

第2期

運用報告書(全体版)

ROBOPROファンド

【2024年12月19日決算】

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「ROBOPROファンド」は、2024年12月19日に第2期決算を迎えましたので、期中の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。

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。

SBI 岡三アセットマネジメント

〒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／内外／資産複合	
信託期間	2023年12月28日から2045年12月19日までです。	
運用方針	ROBOPRO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、世界の取引所に上場しているETFに投資することにより、実質的に世界の株式、債券、リートおよびコモディティに分散投資し、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
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。
	ROBOPROマザーファンド	世界の取引所の上場投資信託証券(ETF)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。
	ROBOPRO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割合には制限を設けません。
分配方針	毎年6月19日および12月19日(それぞれ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、分配対象収益の範囲内で、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等によっては、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			投資信託 組入比率	純資産 総額
		税分 込配 み金	期騰 落	中率		
(設定日) 2023年12月28日	円 10,000	円 —		% —	% —	百万円 2,900
1期(2024年6月19日)	11,558	100		16.6	98.3	10,913
2期(2024年12月19日)	12,067	200		6.1	98.2	25,388

(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) 当ファンドは、各資産の配分比率を機動的に変更して運用を行います。そのため、当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、投資信託証券組入比率は実質比率を記載しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

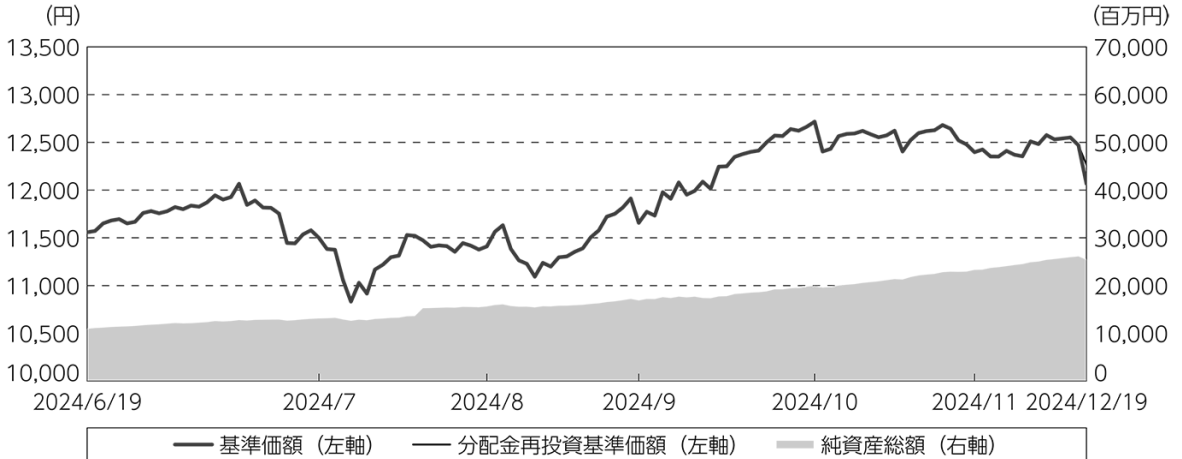
年 月 日	基 準	価 額		投資信託 組入比率	託 券 率
		騰 落	率		
(期 首) 2024年6月19日	円 11,558		% —		% 98.3
6月末	11,760		1.7		97.9
7月末	11,499		△ 0.5		97.7
8月末	11,410		△ 1.3		96.3
9月末	11,657		0.9		97.3
10月末	12,717		10.0		98.3
11月末	12,397		7.3		94.9
(期 末) 2024年12月19日	12,267		6.1		98.2

(注) 期末基準価額は1万口当たり分配金(税引前)込み、騰落率は期首比。

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2024年6月20日～2024年12月19日)



期首：11,558円

期末：12,067円 (既払分配金(税引前)：200円)

騰落率： 6.1% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)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) 分配金再投資基準価額は、期首(2024年6月19日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドの主な投資対象である「ROBOPROマザーファンド」における主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・米国株式や金、米国不動産の上昇などがプラスに寄与しました。

(主なマイナス要因)

- ・米ドル/円の高騰(円高)などがマイナスに影響しました。

投資環境

(2024年6月20日～2024年12月19日)

米国株式は、堅調な経済や半導体・AI（人工知能）関連株の好決算、利下げなどから大きく上昇しました。

米国を除く先進国株式は、欧州では政治の不透明感や業績の悪化、日本では円高などが上値を抑えましたが、欧州中央銀行（ECB）の利下げや、日本では経済対策への期待などが株価を下支えました。

新興国株式は、景気刺激策が好感された中国株の上昇から2024年9月に大きく上昇しました。しかしその後は、米ドル高や決算が市場予想をやや下回ったことによるインド株の下落などから上げ幅を縮小しました。

米国債券は、インフレ率の低下を背景に利下げ期待が高まり、2024年9月中旬にかけて長期金利が低下しました。しかしその後、堅調な経済指標や拡張的財政政策への懸念から長期金利が上昇に転じました。

米ドル建てハイイールド債券は、米金利の低下に加え、堅調な米経済を受けスプレッドがタイト化したことやクーポン収入などから上昇しました。

新興国債券は、米国の利下げ期待から2024年9月末にかけて上昇しました。しかしその後は、米金利の上昇や米ドル高などから上げ幅を縮小しました。

米国不動産は、米金利の低下などを受けて上昇しましたが、期末にかけて米金利が上昇し、上げ幅を縮小しました。

金は、米金利の低下や中東情勢など地政学リスクの高まりから大きく上昇しました。

為替は、日米の金利差縮小などから2024年9月に米ドル/円は下落（円高）しましたが、その後は堅調な米経済などを受け上昇（円安）し、当期間では小幅な動きとなりました。

当ファンドのポートフォリオ

(2024年6月20日～2024年12月19日)

「ROBOPROマザーファンド」受益証券の組入比率は、期を通じて100%に近い高水準を維持しました。

「ROBOPROマザーファンド」の運用につきましては、運用の基本方針に則り、上場投資信託証券（ETF）の組入比率を高位に保ち、実質的に世界の株式、債券、リートおよびコモディティに分散投資を行いました。株式会社FOLIOから投資対象資産の配分比率に関する助言を受け、マーケットデータなどの分析に加え対象資産の期待収益率、リスクおよび相関等の推計値を考慮し配分比率を決定しました。また配分比率の見直しは、1ヵ月毎に行ったほか、2024年11月には米大統領選挙後の相場動向を踏まえ臨時見直しも実施しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2024年6月20日～2024年12月19日)

当ファンドはベンチマークおよび参考指数がないため、本項目は記載していません。

分配金

(2024年6月20日～2024年12月19日)

当期の分配金につきましては、分配可能額、基準価額水準等を勘案して、以下のとおりといたしました。なお、収益分配に充てなかった留保益につきましては、運用の基本方針と同一の運用を行ってまいります。

(単位：円、1万口当たり・税引前)

項 目	第 2 期
	2024年6月20日～ 2024年12月19日
当期分配金	200
(対基準価額比率)	1.630%
当期の収益	200
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,066

(注) 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。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

<ROBOPROファンド>

運用の基本方針に則り、主要投資対象である「ROBOPROマザーファンド」受益証券の組入比率を高水準に維持することにより、投資信託財産の成長を目指して運用してまいります。

○ROBOPROマザーファンド

世界の取引所に上場しているETFに投資することにより、実質的に世界の株式、債券、リートおよびコモディティに分散投資を行い、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。株式会社FOLIOから投資対象資産の配分比率に関する助言を受けます。各資産の配分については、マーケットデータなどの分析に加え対象資産の期待収益率、リスクおよび相関等の推計値を考慮し配分比率を決定し、配分比率の見直しは原則として1ヵ月毎に行います。またETFの組入比率は高位を保つことを基本とし、実質組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

○ 1万口当たりの費用明細

(2024年6月20日～2024年12月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	93	0.783	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(53)	(0.441)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(39)	(0.331)	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 ）	(1)	(0.011)	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	6	0.051	(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
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(6)	(0.051)	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	1	0.004	(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
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(1)	(0.004)	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	1	0.008	(d) 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 ）	(0)	(0.002)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(1)	(0.007)	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、金融商品取引を行う為の識別番号取得費用
合 計	101	0.846	
期中の平均基準価額は、11,906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。

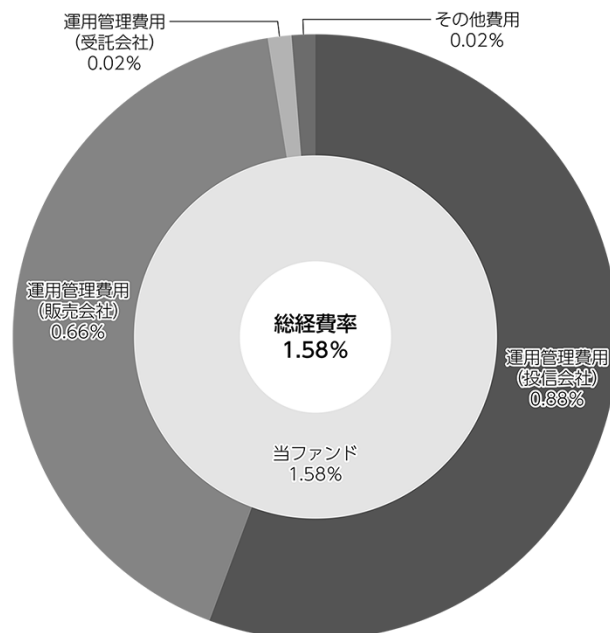
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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1.58%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) 当ファンドの費用は、マザーファンドを通じて実質的に投資する上場投資信託証券 (ETF) が支払った費用は含みません。

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

○売買及び取引の状況

(2024年6月20日～2024年12月19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
ROBOPROマザーファンド	11,073,259 千口	13,691,965 千円	274,850 千口	337,323 千円

(注) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2024年6月20日～2024年12月19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

(2024年12月19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
ROBOPROマザーファンド	9,151,109 千口	19,949,518 千口	25,118,438 千円

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年12月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ROBOPROマザーファンド	25,118,438 千円	96.5 %
コール・ローン等、その他	904,675	3.5
投資信託財産総額	26,023,113	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(注) ROBOPROマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(25,217,297千円)の投資信託財産総額(25,222,255千円)に対する比率は100.0%です。

(注) 外貨建資産は、当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、邦貨換算レートは1米ドル＝154.94円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年12月19日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	26,023,113,791
コール・ローン等	904,671,126
ROBOPROマザーファンド(評価額)	25,118,438,356
未収利息	4,309
(B) 負債	634,632,190
未払収益分配金	420,792,569
未払解約金	80,481,775
未払信託報酬	132,240,382
その他未払費用	1,117,464
(C) 純資産総額(A-B)	25,388,481,601
元本	21,039,628,454
次期繰越損益金	4,348,853,147
(D) 受益権総口数	21,039,628,454口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,067円

- (注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1,2067円です。
(注) 当ファンドの期首元本額は9,442,245,508円、期中追加設定元本額は14,444,891,960円、期中一部解約元本額は2,847,509,014円です。

○損益の状況 (2024年6月20日～2024年12月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	256,747
受取利息	256,747
(B) 有価証券売買損益	862,807,404
売買益	1,005,082,332
売買損	△ 142,274,928
(C) 信託報酬等	△ 133,357,846
(D) 当期損益金(A+B+C)	729,706,305
(E) 前期繰越損益金	634,240,993
(F) 追加信託差損益金	3,405,698,418
(配当等相当額)	(1,095,780,291)
(売買損益相当額)	(2,309,918,127)
(G) 計(D+E+F)	4,769,645,716
(H) 収益分配金	△ 420,792,569
次期繰越損益金(G+H)	4,348,853,147
追加信託差損益金	3,405,698,418
(配当等相当額)	(1,110,022,053)
(売買損益相当額)	(2,295,676,365)
分配準備積立金	943,154,729

- (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(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。
(注) 収益分配金

決算期	第2期
(a) 配当等収益(費用控除後)	89,994,699円
(b) 有価証券等損益額(費用控除後、繰越欠損金補填後)	639,711,606円
(c) 信託約款に規定する収益調整金	3,405,698,418円
(d) 信託約款に規定する分配準備積立金	634,240,993円
分配対象収益(a+b+c+d)	4,769,645,716円
分配対象収益(1万口当たり)	2,266円
分配金額	420,792,569円
分配金額(1万口当たり)	200円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税引前）	200円
支払開始日	2024年12月25日（水）までの間に支払いを開始します。
お支払場所	取得申込みを取扱った販売会社の本支店

〈お知らせ〉

該当事項はございません。

ROBOPROマザーファンド

第1期 運用状況のご報告

決算日：2024年12月19日

当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	世界の取引所に上場しているETFへの投資を通じて、実質的に世界の株式、債券、リートおよびコモディティに分散投資し、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	世界の取引所の上場投資信託証券（ETF）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	騰落率		投資信託証券組入比率	純資産総額
		期騰	中率		
(設定日)	円		%	%	百万円
2023年12月28日	10,000		—	—	2,886
1期(2024年12月19日)	12,591		25.9	99.2	25,222

(注) 基準価額は1万口当たり。

(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) 当ファンドは、各資産の配分比率を機動的に変更して運用を行います。そのため、当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数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

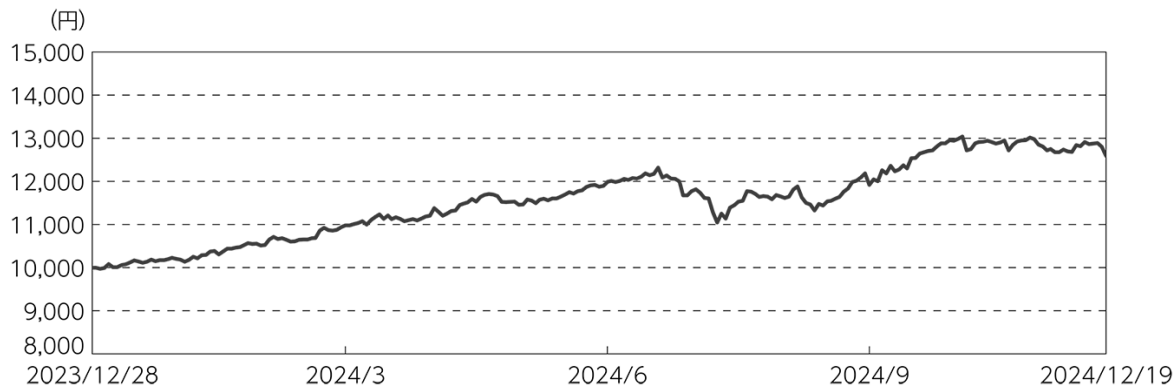
年月日	基準価額	騰落率		投資信託証券組入比率	純資産総額
		騰	落		
(設定日)	円		%	%	
2023年12月28日	10,000		—	—	
12月末	9,974		△ 0.3		97.4
2024年1月末	10,185		1.9		97.6
2月末	10,511		5.1		99.0
3月末	10,978		9.8		97.8
4月末	11,382		13.8		99.5
5月末	11,462		14.6		96.5
6月末	11,988		19.9		99.5
7月末	11,736		17.4		99.5
8月末	11,647		16.5		97.9
9月末	11,920		19.2		99.2
10月末	13,040		30.4		99.5
11月末	12,720		27.2		95.4
(期末)					
2024年12月19日	12,591		25.9		99.2

(注) 騰落率は設定日比。

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2023年12月28日～2024年12月19日)



○基準価額の主な変動要因

当ファンドにおける主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・米ドル/円や金、米国株式の上昇などがプラスに寄与しました。

(主なマイナス要因)

- ・特にありません。

投資環境

(2023年12月28日～2024年12月19日)

米国株式は、堅調な経済や半導体・AI（人工知能）関連株の好決算、利下げなどから大きく上昇しました。

米国を除く先進国株式は、2024年9月頃まで堅調な業績などに支えられ上昇しましたが、その後は政治の不透明感や業績の悪化などから上げ幅を縮小しました。

新興国株式は、景気刺激策を受けた中国株の上昇や、成長期待を背景とするインド株の上昇などから2024年9月頃にかけて大きく上昇しました。その後は、米ドル高を受けた新興国からの資金流出などにより上げ幅を縮小しました。

米国債券は、当初は利下げ開始時期の後ずれ観測があったものの、インフレ率の低下を背景に利下げ期待が高まり、2024年9月中旬にかけて長期金利が低下しました。しかしその後、堅調な経済指標や拡張的財政政策への懸念から長期金利が上昇に転じました。

米ドル建てハイイールド債券は、米金利の低下に加え、堅調な米経済を受けスプレッドがタイト化したことやクーポン収入などから上昇しました。

新興国債券は、米国の利下げ期待や株式市場の上昇などを背景とする投資家心理の改善から2024年9月末にかけて上昇しました。しかしその後は、米金利の上昇や米ドル高などから上げ幅を縮小しました。

米国不動産は、当初は米金利の上昇などを受けて下落したものの、米金利が低下に転じると大きく上昇しました。しかし期末にかけて米金利が再び上昇し、上げ幅を縮小しました。

金は、中東情勢など地政学リスクの高まりや各国中央銀行の金購入継続などから大きく上昇しました。

為替は、日米の金利差拡大などから米ドル/円は2024年7月中旬にかけて大きく上昇（円安）しました。しかしその後、日本の通貨当局が為替介入を行ったことや米金利の低下などを受けて9月中旬にかけて米ドル/円は下落（円高）しました。その後、米国の堅調な経済指標や拡張的財政政策への懸念などから再び米金利が上昇し、米ドル/円も上昇に転じました。

当ファンドのポートフォリオ

(2023年12月28日～2024年12月19日)

運用の基本方針に則り、上場投資信託証券（ETF）の組入比率を高位に保ち、実質的に世界の株式、債券、リートおよびコモディティに分散投資を行いました。株式会社FOLIOから投資対象資産の配分比率に関する助言を受け、マーケットデータなどの分析に加え対象資産の期待収益率、リスクおよび相関等の推計値を考慮し配分比率を決定しました。また配分比率の見直しは、1ヵ月毎に行ったほか、2024年11月には米大統領選挙後の相場動向を踏まえ臨時見直しも実施しました。

今後の運用方針

世界の取引所に上場しているETFに投資することにより、実質的に世界の株式、債券、リートおよびコモディティに分散投資を行い、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。株式会社FOLIOから投資対象資産の配分比率に関する助言を受けます。各資産の配分については、マーケットデータなどの分析に加え対象資産の期待収益率、リスクおよび相関等の推計値を考慮し配分比率を決定し、配分比率の見直しは原則として1ヵ月毎に行います。またETFの組入比率は高位を保つことを基本とし、実質組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年12月28日～2024年12月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券)	円 19 (19)	% 0.169 (0.169)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (投 資 信 託 証 券)	1 (1)	0.008 (0.008)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	0 (0) (0)	0.004 (0.003) (0.000)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の 送金・資産の移転等に要する費用 その他は、金融商品取引を行う為の識別番号取得費用等
合 計	20	0.181	
期中の平均基準価額は、11,461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12月28日～2024年12月19日)

投資信託証券

銘	柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外 国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	iShares U.S. Real Estate ETF	746,350	69,684	414,880	39,848
	Vanguard Total Stock Market ETF	254,250	68,001	235,780	67,367
	Vanguard FTSE Emerging Markets ETF	1,147,140	51,858	431,540	18,445
	iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	500,820	39,708	234,910	18,579
	Vanguard Total Bond Market ETF	570,420	41,319	568,430	41,551
	Vanguard FTSE Developed Markets ETF	1,068,280	53,726	532,630	27,069
	iShares J.P. Morgan USD Emerging Markets Bond ETF	13,210	1,178	13,210	1,167
	SPDR® Gold MiniShares® Trust	1,256,650	60,171	350,360	17,645
小計	5,557,120	385,648	2,781,740	231,674	

(注) 金額は受渡代金。
(注) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2023年12月28日～2024年12月19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

(2024年12月19日現在)

外国投資信託証券

銘	柄	口数	当期末		比率
			評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		口	千米ドル	千円	%
iShares U.S. Real Estate ETF		331,470	30,544	4,732,636	18.8
Vanguard Total Stock Market ETF		18,470	5,363	831,021	3.3
Vanguard FTSE Emerging Markets ETF		715,600	32,223	4,992,704	19.8
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF		265,910	20,786	3,220,611	12.8
Vanguard Total Bond Market ETF		1,990	143	22,258	0.1
Vanguard FTSE Developed Markets ETF		535,650	25,936	4,018,550	15.9
SPDR® Gold MiniShares® Trust		906,290	46,556	7,213,404	28.6
合計		2,775,380	161,554	25,031,186	
	銘	口数	金額	金額	比率
		7	—	<99.2%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別投資信託証券評価額の比率。
(注) 口数・評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年12月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 25,031,186	% 99.2
コール・ローン等、その他	191,069	0.8
投資信託財産総額	25,222,255	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(注) 当期末における外貨建純資産(25,217,297千円)の投資信託財産総額(25,222,255千円)に対する比率は100.0%です。

(注) 外貨建資産は、当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、邦貨換算レートは1米ドル＝154.94円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年12月19日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	円 25,222,255,481
コール・ローン等	140,358,773
投資信託受益証券(評価額)	25,031,186,815
未収配当金	50,709,870
未収利息	23
(B) 負債	0
(C) 純資産総額(A-B)	25,222,255,481
元本	20,031,303,349
次期繰越損益金	5,190,952,132
(D) 受益権総口数	20,031,303,349口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,591円

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1.2591円です。

(注) 当ファンドの当初設定元本額は2,886,100,000円、期中追加設定元本額は18,162,644,702円、期中一部解約元本額は1,017,441,353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。

ROBOPROファンド	19,949,518,193円
私募ROBOPROファンド(適格機関投資家専用)	81,785,156円

○損益の状況 (2023年12月28日～2024年12月19日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	円 203,102,811
受取配当金	201,608,460
受取利息	1,500,278
支払利息	△ 5,927
(B) 有価証券売買損益	1,768,804,315
売買益	2,494,107,307
売買損	△ 725,302,992
(C) その他費用等	△ 387,348
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,971,519,778
(E) 追加信託差損益金	3,480,474,680
(F) 解約差損益金	△ 261,042,326
(G) 計(D+E+F)	5,190,952,132
次期繰越損益金(G)	5,190,952,132

(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(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(F)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>

該当事項はございません。