

第10期【償還】

運用報告書(全体版)

日本の未来図（米ドル投資型）

【2024年10月 4 日償還】

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

皆様の「日本の未来図（米ドル投資型）」は、2024年10月 4 日をもちまして信託約款の規定に基づき、償還となりました。ここに設定以来の運用経過及び償還内容のご報告をいたしますとともに、皆様のご愛顧に対し改めてお礼申し上げます。

今後とも、弊社ファンドに対しまして、一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。



〒104-0031 東京都中央区京橋2-2-1

お問い合わせは弊社投信営業部へ
フリーダイヤル ☎ 0120-048-214（営業日の9:00～17:00）
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。

【ホームページ】

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

※アクセスにかかる通信料はお客様のご負担となります。

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／国内／株式	
信 託 期 間	2014年10月31日から2024年10月 4 日までです。	
運 用 方 針	日本未来戦略マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）を通じて、主として、わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）株式に投資を行い、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。円建て資産について、原則として円売り米ドル買いの外国為替予約取引等を行い、米ドルへの投資効果を享受することを目指します。	
主 要 投 資 対 象	当ファンド	マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
	日本未来戦略マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）株式を主要投資対象とします。
投 資 制 限	当ファンド	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。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	日本未来戦略マザーファンド	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）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は行いません。
分 配 方 針	毎年10月 6 日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、原則として、以下の方針に基づき、収益分配を行います。 分配対象収益の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の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。 繰越分を含めた経費控除後の配当等収益には、マザーファンドの配当等収益のうち、投資信託財産に帰属すべき配当等収益を含むものとします。 分配金額は、委託会社が分配可能額、基準価額水準等を勘案して決定します。分配可能額が少額の場合や基準価額水準によっては、収益分配を行わないことがあります。	

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額		合 成 (参考指数)	指 数 騰 落 中 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 分	込 配 金 騰 落 中 率					
(設定日)	円 銭		円	ポイント	%	%	%	百万円
2014年10月31日	10,000		—	139,412.89	—	—	—	1,646
1期(2015年10月6日)	10,966		0	177,794.44	27.5	92.3	—	4,136
2期(2016年10月6日)	8,744		0	140,077.60	△21.2	90.8	—	2,985
3期(2017年10月6日)	12,065		0	190,480.36	36.0	94.6	—	2,490
4期(2018年10月9日)	13,349		0	198,953.73	4.4	94.6	—	1,911
5期(2019年10月7日)	11,945		0	167,875.34	△15.6	91.9	—	1,310
6期(2020年10月6日)	13,739		0	173,889.95	3.6	93.5	—	975
7期(2021年10月6日)	16,341		0	216,775.41	24.7	94.6	—	879
8期(2022年10月6日)	19,750		0	278,104.51	28.3	79.6	6.9	812
9期(2023年10月6日)	24,763		0	336,781.90	21.1	95.4	—	829
(償還時)	(償還価額)							
10期(2024年10月4日)	30,102.20		—	395,273.95	17.4	—	—	865

(注) 基準価額および分配金（税引前）は1万口当たり、基準価額の騰落率は分配金（税引前）込み。
(注) 設定日の基準価額および純資産総額は当初設定元本。
(注) 合成指数は当ファンドの参考指数であり、ベンチマークではありません。合成指数は、東証株価指数（TOPIX）と米ドル（対円）を合成したものです。設定日の合成指数は設定日前営業日の終値です。
(注) 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、株式組入比率および株式先物比率は実質比率を記載しております。
(注) 株式先物比率＝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 (分配落)	価 額		合 成 (参考指数)	指 数 騰 落 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		円 銭	騰 落 率				
(期 首)			%	ポイント	%	%	%
2023年10月6日	24,763		—	336,781.90	—	95.4	—
10月末	24,976		0.9	336,953.68	0.1	95.6	—
11月末	26,353		6.4	349,280.96	3.7	96.1	—
12月末	25,317		2.2	335,625.09	△0.3	94.9	—
2024年1月末	27,838		12.4	376,414.81	11.8	94.0	—
2月末	31,025		25.3	403,152.24	19.7	96.3	—
3月末	33,209		34.1	419,196.75	24.5	93.9	—
4月末	33,469		35.2	430,403.37	27.8	92.6	—
5月末	34,975		41.2	434,560.08	29.0	95.3	—
6月末	36,851		48.8	452,547.10	34.4	92.4	—
7月末	34,325		38.6	425,956.99	26.5	93.6	—
8月末	31,633		27.7	392,788.82	16.6	94.1	—
9月末	30,107		21.6	377,655.02	12.1	—	—
(償還時)	(償還価額)						
2024年10月4日	30,102.20		21.6	395,273.95	17.4	—	—

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の運用経過

設定以来の基準価額等の推移

（2014年10月31日～2024年10月4日）



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

（注）参考指数は、合成指数です。

（注）分配金再投資基準価額および参考指数は、設定日（2014年10月31日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

設定以来の投資環境

（2014年10月31日～2024年10月4日）

設定以来の国内株式市場は、数回の調整局面を挟みながらも、概ね上昇基調で推移しました。この間、米中貿易摩擦の激化、新型コロナウイルスの世界的感染拡大、インフレの発生と金融引き締め政策、中国不動産市場の悪化、東欧や中東での地政学リスクの顕在化など、投資家心理を悪化させる様々な事象が発生しました。そうした時期には一時的に株式市場が調整する局面も見られましたが、これらの調整を乗り越えて、この間の国内株式市場は大幅な上昇を達成しました。政府・日銀が積極的な支援を行ってマクロ経済を支えたこと、持続的な企業価値の向上に向けて金融庁・東証がイニシアチブをとって上場企業や機関投資家をリードしたこと、こうした環境の変化に対して日本の上場企業が、収益性の改善に向けて事業ポートフォリオ、ガバナンス体制や資本政策の見直しを行ってきたことなどが、企業価値の向上とそれを反映した株価上昇の原動力になったと考えられます。2024年に入り、わが国を代表する株価指数である日経平均株価や東証株価指数（TOPIX）が1989年の史上最高値を更新してきたことは、1990年以降の不良債権問題に端を発する金融危機、物価の持続的な下落（デフレ）、東日本大震災で顕在化したエネルギー危機といった苦難の30年を日本経済がようやく克服し、次の成長ステージに入ってきたことを象徴するものと捉えております。

外国為替市場では、新型コロナウイルス感染症の流行が収束した2022年以降、米連邦準備制度理事会（FRB）がインフレ抑制のため積極的な金融引き締め政策を行った一方、日銀が緩和的な金融政策を維持したことで日米の金利差が拡大し、米ドル高・円安が急速に進行しました。

設定以来の当ファンドのポートフォリオ

（2014年10月31日～2024年10月4日）

株式への投資はマザーファンドを通じて行いました。マザーファンドの運用につきましては、わが国の将来の諸問題に対して、従来の常識を超えた技術、発想で取り組むことが期待される企業に着目して、ボトムアップ・アプローチにより銘柄を選定してまいりました。特にファンドの設定以降、半導体分野の技術革新のスピードは著しく、生成A I（人工知能）の登場などにより中長期的な市場成長への期待が高まったことなどから、半導体関連銘柄への積極的な投資を行ってまいりました。また、半導体以外の銘柄においても、外部環境の変化や個別の自助努力により企業価値の向上が期待される銘柄に投資を行い、投資信託財産の成長を図ってまいりました。満期償還が近づいた2024年9月に入ってから段階的に保有株式の売却を進め、9月下旬に全保有株式の売却を終えました。また、期中は円売り米ドル買いの外国為替予約取引の額が純資産総額比で高位となるよう調整しましたが、このポジションも9月下旬に決済しました。

設定以来の当ファンドのベンチマークとの差異

（2014年10月31日～2024年10月4日）

当ファンドは特定のベンチマークを設けておりませんが、設定以来の基準価額の騰落率は、参考指数としている東証株価指数（TOPIX）と米ドル（対円）の合成指数の騰落率を上回りました。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年10月 7 日～2024年10月 4 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 520	% 1.685	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(253)	(0.820)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(253)	(0.820)	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、購入後の 情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(13)	(0.044)	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	97	0.314	(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
(株 式)	(97)	(0.314)	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) そ の 他 費 用	3	0.011	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(3)	(0.011)	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
(そ の 他)	(0)	(0.000)	その他は、金銭信託支払手数料
合 計	620	2.010	
期中の平均基準価額は、30,839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) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

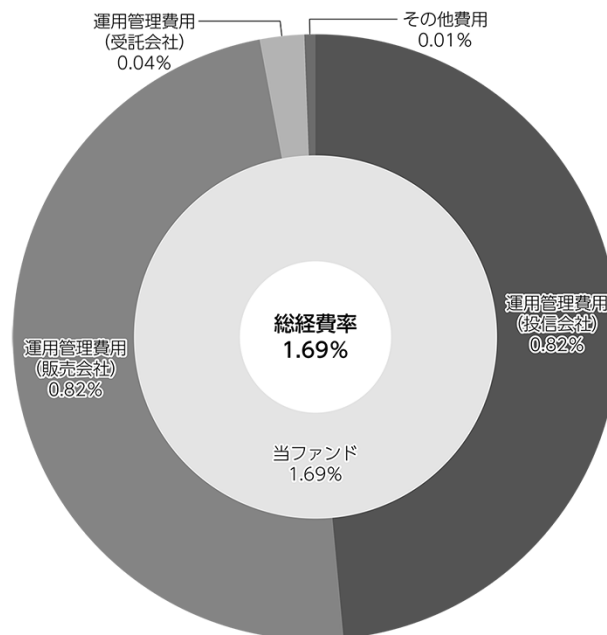
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を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1.69%です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2023年10月7日～2024年10月4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
日本未来戦略マザーファンド	82,641	207,089	489,874	1,191,569

(注) 単位未満は切捨て。

○株式売買比率

(2023年10月7日～2024年10月4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
	日本未来戦略マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	5,181,001千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,300,795千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	3.98

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2023年10月7日～2024年10月4日)

利害関係人との取引状況

<日本の未来図（米ドル投資型）>

該当事項はございません。

<日本未来戦略マザーファンド>

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 1,883	百万円 113	% 6.0	百万円 3,297	百万円 105	% 3.2

平均保有割合 67.0%

※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。

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額（A）	2,899千円
うち利害関係人への支払額（B）	97千円
（B）／（A）	3.3%

（注）売買委託手数料総額は、当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、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは株式会社SBI証券です。

○組入資産の明細 (2024年10月4日現在)

有価証券等の組入れはございません。

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)
	口 数
日本未来戦略マザーファンド	千口 407,233

（注）口数の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成 (2024年10月4日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 873,655	% 100.0
投資信託財産総額	873,655	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況（2024年10月4日現在）

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	873,655,563
コール・ローン等	873,644,843
未収利息	10,720
(B) 負債	8,198,221
未払解約金	67,250
未払信託報酬	8,078,570
その他未払費用	52,401
(C) 純資産総額(A－B)	865,457,342
元本	287,506,337
償還差益金	577,951,005
(D) 受益権総口数	287,506,337口
1万口当たり償還価額(C／D)	30,102円20銭

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、3.010220円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は335,174,536円、期中追加設定元本額は33,380,989円、期中一部解約元本額は81,049,188円です。

○損益の状況（2023年10月7日～2024年10月4日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	45,661
受取利息	48,698
支払利息	△ 3,037
(B) 有価証券売買損益	138,470,408
売買益	270,271,138
売買損	△131,800,730
(C) 信託報酬等	△ 15,435,043
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	123,081,026
(E) 前期繰越損益金	344,764,552
(F) 追加信託差損益金	110,105,427
(配当等相当額)	(63,345,403)
(売買損益相当額)	(46,760,024)
償還差益金(D＋E＋F)	577,951,005

(注) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2014年10月31日			投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024年10月4日			資産総額	873,655,563円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託		負債総額	8,198,221円
					純資産総額	865,457,342円
受益権口数	1,646,565,416口	287,506,337口	△1,359,059,079口		受益権口数	287,506,337口
元本額	1,646,565,416円	287,506,337円	△1,359,059,079円		1万口当たり償還金	30,102円20銭
毎計算期末の状況						
計算期	元本額	純資産総額	基準価額		1万口当たり分配金	
					金額	分配率
第1期	3,772,375,453円	4,136,966,286円	10,966円		0円	0.00%
第2期	3,414,595,329	2,985,788,523	8,744		0	0.00
第3期	2,063,970,335	2,490,221,268	12,065		0	0.00
第4期	1,431,983,271	1,911,618,461	13,349		0	0.00
第5期	1,096,976,480	1,310,359,566	11,945		0	0.00
第6期	709,696,440	975,048,611	13,739		0	0.00
第7期	538,366,544	879,736,657	16,341		0	0.00
第8期	411,533,183	812,788,040	19,750		0	0.00
第9期	335,174,536	829,986,197	24,763		0	0.00

○償還金のお知らせ

1万口当たり償還金	30,102円20銭
-----------	------------

<お知らせ>

該当事項はございません。

<当ファンドの参考指数について>

TOPIX（以下、「東証株価指数（TOPIX）」といいます。）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

日本未来戦略マザーファンド
第10期 運用状況のご報告
償還日：2024年10月3日

当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）株式を主要投資対象とし、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）株式を主要投資対象とします。
投資制限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）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は行いません。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		東証株価指数 (TOPIX)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	(参考指数)	期 騰 落			
(設定日)	円 銭	%	ポイント	%	%	%	百万円
2014年10月31日	10,000	—	1,278.90	—	—	—	2,585
1期(2015年10月6日)	10,265	2.7	1,475.84	15.4	96.9	—	6,051
2期(2016年10月6日)	9,675	△ 5.7	1,353.93	△ 8.3	95.5	—	4,659
3期(2017年10月6日)	12,535	29.6	1,687.16	24.6	96.5	—	3,825
4期(2018年10月9日)	13,870	10.7	1,761.12	4.4	97.2	—	2,870
5期(2019年10月7日)	13,011	△ 6.2	1,572.75	△10.7	93.1	—	1,965
6期(2020年10月6日)	15,256	17.3	1,645.75	4.6	94.8	—	1,478
7期(2021年10月6日)	17,511	14.8	1,941.91	18.0	96.6	—	1,296
8期(2022年10月6日)	16,726	△ 4.5	1,922.47	△ 1.0	81.6	7.0	1,163
9期(2023年10月6日)	19,978	19.4	2,264.08	17.8	97.3	—	1,200
(償還時)	(償還価額)						
10期(2024年10月3日)	24,766.14	24.0	2,683.71	18.5	—	—	658

（注）基準価額は1万円当たり。

（注）設定日の基準価額および純資産総額は当初設定元本。

（注）東証株価指数（TOPIX）は当ファンドの参考指数であり、ベンチマークではありません。設定日の東証株価指数（TOPIX）は設定日前営業日の終値です。

（注）株式先物比率＝買建比率－売建比率。

TOPIX（以下、「東証株価指数（TOPIX）」といいます。）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	東証株価指数 (TOPIX)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
			(参考指数)	騰 落 率		
(期 首) 2023年10月 6 日	円 銭 19,978	% —	ポイント 2,264.08	% —	% 97.3	% —
10月末	19,997	0.1	2,253.72	△ 0.5	97.8	—
11月末	21,383	7.0	2,374.93	4.9	96.9	—
12月末	21,198	6.1	2,366.39	4.5	96.6	—
2024年 1 月末	22,404	12.1	2,551.10	12.7	96.1	—
2 月末	24,462	22.4	2,675.73	18.2	98.3	—
3 月末	26,056	30.4	2,768.62	22.3	96.2	—
4 月末	25,287	26.6	2,743.17	21.2	95.5	—
5 月末	26,382	32.1	2,772.49	22.5	98.1	—
6 月末	27,055	35.4	2,809.63	24.1	94.4	—
7 月末	26,504	32.7	2,794.26	23.4	95.3	—
8 月末	25,646	28.4	2,712.63	19.8	96.1	—
9 月末	24,766	24.0	2,645.94	16.9	—	—
(償還時) 2024年10月 3 日	(償還価額) 24,766.14	24.0	2,683.71	18.5	—	—

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の運用経過

設定以来の基準価額等の推移

(2014年10月31日～2024年10月3日)



(注) 参考指数は、東証株価指数（TOPIX）です。

(注) 参考指数は、設定日（2014年10月31日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

設定以来の投資環境

(2014年10月31日～2024年10月3日)

設定以来の国内株式市場は、数回の調整局面を挟みながらも、概ね上昇基調で推移しました。この間、米中貿易摩擦の激化、新型コロナウイルスの世界的感染拡大、インフレの発生と金融引き締め政策、中国不動産市場の悪化、東欧や中東での地政学リスクの顕在化など、投資家心理を悪化させる様々な事象が発生しました。そうした時期には一時的に株式市場が調整する局面も見られましたが、これらの調整を乗り越えて、この間の国内株式市場は大幅な上昇を達成しました。政府・日銀が積極的な支援を行ってマクロ経済を支えたこと、持続的な企業価値の向上に向けて金融庁・東証がイニシアチブをとって上場企業や機関投資家をリードしたこと、こうした環境の変化に対して日本の上場企業が、収益性の改善に向けて事業ポートフォリオ、ガバナンス体制や資本政策の見直しを行ってきたことなどが、企業価値の向上とそれを反映した株価上昇の原動力になったと考えられます。2024年に入り、わが国を代表する株価指数である日経平均株価や東証株価指数（TOPIX）が1989年の史上最高値を更新してきたことは、1990年以降の不良債権問題に端を発する金融危機、物価の持続的な下落（デフレ）、東日本大震災で顕在化したエネルギー危機といった苦難の30年を日本経済がようやく克服し、次の成長ステージに入ってきたことを象徴するものと捉えております。

設定以来の当ファンドのポートフォリオ

(2014年10月31日～2024年10月3日)

当ファンドの運用につきましては、わが国の将来の諸問題に対して、従来の常識を超えた技術、発想で取り組むことが期待される企業に着目して、ボトムアップ・アプローチにより銘柄を選定してまいりました。特にファンドの設定以降、半導体分野の技術革新のスピードは著しく、生成A I（人工知能）の登場などにより中長期的な市場成長への期待が高まったことなどから、半導体関連銘柄への積極的な投資を行ってまいりました。また、半導体以外の銘柄においても、外部環境の変化や個別の自助努力により企業価値の向上が期待される銘柄に投資を行い、投資信託財産の成長を図ってまいりました。満期償還が近づいた2024年9月に入ってからには段階的に保有株式の売却を進め、9月下旬に全保有株式の売却を終えました。

設定以来の当ファンドのベンチマークとの差異

(2014年10月31日～2024年10月3日)

当ファンドは特定のベンチマークを設けておりませんが、設定以来の基準価額の騰落率は、参考指数としている東証株価指数（TOPIX）の騰落率を上回りました。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年10月 7 日～2024年10月 3 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 81 (81)	% 0.335 (0.335)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、金銭信託支払手数料
合 計	81	0.335	
期中の平均基準価額は、24,261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) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は 1 万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第 3 位未満は四捨五入してあります。

○ 売買及び取引の状況

(2023年10月 7 日～2024年10月 3 日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 675 (89)	千円 1,883,581 (ー)	千株 1,268	千円 3,297,419

(注) 金額は受渡代金。

(注) 単位未満は切捨て。

(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

(2023年10月7日～2024年10月3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	5,181,001千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,300,795千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	3.98

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2023年10月7日～2024年10月3日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 1,883	百万円 113	% 6.0	百万円 3,297	百万円 105	% 3.2

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	4,331千円
うち利害関係人への支払額 (B)	144千円
(B) / (A)	3.3%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは株式会社 S B I 証券です。

○組入資産の明細

(2024年10月3日現在)

有価証券等の組入れはございません。

国内株式

銘柄	期首(前期末)	
	株数	
		千株
鉱業		
INPEX	22	
食料品		
伊藤園	8	
化学		
トリケミカル研究所	12	
デクセリアルズ	6	
ユニ・チャーム	3	
医薬品		
ロート製薬	13.5	
第一三共	3	
ガラス・土石製品		
東洋炭素	3	
機械		
FUJII	15	
ディスコ	1.3	
小松製作所	7	
三菱重工業	5.5	
電気機器		
ソニーグループ	3	
エンプラス	3.5	
新光電気工業	3.5	
輸送用機器		
トヨタ自動車	20	
情報・通信業		
SHIFT	0.5	
ビジュアル	6.5	

銘柄	期首(前期末)	
	株数	
		千株
フューチャー	23	
大塚商会	4.2	
Globe	6	
日本電信電話	140	
ソフトバンクグループ	5.9	
卸売業		
ジーデップ・アドバンス	0.5	
三井物産	7	
小売業		
エービーシー・マート	15.7	
ジンズホールディングス	16	
ファーストリテイリング	1.7	
銀行業		
三菱UFJフィナンシャル・グループ	42	
証券、商品先物取引業		
大和証券グループ本社	47	
保険業		
東京海上ホールディングス	14	
その他金融業		
オリックス	14	
不動産業		
三井不動産	20	
サービス業		
アンビスホールディングス	10	
合 計	株数	503
	銘柄数	34

○投資信託財産の構成

(2024年10月3日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 658,654	% 100.0
投資信託財産総額	658,654	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2024年10月3日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	658,654,723
コール・ローン等	658,651,046
未収利息	3,677
(B) 負債	0
(C) 純資産総額(A－B)	658,654,723
元本	265,949,668
償還差益金	392,705,055
(D) 受益権総口数	265,949,668口
1万口当たり償還価額(C／D)	24,766円14銭

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、2.476614円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は600,659,395円、期中追加設定元本額は82,641,387円、期中一部解約元本額は417,351,114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、以下の通りです。

日本の未来図(米ドル投資型)	177,020,268円
日本の未来図(円投資型)	88,929,400円

○損益の状況 (2023年10月7日～2024年10月3日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	14,298,425
受取配当金	14,220,720
受取利息	82,141
その他収益金	135
支払利息	△ 4,571
(B) 有価証券売買損益	246,272,075
売買益	408,309,745
売買損	△162,037,670
(C) その他費用等	△ 1,855
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	260,568,645
(E) 前期繰越損益金	599,348,588
(F) 追加信託差損益金	124,447,935
(G) 解約差損益金	△591,660,113
償還差益金(D＋E＋F＋G)	392,705,055

(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。

＜お知らせ＞

「日本の未来図(米ドル投資型)」、「日本の未来図(円投資型)」が償還となり、当ファンドを投資対象とする証券投資信託がなくなることから、投資信託約款の規定に基づき投資信託契約を解約し、2024年10月3日をもちまして繰上償還となりました。