

■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／債券 |
| 信託期間 | 2019年5月28日から2029年8月10日まで |
| 運用方針 | マザーファンドへの投資を通じて、主に世界の企業が発行する高利回り社債に投資することにより、高水準のインカムゲインの確保と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。 |
| 主要投資対象 | 当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 世界SDGsハイインカム・マザーファンド 世界の企業が発行する高利回り社債 |
| 当ファンドの運用方法 | <ul style="list-style-type: none">■マザーファンドへの投資を通じて、主に世界の企業が発行する高利回り社債を中心に実質的に投資することにより、高水準のインカムゲインの確保と信託財産の成長を目指します。■マザーファンドにおいて米ドル建て以外の債券等へ投資する場合は、対米ドルで為替取引を行い、実質的に米ドル建てとすることを基本とします。■「為替ヘッジあり」では、実質組入外貨建資産については原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を目指します。■銘柄の選定にあたっては、発行体のSDGsへの貢献度に加え、信用力などのファンダメンタルズ、バリュエーションおよび流動性等を勘案します。■実質的な運用はロベコ・インスティテューショナル・アセット・マネジメント・ビー・ヴィが行います。 |
| 組入制限 | 当ファンド <ul style="list-style-type: none">■株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。■外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 世界SDGsハイインカム・マザーファンド <ul style="list-style-type: none">■株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。■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 | <ul style="list-style-type: none">■年2回（原則として毎年2月および8月の10日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。■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。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;">資産成長型は複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）</div> |

世界SDGsハイインカム・ファンド (為替ヘッジあり) 資産成長型 【運用報告書(全体版)】

(2021年2月11日から2021年8月10日まで)

第 5 期

決算日 2021年8月10日

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、主に世界の企業が発行する高利回り社債に投資することにより、高水準のインカムゲインの確保と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。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

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

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976

受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

世界SDGsハイインカム・ファンド（為替ヘッジあり 資産成長型）

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。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。

■ 設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | (参考指数) ブルームバーグ・バークレイズ・ グローバル・ハイイールド社債 インデックス(米ドルヘッジ) | | 公社債 組入比率 | 純資産 総額 |
|---------------------|-------------|-------------|-----------------------|---|-------------|-------------|------------|
| | (分配) | 税 分 配 | 込 金 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (設定日) 2019年5月28日 | 円 10,000 | 円 - | % - | 100.00 | % - | % - | 百万円 490 |
| 1期(2019年8月13日) | 10,216 | 0 | 2.2 | 101.89 | 1.9 | 93.9 | 607 |
| 2期(2020年2月10日) | 10,571 | 0 | 3.5 | 107.08 | 5.1 | 93.7 | 619 |
| 3期(2020年8月11日) | 10,440 | 0 | △1.2 | 107.11 | 0.0 | 96.5 | 596 |
| 4期(2021年2月10日) | 10,880 | 0 | 4.2 | 114.61 | 7.0 | 96.6 | 620 |
| 5期(2021年8月10日) | 10,961 | 0 | 0.7 | 117.11 | 2.2 | 95.8 | 611 |

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※参考指数は、当報告書作成時に知りえた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

※参考指数は市場の動きを示す目的で記載しており、当ファンドが当該参考指数を意識して運用しているわけではありません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | (参考指数) ブルームバーグ・バークレイズ・ グローバル・ハイイールド社債 インデックス(米ドルヘッジ) | | 公社債 組入比率 |
|--------------------|-------------|-------------|---|-------------|-------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | |
| (期首) 2021年2月10日 | 円 10,880 | % - | 114.61 | % - | % 96.6 |
| 2月末 | 10,818 | △0.6 | 114.39 | △0.2 | 96.0 |
| 3月末 | 10,770 | △1.0 | 114.19 | △0.4 | 97.4 |
| 4月末 | 10,833 | △0.4 | 115.50 | 0.8 | 95.8 |
| 5月末 | 10,853 | △0.2 | 115.93 | 1.1 | 97.2 |
| 6月末 | 10,919 | 0.4 | 117.01 | 2.1 | 94.3 |
| 7月末 | 10,962 | 0.8 | 117.15 | 2.2 | 94.6 |
| (期末) 2021年8月10日 | 10,961 | 0.7 | 117.11 | 2.2 | 95.8 |

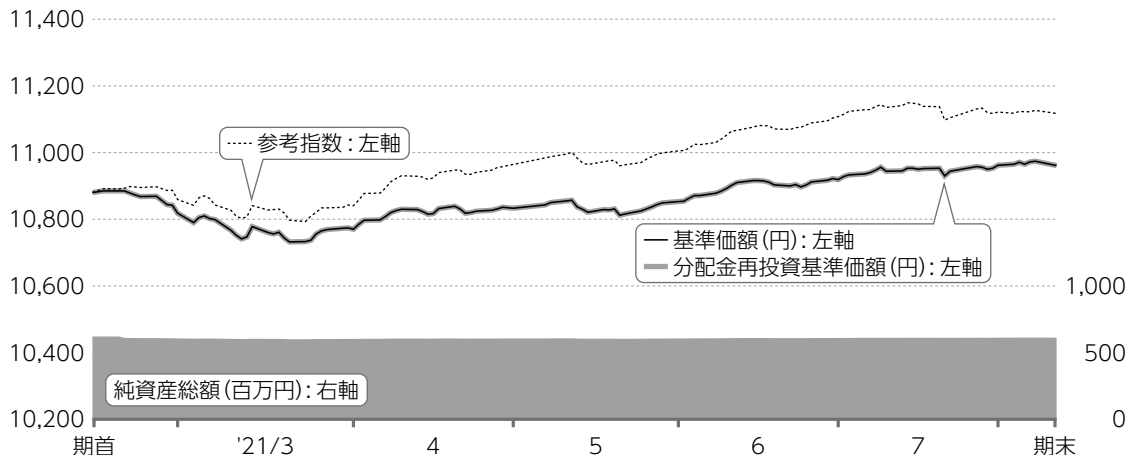
※騰落率は期首比です。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

1 運用経過

基準価額等の推移について(2021年2月11日から2021年8月10日まで)

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額および参考指数は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

| | |
|-----|---------------------------|
| 期首 | 10,880円 |
| 期末 | 10,961円 (既払分配金0円(税引前)) |
| 騰落率 | +0.7% (分配金再投資ベース) |

分配金再投資基準価額について

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と仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆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などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ・パークレイズ・グローバル・ハイイールド社債インデックス(米ドルヘッジ)です。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

基準価額の主な変動要因（2021年2月11日から2021年8月10日まで）

当ファンドは、世界SDGsハイインカム・マザーファンドへの投資を通じて、主に世界の企業が発行する高利回り社債に投資を行いました。

上昇要因

- 各国政府や中央銀行によるさまざまな財政・金融政策等が奏功し、スプレッド（国債に対する上乗せ金利）が縮小したこと
- 個別銘柄では、行動制限により映画館などではなく家庭での娯楽需要が高まったことから、加入者数が予想以上に増加したNetflixや、コスト削減と収益の改善が評価された水道事業会社のAnglian Waterなどの社債価格が上昇したこと

下落要因

- 米国のスポーツ放映権を保有しているDiamond Sportsは多くのイベントの中止により、また、駐車場事業を展開するQ-park Holdingは行動制限で空港や大都市の駐車場利用が減少したことなどにより、両社の社債価格が下落したこと

投資環境について (2021年2月11日から2021年8月10日まで)

グローバル・ハイイールド債券市場は、引き続き堅調に推移しました。各国政府や中央銀行による、新型コロナウイルスによるマイナスの影響を回避することを目的としたさまざまな金融政策等が継続したことや、ワクチン接種の進展に伴い経済活動の

再開が進んだことなどから、スプレッド(国債に対する上乗せ金利)は縮小しました。しかし足元では、新型コロナ変異ウイルスの感染拡大が懸念されたことから、ハイイールド債券市場に対する警戒感が高まりました。

ポートフォリオについて (2021年2月11日から2021年8月10日まで)

当ファンド

主要投資対象である世界SDGsハイインカム・マザーファンドを期間を通じて高位に組み入れ、期間末の実質的な公社債組入比率は95.8%としました。

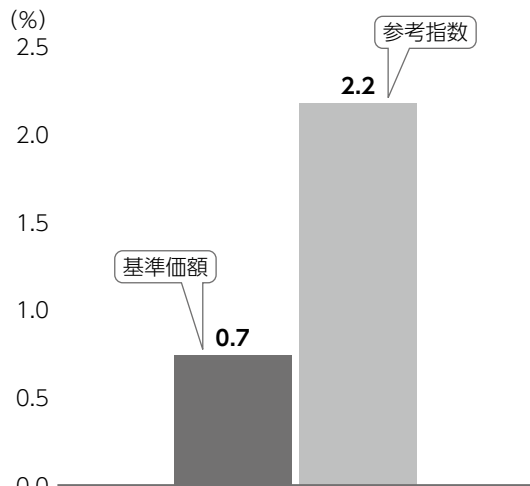
また、為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を目指しました。

世界SDGsハイインカム・マザーファンド

当期間の騰落率は、+7.2%となりました。現在のバリュエーション(投資価値評価)に鑑みて、ポートフォリオのベータ(市場全体の動きに対する感応度)は1を下回る水準としています。引き続き、質の高いハイイールド債券を中心とした保守的なポートフォリオを維持しつつ、SDGsの観点からエネルギーなどのセクターをアンダーウェイトとしています。ハイイールド債券市場は、予想外の悪材料に対して脆弱な状態にあると考えられます。こうした見極めが難しい局面においては、保有債券の価格変動リスクを勘案し、慎重に運用を行うことが重要と考えています。

ベンチマークとの差異について（2021年2月11日から2021年8月10日まで）

基準価額と参考指数の騰落率対比



※基準価額は分配金再投資ベース

当ファンドは運用の指標となるベンチマークはありませんが、参考指数としてブルームバーグ・バークレイズ・グローバル・ハイイールド社債インデックス（米ドルヘッジ）を設けています。

左のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

分配金について（2021年2月11日から2021年8月10日まで）

期間の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りといたしました。なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

（単位：円、1万口当たり、税引前）

| 項目 | 第5期 |
|-----------|---------|
| 当期分配金 | 0 |
| (対基準価額比率) | (0.00%) |
| 当期の収益 | - |
| 当期の収益以外 | - |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,100 |

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

※「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（税引前）込み）に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き、運用の基本方針に従い、マザーファンドへの投資を通じて、主に世界の企業が発行する高利回り社債に投資することにより、高水準のインカムゲイン(利子収入)の確保と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。

世界SDGsハイインカム・マザーファンド

2021年度の米国の名目GDP(国内総生産)成長率は、想定外の出来事がない限り前年比10%に達する見通しです。注目となっているインフレ率は急上昇しましたが、上昇は一時的なものであるとの見方が支配的です。ハイイールド債券市場は、予想外の悪材料に対して脆弱な状態にあると考えられます。引き続き質の高いハイイールド債券への投資を通じて相対的に高いインカムゲインの獲得を目指すとともに、SDGs貢献度評価を用いて中長期的な事業の存続、発展が期待される企業を選別することで、ハイイールド債券への投資リスクの低減を図っていく方針です。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

世界SDGsハイインカム・ファンド（為替ヘッジあり 資産成長型）

1万口当たりの費用明細（2021年2月11日から2021年8月10日まで）

| 項目 | 金額 | 比率 | 項目の概要 |
|--------------------|------------|---------------|---|
| (a) 信託報酬 | 89円 | 0.824% | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×（経過日数／年日数） <div style="border: 1px solid black; padding: 2px; display: inline-block;">期中の平均基準価額は10,859円です。</div> |
| （投信会社） | (46) | (0.425) | 投信会社:ファンド運用の指図等の対価 |
| （販売会社） | (41) | (0.382) | 販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、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） | (2) | (0.016) | 受託会社:ファンド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) 売買委託手数料 | － | － | 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:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （株式） | (－) | (－) | |
| （先物・オプション） | (－) | (－) | |
| （投資信託証券） | (－) | (－) | |
| (c) 有価証券取引税 | － | － | 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:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （株式） | (－) | (－) | |
| （公社債） | (－) | (－) | |
| （投資信託証券） | (－) | (－) | |
| (d) その他費用 | 4 | 0.038 | 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） | (2) | (0.023) | 保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用 |
| （監査費用） | (1) | (0.005) | 監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用 |
| （その他） | (1) | (0.009) | その他:信託事務の処理等に要するその他費用 |
| 合計 | 94 | 0.861 | |

※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

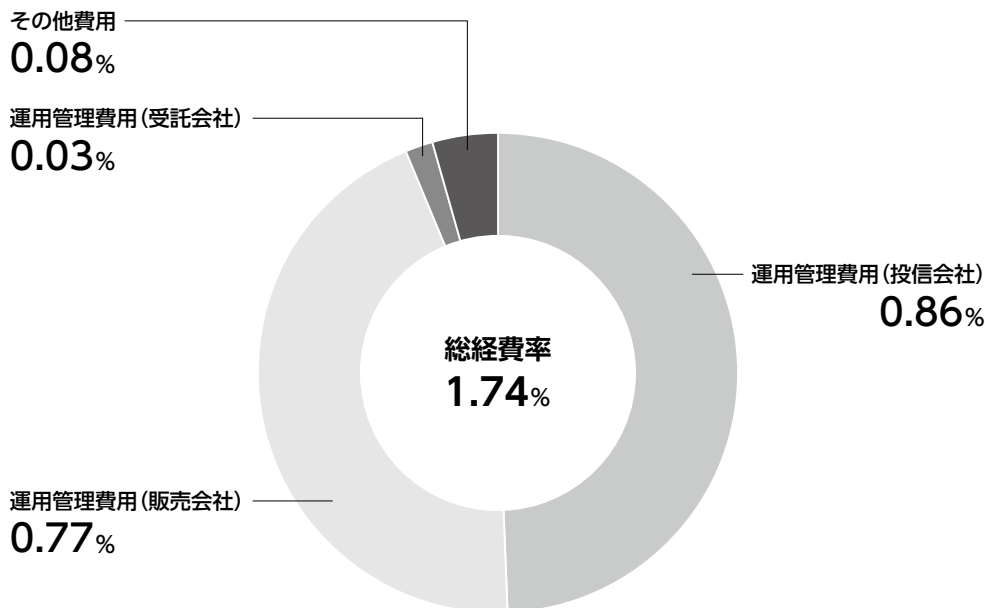
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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。



参考情報 総経費率(年率換算)



※各費用は、前掲「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、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。

※各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。

※上記の前提条件で算出しているため、「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、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。

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(年率換算)は1.74%です。

世界SDGsハイインカム・ファンド（為替ヘッジあり 資産成長型）

■ 当期中の売買及び取引の状況（2021年2月11日から2021年8月10日まで）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| | 設 定 | | 解 約 | |
|----------------------|-------------|-------------|--------------|--------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 世界SDGsハイインカム・マザーファンド | 千口 2,584 | 千円 2,986 | 千口 47,168 | 千円 53,155 |

■ 利害関係人との取引状況等（2021年2月11日から2021年8月10日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

※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（2021年2月11日から2021年8月10日まで）

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（2021年2月11日から2021年8月10日まで）

| 期首 (元) | 残高 (本) | 当 元 | 期 設 定 本 元 | 期 解 約 本 元 | 期末 (元) | 残高 (本) | 取 引 の 理 由 |
|-----------|------------|--------|-----------------------|-----------------------|-----------|------------|----------------------|
| | 百万円 490 | | 百万円 - | 百万円 - | | 百万円 490 | 当初設定時または当初運用時における取得等 |

■ 組入れ資産の明細（2021年8月10日現在）

親投資信託残高

| 種 類 | 期 首(前期末) | | 期 末 | |
|----------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 評 価 額 |
| 世界SDGsハイインカム・マザーファンド | 千口 569,799 | 千円 616,760 | 千口 525,215 | 千円 616,760 |

※世界SDGsハイインカム・マザーファンドの期末の受益権総口数は1,303,665,396口です。

■ 投資信託財産の構成

（2021年8月10日現在）

| 項 目 | 期 末 | |
|----------------------|---------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 世界SDGsハイインカム・マザーファンド | 千円 616,760 | % 99.2 |
| コール・ローン等、その他 | 5,167 | 0.8 |
| 投資信託財産総額 | 621,928 | 100.0 |

※世界SDGsハイインカム・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（1,518,461千円）の投資信託財産総額（1,556,860千円）に対する比率は97.5%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本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、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.36円、1イギリス・ポンド=152.85円、1ユーロ=129.53円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2021年8月10日現在）

| 項 目 | 期 末 |
|---------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 1,223,917,999円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 123,001 |
| 世界SDGsハイインカム・マザーファンド(評価額) | 616,760,809 |
| 未 収 入 金 | 607,034,189 |
| (B) 負 債 | 611,925,747 |
| 未 払 金 | 606,889,250 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 5,003,454 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 33,043 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 611,992,252 |
| 元 本 | 558,318,429 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 53,673,823 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 558,318,429口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,961円 |

※当期における期首元本額570,355,685円、期中追加設定元本額0円、期中一部解約元本額12,037,256円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

（自2021年2月11日 至2021年8月10日）

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|--------------|
| (A) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 9,591,165円 |
| 売 益 | 49,582,203 |
| 買 損 | △39,991,038 |
| (B) 信 託 報 酬 等 | △ 5,042,437 |
| (C) 当 期 損 益 金(A+B) | 4,548,728 |
| (D) 前 期 繰 越 損 益 金 | 48,298,056 |
| (E) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 827,039 |
| (配 当 等 相 当 額) | (1,012,778) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 185,739) |
| (F) 合 計(C+D+E) | 53,673,823 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(F) | 53,673,823 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 827,039 |
| (配 当 等 相 当 額) | (1,012,778) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 185,739) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 60,419,137 |
| 繰 越 損 益 金 | △ 7,572,353 |

※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。

※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。

※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。

※投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託報酬の中から支弁している額は1,462,933円です。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

| | 当 期 |
|----------------------|------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 8,649,806円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0 |
| (c) 収益調整金 | 1,012,778 |
| (d) 分配準備積立金 | 51,769,331 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 61,431,915 |
| 1万口当たり当期分配対象額 | 1,100.30 |
| (f) 分配金 | 0 |
| 1万口当たり分配金 | 0 |

■ 分配金のお知らせ

| 1万口当たり分配金（税引前） | 当 期 |
|----------------|-----|
| | 0円 |

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

世界SDGsハイインカム・マザーファンド

第3期（2020年8月12日から2021年8月10日まで）

| | |
|------|---|
| 信託期間 | 無期限（設定日：2019年5月28日） |
| 運用方針 | <ul style="list-style-type: none"> ■世界の企業が発行する高利回り社債を主要投資対象とします。 ■組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。 ■運用指図にかかる権限をロベコ・インスティテューショナル・アセット・マネジメント・ピー・ヴィへ委託します。 |

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。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。

■ 設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | （参考指数） ブルームバーグ・パークレイズ・ グローバル・ハイイールド 社債インデックス （米ドルヘッジ、円換算） | | 公組社債 入比率 | 純総 資産額 |
|---------------------|--------|-------|---|-------|-------------|--------------|
| | 円 | 騰落率 | 100.00 | 騰落率 | | |
| （設定日） 2019年5月28日 | 10,000 | — | 100.00 | — | — | 百万円 1,000 |
| 1期（2019年8月13日） | 9,930 | △ 0.7 | 98.04 | △ 2.0 | 95.4 | 1,685 |
| 2期（2020年8月11日） | 10,546 | 6.2 | 103.79 | 5.9 | 96.6 | 1,924 |
| 3期（2021年8月10日） | 11,743 | 11.4 | 117.95 | 13.6 | 95.0 | 1,530 |

※参考指数は、当報告書作成時に知れた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

※参考指数は市場の動きを示す目的で記載しており、当ファンドが当該参考指数を意識して運用しているわけではありません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

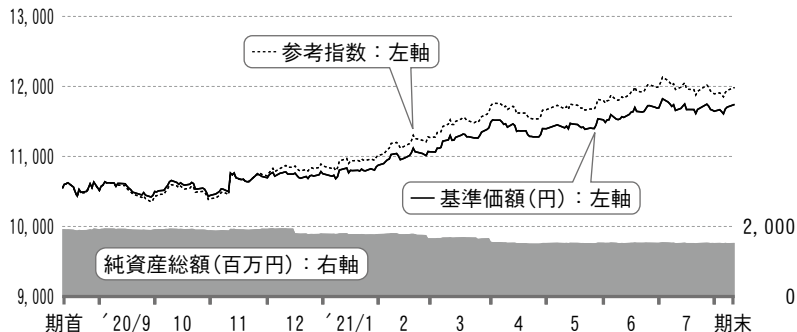
| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | (参 考 指 数) ブルームバーグ・バークレイズ・ グローバル・ハイイールド 社 債 イン デ ッ ク ス (米ドルヘッジ、円換算) | | 公 組 入 社 比 債 率 |
|---------------------|-------------|--------|--|--------|---------------|
| | | 騰 落 率 | | 騰 落 率 | |
| (期 首) 2020年8月11日 | 円 10,546 | % - | 103.79 | % - | % 96.6 |
| 8月末 | 10,517 | △ 0.3 | 103.45 | △ 0.3 | 96.0 |
| 9月末 | 10,500 | △ 0.4 | 102.70 | △ 1.1 | 97.0 |
| 10月末 | 10,444 | △ 1.0 | 102.33 | △ 1.4 | 96.3 |
| 11月末 | 10,696 | 1.4 | 105.53 | 1.7 | 96.8 |
| 12月末 | 10,754 | 2.0 | 106.93 | 3.0 | 93.2 |
| 2021年1月末 | 10,875 | 3.1 | 108.42 | 4.5 | 96.1 |
| 2月末 | 11,067 | 4.9 | 110.92 | 6.9 | 95.3 |
| 3月末 | 11,493 | 9.0 | 115.38 | 11.2 | 95.6 |
| 4月末 | 11,396 | 8.1 | 114.82 | 10.6 | 95.3 |
| 5月末 | 11,523 | 9.3 | 116.13 | 11.9 | 96.1 |
| 6月末 | 11,694 | 10.9 | 118.09 | 13.8 | 93.1 |
| 7月末 | 11,646 | 10.4 | 117.07 | 12.8 | 93.9 |
| (期 末) 2021年8月10日 | 11,743 | 11.4 | 117.95 | 13.6 | 95.0 |

※騰落率は期首比です。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について（2020年8月12日から2021年8月10日まで）

基準価額等の推移



| | |
|-----|---------|
| 期首 | 10,546円 |
| 期末 | 11,743円 |
| 騰落率 | +11.4% |

※参考指数は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドの参考指数は、ブルームバーグ・パークレイズ・グローバル・ハイイールド社債インデックス（米ドルヘッジ、円換算）です。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

▶ 基準価額の主な変動要因 (2020年8月12日から2021年8月10日まで)

| | |
|------|---|
| 上昇要因 | <ul style="list-style-type: none"> ・各国政府や中央銀行によるさまざまな財政・金融政策等が奏功し、スプレッド（国債に対する上乗せ金利）が縮小したこと ・個別銘柄では、金利低下による住宅需要と販売価格の高まりを背景に、米国の住宅関連銘柄であるPulte Groupの社債価格が上昇したこと ・トルコのガラスメーカーであるTurk Sise VE Cam Fabrikaは、世界の経済活動が再開する中で同社製品に対する需要が高まったことから同社の社債価格が上昇したこと ・新型コロナウイルスのワクチン普及や米国の追加経済対策期待によるリスク選好の動きなどから米ドル高・円安となったこと |
| 下落要因 | <ul style="list-style-type: none"> ・米国のスポーツ放映権を保有しているDiamond Sportsは多くのイベントの中止により、また、駐車場事業を展開するQ-park Holdingは行動制限で空港や大都市の駐車場利用が減少したことなどにより、両社の社債価格が下落したこと |

▶ 投資環境について (2020年8月12日から2021年8月10日まで)

グローバル・ハイイールド債券市場は、引き続き堅調に推移しました。各国政府や中央銀行による、新型コロナウイルスによるマイナスの影響を回避することを目的としたさまざまな金融政策等が継続したことや、ワクチン接種の進展に伴い経済活動の再開が進んだことなどから、スプレッド（国債に対する上乗せ金利）は縮小しました。しかし足元では、新型コロナ変異ウイルスの感染拡大が懸念されたことから、ハイイールド債券市場に対する警戒感が高まりました。

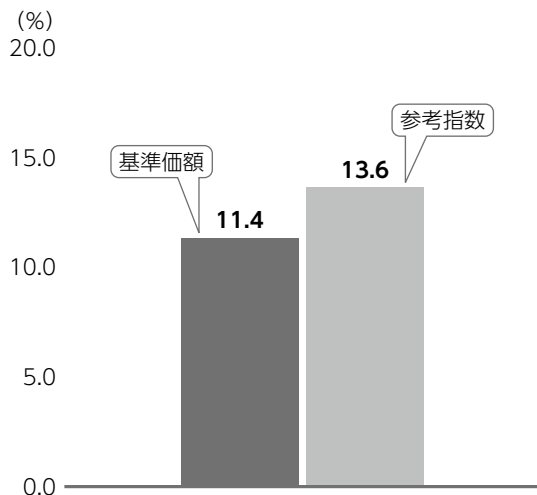
▶ ポートフォリオについて (2020年8月12日から2021年8月10日まで)

当期間の騰落率は、+11.4%となりました。

現在のバリュエーション（投資価値評価）に鑑みて、ポートフォリオのベータ（市場全体の動きに対する感応度）は1を下回る水準としています。引き続き、質の高いハイイールド債券を中心とした保守的なポートフォリオを維持しつつ、SDGsの観点からエネルギーなどのセクターをアンダーウェイトとしています。ハイイールド債券市場は、予想外の悪材料に対して脆弱な状態にあると考えられます。こうした見極めが難しい局面においては、保有債券の価格変動リスクを勘案し、慎重に運用を行うことが重要と考えています。

▶ ベンチマークとの差異について (2020年8月12日から2021年8月10日まで)

基準価額と参考指数の騰落率対比



当ファンドは運用の指標となるベンチマークはありませんが、参考指数としてブルームバーグ・バークレイズ・グローバル・ハイイールド社債インデックス（米ドルヘッジ、円換算）を設けています。

左のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

2 今後の運用方針

2021年度の米国の名目GDP（国内総生産）成長率は、想定外の出来事がない限り前年比10%に達する見通しです。注目となっているインフレ率は急上昇しましたが、上昇は一時的なものであるとの見方が支配的です。ハイイールド債券市場は、予想外の悪材料に対して脆弱な状態にあると考えられます。引き続き質の高いハイイールド債券への投資を通じて相対的に高いインカムゲイン（利子収入）の獲得を目指すとともに、SDGs貢献度評価を用いて中長期的な事業の存続、発展が期待される企業を選別することで、ハイイールド債券への投資リスクの低減を図っていく方針です。

■ 1万口当たりの費用明細 (2020年8月12日から2021年8月10日まで)

| 項 目 | 金 額 | 比 率 | 項 目 の 概 要 |
|---------------------|-----------|-------------------|---|
| (a) その他費用 (保管費用) | 6円 (5) | 0.054% (0.041) | 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：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| (その他) | (1) | (0.013) | |
| 合 計 | 6 | 0.054 | |

期中の平均基準価額は11,054円です。

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況 (2020年8月12日から2021年8月10日まで)

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|--|---------|-------|-------------------|------------------------------|
| 外 国 | ア メ リ カ | 社 債 券 | 千アメリカ・ドル 2,594 | 千アメリカ・ドル 5,192 (1,308) |
| | イ ギ リ ス | 社 債 券 | 千イギリス・ポンド 201 | 千イギリス・ポンド 101 |
| | ユ ー ロ | | 千ユーロ | 千ユーロ |
| | アイルランド | 社 債 券 | — | 106 |
| | オランダ | 社 債 券 | 100 | 159 |
| | ベルギー | 社 債 券 | 100 | 108 |
| | ルクセンブルグ | 社 債 券 | 98 | — |
| | フランス | 社 債 券 | 400 | 398 (101) |
| | ドイツ | 社 債 券 | — | 62 |
| | スペイン | 社 債 券 | 286 | 531 (90) |
| | イタリア | 社 債 券 | 199 | — |
| オーストリア | 社 債 券 | 106 | 212 | |
| そ の 他 | 社 債 券 | 511 | 759 (98) | |

※金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

※（ ）内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

※社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2020年8月12日から2021年8月10日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

※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 (2020年8月12日から2021年8月10日まで)

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。

■ 組入れ資産の明細 (2021年8月10日現在)

公社債

A 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

| 区 分 | 期 | | | | 末 | | | | |
|---------------|-------------------|-------------------|-----------------|-----------|--------------------|-------------------|-----------|----------|--|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 組 入 比 率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 | | | |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 | |
| ア メ リ カ | 千アメリカ・ドル 8,978 | 千アメリカ・ドル 9,481 | 千円 1,046,400 | % 68.4 | % 55.6 | % 45.3 | % 19.4 | % 3.7 | |
| イ ギ リ ス | 千イギリス・ポンド 100 | 千イギリス・ポンド 109 | 16,705 | 1.1 | 1.1 | — | 1.1 | — | |
| ユ ー ロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | | |
| オ ラ ン ダ | 300 | 306 | 39,666 | 2.6 | 2.6 | 2.6 | — | — | |
| ベ ル ギ ー | 100 | 100 | 13,050 | 0.9 | 0.9 | — | 0.9 | — | |
| ル ク セ ン ブ ル グ | 100 | 95 | 12,305 | 0.8 | 0.8 | 0.8 | — | — | |
| フ ラ ン ス | 313 | 320 | 41,513 | 2.7 | 1.8 | 1.7 | 1.0 | — | |
| ド イ ツ | 300 | 315 | 40,915 | 2.7 | 2.7 | 0.9 | 1.7 | — | |
| ス ペ イ ン | 200 | 201 | 26,138 | 1.7 | 1.7 | 0.9 | 0.9 | — | |
| イ タ リ ア | 300 | 312 | 40,458 | 2.6 | 0.9 | 2.6 | — | — | |
| オ ー ス ト リ ア | 200 | 208 | 27,036 | 1.8 | 1.8 | — | 1.8 | — | |
| そ の 他 | 1,121 | 1,163 | 150,703 | 9.8 | 9.8 | 7.3 | 1.7 | 0.8 | |
| 合 計 | — | — | 1,454,894 | 95.0 | 79.7 | 62.1 | 28.4 | 4.5 | |

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本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。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

世界SDGsハイインカム・マザーファンド

B 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債

| 区分 | 銘柄 | 種類 | 期 | | | | 末 | |
|------|--------------------------|----|--------|----------|----------|--------|------------|--|
| | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| アメリカ | XEROX HOLDINGS CORP | 社債 | 5.5000 | 72 | 75 | 8,386 | 2028/08/15 | |
| | XEROX HOLDINGS CORP | 社債 | 5.0000 | 34 | 36 | 3,993 | 2025/08/15 | |
| | MILLICOM INTL CELLULAR | 社債 | 6.2500 | 180 | 197 | 21,776 | 2029/03/25 | |
| | REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD | 社債 | 4.0000 | 188 | 186 | 20,572 | 2027/10/15 | |
| | CENTURYLINK INC | 社債 | 5.6250 | 88 | 95 | 10,512 | 2025/04/01 | |
| | QWEST CORP | 社債 | 7.2500 | 102 | 120 | 13,263 | 2025/09/15 | |
| | ENERGIZER HOLDINGS INC | 社債 | 4.3750 | 42 | 42 | 4,664 | 2029/03/31 | |
| | SBA COMMUNICATIONS CORP | 社債 | 3.8750 | 27 | 27 | 3,070 | 2027/02/15 | |
| | BANCO DO BRASIL (CAYMAN) | 社債 | 4.6250 | 200 | 212 | 23,435 | 2025/01/15 | |
| | CROWN CORK & SEAL CO INC | 社債 | 7.3750 | 86 | 105 | 11,685 | 2026/12/15 | |
| | CROWN AMER/CAP CORP IV | 社債 | 4.5000 | 96 | 99 | 11,031 | 2023/01/15 | |
| | ZIGGO BOND CO BV | 社債 | 5.1250 | 200 | 204 | 22,514 | 2030/02/28 | |
| | OWENS-BROCKWAY | 社債 | 6.3750 | 65 | 72 | 7,998 | 2025/08/15 | |
| | TELECOM ITALIA CAPITAL | 社債 | 6.3750 | 69 | 81 | 8,996 | 2033/11/15 | |
| | BANK OF IRELAND GROUP | 社債 | 4.1250 | 200 | 204 | 22,596 | 2027/09/19 | |
| | ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA | 社債 | 5.2500 | 200 | 204 | 22,513 | 2027/08/15 | |
| | BBVA BANCOMER SA TEXAS | 社債 | 5.1250 | 200 | 207 | 22,875 | 2033/01/18 | |
| | LONGFOR PROPERTIES | 社債 | 3.8750 | 200 | 204 | 22,579 | 2022/07/13 | |
| | NETWORK 121 LTD | 社債 | 5.6500 | 200 | 211 | 23,368 | — (※) | |
| | LEVI STRAUSS & CO | 社債 | 5.0000 | 8 | 8 | 900 | 2025/05/01 | |
| | LEVI STRAUSS & CO | 社債 | 3.5000 | 14 | 14 | 1,589 | 2031/03/01 | |
| | TURK SISE VE CAM FABRIKA | 社債 | 6.9500 | 200 | 222 | 24,593 | 2026/03/14 | |
| | BANCO MERCANTIL DE NORTE | 社債 | 6.7500 | 200 | 215 | 23,779 | — (※) | |
| | DELL INC | 社債 | 6.5000 | 98 | 129 | 14,262 | 2038/04/15 | |
| | MATTAMY GROUP CORP | 社債 | 4.6250 | 35 | 35 | 3,964 | 2030/03/01 | |
| | SPRINT CAPITAL CORP | 社債 | 6.8750 | 130 | 168 | 18,562 | 2028/11/15 | |
| | HCA INC | 社債 | 7.0500 | 90 | 113 | 12,502 | 2027/12/01 | |
| | HCA INC | 社債 | 7.5000 | 87 | 123 | 13,647 | 2033/11/06 | |
| | BALL CORP | 社債 | 5.2500 | 58 | 65 | 7,223 | 2025/07/01 | |
| | BALL CORP | 社債 | 2.8750 | 180 | 178 | 19,666 | 2030/08/15 | |
| | HTA GROUP LTD | 社債 | 7.0000 | 200 | 212 | 23,418 | 2025/12/18 | |
| | SUZANO AUSTRIA GMBH | 社債 | 6.0000 | 200 | 238 | 26,321 | 2029/01/15 | |
| | ARAMARK SERVICES INC | 社債 | 5.0000 | 89 | 91 | 10,128 | 2028/02/01 | |
| | AVIS BUDGET CAR/FINANCE | 社債 | 5.2500 | 52 | 53 | 5,853 | 2025/03/15 | |
| | B&G FOODS INC | 社債 | 5.2500 | 76 | 78 | 8,701 | 2027/09/15 | |
| | STANDARD INDUSTRIES INC | 社債 | 4.7500 | 94 | 97 | 10,780 | 2028/01/15 | |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 社債 | 5.0000 | 116 | 121 | 13,377 | 2028/02/01 | |
| | CCO HLDGS LLC/CAP CORP | 社債 | 4.7500 | 111 | 116 | 12,908 | 2030/03/01 | |
| | FMG RESOURCES AUG 2006 | 社債 | 5.1250 | 54 | 58 | 6,413 | 2024/05/15 | |
| | GOODYEAR TIRE & RUBBER | 社債 | 4.8750 | 97 | 102 | 11,333 | 2027/03/15 | |
| | HANESBRANDS INC | 社債 | 4.6250 | 56 | 59 | 6,566 | 2024/05/15 | |
| | HILTON DOMESTIC OPERATIN | 社債 | 3.7500 | 60 | 60 | 6,679 | 2029/05/01 | |
| | HILTON DOMESTIC OPERATIN | 社債 | 4.0000 | 40 | 40 | 4,508 | 2031/05/01 | |
| | INGEVITY CORP | 社債 | 4.5000 | 155 | 157 | 17,386 | 2026/02/01 | |
| | LEVEL 3 FINANCING INC | 社債 | 4.6250 | 95 | 98 | 10,831 | 2027/09/15 | |
| | LEVEL 3 FINANCING INC | 社債 | 3.7500 | 7 | 6 | 746 | 2029/07/15 | |

世界SDGsハイインカム・マザーファンド

| 区 分 | 銘 柄 | 種 類 | 期 | | 評 価 額 | | 末 |
|-----|--------------------------|-------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
| | | | 利 率 | 額 面 金 額 | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | | | |
| | MPT OPER PARTNERSP/FINL | 社 債 券 | 5.0000 | 106 | 112 | 12,385 | 2027/10/15 |
| | MPT OPER PARTNERSP/FINL | 社 債 券 | 4.6250 | 64 | 68 | 7,570 | 2029/08/01 |
| | MPT OPER PARTNERSP/FINL | 社 債 券 | 3.5000 | 36 | 36 | 4,057 | 2031/03/15 |
| | POST HOLDINGS INC | 社 債 券 | 5.7500 | 92 | 95 | 10,573 | 2027/03/01 |
| | POST HOLDINGS INC | 社 債 券 | 5.6250 | 94 | 98 | 10,892 | 2028/01/15 |
| | PULTE GROUP INC | 社 債 券 | 7.8750 | 56 | 81 | 9,002 | 2032/06/15 |
| | SPCM SA | 社 債 券 | 4.8750 | 200 | 205 | 22,624 | 2025/09/15 |
| | SEALED AIR CORP | 社 債 券 | 5.5000 | 95 | 106 | 11,702 | 2025/09/15 |
| | SEALED AIR CORP | 社 債 券 | 4.0000 | 100 | 106 | 11,794 | 2027/12/01 |
| | SILGAN HOLDINGS INC | 社 債 券 | 4.1250 | 18 | 18 | 2,056 | 2028/02/01 |
| | SMURFIT KAPPA TREASURY | 社 債 券 | 7.5000 | 115 | 143 | 15,857 | 2025/11/20 |
| | SPECTRUM BRANDS INC | 社 債 券 | 5.7500 | 4 | 4 | 453 | 2025/07/15 |
| | SPECTRUM BRANDS INC | 社 債 券 | 5.5000 | 4 | 4 | 477 | 2030/07/15 |
| | TITAN ACQ/CO-BORROWER | 社 債 券 | 7.7500 | 60 | 61 | 6,811 | 2026/04/15 |
| | UNITED RENTALS NORTH AM | 社 債 券 | 4.8750 | 110 | 115 | 12,788 | 2028/01/15 |
| | UNITED RENTALS NORTH AM | 社 債 券 | 4.0000 | 75 | 77 | 8,585 | 2030/07/15 |
| | UNITED RENTALS NORTH AM | 社 債 券 | 3.8750 | 13 | 13 | 1,472 | 2031/02/15 |
| | ZF NA CAPITAL | 社 債 券 | 4.7500 | 250 | 272 | 30,073 | 2025/04/29 |
| | YINGDE GASES INVSTMT LTD | 社 債 券 | 6.2500 | 200 | 205 | 22,626 | 2023/01/19 |
| | FLEX ACQUISITION CO INC | 社 債 券 | 6.8750 | 49 | 49 | 5,468 | 2025/01/15 |
| | SS&C TECHNOLOGIES INC | 社 債 券 | 5.5000 | 95 | 100 | 11,062 | 2027/09/30 |
| | BERRY GLOBAL ESCROW CORP | 社 債 券 | 4.8750 | 100 | 105 | 11,615 | 2026/07/15 |
| | MERCER INTL INC | 社 債 券 | 5.5000 | 100 | 102 | 11,285 | 2026/01/15 |
| | MERCER INTL INC | 社 債 券 | 5.1250 | 26 | 26 | 2,915 | 2029/02/01 |
| | DIAMOND SPORTS GR/DIAMON | 社 債 券 | 5.3750 | 200 | 115 | 12,774 | 2026/08/15 |
| | ALBERTSONS COS/SAFEWAY | 社 債 券 | 4.6250 | 88 | 92 | 10,258 | 2027/01/15 |
| | CASCADES INC/USA INC | 社 債 券 | 5.1250 | 56 | 58 | 6,473 | 2026/01/15 |
| | GRAPHIC PACKAGING INTERN | 社 債 券 | 3.5000 | 125 | 126 | 13,933 | 2028/03/15 |
| | GRAPHIC PACKAGING INTERN | 社 債 券 | 3.5000 | 38 | 37 | 4,157 | 2029/03/01 |
| | ENCOMPASS HEALTH CORP | 社 債 券 | 4.5000 | 14 | 14 | 1,614 | 2028/02/01 |
| | EDGEWELL PERSONAL CARE | 社 債 券 | 5.5000 | 45 | 47 | 5,269 | 2028/06/01 |
| | EDGEWELL PERSONAL CARE | 社 債 券 | 4.1250 | 43 | 43 | 4,776 | 2029/04/01 |
| | QORVO INC | 社 債 券 | 4.3750 | 12 | 13 | 1,450 | 2029/10/15 |
| | PATTERN ENERGY OP LP/PAT | 社 債 券 | 4.5000 | 90 | 93 | 10,304 | 2028/08/15 |
| | SERVICE CORP INTL | 社 債 券 | 3.3750 | 14 | 14 | 1,548 | 2030/08/15 |
| | NCR CORP | 社 債 券 | 5.0000 | 23 | 23 | 2,598 | 2028/10/01 |
| | NCR CORP | 社 債 券 | 5.2500 | 6 | 6 | 689 | 2030/10/01 |
| | NCR CORP | 社 債 券 | 5.1250 | 25 | 25 | 2,837 | 2029/04/15 |
| | BAUSCH HEALTH COS INC | 社 債 券 | 5.7500 | 50 | 52 | 5,745 | 2027/08/15 |
| | VMED O2 UK FINANCING I | 社 債 券 | 4.2500 | 200 | 198 | 21,881 | 2031/01/31 |
| | HOLOGIC INC | 社 債 券 | 3.2500 | 47 | 47 | 5,232 | 2029/02/15 |
| | GARTNER INC | 社 債 券 | 3.7500 | 10 | 10 | 1,134 | 2030/10/01 |
| | GARTNER INC | 社 債 券 | 3.6250 | 15 | 15 | 1,689 | 2029/06/15 |
| | GFL ENVIRONMENTAL INC | 社 債 券 | 3.5000 | 124 | 123 | 13,647 | 2028/09/01 |
| | CAS CAPITAL N01 LTD | 社 債 券 | 4.0000 | 200 | 202 | 22,331 | — (※) |
| | ATP TOW / AND TELECOM | 社 債 券 | 4.0500 | 200 | 204 | 22,513 | 2026/04/27 |
| | XIAOMI BEST TIME INTL | 社 債 券 | 2.8750 | 200 | 199 | 22,011 | 2031/07/14 |
| | TRI POINTE HOMES INC | 社 債 券 | 5.7000 | 40 | 44 | 4,884 | 2028/06/15 |
| 小 | 計 | | — | 8,978 | 9,481 | 1,046,400 | — |

世界SDGsハイインカム・マザーファンド

| 区分 | 銘柄 | 種類 | 期 | | | | 末 |
|---------|---------------------------|-----|--------|------------------|------------------|-----------|------------|
| | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| イギリス | ANGLIAN WATER OSPREY FIN | 社債券 | 4.0000 | 千イギリス・ポンド 100 | 千イギリス・ポンド 109 | 16,705 | 2026/03/08 |
| 小計 | | | — | 100 | 109 | 16,705 | — |
| ユ-ロ | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | |
| オランダ | TELEFONICA EUROPE BV | 社債券 | 3.8750 | 100 | 109 | 14,141 | —(※) |
| | Q-PARK HOLDING BV | 社債券 | 2.0000 | 100 | 94 | 12,283 | 2027/03/01 |
| | TITAN HOLDINGS II BV | 社債券 | 5.1250 | 100 | 102 | 13,241 | 2029/07/15 |
| ベルギー | ONTEX GROUP NV | 社債券 | 3.5000 | 100 | 100 | 13,050 | 2026/07/15 |
| ルクセンブルグ | ADLER GROUP SA | 社債券 | 2.2500 | 100 | 95 | 12,305 | 2029/01/14 |
| フランス | VEOLIA ENVIRONNEMENT SA | 社債券 | 2.5000 | 100 | 102 | 13,317 | —(※) |
| | PAPREC HOLDING SA | 社債券 | 4.0000 | 113 | 115 | 14,935 | 2025/03/31 |
| | CHROME BIDCO SASU | 社債券 | 3.5000 | 100 | 102 | 13,260 | 2028/05/31 |
| ドイツ | CERAMTEC BONDCO GMBH | 社債券 | 5.2500 | 100 | 102 | 13,236 | 2025/12/15 |
| | IHO VERWALTUNGS GMBH | 社債券 | 3.6250 | 100 | 101 | 13,200 | 2025/05/15 |
| | INFINEON TECHNOLOGIES AG | 社債券 | 3.6250 | 100 | 111 | 14,478 | —(※) |
| スペイン | NH HOTEL GROUP SA | 社債券 | 4.0000 | 100 | 100 | 13,069 | 2026/07/02 |
| | CELLNEX FINANCE CO SA | 社債券 | 2.0000 | 100 | 100 | 13,069 | 2033/02/15 |
| イタリア | UNICREDIT SPA | 社債券 | 2.0000 | 200 | 202 | 26,252 | 2029/09/23 |
| | UNIPOLSAI ASSICURAZIONI | 社債券 | 3.8750 | 100 | 109 | 14,206 | 2028/03/01 |
| オーストリア | SAPPI PAPIER HOLDING GMBH | 社債券 | 3.1250 | 100 | 101 | 13,099 | 2026/04/15 |
| | AMS AG | 社債券 | 6.0000 | 100 | 107 | 13,936 | 2025/07/31 |
| その他 | CEMEX SAB DE CV | 社債券 | 3.1250 | 100 | 102 | 13,309 | 2026/03/19 |
| | VODAFONE GROUP PLC | 社債券 | 3.0000 | 100 | 104 | 13,522 | 2080/08/27 |
| | EC FINANCE PLC | 社債券 | 2.3750 | 100 | 100 | 12,985 | 2022/11/15 |
| | ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA | 社債券 | 2.1250 | 100 | 100 | 13,049 | 2026/08/15 |
| | NETFLIX INC | 社債券 | 3.6250 | 100 | 120 | 15,660 | 2030/06/15 |
| | IQVIA INC | 社債券 | 2.8750 | 100 | 104 | 13,471 | 2028/06/15 |
| | BELDEN INC | 社債券 | 4.1250 | 105 | 107 | 13,967 | 2026/10/15 |
| | NOMAD FOODS BONDCO PLC | 社債券 | 2.5000 | 100 | 102 | 13,289 | 2028/06/24 |
| | WMG ACQUISITION CORP | 社債券 | 2.2500 | 116 | 116 | 15,090 | 2031/08/15 |
| | COGENT COMMUNICATIONS GR | 社債券 | 4.3750 | 100 | 102 | 13,228 | 2024/06/30 |
| | CATALENT PHARMA SOLUTION | 社債券 | 2.3750 | 100 | 101 | 13,129 | 2028/03/01 |
| | 小計 | | | — | 2,934 | 3,024 | 391,788 |
| 合計 | | | — | — | — | 1,454,894 | — |

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本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。

(※) 当銘柄は永久劣後債であり、償還期限の定めがありません。一定の場合を除いて償還されずに利払いが継続される債券のことをいいます。

■ 投資信託財産の構成

(2021年8月10日現在)

| 項 目 | 期 末 | |
|-------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 1,454,894 | 93.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 101,966 | 6.5 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 1,556,860 | 100.0 |

※期末における外貨建資産（1,518,461千円）の投資信託財産総額（1,556,860千円）に対する比率は97.5%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本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、期末における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.36円、1イギリス・ポンド=152.85円、1ユーロ=129.53円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年8月10日現在)

| 項 目 | 期 末 |
|-----------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 2,424,133,331円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 70,421,403 |
| 公 社 債 (評価額) | 1,454,894,775 |
| 未 収 入 金 | 882,055,633 |
| 未 収 利 息 | 15,829,588 |
| 前 払 費 用 | 931,932 |
| (B) 負 債 | 893,207,689 |
| 未 払 金 | 882,580,216 |
| 未 払 解 約 金 | 10,627,473 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 1,530,925,642 |
| 元 本 | 1,303,665,396 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 227,260,246 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 1,303,665,396口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 11,743円 |

※当期における期首元本額1,825,052,718円、期中追加設定元本額60,733,682円、期中一部解約元本額582,121,004円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

| | |
|----------------------------------|--------------|
| 世界SDGsハイインカム・ファンド（為替ヘッジあり 毎月分配型） | 496,696,591円 |
| 世界SDGsハイインカム・ファンド（為替ヘッジなし 毎月分配型） | 176,775,779円 |
| 世界SDGsハイインカム・ファンド（為替ヘッジあり 資産成長型） | 525,215,711円 |
| 世界SDGsハイインカム・ファンド（為替ヘッジなし 資産成長型） | 104,977,315円 |

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

■ 損益の状況

(自2020年8月12日 至2021年8月10日)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 79,953,291円 |
| 受 取 利 息 | 78,565,831 |
| そ の 他 収 益 金 | 1,392,866 |
| 支 払 利 息 | △ 5,406 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 104,427,802 |
| 売 買 損 益 | 169,388,446 |
| 売 買 損 益 | △ 64,960,644 |
| (C) そ の 他 費 用 等 | △ 958,706 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 183,422,387 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 99,590,548 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | △ 60,287,495 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 4,534,806 |
| (H) 合 計 (D + E + F + G) | 227,260,246 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H) | 227,260,246 |

※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。

※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。

※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。