

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	2032年6月4日まで（2021年1月21日設定）	
運用方針	サイバーセキュリティ株式マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の金融商品取引所に上場しているサイバーセキュリティ関連企業の株式に投資を行います。なお、当ファンドにおいて、サイバーセキュリティ関連企業とは、サイバー攻撃に対するセキュリティ技術を有し、これを活用した製品・サービスを提供するテクノロジー関連の企業等をいいます。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。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為替変動リスクの低減をはかります。なお、為替ヘッジが困難な一部の通貨については、当該通貨との相関等を勘案し、他の通貨による代替ヘッジを行う場合があります。マザーファンドの株式等の運用にあたっては、アリアンツ・グローバル・インベスターズ・ユーエス・エルエルシーに運用指図に関する権限を委託します。	
主要運用対象	ベビーファンド	サイバーセキュリティ株式マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	日本を含む世界のサイバーセキュリティ関連企業の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。原則として、決算日の前営業日の基準価額に応じ、提示された金額の分配をめざします。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。また、決算日にかけて基準価額が急激に変動し、提示された分配金額が分配対象額を超える場合等には、分配を行わないことがあります。なお、第2計算期末までの間は、収益の分配は行いません。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

サイバーセキュリティ 株式オープン（為替ヘッジあり） 予想分配金提示型



第12期（決算日：2022年1月6日）
 第13期（決算日：2022年2月7日）
 第14期（決算日：2022年3月7日）
 第15期（決算日：2022年4月6日）
 第16期（決算日：2022年5月6日）
 第17期（決算日：2022年6月6日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「サイバーセキュリティ株式オープン（為替ヘッジあり）予想分配金提示型」は、去る6月6日に第17期の決算を行いましたので、法令に基づいて第12期～第17期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル **0120-151034**
 （受付時間：営業日の9:00～17:00、
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

ファンドマネージャーのコメント

当作成期の運用に主眼をおいたポイントをご説明させていただきます。

■ポートフォリオ概況

サイバーセキュリティ関連企業を含む高成長テクノロジー企業にとって厳しい環境となりました。米連邦準備制度理事会（FRB）がインフレ抑制のために、より積極的に行動すると懸念されたことや、原材料費や賃金などの上昇について懸念が高まったことなどからサイバーセキュリティ関連企業を含む高成長テクノロジー企業の株価は大幅に下落しました。世界でのサイバー攻撃の増加や、脅威の継続により、セキュリティ・ソリューションへの投資が急増しています。そのため、ポートフォリオのサイバーセキュリティ関連企業は利益成長を着実に達成し、長期的に魅力的なパフォーマンスを提供できると考えています。

■運用のポイント

サイバー攻撃に対するセキュリティ技術を有し、これを活用した製品・サービスを提供するテクノロジー関連の企業への投資を行っています。銘柄選定に当たっては、セキュリティが脆弱な企業からの需要増加の恩恵を受ける企業をはじめ、IoT（モノのインターネット）やクラウド・コンピューティングなどの分野でのセキュリティ関連企業、サイバーセキュリティに関するコンサルティングサービスを提供する企業などに注目しています。

■運用環境見通しおよび今後の運用方針

サイバーセキュリティ産業は、一時的ではなく、今後も成長が継続すると考えています。サイバーセキュリティ産業は、電子マネーや電子口座の増加、クラウド・コンピューティングの活用、各国の覇権争い、技術盗難などのような絶えず変化する環境やテクノロジーの影響を受け、長期的に成長が見込まれ

る産業です。サイバー犯罪の高度化やクラウド技術の活用などにより、新しいセキュリティ対策が必要となるため、従来のセキュリティ企業は、新しいテクノロジーの開発や、中小企業の買収などを進めています。新興のセキュリティ企業は、クラウドデータを保護するソリューションの設計などを行い、急速に成長しています。魅力的な製品やサービスを提供し、効率的なビジネス・モデルを有するサイバーセキュリティ企業は、将来的に、売上高や収益性の大幅な拡大を期待できるとみています。サイバーセキュリティへの支出は今後も継続して必要となり、このようなポジティブな要因によって、今後数年にわたり、サイバーセキュリティ産業のリーダー的地位にいる企業は、魅力的な売上高成長を達成することができるとみています。テクノロジー関連株式は短期的に値動きが大きくなることがあるものの、最終的には業績の伸びが長期的な株価上昇の牽引役と考えています。そこに十分な投資機会があると考えており、我々のリサーチ重視のボトムアップ・プロセスはこの投資テーマで作りに出される価値を捉える最も効果的な手段であると考えています。



アリアンツ・グローバル・インベスターズ・ユーエス・エルエルシー
マネージング・ディレクター
シニア・ポートフォリオ・マネージャー
ウォルター・プライス

上記は、アリアンツ・グローバル・インベスターズ・ユーエス・エルエルシーの資料を基に、三菱UFJ国際投信が作成したものです。

本資料の表記にあたって

- ・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。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○設定以来の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額			株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金 騰 落 中 率			
(設定日)	円				%	%	百万円
2021年1月21日	10,000		—	—	—	—	1,686
1期(2021年2月8日)	10,174		—	1.7	94.3	—	2,865
2期(2021年3月8日)	8,947		—	△12.1	94.7	—	3,925
3期(2021年4月6日)	9,307		0	4.0	93.8	—	4,537
4期(2021年5月6日)	9,360		0	0.6	93.0	—	4,834
5期(2021年6月7日)	9,674		0	3.4	93.1	—	5,260
6期(2021年7月6日)	10,458		100	9.1	92.3	—	5,725
7期(2021年8月6日)	10,933		100	5.5	91.7	—	6,469
8期(2021年9月6日)	11,468		200	6.7	91.6	—	7,331
9期(2021年10月6日)	10,563		100	△7.0	92.6	—	8,002
10期(2021年11月8日)	11,781		300	14.4	92.3	—	10,174
11期(2021年12月6日)	10,355		100	△11.3	91.9	—	11,172
12期(2022年1月6日)	9,787		100	△4.5	94.0	—	11,906
13期(2022年2月7日)	9,316		0	△4.8	93.4	—	11,891
14期(2022年3月7日)	8,864		0	△4.9	93.1	—	11,719
15期(2022年4月6日)	9,315		0	5.1	94.1	—	13,141
16期(2022年5月6日)	7,863		0	△15.6	93.1	—	11,394
17期(2022年6月6日)	7,442		0	△5.4	93.3	—	10,737

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 信託約款の規定にしたがい、第2期までの収益分配は行っていません。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 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、ベンチマーク等はありません。

(注) 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」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○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		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
			騰 落 率	騰 落 率		
第12期	(期 首) 2021年12月6日	円 10,355	% —	% —	% 91.9	% —
	12月末	10,937	5.6	—	92.9	—
	(期 末) 2022年1月6日	9,887	△ 4.5	—	94.0	—
第13期	(期 首) 2022年1月6日	9,787	—	—	94.0	—
	1月末	9,003	△ 8.0	—	93.5	—
	(期 末) 2022年2月7日	9,316	△ 4.8	—	93.4	—
第14期	(期 首) 2022年2月7日	9,316	—	—	93.4	—
	2月末	9,166	△ 1.6	—	93.7	—
	(期 末) 2022年3月7日	8,864	△ 4.9	—	93.1	—
第15期	(期 首) 2022年3月7日	8,864	—	—	93.1	—
	3月末	9,414	6.2	—	94.2	—
	(期 末) 2022年4月6日	9,315	5.1	—	94.1	—
第16期	(期 首) 2022年4月6日	9,315	—	—	94.1	—
	4月末	8,240	△11.5	—	94.0	—
	(期 末) 2022年5月6日	7,863	△15.6	—	93.1	—
第17期	(期 首) 2022年5月6日	7,863	—	—	93.1	—
	5月末	7,490	△ 4.7	—	93.2	—
	(期 末) 2022年6月6日	7,442	△ 5.4	—	93.3	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注) 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」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

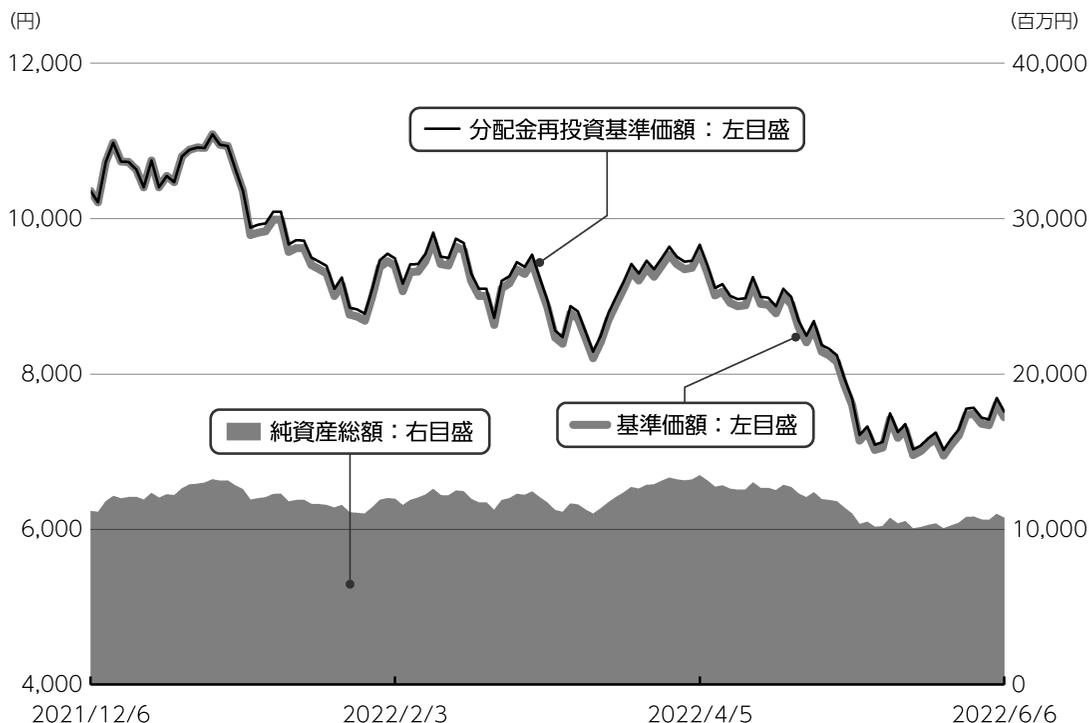
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第12期～第17期：2021年12月7日～2022年6月6日

▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第12期首 10,355円

第17期末 7,442円

既払分配金 100円

騰落率 -27.4%

(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみな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。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ27.4%（分配金再投資ベース）の下落となりました。

▶ 基準価額の主な変動要因

下落要因

個別銘柄（OKTA INCやZSCALER INCなど）の株価下落などが、基準価額の下落要因となりました。

第12期～第17期：2021年12月7日～2022年6月6日

投資環境について

- ▶ **株式市況**
当作成期のテクノロジーセクターの株価は、下落しました。
インフレ長期化を背景とした米国での金

融引き締め加速への警戒感やロシア・ウクライナ情勢に対する警戒感が高まったこと、都市封鎖に起因する中国景気減速懸念を受け、下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

- ▶ **サイバーセキュリティ株式オープン（為替ヘッジあり）予想分配金提示型**
サイバーセキュリティ株式マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、実質的な運用はマザーファンドで行いました。実質組入外貨建資産については対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかりました。
- ▶ **サイバーセキュリティ株式マザーファンド**
日本を含む世界のサイバーセキュリティ関連企業の株式に投資を行いました。なお、当ファンドにおいて、サイバーセキュリティ関連企業とは、サイバー攻撃に対するセキュリティ技術を有し、これを活用した製品・サービスを提供するテクノロジー関連の企業等をいいます。株式等への投資にあたっては、サイバーセキュリティの需要拡大および技術向上の恩恵を享受すると考えられる企業の株式の

中から、持続的な利益成長性、市場優位性、財務健全性、株価水準等を考慮して組入銘柄を選定しました。

銘柄選定に当たっては、セキュリティが脆弱な企業からの需要増加の恩恵を受ける企業をはじめ、IoTやクラウド・コンピューティングなどの分野でのセキュリティ関連企業、サイバーセキュリティに関するコンサルティングサービスを提供する企業などに注目しました。なお、株式等の運用にあたっては、アリアンツ・グローバル・インベスターズ・ユーエス・エルエルシーに運用指図に関する権限を委託しています。

銘柄入替のポイントは、クラウド・サービス分野で堅調に業績を伸ばしていることなどを評価し、ORACLE CORPを新規購入しました。業績成長の実現可能性が低下していると判断し、SHOPIFY INC - CLASS A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について

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、ベンチマーク等はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し決定します。原則として、決算日の前営業日の基準価額に応じた分配をめざします。この結果、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

(単位：円、1万円当たり、税込み)

項目	第12期 2021年12月7日~ 2022年1月6日	第13期 2022年1月7日~ 2022年2月7日	第14期 2022年2月8日~ 2022年3月7日	第15期 2022年3月8日~ 2022年4月6日	第16期 2022年4月7日~ 2022年5月6日	第17期 2022年5月7日~ 2022年6月6日
当期分配金 (対基準価額比率)	100 (1.011%)	— (—%)	— (—%)	— (—%)	— (—%)	— (—%)
当期の収益	—	—	—	—	—	—
当期の収益以外	100	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	1,826	1,826	1,826	1,828	1,828	1,828

(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 （作成対象期間末での見解です。）

▶ サイバーセキュリティ株式オープン （為替ヘッジあり）予想分配金提示型

引き続き、サイバーセキュリティ株式マザーファンドを主要投資対象とし、実質的な運用はマザーファンドで行います。実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかります。

▶ サイバーセキュリティ株式マザーファンド

サイバーセキュリティ関連銘柄は、短期的に値動きが大きくなることもあるものの、個人・企業・国のサイバーセキュリティへの関心やテクノロジーの発展に伴う長期的な需要が見込まれ、同ビジネスを営む企業への投資妙味は大きいと見て

います。

当ファンドの運用については、引き続き、サイバー攻撃に対するセキュリティ技術を有し、これを活用した製品・サービスを提供するテクノロジー関連の企業への投資を行います。銘柄選定に当たっては、セキュリティが脆弱な企業からの需要増加の恩恵を受ける企業をはじめ、IoTやクラウド・コンピューティングなどの分野でのセキュリティ関連企業、サイバーセキュリティに関するコンサルティングサービスを提供する企業などに注目しています。

株式等の運用にあたっては、アライアンス・グローバル・インベスターズ・ユーエス・エルエルシーに運用指図に関する権限を委託します。

2021年12月7日～2022年6月6日

1 万口当たりの費用明細

項目	第12期～第17期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	84	0.932	(a) 信託報酬 = 作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (作成期中の日数 ÷ 年間日数)
(投 信 会 社)	(47)	(0.521)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(35)	(0.384)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.027)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	2	0.021	(b) 売買委託手数料 = 作成期中の売買委託手数料 ÷ 作成期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株 式)	(2)	(0.021)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.003	(c) 有価証券取引税 = 作成期中の有価証券取引税 ÷ 作成期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.003)	
(d) その他費用	1	0.010	(d) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.008)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	87	0.966	

作成期中の平均基準価額は、9,041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せん。

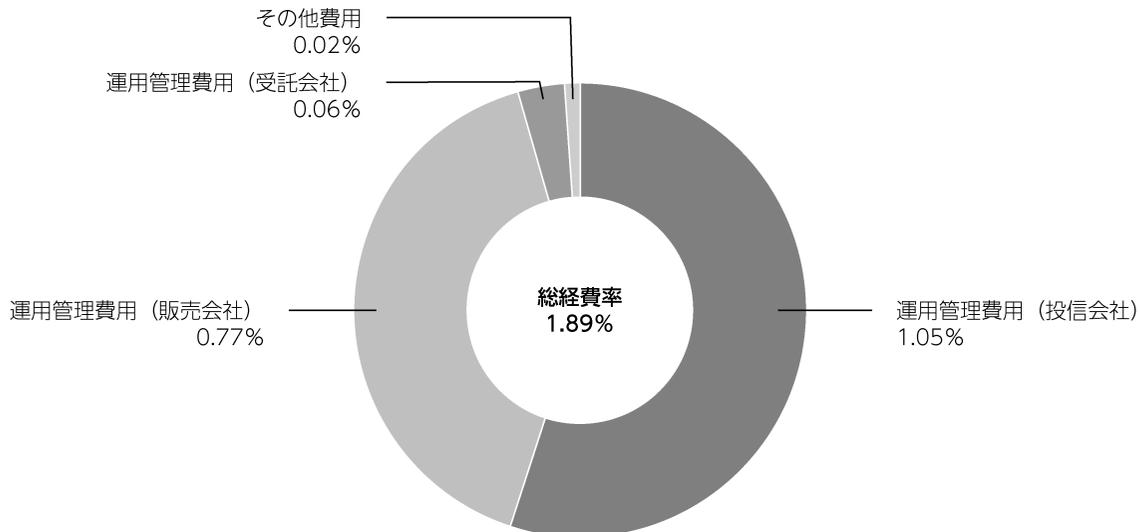
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 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。

（参考情報）

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成中の平均受益権口数に作成中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.89%**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) 前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

(2021年12月7日～2022年6月6日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第12期～第17期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
サイバーセキュリティ株式マザーファンド	1,409,799	4,353,000	803,278	2,440,000

○株式売買比率

(2021年12月7日～2022年6月6日)

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	第12期～第17期	
	サイバーセキュリティ株式マザーファンド	
(a) 当作成期中の株式売買金額	463,420,319千円	
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	522,720,693千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.88	

(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

(2021年12月7日～2022年6月6日)

利害関係人との取引状況

<サイバーセキュリティ株式オープン（為替ヘッジあり）予想分配金提示型>

区 分	第12期～第17期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 76,201	百万円 4,811	% 6.3	百万円 74,165	百万円 4,191	% 5.7

<サイバーセキュリティ株式マザーファンド>

区 分	第12期～第17期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 82,350	百万円 19,243	% 23.4	百万円 53,421	百万円 5,620	% 10.5

平均保有割合 2.2%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2022年6月6日現在)

親投資信託残高

銘	柄	第11期末	第17期末	
		口数	口数	評価額
		千口	千口	千円
サイバーセキュリティ株式マザーファンド		3,282,110	3,888,631	10,544,024

○投資信託財産の構成

(2022年6月6日現在)

項	目	第17期末	
		評価額	比率
		千円	%
サイバーセキュリティ株式マザーファンド		10,544,024	95.8
コール・ローン等、その他		467,954	4.2
投資信託財産総額		11,011,978	100.0

(注) サイバーセキュリティ株式マザーファンドにおいて、作成期末における外貨建純資産（479,967,319千円）の投資信託財産総額（491,902,258千円）に対する比率は97.6%です。

(注) 外貨建資産は、作成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、作成期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1アメリカドル=130.84円	1イギリスポンド=163.30円	100韓国ウォン=10.46円
-----------------	------------------	-----------------

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項	目	第12期末	第13期末	第14期末	第15期末	第16期末	第17期末
		2022年1月6日現在	2022年2月7日現在	2022年3月7日現在	2022年4月6日現在	2022年5月6日現在	2022年6月6日現在
		円	円	円	円	円	円
(A) 資産		23,171,223,146	22,942,887,973	22,579,300,301	25,286,974,556	22,017,340,791	20,691,661,446
	コール・ローン等	766,856,280	348,959,357	246,636,251	910,827,444	362,446,363	381,954,096
	サイバーセキュリティ株式マザーファンド(評価額)	11,474,984,471	11,594,640,948	11,416,126,937	12,796,542,090	11,127,298,714	10,544,024,201
	未収入金	10,929,382,395	10,999,287,668	10,916,537,113	11,579,605,022	10,527,595,714	9,765,683,149
(B) 負債		11,264,643,187	11,051,616,531	10,859,765,235	12,145,010,740	10,622,820,810	9,954,190,134
	未払金	11,121,932,141	11,031,826,102	10,831,685,097	12,120,147,114	10,595,401,135	9,923,211,179
	未払収益分配金	121,660,722	—	—	—	—	—
	未払解約金	1,232,912	602,555	10,677,125	5,911,547	8,326,931	14,193,225
	未払信託報酬	19,775,400	19,147,184	17,366,205	18,911,976	19,052,280	16,749,766
	未払利息	146	155	39	63	128	503
	その他未払費用	41,866	40,535	36,769	40,040	40,336	35,461
(C) 純資産総額(A-B)		11,906,579,959	11,891,271,442	11,719,535,066	13,141,963,816	11,394,519,981	10,737,471,312
	元本	12,166,072,290	12,764,720,767	13,220,755,276	14,108,657,826	14,491,412,139	14,428,325,161
	次期繰越損益金	△ 259,492,331	△ 873,449,325	△ 1,501,220,210	△ 966,694,010	△ 3,096,892,158	△ 3,690,853,849
(D) 受益権総口数		12,166,072,290口	12,764,720,767口	13,220,755,276口	14,108,657,826口	14,491,412,139口	14,428,325,161口
	1万口当たり基準価額(C/D)	9,787円	9,316円	8,864円	9,315円	7,863円	7,442円

○損益の状況

項 目	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期
	2021年12月7日～ 2022年1月6日	2022年1月7日～ 2022年2月7日	2022年2月8日～ 2022年3月7日	2022年3月8日～ 2022年4月6日	2022年4月7日～ 2022年5月6日	2022年5月7日～ 2022年6月6日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 4,255	△ 3,994	△ 3,309	△ 1,528	△ 5,937	△ 4,690
受取利息	401	-	80	38	-	-
支払利息	△ 4,656	△ 3,994	△ 3,389	△ 1,566	△ 5,937	△ 4,690
(B) 有価証券売買損益	△ 596,516,820	△ 558,308,707	△ 576,971,324	640,932,174	△ 2,053,496,541	△ 583,272,691
売買益	28,231,609	204,229,356	122,500,761	1,495,506,719	537,512,811	240,010,725
売買損	△ 624,748,429	△ 762,538,063	△ 699,472,085	△ 854,574,545	△ 2,591,009,352	△ 823,283,416
(C) 信託報酬等	△ 19,823,206	△ 19,187,719	△ 17,402,974	△ 18,952,016	△ 19,126,333	△ 16,826,658
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	△ 616,344,281	△ 577,500,420	△ 594,377,607	621,978,630	△ 2,072,628,811	△ 600,104,039
(E) 前期繰越損益金	△ 272,378,356	△ 1,002,993,979	△ 1,571,705,915	△ 2,149,808,388	△ 1,516,597,626	△ 3,540,845,413
(F) 追加信託差損益金	750,891,028	707,045,074	664,863,312	561,135,748	492,334,279	450,095,603
(配当等相当額)	(1,236,033,809)	(1,352,892,453)	(1,441,670,817)	(1,611,241,609)	(1,688,508,272)	(1,690,009,377)
(売買損益相当額)	(△ 485,142,781)	(△ 645,847,379)	(△ 776,807,505)	(△ 1,050,105,861)	(△ 1,196,173,993)	(△ 1,239,913,774)
(G) 計(D+E+F)	△ 137,831,609	△ 873,449,325	△ 1,501,220,210	△ 966,694,010	△ 3,096,892,158	△ 3,690,853,849
(H) 収益分配金	△ 121,660,722	△ 259,492,331	△ 873,449,325	△ 966,694,010	△ 3,096,892,158	△ 3,690,853,849
次期繰越損益金(G+H)	△ 259,492,331	△ 873,449,325	△ 1,501,220,210	△ 966,694,010	△ 3,096,892,158	△ 3,690,853,849
追加信託差損益金	750,891,028	707,045,074	664,863,312	561,135,748	492,334,279	450,095,603
(配当等相当額)	(1,236,359,829)	(1,352,948,257)	(1,441,773,337)	(1,611,402,121)	(1,688,587,864)	(1,690,033,683)
(売買損益相当額)	(△ 485,468,801)	(△ 645,903,183)	(△ 776,910,025)	(△ 1,050,266,373)	(△ 1,196,253,585)	(△ 1,239,938,080)
分配準備積立金	985,413,444	978,206,682	972,767,272	968,374,876	961,255,687	948,298,432
繰越損益金	△ 1,995,796,803	△ 2,558,701,081	△ 3,138,850,794	△ 2,496,204,634	△ 4,550,482,124	△ 5,089,247,884

(注) (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) (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) (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。

<注記事項>

- ①作成期首（前作成期末）元本額 10,789,249,846円
 作成期中追加設定元本額 4,260,704,756円
 作成期中一部解約元本額 621,629,441円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.7442円です。
- ②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は3,690,853,849円です。
- ③分配金の計算過程

項 目	2021年12月7日～ 2022年1月6日	2022年1月7日～ 2022年2月7日	2022年2月8日～ 2022年3月7日	2022年3月8日～ 2022年4月6日	2022年4月7日～ 2022年5月6日	2022年5月7日～ 2022年6月6日
費用控除後の配当等収益額	-円	-円	-円	2,916,612円	-円	-円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	-円	-円	-円	-円	-円	-円
収益調整金額	1,236,359,829円	1,352,948,257円	1,441,773,337円	1,611,402,121円	1,688,587,864円	1,690,033,683円
分配準備積立金額	1,107,074,166円	978,206,682円	972,767,272円	965,458,264円	961,255,687円	948,298,432円
当ファンドの分配対象収益額	2,343,433,995円	2,331,154,939円	2,414,540,609円	2,579,776,997円	2,649,843,551円	2,638,332,115円
1万口当たり収益分配対象額	1,926円	1,826円	1,826円	1,828円	1,828円	1,828円
1万口当たり分配金額	100円	-円	-円	-円	-円	-円
収益分配金金額	121,660,722円	-円	-円	-円	-円	-円

④「サイバーセキュリティ株式マザーファンド」の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、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の60以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

○分配金のお知らせ

	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期
1万口当たり分配金（税込み）	100円	0円	0円	0円	0円	0円

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。
- ・分配時において、外国税控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ（<https://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

【お知らせ】

①信託金限度額の引き上げを行うため、信託約款に所要の変更を行いました。

（2022年3月5日）

②弊社ホームページ（<https://www.am.mufg.jp/>）において、「弊社ファンド運用委託先の運用チーム移管について」のお知らせを掲載しておりますのでご覧ください。また、今後の決定事項につきましても、弊社ホームページにてお知らせいたします。なお、当該ファンドの運用委託先の運用チーム移管に係わる所要の約款変更を予定しています。

サイバーセキュリティ株式マザーファンド

《第10期》決算日2022年6月6日

〔計算期間：2021年12月7日～2022年6月6日〕

「サイバーセキュリティ株式マザーファンド」は、6月6日に第10期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第10期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	主として日本を含む世界の金融商品取引所に上場しているサイバーセキュリティ関連企業の株式に投資を行います。なお、当ファンドにおいて、サイバーセキュリティ関連企業とは、サイバー攻撃に対するセキュリティ技術を有し、これを活用した製品・サービスを提供するテクノロジー関連の企業等をいいます。 株式等への投資にあたっては、サイバーセキュリティの需要拡大および技術向上の恩恵を享受すると考えられる企業の株式の中から、持続的な利益成長性、市場優位性、財務健全性、株価水準等を考慮して組入銘柄を選定します。 株式等の運用にあたっては、アリアンツ・グローバル・インベスターズ・ユーエス・エルエルシーに運用指図に関する権限を委託します。 株式等の組入比率は高位を維持することを基本とします。 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。
主要運用対象	日本を含む世界のサイバーセキュリティ関連企業の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰 落	中 率			
	円		%	%	%	百万円
6期(2020年6月8日)	19,123		24.2	94.3	—	213,916
7期(2020年12月7日)	23,083		20.7	95.6	—	365,279
8期(2021年6月7日)	26,854		16.3	96.6	—	431,374
9期(2021年12月6日)	32,516		21.1	96.2	—	566,113
10期(2022年6月6日)	27,115		△16.6	95.0	—	491,154

(注) 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、ベンチマーク等はありません。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年	月	日	基準価額		株組入比率	株式先物比率
			円	騰落率		
	(期首)					
	2021年12月6日		32,516	—	96.2	—
	12月末		35,012	7.7	95.4	—
	2022年1月末		29,040	△10.7	95.8	—
	2月末		29,647	△8.8	96.3	—
	3月末		32,237	△0.9	96.6	—
	4月末		29,582	△9.0	95.7	—
	5月末		26,751	△17.7	94.6	—
	(期末)					
	2022年6月6日		27,115	△16.6	95.0	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ16.6%の下落となりました。

基準価額等の推移



●基準価額の主な変動要因

(下落要因)

個別銘柄 (OKTA INCやZSCALER INCなど) の株価下落などが、基準価額の下落要因となりました。

●投資環境について

◎株式市況

- ・当期のテクノロジーセクターの株価は、下落しました。
- ・インフレ長期化を背景とした米国での金融引き締め加速への警戒感やロシア・ウクライナ情勢に対する警戒感が高まったこと、都市封鎖に起因する中国景気減速懸念などを受け、下落しました。

◎為替市況

- ・当ファンドの主要投資先通貨である米ドルは対円で上昇しました。
- ・米国での金融引き締め観測などを背景とした米国金利上昇による日米金利差拡大などから米ドルは円に対して上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・日本を含む世界のサイバーセキュリティ関連企業の株式に投資を行いました。なお、当ファンドにおいて、サイバーセキュリティ関連企業とは、サイバー攻撃に対するセキュリティ技術を有し、これを活用した製品・サービスを提供するテクノロジー関連の企業等をいいます。
- ・株式等への投資にあたっては、サイバーセキュリティの需要拡大および技術向上の恩恵を享受すると考えられる企業の株式の中から、持続的な利益成長性、市場優位性、財務健全性、株価水準等を考慮して組入銘柄を選定しました。
- ・銘柄選定にあたっては、セキュリティが脆弱な企業からの需要増加の恩恵を受ける企業をはじめ、IOTやクラウド・コンピューティングなどの分野でのセキュリティ関連企業、サイバーセキュリティに関するコンサルティングサービスを提供する企業などに注目しました。なお、株式等の運用にあたっては、アリアンツ・グローバル・インベスターズ・ユーエス・エルエルシーに運用指図に関する権限を委託しています。
- ・銘柄入替のポイントは、クラウド・サービス分野で堅調に業績を伸ばしていることなどを評価し、ORACLE CORPを新規購入しました。業績成長の実現可能性が低下していると判断し、SHOPIFY INC - CLASS Aを全売却しました。

○今後の運用方針

- ・サイバーセキュリティ関連銘柄は、短期的に値動きが大きくなることがあるものの、個人・企業・国のサイバーセキュリティへの関心やテクノロジーの発展に伴う長期的な需要が見込まれ、同ビジネスを営む企業への投資妙味は大きいと見ています。当ファンドの運用については、引き続き、サイバー攻撃に対するセキュリティ技術を有し、これを活用した製品・サービスを提供するテクノロジー関連の企業への投資を行います。銘柄選定にあたっては、セキュリティが脆弱な企業からの需要増加の恩恵を受ける企業をはじめ、IOTやクラウド・コンピューティングなどの分野でのセキュリティ関連企業、サイバーセキュリティに関するコンサルティングサービスを提供する企業などに注目しています。
- ・株式等の運用にあたっては、アリアンツ・グローバル・インベスターズ・ユーエス・エルエルシーに運用指図に関する権限を委託します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年12月7日～2022年6月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	円 7 (7) (0)	% 0.022 (0.022) (0.000)	(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 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式)	1 (1)	0.003 (0.003)	(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)	2 (2)	0.008 (0.008)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
合 計	10	0.033	
期中の平均基準価額は、30,147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

(2021年12月7日～2022年6月6日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上場	千株 —	千円 —	千株 288	千円 1,947,695
外国	アメリカ	百株 166,149	千アメリカドル 1,743,553	百株 170,685	千アメリカドル 1,837,867
	イギリス	38,163	千イギリスポンド 16,415	—	千イギリスポンド —
	韓国	35,530	千韓国ウォン 346,221,504	—	千韓国ウォン —

(注) 金額は受渡代金。

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 EQUINIX INC	千口 24	千アメリカドル 15,828	—	—

(注) 金額は受渡代金。

○株式売買比率

(2021年12月7日～2022年6月6日)

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	462,870,339千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	522,720,693千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.88

(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

(2021年12月7日～2022年6月6日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 82,350	百万円 19,243	% 23.4	百万円 53,421	百万円 5,620	% 10.5

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2022年6月6日現在)

国内株式

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	金 額	株 数	評 価 額
情報・通信業 (100.0%)	千株	千円	千株	千円
トレンドマイクロ	1,145.1		856.7	6,356,714
合 計	1,145		856	6,356,714
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1		1	<1.3%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
MICRON TECHNOLOGY INC	—	22,729	158,972	20,799,925	半導体・半導体製造装置
CISCO SYSTEMS INC	5,821	6,163	27,890	3,649,224	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NORTONLIFELOCK INC	39,176	70,477	173,938	22,758,109	ソフトウェア・サービス
MICROSOFT CORP	10,632	10,878	293,732	38,431,904	ソフトウェア・サービス
ORACLE CORP	—	10,849	77,890	10,191,221	ソフトウェア・サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,491	1,579	20,496	2,681,796	ソフトウェア・サービス
AMAZON.COM INC	364	—	—	—	小売
VERISIGN INC	1,575	1,667	29,638	3,877,865	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	4,920	4,599	86,101	11,265,546	半導体・半導体製造装置
F5 INC	3,742	3,963	65,990	8,634,185	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,003	4,239	42,752	5,593,675	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	5,793	9,349	135,929	17,785,025	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FORTINET INC	5,783	6,143	182,249	23,845,548	ソフトウェア・サービス
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,047	—	—	—	メディア・娯楽
SPLUNK INC	803	850	8,976	1,174,496	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	1,582	1,675	82,521	10,797,167	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL C	497	674	154,434	20,206,218	メディア・娯楽
MANDIANT INC	47,596	—	—	—	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	2,241	4,305	220,672	28,872,837	ソフトウェア・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	5,645	5,977	85,871	11,235,460	ソフトウェア・サービス
EPAM SYSTEMS INC	4,417	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	2,603	2,757	48,411	6,334,146	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARISTA NETWORKS INC	10,995	8,248	85,097	11,134,117	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	1,763	1,567	29,875	3,908,931	ソフトウェア・サービス
TWILIO INC - A	962	1,019	10,371	1,357,057	ソフトウェア・サービス
MIMECAST LTD	13,955	—	—	—	ソフトウェア・サービス
QUALYS INC	1,905	3,430	45,383	5,937,929	ソフトウェア・サービス
RAPID7 INC	2,987	5,423	39,030	5,106,763	ソフトウェア・サービス
VARONIS SYSTEMS INC	14,784	13,529	46,472	6,080,447	ソフトウェア・サービス
OKTA INC	16,868	4,353	42,827	5,603,584	ソフトウェア・サービス
SHOPIFY INC - CLASS A	171	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SAILPOINT TECHNOLOGIES HOLDI	5,521	2,849	18,319	2,396,892	ソフトウェア・サービス
ZSCALER INC	13,166	8,136	127,688	16,706,818	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	—	2,451	138,103	18,069,466	半導体・半導体製造装置
MONGODB INC	—	1,146	31,322	4,098,242	ソフトウェア・サービス
TENABLE HOLDINGS INC	5,185	6,793	35,462	4,639,857	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,308	12,392	200,877	26,282,820	ソフトウェア・サービス
DATADOG INC - CLASS A	11,116	14,788	155,929	20,401,873	ソフトウェア・サービス
DYNATRACE INC	7,542	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	10,384	3,487	19,021	2,488,756	ソフトウェア・サービス
SMARTSHEET INC-CLASS A	6,471	11,930	45,417	5,942,427	ソフトウェア・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	6,554	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ASANA INC - CL A	16,528	8,715	19,618	2,566,881	ソフトウェア・サービス
BOX INC - CLASS A	9,590	23,465	63,920	8,363,313	ソフトウェア・サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	—	3,904	23,020	3,011,943	半導体・半導体製造装置
MONDAY.COM LTD	3,126	—	—	—	ソフトウェア・サービス

銘柄	柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
KNOWBE4 INC-A		36,014	38,360	72,079	9,430,910	ソフトウェア・サービス
SENTINELONE INC -CLASS A		4,153	15,392	36,803	4,815,334	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	364,804	360,268	3,183,114	416,478,723	
	銘柄 数 < 比 率 >	43	39	—	<84.8%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
COMPUTACENTER PLC		17,251	17,251	43,198	7,054,271	ソフトウェア・サービス
DARKTRACE PLC		38,049	76,213	27,711	4,525,227	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	55,301	93,464	70,909	11,579,498	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<2.4%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD		1,763	22,244	148,590,387	15,542,554	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK HYNIX INC		—	15,049	161,030,185	16,843,757	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額	1,763	37,293	309,620,572	32,386,311	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	2	—	<6.6%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	421,869	491,027	—	460,444,534	
	銘柄 数 < 比 率 >	46	43	—	<93.7%>	

(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株式評価額の比率。

外国投資信託証券

銘柄	柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率
		口 数	口 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカドル	千円	%
EQUINIX INC		29	54	36,785	4,812,951	1.0
合 計	口 数 ・ 金 額	29	54	36,785	4,812,951	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<1.0%>	

(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) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

○投資信託財産の構成

(2022年6月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 466,801,248	% 94.9
投資証券	4,812,951	1.0
コール・ローン等、その他	20,288,059	4.1
投資信託財産総額	491,902,258	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(479,967,319千円)の投資信託財産総額(491,902,258千円)に対する比率は97.6%です。

(注) 外貨建資産は、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。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1アメリカドル=130.84円	1イギリスポンド=163.30円	100韓国ウォン=10.46円
-----------------	------------------	-----------------

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年6月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	491,902,258,268
コール・ローン等	20,180,895,592
株式(評価額)	466,801,248,124
投資証券(評価額)	4,812,951,598
未収配当金	107,162,954
(B) 負債	748,007,354
未払解約金	748,000,000
未払利息	7,354
(C) 純資産総額(A-B)	491,154,250,914
元本	181,136,473,262
次期繰越損益金	310,017,777,652
(D) 受益権総口数	181,136,473,262口
1万口当たり基準価額(C/D)	27,115円

＜注記事項＞

- ①期首元本額 174,103,319,076円
 期中追加設定元本額 24,331,979,653円
 期中一部解約元本額 17,298,825,467円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.7115円です。

②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）

サイバーセキュリティ株式オープン（為替ヘッジなし）	119,483,411,328円
サイバーセキュリティ株式オープン（為替ヘッジあり）	31,380,315,060円
サイバーセキュリティ株式オープン（為替ヘッジなし） 予想分配金提示型	23,082,864,332円
サイバーセキュリティ株式オープン（為替ヘッジあり） 予想分配金提示型	3,888,631,459円
三菱UFJ国際サイバーセキュリティ株式オープン（為替ヘッジなし）(FOFs用)（適格機関投資家限定）	3,301,251,083円
合計	181,136,473,262円

○損益の状況 (2021年12月7日～2022年6月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	951,130,665
受取配当金	951,579,983
受取利息	8,778
支払利息	△ 458,096
(B) 有価証券売買損益	△ 98,956,746,318
売買益	92,624,842,416
売買損	△ 191,581,588,734
(C) 保管費用等	△ 44,522,994
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 98,050,138,647
(E) 前期繰越損益金	392,010,070,485
(F) 追加信託差損益金	51,206,020,347
(G) 解約差損益金	△ 35,148,174,533
(H) 計(D+E+F+G)	310,017,777,652
次期繰越損益金(H)	310,017,777,652

- (注) (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) (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) (G)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]

運用委託先の運用チーム移管に係わる所要の約款変更を予定しています。