

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	2023年5月30日(設定日)から無期限
運用方針	主として世界各国・地域の取引所に上場しているバイオ医薬関連企業が発行する株式等に投資し、信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	世界各国・地域の取引所に上場しているバイオ医薬関連企業が発行する株式
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。
分配方針	毎決算日(年2回、原則として4月26日、10月26日)に、収益分配方針に基づいて分配を行います。分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

## 世界バイオ医薬株式ファンド

愛称：世界の薬

追加型投信／内外／株式

## 運用報告書(全体版)

### 第1期

決算日：2023年10月26日

作成対象期間：2023年5月30日～2023年10月26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を申し上げます。さて、「世界バイオ医薬株式ファンド(愛称：世界の薬)」は、2023年10月26日に第1期の決算を行いました。ここに、期中の運用状況と収益分配状況についてご報告申し上げます。今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

### キャピタル アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区内神田一丁目13番7号 四国ビルディング9階

< お問い合わせ先 >

[ 電話番号 ] **03-5259-7401**

(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

[ ホームページ ] <http://www.capital-am.co.jp/>

## ◆ 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			参考指数		株式組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率		
(設定日) 2023年5月30日	円 10,000	円 -	% -	572,155.72	% -	% -	百万円 509
1期(2023年10月26日)	9,988	0	△ 0.1	562,029.17	△ 1.8	95.5	1,953

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 基準価額は1万口当たりです。(基準価額の全てに共通)

(注3) 純資産総額は単位未満切捨て、騰落率と組入比率は小数第2位を四捨五入しています。

(注4) 株式組入比率は、純資産総額に対する組入比率です。

(注5) 当ファンドは、適切なベンチマークが存在しないため、ベンチマークを設けていません。当報告書では、前営業日の「ナスダックバイオテクノロジー株指数」の終値を当日の為替レート（投信協会発表）で邦貨換算した数値を参考指数として表示しています。

## ◆ 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数		株式組入比率
		騰落率		期中騰落率	
(設定日) 2023年5月30日	円 10,000	% -	572,155.72	% -	% -
5月末	9,969	△ 0.3	566,166.34	△ 1.0	96.6
6月末	10,472	4.7	586,100.33	2.4	97.6
7月末	10,268	2.7	582,727.69	1.8	99.5
8月末	10,712	7.1	606,776.78	6.1	99.9
9月末	10,465	4.7	594,151.21	3.8	94.2
(期末) 2023年10月26日	9,988	△ 0.1	562,029.17	△ 1.8	95.5

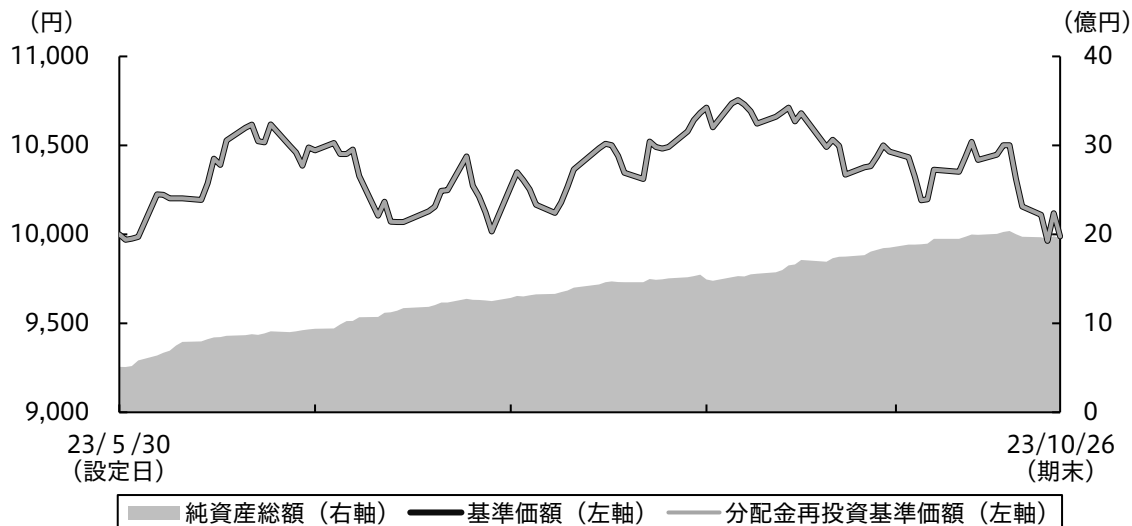
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。

(注2) 株式組入比率は、純資産総額に対する組入比率です。

(注3) 当ファンドは、適切なベンチマークが存在しないため、ベンチマークを設けていません。当報告書では、前営業日の「ナスダックバイオテクノロジー株指数」の終値を当日の為替レート（投信協会発表）で邦貨換算した数値を参考指数として表示しています。

## ◆ 運用経過の説明 ◆

### ● 基準価額の推移 (2023年5月30日～2023年10月26日)



設定日： 10,000円

第1期末： 9,988円 (既払分配金0円)

騰落率：  $\Delta 0.1\%$  (分配金再投資ベース)

(注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客様の損益の状況を示すものではありません。

### ● 基準価額の主な変動要因 (2023年5月30日～2023年10月26日)

当期末の基準価額は、設定日とほぼ同じ9,988円となりました。設定日から8月にかけて横ばい圏で推移していたバイオ医薬関連株式の株価が期末に向けて下落したため、基準価額の押し下げ要因となりました。為替市場では、7月上旬には一時的に米ドル安・円高に振れましたが、概ね当期を通じて米ドル高・円安が進み、株価下落の影響が打ち消される結果となりました。

## ● 投資環境 (2023年5月30日～2023年10月26日)

---

当期のバイオ医薬関連株式市場は、下落しました。設定後から6月初旬にかけて、米国のインフレへの警戒感が後退し、債務上限問題を巡る懸念が払拭された中、米バイオ製薬会社バイオジェンと日本のエーザイが共同開発したアルツハイマー型認知症薬について米食品医薬品局(FDA)の正式認証への期待が高まったこともあり、上昇して始まりましたが、6月後半には、米連邦公開市場委員会(FOMC)で利上げが見送られたものの、年内2回の追加利上げが示唆されたことなどから反落しました。その後7月には、アルツハイマー型認知症薬の正式認証に対する市場の反応は限定的でしたが、米インフレ指標が市場予想を下回ったことを受けて、米連邦準備理事会(FRB)による利上げ打ち止め観測が高まる中、持ち直しました。8月には、格付け会社フィッチによる米国債の格下げ、中国の景気に対する先行き不透明感や同国不動産大手の経営不安などが警戒される場面もありましたが、大手医薬品会社がバイオ医薬技術を用いた肥満症向け治療薬の治験結果が良好であったと発表したことなどを受けて株価は反発しました。

9月に入ると、サウジアラビアが原油の自主減産を年末まで延長すると表明したことなどを受けて原油高となり、米長期金利が上昇する中下落に転じた後も、米FOMCでは2会合ぶりに政策金利が据え置かれたものの、政策金利見通しが市場予想以上にタカ派的な内容だったことや、全米自動車労組(UAW)によるストライキの影響も警戒され、下落基調が続きました。10月に入ってから、イスラエルとイスラム組織ハマスの軍事衝突により中東の地政学的リスクが高まったことや米経済指標の改善を受けて米FRBによる金融引き締め長期化観測が高まり、米10年物国債利回りが16年ぶりに5%をつけたことや、米国での新型コロナウイルスワクチンの接種率が低くなるとの見方なども警戒されて続落しました。

為替市場では、金融緩和策の維持を続ける日銀とインフレ抑制策を進める欧米中央銀行など、金融政策の方向性の違いが注目され、米ドル高・円安で始まりました。7月上旬には米国の利上げ打ち止め観測の台頭や日本の金融緩和政策が修正されるとの見方などを受けて米ドル安・円高が進展する局面もありましたが、米国景気が底堅さを保つ中、米金融引き締めが長引くとの観測などを背景に、期末に1米ドル=150円台をつけるなど米ドル高・円安が進み、当期の米ドル円相場は、約10円の米ドル高・円安となりました。

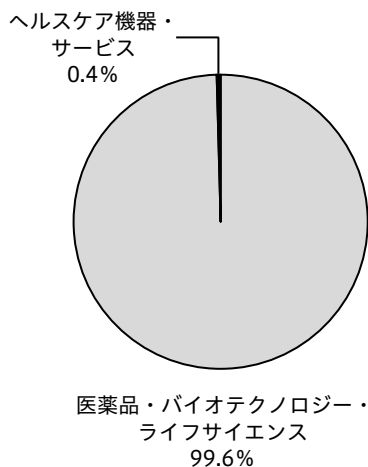
## ● 当該投資信託のポートフォリオ (2023年5月30日～2023年10月26日)

株式組入比率は高位を維持し、期末の組入銘柄数は60銘柄としました。

幅広い製品を手掛け、安定した収益基盤などが評価される米バイオ製薬大手アムジェンや、遺伝性難病治療薬の高い成長・収益性に加え、開発中の複数の新薬候補も注目される同バーテックス・ファーマシューティカルズなど、バイオテクノロジー銘柄を中心としたポートフォリオとしております。

### 【業種別比率】

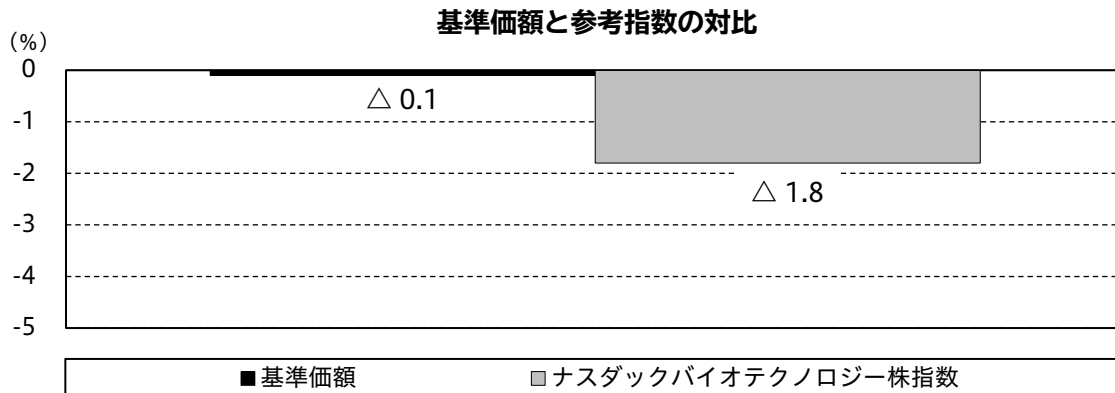
期末 (2023年10月26日)



※ 各比率の合計が四捨五入の関係で100%にならない場合があります。

## ● 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けていません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



(注1) 基準価額は分配金（税引前）込み。

(注2) 参考指数は前営業日の「ナスダックバイオテクノロジー株指数」の終値を当日の為替レート（投信協会発表）で邦貨換算した数値を参考指数として表示しています。

## ● 分配金

分配原資、基準価額水準等を勘案し、当期の収益分配は以下の通りとさせていただきます。留保益は、「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用します。

（単位：円、1万口当たり・税引前）

	第1期
	2023年5月30日～ 2023年10月26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	7

(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、当期の収益以外は収益調整金および分配準備積立金です。

(注2) 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3) 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（税引前）と一致しない場合があります。

## ◆ 今後の運用方針 ◆

世界的に不透明感が残る金融政策や実体経済の動向などを受けて、株式市場は不安定な動きが見込まれます。しかし、バイオ医薬関連銘柄は新薬承認を取り巻く環境が良好であることなどから比較的安定した推移が見込まれます。

また、バイオ医薬関連株式市場では、M&A(合併・買収)の動きが活発です。魅力的な新薬候補や高い技術力・研究開発力を求めて大手医薬品企業がバイオ医薬関連企業を買収する動きは今後も継続すると見られ、株価にはプラス要因になると考えられます。

一方、薬価の引き下げ圧力の動向に加えて、臨床データや治験結果の発表、決算の内容などには注視が必要です。引き続きファンダメンタルズ分析を行い、企業価値を適切に評価してポートフォリオを構築していく方針です。

## ◆ 当期中の1万口(元本 10,000 円)当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	82円	0.789%	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率です。 なお、期中の平均基準価額は10,374円です。
(投 信 会 社)	( 47)	( 0.451)	・ 委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	( 33)	( 0.316)	・ 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、購入後のアフターフォローの対価
(受 託 会 社)	( 2)	( 0.022)	・ 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	14	0.133	(b)売買委託手数料は期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。
(株 式)	( 14)	( 0.133)	売買委託手数料とは、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料です。
(c) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.008	(c)有価証券取引税は期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。
(株 式)	( 1)	( 0.008)	有価証券取引税とは、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金です。
(d) そ の 他 費 用	19	0.186	(d)その他費用は期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。
(監 査 費 用)	( 2)	( 0.018)	・ 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(保 管 費 用)	( 10)	( 0.098)	・ 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(そ の 他)	( 7)	( 0.071)	・ 信託事務の処理等に要するその他の諸費用（目論見書・届出書および報告書の作成、交付、印刷に係る費用等）
合 計	116	1.116	

(注1) 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2) 「比率」欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

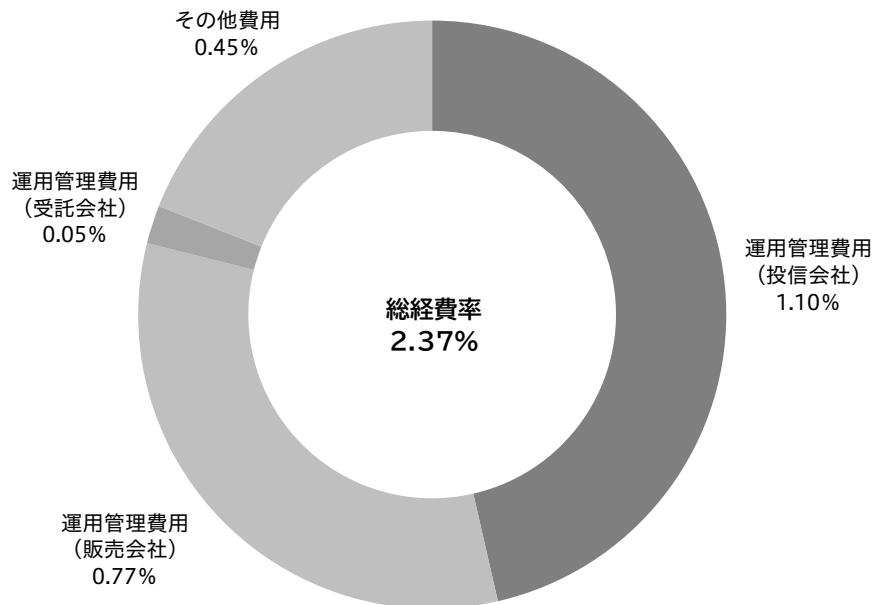
(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。



## (参考情報)

### ○ 総経費率

当期中の運用・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口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は2.37%です。



(注1) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 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。

## ◆ 期中の売買及び取引の状況 (2023年5月30日から2023年10月26日まで)

### 外国株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 2,947.88	千米ドル 14,368	百株 602.20	千米ドル 1,056
	ユ ー ロ ド イ ツ	百株 17.00	千ユーロ 55	百株 -	千ユーロ -

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(注3) 発行通貨によって区分しております。ただし、ユーロの場合は発行地などによって区分しております。

## ◆ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合 (2023年5月30日から2023年10月26日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	2,238,946千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	1,183,550千円
(c) 売 買 高 比 率 ( a ) / ( b )	1.89

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ◆ 主要な売買銘柄 (2023年5月30日から2023年10月26日まで)

### 株 式

銘 柄	買 付			銘 柄	売 付		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
Amgen Inc	4.890	163,610	33,458	Horizon Therapeutics Plc	2.571	44,782	17,418
Gilead Sciences Inc	13.680	151,560	11,078	Amgen Inc	0.515	19,751	38,352
Vertex Pharmaceuticals Inc	3.050	148,856	48,805	Halozyme Therapeutics Inc	1.367	8,254	6,038
Regeneron Pharmaceuticals Inc	1.293	142,353	110,095	PTC Therapeutics Inc	2.321	8,069	3,476
Moderna Inc	5.990	99,031	16,532	Apellis Pharmaceuticals Inc	0.987	5,901	5,978
Biogen Inc	2.340	94,966	40,583	Travere Therapeutics Inc	4.500	5,317	1,181
Seagen Inc	3.205	91,956	28,691	MoonLake Immunotherapeutics	0.670	5,090	7,597
AstraZeneca PLC-ADR	8.747	87,844	10,042	Intellia Therapeutics Inc	1.132	4,761	4,206
Alnylam Pharmaceuticals Inc	2.547	69,108	27,133	Vertex Pharmaceuticals Inc	0.090	4,622	51,364
Illumina Inc	2.180	56,162	25,762	Moderna Inc	0.290	4,553	15,700

(注1) 金額は約定毎の各月末の邦貨換算レートで算出し合計した金額。

(注2) 金額は受渡し代金。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

## ◆ 利害関係人との取引状況等 (2023年5月30日から2023年10月26日まで)

当期中におけ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10月26日現在)

外国株式  
上場、登録株式

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
Amgen Inc	43.75	1,190	178,938	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Gilead Sciences Inc	133.10	1,043	156,797	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
United Therapeutics Corp	8.90	199	30,026	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BioMarin Pharmaceutical Inc	39.20	320	48,170	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Biogen Inc	22.75	561	84,350	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ImmunoGen Inc	68.58	93	14,109	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Incyte Corp	33.15	179	27,026	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Exelixis Inc	46.90	93	14,011	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Illumina Inc	21.80	248	37,324	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Insmid Inc	45.90	116	17,555	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Neurocrine Biosciences Inc	13.45	145	21,876	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACADIA Pharmaceuticals Inc	47.90	108	16,261	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Regeneron Pharmaceuticals Inc	12.60	1,004	150,921	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Vertex Pharmaceuticals Inc	29.60	1,074	161,490	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Sanofi-ADR	43.50	230	34,705	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AstraZeneca PLC-ADR	85.10	546	82,117	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Alnylam Pharmaceuticals Inc	24.80	395	59,441	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Amicus Therapeutics Inc	99.25	107	16,108	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Alkermes PLC	49.80	116	17,549	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Jazz Pharmaceuticals PLC	13.44	174	26,281	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Sarepta Therapeutics Inc	18.71	200	30,153	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Prothena Corp PLC	19.68	78	11,735	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ICON PLC	3.53	79	11,950	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Cytokinetics Inc	28.03	91	13,728	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Mirati Therapeutics Inc	23.41	129	19,423	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Denali Therapeutics Inc	43.81	86	12,930	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Madrigral Pharmaceuticals Inc	3.61	44	6,694	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Medpace Holdings Inc	3.91	101	15,190	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Replimune Group Inc	40.56	56	8,539	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Rocket Pharmaceuticals Inc	43.10	77	11,671	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Ionis Pharmaceuticals Inc	19.90	88	13,269	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
Argenx SE-ADR	4.12	194	29,224	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当 期 末			業 種 等	
	株 数	評 価 額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円		
Arvinas Inc	23.10	33	5,009	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Arcus Biosciences Inc	36.60	57	8,613	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Moderna Inc	57.00	437	65,752	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Intra-Cellular Therapies Inc	23.50	113	17,092	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Karuna Therapeutics Inc	7.10	118	17,850	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Bridgebio Pharma Inc	41.95	102	15,401	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BioNTech SE-ADR	12.75	121	18,250	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Vaxcyte Inc	26.10	125	18,819	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Vera Therapeutics Inc	62.68	61	9,315	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REVOLUTION Medicines Inc	31.70	63	9,532	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Seagen Inc	31.20	675	101,576	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARS Pharmaceuticals Inc	141.03	49	7,375	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Ventyx Biosciences Inc	31.40	49	7,450	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Zentalis Pharmaceuticals Inc	43.55	69	10,471	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Royalty Pharma PLC	61.70	168	25,313	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Roivant Sciences Ltd	121.57	103	15,602	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Legend Biotech Corp-ADR	10.80	69	10,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Olema Pharmaceuticals Inc	65.30	80	12,119	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MoonLake Immunotherapeutics	8.81	45	6,785	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Ocular Therapeutix Inc	181.50	42	6,409	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Mineralys Therapeutics Inc	62.80	51	7,719	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Amylyx Pharmaceuticals Inc	39.65	63	9,599	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Ascendis Pharma A/S-ADR	14.51	125	18,818	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Blueprint Medicines Corp	23.40	102	15,458	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Arrowhead Pharmaceuticals Inc	26.82	64	9,665	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Apellis Pharmaceuticals Inc	17.20	81	12,275	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BeiGene Ltd-ADR	6.12	101	15,311	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,345.68	12,360	1,857,549	
	銘柄数 < 比率 >	59 銘柄	-	<95.1%>	
(ドイツ)	百株	千ユーロ	千円		
Schott Pharma AG & Co KGaA	17.00	51	8,093	ヘルスケア機器・サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額	17.00	51	8,093	
	銘柄数 < 比率 >	1 銘柄	-	<0.4%>	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額	17.00	51	8,093	
	銘柄数 < 比率 >	1 銘柄	-	<0.4%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	2,362.68	-	1,865,642	
	銘柄数 < 比率 >	60 銘柄	-	<95.5%>	

(注1) 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2) ( )内は、発行通貨の国名を記載しています。

(注3) < >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注4) 評価額の単位未満は切捨て。

◆ 投資信託財産の構成 (2023年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 1,865,642	% 94.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	116,266	5.9
投 資 信 託 財 産 総 額	1,981,909	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 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、10月26日における邦貨換算レートは、1米ドル=150.28円、1ユーロ=158.70円です。

(注3) 当期末における外貨建資産(1,912,176千円)の投資信託財産総額(1,981,909千円)に対する比率は、96.5%です。

## ◆ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年10月26日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,981,909,631 円
コール・ローン等	116,266,921
株 式(評価額)	1,865,642,710
(B) 負 債	28,288,941
未 払 金	16,457,361
未 払 解 約 金	35,708
未 払 信 託 報 酬	10,723,872
そ の 他 未 払 費 用	1,072,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,953,620,690
元 本	1,955,973,821
次 期 繰 越 損 益 金	△ 2,353,131
(D) 受 益 権 総 口 数	1,955,973,821 口
1万口当たり基準価額 (C / D)	9,988 円

<注記事項>

- ① 期首元本額 509,976,955 円  
 期中追加設定元本額 1,522,633,582 円  
 期中一部解約元本額 76,636,716 円

② 分配金の計算過程

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 円
(c) 収益調整金	1,389,933 円
(d) 分配準備積立金	0 円
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,389,933 円
(f) 1万口当たり当期分配対象額	7.11 円
(g) 分配金	0 円
(h) 1万口当たり分配金	0 円

## ◆ 損益の状況

当期：自 2023年5月30日 至 2023年10月26日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,298,938 円
受 取 配 当 金	3,074,730
受 取 利 息	245,754
支 払 利 息	△ 21,546
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 46,258,000
売 買 損 益	193,777,393
売 買 損 益	△ 240,035,393
(C) 信 託 報 酬 等	△ 12,994,911
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 55,953,973
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	53,600,842
( 配 当 等 相 当 額 )	( 1,389,933 )
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( 52,210,909 )
(F) 合 計 (D + E)	△ 2,353,131
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F + G)	△ 2,353,131
追 加 信 託 差 損 益 金	53,600,842
( 配 当 等 相 当 額 )	( 1,389,933 )
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( 52,210,909 )
繰 越 損 益 金	△ 55,953,973

(注1) (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2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (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。

◆ 分配金のお知らせ

1万口当たり分配金（税込み）	0円
----------------	----

◆ お知らせ ◆

該当事項はございません。