環境について

○ 国内短期金融市場

当作成期を通じて、日銀は長短金利操作付き量的・質的金融緩和を維持しました。この金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

◆ ポートフォリオについて

流動性や資産の安全性に配慮し、コール・ローン等による運用を行いました。

◆ ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

■ 1万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当 期 |
|---------|-----|
| 売買委託手数料 | -円 |
| 有価証券取引税 | - |
| その他費用 | - |
| 合 計 | - |

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

当作成期中における売買および取引はありません。

■ 主要な売買銘柄

当作成期中における主要な売買銘柄はありません。

■ 組入資産明細表

当作成期末における有価証券等の組み入れはありません。

■ 投資信託財産の構成

2022年12月9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 | 14,815,299 | 100.0 |
| 投資信託財産総額 | 14,815,299 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年12月9日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------|------------------------|
| (A) 資産 | 14,815,299,248円 |
| コール・ローン等 | 14,815,299,248 |
| (B) 負債 | 113,000 |
| 未払解約金 | 113,000 |
| (C) 純資産総額(A - B) | 14,815,186,248 |
| 元本 | 14,576,480,402 |
| 次期繰越損益金 | 238,705,846 |
| (D) 受益権総口数 | 14,576,480,402口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 10,164円 |

* 期首における元本額は6,671,046,264円、当作成期間中における追加設定元本額は21,845,860,602円、同解約元本額は13,940,426,464円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額:

| | |
|--------------------------------------------------------|----------------|
| ゴールド・ファンド (FOF用) (適格機関投資家専用) | 3,627,565,740円 |
| ダイワ・グローバルIoT関連株ファンド -A I新時代- (為替ヘッジあり) | 977,694円 |
| ダイワ・グローバルIoT関連株ファンド -A I新時代- (為替ヘッジなし) | 977,694円 |
| ダイワF Eグローバル・バリュー (為替ヘッジあり) | 9,608円 |
| ダイワF Eグローバル・バリュー (為替ヘッジなし) | 9,608円 |
| NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり) | 49,107円 |
| NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし) | 49,107円 |
| ダイワワ R I C I [®] コモディティ・ファンド | 2,074,249円 |
| スマート・ミックス・Dガード (為替ヘッジあり) | 5,973,809円 |
| スマート・アロケーション・Dガード | 23,929,224円 |
| 堅実バランスファンド -ハジメの一步- | 236,205,446円 |
| NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/隔月分配型) | 180,729円 |
| NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/隔月分配型) | 737,649円 |
| NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/資産成長型) | 95,276円 |
| NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/資産成長型) | 337,885円 |
| 世界セレクトティブ株式オープン | 983円 |
| 世界セレクトティブ株式オープン (年2回決算型) | 983円 |
| NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジあり/毎月分配型) | 983円 |
| NWQグローバル厳選証券ファンド (為替ヘッジなし/毎月分配型) | 983円 |
| iFreeETF NASDAQ100インバース | 5,509,329,948円 |
| iFreeETF NASDAQ100レバレッジ | 595,238,099円 |
| iFreeETF NASDAQ100ダブルインバース | 309,917,358円 |
| D Cダイワ・マネー・ポートフォリオ | 4,031,730,013円 |
| ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- 日本円・コース (毎月分配型) | 132,757円 |
| ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- 豪ドル・コース (毎月分配型) | 52,987円 |
| ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- ブラジル・リアル・コース (毎月分配型) | 467,315円 |
| ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- 米ドル・コース (毎月分配型) | 12,784円 |
| ダイワ/フィデリティ北米株式ファンド -パラダイムシフト- | 1,988,495円 |
| ダイワF Eグローバル・バリュー株ファンド (ダイワSMA専用) | 3,666円 |
| ダイワ米国金利社債ファンド (通貨選択型) ブラジル・リアル・コース (毎月分配型) | 155,317円 |
| ダイワ米国金利社債ファンド (通貨選択型) 日本円・コース (毎月分配型) | 38,024円 |
| ダイワ米国金利社債ファンド (通貨選択型) 米ドル・コース (毎月分配型) | 4,380円 |
| ダイワ米国金利社債ファンド (通貨選択型) 豪ドル・コース (毎月分配型) | 22,592円 |
| ダイワ新興国ソブリン債券ファンド (資産成長コース) | 33,689円 |
| ダイワ新興国ソブリン債券ファンド (通貨αコース) | 96,254円 |
| ダイワ・ダブルバランス・ファンド (Dガード付/部分為替ヘッジあり) | 104,785,071円 |
| ダイワ6資産バランス・ファンド (Dガード付/為替ヘッジあり) | 112,805,921円 |
| ダイワ・インフラビジネス・ファンド -インフラ革命- (為替ヘッジあり) | 5,385円 |
| ダイワ・インフラビジネス・ファンド -インフラ革命- (為替ヘッジなし) | 11,530円 |
| ダイワ米国M L Pファンド (毎月分配型) 米ドルコース | 9,817円 |
| ダイワ米国M L Pファンド (毎月分配型) 日本円コース | 6,964円 |
| ダイワ米国M L Pファンド (毎月分配型) 通貨αコース | 9,479円 |
| ダイワ英国高配当株ツインα (毎月分配型) | 98,107円 |
| ダイワ英国高配当株ファンド | 98,107円 |
| ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ | 982,368円 |
| D Cスマート・アロケーション・Dガード | 8,073,994円 |

| | |
|------------------------------------------------------|----------|
| ダイワ米国金利社債ファンド (通貨選択型) 南アフリカ・ランド・コース (毎月分配型) | 1,097円 |
| ダイワ米国金利社債ファンド (通貨選択型) トルコ・リラ・コース (毎月分配型) | 2,690円 |
| ダイワ米国金利社債ファンド (通貨選択型) 通貨セレクト・コース (毎月分配型) | 1,350円 |
| ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 株式αコース | 98,203円 |
| ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 通貨αコース | 98,203円 |
| ダイワ・オーストラリア高配当株α (毎月分配型) 株式&通貨ツインαコース | 982,029円 |
| ダイワ米国株ストラテジーα (通貨選択型) -トリプルリターンズ- 通貨セレクト・コース (毎月分配型) | 9,652円 |

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,164円です。

■損益の状況

当期 自2021年12月10日 至2022年12月9日

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|---------------------|
| (A) 配当等収益 | △ 3,985,061円 |
| 受取利息 | 2,618 |
| 支払利息 | △ 3,987,679 |
| (B) 当期損益金(A) | △ 3,985,061 |
| (C) 前期繰越損益金 | 111,255,021 |
| (D) 解約差損益金 | △230,350,932 |
| (E) 追加信託差損益金 | 361,786,818 |
| (F) 合計(B + C + D + E) | 238,705,846 |
| 次期繰越損益金(F) | 238,705,846 |

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

■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 | 無期限 | |
| 運用方針 | グローバルIOT関連株マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券を通じて、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 | 為替ヘッジあり | マザーファンドの受益証券 |
| | 為替ヘッジなし | マザーファンドの受益証券 |
| 運用方法 | 為替ヘッジあり | ①マザーファンドの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等に上場しているIOT関連企業の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）に投資することで、信託財産の成長をめざします。 ②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位に維持します。 ③原則として実質組入外貨建資産について、対円での為替ヘッジを行ない、為替変動リスクの低減をめざします。 |
| | 為替ヘッジなし | ①マザーファンドの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等に上場しているIOT関連企業の株式に投資することで、信託財産の成長をめざします。 ②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位に維持します。 ③原則として実質組入外貨建資産について、対円での為替ヘッジを行ないません。 |
| マザーファンドの運用方法 | ①主として、日本を含む世界の金融商品取引所等に上場しているIOT関連企業の株式に投資することで、信託財産の成長をめざします。 ②ポートフォリオの構築にあたっては、次の方針で行なうことを基本とします。 イ. 日本を含む世界の金融商品取引所に上場している株式から、IOT関連企業に該当する銘柄を特定します。 ロ. 個別銘柄調査においては、バリュエーション水準、ファンダメンタルズ分析、モメンタムを重視し、組入候補銘柄の選定を行ないます。 ハ. 独自のクオンツモデルを活用し、流動性、ボラティリティなどを考慮してポートフォリオの構築を行ないます。 ③株式の組入比率は、原則として高位に維持します。 ④運用にあたっては、ニュートン・インベストメント・マネジメント・ノースアメリカ・エルエルシーに運用の指図に関する権限を委託します。 ⑤外貨建資産について、対円での為替ヘッジを行ないません。 | |
| 組入制限 | マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。 | |
| 分配方針 | 毎決算時に原則として、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。基準価額水準、市況動向等によっては分配を行わないこともあります。 | |



BNY MELLON

INVESTMENT MANAGEMENT

グローバルIOT関連株ファンド (為替ヘッジあり) / (為替ヘッジなし) (適格機関投資家専用)

追加型投信／内外／株式

運用報告書（全体版）

第6期（決算日：2023年3月13日）

受益者のみなさまへ

平素は、格別のお引立てにあずかり厚く御礼申し上げます。

さて、「グローバルIOT関連株ファンド（為替ヘッジあり）／（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）」は、2023年3月13日に第6期決算を迎えました。ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

BNY Mellon・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社

東京都千代田区丸の内1丁目8番3号

丸の内トラストタワー本館

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

運用商品開発部

電話番号：03-6756-4600（代表）

受付時間：営業日の9：00～17：00

ホームページ <https://www.bnymellonam.jp/>

グローバル I o T 関連株ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 株組比 | 式入率 | 株先比 | 式比率 | 純資産額 |
|----------------|-------------|--------|----------|-----------|--------|--------|---------------|
| | 税込分配金 | 騰落率 | | | | | |
| 2期（2019年3月13日） | 円 12,425 | 円 0 | % 0.6 | % 99.2 | % — | % — | 百万円 26,702 |
| 3期（2020年3月13日） | 11,003 | 0 | △11.4 | 92.7 | — | — | 15,748 |
| 4期（2021年3月15日） | 20,148 | 0 | 83.1 | 102.4 | — | — | 20,029 |
| 5期（2022年3月14日） | 18,583 | 0 | △7.8 | 97.6 | — | — | 13,305 |
| 6期（2023年3月13日） | 16,636 | 0 | △10.5 | 99.0 | — | — | 10,571 |

（注）株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

（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ないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | 株組比 | 式入率 | 株先比 | 式比率 |
|--------------------|-------------|--------|-----------|-----------|--------|--------|
| | 騰落率 | 騰落率 | | | | |
| （期首） 2022年3月14日 | 円 18,583 | % — | % 97.6 | % 97.6 | % — | % — |
| 3月末 | 20,580 | 10.7 | 103.4 | 103.4 | — | — |
| 4月末 | 17,367 | △6.5 | 100.9 | 100.9 | — | — |
| 5月末 | 17,198 | △7.5 | 97.8 | 97.8 | — | — |
| 6月末 | 15,442 | △16.9 | 99.3 | 99.3 | — | — |
| 7月末 | 17,467 | △6.0 | 98.3 | 98.3 | — | — |
| 8月末 | 16,515 | △11.1 | 101.0 | 101.0 | — | — |
| 9月末 | 15,044 | △19.0 | 100.0 | 100.0 | — | — |
| 10月末 | 16,454 | △11.5 | 100.5 | 100.5 | — | — |
| 11月末 | 16,744 | △9.9 | 93.5 | 93.5 | — | — |
| 12月末 | 16,391 | △11.8 | 94.7 | 94.7 | — | — |
| 2023年1月末 | 17,215 | △7.4 | 94.6 | 94.6 | — | — |
| 2月末 | 17,068 | △8.2 | 100.0 | 100.0 | — | — |
| （期末） 2023年3月13日 | 16,636 | △10.5 | 99.0 | 99.0 | — | — |

（注）騰落率は期首比です。

（注）株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

（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ないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

■ 基準価額等の推移について



【基準価額・騰落率】

期首：18,583円 期末：16,636円 騰落率：△10.5%

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ・2022年10月から2023年2月初旬にかけて、物価が鎮静化に向かう中、米国金融当局が利上げペースを緩めるとの観測を背景にグローバル株式市場が上昇基調で推移したこと

下落要因

- ・2022年4月以降、ウクライナ情勢の悪化に加えてインフレ高進を背景に米国金融当局が引き締め姿勢を一段と強める中で長期金利が上昇し、6月半ばにかけてグローバル株式市場が下落基調で推移したこと

■投資環境について

株式市場

期初、原油高の動きが一巡したことやロシア政府による債務不履行がひとまず回避されたことで投資家心理が改善し2022年3月末にかけて上昇したものの、ウクライナ情勢の悪化に加えてインフレ高進を背景に米連邦準備制度理事会（F R B）が引き締め姿勢を一段と強める中で長期金利が上昇し、6月半ばにかけて世界株式市場は下落基調で推移しました。その後利上げペースの鈍化期待が広がり8月半ばにかけて反発しましたが、根強いインフレ圧力を背景にF R Bが大幅な利上げを継続する姿勢を示したことに加え、英国で財政悪化懸念が台頭したことから、9月末にかけて再度下落しました。

10月以降は底堅さを示す米国経済指標や金融政策動向をにらみ下落する場面が見られたものの、物価が鎮静化に向かう中、米国金融当局が利上げペースを緩めるとの観測を背景に2023年2月初旬にかけて上昇基調で推移しました。期末にかけては米国経済指標が底堅さを示す中で金融引き締めの長期化観測が台頭したほか、米国の一部銀行に対する懸念が高まり軟調となりました。

為替市場

急ピッチで金融引き締めを行う米国に対して、日本では強固な金融緩和姿勢が維持されるなど、日米金融政策の方向性の違いから、2022年3月から10月半ばにかけて米ドルは円に対して上昇しました。しかし、その後は政府・日本銀行によるドル売り・円買いの為替介入、米国での利上げペース鈍化観測、日本銀行による長期金利の変動許容幅の拡大などから一転して米ドルは対円で下落しました。2023年2月以降は堅調な米国経済指標の結果を受けて、F R Bによる金融引き締めの長期化観測から米ドルは対円で再度上昇に転じました。

■ポートフォリオについて

(当ファンド)

グローバルI o T関連株マザーファンドの受益証券を高位に組入れました。実質組入外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いました。

(グローバルI o T関連株マザーファンド)

業種別配分

期末の業種別配分については情報技術、資本財・サービス、ヘルスケアなどへの配分が多くなりました。

国別配分

期末の国別配分では米国、日本、フランスへの配分が多くなりました。

■ベンチマークとの差異について

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

■分配金について

当期の収益分配については、基準価額水準等を勘案して、見送りとさせて頂きました。分配に充てなかった収益につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用致します。

■今後の運用方針

(当ファンド)

引き続き、グローバルI o T関連株マザーファンドの受益証券を高位に組入れます。実質組入外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行います。

(グローバルI o T関連株マザーファンド)

幅広いI o T関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の3つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考えられる企業に投資を行います。

引き続き、高い成長が期待されるI o T関連企業に投資を行うことで、信託財産の成長を目指します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年3月15日～2023年3月13日)

| 項 目 | 当期 | | 項 目 の 概 要 |
|--------------------------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社) | 97 (93) (1) (3) | 0.572 (0.548) (0.005) (0.018) | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 信託財産の運用指図、法定開示書類の作成、基準価額の算出等の対価 口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価 信託財産の保管・管理、投信会社からの指図の実行等の対価 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) | 8 (8) | 0.050 (0.050) | (b) 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 |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) | 0 (0) | 0.001 (0.001) | (c) 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 |
| (d) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (監 査 費 用) (そ の 他) | 6 (2) (1) (2) | 0.033 (0.012) (0.005) (0.015) | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 金融商品取引に要する諸費用 |
| 合 計 | 111 | 0.656 | |
| 期中の平均基準価額は、16,957円です。 | | | |

(注) 期中の費用（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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(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、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況 (2022年3月15日～2023年3月13日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設 定 | | 解 約 | |
|----------------------|---------|-----------|-----------|-----------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| グローバルI o T関連株マザーファンド | 768,373 | 1,794,517 | 2,365,105 | 5,311,571 |

(注) 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率 (2022年3月15日～2023年3月13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 |
|---------------------|----------------------|
| | グローバルI o T関連株マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 47,221,177千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 62,715,111千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.75 |

(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 (2022年3月15日～2023年3月13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。

○組入資産の明細 (2023年3月13日現在)

親投資信託残高

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|-----------|-----------|------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| グローバルI o T関連株マザーファンド | 6,319,561 | 4,722,829 | 10,833,227 |

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成 (2023年3月13日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|----------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| グローバルI o T関連株マザーファンド | 10,833,227 | 96.8 |
| コール・ローン等、その他 | 353,255 | 3.2 |
| 投資信託財産総額 | 11,186,482 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切り捨てです。

(注) グローバルI o T関連株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産(59,721,927千円)の投資信託財産総額(60,657,412千円)に対する比率は98.5%です。

(注) 外貨建て資産は、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米ドル=134.34円、1ユーロ=143.58円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年3月13日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|---------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 22,493,060,974円 |
| グローバルI o T関連株マザーファンド(評価額) | 10,833,227,263 |
| 未 収 入 金 | 11,659,833,711 |
| (B) 負 債 | 11,921,670,328 |
| 未 払 金 | 11,804,536,880 |
| 未 払 解 約 金 | 86,999,999 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 29,847,020 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 286,429 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 10,571,390,646 |
| 元 本 | 6,354,578,214 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 4,216,812,432 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 6,354,578,214口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 16,636円 |

(注) 当ファンドの期首元本額は7,160,078,473円、期中追加設定元本額は376,355,855円、期中一部解約元本額は1,181,856,114円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は1.6636円です。

○損益の状況 (2022年3月15日～2023年3月13日)

| 項目 | 当期 |
|----------------|-----------------|
| (A) 有価証券売買損益 | △1,137,701,514円 |
| 売 買 益 | 2,954,607,954 |
| 売 買 損 | △4,092,309,468 |
| (B) 信託報酬等 | △ 64,331,644 |
| (C) 当期損益金(A+B) | △1,202,033,158 |
| (D) 前期繰越損益金 | 4,628,354,492 |
| (E) 追加信託差損益金 | 790,491,098 |
| (配当等相当額) | (754,117,458) |
| (売買損益相当額) | (36,373,640) |
| (F) 計 (C+D+E) | 4,216,812,432 |
| (G) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(F+G) | 4,216,812,432 |
| 追加信託差損益金 | 790,491,098 |
| (配当等相当額) | (754,391,020) |
| (売買損益相当額) | (36,100,078) |
| 分配準備積立金 | 5,600,797,917 |
| 繰越損益金 | △2,174,476,583 |

- (注) 損益の状況の中で(A)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(B)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(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,081,363円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(754,391,020円)および分配準備積立金(5,591,716,554円)より分配対象収益は6,355,188,937円(10,000口当たり10,000円)ですが、当期に分配した金額はありません。
- (注) 運用の指図にかかる権限を委託するために要する費用：信託財産に属する親投資信託の受益証券の時価総額に年0.34%を乗じて得た額

○分配金のお知らせ

当期の分配金はございません。

グローバル I o T 関連株ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 株組比 | 式入率 | 株先比 | 式物率 | 純資産額 |
|----------------|--------|---|-------|------|-----|-----|-----|---------------|
| | 円 | 円 | % | | | | | |
| 2期（2019年3月13日） | 13,021 | 0 | 6.5 | 98.3 | — | — | — | 百万円 92,353 |
| 3期（2020年3月13日） | 10,984 | 0 | △15.6 | 97.8 | — | — | — | 56,488 |
| 4期（2021年3月15日） | 20,915 | 0 | 90.4 | 99.0 | — | — | — | 78,881 |
| 5期（2022年3月14日） | 20,766 | 0 | △0.7 | 96.2 | — | — | — | 60,499 |
| 6期（2023年3月13日） | 22,183 | 0 | 6.8 | 96.6 | — | — | — | 49,568 |

（注）株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

（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ないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

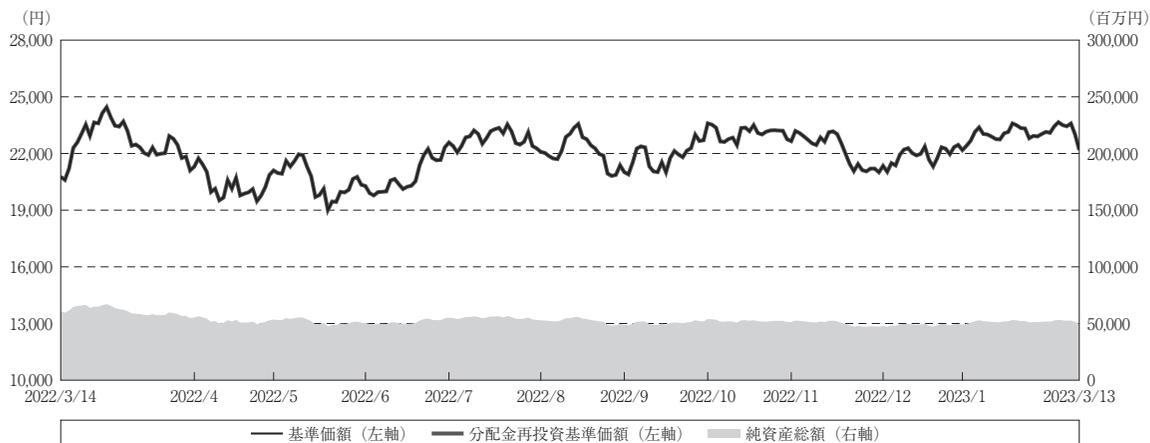
| 年月日 | 基準価額 | | 株組比 | 式入率 | 株先比 | 式物率 |
|--------------------|--------|------|------|-----|-----|-----|
| | 円 | % | | | | |
| （期首） 2022年3月14日 | 20,766 | — | 96.2 | — | — | — |
| 3月末 | 23,914 | 15.2 | 98.4 | — | — | — |
| 4月末 | 21,305 | 2.6 | 97.0 | — | — | — |
| 5月末 | 21,100 | 1.6 | 97.9 | — | — | — |
| 6月末 | 20,276 | △2.4 | 97.6 | — | — | — |
| 7月末 | 22,581 | 8.7 | 99.3 | — | — | — |
| 8月末 | 22,085 | 6.4 | 96.9 | — | — | — |
| 9月末 | 21,012 | 1.2 | 99.2 | — | — | — |
| 10月末 | 23,594 | 13.6 | 98.6 | — | — | — |
| 11月末 | 22,652 | 9.1 | 97.7 | — | — | — |
| 12月末 | 21,342 | 2.8 | 97.3 | — | — | — |
| 2023年1月末 | 22,177 | 6.8 | 95.4 | — | — | — |
| 2月末 | 23,030 | 10.9 | 96.5 | — | — | — |
| （期末） 2023年3月13日 | 22,183 | 6.8 | 96.6 | — | — | — |

（注）騰落率は期首比です。

（注）株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

（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ないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

■ 基準価額等の推移について



【基準価額・騰落率】

期首：20,766円 期末：22,183円 騰落率：6.8%

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ・急ピッチで金融引き締めを行う米国に対して、日本では強固な金融緩和姿勢が維持されるなど、日米金融政策の方向性の違いから、2022年3月から10月半ばにかけて米ドルが円に対して上昇したこと
- ・2022年10月から2023年2月初旬にかけて、物価が鎮静化に向かう中、米国金融当局が利上げペースを緩めるとの観測を背景にグローバル株式市場が上昇基調で推移したこと

下落要因

- ・2022年4月以降、ウクライナ情勢の悪化に加えてインフレ高進を背景に米国金融当局が引き締め姿勢を一段と強める中で長期金利が上昇し、6月半ばにかけてグローバル株式市場が下落基調で推移したこと

■投資環境について

株式市場

期初、原油高の動きが一巡したことやロシア政府による債務不履行がひとまず回避されたことで投資家心理が改善し2022年3月末にかけて上昇したものの、ウクライナ情勢の悪化に加えてインフレ高進を背景に米連邦準備制度理事会（F R B）が引き締め姿勢を一段と強める中で長期金利が上昇し、6月半ばにかけて世界株式市場は下落基調で推移しました。その後利上げペースの鈍化期待が広がり8月半ばにかけて反発しましたが、根強いインフレ圧力を背景にF R Bが大幅な利上げを継続する姿勢を示したことに加え、英国で財政悪化懸念が台頭したことから、9月末にかけて再度下落しました。

10月以降は底堅さを示す米国経済指標や金融政策動向をにらみ下落する場面が見られたものの、物価が鎮静化に向かう中、米国金融当局が利上げペースを緩めるとの観測を背景に2023年2月初旬にかけて上昇基調で推移しました。期末にかけては米国経済指標が底堅さを示す中で金融引き締めの長期化観測が台頭したほか、米国の一部銀行に対する懸念が高まり軟調となりました。

為替市場

急ピッチで金融引き締めを行う米国に対して、日本では強固な金融緩和姿勢が維持されるなど、日米金融政策の方向性の違いから、2022年3月から10月半ばにかけて米ドルは円に対して上昇しました。しかし、その後は政府・日本銀行によるドル売り・円買いの為替介入、米国での利上げペース鈍化観測、日本銀行による長期金利の変動許容幅の拡大などから一転して米ドルは対円で下落しました。2023年2月以降は堅調な米国経済指標の結果を受けて、F R Bによる金融引き締めの長期化観測から米ドルは対円で再度上昇に転じました。

■ポートフォリオについて

（当ファンド）

グローバルI o T関連株マザーファンドの受益証券を高位に組入れました。実質組入外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いませんでした。

（グローバルI o T関連株マザーファンド）

業種別配分

期末の業種別配分については情報技術、資本財・サービス、ヘルスケアなどへの配分が多くなりました。

国別配分

期末の国別配分では米国、日本、フランスへの配分が多くなりました。

■ベンチマークとの差異について

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

■分配金について

当期の収益分配については、基準価額水準等を勘案して、見送りとさせて頂きました。分配に充てなかった収益につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用致します。

■今後の運用方針

（当ファンド）

引き続き、グローバルI o T関連株マザーファンドの受益証券を高位に組入れます。実質組入外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いません。

（グローバルI o T関連株マザーファンド）

幅広いI o T関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の3つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行います。

引き続き、高い成長が期待されるI o T関連企業に投資を行うことで、信託財産の成長を目指します。

○ 1万口当たりの費用明細

(2022年3月15日～2023年3月13日)

| 項 目 | 当期 | | 項 目 の 概 要 |
|--------------------------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社) | 126 (121) (1) (4) | 0.572 (0.548) (0.005) (0.018) | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 信託財産の運用指図、法定開示書類の作成、基準価額の算出等の対価 口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価 信託財産の保管・管理、投信会社からの指図の実行等の対価 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) | 11 (11) | 0.049 (0.049) | (b) 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 |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) | 0 (0) | 0.001 (0.001) | (c) 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 |
| (d) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (監 査 費 用) (そ の 他) | 7 (3) (1) (3) | 0.030 (0.012) (0.002) (0.015) | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 金融商品取引に要する諸費用 |
| 合 計 | 144 | 0.652 | |
| 期中の平均基準価額は、22,089円です。 | | | |

(注) 期中の費用（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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(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、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況 (2022年3月15日～2023年3月13日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設定 | | 解約 | |
|----------------------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| グローバルI o T関連株マザーファンド | 1,179,277 | 2,785,501 | 7,902,399 | 18,261,370 |

(注) 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率 (2022年3月15日～2023年3月13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 |
|---------------------|----------------------|
| | グローバルI o T関連株マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 47,221,177千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 62,715,111千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.75 |

(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 (2022年3月15日～2023年3月13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。

○組入資産の明細 (2023年3月13日現在)

親投資信託残高

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|----------------------|------------|------------|------------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| グローバルI o T関連株マザーファンド | 28,326,797 | 21,603,675 | 49,554,510 |

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成 (2023年3月13日現在)

| 項目 | 当期末 | |
|----------------------|------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| グローバルI o T関連株マザーファンド | 49,554,510 | 99.7 |
| コール・ローン等、その他 | 158,500 | 0.3 |
| 投資信託財産総額 | 49,713,010 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切り捨てです。

(注) グローバルI o T関連株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産(59,721,927千円)の投資信託財産総額(60,657,412千円)に対する比率は98.5%です。

(注) 外貨建て資産は、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米ドル=134.34円、1ユーロ=143.58円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年3月13日現在)

| 項目 | 当期末 |
|---------------------------|-----------------|
| (A) 資産 | 49,713,010,494円 |
| コール・ローン等 | 11,231,100 |
| グローバルI o T関連株マザーファンド(評価額) | 49,554,510,412 |
| 未収入金 | 147,268,982 |
| (B) 負債 | 144,227,073 |
| 未払信託報酬 | 143,566,820 |
| その他未払費用 | 660,253 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 49,568,783,421 |
| 元本 | 22,345,466,413 |
| 次期繰越損益金 | 27,223,317,008 |
| (D) 受益権総口数 | 22,345,466,413口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 22,183円 |

(注) 当ファンドの期首元本額は29,133,974,735円、期中追加設定元本額は1,051,579,648円、期中一部解約元本額は7,840,087,970円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は2,2183円です。

○損益の状況 (2022年3月15日～2023年3月13日)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|------------------|
| (A) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 3,259,081,031円 |
| 売 買 益 | 4,533,992,403 |
| 売 買 損 | △ 1,274,911,372 |
| (B) 信 託 報 酬 等 | △ 303,516,230 |
| (C) 当 期 損 益 金 (A+B) | 2,955,564,801 |
| (D) 前 期 繰 越 損 益 金 | 17,777,353,673 |
| (E) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 6,490,398,534 |
| (配 当 等 相 当 額) | (4,198,906,637) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (2,291,491,897) |
| (F) 計 (C+D+E) | 27,223,317,008 |
| (G) 收 益 分 配 金 | 0 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (F+G) | 27,223,317,008 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 6,490,398,534 |
| (配 当 等 相 当 額) | (4,199,785,161) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (2,290,613,373) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 20,732,918,474 |

- (注) 損益の状況の中で(A)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(B)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(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(300,607,492円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(1,646,361,443円)、信託約款に規定する収益調整金(6,490,398,534円)および分配準備積立金(18,785,949,539円)より分配対象収益は27,223,317,008円(10,000口当たり12,182円)ですが、当期に分配した金額はありません。
- (注) 運用の指図にかかる権限を委託するために要する費用：信託財産に属する親投資信託の受益証券の時価総額に年0.34%を乗じて得た額

○分配金のお知らせ

当期の分配金はありません。

グローバル I o T 関連株マザーファンド

第6期（2023年3月13日決算）〔計算期間：2022年3月15日～2023年3月13日〕

法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|-------------------------------------------------------|
| 商品分類 | 親投資信託 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 運用方針 | 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 | 世界の金融商品取引所等に上場している株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）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。 外貨建資産の投資割合には、制限を設けません。 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 株式比率 | 先比率 | 式物率 | 純資産 |
|----------------|--------|-------|------|-----|-----|---------|
| | 円 | % | | | | |
| 2期(2019年3月13日) | 13,147 | 7.0 | 98.3 | — | — | 119,286 |
| 3期(2020年3月13日) | 11,158 | △15.1 | 97.8 | — | — | 71,387 |
| 4期(2021年3月15日) | 21,365 | 91.5 | 99.0 | — | — | 99,573 |
| 5期(2022年3月14日) | 21,350 | △0.1 | 96.3 | — | — | 73,970 |
| 6期(2023年3月13日) | 22,938 | 7.4 | 96.6 | — | — | 60,388 |

(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ないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | 株式比率 | 先比率 | 式物率 |
|--------------------|--------|------|------|-----|-----|
| | 円 | % | | | |
| (期首) 2022年3月14日 | 21,350 | — | 96.3 | — | — |
| 3月末 | 24,593 | 15.2 | 98.4 | — | — |
| 4月末 | 21,921 | 2.7 | 96.9 | — | — |
| 5月末 | 21,721 | 1.7 | 97.8 | — | — |
| 6月末 | 20,884 | △2.2 | 97.4 | — | — |
| 7月末 | 23,263 | 9.0 | 99.1 | — | — |
| 8月末 | 22,765 | 6.6 | 96.7 | — | — |
| 9月末 | 21,666 | 1.5 | 99.2 | — | — |
| 10月末 | 24,339 | 14.0 | 98.5 | — | — |
| 11月末 | 23,379 | 9.5 | 97.6 | — | — |
| 12月末 | 22,040 | 3.2 | 97.1 | — | — |
| 2023年1月末 | 22,912 | 7.3 | 95.2 | — | — |
| 2月末 | 23,809 | 11.5 | 96.2 | — | — |
| (期末) 2023年3月13日 | 22,938 | 7.4 | 96.6 | — | — |

(注) 騰落率は期首比です。

(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ないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

■基準価額等の推移について



【基準価額・騰落率】

期首：21,350円 期末：22,938円 騰落率：7.4%

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- 急ピッチで金融引き締めを行う米国に対して、日本では強固な金融緩和姿勢が維持されるなど、日米金融政策の方向性の違いから、2022年3月から10月半ばにかけて米ドルが円に対して上昇したこと
- 2022年10月から2023年2月初旬にかけて、物価が鎮静化に向かう中、米国金融当局が利上げペースを緩めるとの観測を背景にグローバル株式市場が上昇基調で推移したこと

下落要因

- 2022年4月以降、ウクライナ情勢の悪化に加えてインフレ高進を背景に米国金融当局が引き締め姿勢を一段と強める中で長期金利が上昇し、6月半ばにかけてグローバル株式市場が下落基調で推移したこと

■投資環境について

株式市場

期初、原油高の動きが一巡したことやロシア政府による債務不履行がひとまず回避されたことで投資家心理が改善し2022年3月末にかけて上昇したものの、ウクライナ情勢の悪化に加えてインフレ高進を背景に米連邦準備制度理事会（FRB）が引き締め姿勢を一段と強める中で長期金利が上昇し、6月半ばにかけて世界株式市場は下落基調で推移しました。その後利上げペースの鈍化期待が広がり8月半ばにかけて反発しましたが、根強いインフレ圧力を背景にFRBが大幅な利上げを継続する姿勢を示したことに加え、英国で財政悪化懸念が台頭したことから、9月末にかけて再度下落しました。

10月以降は底堅さを示す米国経済指標や金融政策動向をにらみ下落する場面が見られたものの、物価が鎮静化に向かう中、米国金融当局が利上げペースを緩めるとの観測を背景に2023年2月初旬にかけて上昇基調で推移しました。期末にかけては米国経済指標が底堅さを示す中で金融引き締めの長期化観測が台頭したほか、米国の一部銀行に対する懸念が高まり軟調となりました。

為替市場

急ピッチで金融引き締めを行う米国に対して、日本では強固な金融緩和姿勢が維持されるなど、日米金融政策の方向性の違いから、2022年3月から10月半ばにかけて米ドルは円に対して上昇しました。しかし、その後は政府・日本銀行によるドル売り・円買いの為替介入、米国での利上げペース鈍化観測、日本銀行による長期金利の変動許容幅の拡大などから一転して米ドルは対円で下落しました。2023年2月以降は堅調な米国経済指標の結果を受けて、FRBによる金融引き締めの長期化観測から米ドルは対円で再度上昇に転じました。

■ポートフォリオについて

業種別配分

期末の業種別配分については情報技術、資本財・サービス、ヘルスケアなどへの配分が多くなりました。

国別配分

期末の国別配分では米国、日本、フランスへの配分が多くなりました。

■ベンチマークとの差異について

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

■今後の運用方針

幅広いI o T関連ビジネスの中から、①情報を「集める」分野、②さまざまな情報をネットワークで「つなげる」分野、③情報を分析し製品やサービスへ「活かす」分野の3つに着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に投資を行います。

引き続き、高い成長が期待されるI o T関連企業に投資を行うことで、信託財産の成長を目指します。

○1万口当たりの費用明細

(2022年3月15日～2023年3月13日)

| 項 目 | 当期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|---------|------------|------------------------------------------------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 | 11 円 | 0.049 % | (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 |
| (株 式) | (11) | (0.049) | |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 | 0 | 0.001 | (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 |
| (株 式) | (0) | (0.001) | |
| (c) そ の 他 費 用 | 6 | 0.027 | (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) | (3) | (0.012) | 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 |
| (そ の 他) | (3) | (0.015) | 金融商品取引に要する諸費用 |
| 合 計 | 17 | 0.077 | |
| 期中の平均基準価額は、22,774円です。 | | | |

(注) 期中の費用（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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(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、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況 (2022年3月15日～2023年3月13日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-------|-------|--------------------|--------------------|----------------|-------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 | アメリカ | 百株 | 千米ドル | 百株 | 千米ドル |
| | | 31,403 (1,192) | 108,517 (△ 206) | 54,346 (ー) | 227,846 (203) |
| 国 | フランス | ユーロ | 千ユーロ | ユーロ | 千ユーロ |
| | | 64 | 910 | 261 | 3,854 |
| ノルウェー | ノルウェー | クローネ | 千ノルウェー | クローネ | 千ノルウェー |
| | | ー | ー | 6,786 | 113,477 |

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) 単位未満は切り捨て。

(注) ()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

○株式売買比率 (2022年3月15日～2023年3月13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 | 47,221,177千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 62,715,111千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.75 |

(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 (2022年3月15日～2023年3月13日)

期中における当ファンドに係る利害関係人との取引はありません。

(注) 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。

○組入資産の明細

(2023年3月13日現在)

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 | 千米ドル | 千円 | | |
| ANSYS, INC. | 641 | 622 | 18,437 | 2,476,872 | ソフトウェア・サービス | |
| APPLIED MATERIALS INC | 1,557 | 1,511 | 17,289 | 2,322,714 | 半導体・半導体製造装置 | |
| AMETEK, INC. | 1,869 | 1,814 | 24,620 | 3,307,452 | 資本財 | |
| COGNEX CORPORATION | 815 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| DIODES INC | 2,246 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 | |
| NVIDIA CORPORATION | 1,077 | 279 | 6,412 | 861,488 | 半導体・半導体製造装置 | |
| EXTREME NETWORKS INC | — | 4,408 | 7,745 | 1,040,500 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| HITACHI LTD -ADR | 1,935 | 1,877 | 19,386 | 2,604,369 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| STMICROELECTRONICS NV-NY SHS | 6,705 | 2,641 | 12,755 | 1,713,634 | 半導体・半導体製造装置 | |
| ITRON INC | — | 1,328 | 7,019 | 943,026 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| SILICON LABORATORIES INC | 612 | 346 | 5,888 | 791,060 | 半導体・半導体製造装置 | |
| NOKIA CORP-SPON ADR | 51,559 | 25,864 | 12,130 | 1,629,576 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| QUALCOMM INC | 1,439 | 375 | 4,325 | 581,025 | 半導体・半導体製造装置 | |
| RESMED INC | 460 | 249 | 5,142 | 690,800 | ヘルスケア機器・サービス | |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 593 | — | — | — | 資本財 | |
| OMNICELL INC | 514 | 1,293 | 6,663 | 895,221 | ヘルスケア機器・サービス | |
| SEMTECH CORPORATION | 2,955 | 1,857 | 5,448 | 731,949 | 半導体・半導体製造装置 | |
| SONY GROUP CORP - SP ADR | 2,245 | 2,178 | 18,464 | 2,480,481 | 耐久消費財・アパレル | |
| SYNAPTICS INC | 955 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 | |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 733 | 711 | 15,999 | 2,149,373 | ヘルスケア機器・サービス | |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 666 | 646 | 18,632 | 2,503,108 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| BELDEN INC. | 1,090 | 1,584 | 13,245 | 1,779,467 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| DEXCOM INC | 3,418 | 1,625 | 17,513 | 2,352,805 | ヘルスケア機器・サービス | |
| MAXLINEAR, INC. | 4,431 | 4,159 | 13,756 | 1,848,015 | 半導体・半導体製造装置 | |
| CALIX INC | 2,882 | 1,541 | 7,349 | 987,274 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| GARMIN LTD. | 1,492 | 1,448 | 13,763 | 1,849,014 | 耐久消費財・アパレル | |
| AMERICAN TOWER CORPORATION | 516 | 501 | 9,588 | 1,288,100 | 不動産 | |
| AMBARELLA, INC. | 813 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 | |
| SERVICENOW INC | 294 | 286 | 11,879 | 1,595,904 | ソフトウェア・サービス | |
| PTC INC | 1,560 | 1,405 | 16,644 | 2,235,969 | ソフトウェア・サービス | |
| TWILIO INC. | 580 | 1,622 | 10,439 | 1,402,444 | ソフトウェア・サービス | |
| HUBBELL INCORPORATED | 398 | 668 | 15,986 | 2,147,656 | 資本財 | |
| ADT INC | 22,428 | 21,760 | 15,972 | 2,145,702 | 商業・専門サービス | |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 1,138 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 1,686 | 1,178 | 21,949 | 2,948,671 | 資本財 | |
| INGERSOLL-RAND INC | — | 1,668 | 9,300 | 1,249,458 | 資本財 | |
| MOBILEYE GLOBAL INC-A | — | 144 | 569 | 76,463 | ソフトウェア・サービス | |
| JFROG LTD | — | 4,274 | 7,942 | 1,067,020 | ソフトウェア・サービス | |
| DIGITALOCEAN HOLDINGS INC | — | 1,640 | 5,414 | 727,389 | ソフトウェア・サービス | |
| GLOBANT SA | 662 | 225 | 3,459 | 464,813 | ソフトウェア・サービス | |

| 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) ADTRAN HOLDINGS INC | | 百株 — | 百株 3,486 | 千米ドル 5,536 | 千円 743,756 | 電気通信サービス |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 118,981 34 | 97,230 35 | 406,674 — | 54,632,586 <90.5%> | |
| (ユーロ・・・フランス) SCHNEIDER ELECTRIC SE | | 1,888 | 1,691 | 千ユーロ 25,771 | 3,700,203 | 資本財 |
| ユーロ計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 1,888 1 | 1,691 1 | 25,771 — | 3,700,203 < 6.1%> | |
| (ノルウェー) NORDIC SEMICONDUCTOR ASA | | 6,786 | — | 千ノルウェークローネ — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 6,786 1 | — — | — — | — < —%> | |
| 合 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 127,656 36 | 98,922 36 | — — | 58,332,789 <96.6%> | |

(注) 邦貨換算金額は、期首、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。

(注) 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載。

(注) —印は組み入れなし。

○投資信託財産の構成 (2023年3月13日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株 式 | 58,332,790 | 96.2 |
| コール・ローン等、その他 | 2,324,622 | 3.8 |
| 投資信託財産総額 | 60,657,412 | 100.0 |

(注) 金額の単位未満は切り捨て。

(注) 当期末における外貨建て純資産 (59,721,927千円) の投資信託財産総額 (60,657,412千円) に対する比率は98.5%です。

(注) 外貨建て資産は、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米ドル=134.34円、1ユーロ=143.58円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年3月13日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 60,657,412,690円 |
| コール・ローン等 | 2,284,397,010 |
| 株 式(評価額) | 58,332,790,010 |
| 未 収 配 当 金 | 40,225,670 |
| (B) 負 債 | 269,337,544 |
| 未 払 解 約 金 | 269,179,865 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 157,679 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 60,388,075,146 |
| 元 本 | 26,326,505,221 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 34,061,569,925 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 26,326,505,221口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 22,938円 |

(注) 当親ファンドの期首元本額は34,646,358,981円、期中追加設定元本額は1,947,651,068円、期中一部解約元本額は10,267,504,828円です。

(注) 当親ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、グローバルI o T関連株ファンド(為替ヘッジなし) (適格機関投資家専用) 21,603,675,304円
グローバルI o T関連株ファンド(為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用) 4,722,829,917円
です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は2,2938円です。

○損益の状況 (2022年3月15日~2023年3月13日)

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 423,804,637円 |
| 受 取 配 当 金 | 417,476,961 |
| 受 取 利 息 | 6,327,676 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 5,003,599,884 |
| 売 買 益 | 16,252,065,668 |
| 売 買 損 | △11,248,465,784 |
| (C) 保 管 費 用 等 | △ 17,338,027 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 5,410,066,494 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 39,324,573,283 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 2,632,367,124 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △13,305,436,976 |
| (H) 計 (D+E+F+G) | 34,061,569,925 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 34,061,569,925 |

(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。