

受益者の皆様へ

毎々格別のお引立てにあずかり厚く御礼申し上げます。

さて、「ロボット戦略Ⅱ 世界成長ファンド」は、2023年5月25日に第10期決算を行いました。

当ファンドはアイルランド籍投資法人「マン・ファンズ・VI plc」のサブファンドである「マン・AHL・ターゲットリスク」が発行する外国投資信託証券への投資を通じて、世界各国の株価指数先物、債券先物、インフレ連動債、クレジット・デフォルト・スワップ、コモディティ・インデックス・スワップ等の幅広い資産に投資を行い、値上がり益の獲得を目指します。当作成対象期間につきましてもそれに沿った運用を行いました。

ここに運用状況をご報告申し上げます。今後ともより一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

ロボット戦略Ⅱ 世界成長ファンド
愛称: あんしんロボ

商品分類 (追加型投信/内外/資産複合)

第10期 (決算日 2023年5月25日)
作成対象期間: 2022年11月26日~2023年5月25日

第10期末 (2023年5月25日)	
基準価額	8,417円
純資産総額	3,379百万円
第10期	
騰落率	△1.8%
分配金合計	0円

(注) 騰落率は収益分配金(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す。

当ファンドは、約款において運用報告書(全体版)を電子交付することが定められています。運用報告書(全体版)については下記の手順でご覧いただけます。なお、書面をご要望の場合は、販売会社までお問い合わせください。

<閲覧方法>

右記URL⇒ファンド情報⇒当ファンド名を選択⇒各種資料のダウンロード⇒「運用報告書(全体版)」を選択



T&Dアセットマネジメント株式会社

〒108-0014 東京都港区芝5-36-7

お問い合わせ先

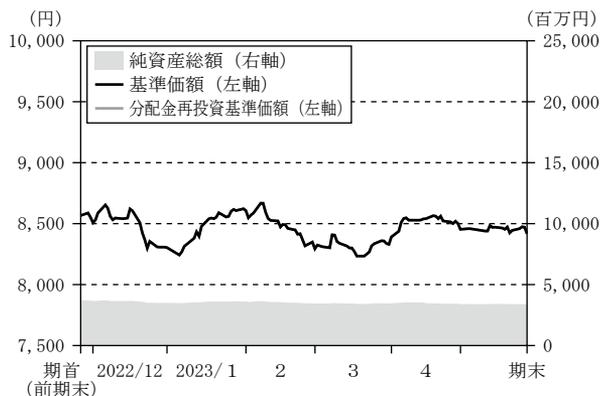
投信営業部 03-6722-4810

(受付時間: 営業日の午前9時~午後5時)

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

運用経過

基準価額等の推移



第10期首：8,567円

第10期末：8,417円（既払分配金0円）

騰落率：△1.8%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、期首（2022年11月25日）の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

(注) 分配金再投資基準価額は、収益分配金（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。

基準価額の主な変動要因

高位に組入れている「マン・ファンズ・VI plc—マン・AHL・ターゲットリスクー日本円クラス（ヘッジ付）」において、国債、社債と株式セクターで収益を獲得しましたが、商品とインフレ連動債セクターで損失が発生し、基準価額（分配金再投資ベース）は下落しました。

■ 組入ファンドの当期中の騰落率

組入ファンド	騰落率
マン・ファンズ・VI plc—マン・AHL・ターゲットリスクー日本円クラス（ヘッジ付）	△1.4%
T&Dマネーアカウントマザーファンド	0.0

1 万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2022/11/26～2023/ 5 /25		
	金額	比率	
平均基準価額	8,425円		期中の平均基準価額です。
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社)	38円 (14) (23) (1)	0.447% (0.164) (0.267) (0.016)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 購入後の情報提供、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 運用財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) その他費用 (監査費用)	1 (1)	0.009 (0.009)	(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係る費用
合計	39	0.456	

(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。

なお、その他費用は、当ファンドが組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) 平均基準価額の円未満は切捨て、それ以外の各金額は項目ごとに四捨五入してあります。

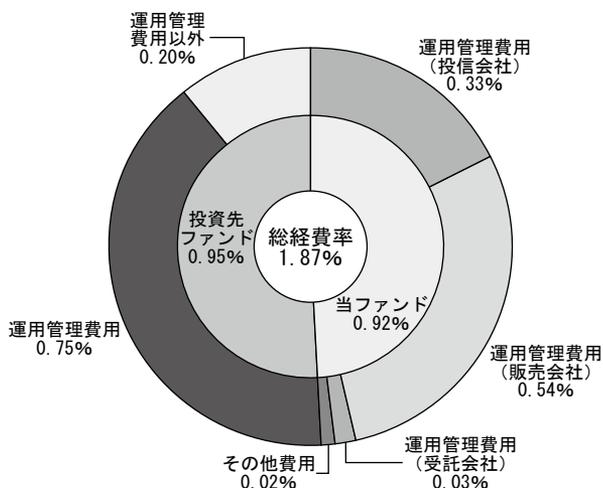
(注) 各項目の費用は、当ファンドが組入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）が支払った費用を含みません。

(注) 「比率」欄は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

当期中の運用・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、1.87%です。



総経費率（①+②+③）	1.87%
①当ファンドの費用の比率	0.92%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.75%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.20%

(注) 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) 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。

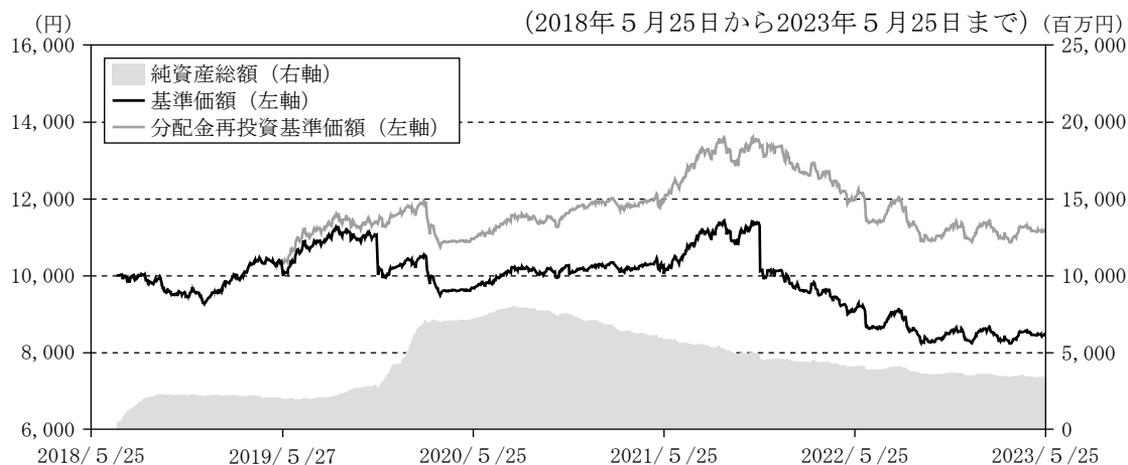
(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（親投資信託を除く）です。

(注) ①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) 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) 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。

最近5年間の基準価額等の推移



- (注) 分配金再投資基準価額は、設定日(2018年7月17日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。
(注) 分配金再投資基準価額は、収益分配金(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。

	2018年7月17日 設定日	2019年5月27日 決算日	2020年5月25日 決算日	2021年5月25日 決算日	2022年5月25日 決算日	2023年5月25日 決算日
基準価額(分配落) (円)	10,000	10,019	9,676	10,040	9,110	8,417
期間分配金合計(税込み) (円)	—	300	1,000	500	1,100	0
分配金再投資基準価額の騰落率(%)	—	3.2	6.2	9.0	0.6	△ 7.6
純資産総額 (百万円)	493	1,957	7,187	5,791	4,096	3,379

- (注) 当ファンドは、特定の指数に連動すること・指数を上回ることを目的として運用していないため、また、運用方針に対し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) 設定日の基準価額および純資産総額には、当初元本を用いております。

■ 株式市場

期初から2022年12月は、F R B（米連邦準備制度理事会）やE C B（欧州中央銀行）が利上げ継続方針を示し、米欧景気後退リスクへの意識が強まり株式市場は総じて軟調となりました。2023年1月に入り、欧州や中国の景気回復期待に加え、欧米各国のインフレ率の鈍化が見られ、米金融引締めペース減速観測の浮上により金利は低下し、幅広く株式市場は堅調となりました。しかし2月には、米国で消費者物価指数が想定ほど鈍化せず、一部経済指標が上振れしたことから、米金融引締め長期化観測が浮上し、株価の重しとなりました。この間、円安進行が追い風となった日本や景気回復期待が高まる欧州では株価は堅調となりました。3月前半には、米中堅銀行の破綻を契機とする金融システム不安の拡大から世界的に株価は下落しましたが、3月後半には、金融当局の素早い対応により金融市場は落ち着きを取り戻し、欧米景気の底堅さもあり株式市場は反転上昇しました。4月から期末にかけても、金融不安の後退、欧米のインフレ圧力の緩和や長期金利上昇の鈍化等を受けて、株価は底堅い展開となりました。

■ 債券市場

期初は、米国のインフレ指標鈍化を受け利上げペース減速期待が浮上し、米国中心に金利は低下しましたが、2022年12月にはF R Bが政策金利見通しを上方修正し、E C B理事会でも利上げの最終到達点が事前予想を上回るとの見方が強まり、欧米長期金利は上昇しました。2023年1月に入り、米国の一部経済指標に陰りが見られ、欧州のインフレ率に鈍化が見られたことで、利上げペース減速期待が高まり、欧米長期金利は低下しました。しかし2月には、米国の消費者物価指数の伸び率が予想を上回り、一部経済指標が上振れしたことから、欧米長期金利は反転上昇しました。3月前半に米シリコンバレー銀行が破綻し、金融システム不安が高まる中で、リスク回避の動きが強まり金利は急低下しました。3月後半には、金融不安は緩和され、金融市場も落ち着きを取り戻し、金利低下も一服しました。その後、4月から期末にかけては、米中堅銀行の大規模預金流出による金融不安の再燃、経済指標軟化による景気後退懸念等の金利低下要因、インフレ高止まりに対する欧米金融当局の金利引上げ継続観測等の金利上昇要因の綱引きが続き、欧米長期金利は一定範囲内で上下し横ばい推移となりました。

■ その他市場

インフレ連動債は、各国の金利動向やインフレ動向に応じて、各地域・各国で変動幅や時期などに違いが見られました。期を通じて、米国では国債金利は一定水準内での上下動となるなか実質金利は小幅の上昇となり、インフレ連動債価格は小幅下落となりました。一方、欧州や英国でも、期を通じて、国債金利は上下動する展開となりましたが、物価や賃金上昇率が高止まりする中、利上げ長期化観測は根強く、国債金利は上昇基調となり実質金利も上昇したことから、インフレ連動債価格は下落しました。

社債は、期初から2022年12月はスプレッド（信用リスクを反映した上乗せ金利）拡大、2023年1月はスプレッド縮小、2月から3月半ばにはスプレッド拡大、3月半ばから4月半ばにはスプレッド縮小、4月半ば以降はスプレッド拡大と、金融引締めによる景気減速懸念からリスク回避の

動きとなる局面、金利引上げペース減速期待からリスク選好の動きとなる局面が交互し、期中にスプレッドや価格は上下動しましたが、期を通じて、社債価格は概ね横ばいの推移となりました。

商品指数は、小刻みに上下動しながらも、期を通じては下落基調となりました。期初から1月上旬は、欧米の金融引締め政策継続観測から商品指数は下落しました。1月中旬には、中国のゼロコロナ政策撤廃を受け、原油やベース金属の需要増加期待から商品指数は上昇しましたが、その後、1月下旬から3月半ばにかけては、一時的に価格が上昇する局面もあったものの、金融引締め政策長期化観測や米中堅銀行の破綻を契機とする金融システム不安の高まりから商品価格は下落しました。3月半ばから4月半ばにかけては、金融当局の素早い対応もあり金融システム不安が緩和、商品指数は上昇しましたが、4月半ばから期末にかけては、金融システム不安が再燃し、商品価格は下落しました。

■ 国内短期金融市場

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、期首の $\Delta 0.20\%$ から期末は $\Delta 0.19\%$ となりました。期中においては、国庫短期証券の入札に伴う需給悪化懸念などが金利上昇要因となり、日銀の買入オペや金融機関の担保需要などが金利低下要因となりました。

当該投資信託のポートフォリオ

■ 当ファンド

「マン・ファンズ・VI plc—マン・AHL・ターゲットリスクー日本円クラス（ヘッジ付）」の組入比率は概ね高位を保ちました。また、「T&Dマネーアカウントマザーファンド」を組入れました。

■ マン・ファンズ・VI plc—マン・AHL・ターゲットリスクー日本円クラス（ヘッジ付）

世界各国の株価指数先物、債券先物、インフレ連動債、クレジット・デフォルト・スワップ、コモディティ・インデックス・スワップ等の幅広い資産クラスを投資対象とし、コンピュータープログラムを利用してポジションを構築し、市場環境に応じてエクスポージャーを増減させることで、中期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行いました。

■ T&Dマネーアカウントマザーファンド

国庫短期証券の利回りがマイナスで推移したため組入れを見送り、期を通じて組入比率は0%となりました。資産については、全額コールローン等で運用を行いました。

当該投資信託のベンチマークとの差異

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

分配金

1万口当たりの分配金（税込み）は分配対象収益がないため、見送らせていただきました。

（単位：円・％、1万口当たり・税引前）

項目	当期
	2022年11月26日 ～2023年5月25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	0

（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、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

「マン・ファンズ・VI plc—マン・AHL・ターゲットリスクー日本円クラス（ヘッジ付）」の組入比率を高位に保ち、「T&Dマネーアカウントマザーファンド」を組入れた運用を行う方針です。

■ マン・ファンズ・VI plc—マン・AHL・ターゲットリスクー日本円クラス（ヘッジ付）

世界各国の株価指数先物、債券先物、インフレ連動債、クレジット・デフォルト・スワップ、コモディティ・インデックス・スワップ等の幅広い資産クラスを投資対象とし、コンピュータープログラムを利用してポジションを構築し、市場環境に応じてエクスポージャーを増減させることで、中期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。

■ T&Dマネーアカウントマザーファンド

日本経済は、雇用・所得環境が改善する下で緩やかな回復が続くことが期待されます。インフレ率については、プラス圏で推移していくと予想されます。こうしたなか、日銀の「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」が金利抑制要因として作用することから、国内金利は低位で推移すると予想します。

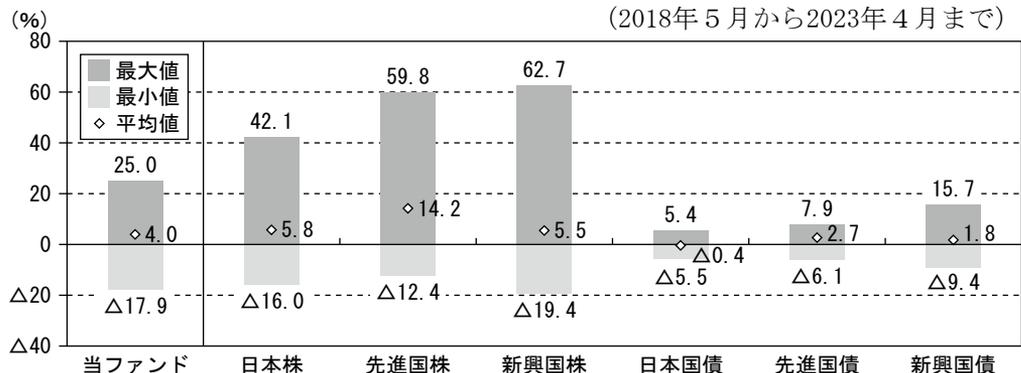
相対的に金利リスクの高い長期債への投資は見送り、国庫短期証券や短期金融商品等を中心とした安定的な運用を行います。

当該投資信託の概要

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	2018年7月17日から2028年11月27日まで	
運用方針	値上がり益の獲得を目指して運用を行います。	
主要運用対象	アイルランド籍投資法人「マン・ファンズ・VI plc」のサブファンドである「マン・AHL・ターゲットリスク」が発行する外国投資信託証券「日本円クラス（ヘッジ付）」および国内の証券投資信託である「T&Dマネーアカウントマザーファンド」を主要投資対象とします。	
	マン・ファンズ・VI plc－マン・AHL・ターゲットリスク－日本円クラス（ヘッジ付）	デリバティブ取引を積極的に活用し、世界各国の株価指数先物、債券先物、インフレ連動債、クレジット・デフォルト・スワップ、コモディティ・インデックス・スワップ等を主要投資対象とします。
	T&Dマネーアカウントマザーファンド	わが国の国債、公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。
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。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 有価証券先物取引等の派生商品取引の指図は行いません。	
分配方針	毎決算時（5月と11月の各25日、休業日の場合は翌営業日）に分配を行います。分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。	

【参考情報】

■ 代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- (注) 上記は、2018年5月から2023年4月の5年間の各月末における直近1年間騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。
- (注) 当ファンドおよび代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものであり、全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- (注) 騰落率は直近月末から60ヵ月遡って算出した結果であり、決算日に対応した数値とは異なります。
- (注) 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。
- (注) 当ファンドは2018年7月17日に設定されたため、2019年7月以降のデータをもとに表示しております。

○各資産クラスの指数

- 日本株・・・東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) ※1
 先進国株・・・MSCI コクサイ・インデックス (配当込み、円ベース) ※2
 新興国株・・・MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース) ※3
 日本国債・・・NOMURA-BPI 国債※4
 先進国債・・・FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ベース) ※5
 新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド (円ベース) ※6
 (注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しております。

- ※1 東証株価指数 (TOPIX) とは、株式会社JPX総研が算出する株価指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。TOPIXに関する一切の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研に帰属します。
- ※2 MSCI コクサイ・インデックスはMSCIが開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国の株式市場の動きを捉える指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCIに帰属します。
- ※3 MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCIが開発した新興国の株式市場の動きを捉える株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCIに帰属します。
- ※4 NOMURA-BPI 国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、日本で発行されている公募利付国債の市場全体を表す投資収益指数です。その知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、対象インデックスを用いて行われるT&Dアセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- ※5 FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ベース) は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- ※6 JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出し公表している、現地通貨建てのエマージング・マーケット債で構成されている指数です。同指数の著作権はJPモルガン社に帰属します。

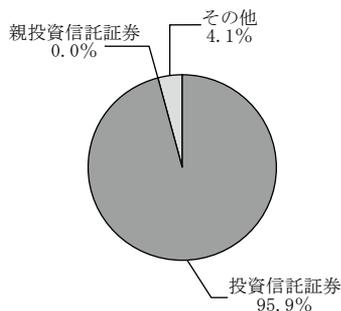
当該投資信託のデータ

当該ファンドの組入資産の内容

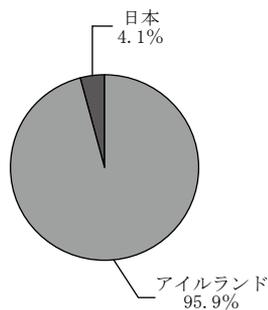
■ 組入（上位）ファンド（銘柄）

銘柄名	当期末
	2023年5月25日
	比率
マン・ファンズ・VI plc-マン・AHL・ターゲットリスクー日本円クラス（ヘッジ付）	95.9%
T&Dマネーアカウントマザーファンド	0.0
その他	4.1

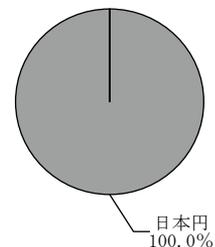
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



(注) 組入（上位）ファンド（銘柄）および各配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 国別配分は発行国を表示しております。

※詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）をご覧ください。

純資産等

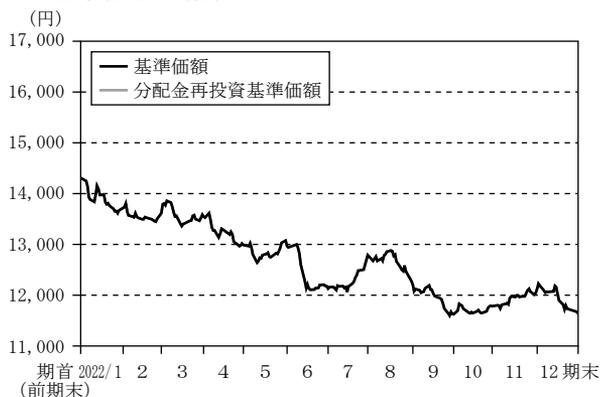
項目	当期末
	2023年5月25日
純資産総額	3,379,293,011円
受益権総口数	4,015,013,257口
1万口当たり基準価額	8,417円

(注) 期中における追加設定元本額は141,513,117円、同解約元本額は436,920,769円です。

組入上位ファンドの概要

マン・ファンズ・VI plc-マン・AHL・ターゲットリスク-日本円クラス（ヘッジ付）（2022年1月1日から2022年12月31日まで）

■ 基準価額の推移



(注) 分配金再投資基準価額は、期首（2021年12月31日）の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

(注) 分配金再投資基準価額は、収益分配金（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。

以下は、「マン・ファンズ・VI plc-マン・AHL・ターゲットリスク」の状況です。

■ 組入銘柄（債券）（上位10銘柄）（組入銘柄数：28銘柄）

銘柄名	国	比率
United States Treasury Inflation Linked IX N/B 0.13% 15/04/2027	アメリカ	3.3%
United States Treasury Inflation Linked IX N/B 0.63% 15/07/2032	アメリカ	3.2
French Discount Treasury Bill 0% 12/07/2023	フランス	3.0
United States Treasury Bill 0% 09/02/2023	アメリカ	2.8
United States Treasury Bill 0% 16/02/2023	アメリカ	2.8
United States Treasury Bill 0% 23/02/2023	アメリカ	2.8
United States Treasury Bill 0% 02/03/2023	アメリカ	2.8
United States Treasury Bill 0% 09/03/2023	アメリカ	2.8
United States Treasury Bill 0% 16/03/2023	アメリカ	2.8
United States Treasury Bill 0% 23/03/2023	アメリカ	2.8

■ 為替先渡取引（上位10銘柄）（組入銘柄数：20銘柄）

通貨		満期日	比率
買い	売り		
EUR	USD	2023/1/31	0.2%
USD	GBP	2023/1/12	0.1
CHF	USD	2023/1/31	0.0
EUR	USD	2023/1/12	0.0
SGD	USD	2023/1/31	0.0
AUD	USD	2023/1/31	0.0
USD	GBP	2023/1/31	0.0
USD	CHF	2023/1/31	0.0
GBP	USD	2023/1/31	0.0
HKD	USD	2023/1/31	0.0

■ 先物取引（上位10銘柄）（組入銘柄数：42銘柄）

買い		
銘柄名	国	比率
FTSE China A50 Index Futures January 2023	シンガポール	0.0%
Hang Seng Index Futures January 2023	香港	0.0
HSCEI Index Futures January 2023	香港	0.0
SGX Nifty 50 Index Futures January 2023	シンガポール	0.0
United States 2 Years Treasury Note CBT Futures March 2023	アメリカ	0.0
United States 5 Years Treasury Note CBT Futures March 2023	アメリカ	△0.0
Korea 3 Years Bond Futures March 2023	韓国	△0.0
Australian 3 Years Bond Futures March 2023	オーストラリア	△0.0
FTSE 100 Index Futures March 2023	イギリス	△0.0
MSCI Singapore Index Futures December 2023	シンガポール	△0.0

■ トータル・リターン・スワップ取引 （組入銘柄数：1銘柄）

銘柄名	国・地域	数量	比率
BBG Commex AG&LV Capital Partners	アメリカ	3,101,000	△0.7%

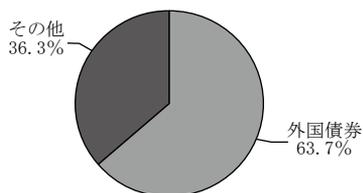
■ クレジット・デフォルト・スワップ取引 売り （組入銘柄数：4銘柄）

銘柄名	国・地域	数量	比率
CDX Naigs39V1 5 Years 100 Obps 20 December 2027 BC	アメリカ	△645,000,000	0.1%
ITraxx Europes38V1 5 Years 100 Obps 20 December 2027 GS	欧州	△525,000,000	0.1
ITraxx Xovers38V1 5 Years 500 Obps 20 December 2027 GS	欧州	△185,000,000	0.1
CDX Nahys39V1 5 Years 500 Obps 20 December 2027 JPM	アメリカ	△260,000,000	0.0

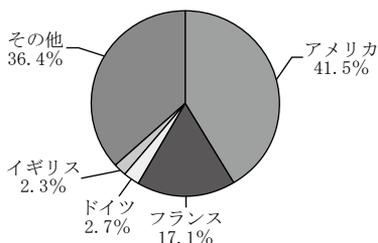
■ 1口当たりの費用明細

1口当たりの費用明細に相当する情報がないため、開示することができません。

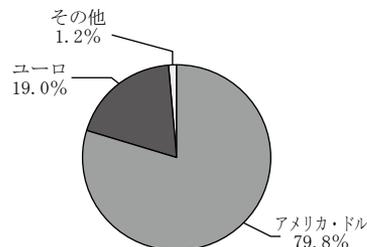
■ 資産別配分



■ 国別配分



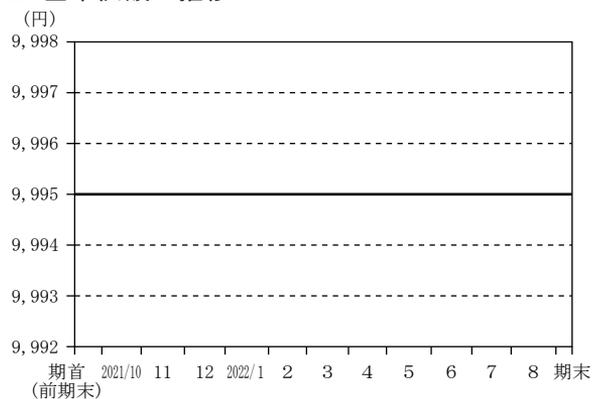
■ 通貨別配分



- (注) 組入銘柄、為替先渡取引、先物取引、スワップ取引および各配分のデータは直近の決算日現在のものです。日付は現地基準日です。
 (注) 組入銘柄、為替先渡取引、先物取引、スワップ取引および各配分の比率は純資産総額に対する評価額（先物取引、スワップ取引については、監査済報告書の損益計算書上のFair Value、為替先渡取引についてはUnrealized gain/loss）の比率です。
 (注) 組入銘柄、為替先渡取引、先物取引、スワップ取引および各配分はマン・グループ・ジャパン・リミテッドより入手したデータをもとに作成したものです。

※詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）をご覧くださいませ。

■ 基準価額の推移



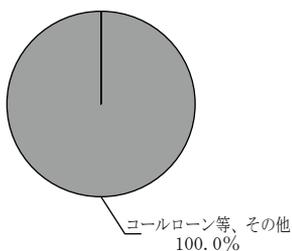
■ 組入銘柄

当期末における組入れはありません。

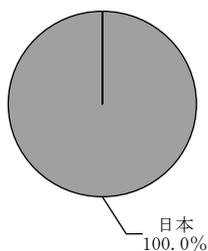
■ 1万口当たりの費用明細

当期において発生した費用はありません。

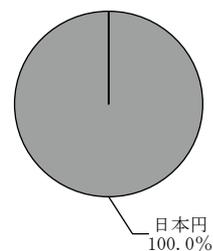
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



(注) 各配分のデータは直近の決算日現在のものです。

(注) 各配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 国別配分は発行国を表示しております。

※詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)をご覧ください。



T&Dアセットマネジメント株式会社