

世界銀行債券ファンド（毎月分配型） 〈愛称 ワールドサポーター〉

運用報告書（全体版）

第197期（決算日 2023年11月13日） 第199期（決算日 2024年1月12日） 第201期（決算日 2024年3月12日）
第198期（決算日 2023年12月12日） 第200期（決算日 2024年2月13日） 第202期（決算日 2024年4月12日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
「世界銀行債券ファンド（毎月分配型）」は、2024年4月12日に第202期の決算を行ないましたので、第197期から第202期の運用状況をまとめてご報告申しあげます。
今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申しあげます。

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／海外／債券
信託期間	2007年6月21日から原則無期限です。
運用方針	主として投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。）に投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	「ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA」受益証券 「マネー・オープン・マザーファンド」受益証券 上記の投資信託証券を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 外貨建資産への直接投資は行ないません。
分配方針	第1計算期は収益分配を行ないません。第2計算期以降、毎決算時、基準価額水準などを勘案して、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。

<940860>

日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号
www.nikkoam.com/

当運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター 電話番号：0120-25-1404
午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			債組入率	証券組入率	信託証券率	純資産総額
		税分	込配	み金騰落				
	円	円	円	騰落率	%	%	百万円	
173期(2021年11月12日)	2,160		10		1.3	—	98.5	10,471
174期(2021年12月13日)	2,094		10		△2.6	—	98.5	10,055
175期(2022年1月12日)	2,137		10		2.5	—	98.3	10,158
176期(2022年2月14日)	2,157		10		1.4	—	98.8	9,979
177期(2022年3月14日)	2,097		10		△2.3	—	98.7	9,613
178期(2022年4月12日)	2,273		10		8.9	—	98.6	10,265
179期(2022年5月12日)	2,247		10		△0.7	—	98.5	9,998
180期(2022年6月13日)	2,334		10		4.3	—	98.6	10,278
181期(2022年7月12日)	2,254		10		△3.0	—	98.5	9,869
182期(2022年8月12日)	2,251		10		0.3	—	98.6	9,796
183期(2022年9月12日)	2,367		10		5.6	—	98.5	10,214
184期(2022年10月12日)	2,336		10		△0.9	—	98.6	9,989
185期(2022年11月14日)	2,309		10		△0.7	—	98.5	9,778
186期(2022年12月12日)	2,243		10		△2.4	—	98.5	9,472
187期(2023年1月12日)	2,233		10		0.0	—	98.7	9,394
188期(2023年2月13日)	2,198		10		△1.1	—	98.6	9,199
189期(2023年3月13日)	2,262		10		3.4	—	98.4	9,431
190期(2023年4月12日)	2,289		5		1.4	—	98.6	9,528
191期(2023年5月12日)	2,331		5		2.1	—	98.6	9,558
192期(2023年6月12日)	2,452		5		5.4	—	98.6	9,875
193期(2023年7月12日)	2,488		5		1.7	—	98.6	9,886
194期(2023年8月14日)	2,559		5		3.1	—	98.5	10,003
195期(2023年9月12日)	2,545		5		△0.4	—	98.7	9,857
196期(2023年10月12日)	2,558		5		0.7	—	98.5	9,823
197期(2023年11月13日)	2,644		5		3.6	—	98.5	10,050
198期(2023年12月12日)	2,593		5		△1.7	—	98.3	9,759
199期(2024年1月12日)	2,630		5		1.6	—	98.3	9,761
200期(2024年2月13日)	2,668		5		1.6	—	98.2	9,780
201期(2024年3月12日)	2,652		5		△0.4	—	98.2	9,563
202期(2024年4月12日)	2,746		5		3.7	—	98.3	9,833

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 複数の投資信託に分散投資を行なうため、適切なベンチマークおよび参考指数はございません。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

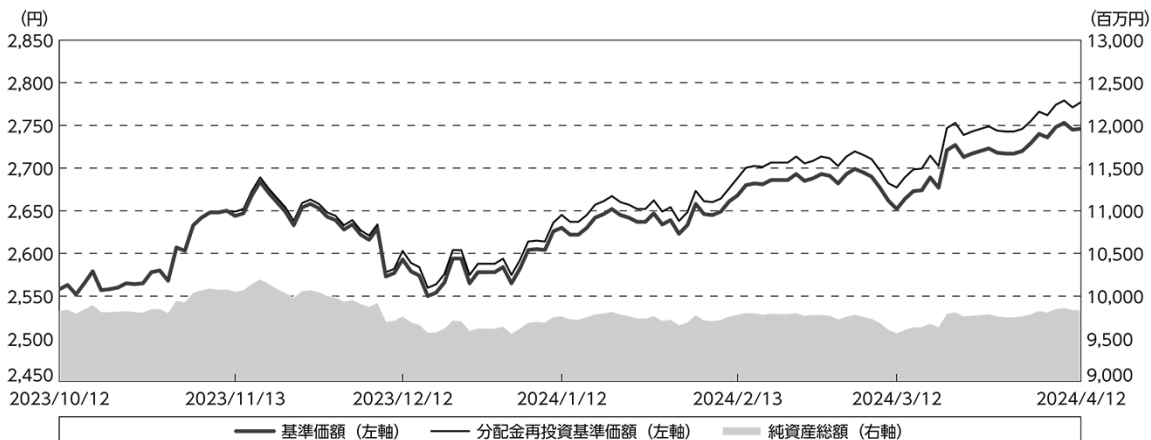
決 算 期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		投 資 信 託 組 入 比	託 券 率
第197期	(期 首) 2023年10月12日	円 2,558		% -		% 98.5
	10月末	2,568		0.4		98.5
	(期 末) 2023年11月13日	2,649		3.6		98.5
第198期	(期 首) 2023年11月13日	2,644		-		98.5
	11月末	2,639		△0.2		98.6
	(期 末) 2023年12月12日	2,598		△1.7		98.3
第199期	(期 首) 2023年12月12日	2,593		-		98.3
	12月末	2,565		△1.1		98.5
	(期 末) 2024年1月12日	2,635		1.6		98.3
第200期	(期 首) 2024年1月12日	2,630		-		98.3
	1月末	2,639		0.3		98.5
	(期 末) 2024年2月13日	2,673		1.6		98.2
第201期	(期 首) 2024年2月13日	2,668		-		98.2
	2月末	2,691		0.9		98.5
	(期 末) 2024年3月12日	2,657		△0.4		98.2
第202期	(期 首) 2024年3月12日	2,652		-		98.2
	3月末	2,718		2.5		98.4
	(期 末) 2024年4月12日	2,751		3.7		98.3

(注) 期末の基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

○運用経過

（2023年10月13日～2024年4月12日）

作成期間中の基準価額等の推移



第197期首：2,558円

第202期末：2,746円（既払分配金（税込み）：30円）

騰落率：8.6%（分配金再投資ベース）

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

（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、作成期首（2023年10月12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。

（注）当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主として、世界銀行が発行する新興国通貨建て債券を投資対象とする投資信託証券に投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行なっております。当作成期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

＜値上がり要因＞

- ・高利回りの新興国通貨建て世界銀行債券からの利息収入を得たこと。
- ・コロンビアペソ、メキシコペソ、ポーランドズロチなどを中心として、ポートフォリオの一部の組入通貨が対円で上昇したこと。

＜値下がり要因＞

- ・信用スプレッド（利回り格差）が拡大したこと。

投資環境

（債券市況）

期間中に市場の主要テーマとなったのは、米国を中心とした好調な経済活動と緩やかに減速しながらも高止まりするインフレで、これらが市場価格に影響を及ぼし、こうした環境が債券利回りに上昇（債券価格は下落）圧力をもたらしめました。市場では米国連邦準備制度理事会（FRB）や欧州中央銀行（ECB）がともに政策金利を高水準で長期間維持するとの見方が広がりました。地政学的な不透明感があるなかでも、ソフトランディング（経済の軟着陸）のテーマが再浮上したことやFRBを中心として各中央銀行がハト派（金融緩和的な政策を支持）的な姿勢を示したことを受けて、市場のセンチメントはポジティブなものとなりました。投資家の間では利上げサイクルが終了したかもしれないとの見方が強まりました。2023年11月の米国連邦公開市場委員会（FOMC）では、金融環境が十分に引き締められているとの見方が示され、投資家心理は一層良好なものとなりました。FRBが予想外に政策に関する姿勢を転換したことを受けて、市場ではFRBの姿勢の転換は積極的な引き締めサイクルの終了や利下げ開始の可能性を示唆していると解釈され、相場は上昇しました。期間の後半はリスク選好度が高まったことから、アメリカドルには大きな逆風がかかりました。その後も、引き続き米国の経済指標は市場予想を上回り、2023年第4四半期の国内総生産（GDP）成長率（速報値）は前四半期比で3.3%と、市場予想を上回りました。12月の消費者物価指数（CPI）上昇率も加速し、総合およびコア指数がともに市場予想を上回りました。ユーロ圏では、様々な国で一連の購買担当者景気指数（PMI）が良好な結果となり、サービス部門の顕著な回復が示されました。経済指標が総じて底堅く推移していることから、債券利回りは上昇傾向が続きました。

世界の新興国市場は、世界的な景気後退に陥るとの懸念が後退したことなどを受けて、下支えされた状態が続きました。こうしたなか、新興国の信用スプレッドは縮小し、現地通貨建て債券利回りが低下（債券価格は上昇）するなど、多くのリスク資産が上昇しました。インフレが鈍化し、経済成長が堅調となるなど良好な環境となっていることを受けて、新興国の各中央銀行は為替レートに過度な圧力を与えることなく利下げを継続することが可能となりました。このところ新興国通貨は幾分軟調となっていますが、これは新興国通貨の下落よりもアメリカドルの上昇が主な要因となっています。

（国内短期金利市況）

無担保コール翌日物金利は、期間の初めの-0.03%近辺から、日銀によるマイナス金利政策の下でコール市場でもマイナス圏での取引が続いたものの、2024年3月の金融政策決定会合においてマイナス金利政策の解除が決定されたことから、0.08%近辺で期間末を迎えました。

国庫短期証券（TB）3ヵ月物金利は、期間の初めの-0.21%近辺から、日銀による国債買入れの継続などを受けてマイナス圏での推移が続いたものの、2024年3月にはマイナス金利政策の解除が決定されたことから、0.00%近辺で期間末を迎えました。

当ファンドのポートフォリオ

（当ファンド）

当ファンドは、収益性を追求するため、「ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA」受益証券を高位に組み入れ、「マネー・オープン・マザーファンド」受益証券への投資を抑制しました。

（ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA）

当ファンドでは、新興国通貨建ての世界銀行の短期債券を中心に分散投資を行ないました。期間末時点で

は、メキシコペソ、インドネシアルピア、ポーランドズロチ、ブラジルレアル、インドルピー、南アフリカランド、チリペソ、中国人民元、コロンビアペソなどの通貨建ての世界銀行債券に投資を行なっています。期間中、ファンダメンタルズ（経済の基礎的条件）面の追い風が強く、インカム創出力が魅力的な水準にあるとみられる通貨の投資比率を高位に維持しました。

インドについては、多くの多国籍企業がサプライチェーン（供給網）の分散を図っており、競争力のある賃金、労働力の増加、力強い生産性の伸びに支えられ、テクノロジーセクター内で主要な恩恵を受ける立場にあるとみられることから、インドルピーに対して中期的にポジティブな見方を維持しています。また、JPモルガンの新興国債券指数「GBI-EMインデックス」に同国が採用されることにより資金が流入するとみられます。EMEA（欧州・中東・アフリカ）地域では、ポーランドの状況が際立っています。同国は、堅調な内需と競争力のある輸出基盤によって下支えされた、中東欧最大且つ非常に多様性のある経済を持ち、様々な外部環境が低迷する局面でその影響が緩和されてきました。特に新型コロナウイルス危機の間に、ポーランドは輸出や大幅な財政出動・金融緩和が追い風となり、多くの欧州諸国をアウトパフォームしました。欧州連合（EU）加盟以降、EU基金の最大の受益国の1つとなっており、最近の地政学的な動向を受けてロシア産エネルギー（炭化水素）からの独立性を確保しています。中南米では、ファンダメンタルズが堅固であり米国の近隣国であるメキシコを 선호しました。メキシコ経済は米国の経済動向と密接に関連しており、2%の成長が見込まれていますが、これまでの金融引き締め措置の影響で減速する可能性があります。しかし、足元で米国経済の底堅さが市場予想を上回っている模様であり、これがメキシコの経済見通しに好影響をもたらすかもしれません。メキシコは、世界の経済状況の変化によってもたらされる成長機会を捉えながら、潜在的な経済問題を克服するための戦略的な準備を整えています。

（マネー・オープン・マザーファンド）

運用の基本方針に従い、国庫短期証券の購入や現先取引、コール・ローンや金銭信託などを通じて、元本の安全性を重視した運用を行ないました。

当ファンドは、原則として世界銀行が発行する債券でポートフォリオを構築しており、その運用方針においてESG（環境・社会・ガバナンス（企業統治））を主要な要素としていることから、日興アセットマネジメントが「金融商品取引業者等向けの総合的な監督指針」を踏まえて定めた「ESG投信」です。世界銀行は、発行する債券を通じて調達した資金で、貧困削減と持続的成長の実現に向け、主に新興国に対して融資や政策助言などを提供しています。

ESGを主要な要素として選定した投資対象への投資比率は100%（当期期末、組入債券の純資産比）としました。

日興アセットマネジメントのESG投資の詳細につきましては、以下のWEBサイトをご参照ください。

<https://www.nikkoam.com/sustainability>

日興アセットマネジメントヨーロッパリミテッドは日興アセットマネジメントのグループ会社として、同グループのステewardシップ方針に基づき、ステewardシップ責任を果たしています。日興アセットマネジメントグループ（以下、「当社グループ」）では、ESG要素の考慮について、お客様に対する受託者責任の不可欠な一部であると考えています。ESG課題に関する投資先企業とのエンゲージメント（目的を持った建設的な対話）および議決権行使は、株式運用におけるステewardシップ活動の主な手段であり、当社グループは議決権行使がお客様の利益に資するよう、細心の注意を払いました。債券運用においては、発行体とのエンゲージメントなど、他のステewardシップ手段を用いることで、積極的な投資家となることをめざしました。

当社グループのステewardシップ方針の詳細は、ホームページでご確認いただけます。

<https://www.nikkoam.com/about/stewardshipcode/policy>

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

分配金

分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案し、以下のとおりといたしました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、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

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項 目	第197期	第198期	第199期	第200期	第201期	第202期
	2023年10月13日～ 2023年11月13日	2023年11月14日～ 2023年12月12日	2023年12月13日～ 2024年1月12日	2024年1月13日～ 2024年2月13日	2024年2月14日～ 2024年3月12日	2024年3月13日～ 2024年4月12日
当期分配金	5	5	5	5	5	5
（対基準価額比率）	0.189%	0.192%	0.190%	0.187%	0.188%	0.182%
当期の収益	5	5	5	5	5	5
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	84	85	87	90	90	93

（注）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）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

（当ファンド）

引き続き、「ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA」受益証券を原則として高位に組み入れ、「マネー・オープン・マザーファンド」受益証券への投資を抑制する方針です。

（ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA）

新興国市場では、2024年上半年期に米国経済のリセッション入りが回避されるなかで世界経済が減速するとの予想が追い風となり、現地通貨建て債券市場を中心に新興国資産の短期的な見通しが楽観的になっているように思われます。世界的にインフレ率は引き続き低水準で推移しており、新興国市場では低下傾向が継続すると予想されることから、現地通貨建て新興国債券にとって有利な環境が生まれるとみています。中国では、中国政府が経済成長を下支えするために実施した財政、金融、住宅の各政策によって、経済成長率が2024年1-3月期まで5.5%に維持されると見込まれていますが、それ以降は通常のペースに戻る可能性が高いとみられています。ブラジル、中欧、トルコを含む、中国以外の新興国市場では、内需の回復に牽引され、2024年1-3月期の経済成長が回復すると予想されています。しかし、足元でハイテク産業の生産高が回復しているにもかかわらず、世界の製造業PMIが示唆する世界的な設備投資の鈍化の可能性がアジア新興国市場の先行き見通しに暗い影を落としています。

アジア新興国市場での金融緩和は、流動性オペの強化から始まると予想されていますが、従来予想されていた2024年下半年よりも早い時期に利下げが実施される可能性もあるとみています。こうした変化の背景には、足元での外部金融環境の改善が追い風となり、インド、インドネシア、マレーシアなどの国々が国際収支の悪化問題に対処するために2023年に実施した金融引き締め措置を緩和する動きを強めていることがあります。欧州・中東・アフリカ（EMEA）新興国市場では、インフレの鈍化を受けて、数カ国の中央銀行が金融政策の緩和を開始しています。特にハンガリー国立銀行とポーランド国立銀行は2023年から利下げを開始しており、チェコ国立銀行とイスラエル銀行が追随して利下げを開始しています。ルーマニア国立銀行は2024年7-9月期に利下げに踏み切ると予想されていますが、前倒して4-6月期に利下げを開始する可能性があります。その一方で、ポーランド国立銀行は、インフレ動向や財政上の懸念から追加利下げを先送りしており、10-12月期に利下げを再開すると予想されています。南アフリカ準備銀行は2024年5月に利下げを開始し、南アフリカランドの対ドル為替レートの安定化がインフレへ及ぼす影響を注視しながら、段階的に利下げを進めていくと見込まれています。中南米新興国市場は、世界的な経済リスクからある程度隔離されており、世界の主要国経済が景気の急減速を回避しソフトランディングするとの予想を前提として、2024年の見通しは良好となっています。世界の主要国経済でインフレの減速ペースが緩やかになり、金融緩和に対して慎重な姿勢が見られるなかで、中南米新興国経済は底堅い成長を維持すると予想されています。ブラジル中央銀行は2024年3月の金融政策委員会で6会合連続となる0.50%の利下げを決定しました。コロンビア共和国銀行は2023年12月の金融政策決定会合における利下げから金融緩和サイクルを開始し、2024年3月の会合では0.50%の利下げを決定しています。今後の政策決定はインフレ動向次第になると思われませんが、追加利下げが実施されるとの予想が多くなっています。チリ中央銀行は、積極的な金融緩和に有利な国内経済環境を利用して、利下げペースを加速しています。ペルー中央準備銀行は金融緩和政策を継続しています。メキシコ銀行はハト派的なシフトを表明し、2024年3月に利下げを開始しました。

引き続き、新興国通貨建ての世界銀行の短期債券に分散投資を行なっていく方針です。原則として、中・長期的に高いリターンが予想される主要新興国の投資比率を高位に維持していく方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

（マネー・オープン・マザーファンド）

引き続き、安定した収益の確保をめざして安定運用を行なう方針です。主要投資対象は、わが国の国債および格付の高い公社債とし、それらの現先取引なども活用する方針です。また、コール・ローンや金銭信託などに投資することもあります。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年10月13日～2024年 4月12日)

項 目	第197期～第202期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 13	% 0.495	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(4)	(0.149)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(9)	(0.330)	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
（ 受 託 会 社 ）	(0)	(0.016)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	0	0.016	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ 印 刷 費 用 等 ）	(0)	(0.014)	印刷費用等は、法定開示資料の印刷に係る費用など
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	13	0.511	
作成期間の平均基準価額は、2,636円です。			

(注) 作成期間の費用（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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

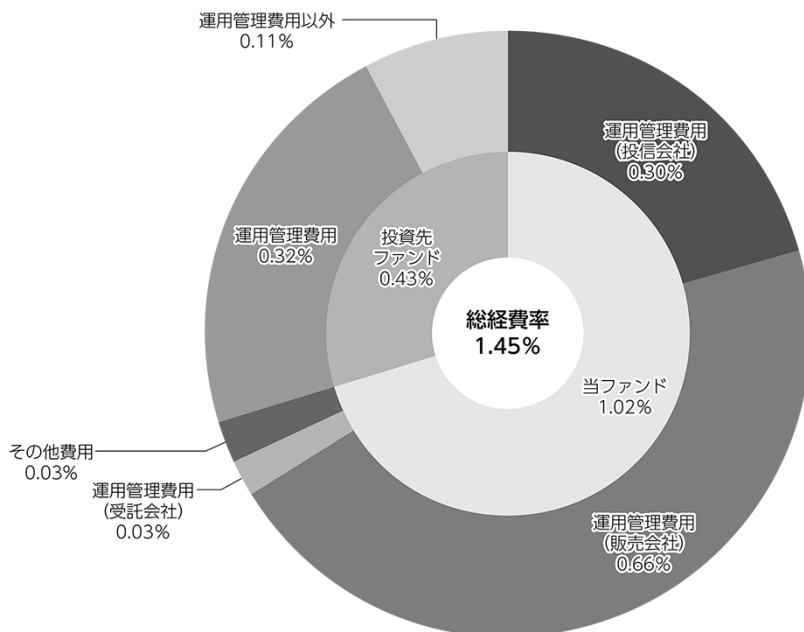
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(注) この他にファンドが投資対象とする投資先においても信託報酬等が発生する場合があります。

（参考情報）

○総経費率

作成期間の運用・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。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.45%です。



(単位:%)

総経費率(①+②+③)	1.45
①当ファンドの費用の比率	1.02
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.32
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.11

(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) 「その他費用」には保管費用が含まれる場合があります。なお、「その他費用」の内訳は「1万口当たりの費用明細」にてご確認ください。ただし、期中の費用の総額と年率換算した値は一致しないことがあります。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託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) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(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13日～2024年4月12日)

投資信託証券

銘柄		第197期～第202期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA	千口 —	千円 —	千口 2,085,706	千円 696,870

(注) 金額は受け渡し代金。

○利害関係人との取引状況等

(2023年10月13日～2024年4月12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。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2023年10月13日～2024年4月12日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2023年10月13日～2024年4月12日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2024年4月12日現在)

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

銘柄		第196期末	第202期末		
		口数	口数	評価額	比率
		千口	千口	千円	%
	ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA	29,899,165	27,813,458	9,662,395	98.3
	合計	29,899,165	27,813,458	9,662,395	98.3

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

親投資信託残高

銘 柄	第196期末	第202期末	
	口 数	口 数	評 価 額
マネー・オープン・マザーファンド	千口 9,000	千口 9,000	千円 9,137

(注) 親投資信託の2024年4月12日現在の受益権総口数は、290,346千口です。

○投資信託財産の構成

(2024年4月12日現在)

項 目	第202期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 9,662,395	% 97.9
マネー・オープン・マザーファンド	9,137	0.1
コール・ローン等、その他	198,498	2.0
投資信託財産総額	9,870,030	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第197期末	第198期末	第199期末	第200期末	第201期末	第202期末
	2023年11月13日現在	2023年12月12日現在	2024年1月12日現在	2024年2月13日現在	2024年3月12日現在	2024年4月12日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	10,104,088,080	9,813,857,857	9,822,068,997	9,823,318,967	9,626,422,917	9,870,030,940
コール・ローン等	196,950,784	211,631,519	217,545,704	174,704,962	222,622,260	198,497,143
投資信託受益証券(評価額)	9,898,000,421	9,593,089,463	9,595,386,418	9,606,613,777	9,394,663,782	9,662,395,579
マネー・オープン・マザーファンド(評価額)	9,136,875	9,136,875	9,136,875	9,136,875	9,136,875	9,137,775
未収入金	—	—	—	32,863,353	—	—
未収利息	—	—	—	—	—	443
(B) 負債	53,343,352	54,576,356	60,359,082	43,015,508	62,519,705	36,844,492
未払収益分配金	19,004,645	18,815,643	18,559,735	18,326,594	18,031,832	17,905,488
未払解約金	23,767,839	25,666,769	31,184,949	13,427,209	34,048,696	7,710,650
未払信託報酬	8,589,852	7,851,421	8,097,681	8,458,139	7,391,057	8,172,086
未払利息	35	26	24	8	37	—
その他未払費用	1,980,981	2,242,497	2,516,693	2,803,558	3,048,083	3,056,268
(C) 純資産総額(A-B)	10,050,744,728	9,759,281,501	9,761,709,915	9,780,303,459	9,563,903,212	9,833,186,448
元本	38,009,291,915	37,631,286,118	37,119,471,210	36,653,189,370	36,063,664,425	35,810,976,678
次期繰越損益金	△27,958,547,187	△27,872,004,617	△27,357,761,295	△26,872,885,911	△26,499,761,213	△25,977,790,230
(D) 受益権総口数	38,009,291,915口	37,631,286,118口	37,119,471,210口	36,653,189,370口	36,063,664,425口	35,810,976,678口
1万口当たり基準価額(C/D)	2,644円	2,593円	2,630円	2,668円	2,652円	2,746円

(注) 当ファンドの第197期首元本額は38,402,679,306円、第197～202期中追加設定元本額は542,707,579円、第197～202期中一部解約元本額は3,134,410,207円です。

(注) 1口当たり純資産額は、第197期0.2644円、第198期0.2593円、第199期0.2630円、第200期0.2668円、第201期0.2652円、第202期0.2746円です。

(注) 2024年4月12日現在、純資産総額は元本額を下回っており、その差額は25,977,790,230円です。

○損益の状況

項 目	第197期	第198期	第199期	第200期	第201期	第202期
	2023年10月13日～ 2023年11月13日	2023年11月14日～ 2023年12月12日	2023年12月13日～ 2024年1月12日	2024年1月13日～ 2024年2月13日	2024年2月14日～ 2024年3月12日	2024年3月13日～ 2024年4月12日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	29,630,335	29,290,965	28,924,607	28,523,218	28,077,005	27,915,163
受取配当金	29,631,399	29,291,954	28,925,393	28,524,019	28,077,323	27,907,801
受取利息	-	-	-	-	-	7,430
支払利息	△ 1,064	△ 989	△ 786	△ 801	△ 318	△ 68
(B) 有価証券売買損益	325,623,151	△ 193,749,849	133,205,928	139,757,490	△ 61,564,930	333,967,949
売買益	326,948,472	1,013,316	133,458,237	140,349,741	924,031	335,847,033
売買損	△ 1,325,321	△ 194,763,165	△ 252,309	△ 592,251	△ 62,488,961	△ 1,879,084
(C) 信託報酬等	△ 8,917,722	△ 8,151,106	△ 8,406,762	△ 8,780,982	△ 7,673,167	△ 8,213,111
(D) 当期損益金(A+B+C)	346,335,764	△ 172,609,990	153,723,773	159,499,726	△ 41,161,092	353,670,001
(E) 前期繰越損益金	△ 9,683,656,085	△ 9,224,767,882	△ 9,262,277,817	△ 9,001,594,467	△ 8,697,462,684	△ 8,672,182,236
(F) 追加信託差損益金	△ 18,602,222,221	△ 18,455,811,102	△ 18,230,647,516	△ 18,012,464,576	△ 17,743,105,605	△ 17,641,372,507
(配当等相当額)	(255,783,206)	(253,517,508)	(250,262,065)	(247,211,235)	(243,428,969)	(241,948,493)
(売買損益相当額)	(△18,858,005,427)	(△18,709,328,610)	(△18,480,909,581)	(△18,259,675,811)	(△17,986,534,574)	(△17,883,321,000)
(G) 計(D+E+F)	△ 27,939,542,542	△ 27,853,188,974	△ 27,339,201,560	△ 26,854,559,317	△ 26,481,729,381	△ 25,959,884,742
(H) 収益分配金	△ 19,004,645	△ 18,815,643	△ 18,559,735	△ 18,326,594	△ 18,031,832	△ 17,905,488
次期繰越損益金(G+H)	△ 27,958,547,187	△ 27,872,004,617	△ 27,357,761,295	△ 26,872,885,911	△ 26,499,761,213	△ 25,977,790,230
追加信託差損益金	△ 18,602,222,221	△ 18,455,811,102	△ 18,230,647,516	△ 18,012,464,576	△ 17,743,105,605	△ 17,641,372,507
(配当等相当額)	(255,783,206)	(253,517,508)	(250,262,065)	(247,211,235)	(243,428,969)	(241,948,493)
(売買損益相当額)	(△18,858,005,427)	(△18,709,328,610)	(△18,480,909,581)	(△18,259,675,811)	(△17,986,534,574)	(△17,883,321,000)
分配準備積立金	66,415,129	67,805,444	75,562,163	83,231,207	84,072,432	92,638,300
繰越損益金	△ 9,422,740,095	△ 9,483,998,959	△ 9,202,675,942	△ 8,943,652,542	△ 8,840,728,040	△ 8,429,056,023

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各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、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2023年10月13日～2024年4月12日)は以下の通りです。

項 目	2023年10月13日～ 2023年11月13日	2023年11月14日～ 2023年12月12日	2023年12月13日～ 2024年1月12日	2024年1月13日～ 2024年2月13日	2024年2月14日～ 2024年3月12日	2024年3月13日～ 2024年4月12日
a. 配当等収益(経費控除後)	28,886,535円	21,139,805円	27,424,791円	27,034,799円	20,403,825円	27,282,385円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金繰戻後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	255,783,206円	253,517,508円	250,262,065円	247,211,235円	243,428,969円	241,948,493円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	56,533,239円	65,481,282円	66,697,107円	74,523,002円	81,700,439円	83,261,403円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	341,202,980円	340,138,595円	344,383,963円	348,769,036円	345,533,233円	352,492,281円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	89円	90円	92円	95円	95円	98円
g. 分配金	19,004,645円	18,815,643円	18,559,735円	18,326,594円	18,031,832円	17,905,488円
h. 分配金(1万円当たり)	5円	5円	5円	5円	5円	5円

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○分配金のお知らせ

	第197期	第198期	第199期	第200期	第201期	第202期
1 万口当たり分配金（税込み）	5円	5円	5円	5円	5円	5円

○お知らせ

約款変更について

2023年10月13日から2024年4月12日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

当ファンドの主要投資対象先の直近の運用状況について、法令および諸規則に基づき、次ページ以降にご報告申し上げます。

種類・項目	ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド クラスA
	ケイマン籍円建外国投資信託
運用の基本方針	
基本方針	リスクを抑制しながら安定的な収益の獲得をめざします。
主な投資対象	世界銀行が発行する新興国通貨建て債券を主な投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 世界銀行が発行する新興国通貨建て債券を主な投資対象とすることで、安定的な収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。 各通貨への投資比率は、各国の経済状況、金利水準、市場の流動性などに基づき決定します。 組み入れる債券は、原則として残存期間が3年以下(変動利付債の場合は10年以下)のものとなります。 ファンドの流動性を確保するため、一部米ドルやユーロなどの主要国通貨建ての債券に投資することがあります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 原則として純資産総額の50%以上を有価証券に投資します。 株式への投資は行ないません。
収益分配	原則として毎月6日(休日の場合は翌営業日)に分配を行ないます。
ファンドに係る費用	
信託報酬など	<p>純資産総額に対して年率0.323%程度(国内における消費税等相当額はかかりません。)</p> <p>※当該外国投資信託の純資産総額が200億円、為替相場が1米ドル=120円の場合の概算値です。</p> <p>※当該外国投資信託の信託報酬率の内訳は、純資産総額に対し年率0.30%~0.32%と、固定報酬として年額5,000米ドル(純資産総額に対し年率0.003%相当)です。</p> <p>※純資産総額や為替相場などにより円換算後の信託報酬率は変動します。</p>
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	事務管理費用、資産の保管費用、有価証券売買時の売買委託手数料、設立に係る費用、法律顧問費用、監査費用、信託財産に関する租税など。
その他	
投資顧問会社	日興アセットマネジメント ヨーロッパリミテッド
管理会社	日興AMグローバル・ケイマン・リミテッド
信託期間	2106年12月31日まで
決算日	原則として、毎年2月末日

◆投資ポートフォリオ

ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド (クラス別)

SHARE CLASS	CURRENCY	TOTAL NET ASSETS(Balance)
A	JPY	9,315,086,477 (100%)

ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド

2023年2月28日現在

社債等	元本金額	公正価値 JPY	純資産に占める 割合(%)
国際機関			
PHP IBRD 4.5% 03-Apr-23	74,000,000	181,704,307	1.95
INR IBRD 0% 09-May-23	80,000,000	129,539,622	1.39
ZAR IBRD 7.5% 17-May-23	10,000,000	73,960,926	0.79
INR IBRD 0% 19-May-23	92,800,000	149,839,717	1.61
PLN IBRD 0.05% 27-Jul-23	13,400,000	401,037,532	4.31
INR IBRD 5.00% 07-Aug-23	28,000,000	44,863,616	0.48
INR IBRD 0% 24-Aug-23	38,100,000	60,106,960	0.65
IDR IBRD 4.3% 13-Sep-23	52,500,000,000	463,211,648	4.97
PLN IBRD 2.125% 18-Sep-23	630,000	18,887,139	0.20
IDR IBRD 7.89% 10-Oct-23	2,050,000,000	18,432,296	0.20
COP IBRD 2.9% 22-Dec-23	23,220,000,000	602,791,464	6.47
IDR IBRD 7.25% 15-Mar-24	38,450,000,000	345,780,047	3.71
BRL IBRD 5.4% 19-Mar-24	14,540,000	350,800,433	3.77
MXN IBRD 0% 30-Apr-24	93,000,000	593,720,370	6.37
ZAR IBRD 0% 20-Jun-24	58,200,000	384,133,508	4.12
MXN IBRD 0% 10-Jul-24	118,500,000	743,327,309	7.98
MXN IBRD 6.65% 30-Jul-24	40,000,000	275,267,420	2.96
ZAR IBRD 0% 20-Sep-24	17,500,000	113,829,225	1.22
PLN IBRD 1.53% 24-Oct-24	7,000,000	186,098,096	2.00
BRL IBRD 0% 14-Nov-24	2,740,000	58,512,328	0.63
ZAR IBRD 0% 29-Nov-24	20,870,000	132,781,219	1.43
INR IBRD 6% 16-Jan-25	349,100,000	560,300,292	6.01
CLP IBRD 2% 31-Jan-25	1,950,000,000	286,315,982	3.07
CLP IBRD 5.7% 07-Feb-25	3,420,000,000	539,491,097	5.79
IDR IBRD 5.5% 04-Mar-25	20,000,000,000	175,861,513	1.89
PLN IBRD 0.33% 25-Jun-25	20,000,000	494,418,459	5.31
BRL IBRD 0% 30-Jun-25	20,000,000	396,972,502	4.26
BRL IBRD 5% 22-Jan-26	12,500,000	277,072,436	2.97
ZAR IBRD 4.5% 22-Jan-26	32,180,000	215,811,753	2.32
IDR IBRD 4.6% 09-Feb-26	22,000,000,000	187,361,317	2.01
国際機関合計 (取得原価：8,227,209,255円)		8,462,230,533	90.84

	公正価値 JPY	純資産に占める 割合(%)
社債等合計(取得原価：8,227,209,255円)	<u>8,462,230,533</u>	<u>90.84</u>
純金融資産合計	8,462,230,533	90.84
その他純資産	<u>852,855,944</u>	<u>9.16</u>
純資産合計	<u>9,315,086,477</u>	<u>100.00</u>

IBRD = 国際復興開発銀行

デリバティブ商品とヘッジ活動

当ファンドは、その取り組むデリバティブ商品やヘッジ活動についての情報開示に関し、FASB会計基準編纂書に記される権威あるガイダンスを採用している。このガイダンスはデリバティブおよびヘッジ活動についての高度な開示を必要とし、それによって財務報告の透明性を高めている。このガイダンスの目的は、なぜ、どのようにデリバティブ商品が使われているか、デリバティブ商品や関連したヘッジがどのように会計処理されているか、そしてデリバティブ商品や関連したヘッジが財務状況や業績、キャッシュフローに関係するとすればどのような影響を与えているかについて、財務諸表のユーザーに対し理解を深めるための目安を示すことである。

このガイダンスを採用することで、資産負債計算書、損益計算書あるいは純資産変動計算書には何らの影響もなかった。当ファンドはいかなるデリバティブ商品もこのガイドの示すところのヘッジ商品として指定していない。

当ファンドは主に外貨のキャッシュフロー管理のための短期的なヘッジとして為替先渡契約に投資しており、主なリスク・エクスポージャーは外国為替リスクである。当ファンドが保有する為替先渡契約は外貨現金エクスポージャーの管理のためおよびリスク・ヘッジ目的で使用される。ただし、ASC第815号の要件に基づく会計目的上、これらのデリバティブはヘッジとみなされない。これらのデリバティブ商品の公正価値の変動額は損益計算書においてデリバティブに係る実現損失または未実現評価損の純変動額として反映されている。

デリバティブ商品とヘッジ活動(続き)

以下の表は2023年2月28日に終了した年度の損益計算書に含まれるデリバティブに係る純利益を示している。

	実現利益 日本円	未実現純損失の 変動額 日本円	合計 日本円	当期中平均活動額* 日本円
為替先渡契約	2,679,946	(655,797)	2,024,149	63,139,990

*日本円に転換された各契約の平均想定エクスポージャーを用いて計算された購入活動額に基づく当期中平均活動額

◆損益計算書

ワールドバンク・ボンド・インカム・ファンド

2023年2月28日に終了した会計年度

	2023 JPY
投資収益	
利息収入	502,582,268
投資収益合計	502,582,268
費用	
管理報酬	4,377,551
運用報酬	24,320,976
受託者報酬	662,122
専門家報酬	9,053,618
保管費用	2,305,350
その他費用	990,702
ファンド費用合計	41,710,319
投資純利益	460,871,949
実現純利益および未実現評価損の変動額	
実現利益	
投資有価証券	947,437,710
外国為替取引および為替先渡契約	83,437,472
実現純利益	1,030,875,182
未実現(評価損) / 評価益の変動額	
投資有価証券	(74,226,070)
外国為替取引および為替先渡契約	8,885,327
未実現評価損の純変動額	(65,340,743)
実現純利益および未実現評価損の変動額	965,534,439
運用による純資産の純増加額	1,426,406,388

マネー・オープン・マザーファンド

運用報告書

第21期（決算日 2024年 1月15日）
 (2023年 1月17日～2024年 1月15日)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2003年3月28日から原則無期限です。
運用方針	公社債への投資により、安定した収益の確保をめざして安定運用を行いません。
主要運用対象	わが国の国債および格付の高い公社債を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資は行いません。

ファンド概要

わが国の国債および格付の高い公社債に投資を行ない、利息等収益の確保をめざして安定運用を行いません。
 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		債 組 入 比 率	純 資 産 額
		騰 落	中 率		
17期(2020年1月15日)	円		%	%	百万円
	10,162		△0.0	—	696
18期(2021年1月15日)	10,159		△0.0	—	521
19期(2022年1月17日)	10,158		△0.0	—	398
20期(2023年1月16日)	10,155		△0.0	—	316
21期(2024年1月15日)	10,152		△0.0	—	293

(注) 元本の安全性を優先した運用を行なっているため、ベンチマークおよび適切な参考指数となる指標はございません。

○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
(期 首)	円		%
2023年1月16日	10,155		—
1月末	10,155		0.0
2月末	10,155		0.0
3月末	10,155		0.0
4月末	10,155		0.0
5月末	10,154		△0.0
6月末	10,154		△0.0
7月末	10,153		△0.0
8月末	10,153		△0.0
9月末	10,153		△0.0
10月末	10,152		△0.0
11月末	10,152		△0.0
12月末	10,152		△0.0
(期 末)			
2024年1月15日	10,152		△0.0

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2023年1月17日～2024年1月15日)

基準価額の推移

期間の初め10,155円の基準価額は、期間末に10,152円となり、騰落率は $\Delta 0.0\%$ となりました。

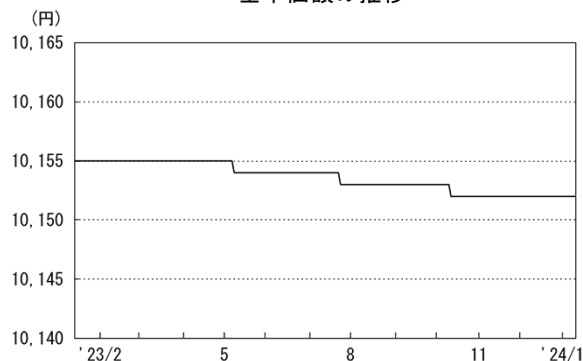
基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

<値下がり要因>

- ・無担保コール翌日物金利がマイナス圏で推移したこと。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2023/01/16	2023/01/17	2023/10/12	2024/01/15
10,155円	10,155円	10,152円	10,152円

(国内短期金利市況)

無担保コール翌日物金利は、期間の初めの -0.03% 近辺から、日銀によるマイナス金利政策の下でコール市場でもマイナス圏での取引が続き、 -0.01% 近辺で期間末を迎えました。

国庫短期証券（TB）3ヵ月物金利は、期間の初めの -0.19% 近辺から、日銀による国債買入れの継続などを受けてマイナス圏での推移が続き、 -0.22% 近辺で期間末を迎えました。

ポートフォリオ

運用の基本方針に従い、国庫短期証券の購入や現先取引、コールローンや金銭信託などを通じて、元本の安全性を重視した運用を行ないました。

○今後の運用方針

引き続き、安定した収益の確保をめざして安定運用を行なう方針です。主要投資対象は原則として、わが国の国債および格付の高い公社債とし、それらの現先取引なども活用する方針です。また、コールローンや金銭信託などに投資することもあります。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

○1万口当たりの費用明細

(2023年1月17日～2024年1月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)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、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、10,153円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第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1月17日～2024年1月15日)

該当事項はございません。

○利害関係人との取引状況等

(2023年1月17日～2024年1月15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。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2023年1月17日～2024年1月15日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2024年1月15日現在)

2024年1月15日現在、有価証券等の組入れはございません。

○投資信託財産の構成

(2024年1月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	293,708	100.0
投資信託財産総額	293,708	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年1月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	293,708,776
コール・ローン等	293,708,776
(B) 負債	198,597
未払解約金	198,565
未払利息	32
(C) 純資産総額(A-B)	293,510,179
元本	289,106,290
次期繰越損益金	4,403,889
(D) 受益権総口数	289,106,290口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,152円

(注) 当ファンドの期首元本額は311,251,070円、期中追加設定元本額は8,857,811円、期中一部解約元本額は31,002,591円です。

(注) 2024年1月15日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・グローバル3倍3分法ファンド(1年決算型)	153,800,333円
・グローバル3倍3分法ファンド(隔月分配型)	68,175,020円
・日興ビムコ・ハインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(米ドルコース)	13,739,040円
・日興ビムコ・ハインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(トルコリラコース)	9,629,170円
・世界銀行債券ファンド(毎月分配型)	9,000,074円
・資源ファンド(株式と通貨)ブラジルリアル・コース	7,904,694円
・日興・GS世界ソブリン・ファンド(毎月分配型)	6,352,120円
・グローバル3倍3分法(適格機関投資家専用)	5,642,457円
・高金利先進国債券オープン(毎月分配型)	5,477,282円
・資源ファンド(株式と通貨)南アフリカランド・コース	2,481,609円
・日興ビムコ・ハインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(ブラジルリアルコース)	2,121,761円
・日興ビムコ・ハインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(円ヘッジコース)	2,048,723円
・資源ファンド(株式と通貨)オーストラリアドル・コース	1,047,314円
・高金利先進国債券オープン(資産成長型)	538,501円
・グローバル3倍3分法オープン(適格機関投資家専用)	469,797円
・日興・世界ソブリン・ファンドVA(適格機関投資家転売制限付)	460,360円
・上場インデックスファンド中国A株(ハンダ)E Fund CSI300	198,295円
・上場インデックスファンド海外債券(FI SE WGBI)毎月分配型	19,740円

(注) 1口当たり純資産額は1.0152円です。

○損益の状況 (2023年1月17日～2024年1月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 83,775
支払利息	△ 83,775
(B) 保管費用等	△ 385
(C) 当期損益金(A+B)	△ 84,160
(D) 前期繰越損益金	4,826,068
(E) 追加信託差損益金	136,117
(F) 解約差損益金	△ 474,136
(G) 計(C+D+E+F)	4,403,889
次期繰越損益金(G)	4,403,889

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

(注) 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。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上し処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2023年1月17日から2024年1月15日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

- 当ファンドについて、新NISA制度における成長投資枠の要件に適合させるため、投資対象ファンドにて行なうデリバティブ取引の利用目的を明確化するべく、2023年10月11日付けにて信託約款の一部に所要の変更を行ないました。(付表、第14条、第15条、第16条)

寄付についてのご報告

「世界銀行債券ファンド（毎月分配型）＜愛称 ワールドサポーター＞」は、2024年4月12日に第202期の決算を迎えました。

目論見書記載の通り、当ファンドでご負担いただいた当期間の信託報酬のうち、日々の純資産総額に年率0.05%を乗じた金額、総額2,452,543円を、国際開発協会（International Development Association、通称IDA：アイダ）に寄付させていただきます。ワールドサポーターを通じたこれまでの寄付金の総額は累計で、553,541,535円となっています。

IDAは、世界銀行の名で知られる国際復興開発銀行（IBRD）の姉妹機関として1960年に設立されました。途上国の中でも特に貧しい国々を支援するため、経済成長の促進、不平等の是正、生活水準向上等を実現すべく超長期で無利子の融資や贈与を行なっています。

日興アセットマネジメントは、今後もワールドサポーターを通じて、世界の子どもたちに笑顔をもたらす新興国支援の取組みを応援してまいります。

引き続きワールドサポーターをみなさまの資産形成のツールとして未長くご愛顧いただきますよう、よろしくお願い申し上げます。