

運用報告書 (全体版)

第2期<決算日2024年11月20日>

One / フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド (成長型)

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12月12日から無期限です。 |
| 運用方針 | 信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 主として、以下の投資信託証券に投資します。 ・フィデリティ・ブルーチップ・グロース・ファンド (適格機関投資家専用) ^(*) (以下「ブルーチップファンド」といいます。) (*) 「フィデリティ・ブルーチップ・グロース・マザーファンド受益証券」を主要投資対象とするファミリーファンド方式により運用を行います。 ・DIAMマネーマザーファンド受益証券 |
| 運用方法 | ブルーチップファンドは、主として米国を中心に世界 (日本を含みます。) の金融商品取引所に上場 (これに準ずると委託者が判断したものを含みます。 ^(*)) されている優良企業の株式に投資を行い、長期的な値上り益を獲得することをめざします。 (*) 米国の店頭市場登録の銘柄を組み入れることがあります。 各投資信託証券への投資割合は、資金動向や市況動向等を勘案して決定するものとし、ブルーチップファンドの組入比率は、原則として高位を維持します。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 |
| 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。 デリバティブ取引の直接利用は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 |
| 分配方針 | 決算日 (毎年5月および11月の各20日。休業日の場合は翌営業日。) に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の全額を分配対象額とし、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、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。 |

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「One / フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド (成長型)」は、2024年11月20日に第2期の決算を行いました。ここに、運用経過等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。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

One / フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド (成長型)

■設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | Russell 1000 グロースインデックス (円換算ベース、配当込) | | 投資信託 組入比率 | 純資産額 |
|----------------------|-------------|---------------|-----------------------|---|-----------------------|--------------|--------------|
| | (分配落) | 税込 分配 金 | 期 騰 落 中 率 | (参考指数) | 期 騰 落 中 率 | | |
| (設定日) 2023年12月12日 | 円 10,000 | 円 - | % - | ポイント (12月11日) 431,608.25 | % - | % - | 百万円 2,063 |
| 1期 (2024年5月20日) | 12,699 | 0 | 27.0 | 551,379.10 | 27.7 | 98.2 | 20,110 |
| 2期 (2024年11月20日) | 14,064 | 0 | 10.7 | 623,494.57 | 13.1 | 98.9 | 44,074 |

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

(注2) Russell 1000 グロースインデックスはラッセル・インベストメント・グループが開発した指数であり、著作権等の知的財産その他一切の権利はラッセル・インベストメント・グループに帰属します。ラッセル・インベストメント・グループは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません (以下同じ)。

(注3) 「投資信託受益証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

(注4) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

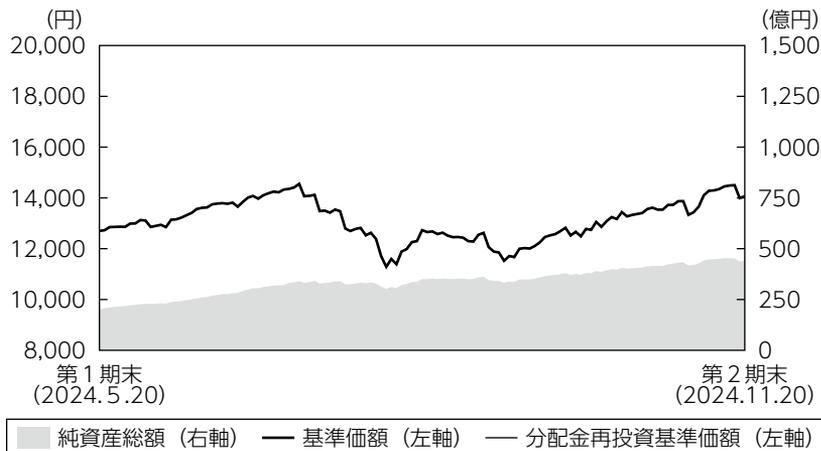
| 年月日 | 基準価額 | | Russell 1000 グロースインデックス (円換算ベース、配当込) | | 投資信託 組入比率 |
|---------------------|-------------|-----------|---|-----------|--------------|
| | 騰落率 | 騰落率 | (参考指数) | 騰落率 | |
| (期首) 2024年5月20日 | 円 12,699 | % - | ポイント 551,379.10 | % - | % 98.2 |
| 5月末 | 13,108 | 3.2 | 563,750.90 | 2.2 | 98.0 |
| 6月末 | 14,012 | 10.3 | 609,576.96 | 10.6 | 98.6 |
| 7月末 | 12,820 | 1.0 | 564,421.90 | 2.4 | 98.5 |
| 8月末 | 12,299 | △3.1 | 542,814.68 | △1.6 | 99.0 |
| 9月末 | 12,822 | 1.0 | 567,034.02 | 2.8 | 99.0 |
| 10月末 | 13,870 | 9.2 | 614,753.10 | 11.5 | 98.7 |
| (期末) 2024年11月20日 | 円 14,064 | % 10.7 | ポイント 623,494.57 | % 13.1 | % 98.9 |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 「投資信託受益証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

■当期の運用経過（2024年5月21日から2024年11月20日まで）

基準価額等の推移



第2期首：12,699円
 第2期末：14,064円
 (既払分配金0円)
 騰落率：10.7%
 (分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

米経済のソフトランディング期待やF R B（米連邦準備理事会）の利下げ、トランプ次期政権の経済政策への期待から米国株式市場が上昇したことが基準価額にプラスに寄与しました。セクター別では、情報技術や一般消費財・サービスセクターなどにおける保有銘柄の株価上昇がプラスに寄与しました。一方で、日銀の追加利上げへの警戒感やF R Bの利下げ観測などを背景に、為替市場では米ドルが円に対して下落し、マイナスに寄与しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|--|-------|
| フィデリティ・ブルーチップ・グロース・ファンド (適格機関投資家専用) | 12.8% |
| D I A Mマネーマザーファンド | 0.0% |

(注) フィデリティ・ブルーチップ・グロース・ファンド（適格機関投資家専用）の騰落率は、分配金を再投資したものとみなして計算したものです。

投資環境

米国株式市場は上昇しました。F R Bによる2024年9月の利下げ観測の強まりから、7月上旬にかけて上昇しました。7月中旬から8月上旬にかけては、米政府による対半導体輸出規制の強化観測や一部大手ハイテック企業の低調な決算、米景気後退懸念などを受けて、反落しました。その後期末にかけては、米景気のソフトランディング期待や、トランプ次期政権が打ち出す減税や規制緩和などの経済政策への期待から上昇基調となりました。

米ドルは円に対して下落しました。F R Bの利下げ観測や日銀の追加利上げ観測、米景気後退懸念などを背景に2024年7月中旬から8月上旬にかけて急速に米ドル安円高が進行しました。その後も、9月のF O M C（米連邦公開市場委員会）でF R Bが大幅利下げを決定したことを受け、9月中旬にかけても米ドル安円高となりました。しかし、米景気の想定以上の底堅さや財政悪化懸念から米長期金利が上昇に転じると、期末にかけては一転して米ドル高円安基調となりました。

国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは概ねプラス圏内で推移しました。日銀は2024年7月に政策金利を0.25%に引き上げましたが、同利回りの上昇は限定的に留まりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

フィデリティ・ブルーチップ・グロース・ファンド（適格機関投資家専用）の組入比率は高位を維持しました。また、D I A Mマネーマザーファンドへの投資を行いました。

●フィデリティ・ブルーチップ・グロース・ファンド（適格機関投資家専用）

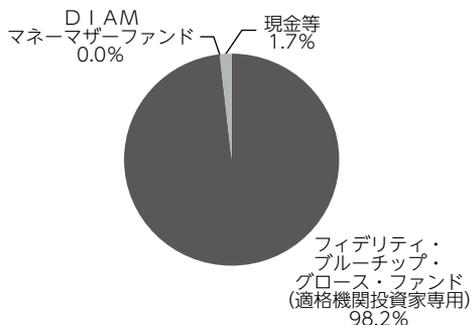
フィデリティ・ブルーチップ・グロース・マザーファンドを通じて、主として米国を中心とした世界の優良企業の株式に投資を行いました。市場平均を上回る成長力や持続可能なビジネスモデルを有し、財務的にも安定した優良企業だけでなく、将来世界をリードする優良企業に成長する可能性のある銘柄にも積極的に投資を行っており、セクター別では情報技術や一般消費財・サービス、コミュニケーション・サービスセクターの組入比率を高位としました。

●D I A Mマネーマザーファンド

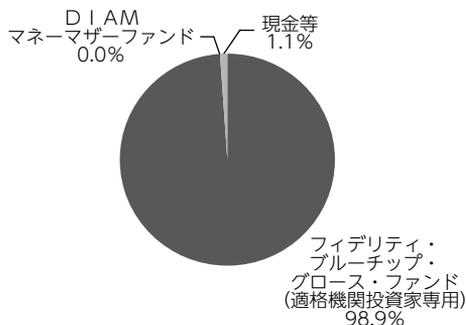
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

ポートフォリオ構成 ※比率は純資産総額に対する割合です。

期首（前期末）

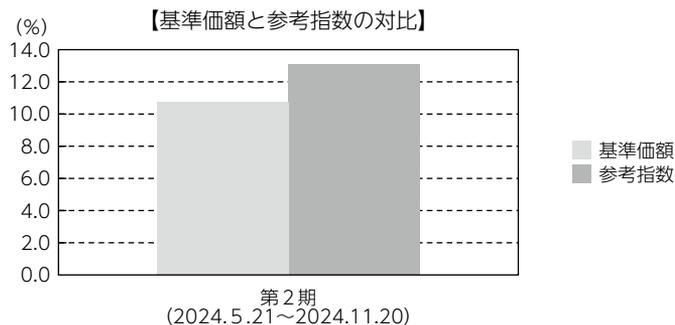


期末



参考指数との差異

当ファンドはベンチマークを定めておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数であるRussell 1000 グロースインデックス（円換算ベース、配当込）の騰落率の対比です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益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（1万口当たり）

| 項目 | 当期 |
|------------|----------------------------|
| | 2024年5月21日 ～2024年11月20日 |
| 当期分配金（税引前） | －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 | 4,063円 |

(注1) 「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」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。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「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・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、フィデリティ・ブルーチップ・グロース・ファンド（適格機関投資家専用）とD I A Mマネーマザーファンドに投資を行い、長期的な値上り益の獲得をめざして運用を行います。

●フィデリティ・ブルーチップ・グロース・ファンド（適格機関投資家専用）

米国のマクロ環境は引き続き良好で、企業業績も総じて成長が続くことが予想されています。経験と実行力がある経営陣、強固な財務基盤、優れたビジネスモデルを備える企業は、事業環境の変化に適応し、中長期的な成長機会を捉え、高い成長を実現すると見えています。引き続き、個別銘柄の調査分析を徹底して成長力の高い企業を選別し、フィデリティ・ブルーチップ・グロース・マザーファンドを通じて投資信託財産の長期的な成長を図る方針です。

●D I A Mマネーマザーファンド

日銀は2024年10月の金融政策決定会合で、政策金利を0.25%とする金融政策を維持しました。日銀は今後政策金利の引き上げを行うと見られますが、そのペースは緩やかなものになると想定され、金利は引き続き安定的に推移することが見込まれます。そのため、今後も公社債などへの投資を通じて、安定的な運用をめざします。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第2期 | | 項目の概要 |
|---------------------|------------------------------|------------------|--|
| | (2024年5月21日 ～2024年11月20日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 71円 | 0.543% | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は13,106円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (投信会社) | (23) | (0.172) | |
| (販売会社) | (47) | (0.360) | |
| (受託会社) | (1) | (0.011) | |
| (b) その他費用 (監査費用) | 0 (0) | 0.001 (0.001) | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 |
| 合計 | 71 | 0.545 | |

(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・解約によって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) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

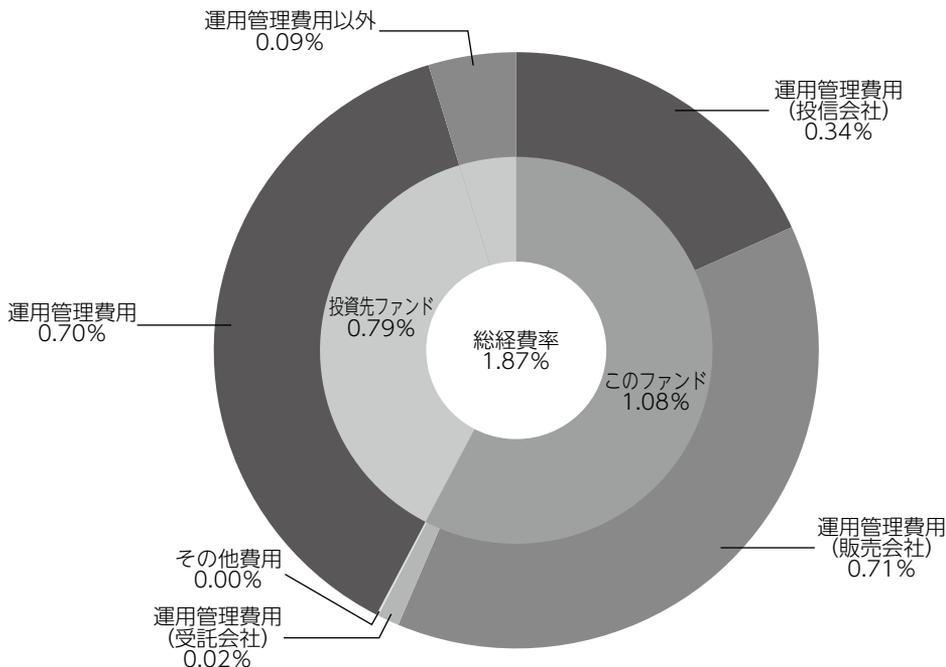
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（D I AMマネーマザーファンドを除く）が支払った費用を含みません。なお、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用については後掲の「組入ファンドの概要」をご参照ください。

(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総経費率（年率）は1.87%です。



| | |
|----------------------|-------|
| 総経費率 (①+②+③) | 1.87% |
| ①このファンドの費用の比率 | 1.08% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.70% |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.09% |

(注1) ①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、売買委託手数料およ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) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（DIAマネーマザーファンドを除く）です。なお、このファンドが組入れている投資信託証券が支払った費用については後掲の「組入ファンドの概要」をご参照ください。

(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) 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7) 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。

■売買及び取引の状況（2024年5月21日から2024年11月20日まで）

投資信託受益証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------------|---|----------------------|------------------|---------|---------|
| | | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 外国 邦 建 | ファイデリティ・ブルーチップ・グロース・ ファンド（適格機関投資家専用） | 千口 15,049,358.882 | 千円 20,220,000 | 千口 - | 千円 - |

(注) 金額は受渡代金です。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2024年5月21日から2024年11月20日まで）

期中の親投資信託受益証券の設定、解約はありません。

■利害関係人との取引状況等（2024年5月21日から2024年11月20日まで）

【One / ファイデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド（成長型）における利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 | 当 | | | 期 | | |
|----------|---------------|--------------------|------------|-----------|--------------------|--------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B / A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D / C |
| 投資信託受益証券 | 百万円 20,220 | 百万円 20,220 | % 100.0 | 百万円 - | 百万円 - | % - |

【D I AMマネーマザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 | 当 | | | 期 | | |
|-------|--------------|--------------------|-----------|--------------|--------------------|--------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B / A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D / C |
| 公 社 債 | 百万円 6,697 | 百万円 1,099 | % 16.4 | 百万円 1,019 | 百万円 - | % - |

平均保有割合 0.3%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行、みずほ証券です。

■組入資産の明細

(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 ア ン ド 名 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | |
|--|----------------|----------------|------------|------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千□ | 千□ | 千円 | % |
| フィデリティ・ブルーチップ・グロース・ファンド (適格機関投資家専用) | 15,359,788.231 | 30,409,147.113 | 43,588,471 | 98.9 |
| 合 計 | 15,359,788.231 | 30,409,147.113 | 43,588,471 | 98.9 |

(注) 比率欄は純資産総額に対する比率です。

(2) 親投資信託残高

| | 期 首 (前期末) | 当 期 末 | | |
|----------------------------|-----------|-------|-------|--|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 | |
| | 千□ | 千□ | 千円 | |
| D I A M マ ネ ー マ ザ ー ファ ン ド | 9,943 | 9,943 | 9,999 | |

■投資信託財産の構成

2024年11月20日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資信託受益証券 | 43,588,471 | 98.2 |
| D I A M マネーマザーファンド | 9,999 | 0.0 |
| コール・ローン等、その他 | 779,139 | 1.8 |
| 投資信託財産総額 | 44,377,610 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年11月20日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 44,377,610,238円 |
| コール・ローン等 | 779,139,761 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 43,588,471,471 |
| D I A M マネーマザーファンド(評価額) | 9,999,006 |
| (B) 負 債 | 303,537,283 |
| 未払解約金 | 112,717,220 |
| 未払信託報酬 | 190,342,389 |
| その他未払費用 | 477,674 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 44,074,072,955 |
| 元 本 | 31,338,441,353 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 12,735,631,602 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 31,338,441,353口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 14,064円 |

(注) 期首における元本額は15,835,445,516円、当期中における追加設定元本額は17,582,591,880円、同解約元本額は2,079,596,043円です。

■損益の状況

当期 自2024年5月21日 至2024年11月20日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 446,486円 |
| 受 取 利 息 | 446,486 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 3,515,936,041 |
| 売 益 | 3,657,868,481 |
| 売 買 損 益 | △141,932,440 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △190,820,063 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 3,325,562,464 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 2,401,107,014 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 7,008,962,124 |
| (配 当 等 相 当 額) | (2,740,403,319) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (4,268,558,805) |
| (G) 合 計 (D + E + F) | 12,735,631,602 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G) | 12,735,631,602 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 7,008,962,124 |
| (配 当 等 相 当 額) | (2,740,403,375) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (4,268,558,749) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 5,726,669,478 |

(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) (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4) 分配金の計算過程

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 432,059円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 3,325,130,405 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 7,008,962,124 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 2,401,107,014 |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 12,735,631,602 |
| (f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 4,063.90 |
| (g) 分 配 金 | 0 |
| (h) 1 万 口 当 た り 分 配 金 | 0 |

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■信託報酬を年率1.078%（税抜0.98%）に引き下げる変更を行いました。

（2024年10月31日）

■当ファンドが投資対象とするフィデリティ・ブルーチップ・グロース・ファンド（適格機関投資家専用）の信託報酬を年率0.649%（税抜0.59%）に引き下げる変更を行いました。

（2024年10月31日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のお引き立てにあずかり、厚くお礼申し上げます。
さて、「フィデリティ・ブルーチップ・グロース・ファンド(適格機関投資家専用)」は、第1期の決算を行いました。当ファンドは、主として米国を中心に世界(日本を含みます。)の金融商品取引所に上場されている優良企業の株式に投資を行ない、投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行いました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

運用報告書
(全体版)

第1期(決算日 2024年5月20日)
計算期間(2023年12月13日～2024年5月20日)

■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 | 原則無期限(2023年12月13日設定) |
| 運用方針 | <ul style="list-style-type: none">●フィデリティ・ブルーチップ・グロース・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国を中心に世界(日本を含みます。)の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている優良企業の株式を主要な投資対象とし、投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行ないます。●FIAM LLCに、運用の指図に関する権限を委託します。 |
| 主要運用対象 | <p>ベビーファンド</p> <p>フィデリティ・ブルーチップ・グロース・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。</p> <p>マザーファンド</p> <p>米国を中心に世界(日本を含みます。)の金融商品取引所に上場されている株式を主要な投資対象とします。</p> |
| 組入制限 | <p>ベビーファンド</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>マザーファンド</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> |
| 分配方針 | <p>毎決算時(原則5月20日。同日が休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の収益分配方針に基づき分配を行ないます。</p> <ul style="list-style-type: none">●分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。●収益分配金額は、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、必ず分配を行なうものではありません。●留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行ないます。 |

(お問合せ先)

フィデリティ投信株式会社 カスタマー・コミュニケーション部
東京都港区六本木七丁目7番7号 TRI-SEVEN ROPPONGI

 0120-00-8051 (無料)

受付時間: 営業日の午前9時～午後5時

 <https://www.fidelity.co.jp/>

お客様の口座内容などに関するご照会は、お申し込みされた販売会社にお尋ねください。

フィデリティ・ブルーチップ・グロース・ファンド
(適格機関投資家専用)

フィデリティ投信株式会社



■設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | (参考指数) [※] | | 株式組入比率等 | 株式先物比率 | 投資信託受益証券組入比率 | 投資証券組入比率 | 純資産総額 |
|----------------------|--------|---|------|---------------------|------|---------|--------|--------------|----------|--------|
| | (分配) 税 | 達 | 期中 | Russell 1000グロース | 期中 | | | | | |
| | 分配金 | 騰 | 落 | インデックス (税引前) | 騰 | | | | | |
| | 円 | 率 | 率 | 配当金込/円ベース) | 落 | % | % | % | % | 百万円 |
| (設定日) 2023年12月13日 | 10,000 | — | — | 445,566.56 | — | — | — | — | — | 2,340 |
| 1期 (2024年5月20日) | 12,891 | 0 | 28.9 | 555,175.38 | 24.6 | 91.2 | — | 8.0 | 0.2 | 27,181 |

※当ファンドは、ベンチマークを設定していません。参考指数としてRussell 1000グロースインデックス(税引前配当金込/円ベース)を記載しております。

フィデリティ・ブルーチップ・グロース・ファンド(適格機関投資家専用)(以下「本ファンド」)の開発は、フィデリティ投信株式会社のみにより行われています。London Stock Exchange Group plcおよびそのグループ会社(以下総称して「LSE グループ」)は、いかなる形においても、本ファンドとの関係を有さず、またスポンサー、保証、販売もしくは販売促進を行うものではありません。FTSE Russellは、特定のLSE グループ会社の取引名です。

本インデックスにかかるすべての権利は、インデックスを保有する該当LSE グループ会社に帰属します。「Russell®」は、該当するLSE グループ会社の商標であり、ライセンス契約に基づき、他のあらゆるLSE グループ会社が使用します。

本インデックスは、FTSE International Limitedまたはその関連会社、代理人もしくはパートナーによって、またはこれらからの委託を受けて算出されています。LSE グループは、(a)本インデックスの使用、本インデックスへの依拠もしくは本インデックスの誤り、または(b)本ファンドへの投資もしくはその運用から生じる、いかなる者に対する責任も負うものではありません。LSE グループは、本ファンドから得られる結果、またはフィデリティ投信株式会社による提供の目的に対する本インデックスの適切性のいづれについても、主張、予想、保証、表明を行わないものとします。

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率等」「株式先物比率」「投資信託受益証券組入比率」「投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

(注3) (設定日)参考指数はファンド設定日前営業日(2023年12月12日)の値です。

(注4) 新株予約権証券の組入がある場合には、「株式組入比率等」に含みます。

(注5) 株式先物比率=買建比率-売建比率

■当期中の基準価額と市況等の推移

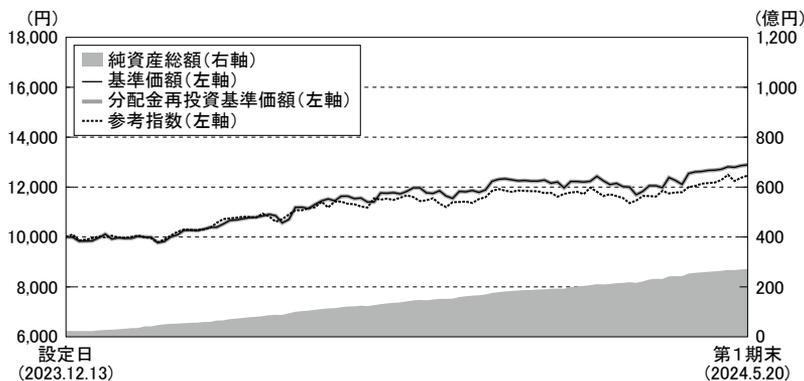
| 年月日 | 基準価額 | | (参考指数) | | 株式組入比率等 | 株式先物比率 | 投資信託受益証券組入比率 | 投資証券組入比率 |
|----------------------|------|---|------------------|------|---------|--------|--------------|----------|
| | 騰 | 落 | Russell 1000グロース | 騰 | | | | |
| | 率 | 率 | インデックス (税引前) | 落 | | | | |
| | % | % | 配当金込/円ベース) | 率 | % | % | % | % |
| (設定日) 2023年12月13日 | — | — | 445,566.56 | — | — | — | — | — |
| 12月末 | △0.1 | — | 443,429.03 | △0.5 | 100.4 | — | 13.0 | 0.1 |
| 2024年1月末 | 8.5 | — | 472,818.33 | 6.1 | 88.7 | — | 13.2 | 0.1 |
| 2月末 | 17.3 | — | 515,757.43 | 15.8 | 88.8 | — | 12.5 | 0.2 |
| 3月末 | 22.4 | — | 527,414.55 | 18.4 | 86.9 | — | 13.5 | 0.2 |
| 4月末 | 23.8 | — | 523,356.38 | 17.5 | 89.4 | — | 11.3 | 0.1 |
| (期末) 2024年5月20日 | 28.9 | — | 555,175.38 | 24.6 | 91.2 | — | 8.0 | 0.2 |

(注1) 騰落率は設定日比です。

(注2) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

■運用経過の説明

●基準価額等の推移



設定日:10,000円

第1期末:12,891円(既払分配金0円)

騰落率:28.9%(分配金再投資ベース)

(注1)分配金再投資基準価額および参考指数は、当ファンドの設定日(2023年12月13日)を起点として計算しています。

(注2)設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

*分配金再投資基準価額は、税引前の分配金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。

※参考指数は「Russell 1000グロースインデックス(税引前配当金込/円ベース)」です。

●基準価額の主な変動要因

当期の当ファンドの騰落率は、+28.9%でした。

<プラス要因>

米国株式相場が上昇したこと。

米ドルが対円で上昇し、円安となったこと。

<マイナス要因>

特になし。

●投資環境

期初は、年末にかけて金融政策は利上げ局面が終了し、2024年には利下げに転じるとの楽観的な見方が台頭し、上昇しました。1月は、AIが本格的に普及していくとの観測から大手テクノロジー銘柄などがけん引して、株価は上昇となりました。2月は、インフレは落ち着きの傾向が続いていることが、市場の安心材料となりました。一方で、度重なる値上げを受けて、消費者の購買意欲は後退しました。3月は、就業者数は引き続き増加傾向である一方、平均時給の伸びは鈍化し、雇用環境の過熱感は徐々に和らいていることが好感され、株価は上昇しました。4月から期末にかけては、株価が高値を更新してきたことや混迷が続く中東情勢などを受けて、利益を確定する動きが広がりました。その一方で、企業の業績は今後の増益基調が期待される中、市場では米国の景気は過熱せず、大きく後退することも回避するとの見方が広まり、一進一退の動きとなりました。当期の米ドル／円相場は、円安・米ドル高でした。

●ポートフォリオ

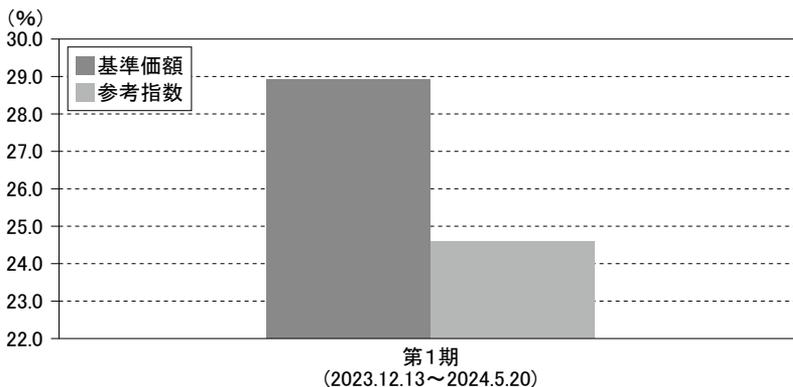
当ファンドは、主として、米国を中心に世界(日本を含みます。)の金融商品取引所に上場(これに準ずると委託会社が判断したものを含みます。(*1))されている優良企業の株式に実質的に投資を行い、長期的な値上り益を獲得することをめざした運用を行いました。

(*1)米国の店頭市場登録の銘柄を組入れることがあります。

●ベンチマークとの差異

当ファンドは、ベンチマークを設定していません。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。

当ファンドの基準価額と参考指数の対比(期別騰落率)



(注)基準価額の騰落率は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算しています。

※参考指数は「Russell 1000グロスインデックス(税引前配当金込／円ベース)」です。

■分配金

当期の分配金は、長期的な投資信託財産の成長を追求する観点から無分配とさせていただきました。また、収益分配に充てなかった利益につきましては投資信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

●分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり・税引前)

| 項目 | 第1期 |
|-----------|------------------------|
| | 2023年12月13日～2024年5月20日 |
| 当期分配金 | 0 |
| (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 | 2,891 |

- * 「当期の収益」および「当期の収益以外」は円未満切捨てのため、合計額が「当期分配金」と一致しない場合があります。
- * 当期分配金の「対基準価額比率」は当期分配金(税引前)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。
- * 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」が当該決算期末日時点の基準価額を上回ることがありますが、実際には基準価額を超えて分配金が支払われることはありません。

■今後の運用方針

経済環境は変遷しますが、優れた企業は事業環境の変化に順応しています。経験と実行力ある経営陣、強固な財務基盤、優れたビジネスモデルを備える企業には、市場をリードして高い成長を実現することが期待されます。市場の先行きは不透明な反面、中長期的に大きく成長する企業を見極める絶好の機会と捉えております。引き続き個別銘柄の調査分析を徹底し、成長力の高い企業を選別して、長期的な運用成果の達成を目指します。

■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用明細

| 項目 | 第1期 | | 項目の概要 |
|---|---------------------------|---|--|
| | 2023年12月13日～2024年5月20日 | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社) | 36円 (34) (1) (1) | 0.312% (0.298) (0.005) (0.010) | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,444円です。 委託した資金の運用の対価 購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口内でのファンドの 管理及び事務手続き等の対価 運用財産の保管・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 (株式) (投資信託受益証券) (投資証券) | 2 (2) (0) (0) | 0.017 (0.016) (0.001) (0.000) | (b) 売買委託手数料＝ $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権総口数}}$ 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) | 0.004 (0.004) | (c) 有価証券取引税＝ $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 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) | 4 (4) (0) (－) | 0.039 (0.038) (0.001) (－) | (d) その他費用＝ $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 保管費用は、有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等のために、海外 における保管銀行等に支払う費用。また、信託事務の諸費用等が含まれます。 監査費用は、ファンドの監査人等に対する報酬及び費用 その他には、法定書類等(有価証券届出書、目論見書、運用報告書等)の作成、 印刷、提出等に係る費用や法律顧問、税務顧問に対する報酬及び費用等が含ま れます。 |
| 合計 | 43 | 0.373 | |

(注1) 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、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、このファンドが組み入れている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まず。

(注2) 「金額」欄は、各項目毎に円未満を四捨五入しています。

(注3) 「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。

■ 親投資信託受益証券の設定、解約状況 (2023年12月13日から2024年5月20日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|----------------------------|------------------|------------------|--------------|--------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| フィデリティ・ブルーチップ・グロース・マザーファンド | 千口 21,057,831 | 千円 23,667,000 | 千口 35,114 | 千円 44,398 |

(注) 金額の単位未満は切捨て。

■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 | |
|-------------------------------|----------------------------|--|
| | フィデリティ・ブルーチップ・グロース・マザーファンド | |
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 22,840,638千円 | |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 12,443,819千円 | |
| (c) 売 買 高 比 率(a)/(b) | 1.83 | |

(注1) 売買高比率は小数点以下2位未満切捨て。

(注2) 期中の株式売買金額には、増資、配当株式等は含まれておりません。なお、単位未満は切捨て。

(注3) 期中の平均組入株式時価総額は、月末に残高がない月数を除いた単純平均とし、単位未満は切捨て。

(注4) 外貨建株式の邦貨換算は、期中の株式売買金額、期中の平均組入株式時価総額とも各月末(決算日の属する月については決算日)の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

■利害関係人との取引状況等 (2023年12月13日から2024年5月20日まで)

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 (2024年5月20日現在)

●親投資信託残高

| 種 類 | 当 期 末 | |
|----------------------------|------------------|------------------|
| | 口 数 | 評 価 額 |
| フィデリティ・ブルーチップ・グロース・マザーファンド | 千口 21,022,716 | 千円 27,180,270 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成 (2024年5月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|----------------------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| フィデリティ・ブルーチップ・グロース・マザーファンド | 千円 27,180,270 | % 99.8 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 44,398 | 0.2 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 27,224,669 | 100.0 |

(注1) 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、5月20日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=155.91円、1カナダ・ドル=114.58円、1香港・ドル=19.98円、1イギリス・ポンド=198.10円、1スイス・フラン=171.46円、1インド・ルピー=1.88円、1ユーロ=169.57円です。

(注2) フィデリティ・ブルーチップ・グロース・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(26,994,446千円)の投資信託財産総額(27,328,173千円)に対する比率は、98.8%です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年5月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 27,224,669,615 |
| フィデリティ・ブルーチップ・グ ロース・マザーファンド(評価額) | 27,180,270,619 |
| 未 収 入 金 | 44,398,996 |
| (B) 負 債 | 43,576,444 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 43,438,075 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 138,369 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 27,181,093,171 |
| 元 本 | 21,084,988,669 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 6,096,104,502 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 21,084,988,669口 |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D) | 12,891円 |

(注1) 当期における期首元本額は2,340,000,000円、期中追加設定元本額は18,744,988,669円、期中一部解約元本額0円です。

(注2) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

■損益の状況

当期 自2023年12月13日 至2024年5月20日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|-----------------|
| (A) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 3,557,669,551 |
| 売 買 損 益 | 3,557,669,551 |
| (B) 信 託 報 酬 等 | △43,576,444 |
| (C) 当 期 損 益 金(A+B) | 3,514,093,107 |
| (D) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 2,582,011,395 |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (2,582,011,395) |
| (E) 合 計(C+D) | 6,096,104,502 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(E) | 6,096,104,502 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 2,582,011,395 |
| (配 当 等 相 当 額) | (6,502,705) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (2,575,508,690) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 3,514,093,107 |

(注1) (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2) (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せん。

(注3) (D)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4) 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する費用として、純資産総額に対して年0.31%以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

(注5) 分配金の計算過程は以下の通りです。

| | 当 期 |
|----------------------------------|----------------|
| (a) 費用控除後の配当等収益 | 32,414,501円 |
| (b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の 有価証券売買等損益 | 3,481,678,606円 |
| (c) 収益調整金 | 2,582,011,395円 |
| (d) 分配準備積立金 | 0円 |
| (e) 分配可能額(a+b+c+d) | 6,096,104,502円 |
| 1 万 口 当 ち 分 配 可 能 額 | 2,891.21円 |
| (f) 分配金額 | 0円 |
| 1 万 口 当 ち 分 配 金 額(税引前) | 0円 |

フィデリティ・ブルーチップ・グロース・マザーファンド 運用報告書

《第1期》

決算日 2024年5月20日

(計算期間：2023年12月13日から2024年5月20日まで)

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | <ul style="list-style-type: none">●主として米国を中心に世界(日本を含みます。)の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている優良企業の株式を主要な投資対象とし、投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行いません。●FIAM LLCに、運用の指図に関する権限を委託します。 |
| 主要運用対象 | 米国を中心に世界(日本を含みます。)の金融商品取引所に上場されている株式を主要な投資対象とします。 |
| 組入制限 | 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 株式への投資割合には制限を設けません。 |

■設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | (参考指数) [※] | | 株式組入比率等 | 株式先物比率 | 投資信託受益証券組入比率 | 投資証券組入比率 | 純資産総額 |
|----------------------|-------------|--------------------------------------|---------------------|--------|---------|--------|--------------|----------|--------------|
| | 期騰落率 | Russell 1000グロースインデックス(税引前配当金込/円ベース) | 期騰落率 | | | | | | |
| (設定日) 2023年12月13日 | 円 10,000 | % — | 445,566.56 | % — | % — | % — | % — | % — | 百万円 2,340 |
| 1期(2024年5月20日) | 12,929 | 29.3 | 555,175.38 | 24.6 | 91.2 | — | 8.0 | 0.2 | 27,179 |

※当ファンドは、ベンチマークを設定していません。参考指数としてRussell 1000グロースインデックス(税引前配当金込/円ベース)を記載しております。

フィデリティ・ブルーチップ・グロース・ファンド(適格機関投資家専用)(以下「本ファンド」)の開発は、フィデリティ投信株式会社のみにより行われています。London Stock Exchange Group plcおよびそのグループ会社(以下総称して「LSEグループ」)は、いかなる形においても、本ファンドとの関係を有さず、またスポンサー、保証、販売もしくは販売促進を行うものではありません。FTSE Russellは、特定のLSEグループ会社の取引名です。

本インデックスにかかるすべての権利は、インデックスを保有する該当LSEグループ会社に帰属します。「Russell」は、該当するLSEグループ会社の商標であり、ライセンス契約に基づき、他のあらゆるLSEグループ会社が使用します。

本インデックスは、FTSE International Limitedまたはその関連会社、代理人もしくはパートナーによって、またはこれらからの委託を受けて算出されています。LSEグループは、(a)本インデックスの使用、本インデックスへの依拠もしくは本インデックスの誤り、または(b)本ファンドへの投資もしくはその運用から生じる、いかなる者に対する責任も負うものではありません。LSEグループは、本ファンドから得られる結果、またはフィデリティ投信株式会社による提供の目的に対する本インデックスの適切性のいずれについても、主張、予想、保証、表明を行わないものとします。

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

(注2) (設定日)参考指数はファンド設定日前営業日(2023年12月12日)の値です。

(注3) 新株予約権証券の組入がある場合には、「株式組入比率等」に含まれます。

(注4) 株式先物比率=買建比率-売建比率

■当期中の基準価額と市況等の推移

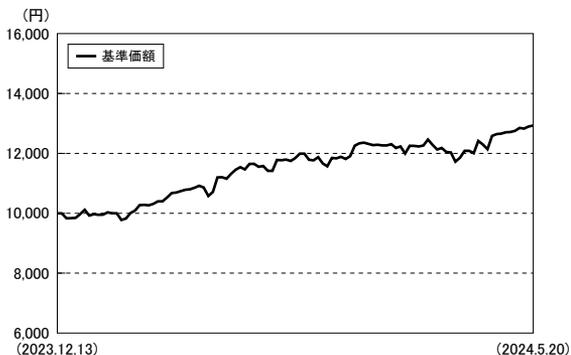
| 年月日 | 基準価額 | | (参考指数) | | 株式組入比率等 | 株式先物比率 | 投資信託受益証券組入比率 | 投資証券組入比率 |
|----------------------|-------------|--------------------------------------|------------|--------|---------|--------|--------------|----------|
| | 騰落率 | Russell 1000グロースインデックス(税引前配当金込/円ベース) | 騰落率 | | | | | |
| (設定日) 2023年12月13日 | 円 10,000 | % — | 445,566.56 | % — | % — | % — | % — | % — |
| 12月末 | 9,998 | △0.0 | 443,429.03 | △0.5 | 100.4 | — | 13.0 | 0.1 |
| 2024年1月末 | 10,862 | 8.6 | 472,818.33 | 6.1 | 88.6 | — | 13.2 | 0.1 |
| 2月末 | 11,745 | 17.5 | 515,757.43 | 15.8 | 88.8 | — | 12.5 | 0.2 |
| 3月末 | 12,264 | 22.6 | 527,414.55 | 18.4 | 86.8 | — | 13.4 | 0.2 |
| 4月末 | 12,414 | 24.1 | 523,356.38 | 17.5 | 89.2 | — | 11.3 | 0.1 |
| (期末) 2024年5月20日 | 12,929 | 29.3 | 555,175.38 | 24.6 | 91.2 | — | 8.0 | 0.2 |

(注1) 騰落率は設定日比です。

(注2) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

■運用経過の説明

●基準価額の推移



●基準価額の主な変動要因

当期の当ファンドの騰落率は、+29.3%でした。

<プラス要因>

米国株式相場が上昇したこと。

米ドルが対円で上昇し、円安となったこと。

<マイナス要因>

特になし。

●投資環境

期初は、年末にかけて金融政策は利上げ局面が終了し、2024年には利下げに転じるとの楽観的な見方が台頭し、上昇しました。1月は、AIが本格的に普及していくとの観測から大手テクノロジー銘柄などがけん引して、株価は上昇となりました。2月は、インフレは落ち着いた傾向が続いていることが、市場の安心材料となりました。一方で、度重なる値上げを受けて、消費者の購買意欲は後退しました。3月は、就業者数は引き続き増加傾向である一方、平均時給の伸びは鈍化し、雇用環境の過熱感は徐々に和らいでいることが好感され、株価は上昇しました。4月から期末にかけては、株価が高値を更新してきたことや混迷が続く中東情勢などを受けて、利益を確定する動きが広がりました。その一方で、企業の業績は今後の増益基調が期待される中、市場では米国の景気は過熱せず、大きく後退することも回避するとの見方が広まり、一進一退の動きとなりました。当期の米ドル/円相場は、円安・米ドル高でした。

●ポートフォリオ

当ファンドは、主として、米国を中心に世界(日本を含みます。)の金融商品取引所に上場(これに準ずると委託会社が判断したものを含みます。(*1))されている優良企業の株式に実質的に投資を行い、長期的な値上り益を獲得することをめざした運用を行いました。

(*1)米国の店頭市場登録の銘柄を組入れることがあります。

■今後の運用方針

経済環境は変遷しますが、優れた企業は事業環境の変化に順応しています。経験と実行力ある経営陣、強固な財務基盤、優れたビジネスモデルを備える企業には、市場をリードして高い成長を実現することが期待されます。市場の先行きは不透明な反面、中長期的に大きく成長する企業を見極める絶好の機会と捉えております。引き続き個別銘柄の調査分析を徹底し、成長力の高い企業を選別して、長期的な運用成果の達成を目指します。

■ 1 万口（元本10,000円）当たりの費用明細

（2023年12月13日～2024年5月20日）

| 項目 | 金額 |
|-------------|-----|
| (a) 売買委託手数料 | 2円 |
| （株式） | (2) |
| （投資信託受益証券） | (0) |
| （投資証券） | (0) |
| (b) 有価証券取引税 | 0 |
| （株式） | (0) |
| (c) その他費用 | 4 |
| （保管費用） | (4) |
| 合計 | 7 |

（注）費用明細の項目の概要および注記については、前述の「1 万口（元本10,000円）当たりの費用明細」をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況（2023年12月13日から2024年5月20日まで）

(1) 株 式

| | 買 付 | | 売 付 | |
|------|----------------------|-----------------------------|--------|-------------------|
| | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国内 | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| 上場 | 0.01 (-) | 357 (-) | 0.01 | 393 |
| 未上場 | - | - | - | - |
| 外国 | 百株 | | 百株 | |
| アメリカ | 11,293.83 (35.27) | 千アメリカ・ドル 145,630 (△0) | 582.98 | 千アメリカ・ドル 3,573 |
| カナダ | 180.2 (-) | 千カナダ・ドル 874 (-) | - | 千カナダ・ドル - |
| 香港 | 57.3 (-) | 千香港・ドル 364 (-) | - | 千香港・ドル - |
| イギリス | 471.77 (-) | 千イギリス・ポンド 164 (-) | 465.3 | 千イギリス・ポンド 61 |
| スイス | 11.92 (-) | 千スイス・フラン 117 (-) | 0.46 | 千スイス・フラン 10 |
| インド | 602.74 (-) | 千インド・ルピー 33,666 (-) | - | 千インド・ルピー - |
| ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| オランダ | 59.51 (-) | 197 (-) | 3.15 | 46 |
| ベルギー | 3.5 (-) | 43 (-) | - | - |

| | 買 付 | | 売 付 | |
|------|-------------|------------|------|-----|
| | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外国 | 百株 | | 百株 | |
| ユーロ | 千ユーロ | | 千ユーロ | |
| フランス | 4.71 (-) | 448 (-) | - | - |
| ドイツ | 4.61 (-) | 96 (-) | - | - |
| その他 | 24 (-) | 33 (-) | - | - |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は増資割当、株式転換・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。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託受益証券、投資証券

| | 買 付 | | 売 付 | |
|-----------------------------|---------------|---------------|--------------|--------------|
| | 単位数又は口数 | 金 額 | 単位数又は口数 | 金 額 |
| 外国 | 千口 | | 千口 | |
| (アメリカ) | 千アメリカ・ドル | | 千アメリカ・ドル | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 0.249 (-) | 36 (-) | 0.249 (-) | 34 (-) |
| WELLTOWER INC | 2.608 (-) | 239 (-) | - (-) | - (-) |
| Invesco QQQ Trust Series 1 | 15.262 (-) | 6,548 (-) | 9.405 (-) | 4,044 (-) |
| ISHARES TR RUS 1000 GRW ETF | 44.016 (-) | 14,059 (-) | 11.19 (-) | 3,754 (-) |
| PROLOGIS INC | 0.106 (-) | 13 (-) | 0.106 (-) | 11 (-) |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付()内は分割割当、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。

(注3) 売付()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

■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 | 22,840,638千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 12,443,819千円 |
| (c) 売 買 高 比 率(a)／(b) | 1.83 |

(注1) 売買高比率は小数点以下2位未満切捨て。

(注2) 期中の株式売買金額には、増資、配当株式等は含まれておりません。なお、単位未満は切捨て。

(注3) 期中の平均組入株式時価総額は、月末に残高がない月数を除いた単純平均とし、単位未満は切捨て。

(注4) 外貨建株式の邦貨換算は、期中の株式売買金額、期中の平均組入株式時価総額とも各月末(決算日の属する月については決算日)の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

■当期中の主要な売買銘柄 (2023年12月13日から2024年5月20日まで)

●株 式

| 買 付 | | | | 当 期 | | | | 売 付 | | | |
|-------------------------|--------|-----------|---------|--------------------------------|-------|--------|--------|-----|--|--|--|
| 銘 柄 | 株 数 | 金 額 | 平均単価 | 銘 柄 | 株 数 | 金 額 | 平均単価 | | | | |
| | 千株 | 千円 | 円 | | 千株 | 千円 | 円 | | | | |
| APPLE INC | 87.115 | 2,408,208 | 27,644 | DOLLAR TREE INC | 2.065 | 39,169 | 18,968 | | | | |
| MICROSOFT CORP | 38.314 | 2,306,965 | 60,212 | ALIBABA GROUP HLD LTD SPON ADR | 2.904 | 32,668 | 11,249 | | | | |
| AMAZON COM INC | 84.759 | 2,119,211 | 25,002 | HESS CORP | 1.45 | 31,522 | 21,739 | | | | |
| NVIDIA CORP | 17.747 | 1,780,449 | 100,323 | VERTEX PHARMCEUTICALS INC | 0.487 | 31,178 | 64,021 | | | | |
| ALPHABET INC CL A | 66.233 | 1,452,894 | 21,936 | FREEPORT MCMORAN INC | 3.942 | 22,694 | 5,757 | | | | |
| META PLATFORMS INC CL A | 20.909 | 1,364,458 | 65,257 | HUMANA INC | 0.388 | 21,179 | 54,586 | | | | |
| ELI LILLY & CO | 6.111 | 634,419 | 103,815 | REDDIT INC A | 2.18 | 17,561 | 8,055 | | | | |
| NETFLIX INC | 5.967 | 495,586 | 83,054 | KENVUE INC | 5.63 | 16,677 | 2,962 | | | | |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 44.739 | 459,663 | 10,274 | INSPIRE MEDICAL SYSTEMS INC | 0.578 | 16,336 | 28,264 | | | | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 5.495 | 413,946 | 75,331 | SWEETGREEN INC CL A | 3.16 | 15,620 | 4,943 | | | | |

(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 (2023年12月13日から2024年5月20日まで)

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 (2024年5月20日現在)

(1) 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・・・ロンドン) | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| RELIANCE INDS GDR | 100.13 | 685 | 106,937 | エネルギー |
| (アメリカ・・・NASDAQ) | | | | |
| ADOBE INC | 3.52 | 170 | 26,530 | ソフトウェア・サービス |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC | 35.1 | 577 | 90,005 | 半導体・半導体製造装置 |
| APPLE INC | 871.15 | 16,540 | 2,578,833 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| APPLIED MATERIALS INC | 3.52 | 74 | 11,639 | 半導体・半導体製造装置 |
| CADENCE DESIGN SYSTEMS INC | 0.31 | 8 | 1,395 | ソフトウェア・サービス |
| INTUIT INC | 8.11 | 536 | 83,601 | ソフトウェア・サービス |
| LAM RESEARCH CORP | 1.56 | 142 | 22,183 | 半導体・半導体製造装置 |
| MICROSOFT CORP | 383.14 | 16,099 | 2,510,139 | ソフトウェア・サービス |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 39.91 | 500 | 77,960 | 半導体・半導体製造装置 |
| PENN ENTERTAINMENT INC | 102.32 | 162 | 25,412 | 消費者サービス |
| PEPSICO INC | 8 | 145 | 22,724 | 食品・飲料・タバコ |
| REGENERON PHARMACEUTICALS INC | 11.35 | 1,114 | 173,823 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| STARBUCKS CORP | 64.44 | 501 | 78,214 | 消費者サービス |
| SYNOPSYS INC | 2.15 | 121 | 18,997 | ソフトウェア・サービス |
| TERADYNE INC | 34.13 | 450 | 70,192 | 半導体・半導体製造装置 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 23.03 | 166 | 25,888 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ASML HLDG NV (NY REG SHS) NEW | 3.82 | 353 | 55,089 | 半導体・半導体製造装置 |
| AMAZON COM INC | 847.59 | 15,654 | 2,440,769 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| NVIDIA CORP | 176.77 | 16,347 | 2,548,740 | 半導体・半導体製造装置 |
| THE BOOKING HOLDINGS INC | 0.04 | 14 | 2,312 | 消費者サービス |
| MARRIOTT INTERNATIONAL INC A | 13.22 | 314 | 48,999 | 消費者サービス |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 1.04 | 82 | 12,903 | 生活必需品流通・小売り |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | 3.02 | 44 | 6,961 | メディア・娯楽 |
| SYNAPTICS INC | 2.1 | 19 | 3,093 | 半導体・半導体製造装置 |
| LIGHT & WONDER INC CL A | 9.16 | 85 | 13,298 | 消費者サービス |
| NETFLIX INC | 59.67 | 3,706 | 577,818 | メディア・娯楽 |
| ON SEMICONDUCTOR CORP | 122.13 | 893 | 139,325 | 半導体・半導体製造装置 |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 3.41 | 135 | 21,203 | ヘルスケア機器・サービス |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 7.28 | 108 | 16,957 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CROCS INC | 29.02 | 409 | 63,772 | 耐久消費財・アパレル |
| DEXCOM INC | 58.14 | 763 | 119,072 | ヘルスケア機器・サービス |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 40.1 | 1,343 | 209,410 | 耐久消費財・アパレル |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 28.72 | 768 | 119,877 | 半導体・半導体製造装置 |
| TESLA INC | 74.29 | 1,318 | 205,544 | 自動車・自動車部品 |
| FIVE BELOW INC | 21.76 | 299 | 46,661 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 26.24 | 518 | 80,868 | エネルギー |
| ZILLOW GROUP INC CL C | 24.52 | 108 | 16,859 | 不動産管理・開発 |
| ALPHABET INC CL A | 662.33 | 11,660 | 1,818,063 | メディア・娯楽 |
| OKTA INC CL A | 53.84 | 554 | 86,426 | ソフトウェア・サービス |
| MONGODB INC CL A | 6.6 | 244 | 38,157 | ソフトウェア・サービス |
| BROADCOM INC | 3.83 | 534 | 83,317 | 半導体・半導体製造装置 |
| PDD HOLDINGS INC ADR | 38.4 | 561 | 87,523 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| VIKING THERAPEUTICS INC | 12.59 | 84 | 13,151 | 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 | |
| | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| MODERNA INC | 10.56 | 140 | 21,880 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LYFT INC | 19.45 | 32 | 5,039 | 運輸 |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC | 27.9 | 179 | 27,908 | ソフトウェア・サービス |
| DATADOG INC CL A | 17.95 | 215 | 33,602 | ソフトウェア・サービス |
| LEGEND BIOTECH CORP SPON ADR | 12.35 | 55 | 8,695 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AVIDITY BIOSCIENCES | 6 | 17 | 2,759 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DOORDASH INC | 7.43 | 87 | 13,603 | 消費者サービス |
| AIRBNB INC CLASS A | 64.54 | 940 | 146,569 | 消費者サービス |
| ACV AUCTIONS INC CL A | 64.58 | 120 | 18,747 | 商業・専門サービス |
| MARVELL TECHNOLOGY INC | 11.06 | 79 | 12,401 | 半導体・半導体製造装置 |
| CELSIUS HOLDINGS INC | 91.84 | 854 | 133,193 | 食品・飲料・タバコ |
| DUOLINGO INC | 3.52 | 63 | 9,831 | 消費者サービス |
| GLOBALFOUNDRIES INC | 149.5 | 806 | 125,749 | 半導体・半導体製造装置 |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC | 245.17 | 257 | 40,135 | 自動車・自動車部品 |
| CONSTELLATION ENERGY CORP | 2.2 | 46 | 7,309 | 公益事業 |
| TRANSMEDICS GROUP INC | 3.45 | 47 | 7,421 | ヘルスケア機器・サービス |
| DRAFTKINGS HOLDINGS INC | 46.44 | 205 | 32,010 | 消費者サービス |
| APPROVIN CORP | 11.43 | 94 | 14,700 | ソフトウェア・サービス |
| IMPINJ INC | 6.21 | 107 | 16,788 | 半導体・半導体製造装置 |
| MOONLAKE IMMUNOTHERAPEUTICS | 9.3 | 36 | 5,763 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ODDITY TECH LTD | 16.65 | 70 | 10,998 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| ARM HOLDINGS LTD | 0.3 | 3 | 516 | 半導体・半導体製造装置 |
| MAPLEBEAR INC | 8.82 | 30 | 4,735 | メディア |
| JANUX THERAPEUTICS INC | 1.9 | 8 | 1,395 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ASTERA LABS INC | 49.33 | 357 | 55,760 | 半導体・半導体製造装置 |
| ARCELLX INC | 1.7 | 9 | 1,421 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PROFICIENT AUTO LOGISTICS INC | 15 | 22 | 3,456 | 運輸 |
| BUILDERS FIRSTSOURCE | 3.3 | 55 | 8,594 | 資本財 |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC | 64.99 | 230 | 35,990 | 消費者サービス |
| ENPHASE ENERGY INC | 3.64 | 41 | 6,487 | 半導体・半導体製造装置 |
| META PLATFORMS INC CL A | 209.09 | 9,867 | 1,538,389 | メディア・娯楽 |
| FIRST SOLAR INC | 3.26 | 64 | 10,042 | 半導体・半導体製造装置 |
| MASIMO CORP | 3.12 | 38 | 6,036 | ヘルスケア機器・サービス |
| MONOLITHIC POWER SYS INC | 6.08 | 443 | 69,203 | 半導体・半導体製造装置 |
| STERLING INFRASTRUCTURE INC | 1.5 | 19 | 3,013 | 資本財 |
| SURGERY PARTNERS INC | 9.31 | 24 | 3,749 | ヘルスケア機器・サービス |
| TRADE DESK INC | 5.83 | 55 | 8,615 | メディア・娯楽 |
| COINBASE GLOBAL INC | 28.29 | 587 | 91,566 | 金融サービス |
| FTAI AVIATION LTD | 52.72 | 412 | 64,309 | 資本財 |
| APOGEE THERAPEUTICS INC (アメリカ・・・ニューヨーク証券取引所) | 4.75 | 23 | 3,725 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ABERCROMBIE & FITCH CO CL A | 54.38 | 759 | 118,366 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| AMERICAN EXPRESS CO | 24.71 | 600 | 93,547 | 金融サービス |
| BOEING CO | 38.76 | 716 | 111,766 | 資本財 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 150.74 | 1,125 | 175,441 | ヘルスケア機器・サービス |
| CARPENTER TECHNOLOGY CORP | 14.27 | 156 | 24,435 | 素材 |
| CLOROX CO | 2.09 | 28 | 4,419 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| CORNING INC | 8.1 | 28 | 4,464 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| DANAHER CORP | 18.25 | 485 | 75,629 | 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 | |
| | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| TARGET CORP | 18.78 | 300 | 46,885 | 生活必需品流通・小売り |
| DECKERS OUTDOOR CORP | 11.4 | 1,012 | 157,930 | 耐久消費財・アパレル |
| DISNEY (WALT) CO | 9.51 | 98 | 15,308 | メディア・娯楽 |
| EOG RESOURCES INC | 35.12 | 456 | 71,149 | エネルギー |
| GAP INC | 29.48 | 63 | 9,927 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| GENERAL ELECTRIC CO | 19.46 | 311 | 48,510 | 資本財 |
| GSK PLC SPONS ADR | 13.92 | 62 | 9,761 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 3.95 | 88 | 13,768 | 資本財 |
| HERSHEY CO (THE) | 3.04 | 62 | 9,813 | 食品・飲料・タバコ |
| HOME DEPOT INC | 2.56 | 88 | 13,738 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 16.31 | 219 | 34,265 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| ELI LILLY & CO | 61.11 | 4,705 | 733,629 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LOWES COS INC | 66.56 | 1,538 | 239,831 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| MCDONALDS CORP | 8.59 | 233 | 36,478 | 消費者サービス |
| NIKE INC CL B | 93.72 | 863 | 134,692 | 耐久消費財・アパレル |
| NOVO-NORDISK AS CL B ADR | 72.56 | 956 | 149,204 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 47.35 | 300 | 46,811 | エネルギー |
| ORACLE CORP | 14.65 | 180 | 28,208 | ソフトウェア・サービス |
| PROCTER & GAMBLE CO | 30.6 | 512 | 79,978 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| PROGRESSIVE CORP OHIO | 15.31 | 320 | 49,940 | 保険 |
| PULTEGROUP INC | 1.8 | 21 | 3,341 | 耐久消費財・アパレル |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 3 | 42 | 6,638 | 消費者サービス |
| SHERWIN WILLIAMS CO | 1.36 | 42 | 6,624 | 素材 |
| STRYKER CORP | 8.61 | 288 | 44,926 | ヘルスケア機器・サービス |
| TJX COMPANIES INC | 82.67 | 829 | 129,264 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 3.53 | 210 | 32,763 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WALMART INC | 86.29 | 557 | 86,976 | 生活必需品流通・小売り |
| WILLIAMS-SONOMA INC | 3.11 | 96 | 15,007 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| FOOT LOCKER INC | 21.07 | 46 | 7,197 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| MORGAN STANLEY | 14.82 | 148 | 23,156 | 金融サービス |
| VALERO ENERGY CORP | 1.6 | 26 | 4,142 | エネルギー |
| YUM BRANDS INC | 2.91 | 41 | 6,427 | 消費者サービス |
| TAIWAN SEMIC MFG CO LTD SP ADR | 76.71 | 1,163 | 181,407 | 半導体・半導体製造装置 |
| FREEMPORT MCMORAN INC | 12.6 | 68 | 10,653 | 素材 |
| FEDEX CORP | 5.98 | 153 | 23,984 | 運輸 |
| MCKESSON CORP | 0.73 | 41 | 6,425 | ヘルスケア機器・サービス |
| AMERICAN EAGLE OUTFITTERS INC | 263.86 | 620 | 96,798 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 4.94 | 231 | 36,023 | 金融サービス |
| EXXON MOBIL CORP | 32.33 | 386 | 60,305 | エネルギー |
| DR HORTON INC | 6.94 | 105 | 16,392 | 耐久消費財・アパレル |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 53.95 | 2,830 | 441,284 | ヘルスケア機器・サービス |
| NRG ENERGY INC | 4.2 | 34 | 5,389 | 公益事業 |
| TAPESTRY INC | 15.42 | 65 | 10,174 | 耐久消費財・アパレル |
| ATI INC | 16.9 | 101 | 15,880 | 素材 |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 1.3 | 42 | 6,660 | 資本財 |
| CONSTELLATION BRANDS INC CLASS A | 1.02 | 26 | 4,062 | 食品・飲料・タバコ |
| EMCOR GROUP INC | 2.69 | 101 | 15,868 | 資本財 |
| GARMIN LTD | 3.75 | 64 | 9,994 | 耐久消費財・アパレル |
| DICKS SPORTING GOODS INC | 7.6 | 147 | 23,051 | 一般消費財・サービス流通・小売り |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|--------------------------------|---------|-----------|-------------|------------------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| ACUITY BRANDS INC | 2.74 | 71 | 11,088 | 資本財 |
| SALESFORCE INC | 52.99 | 1,513 | 235,961 | ソフトウェア・サービス |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 2.22 | 713 | 111,223 | 消費者サービス |
| COMFORT SYSTEMS USA INC | 1.5 | 47 | 7,395 | 資本財 |
| NEW ORIENTAL ED & TECH GR INC | 14.23 | 116 | 18,230 | 消費者サービス |
| CIENA CORP | 22.36 | 109 | 17,029 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MASTERCARD INC CL A | 37.91 | 1,744 | 272,044 | 金融サービス |
| DELTA AIR INC | 15.04 | 79 | 12,357 | 運輸 |
| SPIRIT AEROSYSTEM HLD INC CL A | 21.71 | 66 | 10,327 | 資本財 |
| VISA INC CL A | 14.25 | 399 | 62,230 | 金融サービス |
| MERCK & CO INC NEW | 19.34 | 253 | 39,557 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B | 1.51 | 62 | 9,815 | 金融サービス |
| GENERAL MOTORS CO | 12.3 | 56 | 8,775 | 自動車・自動車部品 |
| CITIGROUP INC | 36.72 | 235 | 36,680 | 銀行 |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 1.3 | 23 | 3,641 | エネルギー |
| KKR & CO INC | 10.25 | 107 | 16,722 | 金融サービス |
| CHENIERE ENERGY INC | 1.95 | 31 | 4,869 | エネルギー |
| WATSCO INC | 1.15 | 54 | 8,563 | 資本財 |
| SERVICENOW INC | 5.99 | 458 | 71,448 | ソフトウェア・サービス |
| EATON CORP PLC | 9.18 | 303 | 47,265 | 資本財 |
| ZOETIS INC CL A | 46.89 | 816 | 127,248 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| T-MOBILE US INC | 6.93 | 113 | 17,719 | 電気通信サービス |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 1.3 | 26 | 4,138 | 消費者サービス |
| ARISTA NETWORKS INC | 3.31 | 105 | 16,508 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| RH | 25.87 | 720 | 112,293 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| HUBSPOT INC | 8.98 | 552 | 86,152 | ソフトウェア・サービス |
| TOPBUILD CORP | 1.93 | 77 | 12,157 | 耐久消費財・アパレル |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | 25.45 | 220 | 34,429 | 食品・飲料・タバコ |
| HOWMET AEROSPACE INC | 30.09 | 249 | 38,905 | 資本財 |
| BLOCK INC CL A | 64.76 | 467 | 72,958 | 金融サービス |
| GLAUKOS CORP | 6.06 | 66 | 10,373 | ヘルスケア機器・サービス |
| SNAP INC - A | 2,007.4 | 3,221 | 502,322 | メディア・娯楽 |
| FLOOR & DECOR HOLDING INC CL A | 0.8 | 9 | 1,483 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| SEA LTD ADR | 79.13 | 583 | 90,998 | メディア・娯楽 |
| VISTRA CORP | 9.56 | 89 | 14,022 | 公益事業 |
| SPOTIFY TECHNOLOGY SA | 2 | 60 | 9,442 | メディア・娯楽 |
| NVENT ELECTRIC PLC | 3.9 | 31 | 4,865 | 資本財 |
| DELL TECHNOLOGIES INC CL C | 27.24 | 407 | 63,500 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| PINTEREST INC CL A | 25.8 | 110 | 17,208 | メディア・娯楽 |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 437.89 | 2,875 | 448,338 | 運輸 |
| BILL HOLDINGS INC | 20.19 | 119 | 18,660 | ソフトウェア・サービス |
| AZEK CO INC | 7.61 | 35 | 5,532 | 資本財 |
| SNOWFLAKE INC CL A | 12.75 | 206 | 32,175 | ソフトウェア・サービス |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC | 25.44 | 55 | 8,630 | ソフトウェア・サービス |
| ROBLOX CORP | 50.51 | 166 | 25,908 | メディア・娯楽 |
| SWEETGREEN INC CL A | 139.7 | 443 | 69,153 | 消費者サービス |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 9.43 | 106 | 16,625 | 金融サービス |
| LINDE PLC | 1.94 | 83 | 13,082 | 素材 |
| KENVUE INC | 43.08 | 88 | 13,748 | 家庭用品・パーソナル用品 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------|------------------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| CAVA GROUP INC | 4.9 | 37 | 5,903 | 消費者サービス |
| SHARKNINJA INC | 24.65 | 183 | 28,616 | 耐久消費財・アパレル |
| TKO GROUP HOLDINGS INC | 8.45 | 89 | 13,879 | メディア・娯楽 |
| GE VERNOVA LLC | 7.25 | 117 | 18,381 | 資本財 |
| RUBRIK INC | 4 | 14 | 2,280 | ソフトウェア・サービス |
| LOAR HOLDINGS INC | 2 | 10 | 1,606 | 資本財 |
| VIKING HOLDINGS LTD | 17 | 48 | 7,551 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| CRH PLC(US) | 6.03 | 49 | 7,701 | 素材 |
| BEYOND INC | 30.7 | 55 | 8,601 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| PVH CORP | 31.27 | 356 | 55,617 | 耐久消費財・アパレル |
| PHILIP MORRIS INTL INC | 9.04 | 90 | 14,070 | 食品・飲料・タバコ |
| PHILLIPS 66 | 1.6 | 23 | 3,668 | エネルギー |
| RALPH LAUREN CORP | 2.67 | 44 | 6,988 | 耐久消費財・アパレル |
| TRANSDIGM GROUP INC | 0.67 | 86 | 13,495 | 資本財 |
| FERGUSON PLC | 4.12 | 86 | 13,534 | 資本財 |
| SPHERE ENTERTAINMENT CO | 4.61 | 16 | 2,590 | メディア・娯楽 |
| BLUE OWL CAPITAL INC A | 68.15 | 129 | 20,188 | 金融サービス |
| WARBY PARKER INC | 159.5 | 263 | 41,106 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 銘柄 数 <比 率> | 10,746.12 208銘柄 | 156,764 — <89.9%> | |
| (カナダ・・・トロント) | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| CAMECO CORP | 38.96 | 281 | 32,234 | エネルギー |
| SECURE ENERGY SERVICES INC | 53.32 | 60 | 6,976 | エネルギー |
| RESTAURANT BRANDS INTRNTNL INC | 11.73 | 113 | 12,963 | 消費者サービス |
| SHOPIFY INC CL A | 25.6 | 203 | 23,357 | ソフトウェア・サービス |
| ARITZIA INC | 45.38 | 154 | 17,678 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| DOLLARAMA INC | 5.21 | 63 | 7,328 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 銘柄 数 <比 率> | 180.2 6銘柄 | 877 — <0.4%> | |
| (香港・・・香港) | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| PRADA SPA | 57.3 | 345 | 6,903 | 耐久消費財・アパレル |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 銘柄 数 <比 率> | 57.3 1銘柄 | 345 — <0.0%> | |
| (イギリス・・・ロンドン) | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 6.47 | 104 | 20,782 | 消費者サービス |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 銘柄 数 <比 率> | 6.47 1銘柄 | 104 — <0.1%> | |
| (スイス・・・SIX Swiss Exchange) | 百株 | 千スイス・フラン | 千円 | |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT SA A | 5.48 | 79 | 13,600 | 耐久消費財・アパレル |
| GALDERMA GROUP AG | 5.98 | 44 | 7,575 | 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 銘柄 数 <比 率> | 11.46 2銘柄 | 123 — <0.1%> | |
| (インド・・・ナショナル証券取引所) | 百株 | 千インド・ルピー | 千円 | |
| LARSEN & TOUBRO LTD | 12.04 | 4,170 | 7,841 | 資本財 |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD(DEMAT) | 5.9 | 1,477 | 2,777 | 自動車・自動車部品 |
| HDFC BANK LTD (DEMAT) | 29.43 | 4,314 | 8,111 | 銀行 |
| GRASIM INDUSTRIES LTD (DEMAT) | 14.46 | 3,520 | 6,617 | 素材 |
| INDUS TOWERS LTD | 174.77 | 6,025 | 11,327 | 電気通信サービス |
| ZOMATO LTD | 170.46 | 3,315 | 6,233 | 消費者サービス |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|---|--------------------------|----------------------------|------------------------|--------------------------|
| | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| JIO FINANCIAL SERVICES LTD PATANJALI FOODS LTD (DEMAT) | 百株 167.95 27.73 | 千インド・ルピー 6,083 3,957 | 千円 11,436 7,440 | 金融サービス 食品・飲料・タバコ |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 銘 柄 数 <比 率> | 602.74 8銘柄 | 32,864 — <0.2%> | 61,785 |
| ユーロ (オランダ・・・アムステルダム) UNIVERSAL MUSIC GROUP INC | 百株 56.36 | 千ユーロ 161 | 千円 27,466 | メディア・娯楽 |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 銘 柄 数 <比 率> | 56.36 1銘柄 | 161 — <0.1%> | 27,466 |
| ユーロ (ベルギー・・・EURONEXT ブリュッセル) UCB SA | 百株 3.5 | 千ユーロ 43 | 千円 7,400 | 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 銘 柄 数 <比 率> | 3.5 1銘柄 | 43 — <0.0%> | 7,400 |
| ユーロ (フランス・・・EURONEXT パリ) HERMES INTERNATIONAL SA LVMH MOET HENNESSY LOUIS VU SE | 百株 0.62 4.09 | 千ユーロ 142 320 | 千円 24,128 54,318 | 耐久消費財・アパレル 耐久消費財・アパレル |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 銘 柄 数 <比 率> | 4.71 2銘柄 | 462 — <0.3%> | 78,446 |
| ユーロ (ドイツ・・・XETRA) ADIDAS AG | 百株 4.61 | 千ユーロ 105 | 千円 17,885 | 耐久消費財・アパレル |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 銘 柄 数 <比 率> | 4.61 1銘柄 | 105 — <0.1%> | 17,885 |
| ユーロ (その他・・・アムステルダム) CVC CAPITAL PARTNERS PLC | 百株 24 | 千ユーロ 43 | 千円 7,366 | 金融サービス |
| 小 計 | 株 数 、 金 額 銘 柄 数 <比 率> | 24 1銘柄 | 43 — <0.0%> | 7,366 |
| ユーロ 計 | 株 数 、 金 額 銘 柄 数 <比 率> | 93.18 6銘柄 | 817 — <0.5%> | 138,565 |
| 合 計 | 株 数 、 金 額 銘 柄 数 <比 率> | 11,697.47 232銘柄 | — — <91.2%> | 24,790,859 |

(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相場場の仲値により、邦貨換算したものです。

(注2) < >は純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘 柄 | 単 位 数 又 は 口 数 | 当 期 末 | |
|-----------------------------|---------------|-----------|-------------|
| | | 評 価 額 | |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |
| (アメリカ) | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 |
| WELLTOWER INC | 2,608 | 264 | 41,185 |
| Invesco QQQ Trust Series 1 | 5,857 | 2,645 | 412,531 |
| ISHARES TR RUS 1000 GRW ETF | 32,826 | 11,255 | 1,754,774 |
| 小 計 | 口 数 、 金 額 | 14,165 | 2,208,492 |
| | 銘 柄 数 <比 率> | — | <8.1%> |
| 合 計 | 口 数 、 金 額 | — | 2,208,492 |
| | 銘 柄 数 <比 率> | — | <8.1%> |

(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、純資産総額に対する各国別投資信託受益証券、投資証券評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

(2024年5月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株 式 | 千円 24,790,859 | % 90.7 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券 | 2,167,306 | 7.9 |
| 投 資 証 券 | 41,185 | 0.2 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 328,821 | 1.2 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 27,328,173 | 100.0 |

(注1) 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、5月20日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=155.91円、1カナダ・ドル=114.58円、1香港・ドル=19.98円、1イギリス・ポンド=198.10円、1スイス・フラン=171.46円、1インド・ルピー=1.88円、1ユーロ=169.57円です。

(注2) 当期末における外貨建資産(26,994,446千円)の投資信託財産総額(27,328,173千円)に対する比率は、98.8%です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年5月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資 産 | 27,602,866,404 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 298,185,635 |
| 株 式(評価額) | 24,790,859,371 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券(評価額) | 2,167,306,304 |
| 投 資 証 券(評価額) | 41,185,859 |
| 未 収 入 金 | 295,772,202 |
| 未 収 配 当 金 | 9,557,033 |
| (B) 負 債 | 422,891,156 |
| 未 払 金 | 378,492,160 |
| 未 払 解 約 金 | 44,398,996 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 27,179,975,248 |
| 元 本 | 21,022,716,853 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 6,157,258,395 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 21,022,716,853口 |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D) | 12,929円 |

(注1) 当ファンドの期首元本額、期中追加設定元本額、期中一部解約元本額は以下の通りです。

| | |
|-----------|-----------------|
| 期首元本額 | 2,340,000,000円 |
| 期中追加設定元本額 | 18,717,831,529円 |
| 期中一部解約元本額 | 35,114,676円 |

(注2) 当ファンドの当期末元本の内訳は以下の通りです。

フィデリティ・ブルーチップ・グロース・ファンド(適格機関投資家専用) 21,022,716,853円

(注3) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

■損益の状況

当期 自2023年12月13日 至2024年5月20日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配 当 等 収 益 | 33,395,232 |
| 受 取 配 当 金 | 32,109,248 |
| 受 取 利 息 | 1,285,445 |
| そ の 他 収 益 金 | 539 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 3,529,207,984 |
| 売 買 益 | 3,840,745,727 |
| 売 買 損 | △311,537,743 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △5,229,036 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 3,557,374,180 |
| (E) 解 約 差 損 益 金 | △9,284,320 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 2,609,168,535 |
| (G) 合 計(D+E+F) | 6,157,258,395 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G) | 6,157,258,395 |

(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せん。

(注3) (E)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。

(注4) (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。

D I A M マネーマザーファンド

運用報告書

第15期 (決算日 2024年4月5日)

(計算期間 2023年4月6日～2024年4月5日)

D I A M マネーマザーファンドの第15期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。

| | |
|--------|---|
| 信託期間 | 2009年10月29日から無期限です。 |
| 運用方針 | 安定した収益の確保をめざします。 |
| 主要投資対象 | 国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。 外貨建て資産への投資は行いません。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 債券 組入比率 | 新株予約権 付社債 (転換社債) | 債券 先物比率 | 純資産 総額 |
|----------------|--------|----------|------------|------------------------|------------|--------------|
| | 円 | 騰落 中率 | | | | |
| 11期(2020年4月6日) | 10,089 | △0.1 | 69.3 | — | — | 百万円 1,139 |
| 12期(2021年4月5日) | 10,080 | △0.1 | 62.4 | — | — | 1,064 |
| 13期(2022年4月5日) | 10,071 | △0.1 | 76.3 | — | — | 1,192 |
| 14期(2023年4月5日) | 10,063 | △0.1 | 71.8 | — | — | 1,253 |
| 15期(2024年4月5日) | 10,055 | △0.1 | 62.0 | — | — | 483 |

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指標を定めておりません。

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

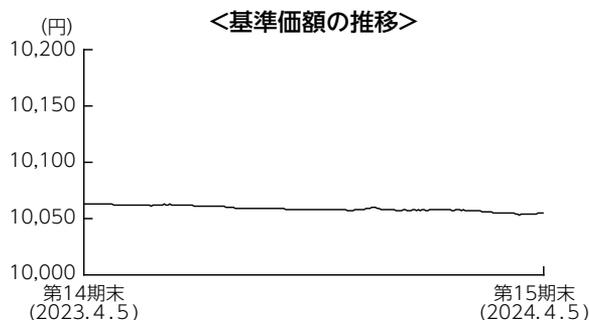
■当期中の基準価額の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | 債 組 入 比 率 | 新 株 予 約 権 付 社 債 (転 換 社 債) 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|------------------------|---------|-------|-----------|---|-----------|
| | | | | | |
| (期 首) 2023年 4 月 5 日 | 10,063 | — | 71.8 | — | — |
| 4 月 末 | 10,062 | △0.0 | 71.8 | — | — |
| 5 月 末 | 10,062 | △0.0 | 61.6 | — | — |
| 6 月 末 | 10,061 | △0.0 | 61.6 | — | — |
| 7 月 末 | 10,060 | △0.0 | 61.6 | — | — |
| 8 月 末 | 10,059 | △0.0 | 61.6 | — | — |
| 9 月 末 | 10,058 | △0.0 | 61.6 | — | — |
| 10 月 末 | 10,057 | △0.1 | 61.6 | — | — |
| 11 月 末 | 10,058 | △0.0 | 61.6 | — | — |
| 12 月 末 | 10,057 | △0.1 | 60.2 | — | — |
| 2024年 1 月 末 | 10,057 | △0.1 | 60.2 | — | — |
| 2 月 末 | 10,055 | △0.1 | 60.1 | — | — |
| 3 月 末 | 10,054 | △0.1 | 62.0 | — | — |
| (期 末) 2024年 4 月 5 日 | 10,055 | △0.1 | 62.0 | — | — |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2023年4月6日から2024年4月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,055円となり、前期末比で0.1%下落しました。

基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主としてわが国の短期公社債に投資し、安定した収益の確保をめざした運用を行いました。日銀のマイナス金利政策の影響が大きく、基準価額は前期末比で下落して期末を迎えました。

投資環境

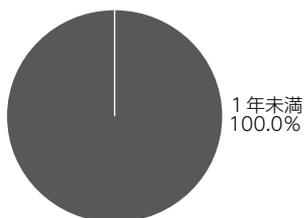
国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは、日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続した影響によりマイナス圏で推移しましたが、当期末にかけては、マイナス金利政策の解除を受けて上昇の動きとなり、利回りはプラス水準に転じる局面がありました。

ポートフォリオについて

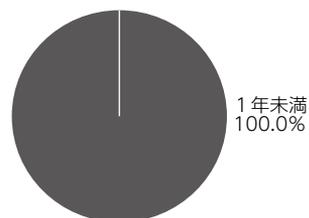
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

【運用状況】 ※比率は組入債券の時価評価額に対する割合です。

○残存年限別構成比 期首（前期末）



当期末



今後の運用方針

日銀は2024年3月の金融政策決定会合で、マイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策の解除を決定しました。声明文で日銀は「現時点の経済・物価見通しを前提にすれば、当面、緩和的な金融環境が継続すると考えている。」としており、今後はプラス圏ながらも金利は低位で推移するものと見られます。そのため、今後も公社債などへの投資を通じて、安定的な運用をめざします。

■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

■ 売買及び取引の状況 (2023年4月6日から2024年4月5日まで)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|------|---------|----------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国内 | 国債証券 | 500,341 | 600,273 (500,000) |

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2023年4月6日から2024年4月5日まで)

期中の利害関係人との取引状況

| 決算期 区分 | 当 | | | 期 | | |
|-----------|------------|--------------------|-----------|------------|--------------------|--------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D/C |
| 公社債 | 百万円 500 | 百万円 200 | % 40.0 | 百万円 600 | 百万円 - | % - |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

| 区 分 | 当 期 | | | | 末 | | |
|---------|---------|---------|---------|--------------------|-------------------|---------|---------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うち B B 格 以下組入比率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 | | |
| | | | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国 債 証 券 | 300,000 | 299,992 | 62.0 | — | — | — | 62.0 |
| 合 計 | 300,000 | 299,992 | 62.0 | — | — | — | 62.0 |

(注) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

| 銘 柄 | 当 期 | | 末 | |
|--------------------|--------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| (国債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 4 4 0 回 利付国庫債券（2年） | 0.0050 | 100,000 | 100,006 | 2024/09/01 |
| 4 4 1 回 利付国庫債券（2年） | 0.0050 | 100,000 | 100,004 | 2024/10/01 |
| 4 4 6 回 利付国庫債券（2年） | 0.0050 | 100,000 | 99,982 | 2025/03/01 |
| 合 計 | — | 300,000 | 299,992 | — |

■投資信託財産の構成

2024年4月5日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 | |
|-------------------------|---------|-------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 千円 | % | 千円 | % |
| | 299,992 | 62.0 | 299,992 | 62.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 183,876 | 38.0 | 183,876 | 38.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 483,868 | 100.0 | 483,868 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年4月5日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 483,868,290円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 183,875,306 |
| 公 社 | 299,992,000 |
| 未 収 利 息 | 546 |
| 前 払 費 用 | 438 |
| (B) 負 債 | — |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 483,868,290 |
| 元 本 | 481,233,562 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 2,634,728 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 481,233,562口 |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D) | 10,055円 |

| | | | |
|--|----------------|--|--------------|
| (注1) 期首元本額 | 1,245,658,613円 | モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジなし) | 109,063円 |
| 追加設定元本額 | 13,726,863円 | モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジあり) | 297,442円 |
| 一部解約元本額 | 778,151,914円 | モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジなし) | 118,977円 |
| (注2) 期末における元本の内訳 | | ファンドスミス・グローバル・エクイティ・ファンド | 99,255,584円 |
| バンクローン・ファンド (ヘッジなし) | 15,843,407円 | PIMCOストラテジック・インカム・ファンド (為替ヘッジあり) | 301,134円 |
| バンクローン・ファンド (ヘッジあり) | 13,867,169円 | PIMCOストラテジック・インカム・ファンド (為替ヘッジなし) | 1,493,740円 |
| バンクローン・ファンド (ヘッジなし/年1回決算型) | 1,088,285円 | One/フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド (成長型) | 9,943,324円 |
| バンクローン・ファンド (ヘッジあり/年1回決算型) | 98,095円 | One/フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド (毎月決算・予想分配金提示型) | 1,988,665円 |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号 | 3,959,763円 | 期末元本合計 | 481,233,562円 |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド11月号 | 989,197円 | | |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド12月号 | 494,102円 | | |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド1月号 | 494,102円 | | |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド2月号 | 48,517円 | | |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド3月号 | 395,083円 | | |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド4月号 | 11,377円 | | |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド5月号 | 98,027円 | | |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド6月号 | 989,197円 | | |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド7月号 | 395,083円 | | |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド8月号 | 494,102円 | | |
| 新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド9月号 | 494,102円 | | |
| ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジあり> | 791,316円 | | |
| ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジなし> | 2,474,972円 | | |
| グルーズコントロール | 294,245,101円 | | |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース> | 870,000円 | | |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<豪ドルコース> | 530,000円 | | |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース> | 70,000円 | | |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<ブラジルレアルコース> | 10,530,000円 | | |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<中国元コース> | 149,716円 | | |
| DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<米ドルコース> | 5,972円 | | |
| USストラテジック・インカム・ファンドAコース (為替ヘッジあり) | 993,740円 | | |
| USストラテジック・インカム・ファンドBコース (為替ヘッジなし) | 1,987,479円 | | |
| DIAM-ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<DC年金> | 9,935円 | | |
| マッシュューズ・アジア株式ファンド | 14,723,185円 | | |
| One世界分散セレクト (Aコース) | 99,040円 | | |
| One世界分散セレクト (Bコース) | 99,040円 | | |
| One世界分散セレクト (Cコース) | 99,040円 | | |
| 世界8資産リスク分散バランスファンド (目標払出し型) | 99,109円 | | |
| モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジあり) | 188,380円 | | |

■損益の状況

当期 自2023年4月6日 至2024年4月5日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|-------------|---|------------|
| (A) | 配当等収益 | | △54,712円 |
| | 受取利息 | | 26,392 |
| | 支払利息 | | △81,104 |
| (B) | 有価証券売買損益 | | △502,000 |
| | 売却益 | | 14,000 |
| | 売却損 | | △516,000 |
| (C) | 当期損益金(A+B) | | △556,712 |
| (D) | 前期繰越損益金 | | 7,856,815 |
| (E) | 解約差損益金 | | △4,744,512 |
| (F) | 追加信託差損益金 | | 79,137 |
| (G) | 合計(C+D+E+F) | | 2,634,728 |
| | 次期繰越損益金(G) | | 2,634,728 |

(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) (E)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。

(注3) (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。