

明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式ファンド

愛称：未来コレクター

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	2021年3月26日から2024年3月19日（当初、2031年3月18日）まで	
運用方針	明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式マザーファンドを通じて、日本および新興国を含む世界の金融商品取引所に上場している株式等を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式ファンド	明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式マザーファンドを主要投資対象とします。
	明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式マザーファンド	日本および新興国を含む世界の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）している株式等（DR（預託証券）等を含みます。）を主要投資対象とします。
組入制限	明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式ファンド	株式への実質投資割合には、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。
	明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式マザーファンド	株式への投資割合には、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	年2回（3月、9月の20日。休業日の場合は翌営業日。）決算を行い、原則として以下の方針に基づいて分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、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。 ③収益分配にあてず信託財産内に留保した利益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。	

償還運用報告書(全体版)

〈繰上償還〉

第6期（信託終了日 2024年3月19日）

受益者のみなさまへ

平素は「明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式ファンド」にご投資いただき、厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、信託約款の規定に基づき、償還の手続きを行い、2024年3月19日に繰上償還いたしました。

ここに謹んで運用経過と償還内容をご報告申し上げます。

長い間ご愛顧賜り、厚くお礼申し上げます。

MYAM 明治安田アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目3番2号
ホームページ <https://www.myam.co.jp/>

〈運用報告書のお問い合わせ先〉
サポートデスク 0120-565787
(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

◎最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			MSCI オールカントリー・ ワールド・インデックス (配当込み、円換算ベース)		株 組 比	式 入 率	投資信託 証 券 組入比率	純 資 産 総 額
	(分 配 落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率	(参考指数)	期 騰 落 中 率				
	円	円	%		%	%	%		百万円
(第2期) 2022年3月22日	9,645	0	△12.4	183,738	7.8	91.8	6.9		2,920
(第3期) 2022年9月20日	9,234	0	△4.3	190,130	3.5	90.4	8.1		2,797
(第4期) 2023年3月20日	8,769	0	△5.0	182,682	△3.9	91.1	8.2		2,656
(第5期) 2023年9月20日	10,882	0	24.1	227,159	24.3	92.6	6.6		3,305
(償還時) (第6期) 2024年3月19日	(償還価額) 13,089.91	—	20.3	263,087	15.8	—	—		1,225

(注1) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 当ファンドは、親投資信託への投資を通じて、日本および新興国を含む世界の金融商品取引所に上場している株式等に投資します。特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、同様のユニバースから構成される適切な指数がないため、ベンチマークは設定しておりません。

(注3) MSCI オールカントリー・ワールド・インデックスは、先進国および新興国を対象とした世界の株価の動きを表す代表的な指数です。MSCIインデックスは、MSCI Inc. の知的財産であり、MSCIはMSCI Inc. のサービスマークです。MSCIインデックスに関する著作権、その他の知的財産権はMSCI Inc. に帰属しており、その許諾なしにコピーを含め電子的、機械的な一切の手段その他あらゆる形態を用い、またはあらゆる情報保存、検索システムを用いてインデックスの全部または一部を複製、頒布、使用などすることは禁じられております。またこれらの情報は、信頼のおける情報源から得たものでありますが、その確実性および完結性をMSCI Inc. は何ら保証するものではありません。

◎当期中の基準価額と市況等の推移

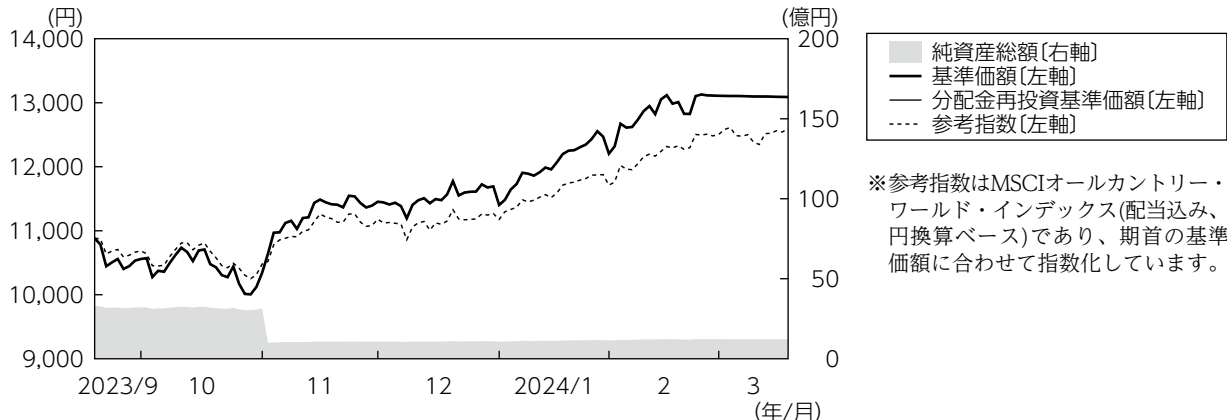
年 月 日	基 準 価 額		MSCI オールカントリー・ ワールド・インデックス (配当込み、円換算ベース)		株 組 比	式 入 率	投資信託 証 券 組入比率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
	円	%		%	%	%	%
(期 首) 2023年 9月20日	10,882	—	227,159	—	92.6	6.6	
9月末	10,533	△3.2	222,647	△2.0	91.6	6.4	
10月末	10,123	△7.0	215,323	△5.2	92.4	7.1	
11月末	11,392	4.7	231,310	1.8	86.7	10.9	
12月末	11,692	7.4	235,247	3.6	88.2	9.8	
2024年 1月末	12,470	14.6	247,919	9.1	91.1	7.0	
2月末	13,112	20.5	260,555	14.7	—	—	
(償還時) 2024年 3月19日	(償還価額) 13,089.91	20.3	263,087	15.8	—	—	

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

◎当期の運用経過

■ 基準価額等の推移



第6期首(2023年9月20日)：10,882円

償還時(2024年3月19日)：13,089円91銭(既払分配金－円)

騰落率：20.3%(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は分配金実績があった場合、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。

※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。したがって、お客さま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

ファンドの運用方針に基づき、明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式マザーファンドを通じて、日本および新興国を含む世界の金融商品取引所に上場している株式等に投資を行いました。投資対象資産の価格変動等による基準価額の変動要因は以下の通りとなりました。

(上昇要因)

- ・米ドルが円に対して大きく上昇したこと
- ・市場予想を上回る四半期決算が好感されたほか、クラウドサービスが収益をけん引したことに加え、生成AI（人工知能）機能を搭載した業務ソフトの販売が好調で、AIの需要急増を背景に好業績が続くとの見方が強まった、米国に本社を置く世界的なソフトウェア企業であるMICROSOFT CORPの株価が上昇し、巨大テクノロジー株や半導体関連株も上昇したこと

(下落要因)

- ・アプリの革新性の欠如や、歴史的に高インフレの環境下、主要ユーザーである若者の有料会員離れが進んでいることから、成長が予想よりも大きく減速していることが嫌気された、世界各国向けに出会い系のマッチングアプリを運営する米国のプロバイダーであるMATCH GROUP INCの株価が下落したこと

■ 投資環境

当期のグローバル株式相場は上昇しました。期首から2023年10月下旬にかけてはインフレ再燃懸念が重荷となったことに加え、米国長期金利が急騰し一時5%台をつけるなど、金利の高止まり観測が警戒され、相対的な割高感からハイテク株や高配当株を中心に下げ足を早めました。しかし11月に入ると、インフレ減速傾向を背景に米国長期金利が大幅低下したことから、市場心理が改善し上昇に転じました。その後も早期利下げ観測の広がりや米国経済の軟着陸期待が高まり上げ幅が拡大しました。期末にかけては堅調な経済と利下げ観測、好調な企業業績を背景に半導体関連株やハイテク株を中心に上昇基調を維持しました。

当期の米ドルは円に対して上昇しました。期首から2023年11月前半にかけて高止まりするインフレを受けた米国の金融引き締め長期化観測、米国長期金利の上昇などから、概ね上昇基調となりました。その後米国の利上げ打ち止め観測などから12月にかけて下落しましたが、2024年1月から期末にかけては能登半島地震を受けた日銀の金融緩和継続観測などから戻り歩調となりました。

■ 当該投資信託のポートフォリオ

明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式ファンド

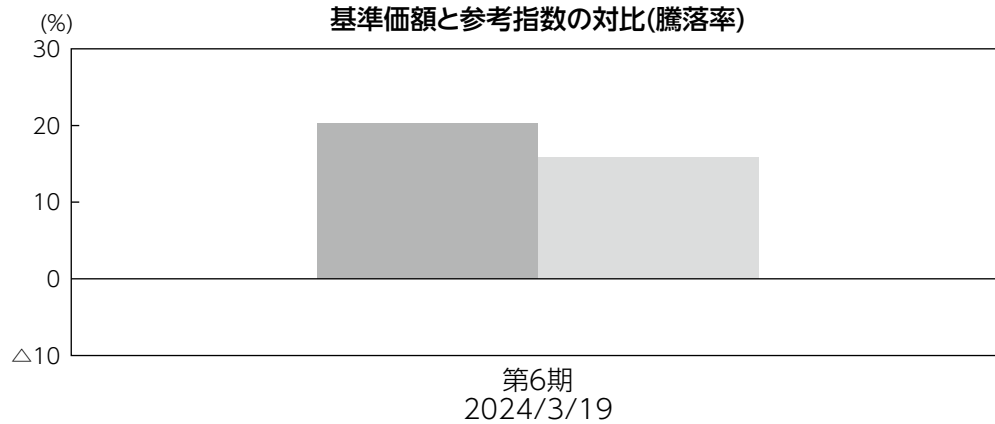
期首の運用方針に基づき、明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式マザーファンドの投資比率を高位に維持しましたが、償還に向けて、2024年2月下旬にマザーファンドを全売却しました。

なお、マザーファンドの運用に関して、ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーに株式等の運用指図にかかる権限を委託しました。

明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式マザーファンド

期首の運用方針に基づき、日本および新興国を含む世界の金融商品取引所に上場している株式等に投資を行い、期を通じて株式の組入比率を高位に維持しましたが、償還に向けて、2024年2月下旬に組入銘柄を全売却しました。

■ 当該投資信託のベンチマークとの差異



※ファンドの騰落率は分配金込み

■ 基準価額 ■ MSCIオールカントリー・ワールド・インデックス (配当込み、円換算ベース)

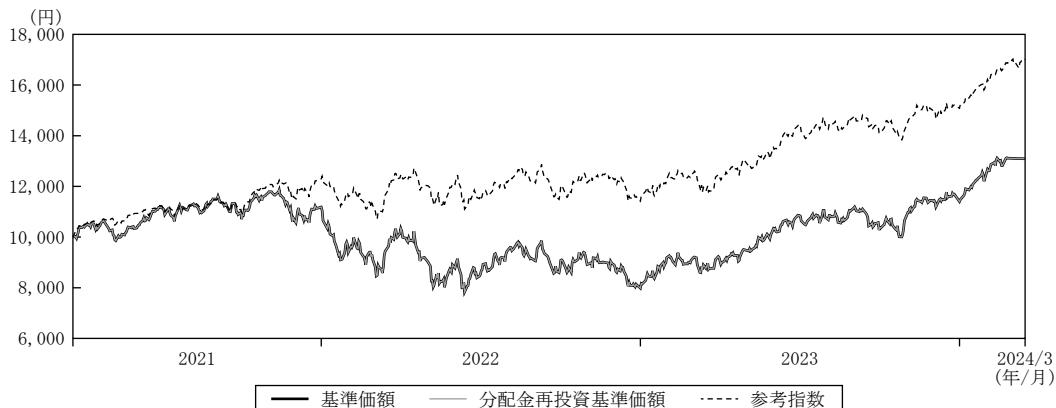
当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

上記グラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。当期の基準価額の騰落率（分配金込み）は+20.3%となり、参考指数の騰落率は+15.8%となりました。

◎設定以来の運用経過 (2021年3月26日～2024年3月19日)

基準価額と収益分配金

基準価額の推移



※参考指数はMSCIオールカントリー・ワールド・インデックス (配当込み、円換算ベース) であり、設定時の基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は分配金実績があった場合、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。

※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。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

基準価額は設定時10,000円で始まり償還日13,089円91銭で終わりました。騰落率（分配金再投資ベース）は+30.9%でした。設定以来お支払いした分配金はございませんでした。なお、収益分配にあてず信託財産内に留保した利益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行いました。

基準価額の主な変動要因

ファンドの運用方針に基づき、明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式マザーファンドを通じて、日本および新興国を含む世界の金融商品取引所に上場している株式等に投資を行いました。投資対象資産の価格変動等による基準価額の変動要因は以下の通りとなりました。

（上昇要因）

- ・ELI LILLY AND COMPANY（医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス）、NVIDIA CORP（半導体・半導体製造装置）、ALPHABET INC-CL A（メディア・娯楽）などの株価が保有期間中に上昇したこと
- ・米ドルが円に対して上昇したこと

（下落要因）

- ・GENUS PLC（医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス）、ILLUMINA INC（医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス）、SNAP INC - A（メディア・娯楽）などの株価が保有期間中に下落したこと

運用概況

明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式ファンド

運用方針に基づき、明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式マザーファンドの投資比率を高位に維持しましたが、償還に向けて、2024年2月下旬にマザーファンドを全売却しました。

なお、マザーファンドの運用に関して、ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーに株式等の運用指図にかかる権限を委託しました。

明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式マザーファンド

後述の同マザーファンドの運用報告書をご参照ください。

◎1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2023年9月21日～2024年3月19日		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	106円	0.914%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×期末の信託報酬率 ※期中の平均基準価額は11,553円です。
(投信会社)	(60)	(0.517)	ファンドの運用、基準価額の算出、法定書類の作成等の対価
(販売会社)	(44)	(0.381)	購入後の情報提供、運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(2)	(0.016)	ファンド財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	3	0.029	(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)	(3)	(0.025)	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
(投資信託証券)	(0)	(0.003)	
(c) 有価証券取引税	1	0.009	(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
(株式)	(1)	(0.009)	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
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	6	0.053	(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)	(3)	(0.028)	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)	(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
(その他)	(2)	(0.022)	信託事務の処理等に要する諸費用、信託財産に関する租税等
合計	116	1.005	

(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、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

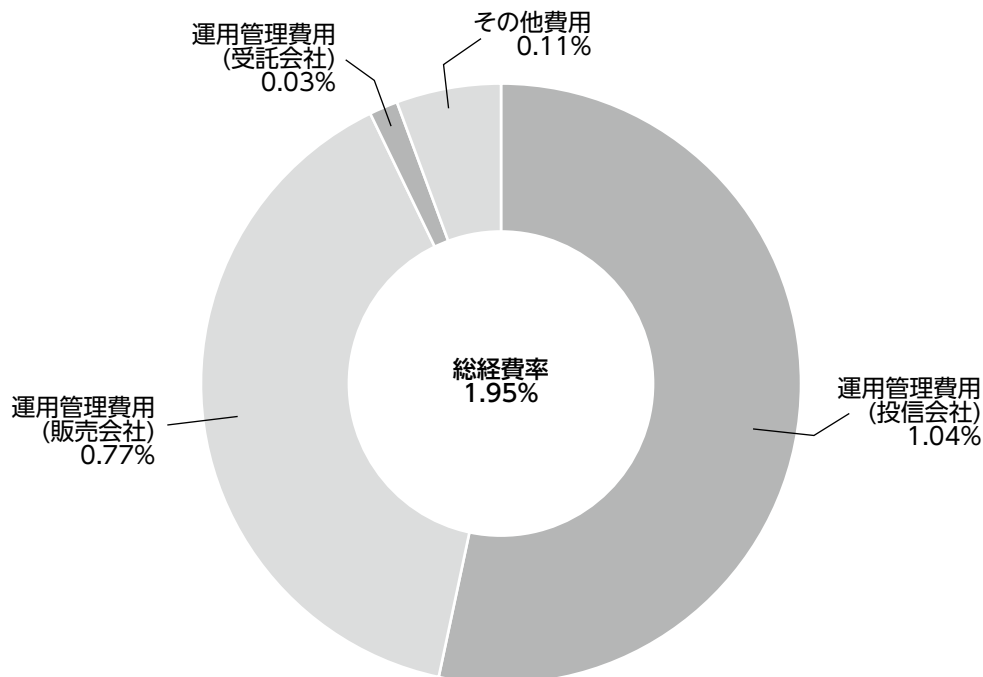
(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 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、売買委託手数料及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1.95%です。



(注) 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、売買委託手数料及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) 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9月21日～2024年3月19日)

○親投資信託の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
明 治 安 田 ウ エ リ ン ト ン ・ 世界イノベーション株式マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 2, 896, 948	千円 3, 399, 791

(注) 単位未満は切り捨て。

◎親投資信託の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
	明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	3, 616, 218千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	1, 744, 890千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	2. 07

(注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

◎利害関係人との取引状況等(2023年9月21日～2024年3月19日)

期中の利害関係人との取引はございません。

(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。

◎組入資産明細表

2024年3月19日現在、有価証券等の組み入れはございません。

○親投資信託残高

種 類	期 首	償 還 時	
	口 数	口 数	評 価 額
明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式マザーファンド	千口 2, 896, 948	千口 —	千円 —

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

◎投資信託財産の構成

2024年3月19日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1, 239, 786	100. 0
投 資 信 託 財 産 総 額	1, 239, 786	100. 0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

◎資産、負債、元本及び償還価額の状況

2024年3月19日現在

項 目	償 還 時
(A) 資 産	1, 239, 786, 746円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1, 239, 786, 746
(B) 負 債	14, 786, 446
未 払 信 託 報 酬	14, 736, 789
未 払 利 息	5, 856
そ の 他 未 払 費 用	43, 801
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	1, 225, 000, 300
元 本	935, 835, 227
償 還 差 益 金	289, 165, 073
(D) 受 益 権 総 口 数	935, 835, 227口
1万口当たり償還価額(C/D)	13, 089円91銭

◎損益の状況

自 2023年9月21日
至 2024年3月19日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 12, 865円
受 取 利 息	36
支 払 利 息	△ 12, 901
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	214, 893, 151
売 買 益	318, 787, 055
売 買 損	△103, 893, 904
(C) 信 託 報 酬 等	△ 14, 780, 603
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	200, 099, 683
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	88, 052, 068
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1, 013, 322
(配 当 等 相 当 額)	(1, 208, 127)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 194, 805)
償 還 差 益 金 (D+E+F)	289, 165, 073

(注1) 当ファンドの期首元本額は3, 037, 243, 540円、期中追加設定元本額は191, 687円、期中一部解約元本額は2, 101, 600, 000円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1. 308991円です。

(注3) 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4) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬等に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注5) 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6) 信託財産の運用指図に係る権限の一部を委託するために要した費用は4, 536, 955円です。

◎投資信託財産運用総括表

信 託 期 間	投資信託契約締結日	2021年3月26日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024年3月19日		資 産 総 額	1,239,786,746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 又 は 追 加 信 託	負 債 総 額	14,786,446円
				純 資 産 総 額	1,225,000,300円
受 益 権 口 数	3,000,000,000口	935,835,227口	△2,064,164,773口	受 益 権 口 数	935,835,227口
元 本 額	3,000,000,000円	935,835,227円	△2,064,164,773円	1万口当たり償還金	13,089.91円
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
	円	円	円	円	%
第 1 期	3,000,000,000	3,302,320,026	11,008	0	0.0000
第 2 期	3,027,939,907	2,920,564,241	9,645	0	0.0000
第 3 期	3,029,119,604	2,797,220,046	9,234	0	0.0000
第 4 期	3,029,373,281	2,656,478,827	8,769	0	0.0000
第 5 期	3,037,243,540	3,305,158,673	10,882	0	0.0000

◎償還金のお知らせ

1万口当たり償還金（税込み）	13,089円91銭
----------------	------------

※償還金は、償還日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式マザーファンド

償還運用報告書

第3期 〈繰上償還〉

(信託終了日 2024年3月18日)

「明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式マザーファンド」は、2024年3月18日に繰上償還いたしました。

以下、償還までの運用状況をご報告申し上げます。

当マザーファンドの仕組みは次の通りです。

運 用 方 針	信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主 要 運 用 対 象	日本および新興国を含む世界の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）している株式等（DR（預託証券）等を含みます。）を主要投資対象とします。
組 入 制 限	株式への投資割合には、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		MSCI オールカントリー・ ワールド・インデックス (配当込み、円換算ベース)		株 組 比	式 入 率	投資信託 証券 組入比率	純 資 産 額
		期 中 騰落率	(参考指数)	期 中 騰落率				
(設定日) 2021年3月26日	円 10,000	% —	154,651	% —	% —	% —	百万円 2,970	
(第1期) 2022年3月22日	9,806	△ 1.9	183,738	18.8	92.5	6.9	2,897	
(第2期) 2023年3月20日	9,072	△ 7.5	182,682	△ 0.6	91.2	8.2	2,652	
(償 還 時) (第3期) 2024年3月18日	(償還価額) 13,758.97	51.7	261,822	43.3	—	—	1,220	

- (注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。
- (注2) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。
- (注3) 当ファンドは、日本および新興国を含む世界の金融商品取引所に上場している株式等に投資します。特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、同様のユニバースから構成される適切な指数がないため、ベンチマークは設定しておりません。
- (注4) MSCI オールカントリー・ワールド・インデックスは、先進国および新興国を対象とした世界の株価の動きを表す代表的な指数です。MSCI インデックスは、MSCI Inc. の知的財産であり、MSCIはMSCI Inc. のサービスマークです。MSCI インデックスに関する著作権、その他知的財産権はMSCI Inc. に帰属しており、その許諾なしにコピーを含め電子的、機械的な一切の手段その他あらゆる形態を用い、またはあらゆる情報保存、検索システムを用いてインデックスの全部または一部を複製、頒布、使用などすることは禁じられております。またこれらの情報は、信頼のおける情報源から得たものでありますが、その確実性および完結性をMSCI Inc. は何ら保証するものではありません。
- (注5) 設定日の参考指数は設定日前日の値を用いております。

◎当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCI オールカントリー・ ワールド・インデックス (配当込み、円換算ベース) (参考指数)		株 組 比	式 入 率	投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率			
(期 首)2023年 3月20日	円	%		%			
	9,072	—	182,682	—	91.2		8.2
3月末	9,435	4.0	191,246	4.7	90.5		9.0
4月末	9,572	5.5	195,635	7.1	92.1		7.1
5月末	10,399	14.6	205,153	12.3	92.9		6.2
6月末	11,187	23.3	220,931	20.9	92.2		7.2
7月末	11,326	24.8	224,528	22.9	92.1		7.4
8月末	11,540	27.2	227,472	24.5	93.3		6.1
9月末	11,022	21.5	222,647	21.9	91.8		6.4
10月末	10,610	17.0	215,323	17.9	92.4		7.1
11月末	11,895	31.1	231,310	26.6	87.7		11.1
12月末	12,229	34.8	235,247	28.8	89.0		9.9
2024年 1月末	13,072	44.1	247,919	35.7	91.7		7.0
2月末	13,769	51.8	260,555	42.6	—		—
(償還時)2024年 3月18日	(償還価額) 13,758.97	51.7	261,822	43.3	—		—

(注) 騰落率は期首比です。

◎設定以来の運用経過 (2021年3月26日～2024年3月18日)

1 基準価額

基準価額の推移と主な変動要因



※参考指数はMSCI オールカントリー・ワールド・インデックス(配当込み、円換算ベース)であり、設定時の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額は設定時10,000円で始まり償還日13,758円97銭で終わりました。騰落率は+37.6%でした。基準価額の主な変動要因は以下の通りです。

(上昇要因)

- ・ELI LILLY AND COMPANY (医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス)、NVIDIA CORP (半導体・半導体製造装置)、ALPHABET INC-CL A (メディア・娯楽)などの株価が保有期間中に上昇したこと
- ・米ドルが円に対して上昇したこと

(下落要因)

- ・GENUS PLC (医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス)、ILLUMINA INC (医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス)、SNAP INC - A (メディア・娯楽)などの株価が保有期間中に下落したこと

2 運用経過

運用概況

運用方針に基づき、日本および新興国を含む世界の金融商品取引所に上場している株式等に投資を行い、株式の組入比率を高位に維持しましたが、償還に向けて、2024年2月下旬に組入銘柄を全売却しました。

なお、運用に関して、ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーに株式等の運用指図にかかる権限を委託しました。

◎1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2023年3月21日～2024年3月18日		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	4円	0.033%	(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 ※期中の平均基準価額は11,338円です。
(株式)	(3)	(0.028)	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
(投資信託証券)	(1)	(0.005)	
(b) 有価証券取引税	3	0.028	(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
(株式)	(3)	(0.028)	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
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	9	0.082	(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)	(7)	(0.062)	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)	(2)	(0.020)	
合計	16	0.143	信託事務の処理等に要する諸費用、信託財産に関する租税等

(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2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 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3月21日～2024年3月18日)

(1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 2	千円 9,159	千株 11	千円 99,589
外 国	ア メ リ カ	百株 529 (102)	千米ドル 4,209 (ー)	百株 3,002	千米ドル 22,960
	ユ ー ロ		千ユーロ		千ユーロ
	ア イ ル ラ ン ド	ー	ー	99	331
	イ ギ リ ス	208	千ポンド 352	1,122	千ポンド 774
	香 港	11	千香港ドル 170	316	千香港ドル 2,859
	中 国	140 (76)	千中国元 417 (ー)	524	千中国元 2,173

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切り捨て。
(注3) ()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。

(2) 投資信託証券

		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
	VANGUARD TOTAL WORLD STOCK ETF	37,515	3,563	46,287	4,457
	PROLOGIS INC	60	6	6,318	704
	HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE	3,672	88	9,632	200
	合計口数・金額	41,247	3,658	62,237	5,363

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切り捨て。

◎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	4,473,157千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	2,334,898千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	1.91

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

◎利害関係人との取引状況等 (2023年3月21日～2024年3月18日)

期中の利害関係人との取引はございません。

(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。

◎組入資産明細表

2024年3月18日現在、有価証券等の組み入れはございません。

○国内株式
上場株式

銘柄		期 株	首 数
医薬品			千株
第一三共			8.7
電気機器			0.8
合計	株数		9
	銘柄数		2

○外国株式
上場、登録株式

銘柄	期 株	首 数
(アメリカ)		百株
WALT DISNEY CO/THE		46
ELI LILLY AND COMPANY		21
SKYLINE CHAMPION CORP		47
UNITEDHEALTH GROUP INC		10
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC		4
MASTERCARD INC - A		19
VISA INC-CLASS A SHARES		47
APTIV PLC		46
SNAP INC - A		260
LIVENT CORP		70
DAYFORCE INC		48
DYNATRACE INC		90
UBER TECHNOLOGIES INC		136
ROBLOX CORP -CLASS A		28
STEM INC		121
COUPANG INC		160
SHAKE SHACK INC - CLASS A		31
SHOPIFY INC - CLASS A		45
BLOCK INC		34
AMAZON.COM INC		102
ADVANCED MICRO DEVICES		16

銘		柄		期	首
				株	数
(アメリカ)					百株
COGNEX CORP					45
NVIDIA CORP					18
MICROSOFT CORP					24
ILLUMINA INC					17
NETFLIX INC					9
INTUITIVE SURGICAL INC					8
ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR					66
FIRST SOLAR INC					12
MERCADOLIBRE INC					2
ICON PLC					18
MONGODB INC					10
CARGURUS INC					142
XP INC - CLASS A					136
MATCH GROUP INC					48
HEALTH CATALYST INC					147
REVOLUTION MEDICINES INC					57
AIRBNB INC-CLASS A					34
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC					6
ALPHABET INC-CL A					85
WINGSTOP INC					16
MONSTER BEVERAGE CORP					47
ROKU INC					21
小計		株	数	2,370	
		銘	柄数	43	
(ユーロ・・・アイルランド)					
SMURFIT KAPPA GROUP PLC					99
ユーロ小計		株	数	99	
		銘	柄数	1	
(イギリス)					
GENUS PLC					100
TRAINLINE PLC					813
小計		株	数	914	
		銘	柄数	2	
(香港)					
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD					248
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H					57
小計		株	数	305	
		銘	柄数	2	

銘		柄	期	首
			株	数
(中国) GLDON CO LTD-A SG MICRO CORP-A WILL SEMICONDUCTOR CO LTD-A				百株
				151
				53
				103
小	計	株	数	308
		銘	柄	数
合	計	株	数	3,997
		銘	柄	数

(注1) 株数の単位未満は切り捨て。

(注2) 銘柄コード等の変更があった場合は、変更前後を別銘柄として記載しております。

○外国投資信託証券

銘柄		期	首
		口	数
(アメリカ)			口
VANGUARD TOTAL WORLD STOCK ETF			8,772
PROLOGIS INC			6,258
HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE			5,960
合 計	口		20,990
	銘 柄 数		3

(注) 口数の単位未満は切り捨て。

◎投資信託財産の構成

2024年3月18日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1, 220, 352	100. 0
投 資 信 託 財 産 総 額	1, 220, 352	100. 0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

◎資産、負債、元本及び償還価額の状況

2024年3月18日現在

項 目	償 還 時
(A) 資 産	1, 220, 352, 215円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1, 220, 352, 215
(B) 負 債	3, 287
未 払 利 息	3, 160
そ の 他 未 払 費 用	127
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	1, 220, 348, 928
元 本	886, 948, 164
償 還 差 益 金	333, 400, 764
(D) 受 益 権 総 口 数	886, 948, 164口
1万口当たり償還価額(C／D)	13, 758円97銭

◎損益の状況

自 2023年3月21日
至 2024年3月18日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	13, 473, 995円
受 取 配 当 金	13, 527, 610
受 取 利 息	25
そ の 他 収 益 金	5, 254
支 払 利 息	△ 58, 894
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	760, 835, 042
売 買 益	1, 003, 557, 428
売 買 損	△ 242, 722, 386
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2, 099, 544
(D) 当 期 損 益 金 (A＋B＋C)	772, 209, 493
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 271, 290, 878
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 167, 517, 851
償 還 差 益 金 (D＋E＋F)	333, 400, 764

(注1) 当親ファンドの期首元本額は2, 923, 873, 313円、期中追加設定元本額は0円、期中一部解約元本額は2, 036, 925, 149円です。

(注2) 当親ファンドの当期末元本の内訳は、明治安田ウエリントン・世界イノベーション株式ファンド886, 948, 164円です。

(注3) 1口当たり純資産額は1. 375897円です。

(注4) 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5) 損益の状況の中で(C) 信託報酬等には信託報酬等に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注6) 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。