

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2024年12月17日

【計算期間】 第13期（自 2023年9月15日 至 2024年9月17日）

【ファンド名】 セレブライフ・ストーリー2025
セレブライフ・ストーリー2035
セレブライフ・ストーリー2045
セレブライフ・ストーリー2055

【発行者名】 SBIアセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 梅本 賢一

【本店の所在の場所】 東京都港区六本木一丁目6番1号

【事務連絡者氏名】 山下 明美

【連絡場所】 東京都港区六本木一丁目6番1号

【電話番号】 03-6229-0170

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

ターゲット・イヤー を想定し、運用の時間経過とともに資産配分を変更することにより、投資信託財産の中長期的な成長を図ることを目指して運用を行います。

ターゲット・イヤーとは、個々人が想定するライフイベント（退職など）の時期を意味し、ファンドにおける安定運用開始時期を指します。

ファンドの基本的性格

ファンドの商品分類

ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品分類において、「追加型投信 / 内外 / 資産複合」に分類されます。ファンドの商品分類、属性区分の詳細につきましては、以下のようになります。

なお、ファンドが該当しない商品分類及び属性区分、その定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

商品分類

セレブライフ・ストーリー2025

セレブライフ・ストーリー2035

セレブライフ・ストーリー2045

セレブライフ・ストーリー2055

ファンドの商品分類は「追加型投信 / 内外 / 資産複合」です。

商品分類表（ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。）

| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産 (収益の源泉) |
|---------|--------|-------------------|
| 単位型投信 | 国内 | 株式 債券 |
| | 海外 | 不動産投信 |
| 追加型投信 | 内外 | その他資産 () |
| | | 資産複合 |

商品分類の定義

| 該当分類 | 分類の定義 |
|-------|---|
| 追加型投信 | 一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。 |
| 内外 | 目論見書または投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| 資産複合 | 目論見書または信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |

属性区分

ファンドの属性区分

| | |
|--------|---|
| 投資対象資産 | その他資産 (投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信、その他資産)資産配分変更型)) |
| 決算頻度 | 年1回 |
| 投資対象地域 | グローバル(日本含む) |
| 投資形態 | ファンド・オブ・ファンズ |
| 為替ヘッジ | あり(適時ヘッジ) |

属性区分表(ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。)

| 投資対象資産 | 決算頻度 | 投資対象地域 | 投資形態 | 為替ヘッジ |
|--|------|--------|-------|---------|
| 株式 | 年1回 | | | |
| 一般 | 年2回 | グローバル | | |
| 大型株 | 年4回 | (日本含む) | | |
| 中小型株 | 年6回 | 北米 | | |
| 債券 | (隔月) | 欧州 | ファミリー | あり |
| 一般 | 年12回 | アジア | ファンド | (適時ヘッジ) |
| 公債 | (毎月) | オセアニア | | |
| 社債 | 日々 | 中南米 | ファンド・ | |
| その他債券 | その他 | アフリカ | オブ・ | なし |
| クレジット | () | 中近東 | ファンズ | |
| 属性 | | (中東) | | |
| () | | エマージング | | |
| 不動産投信 | | | | |
| その他資産 | | | | |
| (投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信、その他資産)資産配分変更型)) | | | | |
| 資産複合 | | | | |

属性区分の投資対象資産に記載している「その他資産」は、投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信、その他資産)資産配分変更型)です。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

属性区分の定義

| 該当区分 | 区分の定義 |
|--|--|
| その他資産 (投資信託証券(資産複 合(株式、債券、不動産 投信、その他資産))資 産配分変更型)) | 目論見書または信託約款において、組入れ資産が主として投資信託証券であり、実質的に複数資産(株式、債券、不動産投信、その他資産)を投資対象とし、組入比率については機動的な変更を行う旨の記載があるものをいいます。本ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産(その他資産(投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信、その他資産))資産配分変更型))と、収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産(資産複合)とが異なります。 |
| 年1回 | 目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。 |
| グローバル (日本含む) | 目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。なお、「世界の資産」の中に日本を含みます。 |
| ファンド・オブ・ ファンズ | 目論見書または信託約款において、投資信託及び外国投資信託の受益証券ならびに投資法人及び外国投資法人の投資証券(投資法人債券を除く)への投資を目的とする投資信託(ファミリーファンドのベビーファンドに該当するものを除く)をいいます。 |
| 為替ヘッジあり (適時ヘッジ) | 目論見書または信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるもののうち、適時ヘッジを行うものをいいます。 |

ファンドの特色

ファンドの目的

ターゲット・イヤー[※]を想定し、運用の時間経過とともに資産配分を変更することにより、投資信託財産の中長期的な成長を図ることをめざして運用を行います。

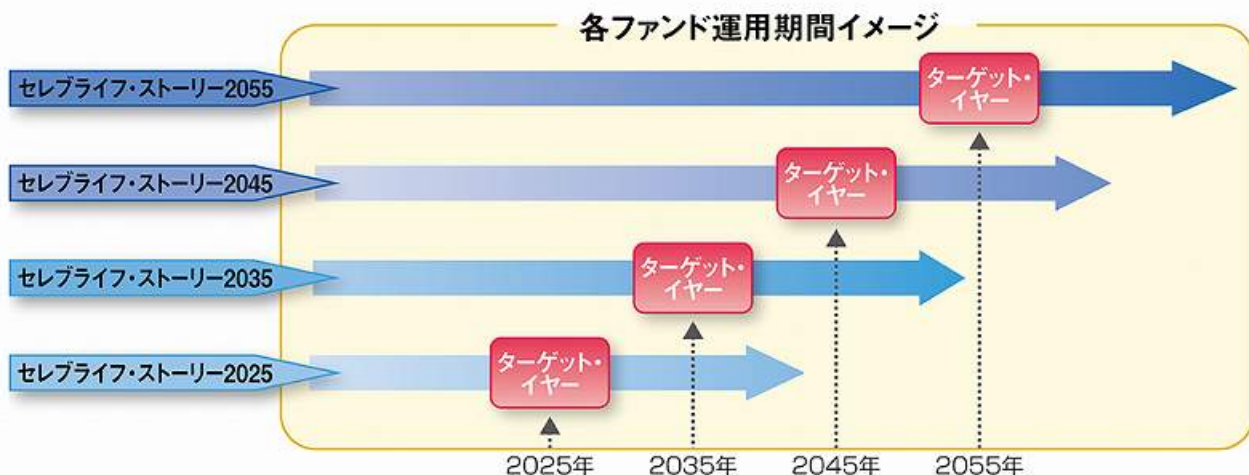
※ターゲット・イヤーとは

個人が想定するライフイベント(退職など)の時期を意味し、本ファンドにおける安定運用開始時期を指します。

ファンドの特色

① ターゲット・イヤー（安定運用開始時期）を想定した4種類のファンドから構成されています。

- ・ 投資者が想定するターゲット・イヤーに合わせてファンドを選択できるよう、ターゲット・イヤーを2025年、2035年、2045年、2055年とする4種類のファンドがあります。



② 主としてETF(上場投資信託)及び投資信託証券への投資を通じて、国内株式、先進国株式、新興国株式、オルタナティブ資産(ヘッジファンド、コモディティ、リート(不動産投資信託))、日本債券及び世界の国債等、広範な各資産へ分散投資します。

※本ファンドが投資対象とするETF及び投資信託証券については、後述の「投資対象ファンドの概要」をご覧ください。

- ・ 株式や債券等の伝統的資産と値動きが異なる、オルタナティブ資産もポートフォリオに組入れることで、信託財産の安定的な収益獲得をめざします。
- ・ 本ファンドが組入れる投資対象ファンドに対し、為替ヘッジを行う場合があります。なお、当初はヘッジファンド及びコモディティを投資対象としているETFに対し、為替ヘッジを行う方針です。ただし、資金動向、市場動向等により、委託会社が適切と判断した場合には為替ヘッジを行う投資対象ファンドを変更する場合があります。

3 ターゲット・イヤー（安定運用開始時期）に向けて、安定性資産の投資割合を高め、徐々に安定運用に移行します。

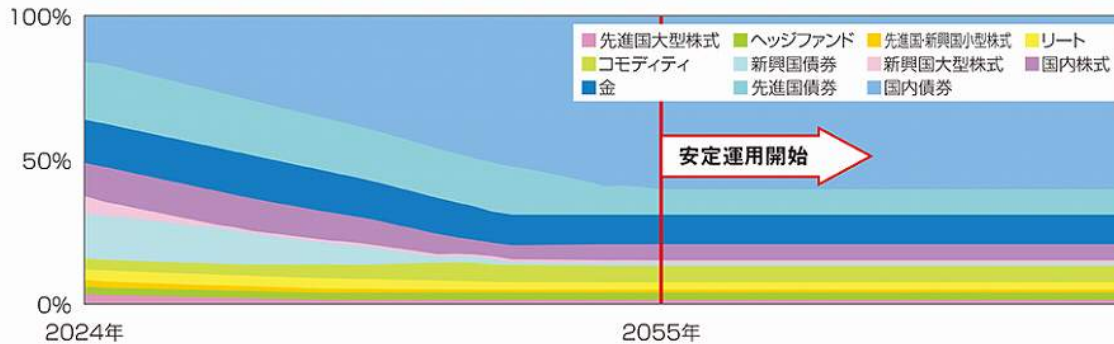
ターゲット・イヤーまでの残存期間が長いほど、値上がり益の獲得を重視した運用を行います。ターゲット・イヤーに接近するにしたがって、収益性資産（株式等）への投資割合を徐々に減らし、安定性資産（債券等）の比率を高めることでファンド全体のリスクを徐々に減らしていきます。

※市場の変動により、投資対象ファンドの組入比率が基本投資割合から乖離した場合は、3カ月に1回基本投資割合へ戻す調整を行います。

※基本投資割合の変更を、家計や市場の構造変化等を考慮して、原則として年に1回行います。

※また、投資対象とする資産または投資スタイルについては、原則として5年に1回見直しを行います。（原則としてターゲット・イヤーを迎え安定運用となったファンドは除きます。）

基本投資割合推移のイメージ「セレブライフ・ストーリー2055」の例



※上記の図は、基本投資割合をもとにしたイメージ図であり、実際に上記のような運用を行うことを保証するものではありません。

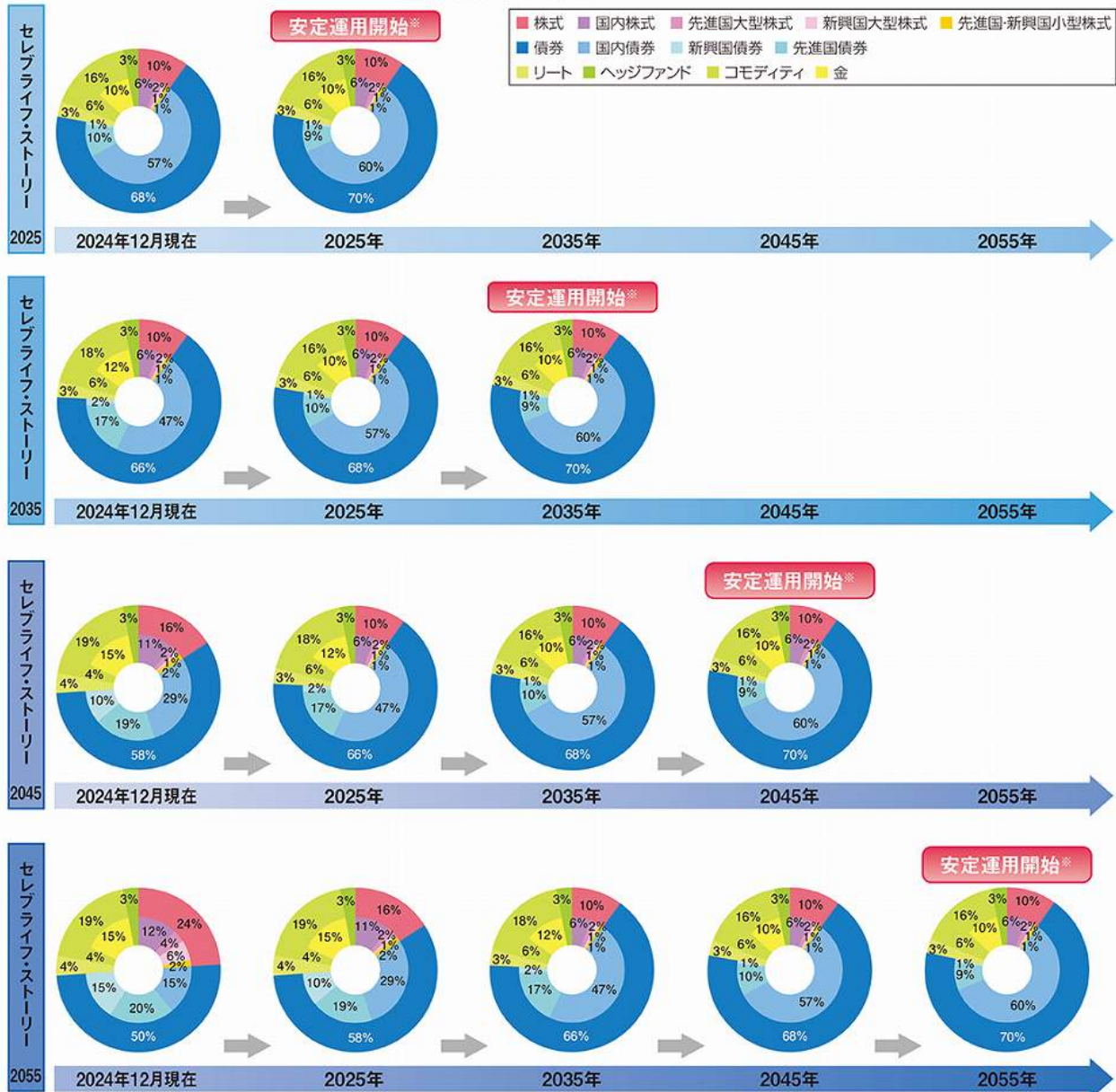
4 本ファンドの運用にあたっては、「ウエルスアドバイザー株式会社」の投資助言を受けます。

ウエルスアドバイザー株式会社

投資信託を中心に、様々な金融商品に関する調査分析情報を提供する運用調査機関です。グローバルな株式銘柄の分析、ファンド選定、資産配分に関する運用助言等を行っています。契約資産残高約5,539億円（2024年6月末現在）

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができないことがあります。

● セレブライフ・ストーリーの基本投資割合の変化



※各ファンドのターゲット・イヤーの決算日の翌日を「安定運用開始時期」とします。

・上記の図は、現時点で決定している基本投資割合であり、市況動向等によって組入比率等が変更される場合があります。

追加的記載事項

投資対象ファンドの概要

本ファンドが投資対象とするファンドの概要は以下の通りです。ただし、今後投資対象から外したり、新たなファンドを投資対象とする場合があります。また、将来の市場構造等の変化によっては、投資対象とする資産または投資スタイルを見直す場合があります。

なお、下記は2024年12月18日以降に投資する投資対象ファンドの内容です。下記は2024年9月末時点で委託会社が取得可能な情報を基に記載しており、今後変更される場合があります。

(凡例)

| |
|------------|
| 1.ファンド名 |
| 2.資産の種類・分類 |
| 3.連動する指数 |
| 4.委託会社 |

*各投資対象ファンドが連動する指数については次ページをご確認ください。

株式

| 国内 | 先進国 | 新興国 |
|-----------------------|--|---------------------------------------|
| 1.iシェアーズ・コア TOPIX ETF | 1.BNY Mellon米国大型コア株式ETF | 1.SPDR ポートフォリオ 新興国株式 ETF |
| 2.国内株式 | 2.先進国大型株式 | 2.新興国株式 |
| 3.TOPIX(東証株価指数) | 3.Solactive GBS United States 500指数 | 3.S&PエマージングBMI指数 |
| 4.ブラックロック・ジャパン株式会社 | 4.BNY Mellon ETF Investment Adviser, LLC | 4.State Street Global Advisors |
| | 1.SPDR ポートフォリオ・ヨーロッパ ETF | |
| | 2.先進国大型株式 | |
| | 3.ストックス・ヨーロッパ・トータル・マーケット指数 | |
| | 4.State Street Global Advisors | |
| | 1.バンガード・FTSE・ディベロップド・アジア・パシフィック(除く日本)UCITS ETF | |
| | 2.先進国株式 | |
| | 3.FTSE ディベロップド・アジア・パシフィック(除く日本)・インデックス | |
| | 4.The Vanguard Group,Inc. | |
| | | 先進国・新興国 |
| | | 1.SPDR ポートフォリオ S&P 600 小型株式 ETF |
| | | 2.先進国小型株式 |
| | | 3.S&P小型株600指数 |
| | | 4.State Street Global Advisors |
| | | 1.バンガード・FTSE・オールワールド(除く米国)スモールキャップETF |
| | | 2.先進国・新興国小型株式 |
| | | 3.FTSEグローバル・スモールキャップ(除く米国)インデックス |
| | | 4.The Vanguard Group,Inc. |

債券

| 国内 | 先進国 | 新興国 |
|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 1.MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定) | 1.MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定) | 1.バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF |
| 2.国内債券 | 2.先進国債券 | 2.新興国債券 |
| 3.NOMURA-BPI総合 | 3.FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース) | 3.ブルームバーグ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックス |
| 4.三菱UFJアセットマネジメント株式会社 | 4.三菱UFJアセットマネジメント株式会社 | 4.The Vanguard Group,Inc. |

オルタナティブ

| ヘッジファンド | コモディティ | リート |
|---|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 1.NYLI ヘッジ・マルチストラテジー・トラッカーETF* | 1.インベスコ・ブルームバーグ・コモディティUCITS ETF | 1.シュワブU.S.リートETF |
| 2.ヘッジファンド | 2.コモディティ(主に原油) | 2.先進国リート |
| 3.NYLI ヘッジ・マルチストラテジー・インデックス | 3.ブルームバーグ商品指数トータルリターン | 3.ダウジョーンズ エクイティ オールREITキャップド インデックス |
| 4.New York Life Investment Management LLC | 4.Invesco Investment Management Ltd. | 4.Charles Schwab & Co.,Inc. |
| | 1.iシェアーズ・ゴールド・トラスト・マイクロ | |
| | 2.コモディティ(金) | |
| | 3.現物の金地金の取引価格 | |
| | 4.ブラックロック・ジャパン株式会社 | |

*当ファンドは、2024年8月28日付で、IQヘッジ マルチストラテジー トラッカーETFより名称変更されました。

各投資対象ファンドが連動する指数について

| | |
|--------------------------------------|---|
| TOPIX(東証株価指数) | TOPIX(東証株価指数)は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社が算出する株価指数であり、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、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、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。 |
| Solactive GBS United States 500指数 | Solactive GBS United States 500指数は、米国株式市場の上位500社のパフォーマンスの動きを示す指数です。企業の時価総額に基づいて選択され、自由浮動株時価総額で加重されます。米ドル建てのトータルリターン・インデックスとして計算され、四半期ごとに再構成されます。同指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はSolactive AGに帰属します。 |
| ストックス・ヨーロッパ・トータル・マーケット指数 | ストックス・ヨーロッパ・トータル・マーケット指数は、欧州17カ国(オーストリア、ベルギー、ポーランド、デンマーク、フィンランド、フランス、ドイツ、アイルランド、イタリア、ルクセンブルグ、オランダ、ノルウェー、ポルトガル、スペイン、スウェーデン、スイス、英国)の自由浮動株時価総額の約95%をカバーする指数です。大・中・小の時価総額インデックスと、4つの地域別TMIインデックスで構成されています。同指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はSTOXX Ltd.に帰属します。 |
| FTSE ディベロップド・アジア・パシフィック(除く日本)・インデックス | FTSE ディベロップド・アジア・パシフィック(除く日本)・インデックスとは、FTSE社が開発した指数で日本を除くアジア太平洋地域の先進国地域の株式市場の大型株および中型株の動きを表す指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はFTSE社に帰属します。 |
| S&PエマージングBMI指数 | S&PエマージングBMI指数は、S&Pダウジョーンズ・インディシイズ社が算出する指数で新興国株式市場全体の動きを表す株価指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はS&Pダウジョーンズ・インディシイズ社に帰属します。 |
| S&P小型株600指数 | S&P 小型株 600指数は、米国株式市場の小型株セグメントのパフォーマンスを測定する指数です。特定の指数採用基準を満たしている企業のパフォーマンスに連動するように設計されています。特定の指数採用基準では、これらの企業の流動性や財務の健全性を判断しています。同指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はS&Pダウジョーンズ・インディシイズ社に帰属します。 |
| FTSE グローバル・スモールキャップ(除く米国)インデックス | FTSE グローバル・スモールキャップ(除く米国)インデックスとは、FTSE社が算出する指数で米国を除く世界の小型株式市場全体の動きを表す株価指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はFTSE社に帰属します。 |
| NOMURA-BPI総合 | NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が公表している国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数です。同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、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。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、ファンドの運用成果等に関し、一切責任はありません。 |
| FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース) | FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)とは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均し円ベースで表示した債券指数です。同指数に対する著作権等の知的財産権その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 |
| ブルームバーグ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックス | ブルームバーグ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックスとは、新興市場国政府、政府機関、及び国有企業が発行体であり残存期間が1年超の米ドル建て債券で構成される指数です。同指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はブルームバーグ社に帰属します。 |
| NYLI ヘッジ・マルチストラテジー・インデックス | NYLI ヘッジ・マルチストラテジー・インデックスは、パークレイ・ヘッジファンド・インデックス(パークレイのデータベースでその月に報告されたすべてのファンド(ファンド・オブ・ファンズを除く)のネット・リターンの単純な算術平均)によって測定されるパフォーマンスを、ヘッジファンドのリターン特性の「ベータ」部分(非特異的リターン、すなわち、マネージャーのスキルに無関係なリターン部分)を長期にわたって再現することを目的とした指数です。パークレイ・ヘッジファンド・インデックスとの高い相関を維持するために、インデックスはシステムティック・モデルを利用し、複数の資産クラスとオルタナティブ戦略にまたがるファクターを選択し加重しています。同指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はNew York Life Investment Management LLCに帰属します。 |
| ブルームバーグ商品指数トータルリターン | ブルームバーグ商品指数トータルリターンとは、商品セクターのエクスポージャーを幅広くカバーしたコモディティ価格の標準的なベンチマークです。旧ダウ・ジョーンズ・UBS商品指数トータルリターンとして開発された指数であり、その後ブルームバーグ社に買収され、現在の名称に変更されました。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はブルームバーグ社に帰属します。 |
| 現物の金地金の取引価格 | 現物の金地金の取引価格とは、市場での現物の金地金の取引価格を表します。ロンドン市場における取引価格が金地金価格の国際的な指標となります。 |
| ダウジョーンズ エクイティ オールREIT キャップド インデックス | ダウジョーンズ エクイティ オールREIT キャップド インデックスとは、S&Pダウジョーンズ・インディシイズ社が算出する指数で、米国のリートで構成される指数です。同指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はS&Pダウジョーンズ・インディシイズ社に帰属します。 |

信託金の限度額

| | |
|------|---------|
| 2025 | 上限500億円 |
| 2035 | 上限500億円 |
| 2045 | 上限500億円 |
| 2055 | 上限500億円 |

・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

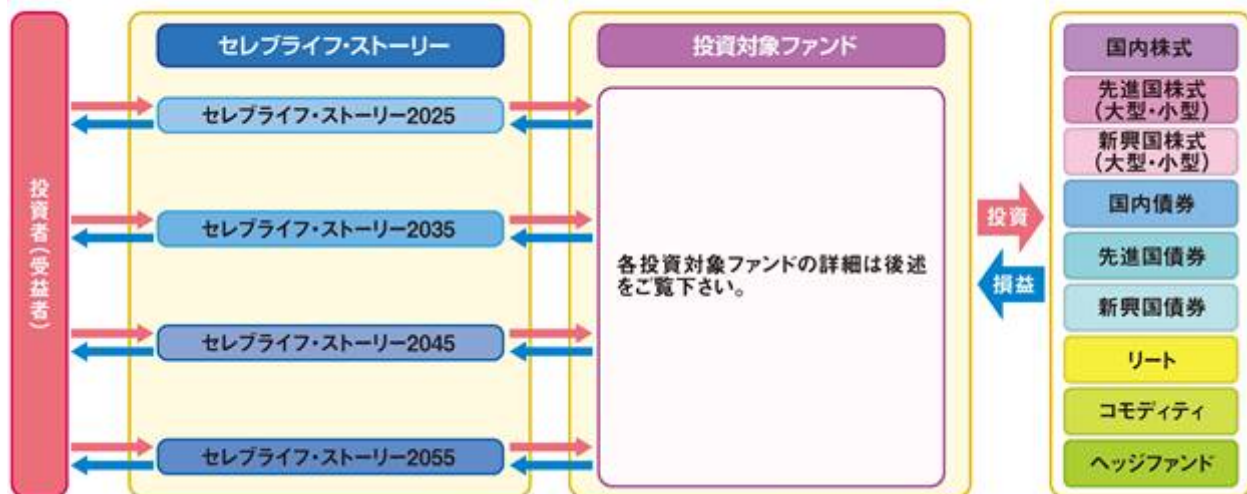
(2) 【ファンドの沿革】

| | |
|-------------|--|
| 2012年1月23日 | 2015、2025、2035、2045、2055、各ファンドについて信託契約締結、 ファンドの設定・運用開始 |
| 2012年12月15日 | ファンド名称を「セレブライフ・ストーリー2015 / セレブライフ・ ストーリー2025 / セレブライフ・ストーリー2035 / セレブライフ・ス トーリー2045 / セレブライフ・ストーリー2055」に変更 |
| 2020年6月16日 | 「セレブライフ・ストーリー2015」の信託終了（繰上償還） |

(3) 【ファンドの仕組み】

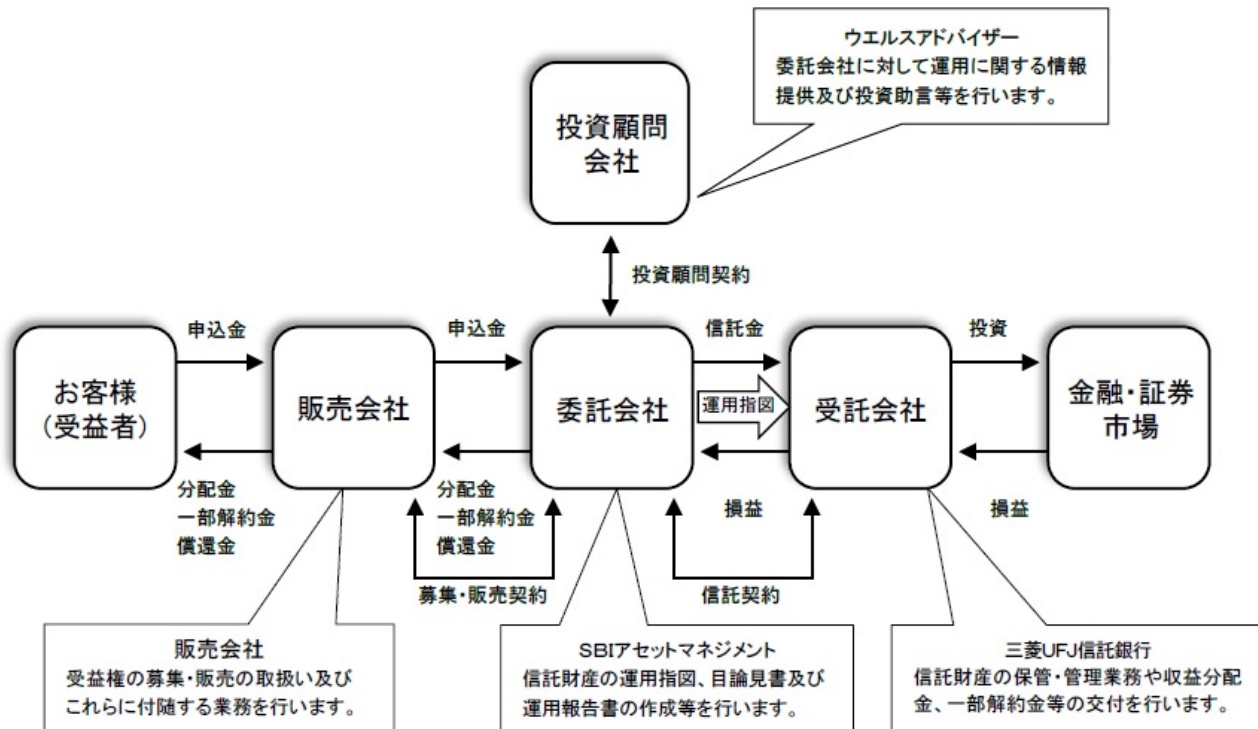
ファンドの仕組み

本ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用されます。ファンド・オブ・ファンズ方式とは、投資者の皆様からお預かりした資金を複数の投資信託に投資することにより運用を行う方式です。



※投資対象ファンドは今後変更する場合があります。

委託会社及び本ファンドの関係法人との契約等の概要



(注) 受託会社は、業務の一部を再信託先である日本マスタートラスト信託銀行株式会社に委託しています。

委託会社の概況（2024年9月末日現在）

() 資本金

4億20万円

() 沿革

委託会社は、投資運用業務（投資信託の委託者としての業務、登録投資法人との資産の運用契約に基づく運用業務または投資一任契約に基づく運用業務）及び投資助言業務（投資顧問契約に基づく助言業務）を行う金融商品取引業者です。

委託会社は、旧株式会社日本債券信用銀行(現株式会社あおぞら銀行)を設立母体として成立し、その後、株主の異動によりソフトバンクグループの一員となりました。2002年5月1日には、同グループのソフトバンク・インベストメント株式会社の子会社である、ソフトバンク・アセット・マネジメント株式会社と合併し、エスピーアイ・アセット・マネジメント株式会社に商号変更しました。

2005年7月1日には、SBIアセットマネジメント株式会社に商号変更しました。

2006年8月2日には、委託会社の親会社（現SBIホールディングス株式会社）の主要株主であるソフトバンク株式会社（現ソフトバンクグループ株式会社）の子会社が、現SBIホールディングス株式会社の全株式を売却したことにより、ソフトバンクグループから独立し、SBIグループの一員となりました。

2019年12月20日には、委託会社の全株式をSBIアセットマネジメント・グループ株式会社（SBIAMG）が、モーニングスター株式会社より取得しました。SBIAMGはモーニングスター株式会社傘下の資産運用会社を統括する中間持株会社です。

2022年8月1日に、SBIアセットマネジメント株式会社、SBIボンド・インベストメント・マネジメント株式会社、SBI地方創生アセットマネジメント株式会社の3社合併をしま

した。なお、S B I アセットマネジメント株式会社を存続会社とし、合併後は同社名を継承しました。

2022年10月1日には、モーニングスター株式会社がS B I A M Gを吸収合併したことにより、モーニングスター株式会社は過半数を超える筆頭株主となりました。なお、同社は2023年3月30日に、S B I グローバルアセットマネジメント株式会社に商号を変更しました。

2023年4月1日に、S B I アセットマネジメント株式会社を存続会社とし、新生インベストメント・マネジメント株式会社と合併しました。なお、商号はS B I アセットマネジメント株式会社を継承しました。

| | |
|-------------|--|
| 1986年 8月29日 | 日債銀投資顧問株式会社として設立 |
| 1987年 2月20日 | 有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律第4条にかかる登録 |
| 1987年 9月 9日 | 有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律第24条1項の規定に基づく投資一任契約業務の認可 |
| 2000年11月28日 | 証券投資信託及び証券投資法人に関する法律第6条の規定に基づく証券投資信託委託業の認可 |
| 2001年 1月 4日 | あおぞらアセットマネジメント株式会社に商号変更 |
| 2002年 5月 1日 | ソフトバンク・アセット・マネジメント株式会社との合併により、エスピーアイ・アセット・マネジメント株式会社に商号変更 |
| 2005年 7月 1日 | S B I アセットマネジメント株式会社に商号変更 |
| 2007年 9月30日 | 金融商品取引法等の施行により同法第29条の規定に基づく金融商品取引業者の登録（関東財務局長（金商）第311号） |
| 2022年 8月 1日 | S B I アセットマネジメント株式会社、S B I ボンド・インベストメント・マネジメント株式会社、S B I 地方創生アセットマネジメント株式会社の3社合併。S B I アセットマネジメント株式会社を存続会社とし、合併後は同社名を継承。 |
| 2023年 4月 1日 | S B I アセットマネジメント株式会社は、新生インベストメント・マネジメント株式会社と合併。S B I アセットマネジメント株式会社を存続会社とし、合併後は同社名を継承。 |

() 大株主の状況

| 株主名 | 住所 | 所有株数 | 所有比率 |
|------------------------------------|--|------------|-------|
| S B I グローバルアセットマネジメント株式会社 | 東京都港区六本木一丁目6番1号 | 1,378,823株 | 97.9% |
| P I M C O A S I A L I M I T E D | Suite 2201, 22nd Floor, Two International Finance Centre, 8 Finance Street, Central, Hong Kong | 29,507株 | 2.1% |

2【投資方針】

(1)【投資方針】

(各ファンド共通)

1. 基本方針

ターゲット・イヤー を想定し、運用の時間経過とともに資産配分を変更することにより、投資信託財産の中長期的な成長を図ることを目指して運用を行います。

ターゲット・イヤーとは、個々人が想定するライフイベント（退職など）の時期を意味し、本ファンドにおける安定運用開始時期を指します。

2. 運用方法

()投資対象

主としてETF（上場投資信託）及び投資信託証券への投資を通じて、国内株式、先進国株式、新興国株式、オルタナティブ資産（ヘッジファンド、コモディティ、リート（不動産投資信託））、日本債券及び世界の国債等、広範な各資産クラスへ分散投資します。

なお、投資対象とするETF（上場投資信託）及び投資信託証券は後述（2）投資対象の参考情報「投資対象ファンドの概要」をご覧ください。なお、それらを個々にまたは総称して「投資対象ファンド」という場合があります。

()投資態度

ターゲット・イヤー（安定運用開始時期）に向けて、安定資産の投資割合を高め、徐々に安定運用に移行します。

株式や債券等の伝統的資産と値動きが異なる、オルタナティブ資産もポートフォリオに組入れることで、信託財産の安定的な収益獲得を目指します。

各ファンドが投資する投資対象ファンドの基本投資割合は、次の通りとします。

| ファンド名称 | 2025 | 2035 | 2045 | 2055 |
|--------------------|-----------|-------|-------|-------|
| ターゲット・イヤー | 2025年 | 2035年 | 2045年 | 2055年 |
| 連動する投資対象 | 基本資産配分（％） | | | |
| 日本の株価指数 | 6% | 6% | 11% | 12% |
| 先進国の大型株式指数 | 2% | 2% | 2% | 4% |
| 新興国の大型株式指数 | 1% | 1% | 1% | 6% |
| 先進国・新興国の 小型株式指数 | 1% | 1% | 2% | 2% |
| 新興国の債券指数 | 1% | 2% | 10% | 15% |
| 先進国の債券指数 | 10% | 17% | 19% | 20% |
| 日本の債券指数 | 57% | 47% | 29% | 15% |
| リート指数 | 3% | 3% | 4% | 4% |
| ヘッジファンド指数 | 3% | 3% | 3% | 3% |
| コモディティ指数 | 16% | 18% | 19% | 19% |
| 合計 | 100% | 100% | 100% | 100% |

(変更日：2024年12月18日)

<ご参考 当初設定時の基本投資割合>

| ファンド名称 | 2025 | 2035 | 2045 | 2055 |
|------------|-----------|-------|-------|-------|
| ターゲット・イヤー | 2025年 | 2035年 | 2045年 | 2055年 |
| 連動する投資対象 | 基本資産配分（％） | | | |
| 日本の株価指数 | 3% | 4% | 5% | 8% |
| 先進国の大型株指数 | 5% | 6% | 8% | 11% |
| 先進国の小型株指数 | 2% | 3% | 3% | 6% |
| 新興国の大型株式指数 | 17% | 22% | 27% | 40% |
| 新興国の小型株式指数 | 4% | 5% | 7% | 10% |
| 新興国の債券指数 | 11% | 13% | 16% | 0% |
| 先進国の債券指数 | 5% | 7% | 8% | 0% |
| 日本の債券指数 | 36% | 19% | 1% | 0% |
| リート指数 | 6% | 8% | 10% | 10% |
| ヘッジファンド指数 | 6% | 8% | 10% | 10% |
| コモディティ指数 | 5% | 5% | 5% | 5% |
| 合計 | 100% | 100% | 100% | 100% |

ターゲット・イヤーまでの残存期間が長いほど、値上がり益の獲得を重視した運用を行います。ターゲット・イヤーに接近するにしたがって、収益性資産（株式等）への投資割合を徐々に減らし、安定性資産（債券等）の比率を高めることでファンド全体のリスクを徐々に減らしていきます。

各ファンドのターゲット・イヤーの決算日の翌日を「安定運用開始時期」とし、それ以降は債券への投資割合を69%程度とし運用を行います。（当初設定時）

市場の変動により、投資対象ファンドの組入比率が基本投資割合から乖離した場合は、3ヶ月に1回基本投資割合へ戻す調整を行います。

基本投資割合の変更については、家計や市場の構造変化等を考慮して、原則として年に1回行います。

投資対象とする資産または投資スタイルについては、原則として5年に1回見直しを行います。

（ターゲット・イヤーを迎え安定運用となったファンドは除きます。）

当初設定時の投資対象ファンドが、その後投資対象から外れたり、投資対象として新たなETFまたは投資信託証券を組入れる場合があります。

本ファンドは、ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行い、実質的な運用は投資信託証券への投資を通じて行います。

本ファンドの運用にあたっては、「ウエルスアドバイザー株式会社」の投資助言を受けます。

投資対象ファンドの合計組入比率を高位に維持することを原則とします。

外貨建資産については、為替ヘッジのため外国為替の売買の予約を行うことがあります。

当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市場動向等に急激な変化が生じたときまたは予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等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。

なお、市況動向及び資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2)【投資対象】

(各ファンド共通)

投資の対象とする資産の種類(信託約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ 有価証券

ロ 金銭債権

ハ 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

為替手形

運用の指図範囲(信託約款第17条第1項)

委託会社は、信託金を、主として別に定めるETF（上場投資信託）及び投資信託証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等

2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により設立された法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）

4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、3. の証券を以下「公社債」といい、公社債にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができます。

金融商品の指図範囲(信託約款第17条第2項)

委託会社は、信託金を、 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。次項において同じ。）により運用することを指図することができます。

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

前記の規定に関わらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前記 1. から 4. までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

〔参考情報〕

投資対象ファンドの概要

投資対象ファンドは以下の通りです。ただし、今後投資対象から外したり、新たなファンドを投資対象とする場合があります。また、将来の市場構造等の変化によっては、投資対象とする資産または投資スタイルを見直す場合があります。

なお、下記は2024年9月末時点で委託会社が取得可能な情報を基に記載しており、今後変更される場合があります。

国内株式

| | |
|---------|---|
| ファンド名称 | iシェアーズ・コア TOPIX ETF |
| ファンドの目的 | 日本の株式市場全体の動向を示す「東証株価指数(TOPIX)」への連動を目指して運用を行います。 |
| 委託会社 | ブラックロック・ジャパン株式会社 |
| 管理報酬等 | 年率0.0495%（税抜：0.045%） |

先進国株式（大型）

| | |
|---------|---|
| ファンド名称 | BNY Mellon米国大型コア株式ETF |
| ファンドの目的 | Solactive GBS United States 500指数に連動する投資成果を目指します。 |
| 委託会社 | BNY Mellon ETF Investment Adviser, LLC |
| 管理報酬等 | 年率0.00% |

先進国株式（大型）

| | |
|---------|--|
| ファンド名称 | SPDR ポートフォリオ・ヨーロッパ ETF |
| ファンドの目的 | ストックス・ヨーロッパ・トータル・マーケット指数に連動する投資成果を目指します。 |
| 委託会社 | State Street Global Advisors |
| 管理報酬等 | 年率0.07% |

先進国株式（大型）

| | |
|---------|--|
| ファンド名称 | バンガード・FTSE・ディベロップド・アジア・パシフィック（除く日本）UCITS ETF |
| ファンドの目的 | FTSE ディベロップド・アジア・パシフィック（除く日本）・インデックスに連動する投資成果を目指します。 |
| 委託会社 | The Vanguard Group, Inc. |
| 管理報酬等 | 年率0.15% |

新興国株式

| | |
|---------|--------------------------------|
| ファンド名称 | SPDR ポートフォリオ 新興国株式 ETF |
| ファンドの目的 | S&PエマージングBMI指数に連動する投資成果を目指します。 |
| 委託会社 | State Street Global Advisors |
| 管理報酬等 | 年率0.07% |

先進国株式（小型）

| | |
|---------|-------------------------------|
| ファンド名称 | SPDR ポートフォリオ S&P 600 小型株式 ETF |
| ファンドの目的 | S&P小型株600指数に連動する投資成果を目指します。 |
| 委託会社 | State Street Global Advisors |
| 管理報酬等 | 年率0.03% |

先進国・新興国株式（小型）

| | |
|--------|-------------------------------------|
| ファンド名称 | バンガード・FTSE・オールワールド（除く米国）スモールキャップETF |
|--------|-------------------------------------|

| | |
|---------|--|
| ファンドの目的 | FTSEグローバル・スモールキャップ（除く米国）インデックスに連動する投資成果を目指します。 |
| 委託会社 | The Vanguard Group Inc |
| 管理報酬等 | 年率0.08% |

国内債券

| | |
|---------|--------------------------------|
| ファンド名称 | MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） |
| ファンドの目的 | NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目指します。 |
| 委託会社 | 三菱UFJアセットマネジメント株式会社 |
| 管理報酬等 | 年率0.154%（税抜：0.14%） |

先進国債券

| | |
|---------|---|
| ファンド名称 | MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） |
| ファンドの目的 | FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に連動する投資成果を目指します。 |
| 委託会社 | 三菱UFJアセットマネジメント株式会社 |
| 管理報酬等 | 年率0.209%（税抜：0.19%） |

新興国債券

| | |
|---------|--|
| ファンド名称 | バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF |
| ファンドの目的 | ブルームバーグ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックスに連動する投資成果を目指します。 |
| 委託会社 | The Vanguard Group, Inc. |
| 管理報酬等 | 年率0.20% |

ヘッジファンド

| | |
|---------|---|
| ファンド名称 | NYLI ヘッジ・マルチストラテジー・トラッカーETF |
| ファンドの目的 | NYLI ヘッジ・マルチストラテジー・インデックスに連動する投資成果を目指します。 |
| 委託会社 | New York Life Investment Management LLC |
| 管理報酬等 | 年率0.78% |

コモディティ

| | |
|---------|-------------------------------------|
| ファンド名称 | インベスコ・ブルームバーグ・コモディティ UCITS ETF |
| ファンドの目的 | ブルームバーグ商品指数トータルリターンに連動する投資成果を目指します。 |
| 委託会社 | Invesco Investment Management Ltd. |
| 管理報酬等 | 年率0.19% |

コモディティ

| | |
|---------|-----------------------------|
| ファンド名称 | iシェアーズ・ゴールド・トラスト・マイクロ |
| ファンドの目的 | 現物の金地金の取引価格に連動する投資成果を目指します。 |
| 委託会社 | ブラックロック・ジャパン株式会社 |
| 管理報酬等 | 年率0.09% |

リート

| | |
|---------|--|
| ファンド名称 | シュワブU.S.リートETF |
| ファンドの目的 | ダウジョーンズ エクイティ オールREIT キャップド インデックスに連動する投資成果を目指します。 |
| 委託会社 | Charles Schwab & Co., Inc. |

| | |
|-------|---------|
| 管理報酬等 | 年率0.07% |
|-------|---------|

(3)【運用体制】

運用業務方法に関する社内規則に則り、以下のプロセスで運用が行われます。

市場環境分析・企業分析

ファンドマネジャー、アナリストによる市場環境、業種、個別企業などの調査・分析及び基本投資戦略の協議・策定を行います。

投資基本方針の策定

最高運用責任者のもとで開催される「運用会議」において、市場動向・投資行動・市場見通し・投資方針等を策定します。

最高運用責任者は、組織規定の運用部門の長とします。

運用基本方針の決定

「運用会議」の策定内容を踏まえ、常勤取締役、最高運用責任者、運用部長及び運用部マネジャーをもって構成される「投資戦略委員会」において、運用の基本方針が決定されます。

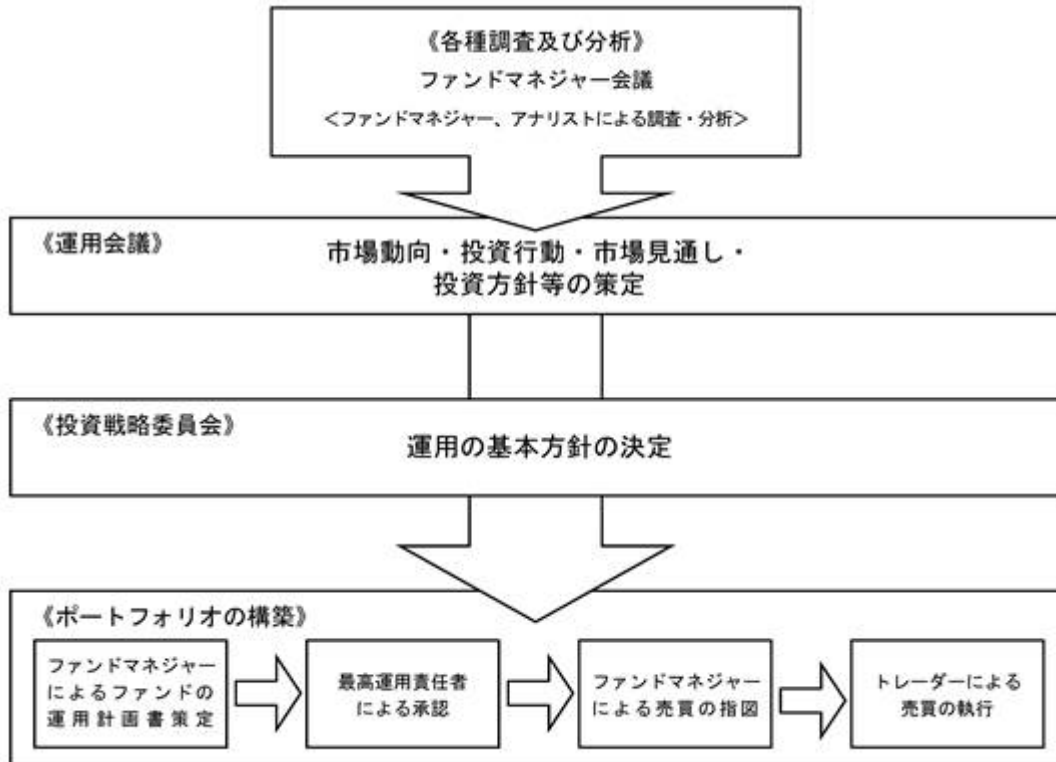
投資銘柄の策定、ポートフォリオの構築

ファンドマネジャーは、この運用の基本方針に沿って、各ファンドの運用計画書を策定し、最高運用責任者の承認後、売買の指図を行います。

ただし、未公開株及び組合への投資を行う場合は、それぞれ「未公開株投資委員会」、「組合投資委員会」での承認後、売買の指図等を行います。

パフォーマンス分析、リスク分析・評価

ファンドのリスク特性分析、パフォーマンスの要因分析の報告及び監視を行い、運用方針の確認・見直しを行います。



コンプライアンス部長がファンドに係る意思決定を監督します。

< 受託会社に対する管理体制 >

受託会社(再信託先を含む)に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行い業務遂行状況を確認しています。また、受託会社より内部統制の整備及び運用状況の報告書を受け取っています。

上記体制は、今後、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

年1回決算(毎年9月14日。ただし、当該日が休業日の場合は翌営業日。)を行い、毎計算期末に原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みません。)等の全額とします。

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わない場合があります。また、将来の分配金の支払い及びその金額について示唆、保証するものではありません。

収益分配に充当せず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- () 分配金、配当金、利子及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額(以下「配当等収益」といいます。)は、諸経費、信託報酬及び当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積立てることができます。
 - () 売買損益に評価損益を加減した利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬及び当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積立てることができます。
 - () 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。
- (注) 分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に、原則として決算日から起算して5営業日目までに支払いを開始します。

(5)【投資制限】

(各ファンド共通)

本ファンドは、以下の投資制限にしています。

信託約款の「運用の基本方針」に定める投資制限

- () 投資対象ファンドへの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。
- () 株式への直接投資は行いません。
- () 組入投資信託証券が、一般社団法人投資信託協会の規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、同一銘柄の投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- () 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

信託約款上のその他の投資制限

- () 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款第20条)
外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- () 外国為替予約取引の指図及び範囲(信託約款第21条)
委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

その他の法令上の投資制限

本ファンドに適用されるその他の法令上の投資制限は以下の通りです。

委託会社は、委託会社が運用の指図を行うすべての投資信託について、信託財産として有する同一法人の発行する株式にかかる議決権の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合には、かかる株式を取得することを受託会社に指図することはできません。(投信法第9条)

その他

- () 資金の借入れ(信託約款第27条)
 - (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、信託財産において一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
 - (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金の借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- (ハ) 借入金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

3【投資リスク】

本ファンドは、主として投資信託証券（投資対象ファンド）への投資を通じて、株式・債券・オルタナティブ資産（ヘッジファンド、コモディティ、リート（不動産投資信託））など値動きのある金融商品等に投資しますので、基準価額は変動します。また、外貨建資産には為替変動リスクもあります。したがって、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割込むことがあります。

本ファンドの運用による損益はすべて投資者の皆様には帰属します。また、投資信託は預貯金とは異なります。本ファンドの基準価額の主な変動要因としては以下のものがあります。ただし、基準価額の変動要因は以下に限定されるものではありません。

- ・ 資産配分リスク

資産配分リスクとは、複数資産への投資（資産配分）を行った場合に、投資成果の悪い資産への配分が大きかったため、投資全体の成果も悪くなってしまうリスクをいいます。本ファンドは、投資対象ファンドへの投資を通じてわが国及び海外の株式・債券・オルタナティブ資産（ヘッジファンド、コモディティ、リート（不動産投資信託））・短期金融商品に資産配分を行います。配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数の資産の価値が同時に下落した場合には、本ファンドの基準価額はより大きく影響を受け損失を被ることがあります。

- ・ 株価変動リスク

一般に株価は経済・政治情勢や発行企業の業績等の影響を受け変動しますので、投資対象ファンドが組入れる株式の価格が変動し、本ファンドの基準価額は影響を受け、損失を被ることがあります。

- ・ 為替変動リスク

為替レートは、各国・地域の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向にすすんだ場合には、本ファンドの基準価額は影響を受け、損失を被ることがあります。

- ・ 債券価格変動リスク

債券（公社債等）は、国内外の経済・政治情勢、市場環境・需給等を反映して価格が変動します。また、債券価格は金利変動による影響を受け、一般に金利が上昇した場合には債券価格は下落します。これらの影響により債券の価格が変動した場合、本ファンドの基準価額は影響を受け、損失を被ることがあります。

- ・ リート（不動産投資信託）の価格変動リスク

一般にリート（不動産投資信託）が投資対象とする不動産の価値及び当該不動産から得る収入は、当該国または国際的な景気、経済、社会情勢等の変化等により変動します。リート（不動産投資信託）の価格及び分配金がその影響を受け下落した場合、本ファンドの基準価額は影響を受け、損失を被ることがあります。

- ・ ヘッジファンドに投資するリスク

本ファンドが投資対象とする「NYLI ヘッジ マルチストラテジー トラッカーETF」は「NYLI ヘッジ・マルチストラテジー・インデックス」をベンチマークとして値動きするため、当該インデックスのヘッジファンドマネージャーが採用する戦略等の影響を受けます。これらによって、本ファンドの基準価額は影響を受け、損失を被ることがあります。

- ・ コモディティ投資リスク

一般にコモディティ価格は商品の需給や金利変動、天候、景気、農業生産、政治・経済情勢及び政策等の影響を受け変動します。これらにより、本ファンドの基準価額は影響を受け損失を被ることがあります。

- ・ カントリーリスク

投資対象ファンドが組入れる金融商品等の発行国の政治・経済・社会情勢の変化で金融・証券市場が混乱し、金融商品等の価格が大きく変動する可能性があります。一般に新興国市場は、市場規模、法制度、インフラなどが限定的なこと、価格変動性が大きいこと、決済の効率性が低いことなどから、当該リスクが高くなります。

- ・ 信用リスク

投資対象ファンドが組入れる金融商品等の発行体が経営不安や倒産等に陥った場合に資金回収ができなくなるリスクや、それが予想される場合にその金融商品等の価格下落で損失を被るリスクがあります。また、金融商品等の取引相手方にデフォルト（債務不履行）が生じた場合等、本ファンドの基準価額は影響を受け、損失を被ることがあります。

- ・ 流動性リスク

投資対象ファンドが組入れる金融商品等の市場規模が小さく取引量が限られる場合などには、機動的に売買できない可能性があります。また、保有する金融商品等が期待された価格で処分できず、本ファンドの基準価額は影響を受け、損失を被ることがあります。

その他の留意点

本ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

本ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待される価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

投資信託は預金や保険契約と異なり、預金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。

銀行など登録金融機関でご購入いただく投資信託は投資者保護基金の支払対象ではありません。

収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における本ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。

投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。

収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。

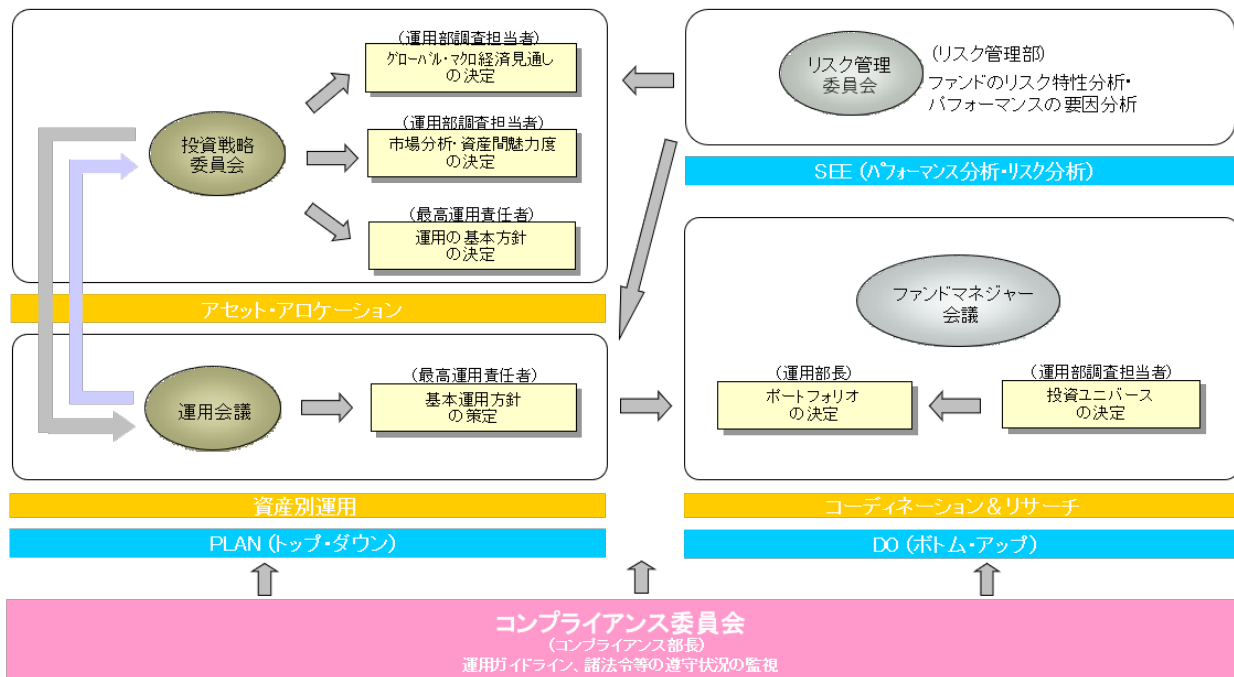
《リスク管理体制》

運用に関するリスク管理体制

委託会社では、ファンドのパフォーマンスの分析及び運用リスクの管理をリスク管理関連の各委員会を設けて行っております。

流動性リスクの管理においては、委託会社が規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行います。取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

最高運用責任者による統括



運用者の意思決定方向を調整・相互確認するために、下記の会議を運営します。

| 会議の名称 | 頻度 | 内 容 |
|---------------|-------|--|
| 投資戦略委員会 | 原則月1回 | 常勤取締役、最高運用責任者、運用部長及び運用部マネジャーをもって構成する。 運用の基本方針 市場見通し、等について協議する。 |
| 運用会議 | 原則月1回 | 最高運用責任者、運用部及び商品企画部に在籍する者をもって構成する。 市場動向 今月の投資行動 市場見通し 今後の投資方針、等についての情報交換、議論を行う。 |
| リスク管理委員会 | 原則月1回 | 常勤取締役、最高運用責任者、リスク管理部長、商品企画部長、マーケティング部長、運用部長及び運用部マネジャーをもって構成する。 ファンドのリスク特性分析、パフォーマンスの要因分析の報告及び監視等を行う。 |
| ファンドマネジャー会議 | 随時 | 運用担当者及び調査担当者をもって構成する。 個別銘柄の調査報告及び情報交換、ファンドの投資戦略について議論を行う。 |
| 未公開株投資委員会 | 随時 | 最高運用責任者、運用部長、未公開株運用担当者、未公開株調査担当者及びコンプライアンス部長をもって構成する。 未公開株式の購入及び売却の決定を行う。 |
| 組合投資委員会 | 随時 | 最高運用責任者、運用部長、組合運用担当者、組合の投資する資産の調査担当者及びコンプライアンス部長をもって構成する。 組合への新規投資及び契約変更の決定を行う。 |
| 商品検討委員会 | 随時 | 常勤取締役、運用部長、リスク管理部長、投信計理部長、コンプライアンス部長、商品企画部長、マーケティング部長及び業務管理部長をもって構成する。 新商品等についての取扱い等の可否、商品性の変更に関連する基本事項等の審議・決定を行う。 |
| コンプライアンス委員会 | 原則月1回 | 常勤取締役及びコンプライアンス部長をもって構成する。 法令等、顧客ガイドライン、社内ルールの遵守状況の報告及び監視を行う。 |
| プロダクトガバナンス委員会 | 原則月1回 | 常勤取締役、運用部長、リスク管理部長、コンプライアンス部長、商品企画部長、マーケティング部長及び業務管理部長をもって構成する。 基本的商品戦略について、投資戦略委員会・運用会議・商品検討委員会の内容、市況及び業界動向を鑑みた上で決定する。また、商品戦略に係る对外公表を担当する。 |

上記体制は、今後、変更となる場合があります。

コンプライアンス

コンプライアンス委員会において、業務全般にかかる法令諸規則、社内ルール等を遵守していくための諸施策の検討や諸施策の実施状況の報告等が行われています。また、コンプライアンス部長は、遵守状況の管理・監督を行うとともに、必要に応じて当社の役職員に諸施策の実行を指示します。

機関化回避に関する運営

グループ内取引による機関化を回避するために、グループ企業との各種取引について監査をする外部専門家(弁護士)を選任した上で、自ら率先垂範して運営しています。

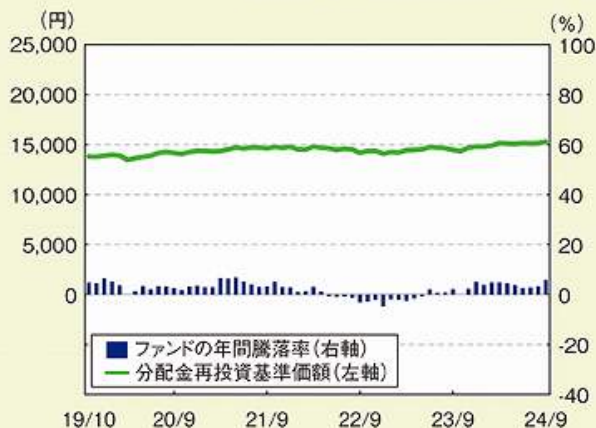
(参考情報)

下記のグラフは、ファンドと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す。

〈セレブライフ・ストーリー2025〉

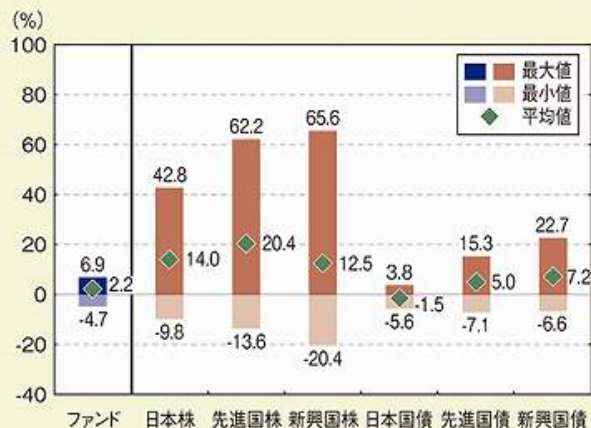
● ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

(2019年10月～2024年9月)



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2019年10月～2024年9月)



〈セレブライフ・ストーリー2035〉

● ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

(2019年10月～2024年9月)



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2019年10月～2024年9月)



* 分配金再投資基準価額及び年間騰落率は、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あり、実際の基準価額及び実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

* 「ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較」は、過去5年間の年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示します。なお、全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

* ファンドの年間騰落率算出において、過去5年間のデータがない場合は以下のルールに基づき表示しています。

① 年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。

② 年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。

③ インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示しています。

〈セレブライフ・ストーリー2045〉

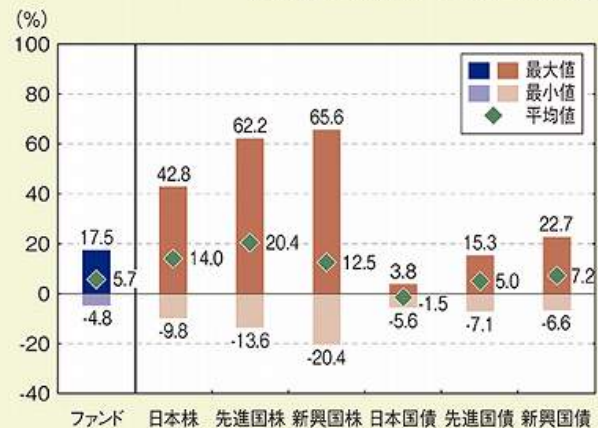
● ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

(2019年10月～2024年9月)



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2019年10月～2024年9月)



〈セレブライフ・ストーリー2055〉

● ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

(2019年10月～2024年9月)



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2019年10月～2024年9月)



* 分配金再投資基準価額及び年間騰落率は、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あり、実際の基準価額及び実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

* 「ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較」は、過去5年間の年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示します。なお、全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

* ファンドの年間騰落率算出において、過去5年間分のデータがない場合は以下のルールに基づき表示しています。

① 年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。

② 年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。

③ インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示しています。

〈代表的な各資産クラスの指数〉

日本株…Morningstar 日本株式指数

先進国株…Morningstar 先進国株式指数(除く日本)

新興国株…Morningstar 新興国株式指数

日本国債…Morningstar 日本国債指数

先進国債…Morningstar グローバル国債指数(除く日本)

新興国債…Morningstar 新興国ソブリン債指数

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。各指数は、全て税引前利子・配当込み指数です。

〈各指数の概要〉

日本株：Morningstar 日本株式指数は、Morningstar, Inc.が発表している株価指数で、日本に上場する株式で構成されています。

先進国株：Morningstar 先進国株式指数(除く日本)は、Morningstar, Inc.が発表している株価指数で、日本を除く世界の先進国に上場する株式で構成されています。

新興国株：Morningstar 新興国株式指数は、Morningstar, Inc.が発表している株価指数で、世界の新興国に上場する株式で構成されています。

日本国債：Morningstar 日本国債指数は、Morningstar, Inc.が発表している債券指数で、日本の国債で構成されています。

先進国債：Morningstar グローバル国債指数(除く日本)は、Morningstar, Inc.が発表している債券指数で、日本を除く主要先進国の政府や政府系機関により発行された債券で構成されています。

新興国債：Morningstar 新興国ソブリン債指数は、Morningstar, Inc.が発表している債券指数で、エマージング諸国の政府や政府系機関により発行された米ドル建て債券で構成されています。

〈重要事項〉

本ファンドは、Morningstar, Inc.、又はモーニングスター・ジャパン株式会社を含むMorningstar, Inc.が支配する会社(これらの法人全てを総称して「Morningstarグループ」と言います)が組成、推薦、販売または宣伝するものではありません。Morningstarグループは、投資信託への一般的な投資の当否、特に本ファンドに投資することの当否、または本ファンドが投資対象とする市場の一般的な騰落率と連動するMorningstarのインデックス(以下「Morningstarインデックス」と言います)の能力について、本ファンドの受益者又は公衆に対し、明示又は黙示を問わず、いかなる表明保証も行いません。本ファンドとの関連においては、委託会社とMorningstarグループとの唯一の関係は、Morningstarのサービスマーク及びサービス名並びに特定のMorningstarインデックスの使用の許諾であり、Morningstarインデックスは、Morningstarグループが委託会社又は本ファンドとは無関係に判断、構成、算定しています。Morningstarグループは、Morningstarインデックスの判断、構成又は算定を行うにあたり、委託会社又は本ファンドの受益者のニーズを考慮する義務を負いません。Morningstarグループは、本ファンドの基準価額及び設定金額あるいは本ファンドの設定あるいは販売の時期の決定、または本ファンドの解約時の基準価額算出式の決定あるいは計算について責任を負わず、また関与しておりません。Morningstarグループは、本ファンドの運営管理、マーケティング又は売買取引に関連していかなる義務も責任も負いません。

Morningstarグループは、Morningstarインデックス又はそれに含まれるデータの正確性及び／又は完全性を保証せず、また、Morningstarグループは、その誤謬、脱漏、中断についていかなる責任も負いません。Morningstarグループは、委託会社、本ファンドの受益者又はユーザー、またはその他の人又は法人が、Morningstarインデックス又はそれに含まれるデータを使用して得る結果について、明示又は黙示を問わず、いかなる保証も行いません。Morningstarグループは、Morningstarインデックス又はそれに含まれるデータについて明示又は黙示の保証を行わず、また商品性あるいは特定目的又は使用への適合性に関する一切の保証を明確に否認します。上記のいずれも制限することなく、いかなる場合であれ、Morningstarグループは、特別損害、懲罰的損害、間接損害または結果損害(逸失利益を含む)について、例えこれらの損害の可能性を告知されていたとしても責任を負いません。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

通常のお申込み

お申込金額の3.3%（税抜3.0%）を上限とする販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

お申込手数料は販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。なお、下記に記載の照会先においてもご確認ください。

* 申込手数料には、消費税等が課されます。

(注) 申込手数料とは、購入時の商品説明、情報提供及び事務手続き等にかかる対価のことをいいます。

委託会社における照会先：

| |
|--|
| SBIアセットマネジメント株式会社（委託会社） |
| 電話番号 03 - 6229 - 0097（受付時間：毎営業日の午前9時～午後5時） |
| ホームページ https://www.sbi-am.co.jp/ |

確定拠出年金制度に基づくお申込み

申込手数料はかかりません。

(2)【換金(解約)手数料】

換金（解約）手数料はかかりません。

ただし、換金時に、基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に対し0.3%）が差引かれます。

(注) 信託財産留保額とは、換金に伴う有価証券の売買委託手数料等の費用のことをいいます。

(3)【信託報酬等】

以下の支払先が行う各ファンドに関する業務の対価として支払われる信託報酬の総額は、信託財産の計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.484%（税抜：年0.44%）の率を乗じて得た額とします。信託報酬の配分は下記の通りです。

運用管理費用及び実質的な負担等

| | 2025 | 2035 | 2045 | 2055 | |
|--------------------------------------|--------------------|--------------------|---------|---------|--|
| 運用管理費用 （信託報酬） | 年0.484%（税抜：年0.44%） | | | | 信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率 |
| 内訳 | 委託会社 | 年0.22%（税抜：年0.2%） | | | ファンドの運用、基準価額の算出等の対価 |
| | 販売会社 | 年0.22%（税抜：年0.2%） | | | 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及び事務手続き等の対価 |
| | 受託会社 | 年0.044%（税抜：年0.04%） | | | 運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等の対価 |
| 各ファンドの投資対象 ファンドの信託報酬 ¹ | 0.1611% | 0.1642% | 0.1592% | 0.1541% | 投資対象とする投資信託証券の管理報酬等 |
| 実質的な負担 （概算値） ² | 0.6451% | 0.6482% | 0.6432% | 0.6381% | |

投資顧問（助言）会社への報酬は委託会社報酬の中から支払われます。

- 1 基本投資割合で運用された場合の信託報酬率（年）であり、実際の組入状況により変動します。また、投資対象ファンドの信託報酬の改定や投資対象ファンドの変更等により、変動する場合があります。
- 2 各ファンドが投資対象とする投資信託証券の信託報酬を加味した、投資者の皆様が実質的に負担する信託報酬率（年）になります。

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日及び毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。委託会社及び販売会社の報酬は本ファンドから委託会社に対して支弁され、販売会社の報酬は委託会社より販売会社に対して支払われます。受託会社の報酬は本ファンドから受託会社に対して支弁されます。

(4)【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（印刷等費用（有価証券届出書、有価証券報告書、信託約款、目論見書、運用報告書その他法令により必要とされる書類の作成、届出、交付に係る費用）、公告費用、受益権の管理事務に関する費用を含みます。）および受託者の立替えた立替金の利息（以下、「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）は、計算期間を通じて毎日計上し、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

委託者は、に定める諸費用の支払を行い、当該支払金額について信託財産中から支弁を受けることができます。この場合、委託者は、当該支払金額について信託財産中から支弁を受ける際に、受領する金額にあらかじめ上限を付することができます。また、委託者は、当該支払金額の信託財産中からの支弁を受ける代わりに、に定める諸費用の金額をあらかじめ見積もったうえで、実際または予想される費用金額を上限として、一定の率または一定の金額に基づいて信託財産中から支弁を受けることもできます。

委託者は、信託財産の規模等を考慮のうえ、あらかじめ委託者が定めた範囲内で、前項の受領する金額の上限、一定の率または一定の金額を変更することができます。

の一定の率を定めた場合、諸費用の額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に応じて計上されます。また、の一定の金額を定めた場合、諸費用の額は、計算期間を通じて毎日、当該計算期間の日数に応じて按分して計上されます。かかる諸費用は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（ただし、計算期間の最初の6ヵ月終了日に該当する日が休業日のときは、その翌営業日とします。）および毎計算期末ならびに信託終了のときに信託財産中から支弁します。

の諸費用に係る消費税等に相当する金額は、諸費用支弁のときに、信託財産中から支弁します。

(5)【課税上の取扱い】

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、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。

当ファンドは、NISAの対象ではありません。

配当控除、益金不算入制度の適用はありません。

税制が改正された場合には、変更となる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家にご確認されることをお勧めします。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金は、配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%及び地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適

用されます。なお、確定申告による総合課税(配当控除は適用されません。)もしくは申告分離課税のいずれかを選択することも可能です。

ロ. 解約金及び償還金に対する課税

換金(解約)及び償還時の差益(個別元本超過額)は譲渡所得とみなされ、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%及び地方税5%)の税率により、申告分離課税が適用されます。

なお、源泉徴収口座(特定口座)を選択することも可能です。

法人の投資者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金(解約)及び償還時の差益(個別元本超過額)については配当所得として課税され、15.315%(所得税15%及び復興特別所得税0.315%)の税率で源泉徴収が行われます。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金(特別分配金)には課税されません。

また、益金不算入制度の適用はありません。

<注1> 個別元本について

受益者ごとの信託時の受益権の価額等(申込手数料及び当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込の場合等により把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

受益者が元本払戻金(特別分配金)を受取った場合、収益分配金発生時にそ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、その後の当該受益者の個別元本となります。

<注2> 収益分配金の課税について

追加型証券投資信託の収益分配金には、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)」(受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

受益者が収益分配金を受取る際、イ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

外国税額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。

詳しくは、販売会社または税務署等にお問い合わせください。

税法が改正された場合等には、上記の内容が変更となる場合があります。

課税上の取扱いの詳細については、税務専門家に確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

セレブライフ・ストーリー2025

(2024年9月30日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|--------|---------------|-------------|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 1,341,724,852 | 69.29 |
| | アメリカ | 411,902,777 | 21.27 |
| | アイルランド | 96,995,264 | 5.01 |
| | 小計 | 1,850,622,893 | 95.58 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 85,652,467 | 4.42 |
| 合計(純資産総額) | | 1,936,275,360 | 100.00 |

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

セレブライフ・ストーリー2035

(2024年9月30日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|--------|---------------|-------------|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 2,606,432,557 | 66.03 |
| | アメリカ | 963,747,365 | 24.41 |
| | アイルランド | 237,822,234 | 6.02 |
| | 小計 | 3,808,002,156 | 96.46 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 139,597,325 | 3.54 |
| 合計(純資産総額) | | 3,947,599,481 | 100.00 |

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

セレブライフ・ストーリー2045

(2024年9月30日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|--------|---------------|-------------|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 1,462,714,178 | 54.44 |
| | アメリカ | 1,014,132,561 | 37.75 |
| | アイルランド | 108,554,350 | 4.04 |
| | 小計 | 2,585,401,089 | 96.23 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 101,211,439 | 3.77 |
| 合計(純資産総額) | | 2,686,612,528 | 100.00 |

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

セレブライフ・ストーリー2055

(2024年9月30日現在)

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|-------|----|-------------|-------------|
|-------|----|-------------|-------------|

| | | | |
|---------------------|--------|---------------|--------|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 647,926,766 | 40.80 |
| | アメリカ | 812,316,412 | 51.15 |
| | アイルランド | 64,733,291 | 4.08 |
| | 小計 | 1,524,976,469 | 96.02 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 63,178,970 | 3.98 |
| 合計(純資産総額) | | 1,588,155,439 | 100.00 |

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

セレブライフ・ストーリー2025

(2024年9月30日現在)

| 国/ 地域 | 種 類 | 銘 柄 名 | 数 量 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------|----------|--|-------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 日本 | 投資信託受益証券 | MUAM 日本債券インデックス ファンド(適格機関投資家限定) | 898,557,591 | 1.165 | 1,046,819,593 | 1.1652 | 1,046,999,305 | 54.07 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | MUAM 外国債券インデックス ファンド(適格機関投資家限定) | 116,717,217 | 1.6815 | 196,260,000 | 1.7336 | 202,340,967 | 10.45 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | ABRDN PHYSICAL GOLD SHARES ETF | 52,783 | 3,519.72 | 185,781,476 | 3,615.35 | 190,829,067 | 9.86 |
| アイル ランド | 投資信託受益証券 | INVECO BLOOMBERG COMMODITY | 28,783 | 3,178.59 | 91,489,560 | 3,299.91 | 94,981,528 | 4.91 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | ISHARES CORE TOP IX ETF | 337,170 | 261 | 88,136,238 | 274 | 92,384,580 | 4.77 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | NYLI HDG MLT-STR TRC ETF-USD | 12,000 | 4,517.40 | 54,208,854 | 4,580.20 | 54,962,468 | 2.84 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | SCHWAB US REIT ETF | 16,664 | 3,358.43 | 55,964,992 | 3,284.21 | 54,728,197 | 2.83 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | SCHWAB US LARGE-CAP ETF | 4,289 | 9,500.10 | 40,745,967 | 9,649.97 | 41,388,744 | 2.14 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | SPDR PORTFOLIO S&P EMERGING MARKETS ETF | 3,329 | 5,487.96 | 18,269,447 | 5,946.13 | 19,794,673 | 1.02 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | VANGUARD EMERGING MARKETS GOVERNMENT BOND ETF | 1,988 | 9,477.27 | 18,840,817 | 9,457.28 | 18,801,092 | 0.97 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | VANGUARD FTSE EUROPE ETF | 1,212 | 10,028.20 | 12,154,190 | 10,230.88 | 12,399,834 | 0.64 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | VANGUARD SMALL-CAP ETF | 341 | 33,153.32 | 11,305,283 | 33,838.42 | 11,538,904 | 0.60 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | VANGUARD FTSE ALL WORLD EX-US SMALL-CAP ETF | 415 | 17,541.51 | 7,279,730 | 17,975.41 | 7,459,798 | 0.39 |
| アイル ランド | 投資信託受益証券 | VANGUARD FTSE DEVELOPED ASIA PACIFIC EX JAPAN UCITS ETF | 511 | 3,724.53 | 1,903,239 | 3,940.77 | 2,013,736 | 0.10 |

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

種類別投資比率

2024年9月30日現在)

| 種 類 | 投資比率(%) |
|----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 95.58 |
| 合 計 | 95.58 |

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

セブライフ・ストーリー-2035

(2024年9月30日現在)

| 国/ 地域 | 種 類 | 銘 柄 名 | 数 量 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------|--------------|--|---------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 日本 | 投資信託受益 証券 | MUAM 日本債券インデックス ファンド（適格機関投資家限定） | 1,457,074,853 | 1.165 | 1,697,492,203 | 1.1652 | 1,697,783,618 | 43.01 |
| 日本 | 投資信託受益 証券 | MUAM 外国債券インデックス ファンド（適格機関投資家限定） | 348,064,559 | 1.6815 | 585,270,555 | 1.7336 | 603,404,719 | 15.29 |
| アメリカ | 投資信託受益 証券 | ABRDN PHYSICAL GOLD SHARES ETF | 140,995 | 3,519.72 | 496,263,175 | 3,615.35 | 509,746,400 | 12.91 |
| 日本 | 投資信託受益 証券 | ISHARES CORE TOP IX ETF | 1,114,030 | 261 | 291,207,442 | 274 | 305,244,220 | 7.73 |
| アイルラ ンド | 投資信託受益 証券 | INVESCO BLOOMBERG COMMODITY | 70,986 | 3,178.59 | 225,635,894 | 3,299.91 | 234,247,951 | 5.93 |
| アメリカ | 投資信託受益 証券 | NYLI HDG MLT-STR TRC ETF-USD | 24,833 | 4,517.40 | 112,180,706 | 4,580.20 | 113,740,248 | 2.88 |
| アメリカ | 投資信託受益 証券 | SCHWAB US REIT ETF | 34,245 | 3,358.43 | 115,009,671 | 3,284.21 | 112,468,021 | 2.85 |
| アメリカ | 投資信託受益 証券 | SCHWAB US LARGE-CAP ETF | 8,830 | 9,500.10 | 83,885,961 | 9,649.97 | 85,209,282 | 2.16 |
| アメリカ | 投資信託受益 証券 | SPDR PORTFOLIO S&P EMERGING MARKETS ETF | 6,813 | 5,487.96 | 37,389,529 | 5,946.13 | 40,510,996 | 1.03 |
| アメリカ | 投資信託受益 証券 | VANGUARD EMERGING MARKETS GOVERNMENT BOND ETF | 4,038 | 9,477.27 | 38,269,224 | 9,457.28 | 38,188,536 | 0.97 |
| アメリカ | 投資信託受益 証券 | VANGUARD FTSE EUROPE ETF | 2,554 | 10,028.20 | 25,612,048 | 10,230.88 | 26,129,684 | 0.66 |
| アメリカ | 投資信託受益 証券 | VANGUARD SMALL-CAP ETF | 678 | 33,153.32 | 22,477,955 | 33,838.42 | 22,942,455 | 0.58 |
| アメリカ | 投資信託受益 証券 | VANGUARD FTSE ALL WORLD EX-US SMALL-CAP ETF | 824 | 17,541.51 | 14,454,210 | 17,975.41 | 14,811,743 | 0.38 |
| アイルラ ンド | 投資信託受益 証券 | VANGUARD FTSE DEVELOPED ASIA PACIFIC EX JAPAN UCITS ETF | 907 | 3,724.53 | 3,378,156 | 3,940.77 | 3,574,283 | 0.09 |

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

種類別投資比率

(2024年9月30日現在)

| 種 類 | 投資比率 (%) |
|----------|----------|
| 投資信託受益証券 | 96.46 |
| 合 計 | 96.46 |

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

セブライフ・ストーリー-2045

(2024年9月30日現在)

| 国/ 地域 | 種 類 | 銘 柄 名 | 数 量 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------|--------------|--|-------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 日本 | 投資信託受益 証券 | MUAM 日本債券インデックス ファンド（適格機関投資家限定） | 593,009,945 | 1.165 | 690,856,585 | 1.1652 | 690,975,187 | 25.72 |
| 日本 | 投資信託受益 証券 | MUAM 外国債券インデックス ファンド（適格機関投資家限定） | 265,897,538 | 1.6815 | 447,106,710 | 1.7336 | 460,959,971 | 17.16 |
| アメリカ | 投資信託受益 証券 | ABRDN PHYSICAL GOLD SHARES ETF | 110,368 | 3,519.72 | 388,464,655 | 3,615.35 | 399,019,048 | 14.85 |
| 日本 | 投資信託受益 証券 | ISHARES CORE TOP IX ETF | 1,134,230 | 261 | 296,487,722 | 274 | 310,779,020 | 11.57 |
| アメリカ | 投資信託受益 証券 | VANGUARD EMERGING MARKETS GOVERNMENT BOND ETF | 29,765 | 9,477.27 | 282,091,001 | 9,457.28 | 281,496,231 | 10.48 |

| | | | | | | | | |
|--------|----------|---|--------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| アイルランド | 投資信託受益証券 | INVESCO BLOOMBERG COMMODITY | 32,047 | 3,178.59 | 101,864,501 | 3,299.91 | 105,752,459 | 3.94 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | SCHWAB US REIT ETF | 31,007 | 3,358.43 | 104,135,053 | 3,284.21 | 101,833,726 | 3.79 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | NYLI HDG MLT-STR TRC ETF-USD | 16,774 | 4,517.40 | 75,774,943 | 4,580.20 | 76,828,370 | 2.86 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | SCHWAB US LARGE-CAP ETF | 5,991 | 9,500.10 | 56,915,152 | 9,649.97 | 57,813,002 | 2.15 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | VANGUARD SMALL-CAP ETF | 933 | 33,153.32 | 30,932,052 | 33,838.42 | 31,571,254 | 1.18 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | SPDR PORTFOLIO S&P EMERGING MARKETS ETF | 4,524 | 5,487.96 | 24,827,569 | 5,946.13 | 26,900,300 | 1.00 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | VANGUARD FTSE ALL WORLD EX-US SMALL-CAP ETF | 1,153 | 17,541.51 | 20,225,369 | 17,975.41 | 20,725,655 | 0.77 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | VANGUARD FTSE EUROPE ETF | 1,754 | 10,028.20 | 17,589,480 | 10,230.88 | 17,944,975 | 0.67 |
| アイルランド | 投資信託受益証券 | VANGUARD FTSE DEVELOPED ASIA PACIFIC EX JAPAN UCITS ETF | 711 | 3,724.53 | 2,648,147 | 3,940.77 | 2,801,891 | 0.10 |

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

種類別投資比率

(2024年9月30日現在)

| 種類 | 投資比率(%) |
|----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 96.23 |
| 合計 | 96.23 |

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

セレクトライフ・ストーリー-2055

(2024年9月30日現在)

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------|----------|--|-------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 日本 | 投資信託受益証券 | MUAM 外国債券インデックス ファンド(適格機関投資家限定) | 156,014,018 | 1.6815 | 262,337,571 | 1.7336 | 270,465,901 | 17.03 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | ABRDN PHYSICAL GOLD SHARES ETF | 64,569 | 3,519.72 | 227,264,917 | 3,615.35 | 233,439,592 | 14.70 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | VANGUARD EMERGING MARKETS GOVERNMENT BOND ETF | 22,212 | 9,477.27 | 210,509,166 | 9,457.28 | 210,065,321 | 13.23 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | MUAM 日本債券インデックス ファンド(適格機関投資家限定) | 167,575,597 | 1.165 | 195,225,570 | 1.1652 | 195,259,085 | 12.29 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | ISHARES CORE TOP IX ETF | 664,970 | 261 | 173,823,158 | 274 | 182,201,780 | 11.47 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | SPDR PORTFOLIO S&P EMERGING MARKETS ETF | 24,298 | 5,487.96 | 133,346,658 | 5,946.13 | 144,479,110 | 9.10 |
| アイルランド | 投資信託受益証券 | INVESCO BLOOMBERG COMMODITY | 18,924 | 3,178.59 | 60,151,772 | 3,299.91 | 62,447,641 | 3.93 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | SCHWAB US REIT ETF | 18,094 | 3,358.43 | 60,767,557 | 3,284.21 | 59,424,628 | 3.74 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | SCHWAB US LARGE-CAP ETF | 5,866 | 9,500.10 | 55,727,638 | 9,649.97 | 56,606,755 | 3.56 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | NYLI HDG MLT-STR TRC ETF-USD | 9,836 | 4,517.40 | 44,433,190 | 4,580.20 | 45,050,903 | 2.84 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | VANGUARD SMALL-CAP ETF | 825 | 33,153.32 | 27,351,492 | 33,838.42 | 27,916,703 | 1.76 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | VANGUARD FTSE ALL WORLD EX-US SMALL-CAP ETF | 1,018 | 17,541.51 | 17,857,265 | 17,975.41 | 18,298,974 | 1.15 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | VANGUARD FTSE EUROPE ETF | 1,665 | 10,028.21 | 16,696,970 | 10,230.88 | 17,034,426 | 1.07 |
| アイルランド | 投資信託受益証券 | VANGUARD FTSE DEVELOPED ASIA PACIFIC EX JAPAN UCITS ETF | 580 | 3,724.53 | 2,160,233 | 3,940.77 | 2,285,650 | 0.14 |

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

種類別投資比率

(2024年9月30日現在)

| 種 類 | 投資比率 (%) |
|----------|----------|
| 投資信託受益証券 | 96.02 |
| 合 計 | 96.02 |

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

【投資不動産物件】

セレブライフ・ストーリー-2025

該当事項はありません。

セレブライフ・ストーリー-2035

該当事項はありません。

セレブライフ・ストーリー-2045

該当事項はありません。

セレブライフ・ストーリー-2055

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。

セレブライフ・ストーリー-2025

(2024年9月30日現在)

| 資産の種類 | 通貨 | 売買 | 数量 | 帳簿価額 金 額 (円) | 評価額 金 額 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------|-----|----|--------------|--------------------|-------------------|-----------------|
| 為替予約取引 | 米ドル | 売建 | 2,275,000.00 | 316,501,866 | 321,486,164 | 16.60 |

セレブライフ・ストーリー-2035

(2024年9月30日現在)

| 資産の種類 | 通貨 | 売買 | 数量 | 帳簿価額 金 額 (円) | 評価額 金 額 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------|-----|----|--------------|--------------------|-------------------|-----------------|
| 為替予約取引 | 米ドル | 売建 | 5,721,000.00 | 795,915,245 | 808,449,384 | 20.48 |

セレブライフ・ストーリー-2045

(2024年9月30日現在)

| 資産の種類 | 通貨 | 売買 | 数量 | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------|-----|----|--------------|-------------------|------------------|-----------------|
| 為替予約取引 | 米ドル | 売建 | 3,879,000.00 | 539,653,074 | 548,151,574 | 20.40 |

セレクトライフ・ストーリー-2055

(2024年9月30日現在)

| 資産の種類 | 通貨 | 売買 | 数量 | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------|-----|----|--------------|-------------------|------------------|-----------------|
| 為替予約取引 | 米ドル | 売建 | 2,274,000.00 | 316,362,745 | 321,344,852 | 20.23 |

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

セレクトライフ・ストーリー-2025

2024年9月30日（直近日）現在、同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

| 年 月 日 | 純資産総額 (円) | | 1万口当たり純資産額 (円) | |
|------------------------|---------------|---------------|-------------------|--------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) |
| 第3計算期間末 (2014年 9月16日) | 608,599,477 | 608,599,477 | 12,704 | 12,704 |
| 第4計算期間末 (2015年 9月14日) | 818,889,161 | 818,889,161 | 12,619 | 12,619 |
| 第5計算期間末 (2016年 9月14日) | 966,849,954 | 966,849,954 | 12,663 | 12,663 |
| 第6計算期間末 (2017年 9月14日) | 1,017,634,321 | 1,017,634,321 | 13,373 | 13,373 |
| 第7計算期間末 (2018年 9月14日) | 1,044,319,643 | 1,044,319,643 | 13,291 | 13,291 |
| 第8計算期間末 (2019年 9月17日) | 1,267,265,876 | 1,267,265,876 | 13,826 | 13,826 |
| 第9計算期間末 (2020年 9月14日) | 1,433,021,915 | 1,433,021,915 | 14,251 | 14,251 |
| 第10計算期間末 (2021年 9月14日) | 1,660,102,124 | 1,660,102,124 | 14,769 | 14,769 |
| 第11計算期間末 (2022年 9月14日) | 1,749,459,167 | 1,749,459,167 | 14,585 | 14,585 |
| 第12計算期間末 (2023年 9月14日) | 1,824,131,817 | 1,824,131,817 | 14,600 | 14,600 |
| 第13計算期間末 (2024年 9月17日) | 1,914,679,233 | 1,914,679,233 | 15,132 | 15,132 |
| 2023年 9月末日 | 1,829,458,583 | | 14,476 | |
| 10月末日 | 1,824,915,767 | | 14,362 | |
| 11月末日 | 1,870,890,025 | | 14,705 | |
| 12月末日 | 1,881,547,296 | | 14,810 | |
| 2024年 1月末日 | 1,847,756,982 | | 14,801 | |
| 2月末日 | 1,842,521,819 | | 14,902 | |
| 3月末日 | 1,877,007,363 | | 15,154 | |
| 4月末日 | 1,844,150,095 | | 15,115 | |
| 5月末日 | 1,833,924,979 | | 15,085 | |
| 6月末日 | 1,856,823,784 | | 15,156 | |
| 7月末日 | 1,847,936,303 | | 15,120 | |
| 8月末日 | 1,882,671,593 | | 15,145 | |

| | | | | |
|------|---------------|--|--------|--|
| 9月末日 | 1,936,275,360 | | 15,317 | |
|------|---------------|--|--------|--|

(注)表中の末日とはその月の最終営業日を指します。

セレブライフ・ストーリー-2035

2024年9月30日（直近日）現在、同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

| 年 月 日 | 純資産総額 (円) | | 1万口当たり純資産額 (円) | |
|------------------------|---------------|---------------|-------------------|--------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) |
| 第3計算期間末 (2014年 9月16日) | 683,856,035 | 683,856,035 | 13,527 | 13,527 |
| 第4計算期間末 (2015年 9月14日) | 968,175,729 | 968,175,729 | 13,262 | 13,262 |
| 第5計算期間末 (2016年 9月14日) | 1,167,876,403 | 1,167,876,403 | 13,036 | 13,036 |
| 第6計算期間末 (2017年 9月14日) | 1,416,524,224 | 1,416,524,224 | 14,253 | 14,253 |
| 第7計算期間末 (2018年 9月14日) | 1,528,621,420 | 1,528,621,420 | 14,203 | 14,203 |
| 第8計算期間末 (2019年 9月17日) | 1,838,586,657 | 1,838,586,657 | 14,745 | 14,745 |
| 第9計算期間末 (2020年 9月14日) | 2,114,428,405 | 2,114,428,405 | 15,229 | 15,229 |
| 第10計算期間末 (2021年 9月14日) | 2,588,088,176 | 2,588,088,176 | 16,227 | 16,227 |
| 第11計算期間末 (2022年 9月14日) | 2,940,992,308 | 2,940,992,308 | 16,194 | 16,194 |
| 第12計算期間末 (2023年 9月14日) | 3,351,999,309 | 3,351,999,309 | 16,490 | 16,490 |
| 第13計算期間末 (2024年 9月17日) | 3,881,373,181 | 3,881,373,181 | 17,306 | 17,306 |
| 2023年 9月末日 | 3,336,193,423 | | 16,312 | |
| 10月末日 | 3,380,306,969 | | 16,222 | |
| 11月末日 | 3,499,526,893 | | 16,653 | |
| 12月末日 | 3,539,886,981 | | 16,754 | |
| 2024年 1月末日 | 3,540,396,396 | | 16,796 | |
| 2月末日 | 3,566,351,241 | | 16,935 | |
| 3月末日 | 3,668,807,021 | | 17,307 | |
| 4月末日 | 3,725,753,084 | | 17,325 | |
| 5月末日 | 3,772,457,312 | | 17,330 | |
| 6月末日 | 3,813,284,346 | | 17,436 | |
| 7月末日 | 3,815,622,598 | | 17,363 | |
| 8月末日 | 3,855,967,126 | | 17,359 | |
| 9月末日 | 3,947,599,481 | | 17,589 | |

(注)表中の末日とはその月の最終営業日を指します。

セレブライフ・ストーリー-2045

2024年9月30日（直近日）現在、同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

| 年 月 日 | 純資産総額 (円) | | 1万口当たり純資産額 (円) | |
|-----------------------|--------------|-------------|-------------------|--------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) |
| 第3計算期間末 (2014年 9月16日) | 427,647,795 | 427,647,795 | 14,137 | 14,137 |
| 第4計算期間末 (2015年 9月14日) | 607,516,290 | 607,516,290 | 13,747 | 13,747 |
| 第5計算期間末 (2016年 9月14日) | 748,882,117 | 748,882,117 | 13,216 | 13,216 |
| 第6計算期間末 (2017年 9月14日) | 926,419,660 | 926,419,660 | 15,000 | 15,000 |

| | | | | | |
|----------|---------------|---------------|---------------|--------|--------|
| 第7計算期間末 | (2018年 9月14日) | 1,025,265,949 | 1,025,265,949 | 14,984 | 14,984 |
| 第8計算期間末 | (2019年 9月17日) | 1,196,540,983 | 1,196,540,983 | 15,513 | 15,513 |
| 第9計算期間末 | (2020年 9月14日) | 1,367,800,052 | 1,367,800,052 | 16,099 | 16,099 |
| 第10計算期間末 | (2021年 9月14日) | 1,624,846,863 | 1,624,846,863 | 17,707 | 17,707 |
| 第11計算期間末 | (2022年 9月14日) | 1,905,828,400 | 1,905,828,400 | 17,943 | 17,943 |
| 第12計算期間末 | (2023年 9月14日) | 2,256,884,465 | 2,256,884,465 | 18,603 | 18,603 |
| 第13計算期間末 | (2024年 9月17日) | 2,632,087,357 | 2,632,087,357 | 20,017 | 20,017 |
| | 2023年 9月末日 | 2,240,333,343 | | 18,369 | |
| | 10月末日 | 2,239,786,836 | | 18,254 | |
| | 11月末日 | 2,326,496,700 | | 18,854 | |
| | 12月末日 | 2,365,547,173 | | 18,994 | |
| | 2024年 1月末日 | 2,387,206,390 | | 19,180 | |
| | 2月末日 | 2,422,313,215 | | 19,427 | |
| | 3月末日 | 2,500,451,859 | | 19,985 | |
| | 4月末日 | 2,534,893,946 | | 20,101 | |
| | 5月末日 | 2,568,601,464 | | 20,182 | |
| | 6月末日 | 2,620,212,042 | | 20,429 | |
| | 7月末日 | 2,610,165,477 | | 20,264 | |
| | 8月末日 | 2,620,356,334 | | 20,149 | |
| | 9月末日 | 2,686,612,528 | | 20,417 | |

(注)表中の末日とはその月の最終営業日を指します。

セレブライフ・ストーリー2055

2024年9月30日(直近日)現在、同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

| 年 月 日 | 純資産総額 (円) | | 1万口当たり純資産額 (円) | |
|------------------------|---------------|---------------|-------------------|--------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) |
| 第3計算期間末 (2014年 9月16日) | 256,160,933 | 256,160,933 | 14,793 | 14,793 |
| 第4計算期間末 (2015年 9月14日) | 393,081,193 | 393,081,193 | 14,469 | 14,469 |
| 第5計算期間末 (2016年 9月14日) | 412,517,782 | 412,517,782 | 13,781 | 13,781 |
| 第6計算期間末 (2017年 9月14日) | 501,559,436 | 501,559,436 | 16,280 | 16,280 |
| 第7計算期間末 (2018年 9月14日) | 524,979,118 | 524,979,118 | 16,271 | 16,271 |
| 第8計算期間末 (2019年 9月17日) | 619,548,079 | 619,548,079 | 16,767 | 16,767 |
| 第9計算期間末 (2020年 9月14日) | 718,168,849 | 718,168,849 | 17,558 | 17,558 |
| 第10計算期間末 (2021年 9月14日) | 907,047,854 | 907,047,854 | 19,843 | 19,843 |
| 第11計算期間末 (2022年 9月14日) | 1,103,164,298 | 1,103,164,298 | 20,340 | 20,340 |
| 第12計算期間末 (2023年 9月14日) | 1,308,564,844 | 1,308,564,844 | 21,380 | 21,380 |
| 第13計算期間末 (2024年 9月17日) | 1,542,403,956 | 1,542,403,956 | 23,396 | 23,396 |
| 2023年 9月末日 | 1,296,097,602 | | 21,098 | |
| 10月末日 | 1,294,612,337 | | 20,926 | |
| 11月末日 | 1,352,058,395 | | 21,714 | |
| 12月末日 | 1,367,404,533 | | 21,885 | |
| 2024年 1月末日 | 1,381,618,354 | | 22,184 | |
| 2月末日 | 1,407,883,483 | | 22,596 | |
| 3月末日 | 1,464,613,055 | | 23,340 | |
| 4月末日 | 1,481,770,365 | | 23,655 | |
| 5月末日 | 1,515,933,486 | | 23,835 | |
| 6月末日 | 1,549,923,637 | | 24,258 | |
| 7月末日 | 1,532,055,843 | | 23,875 | |
| 8月末日 | 1,533,039,198 | | 23,637 | |
| 9月末日 | 1,588,155,439 | | 24,071 | |

(注)表中の末日とはその月の最終営業日を指します。

【分配の推移】

セレブライフ・ストーリー-2025

| 期 間 | 計算期間 | 1万口当たりの分配金（円） |
|---------|-------------------------|---------------|
| 第3計算期間 | 2013年 9月18日～2014年 9月16日 | 0 |
| 第4計算期間 | 2014年 9月17日～2015年 9月14日 | 0 |
| 第5計算期間 | 2015年 9月15日～2016年 9月14日 | 0 |
| 第6計算期間 | 2016年 9月15日～2017年 9月14日 | 0 |
| 第7計算期間 | 2017年 9月15日～2018年 9月14日 | 0 |
| 第8計算期間 | 2018年 9月15日～2019年 9月17日 | 0 |
| 第9計算期間 | 2019年 9月18日～2020年 9月14日 | 0 |
| 第10計算期間 | 2020年 9月15日～2021年 9月14日 | 0 |
| 第11計算期間 | 2021年 9月15日～2022年 9月14日 | 0 |
| 第12計算期間 | 2022年 9月15日～2023年 9月14日 | 0 |
| 第13計算期間 | 2023年 9月15日～2024年 9月17日 | 0 |

セレブライフ・ストーリー-2035

| 期 間 | 計算期間 | 1万口当たりの分配金（円） |
|---------|-------------------------|---------------|
| 第3計算期間 | 2013年 9月18日～2014年 9月16日 | 0 |
| 第4計算期間 | 2014年 9月17日～2015年 9月14日 | 0 |
| 第5計算期間 | 2015年 9月15日～2016年 9月14日 | 0 |
| 第6計算期間 | 2016年 9月15日～2017年 9月14日 | 0 |
| 第7計算期間 | 2017年 9月15日～2018年 9月14日 | 0 |
| 第8計算期間 | 2018年 9月15日～2019年 9月17日 | 0 |
| 第9計算期間 | 2019年 9月18日～2020年 9月14日 | 0 |
| 第10計算期間 | 2020年 9月15日～2021年 9月14日 | 0 |
| 第11計算期間 | 2021年 9月15日～2022年 9月14日 | 0 |
| 第12計算期間 | 2022年 9月15日～2023年 9月14日 | 0 |
| 第13計算期間 | 2023年 9月15日～2024年 9月17日 | 0 |

セレブライフ・ストーリー-2045

| 期 間 | 計算期間 | 1万口当たりの分配金（円） |
|---------|-------------------------|---------------|
| 第3計算期間 | 2013年 9月18日～2014年 9月16日 | 0 |
| 第4計算期間 | 2014年 9月17日～2015年 9月14日 | 0 |
| 第5計算期間 | 2015年 9月15日～2016年 9月14日 | 0 |
| 第6計算期間 | 2016年 9月15日～2017年 9月14日 | 0 |
| 第7計算期間 | 2017年 9月15日～2018年 9月14日 | 0 |
| 第8計算期間 | 2018年 9月15日～2019年 9月17日 | 0 |
| 第9計算期間 | 2019年 9月18日～2020年 9月14日 | 0 |
| 第10計算期間 | 2020年 9月15日～2021年 9月14日 | 0 |
| 第11計算期間 | 2021年 9月15日～2022年 9月14日 | 0 |

| | | |
|---------|-------------------------|---|
| 第12計算期間 | 2022年 9月15日～2023年 9月14日 | 0 |
| 第13計算期間 | 2023年 9月15日～2024年 9月17日 | 0 |

セブライフ・ストーリー-2055

| 期 間 | 計算期間 | 1万口当たりの分配金（円） |
|---------|-------------------------|---------------|
| 第3計算期間 | 2013年 9月18日～2014年 9月16日 | 0 |
| 第4計算期間 | 2014年 9月17日～2015年 9月14日 | 0 |
| 第5計算期間 | 2015年 9月15日～2016年 9月14日 | 0 |
| 第6計算期間 | 2016年 9月15日～2017年 9月14日 | 0 |
| 第7計算期間 | 2017年 9月15日～2018年 9月14日 | 0 |
| 第8計算期間 | 2018年 9月15日～2019年 9月17日 | 0 |
| 第9計算期間 | 2019年 9月18日～2020年 9月14日 | 0 |
| 第10計算期間 | 2020年 9月15日～2021年 9月14日 | 0 |
| 第11計算期間 | 2021年 9月15日～2022年 9月14日 | 0 |
| 第12計算期間 | 2022年 9月15日～2023年 9月14日 | 0 |
| 第13計算期間 | 2023年 9月15日～2024年 9月17日 | 0 |

【収益率の推移】

セブライフ・ストーリー-2025

| 期 | 計算期間 | 収益率（％） |
|---------|-------------------------|--------|
| 第3計算期間 | 2013年 9月18日～2014年 9月16日 | 7.52 |
| 第4計算期間 | 2014年 9月17日～2015年 9月14日 | 0.67 |
| 第5計算期間 | 2015年 9月15日～2016年 9月14日 | 0.35 |
| 第6計算期間 | 2016年 9月15日～2017年 9月14日 | 5.61 |
| 第7計算期間 | 2017年 9月15日～2018年 9月14日 | 0.61 |
| 第8計算期間 | 2018年 9月15日～2019年 9月17日 | 4.03 |
| 第9計算期間 | 2019年 9月18日～2020年 9月14日 | 3.07 |
| 第10計算期間 | 2020年 9月15日～2021年 9月14日 | 3.63 |
| 第11計算期間 | 2021年 9月15日～2022年 9月14日 | 1.25 |
| 第12計算期間 | 2022年 9月15日～2023年 9月14日 | 0.10 |
| 第13計算期間 | 2023年 9月15日～2024年 9月17日 | 3.64 |

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数を記載しております。

セブライフ・ストーリー-2035

| 期 | 計算期間 | 収益率（％） |
|--------|-------------------------|--------|
| 第3計算期間 | 2013年 9月18日～2014年 9月16日 | 9.67 |
| 第4計算期間 | 2014年 9月17日～2015年 9月14日 | 1.96 |
| 第5計算期間 | 2015年 9月15日～2016年 9月14日 | 1.70 |
| 第6計算期間 | 2016年 9月15日～2017年 9月14日 | 9.34 |
| 第7計算期間 | 2017年 9月15日～2018年 9月14日 | 0.35 |
| 第8計算期間 | 2018年 9月15日～2019年 9月17日 | 3.82 |

| | | |
|---------|-------------------------|------|
| 第9計算期間 | 2019年 9月18日～2020年 9月14日 | 3.28 |
| 第10計算期間 | 2020年 9月15日～2021年 9月14日 | 6.55 |
| 第11計算期間 | 2021年 9月15日～2022年 9月14日 | 0.20 |
| 第12計算期間 | 2022年 9月15日～2023年 9月14日 | 1.83 |
| 第13計算期間 | 2023年 9月15日～2024年 9月17日 | 4.95 |

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数を記載しております。

セレブライフ・ストーリー-2045

| 期 | 計算期間 | 収益率（％） |
|---------|-------------------------|--------|
| 第3計算期間 | 2013年 9月18日～2014年 9月16日 | 11.46 |
| 第4計算期間 | 2014年 9月17日～2015年 9月14日 | 2.76 |
| 第5計算期間 | 2015年 9月15日～2016年 9月14日 | 3.86 |
| 第6計算期間 | 2016年 9月15日～2017年 9月14日 | 13.50 |
| 第7計算期間 | 2017年 9月15日～2018年 9月14日 | 0.11 |
| 第8計算期間 | 2018年 9月15日～2019年 9月17日 | 3.53 |
| 第9計算期間 | 2019年 9月18日～2020年 9月14日 | 3.78 |
| 第10計算期間 | 2020年 9月15日～2021年 9月14日 | 9.99 |
| 第11計算期間 | 2021年 9月15日～2022年 9月14日 | 1.33 |
| 第12計算期間 | 2022年 9月15日～2023年 9月14日 | 3.68 |
| 第13計算期間 | 2023年 9月15日～2024年 9月17日 | 7.60 |

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数を記載しております。

セレブライフ・ストーリー-2055

| 期 | 計算期間 | 収益率（％） |
|---------|-------------------------|--------|
| 第3計算期間 | 2013年 9月18日～2014年 9月16日 | 13.60 |
| 第4計算期間 | 2014年 9月17日～2015年 9月14日 | 2.19 |
| 第5計算期間 | 2015年 9月15日～2016年 9月14日 | 4.75 |
| 第6計算期間 | 2016年 9月15日～2017年 9月14日 | 18.13 |
| 第7計算期間 | 2017年 9月15日～2018年 9月14日 | 0.06 |
| 第8計算期間 | 2018年 9月15日～2019年 9月17日 | 3.05 |
| 第9計算期間 | 2019年 9月18日～2020年 9月14日 | 4.72 |
| 第10計算期間 | 2020年 9月15日～2021年 9月14日 | 13.01 |
| 第11計算期間 | 2021年 9月15日～2022年 9月14日 | 2.50 |
| 第12計算期間 | 2022年 9月15日～2023年 9月14日 | 5.11 |
| 第13計算期間 | 2023年 9月15日～2024年 9月17日 | 9.43 |

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数を記載しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

セレブライフ・ストーリー-2025

| 期 | 計算期間 | 設定数量 (口) | 解約数量 (口) | 発行済み数量 (口) |
|---------|-------------------------|-------------|-------------|---------------|
| 第3計算期間 | 2013年 9月18日～2014年 9月16日 | 236,303,078 | 71,333,474 | 479,079,542 |
| 第4計算期間 | 2014年 9月17日～2015年 9月14日 | 283,950,405 | 114,072,144 | 648,957,803 |
| 第5計算期間 | 2015年 9月15日～2016年 9月14日 | 183,543,672 | 68,980,253 | 763,521,222 |
| 第6計算期間 | 2016年 9月15日～2017年 9月14日 | 159,831,130 | 162,366,063 | 760,986,289 |
| 第7計算期間 | 2017年 9月15日～2018年 9月14日 | 133,635,236 | 108,915,248 | 785,706,277 |
| 第8計算期間 | 2018年 9月15日～2019年 9月17日 | 196,901,223 | 66,008,777 | 916,598,723 |
| 第9計算期間 | 2019年 9月18日～2020年 9月14日 | 282,173,528 | 193,201,683 | 1,005,570,568 |
| 第10計算期間 | 2020年 9月15日～2021年 9月14日 | 354,768,856 | 236,274,555 | 1,124,064,869 |
| 第11計算期間 | 2021年 9月15日～2022年 9月14日 | 229,869,031 | 154,464,769 | 1,199,469,131 |
| 第12計算期間 | 2022年 9月15日～2023年 9月14日 | 213,283,284 | 163,315,705 | 1,249,436,710 |
| 第13計算期間 | 2023年 9月15日～2024年 9月17日 | 268,642,452 | 252,740,150 | 1,265,339,012 |

(注)本邦外における設定及び解約の実績はありません。

セレブライフ・ストーリー-2035

| 期 | 計算期間 | 設定数量 (口) | 解約数量 (口) | 発行済み数量 (口) |
|---------|-------------------------|-------------|-------------|---------------|
| 第3計算期間 | 2013年 9月18日～2014年 9月16日 | 281,866,268 | 80,636,866 | 505,557,345 |
| 第4計算期間 | 2014年 9月17日～2015年 9月14日 | 351,107,898 | 126,643,086 | 730,022,157 |
| 第5計算期間 | 2015年 9月15日～2016年 9月14日 | 267,608,201 | 101,726,372 | 895,903,986 |
| 第6計算期間 | 2016年 9月15日～2017年 9月14日 | 222,999,233 | 125,071,997 | 993,831,222 |
| 第7計算期間 | 2017年 9月15日～2018年 9月14日 | 207,122,328 | 124,665,813 | 1,076,287,737 |
| 第8計算期間 | 2018年 9月15日～2019年 9月17日 | 250,491,996 | 79,882,114 | 1,246,897,619 |
| 第9計算期間 | 2019年 9月18日～2020年 9月14日 | 295,654,858 | 154,100,097 | 1,388,452,380 |
| 第10計算期間 | 2020年 9月15日～2021年 9月14日 | 376,462,562 | 170,033,274 | 1,594,881,668 |
| 第11計算期間 | 2021年 9月15日～2022年 9月14日 | 368,952,043 | 147,751,284 | 1,816,082,427 |
| 第12計算期間 | 2022年 9月15日～2023年 9月14日 | 377,082,251 | 160,374,440 | 2,032,790,238 |
| 第13計算期間 | 2023年 9月15日～2024年 9月17日 | 459,012,065 | 249,009,650 | 2,242,792,653 |

(注)本邦外における設定及び解約の実績はありません。

セレブライフ・ストーリー-2045

| 期 | 計算期間 | 設定数量 (口) | 解約数量 (口) | 発行済み数量 (口) |
|--------|-------------------------|-------------|-------------|---------------|
| 第3計算期間 | 2013年 9月18日～2014年 9月16日 | 170,380,879 | 47,528,476 | 302,491,823 |
| 第4計算期間 | 2014年 9月17日～2015年 9月14日 | 204,270,268 | 64,822,458 | 441,939,633 |
| 第5計算期間 | 2015年 9月15日～2016年 9月14日 | 185,422,665 | 60,735,426 | 566,626,872 |
| 第6計算期間 | 2016年 9月15日～2017年 9月14日 | 146,079,642 | 95,074,753 | 617,631,761 |
| 第7計算期間 | 2017年 9月15日～2018年 9月14日 | 141,952,700 | 75,343,120 | 684,241,341 |

| | | | | |
|---------|-------------------------|-------------|-------------|---------------|
| 第8計算期間 | 2018年 9月15日～2019年 9月17日 | 162,270,954 | 75,177,766 | 771,334,529 |
| 第9計算期間 | 2019年 9月18日～2020年 9月14日 | 194,237,420 | 115,954,404 | 849,617,545 |
| 第10計算期間 | 2020年 9月15日～2021年 9月14日 | 216,301,704 | 148,277,107 | 917,642,142 |
| 第11計算期間 | 2021年 9月15日～2022年 9月14日 | 232,632,360 | 88,093,782 | 1,062,180,720 |
| 第12計算期間 | 2022年 9月15日～2023年 9月14日 | 243,344,509 | 92,369,362 | 1,213,155,867 |
| 第13計算期間 | 2023年 9月15日～2024年 9月17日 | 246,142,958 | 144,370,046 | 1,314,928,779 |

(注)本邦外における設定及び解約の実績はありません。

セレブライフ・ストーリー2055

| 期 | 計算期間 | 設定数量 (口) | 解約数量 (口) | 発行済み数量 (口) |
|---------|-------------------------|-------------|-------------|---------------|
| 第3計算期間 | 2013年 9月18日～2014年 9月16日 | 110,381,094 | 48,633,996 | 173,166,677 |
| 第4計算期間 | 2014年 9月17日～2015年 9月14日 | 181,591,921 | 83,083,688 | 271,674,910 |
| 第5計算期間 | 2015年 9月15日～2016年 9月14日 | 103,715,800 | 76,062,048 | 299,328,662 |
| 第6計算期間 | 2016年 9月15日～2017年 9月14日 | 79,194,276 | 70,443,351 | 308,079,587 |
| 第7計算期間 | 2017年 9月15日～2018年 9月14日 | 72,893,191 | 58,330,954 | 322,641,824 |
| 第8計算期間 | 2018年 9月15日～2019年 9月17日 | 89,383,232 | 42,525,569 | 369,499,487 |
| 第9計算期間 | 2019年 9月18日～2020年 9月14日 | 116,518,751 | 76,991,117 | 409,027,121 |
| 第10計算期間 | 2020年 9月15日～2021年 9月14日 | 138,613,786 | 90,535,159 | 457,105,748 |
| 第11計算期間 | 2021年 9月15日～2022年 9月14日 | 147,757,758 | 62,506,176 | 542,357,330 |
| 第12計算期間 | 2022年 9月15日～2023年 9月14日 | 139,593,420 | 69,892,189 | 612,058,561 |
| 第13計算期間 | 2023年 9月15日～2024年 9月17日 | 145,116,786 | 97,913,981 | 659,261,366 |

(注)本邦外における設定及び解約の実績はありません。

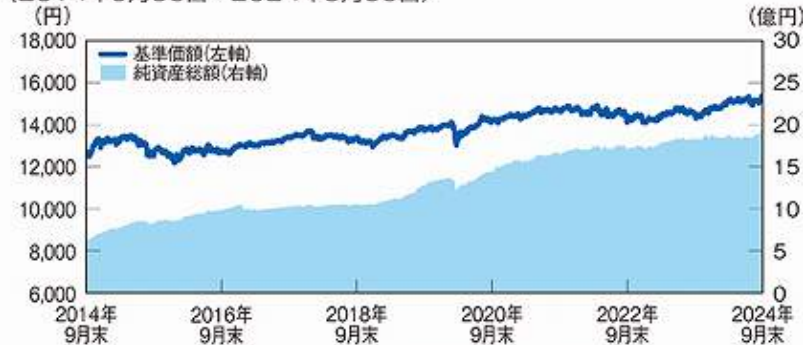
(参考情報)

運用実績 〈セレブライフ・ストーリー2025〉

基準価額・純資産の推移

(基準日:2024年9月30日)

(2014年9月30日～2024年9月30日)



※基準価額及び分配金再投資基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しています。

| | |
|--------------|---------|
| 基準価額(1万口当たり) | 15,317円 |
| 純資産総額 | 19.36億円 |

分配の推移(1万口当たり、税引前)

| 決算期 | 金額 |
|------------------|----|
| 第9期(2020年9月14日) | 0円 |
| 第10期(2021年9月14日) | 0円 |
| 第11期(2022年9月14日) | 0円 |
| 第12期(2023年9月14日) | 0円 |
| 第13期(2024年9月17日) | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

主要な資産の状況

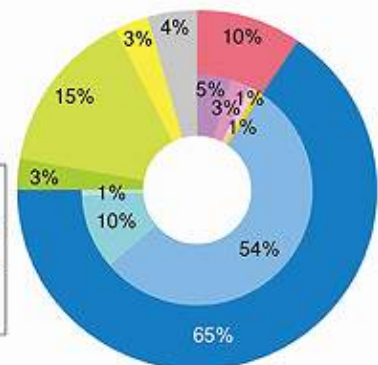
※比率は本ファンドの純資産総額に対する比率です。
 ※比率は表示単位未満を四捨五入しているため、合計が100%にならない場合があります。

《構成比率》

| | |
|-----------|--------|
| 投資信託証券 | 95.6% |
| 為替ヘッジ評価損益 | -0.3% |
| 現金等 | 4.7% |
| 合計 | 100.0% |

《資産別投資比率》

| | | | | |
|--------|--------|---------|---------|-------------|
| 株式 | 国内株式 | 新興国大型株式 | 先進国大型株式 | 先進国・新興国小型株式 |
| 債券 | 国内債券 | 先進国債券 | 新興国債券 | ヘッジファンド |
| コモディティ | コモディティ | リート | 現金等 | |



《組入上位10銘柄》

| 投資信託証券の名称 | 比率 | 投資対象資産 | 通貨 |
|-------------------------------------|-------|---------|-----|
| 1 MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定) | 54.1% | 国内債券 | 円 |
| 2 MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定) | 10.5% | 先進国債券 | 円 |
| 3 Abrdnフィジカル・ゴールド・シェアーズ ETF ★ | 9.9% | コモディティ | 米ドル |
| 4 インベスコ・ブルー・ムバーグ・コモディティ UCITS ETF ★ | 4.9% | コモディティ | 米ドル |
| 5 iシェアーズ・コア TOPIX ETF | 4.8% | 国内株式 | 円 |
| 6 NYLI ヘッジ・マルチストラテジー・トラッカーETF * | 2.8% | ヘッジファンド | 米ドル |
| 7 シュワブU.S.リートETF | 2.8% | リート | 米ドル |
| 8 シュワブU.S.ラージキャップETF | 2.1% | 先進国大型株式 | 米ドル |
| 9 SPDR ポートフォリオ 新興国株式 ETF | 1.0% | 新興国大型株式 | 米ドル |
| 10 ハンガード・米ドル建て 新興国政府債券ETF | 1.0% | 新興国債券 | 米ドル |

※NYLI ヘッジ・マルチストラテジー・トラッカーETFは、2024年8月28日付で、IQ ヘッジ マルチストラテジー・トラッカーETFより名称変更されました。
 ★ヘッジファンドとコモディティを投資対象としているETFに対し、為替ヘッジを高位に行います。
 ※各比率の合計が四捨五入の関係で一致しないことがあります。
 ※基準日(2024年9月30日時点)の状況です。直近の基本投資割合及び投資対象ファンドはそれぞれP4、P5に記載しています。

《為替変動の影響を受ける割合》 9.7%

※比率は純資産総額に対する割合です。外資建て資産のうち、為替変動の影響を受ける割合を示しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドの年間収益率は、分配金再投資基準価額の騰落率です。 ※本ファンドにはベンチマークはありません。
 ※2024年は年初から9月末までの騰落率です。

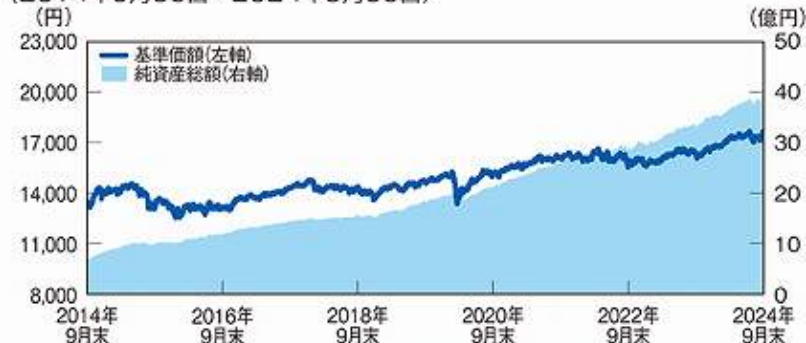
最新の運用実績は、委託会社のホームページまたは販売会社でご確認いただけます。
 ※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

運用実績 〈セレブライフ・ストーリー2035〉

基準価額・純資産の推移

(基準日:2024年9月30日)

(2014年9月30日～2024年9月30日)



※基準価額及び分配金再投資基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しています。

| | |
|--------------|---------|
| 基準価額(1万口当たり) | 17,589円 |
| 純資産総額 | 39.47億円 |

分配の推移(1万口当たり、税引前)

| 決算期 | 金額 |
|------------------|----|
| 第9期(2020年9月14日) | 0円 |
| 第10期(2021年9月14日) | 0円 |
| 第11期(2022年9月14日) | 0円 |
| 第12期(2023年9月14日) | 0円 |
| 第13期(2024年9月17日) | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

主要な資産の状況

※比率は本ファンドの純資産総額に対する比率です。

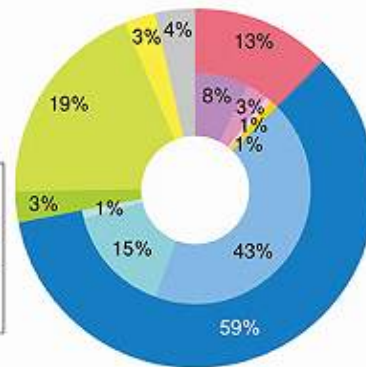
※比率は表示単位未満を四捨五入しているため、合計が100%にならない場合があります。

《構成比率》

| | |
|-----------|--------|
| 投資信託証券 | 96.5% |
| 為替ヘッジ評価損益 | -0.3% |
| 現金等 | 3.9% |
| 合計 | 100.0% |

《資産別投資比率》

| | | | | |
|--------|--------|---------|---------|-------------|
| 株式 | 国内株式 | 新興国大型株式 | 先進国大型株式 | 先進国・新興国小型株式 |
| 債券 | 国内債券 | 先進国債券 | 新興国債券 | ヘッジファンド |
| コモディティ | コモディティ | リート | 現金等 | |



《組入上位10銘柄》

| | 投資信託証券の名称 | 比率 | 投資対象資産 | 通貨 |
|----|----------------------------------|-------|---------|-----|
| 1 | MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定) | 43.0% | 国内債券 | 円 |
| 2 | MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定) | 15.3% | 先進国債券 | 円 |
| 3 | Abrdnフィジカル・ゴールド・シェアーズ ETF ★ | 12.9% | コモディティ | 米ドル |
| 4 | iシェアーズ・コア TOPIX ETF | 7.7% | 国内株式 | 円 |
| 5 | インベスコ・ブルームバーグ・コモディティ UCITS ETF ★ | 5.9% | コモディティ | 米ドル |
| 6 | NYLI ヘッジ・マルチストラテジー・トラッカーETF * | 2.9% | ヘッジファンド | 米ドル |
| 7 | シュワブU.S.リートETF | 2.8% | リート | 米ドル |
| 8 | シュワブU.S.ラージキャップETF | 2.2% | 先進国大型株式 | 米ドル |
| 9 | SPDR ポートフォリオ 新興国株式 ETF | 1.0% | 新興国大型株式 | 米ドル |
| 10 | ハンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF | 1.0% | 新興国債券 | 米ドル |

※NYLI ヘッジ・マルチストラテジー・トラッカーETFは、2024年8月28日付で、IQ ヘッジ マルチストラテジー トラッカーETFより名称変更されました。

★ヘッジファンドとコモディティを投資対象としているETFに対し、為替ヘッジを高位に行います。

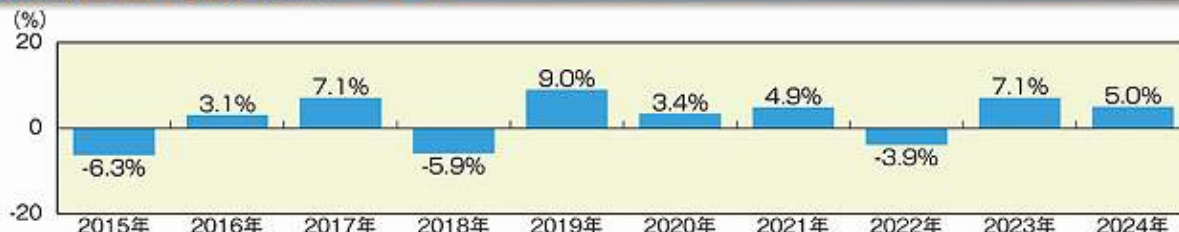
※各比率の合計が四捨五入の関係で一致しないことがあります。

※基準日(2024年9月30日時点)の状況です。直近の基本投資割合及び投資対象ファンドはそれぞれP4、P5に記載しています。

《為替変動の影響を受ける割合》 10.0%

※比率は純資産総額に対する割合です。外貨建て資産のうち、為替変動の影響を受ける割合を示しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドの年間収益率は、分配金再投資基準価額の騰落率です。 ※本ファンドにはベンチマークはありません。

※2024年は年初から9月末までの騰落率です。

最新の運用実績は、委託会社のホームページまたは販売会社でご確認いただけます。

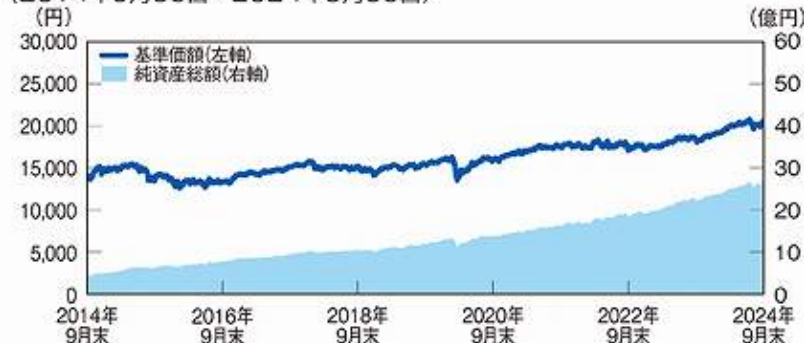
※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

運用実績 〈セレブライフ・ストーリー2045〉

基準価額・純資産の推移

(基準日:2024年9月30日)

(2014年9月30日～2024年9月30日)



※基準価額及び分配金再投資基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しています。

| | |
|--------------|---------|
| 基準価額(1万口当たり) | 20,417円 |
| 純資産総額 | 26.86億円 |

分配の推移(1万口当たり、税引前)

| 決算期 | 金額 |
|------------------|----|
| 第9期(2020年9月14日) | 0円 |
| 第10期(2021年9月14日) | 0円 |
| 第11期(2022年9月14日) | 0円 |
| 第12期(2023年9月14日) | 0円 |
| 第13期(2024年9月17日) | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

主要な資産の状況

※比率は本ファンドの純資産総額に対する比率です。

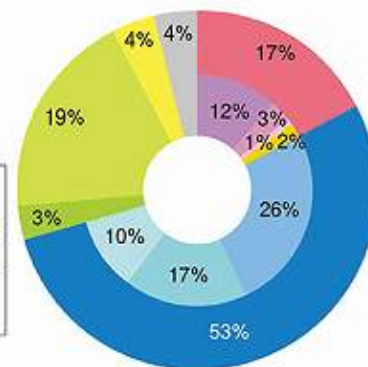
※比率は表示単位未満を四捨五入しているため、合計が100%にならない場合があります。

《構成比率》

| | |
|-----------|--------|
| 投資信託証券 | 96.2% |
| 為替ヘッジ評価損益 | -0.3% |
| 現金等 | 4.1% |
| 合計 | 100.0% |

《資産別投資比率》

| 資産別 | 比率 |
|-------------|-----|
| 株式 | 53% |
| 国内株式 | 26% |
| 先進国大型株式 | 17% |
| 新興国大型株式 | 12% |
| 先進国・新興国小型株式 | 3% |
| 債券 | 19% |
| 国内債券 | 10% |
| 先進国債券 | 7% |
| 新興国債券 | 2% |
| ヘッジファンド | 3% |
| コモディティ | 4% |
| リート | 4% |
| 現金等 | 1% |



《組入上位10銘柄》

| 順位 | 投資信託証券の名称 | 比率 | 投資対象資産 | 通貨 |
|----|----------------------------------|-------|---------|-----|
| 1 | MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定) | 25.7% | 国内債券 | 円 |
| 2 | MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定) | 17.2% | 先進国債券 | 円 |
| 3 | Abrdnフィジカル・ゴールド・シェアーズ ETF ★ | 14.9% | コモディティ | 米ドル |
| 4 | iシェアーズ・コア TOPIX ETF | 11.6% | 国内株式 | 円 |
| 5 | バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF | 10.5% | 新興国債券 | 米ドル |
| 6 | インベスコ・ブルームバーグ・コモディティ UCITS ETF ★ | 3.9% | コモディティ | 米ドル |
| 7 | シュワブU.S.リートETF | 3.8% | リート | 米ドル |
| 8 | NYLI ヘッジ・マルチストラテジー・トラッカーETF * | 2.9% | ヘッジファンド | 米ドル |
| 9 | シュワブU.S.ラージキャップETF | 2.2% | 先進国大型株式 | 米ドル |
| 10 | バンガード・スモールキャップETF | 1.2% | 先進国小型株式 | 米ドル |

※NYLI ヘッジ・マルチストラテジー・トラッカーETFは、2024年8月28日付で、IQ ヘッジ マルチストラテジー トラッカーETFより名称変更されました。

★ヘッジファンドとコモディティを投資対象としているETFに対し、為替ヘッジを高位に行います。

※各比率の合計が四捨五入の関係で一致しないことがあります。

※基準日(2024年9月30日時点)の状況です。直近の基本投資割合及び投資対象ファンドはそれぞれP4、P5に記載しています。

《為替変動の影響を受ける割合》 21.4%

※比率は純資産総額に対する割合です。外貨建て資産のうち、為替変動の影響を受ける割合を示しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドの年間収益率は、分配金再投資基準価額の騰落率です。 ※本ファンドにはベンチマークはありません。

※2024年は年初から9月末までの騰落率です。

最新の運用実績は、委託会社のホームページまたは販売会社でご確認いただけます。

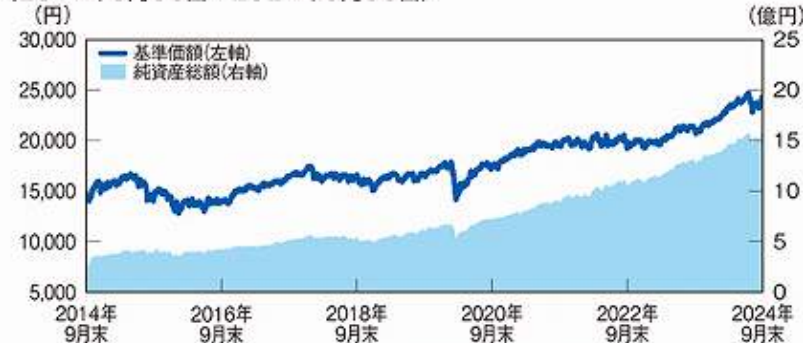
※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

運用実績 〈セレブライフ・ストーリー2055〉

基準価額・純資産の推移

(基準日:2024年9月30日)

(2014年9月30日～2024年9月30日)



※基準価額及び分配金再投資基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しています。

| | |
|--------------|---------|
| 基準価額(1万口当たり) | 24,071円 |
| 純資産総額 | 15.88億円 |

分配の推移(1万口当たり、税引前)

| 決算期 | 金額 |
|------------------|----|
| 第9期(2020年9月14日) | 0円 |
| 第10期(2021年9月14日) | 0円 |
| 第11期(2022年9月14日) | 0円 |
| 第12期(2023年9月14日) | 0円 |
| 第13期(2024年9月17日) | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

主要な資産の状況

※比率は本ファンドの純資産総額に対する比率です。

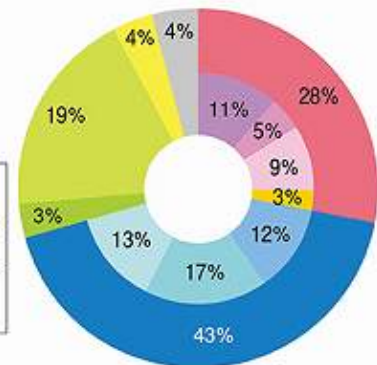
※比率は表示単位未満を四捨五入しているため、合計が100%にならない場合があります。

〈構成比率〉

| | |
|-----------|--------|
| 投資信託証券 | 96.0% |
| 為替ヘッジ評価損益 | -0.3% |
| 現金等 | 4.3% |
| 合計 | 100.0% |

〈資産別投資比率〉

| | | | |
|---------|--------|---------|---------|
| 株式 | 国内株式 | 新興国大型株式 | 新興国小型株式 |
| 債券 | 国内債券 | 先進国債券 | 新興国債券 |
| ヘッジファンド | コモディティ | リート | 現金等 |



〈組入上位10銘柄〉

| 順位 | 投資信託証券の名称 | 比率 | 投資対象資産 | 通貨 |
|----|----------------------------------|-------|---------|-----|
| 1 | MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定) | 17.0% | 先進国債券 | 円 |
| 2 | Abrdnフィジカル・ゴールド・シェアーズ ETF ★ | 14.7% | コモディティ | 米ドル |
| 3 | バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF | 13.2% | 新興国債券 | 米ドル |
| 4 | MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定) | 12.3% | 国内債券 | 円 |
| 5 | iシェアーズ・コア TOPIX ETF | 11.5% | 国内株式 | 円 |
| 6 | SPDR ポートフォリオ 新興国株式 ETF | 9.1% | 新興国大型株式 | 米ドル |
| 7 | インベスコ・ブルームバーグ・コモディティ UCITS ETF ★ | 3.9% | コモディティ | 米ドル |
| 8 | シュワブU.S.リートETF | 3.7% | リート | 米ドル |
| 9 | シュワブU.S.ラージキャップETF | 3.6% | 先進国大型株式 | 米ドル |
| 10 | NYLI ヘッジ・マルチストラテジー・トラッカーETF * | 2.8% | ヘッジファンド | 米ドル |

※NYLI ヘッジ・マルチストラテジー・トラッカーETFは、2024年8月28日付で、IQ ヘッジ マルチストラテジー トラッカーETFより名称変更されました。

★ヘッジファンドとコモディティを投資対象としているETFに対し、為替ヘッジを高位に行います。

※各比率の合計が四捨五入の関係で一致しないことがあります。

※基準日(2024年9月30日時点)の状況です。直近の基本投資割合及び投資対象ファンドはそれぞれP4、P5に記載しています。

〈為替変動の影響を受ける割合〉 35.0%

※比率は純資産総額に対する割合です。外貨建て資産のうち、為替変動の影響を受ける割合を示しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドの年間収益率は、分配金再投資基準価額の騰落率です。 ※本ファンドにはベンチマークはありません。

※2024年は年初から9月末までの騰落率です。

最新の運用実績は、委託会社のホームページまたは販売会社でご確認いただけます。

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

(参考情報)ファンドの総経費率

直近の運用報告書の作成対象期間は2023年9月15日～2024年9月17日です。

<セレブライフ・ストーリー2025>

| 総経費率(①+②) | ①運用管理費用の比率 | ②その他費用の比率 |
|-----------|------------|-----------|
| 0.73% | 0.48% | 0.25% |

<セレブライフ・ストーリー2035>

| 総経費率(①+②) | ①運用管理費用の比率 | ②その他費用の比率 |
|-----------|------------|-----------|
| 0.69% | 0.48% | 0.21% |

<セレブライフ・ストーリー2045>

| 総経費率(①+②) | ①運用管理費用の比率 | ②その他費用の比率 |
|-----------|------------|-----------|
| 0.70% | 0.48% | 0.22% |

<セレブライフ・ストーリー2055>

| 総経費率(①+②) | ①運用管理費用の比率 | ②その他費用の比率 |
|-----------|------------|-----------|
| 0.72% | 0.48% | 0.24% |

※対象期間中の運用・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値（年率）です。

※その他費用には、投資先ファンド（ファンドが組入れている投資信託証券）にかかる費用が含まれています。

※投資先ファンドの費用は、各月末の投資先ファンドの保有比率に当該投資先ファンドの運用管理費用の比率を乗じて算出した概算値です。なお、投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除いています。

※各比率は、年率換算した値です。なお、四捨五入の関係により、合計が一致しない場合があります。

※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。

※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。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

()お申込日

毎営業日お申込いただけます。

原則として、営業日の午後3時までには販売会社が受付けた分を当日のお申込みとします。

上記時間を過ぎての受付は、翌営業日の取扱いとなります。

ただし、各ファンドとも取得申込日当日がニューヨーク証券取引所、ニューヨークの商業銀行のいずれかの休業日にあたる場合には、受付を行いません。詳しくは販売会社へお問い合わせください。なお、下記照会先においてもご確認いただけます。

委託会社における照会先：

| |
|---|
| SBIアセットマネジメント株式会社（委託会社） 電話番号 03 - 6229 - 0097（受付時間：毎営業日の午前9時～午後5時） ホームページ https://www.sbi-am.co.jp/ |
|---|

()お申込単位

お申込単位は、各販売会社が定めるものとします。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。なお、上記()に記載の照会先においてもご確認いただけます。

()お申込価額

取得申込受付日の翌営業日に算出される基準価額とします。

()お申込手数料

通常のお申込み

お申込金額の3.3%（税抜3.0%）を上限とする販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

お申込手数料は、販売会社によって異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。

なお、上記()の照会先においてもご確認いただけます。

(注)申込手数料とは、購入時の商品説明、情報提供及び事務手続き等にかかる対価のことをいいます。

確定拠出年金制度に基づくお申込み

申込手数料はかかりません。

本ファンドの受益権は、振替制度の適用を受けており、取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

上記にかかわらず、委託会社は、取得申込者の取得申込総額が多額な場合、投資信託財産の効率的な運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合、または金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。)等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取消することができます。

なお、取得申込みの受付が中止または取消された場合には、受益者は当該受付中止または取消し以前に行った当日の取得申込みを撤回できます。ただし、受益者がその取得申込みを撤回しない場合には、当該受益権の取得の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に取得申込みを受付けたものとし、上記の規定に準じて算出した価額とします。

2【換金(解約)手続等】

a. 換金の受付

毎営業日お申込みいただけます。

原則として営業日の午後3時までに販売会社が受付けた分を当日のお申込みとします。

上記時間を過ぎての受付は、翌営業日のお取扱いとなります。

ただし、各ファンド取得申込日当日がニューヨーク証券取引所、ニューヨークの商業銀行のいずれかの休業日にあたる場合には、受付を行いません。詳しくは販売会社へお問い合わせください。なお、下記照会先においてもご確認ください。

委託会社における照会先：

| |
|---|
| SBIアセットマネジメント株式会社(委託会社) 電話番号 03-6229-0097(受付時間:毎営業日の午前9時~午後5時) ホームページ https://www.sbi-am.co.jp/ |
|---|

b. 換金単位

最低単位を1円単位または1口単位として、販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

換金単位は販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。

なお、上記に記載の照会先においてもご確認ください。

c. 換金価額

解約請求受付日の翌営業日に算出される基準価額から信託財産留保額(基準価額に対し0.3%)を控除した価額となります。

(注)信託財産留保額とは、換金に伴う有価証券の売買委託手数料等の費用のことをいいます。

換金手数料はありません。基準価額については、上記a.の照会先においてもご確認ください。

d. 換金代金のお支払い

原則として、換金代金は、受益者の一部解約の実行の請求を受付けた日から起算して7営業日目以降にお支払いします。

e. その他

信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口解約または換金の請求金額が多額となる場合には制限を設ける場合があります。

上記にかかわらず、委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること及びすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付を取消することができます。

なお、一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者が当該一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の解約請求受付期間に一部解約の実行の請求を受付けたものとし、上記の規定に準じて計算された価額とします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

() 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口当たりで表示されます。

() 主な投資対象資産の評価方法

| | |
|--------------------|---|
| 投資信託または外国投資信託の受益証券 | 原則として、投資信託証券の基準価額計算時に知り得る直近の日の基準価額で評価します。 |
| 外貨建資産 | 原則として、基準価額計算日の対顧客電信売買相場の仲値で円換算を行います。 |
| 為替予約取引 | 原則として、基準価額計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価します。 |

() 基準価額の算出頻度・照会方法等

本ファンドの基準価額は毎営業日算出されます。最新の基準価額（1万口当たり）は最寄りの取扱販売会社にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします。また、日本経済新聞にも原則として計算日の翌日付の朝刊に基準価額（1万口当たり）が掲載されています。なお、下記照会先においてもご確認いただけます。

委託会社における照会先：

| |
|--|
| <p>SBIアセットマネジメント株式会社（委託会社） 電話番号 03 - 6229 - 0097（受付時間：毎営業日の午前9時～午後5時） ホームページ https://www.sbi-am.co.jp/</p> |
|--|

(2)【保管】

本ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3)【信託期間】

本ファンドの信託期間は2012年1月23日から開始し、原則として無期限です。

ただし、後記の「（5）その他」の規定等によりファンドを償還させることがあります。

(4)【計算期間】

この信託の計算期間は、毎年9月15日から翌年9月14日までとすることを原則とします。各計算期間終了日に該当する日が休業日のとき、各計算期間終了日は翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

() 信託の終了

委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が3億口を下回ることとなった場合、またはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、もしくはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

委託会社は、前記の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

前記の書面決議において、受益者（委託会社及びこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

前記の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行います。

前記からまでの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記からまでに規定する手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

() その他の事由による信託の終了

委託会社は、監督官庁より、この信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは委託会社は、この信託契約を解約し信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「() 約款変更」の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

() 約款変更

委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合し

ようとする旨及びその内容を監督官庁に届出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

委託会社は、前記の事項(前記の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前項の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

前記の書面決議において、受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

前記の書面決議は議決権が行使できる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

前記からまでの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

前記からの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる1つまたは複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

() 公告

委託会社が受益者に対して行う公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

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

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日刊工業新聞に掲載します。

() 反対受益者の受益権買取請求の不適用

本ファンドは、受益者が信託約款第38条の規定による一部解約請求を行ったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第39条に規定する信託契約の解約または第44条に規定する重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

() 運用報告書の作成

ファンドは、毎計算期末(毎年9月14日。ただし、当該日が休業日の場合は翌営業日。)及び信託終了時に期中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて知れている受益者に交付します。運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページに掲載します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、これを交付します。

() 関係法人との契約の更改

募集・販売契約

委託会社と販売会社との間の募集・販売契約は、当事者の別段の意思表示のない限り、1年ごとに自動的に更新されます。募集・販売契約は、当事者間の合意により変更することができます。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

()収益分配金・償還金の請求権

受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を所有する受益権の口数に応じて委託会社に請求する権利を有します。収益分配金の請求権は支払開始日から5年間、償還金の請求権は支払開始日から10年間その支払いを請求しないときはその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(注)本ファンドの受益権は、振替制度の適用を受けており、その場合の分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に、原則として決算日から起算して5営業日目までに支払いを開始します。

()換金請求権

受益者は、保有する受益権について販売会社に換金を請求する権利を有します。

()帳簿閲覧権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に本ファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧・謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

- 1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- 2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間(2023年9月15日から2024年9月17日まで)の財務諸表について、監査法人ナカチによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【セレクトライフ・ストーリー2025】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第12期 2023年 9月14日現在 | 第13期 2024年 9月17日現在 |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 282,438 | 267,898 |
| コール・ローン | 73,360,189 | 85,447,274 |
| 投資信託受益証券 | 1,765,481,208 | 1,822,321,515 |
| 派生商品評価勘定 | - | 13,186,694 |
| 未収配当金 | 770,000 | 1,093,486 |
| 未収利息 | - | 257 |
| 流動資産合計 | 1,839,893,835 | 1,922,317,124 |
| 資産合計 | 1,839,893,835 | 1,922,317,124 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 3,667,733 | - |
| 未払金 | 408,128 | - |
| 未払解約金 | 6,941,040 | 2,610,116 |
| 未払受託者報酬 | 401,359 | 417,409 |
| 未払委託者報酬 | 4,013,558 | 4,173,941 |
| 未払利息 | 200 | - |
| その他未払費用 | 330,000 | 436,425 |
| 流動負債合計 | 15,762,018 | 7,637,891 |
| 負債合計 | 15,762,018 | 7,637,891 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,249,436,710 | 1,265,339,012 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 574,695,107 | 649,340,221 |
| (分配準備積立金) | 114,624,296 | 139,765,789 |
| 元本等合計 | 1,824,131,817 | 1,914,679,233 |
| 純資産合計 | 1,824,131,817 | 1,914,679,233 |
| 負債純資産合計 | 1,839,893,835 | 1,922,317,124 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第12期 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | 第13期 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 7,165,748 | 8,286,236 |
| 受取利息 | 34,463 | 47,525 |
| 有価証券売買等損益 | 20,050,902 | 87,708,811 |
| 為替差損益 | 15,588,574 | 20,841,857 |
| その他収益 | 8 | 7,573 |
| 営業収益合計 | 11,662,547 | 75,208,288 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 76,380 | 43,017 |
| 受託者報酬 | 779,307 | 821,146 |
| 委託者報酬 | 7,792,962 | 8,211,285 |
| その他費用 | 877,418 | 966,269 |
| 営業費用合計 | 9,526,067 | 10,041,717 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 2,136,480 | 65,166,571 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 2,136,480 | 65,166,571 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 2,136,480 | 65,166,571 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） | 1,793,815 | 6,848,246 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 549,990,036 | 574,695,107 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 94,791,736 | 132,191,214 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 94,791,736 | 132,191,214 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 74,016,960 | 115,864,425 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 74,016,960 | 115,864,425 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | - |
| 分配金 | - | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 574,695,107 | 649,340,221 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|-------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、計算期間の前営業日の基準価額で評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 外国為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算期間において予約為替の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。 |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 4. 収益及び費用の計上基準 | 受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。 |
| 5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | 外貨建資産等の会計処理 外貨建資産等については、計算期間の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に従って換算しております。 ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は原則として、毎年9月15日から翌年9月14日までとしておりますが、当計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2023年9月15日から2024年9月17日までとなっております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第12期 2023年 9月14日現在 | 第13期 2024年 9月17日現在 |
|-------------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 1. 当該計算期間の末日における受益権の総数 | 1,249,436,710口 | 1,265,339,012口 |
| 2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 | - | - |
| 3. 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) | 1.4600円 (14,600円) | 1.5132円 (15,132円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第12期 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | | | 第13期 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 | | |
|--|-----------|----------------|--|-----------|----------------|
| 1. 分配金の計算過程 | | | 1. 分配金の計算過程 | | |
| 項目 | | | 項目 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 2,090,400円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 6,925,633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 | B | 0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 | B | 38,610,257円 |
| 収益調整金額 | C | 460,070,811円 | 収益調整金額 | C | 509,574,432円 |
| 分配準備積立金額 | D | 112,533,896円 | 分配準備積立金額 | D | 94,229,899円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 574,695,107円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 649,340,221円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 1,249,436,710口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 1,265,339,012口 |

| | | |
|-------------------|-----------------------|--------|
| 10,000口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 4,599円 |
| 10,000口当たり分配金額 | H | 0円 |
| 収益分配金金額 | $I=F \times H/10,000$ | 0円 |

| | | |
|-------------------|-----------------------|--------|
| 10,000口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 5,131円 |
| 10,000口当たり分配金額 | H | 0円 |
| 収益分配金金額 | $I=F \times H/10,000$ | 0円 |

2. 追加情報

2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

-

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第12期 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | 第13期 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 |
|------------------------|--|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券及びデリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク、為替変動リスク、カントリーリスク等にさらされております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左 |
| 3. 金融商品に係るリスクの管理体制 | 常勤取締役、最高運用責任者、リスク管理部長、商品企画部長、マーケティング部長、運用部長及び運用部マネジャーをもって構成するリスク管理委員会にて、ファンドのリスク特性分析、パフォーマンスの要因分析の報告及び監視を行い、運用者の意思決定方向を調整・相互確認しております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 | 同左 市場リスクの管理 同左 信用リスクの管理 同左 |

| | |
|---|-----------------|
| 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて 市場流動性の状況を把握し、取引量や組 入比率等の管理を行っております。 | 流動性リスクの管理 同左 |
|---|-----------------|

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第12期 | 第13期 |
|---------------------------|---|---|
| | 2023年 9月14日現在 | 2024年 9月17日現在 |
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2.時価の算定方法 | 投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品は、短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | 投資信託受益証券 同左 デリバティブ取引 同左 上記以外の金融商品 同左 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引の契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 | 同左 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 第12期 | 第13期 |
|----------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 |
| | 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円) | 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円) |
| 投資信託受益証券 | 16,441,008 | 73,468,488 |
| 合計 | 16,441,008 | 73,468,488 |

(デリバティブ取引等に関する注記)

(通貨関連)

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 第12期 | | | | 第13期 | | | |
|-----------|--------|---------------|---|-------------|-----------|---------------|---|-------------|------------|
| | | 2023年 9月14日現在 | | | | 2024年 9月17日現在 | | | |
| | | 契約額等(円) | | 時価 | 評価損益 | 契約額等(円) | | 時価 | 評価損益 |
| | | うち1年超 | | | | | | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | | | | | |
| | 売建 | 306,353,909 | 0 | 310,021,642 | 3,667,733 | 329,688,560 | 0 | 316,501,866 | 13,186,694 |
| | アメリカドル | 306,353,909 | 0 | 310,021,642 | 3,667,733 | 329,688,560 | 0 | 316,501,866 | 13,186,694 |
| | 合計 | 306,353,909 | 0 | 310,021,642 | 3,667,733 | 329,688,560 | 0 | 316,501,866 | 13,186,694 |

(注)時価の算定方法

・為替予約取引

- 1) 計算期間に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。
計算期間において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間において当該日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・計算期間に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち、当該日に最も近い前後の日の対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・計算期間に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2) 計算期間に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（元本の移動）

| 項目 | 第12期 | 第13期 |
|----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 |
| 投資信託財産に係る元本の状況 | | |
| 期首元本額 | 1,199,469,131円 | 1,249,436,710円 |
| 期中追加設定元本額 | 213,283,284円 | 268,642,452円 |
| 期中一部解約元本額 | 163,315,705円 | 252,740,150円 |

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----------|--------|---|---------------|-------------------------------|----|
| 投資信託受益証券 | 日本円 | ISHARES CORE TOPIX ETF | 337,170 | 88,136,238 | |
| | | MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 116,717,217 | 196,260,000 | |
| | | MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 898,557,591 | 1,046,819,593 | |
| 日本円合計 | | | 1,015,611,978 | 1,331,215,831 | |
| 投資信託受益証券 | アメリカドル | ABRDN PHYSICAL GOLD SHARES ETF | 52,783 | 1,301,628.78 | |
| | | INVESCO BLOOMBERG COMMODITY | 28,783 | 640,997.41 | |
| | | NYLI HDG MLT-STR TRC ETF-USD | 12,000 | 379,800.00 | |
| | | SCHWAB US LARGE-CAP ETF | 4,289 | 285,475.84 | |
| | | SCHWAB US REIT ETF | 16,664 | 392,103.92 | |
| | | SPDR PORTFOLIO S&P EMERGING MARKETS ETF | 3,329 | 128,000.05 | |
| | | VANGUARD EMERGING MARKETS GOVERNMENT BOND ETF | 1,988 | 132,003.20 | |
| | | VANGUARD FTSE ALL WORLD EX-US SMALL-CAP ETF | 415 | 51,003.50 | |
| | | VANGUARD FTSE DEVELOPED ASIA PACIFIC EX JAPAN UCITS ETF | 511 | 13,334.54 | |
| | | VANGUARD FTSE EUROPE ETF | 1,212 | 85,155.12 | |
| | | VANGUARD SMALL-CAP ETF | 341 | 79,207.48 | |
| アメリカドル合計 | | | 122,315 | 3,488,709.84 (491,105,684) | |

| | | | |
|----|--|--------------------------------|--|
| 合計 | | 1,822,321,515 (491,105,684) | |
|----|--|--------------------------------|--|

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|--------|------------------|--------|------------|
| アメリカドル | 投資信託受益証券 11銘柄 | 25.6% | 26.9% |

(注)「組入時価比率」とは、純資産総額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

第4 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

【セレクトライフ・ストーリー2035】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第12期 2023年 9月14日現在 | 第13期 2024年 9月17日現在 |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 738,255 | 434,337 |
| コール・ローン | 96,927,045 | 122,172,757 |
| 投資信託受益証券 | 3,274,135,544 | 3,732,397,458 |
| 派生商品評価勘定 | - | 33,453,879 |
| 未収配当金 | 3,150,700 | 3,612,282 |
| 未収利息 | - | 368 |
| 流動資産合計 | 3,374,951,544 | 3,892,071,081 |
| 資産合計 | 3,374,951,544 | 3,892,071,081 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 8,306,892 | - |
| 未払金 | 650,799 | - |
| 未払解約金 | 5,788,631 | 940,758 |
| 未払受託者報酬 | 715,977 | 847,340 |
| 未払委託者報酬 | 7,159,671 | 8,473,377 |
| 未払利息 | 265 | - |
| その他未払費用 | 330,000 | 436,425 |
| 流動負債合計 | 22,952,235 | 10,697,900 |
| 負債合計 | 22,952,235 | 10,697,900 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 2,032,790,238 | 2,242,792,653 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 1,319,209,071 | 1,638,580,528 |
| (分配準備積立金) | 325,503,219 | 450,998,867 |
| 元本等合計 | 3,351,999,309 | 3,881,373,181 |
| 純資産合計 | 3,351,999,309 | 3,881,373,181 |
| 負債純資産合計 | 3,374,951,544 | 3,892,071,081 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第12期 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | 第13期 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 20,571,098 | 19,416,111 |
| 受取利息 | 54,749 | 81,894 |
| 有価証券売買等損益 | 97,546,433 | 221,373,705 |
| 為替差損益 | 41,866,653 | 51,056,718 |
| その他収益 | 150 | 7,573 |
| 営業収益合計 | 76,305,777 | 189,822,565 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 107,721 | 64,449 |
| 受託者報酬 | 1,362,862 | 1,607,479 |
| 委託者報酬 | 13,628,450 | 16,074,672 |
| その他費用 | 971,160 | 1,083,238 |
| 営業費用合計 | 16,070,193 | 18,829,838 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 60,235,584 | 170,992,727 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 60,235,584 | 170,992,727 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 60,235,584 | 170,992,727 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） | 1,165,632 | 10,419,907 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 1,124,909,881 | 1,319,209,071 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 231,329,788 | 320,006,683 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 231,329,788 | 320,006,683 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 98,431,814 | 161,208,046 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 98,431,814 | 161,208,046 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | - |
| 分配金 | - | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 1,319,209,071 | 1,638,580,528 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|-------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、計算期間の前営業日の基準価額で評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 外国為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算期間において予約為替の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。 |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 4. 収益及び費用の計上基準 | 受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。 |
| 5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | 外貨建資産等の会計処理 外貨建資産等については、計算期間の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に従って換算しております。 ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は原則として、毎年9月15日から翌年9月14日までとしておりますが、当計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2023年9月15日から2024年9月17日までとなっております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第12期 2023年 9月14日現在 | 第13期 2024年 9月17日現在 |
|-------------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 1. 当該計算期間の末日における受益権の総数 | 2,032,790,238口 | 2,242,792,653口 |
| 2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 | - | - |
| 3. 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) | 1.6490円 (16,490円) | 1.7306円 (17,306円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第12期 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | | | 第13期 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 | | |
|--|-----------|----------------|--|-----------|----------------|
| 1. 分配金の計算過程 | | | 1. 分配金の計算過程 | | |
| 項目 | | | 項目 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 16,147,376円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 17,141,539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 | B | 37,571,631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 | B | 143,431,281円 |
| 収益調整金額 | C | 993,705,852円 | 収益調整金額 | C | 1,187,581,661円 |
| 分配準備積立金額 | D | 271,784,212円 | 分配準備積立金額 | D | 290,426,047円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 1,319,209,071円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 1,638,580,528円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 2,032,790,238口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 2,242,792,653口 |

| | | |
|-------------------|-----------------------|--------|
| 10,000口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 6,489円 |
| 10,000口当たり分配金額 | H | 0円 |
| 収益分配金額 | $I=F \times H/10,000$ | 0円 |

| | | |
|-------------------|-----------------------|--------|
| 10,000口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 7,305円 |
| 10,000口当たり分配金額 | H | 0円 |
| 収益分配金額 | $I=F \times H/10,000$ | 0円 |

2. 追加情報

2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

-

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第12期 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | 第13期 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 |
|------------------------|--|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券及びデリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク、為替変動リスク、カントリーリスク等にさらされております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左 |
| 3. 金融商品に係るリスクの管理体制 | 常勤取締役、最高運用責任者、リスク管理部長、商品企画部長、マーケティング部長、運用部長及び運用部マネジャーをもって構成するリスク管理委員会にて、ファンドのリスク特性分析、パフォーマンスの要因分析の報告及び監視を行い、運用者の意思決定方向を調整・相互確認しております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 | 同左 市場リスクの管理 同左 信用リスクの管理 同左 |

| | |
|---|-----------------|
| 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて 市場流動性の状況を把握し、取引量や組 入比率等の管理を行っております。 | 流動性リスクの管理 同左 |
|---|-----------------|

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第12期 | 第13期 |
|----------------------------|---|---|
| | 2023年 9月14日現在 | 2024年 9月17日現在 |
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | 投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品は、短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | 投資信託受益証券 同左 デリバティブ取引 同左 上記以外の金融商品 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引の契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 | 同左 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 第12期 | 第13期 |
|----------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 |
| | 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円) | 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円) |
| 投資信託受益証券 | 87,451,135 | 192,557,119 |
| 合計 | 87,451,135 | 192,557,119 |

(デリバティブ取引等に関する注記)

(通貨関連)

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 第12期 | | | | 第13期 | | | |
|-----------|--------|---------------|---|-------------|-----------|---------------|---|-------------|------------|
| | | 2023年 9月14日現在 | | | | 2024年 9月17日現在 | | | |
| | | 契約額等(円) | | 時価 | 評価損益 | 契約額等(円) | | 時価 | 評価損益 |
| | | うち1年超 | | | | | | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | | | | | |
| | 売建 | 693,847,880 | 0 | 702,154,772 | 8,306,892 | 829,369,124 | 0 | 795,915,245 | 33,453,879 |
| | アメリカドル | 693,847,880 | 0 | 702,154,772 | 8,306,892 | 829,369,124 | 0 | 795,915,245 | 33,453,879 |
| | 合計 | 693,847,880 | 0 | 702,154,772 | 8,306,892 | 829,369,124 | 0 | 795,915,245 | 33,453,879 |

(注) 時価の算定方法

・為替予約取引

1) 計算期間に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算期間において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間において当該日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・計算期間に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち、当該日に最も近い前後の日の対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・計算期間に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算期間に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（元本の移動）

| 項目 | 第12期 | 第13期 |
|----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 |
| 投資信託財産に係る元本の状況 | | |
| 期首元本額 | 1,816,082,427円 | 2,032,790,238円 |
| 期中追加設定元本額 | 377,082,251円 | 459,012,065円 |
| 期中一部解約元本額 | 160,374,440円 | 249,009,650円 |

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----------|--------|---|---------------|---------------------------------|----|
| 投資信託受益証券 | 日本円 | ISHARES CORE TOPIX ETF | 1,114,030 | 291,207,442 | |
| | | MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 348,064,559 | 585,270,555 | |
| | | MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 1,457,074,853 | 1,697,492,203 | |
| 日本円合計 | | | 1,806,253,442 | 2,573,970,200 | |
| 投資信託受益証券 | アメリカドル | ABRDN PHYSICAL GOLD SHARES ETF | 140,995 | 3,476,936.70 | |
| | | INVESCO BLOOMBERG COMMODITY | 70,986 | 1,580,858.22 | |
| | | NYLI HDG MLT-STR TRC ETF-USD | 24,833 | 785,964.45 | |
| | | SCHWAB US LARGE-CAP ETF | 8,830 | 587,724.80 | |
| | | SCHWAB US REIT ETF | 34,245 | 805,784.85 | |
| | | SPDR PORTFOLIO S&P EMERGING MARKETS ETF | 6,813 | 261,959.85 | |
| | | VANGUARD EMERGING MARKETS GOVERNMENT BOND ETF | 4,038 | 268,123.20 | |
| | | VANGUARD FTSE ALL WORLD EX-US SMALL-CAP ETF | 824 | 101,269.60 | |
| | | VANGUARD FTSE DEVELOPED ASIA PACIFIC EX JAPAN UCITS ETF | 907 | 23,668.16 | |
| | | VANGUARD FTSE EUROPE ETF | 2,554 | 179,444.04 | |
| | | VANGUARD SMALL-CAP ETF | 678 | 157,485.84 | |
| アメリカドル合計 | | | 295,703 | 8,229,219.71 (1,158,427,258) | |

| | | | |
|----|--|----------------------------------|--|
| 合計 | | 3,732,397,458 (1,158,427,258) | |
|----|--|----------------------------------|--|

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|--------|------------------|--------|------------|
| アメリカドル | 投資信託受益証券 11銘柄 | 29.8% | 31.0% |

(注)「組入時価比率」とは、純資産総額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

第4 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

【セレクトライフ・ストーリー2045】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第12期 2023年 9月14日現在 | 第13期 2024年 9月17日現在 |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 1,289,166 | 1,397,010 |
| コール・ローン | 55,730,359 | 86,604,485 |
| 投資信託受益証券 | 2,212,346,628 | 2,524,738,409 |
| 派生商品評価勘定 | - | 22,935,645 |
| 未収配当金 | 2,810,750 | 3,687,010 |
| 未収利息 | - | 260 |
| 流動資産合計 | 2,272,176,903 | 2,639,362,819 |
| 資産合計 | 2,272,176,903 | 2,639,362,819 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 5,610,584 | - |
| 未払金 | 341,945 | - |
| 未払解約金 | 3,776,129 | 489,547 |
| 未払受託者報酬 | 475,786 | 577,229 |
| 未払委託者報酬 | 4,757,842 | 5,772,261 |
| 未払利息 | 152 | - |
| その他未払費用 | 330,000 | 436,425 |
| 流動負債合計 | 15,292,438 | 7,275,462 |
| 負債合計 | 15,292,438 | 7,275,462 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,213,155,867 | 1,314,928,779 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 1,043,728,598 | 1,317,158,578 |
| (分配準備積立金) | 315,011,372 | 444,336,368 |
| 元本等合計 | 2,256,884,465 | 2,632,087,357 |
| 純資産合計 | 2,256,884,465 | 2,632,087,357 |
| 負債純資産合計 | 2,272,176,903 | 2,639,362,819 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第12期 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | 第13期 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 24,880,688 | 28,171,578 |
| 受取利息 | 72,561 | 117,834 |
| 有価証券売買等損益 | 89,301,210 | 203,871,596 |
| 為替差損益 | 22,716,064 | 45,563,541 |
| その他収益 | 125 | - |
| 営業収益合計 | 91,538,520 | 186,597,467 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 72,606 | 40,442 |
| 受託者報酬 | 896,758 | 1,086,352 |
| 委託者報酬 | 8,967,523 | 10,863,438 |
| その他費用 | 974,119 | 1,056,195 |
| 営業費用合計 | 10,911,006 | 13,046,427 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 80,627,514 | 173,551,040 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 80,627,514 | 173,551,040 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 80,627,514 | 173,551,040 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） | 580,567 | 10,429,839 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 843,647,680 | 1,043,728,598 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 191,574,467 | 234,441,715 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 191,574,467 | 234,441,715 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 72,701,630 | 124,132,936 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 72,701,630 | 124,132,936 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | - |
| 分配金 | - | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 1,043,728,598 | 1,317,158,578 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|-------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、計算期間の前営業日の基準価額で評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 外国為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算期間において予約為替の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。 |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 4. 収益及び費用の計上基準 | 受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。 |
| 5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | 外貨建資産等の会計処理 外貨建資産等については、計算期間の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に従って換算しております。 ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は原則として、毎年9月15日から翌年9月14日までとしておりますが、当計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2023年9月15日から2024年9月17日までとなっております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第12期 2023年 9月14日現在 | 第13期 2024年 9月17日現在 |
|-------------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 1. 当該計算期間の末日における受益権の総数 | 1,213,155,867口 | 1,314,928,779口 |
| 2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 | - | - |
| 3. 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) | 1.8603円 (18,603円) | 2.0017円 (20,017円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第12期 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | | | 第13期 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 | | |
|--|-----------|----------------|--|-----------|----------------|
| 1. 分配金の計算過程 | | | 1. 分配金の計算過程 | | |
| 項目 | | | 項目 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 21,507,979円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 25,281,969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 | B | 59,700,102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 | B | 137,839,232円 |
| 収益調整金額 | C | 728,717,226円 | 収益調整金額 | C | 872,822,210円 |
| 分配準備積立金額 | D | 233,803,291円 | 分配準備積立金額 | D | 281,215,167円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 1,043,728,598円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 1,317,158,578円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 1,213,155,867口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 1,314,928,779口 |

| | | |
|-------------------|-----------------------|--------|
| 10,000口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 8,603円 |
| 10,000口当たり分配金額 | H | 0円 |
| 収益分配金額 | $I=F \times H/10,000$ | 0円 |

| | | |
|-------------------|-----------------------|---------|
| 10,000口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 10,016円 |
| 10,000口当たり分配金額 | H | 0円 |
| 収益分配金額 | $I=F \times H/10,000$ | 0円 |

2. 追加情報

2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

-

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第12期 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | 第13期 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 |
|------------------------|--|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券及びデリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク、為替変動リスク、カントリーリスク等にさらされております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左 |
| 3. 金融商品に係るリスクの管理体制 | 常勤取締役、最高運用責任者、リスク管理部長、商品企画部長、マーケティング部長、運用部長及び運用部マネジャーをもって構成するリスク管理委員会にて、ファンドのリスク特性分析、パフォーマンスの要因分析の報告及び監視を行い、運用者の意思決定方向を調整・相互確認しております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 | 同左 市場リスクの管理 同左 信用リスクの管理 同左 |

| | |
|---|-----------------|
| 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて 市場流動性の状況を把握し、取引量や組 入比率等の管理を行っております。 | 流動性リスクの管理 同左 |
|---|-----------------|

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第12期 | 第13期 |
|---------------------------|---|---|
| | 2023年 9月14日現在 | 2024年 9月17日現在 |
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2.時価の算定方法 | 投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品は、短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | 投資信託受益証券 同左 デリバティブ取引 同左 上記以外の金融商品 同左 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引の契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 | 同左 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 第12期 | 第13期 |
|----------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 |
| | 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円) | 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円) |
| 投資信託受益証券 | 83,077,292 | 186,599,079 |
| 合計 | 83,077,292 | 186,599,079 |

(デリバティブ取引等に関する注記)

(通貨関連)

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 第12期 | | | 第13期 | | | | |
|-----------|-------------|---------------|-------------|-------------|---------------|-------------|-------------|-------------|------------|
| | | 2023年 9月14日現在 | | | 2024年 9月17日現在 | | | | |
| | | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価 | 評価損益 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | | | | | |
| | 売建 | 468,634,033 | 0 | 474,244,617 | 5,610,584 | 562,588,719 | 0 | 539,653,074 | 22,935,645 |
| | アメリカドル | 468,634,033 | 0 | 474,244,617 | 5,610,584 | 562,588,719 | 0 | 539,653,074 | 22,935,645 |
| 合計 | 468,634,033 | 0 | 474,244,617 | 5,610,584 | 562,588,719 | 0 | 539,653,074 | 22,935,645 | |

(注)時価の算定方法

・為替予約取引

1) 計算期間に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算期間において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間において当該日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・計算期間に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち、当該日に最も近い前後の日の対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・計算期間に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算期間に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（元本の移動）

| 項目 | 第12期 | 第13期 |
|----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 |
| 投資信託財産に係る元本の状況 | | |
| 期首元本額 | 1,062,180,720円 | 1,213,155,867円 |
| 期中追加設定元本額 | 243,344,509円 | 246,142,958円 |
| 期中一部解約元本額 | 92,369,362円 | 144,370,046円 |

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----------|--------|---|-------------|---------------------------------|----|
| 投資信託受益証券 | 日本円 | ISHARES CORE TOPIX ETF | 1,134,230 | 296,487,722 | |
| | | MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 265,897,538 | 447,106,710 | |
| | | MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 593,009,945 | 690,856,585 | |
| 日本円合計 | | | 860,041,713 | 1,434,451,017 | |
| 投資信託受益証券 | アメリカドル | ABRDN PHYSICAL GOLD SHARES ETF | 110,368 | 2,721,674.88 | |
| | | INVESCO BLOOMBERG COMMODITY | 32,047 | 713,686.69 | |
| | | NYLI HDG MLT-STR TRC ETF-USD | 16,774 | 530,897.10 | |
| | | SCHWAB US LARGE-CAP ETF | 5,991 | 398,760.96 | |
| | | SCHWAB US REIT ETF | 31,007 | 729,594.71 | |
| | | SPDR PORTFOLIO S&P EMERGING MARKETS ETF | 4,524 | 173,947.80 | |
| | | VANGUARD EMERGING MARKETS GOVERNMENT BOND ETF | 29,765 | 1,976,396.00 | |
| | | VANGUARD FTSE ALL WORLD EX-US SMALL-CAP ETF | 1,153 | 141,703.70 | |
| | | VANGUARD FTSE DEVELOPED ASIA PACIFIC EX JAPAN UCITS ETF | 711 | 18,553.54 | |
| | | VANGUARD FTSE EUROPE ETF | 1,754 | 123,236.04 | |
| | | VANGUARD SMALL-CAP ETF | 933 | 216,717.24 | |
| アメリカドル合計 | | | 235,027 | 7,745,168.66 (1,090,287,392) | |

| | | | |
|----|--|----------------------------------|--|
| 合計 | | 2,524,738,409 (1,090,287,392) | |
|----|--|----------------------------------|--|

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|--------|------------------|--------|------------|
| アメリカドル | 投資信託受益証券 11銘柄 | 41.4% | 43.2% |

(注)「組入時価比率」とは、純資産総額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

第4 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

【セレクトライフ・ストーリー2055】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第12期 2023年 9月14日現在 | 第13期 2024年 9月17日現在 |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 1,045,420 | 1,041,532 |
| コール・ローン | 33,095,026 | 56,129,873 |
| 投資信託受益証券 | 1,281,173,856 | 1,475,894,710 |
| 派生商品評価勘定 | - | 13,462,881 |
| 未収配当金 | 1,483,350 | 2,179,178 |
| 未収利息 | - | 169 |
| 流動資産合計 | 1,316,797,652 | 1,548,708,343 |
| 資産合計 | 1,316,797,652 | 1,548,708,343 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 3,250,672 | - |
| 未払金 | 169,869 | - |
| 未払解約金 | 1,477,892 | 2,140,099 |
| 未払受託者報酬 | 273,121 | 338,903 |
| 未払委託者報酬 | 2,731,164 | 3,388,960 |
| 未払利息 | 90 | - |
| その他未払費用 | 330,000 | 436,425 |
| 流動負債合計 | 8,232,808 | 6,304,387 |
| 負債合計 | 8,232,808 | 6,304,387 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 612,058,561 | 659,261,366 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 696,506,283 | 883,142,590 |
| (分配準備積立金) | 205,562,257 | 288,488,903 |
| 元本等合計 | 1,308,564,844 | 1,542,403,956 |
| 純資産合計 | 1,308,564,844 | 1,542,403,956 |
| 負債純資産合計 | 1,316,797,652 | 1,548,708,343 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第12期 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | 第13期 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 19,344,325 | 21,769,526 |
| 受取利息 | 69,211 | 101,016 |
| 有価証券売買等損益 | 59,953,055 | 144,492,027 |
| 為替差損益 | 9,443,991 | 34,627,248 |
| その他収益 | 76 | 7,573 |
| 営業収益合計 | 69,922,676 | 131,742,894 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 41,204 | 22,174 |
| 受託者報酬 | 515,407 | 634,134 |
| 委託者報酬 | 5,153,945 | 6,341,202 |
| その他費用 | 918,774 | 1,039,382 |
| 営業費用合計 | 6,629,330 | 8,036,892 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 63,293,346 | 123,706,002 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 63,293,346 | 123,706,002 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 63,293,346 | 123,706,002 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） | 238,457 | 11,498,950 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 560,806,968 | 696,506,283 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 144,339,783 | 186,143,191 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 144,339,783 | 186,143,191 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 71,695,357 | 111,713,936 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 71,695,357 | 111,713,936 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | - |
| 分配金 | - | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 696,506,283 | 883,142,590 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|-------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、計算期間の前営業日の基準価額で評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 外国為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算期間において予約為替の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。 |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 4. 収益及び費用の計上基準 | 受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。 |
| 5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | 外貨建資産等の会計処理 外貨建資産等については、計算期間の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に従って換算しております。 ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は原則として、毎年9月15日から翌年9月14日までとしておりますが、当計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2023年9月15日から2024年9月17日までとなっております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第12期 2023年 9月14日現在 | 第13期 2024年 9月17日現在 |
|-------------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 1. 当該計算期間の末日における受益権の総数 | 612,058,561口 | 659,261,366口 |
| 2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 | - | - |
| 3. 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) | 2.1380円 (21,380円) | 2.3396円 (23,396円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第12期 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | | | 第13期 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 | | |
|--|-----------|--------------|--|-----------|--------------|
| 1. 分配金の計算過程 | | | 1. 分配金の計算過程 | | |
| 項目 | | | 項目 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 16,889,760円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 19,250,349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 | B | 46,165,129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 | B | 92,956,703円 |
| 収益調整金額 | C | 490,944,026円 | 収益調整金額 | C | 594,653,687円 |
| 分配準備積立金額 | D | 142,507,368円 | 分配準備積立金額 | D | 176,281,851円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 696,506,283円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 883,142,590円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 612,058,561口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 659,261,366口 |

| | | |
|-------------------|-----------------------|---------|
| 10,000口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 11,379円 |
| 10,000口当たり分配金額 | H | 0円 |
| 収益分配金金額 | $I=F \times H/10,000$ | 0円 |

| | | |
|-------------------|-----------------------|---------|
| 10,000口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 13,395円 |
| 10,000口当たり分配金額 | H | 0円 |
| 収益分配金金額 | $I=F \times H/10,000$ | 0円 |

2. 追加情報

2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

-

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第12期 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | 第13期 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 |
|------------------------|--|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券及びデリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク、為替変動リスク、カントリーリスク等にさらされております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左 |
| 3. 金融商品に係るリスクの管理体制 | 常勤取締役、最高運用責任者、リスク管理部長、商品企画部長、マーケティング部長、運用部長及び運用部マネジャーをもって構成するリスク管理委員会にて、ファンドのリスク特性分析、パフォーマンスの要因分析の報告及び監視を行い、運用者の意思決定方向を調整・相互確認しております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 | 同左 市場リスクの管理 同左 信用リスクの管理 同左 |

| | |
|---|-----------------|
| 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて 市場流動性の状況を把握し、取引量や組 入比率等の管理を行っております。 | 流動性リスクの管理 同左 |
|---|-----------------|

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第12期 | 第13期 |
|---------------------------|---|---|
| | 2023年 9月14日現在 | 2024年 9月17日現在 |
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2.時価の算定方法 | 投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品は、短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | 投資信託受益証券 同左 デリバティブ取引 同左 上記以外の金融商品 同左 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引の契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 | 同左 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 第12期 | 第13期 |
|----------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 |
| | 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円) | 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円) |
| 投資信託受益証券 | 56,754,919 | 133,962,203 |
| 合計 | 56,754,919 | 133,962,203 |

(デリバティブ取引等に関する注記)

(通貨関連)

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 第12期 | | | 第13期 | | | | |
|-----------|-------------|---------------|-------------|-------------|---------------|-------------|-------------|-------------|------------|
| | | 2023年 9月14日現在 | | | 2024年 9月17日現在 | | | | |
| | | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価 | 評価損益 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | | | | | |
| | 売建 | 271,518,158 | 0 | 274,768,830 | 3,250,672 | 329,825,626 | 0 | 316,362,745 | 13,462,881 |
| | アメリカドル | 271,518,158 | 0 | 274,768,830 | 3,250,672 | 329,825,626 | 0 | 316,362,745 | 13,462,881 |
| 合計 | 271,518,158 | 0 | 274,768,830 | 3,250,672 | 329,825,626 | 0 | 316,362,745 | 13,462,881 | |

(注)時価の算定方法

・為替予約取引

1) 計算期間に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算期間において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間において当該日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・計算期間に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち、当該日に最も近い前後の日の対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・計算期間に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算期間に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（元本の移動）

| 項目 | 第12期 | 第13期 |
|----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 自 2022年 9月15日 至 2023年 9月14日 | 自 2023年 9月15日 至 2024年 9月17日 |
| 投資信託財産に係る元本の状況 | | |
| 期首元本額 | 542,357,330円 | 612,058,561円 |
| 期中追加設定元本額 | 139,593,420円 | 145,116,786円 |
| 期中一部解約元本額 | 69,892,189円 | 97,913,981円 |

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----------|--------|---|-------------|-------------------------------|----|
| 投資信託受益証券 | 日本円 | ISHARES CORE TOPIX ETF | 664,970 | 173,823,158 | |
| | | MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 156,014,018 | 262,337,571 | |
| | | MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定） | 167,575,597 | 195,225,570 | |
| 日本円合計 | | | 324,254,585 | 631,386,299 | |
| 投資信託受益証券 | アメリカドル | ABRDN PHYSICAL GOLD SHARES ETF | 64,569 | 1,592,271.54 | |
| | | INVESCO BLOOMBERG COMMODITY | 18,924 | 421,437.48 | |
| | | NYLI HDG MLT-STR TRC ETF-USD | 9,836 | 311,309.40 | |
| | | SCHWAB US LARGE-CAP ETF | 5,866 | 390,440.96 | |
| | | SCHWAB US REIT ETF | 18,094 | 425,751.82 | |
| | | SPDR PORTFOLIO S&P EMERGING MARKETS ETF | 24,298 | 934,258.10 | |
| | | VANGUARD EMERGING MARKETS GOVERNMENT BOND ETF | 22,212 | 1,474,876.80 | |
| | | VANGUARD FTSE ALL WORLD EX-US SMALL-CAP ETF | 1,018 | 125,112.20 | |
| | | VANGUARD FTSE DEVELOPED ASIA PACIFIC EX JAPAN UCITS ETF | 580 | 15,135.10 | |
| | | VANGUARD FTSE EUROPE ETF | 1,665 | 116,982.90 | |
| | | VANGUARD SMALL-CAP ETF | 825 | 191,631.00 | |
| アメリカドル合計 | | | 167,887 | 5,999,207.30 (844,508,411) | |

| | | | |
|----|--|--------------------------------|--|
| 合計 | | 1,475,894,710 (844,508,411) | |
|----|--|--------------------------------|--|

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|--------|------------------|--------|------------|
| アメリカドル | 投資信託受益証券 11銘柄 | 54.8% | 57.2% |

(注)「組入時価比率」とは、純資産総額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

第4 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

・セレブライフ・ストーリー2025

2024年 9月30日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 2,259,069,984円 |
| 負債総額 | 322,794,624円 |
| 純資産総額(-) | 1,936,275,360円 |
| 発行済口数 | 1,264,112,773口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.5317円 |
| (1万口当たり純資産額) | (15,317円) |

・セレブライフ・ストーリー2035

2024年 9月30日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 4,747,338,301円 |
| 負債総額 | 799,738,820円 |
| 純資産総額(-) | 3,947,599,481円 |
| 発行済口数 | 2,244,400,363口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.7589円 |
| (1万口当たり純資産額) | (17,589円) |

・セレブライフ・ストーリー2045

2024年 9月30日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 3,228,594,737円 |
| 負債総額 | 541,982,209円 |
| 純資産総額(-) | 2,686,612,528円 |
| 発行済口数 | 1,315,858,210口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 2.0417円 |
| (1万口当たり純資産額) | (20,417円) |

・セレブライフ・ストーリー2055

2024年 9月30日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 1,905,604,496円 |
| 負債総額 | 317,449,057円 |
| 純資産総額(-) | 1,588,155,439円 |
| 発行済口数 | 659,788,496口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 2.4071円 |
| (1万口当たり純資産額) | (24,071円) |

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換についてその手続、取扱場所、取次所、代理人の名称及び住所並びに手数料
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡
受益権の譲渡制限は設けておりません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。前記の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

前記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(4) 受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

(5) 受益権の再分割
委託会社は受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6) 償還金
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

(7) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第二部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

資本金の額(2024年9月末日現在)

- () 資本金の額
委託会社の資本金の額は金4億20万円です。
- () 発行する株式の総数
委託会社の発行する株式の総数は146万4,000株です。
- () 発行済株式の総数
委託会社がこれまでに発行した株式の総数は1,408,348株です。
- (iv) 最近5年間ににおける主な資本金の額の増減
2022年1月31日に資本金を10億5,020万円に増資しました。
2022年3月23日に資本金を4億20万円に減資しました。
2023年4月1日に吸収合併に係る資本金4億9,500万円を引き継ぎ、
同日に同額を減資しました。

委託会社の機構

- (i) 会社の意思決定機構
経営の意思決定機関として取締役会をおきます。取締役会は、委託会社の業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務を監督します。代表取締役である社長は、委託会社を代表し、全般の業務執行について指揮統括します。取締役は、委嘱された業務の執行にあたり、また、社長に事故有るときにその職務を代行します。委託会社の一切の活動における法令遵守に関して管理監督する機関としてコンプライアンス委員会をおきます。コンプライアンス委員会は、委託会社が法律上・規制上の一切の要件と社内の方針とを遵守するという目的に関し、法律により許可されているすべての権限を行使することができます。監査役は、委託会社の会計監査及び業務監査を行います。
- () 投資運用の意思決定機構
 - ア) 市場環境分析・企業分析
ファンドマネジャー、アナリストによる市場環境、業種、個別企業などの調査・分析及び基本投資戦略の協議・策定を行います。
 - イ) 投資基本方針の策定
最高運用責任者のもとで開催される「運用会議」において、市場動向・投資行動・市場見通し・投資方針等を策定します。
 - ウ) 運用基本方針の決定
「運用会議」の策定内容を踏まえ、常勤取締役、最高運用責任者、運用部長及び運用部マネジャーをもって構成される「投資戦略委員会」において運用の基本方針が決定されます。
 - エ) 投資銘柄の策定、ポートフォリオの構築
ファンドマネジャーは、この運用の基本方針に沿って、各ファンドの運用計画書を策定し、最高運用責任者の承認後、売買の指図を行います。ただし、未公開株及び組合への投資を行う場合は、それぞれ「未公開株投資委員会」、「組合投資委員会」での承認後、売買の指図等を行います。
 - オ) パフォーマンス分析、リスク分析・評価
ファンドのリスク特性分析、パフォーマンスの要因分析の報告及び監視を行い、運用方針の確認・見直しを行います。
上記体制は、今後、変更となる場合があります。

2 【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資一任契約に係る業務（投資運用業）、投資助言業務（投資助言・代理業）及び第二種金融商品取引業に係る業務の一部を行っています。

2024年9月末日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（マザーファンドは除きます）は以下の通りです。

(2024年9月末日現在)

| ファンドの種類 | 本数 | 純資産総額（百万円） |
|------------|-----|------------|
| 追加型株式投資信託 | 282 | 4,022,163 |
| 単位型株式投資信託 | 577 | 1,470,064 |
| 単位型公社債投資信託 | 73 | 168,704 |
| 合計 | 932 | 5,660,931 |

3 【委託会社等の経理状況】

(1) 財務諸表の作成方法について

委託会社であるSBIアセットマネジメント株式会社（以下「当社」という）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（2023年4月1日から2024年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

| | 前事業年度 (2023年3月31日) | 当事業年度 (2024年3月31日) |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金・預金 | 801,610 | 1,318,220 |
| 関係会社短期貸付金 | 2,900,000 | 2,450,000 |
| 前払費用 | 47,781 | 75,720 |
| 未収委託者報酬 | 930,483 | 1,476,224 |
| 未収運用受託報酬 | 27,192 | 20,429 |
| その他 | 2,359,928 | 43,335 |
| 流動資産合計 | 4,742,996 | 7,433,929 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | | |
| 建物 | 1,261,185 | 1,261,047 |
| 器具備品 | 1,259,2 | 1,393,0 |
| 有形固定資産合計 | 28,778 | 29,977 |
| 無形固定資産 | | |
| 商標権 | 1,261 | 1,860 |
| ソフトウェア | 61,598 | 194,084 |
| その他 | 67 | 67 |
| 無形固定資産合計 | 62,926 | 196,011 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | 688,191 | 746,394 |
| 関係会社株式 | 22,031 | 22,031 |
| 繰延税金資産 | 115,138 | 47,988 |
| その他 | 30,247 | 41,782 |
| 投資その他の資産合計 | 855,609 | 858,197 |
| 固定資産合計 | 947,314 | 1,084,186 |
| 繰延資産 | | |
| 株式交付費 | 2,654 | 1,632 |
| 繰延資産合計 | 2,654 | 1,632 |
| 資産合計 | 5,692,964 | 8,519,748 |

(単位：千円)

| | 前事業年度 (2023年3月31日) | 当事業年度 (2024年3月31日) |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 118,440 | 56,020 |
| 未払金 | 647,383 | 1,348,795 |
| 未払手数料 | 446,336 | 788,350 |
| その他未払金 | 201,047 | 560,444 |
| 未払法人税等 | 159,134 | 162,014 |
| 未払消費税等 | 22,860 | |
| 流動負債合計 | 947,819 | 1,566,829 |
| 負債合計 | 947,819 | 1,566,829 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 400,200 | 400,200 |
| 資本剰余金 | | |
| その他資本剰余金 | 3,352,137 | 3,847,137 |
| 資本剰余金合計 | 3,352,137 | 3,847,137 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 100,050 | 100,050 |
| その他利益剰余金 | | |
| 繰越利益剰余金 | 853,521 | 2,586,857 |
| 利益剰余金合計 | 953,571 | 2,686,907 |
| 自己株式 | 63 | 63 |
| 株主資本合計 | 4,705,845 | 6,934,181 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 39,299 | 18,737 |
| 評価・換算差額等合計 | 39,299 | 18,737 |
| 純資産合計 | 4,745,145 | 6,952,919 |
| 負債純資産合計 | 5,692,964 | 8,519,748 |

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

| | 前事業年度 (自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日) | 当事業年度 (自 2023年 4月 1日 至 2024年 3月31日) |
|-----------|---|---|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 3,810,647 | 6,530,321 |
| 運用受託報酬 | 77,528 | 112,247 |
| 投資助言報酬 | 20 | 40 |
| その他営業収益 | | 17,987 |
| 営業収益計 | 3,888,196 | 6,660,596 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 1,786,085 | 3,002,489 |
| 広告宣伝費 | 4,516 | 1,071 |
| 調査費 | 129,242 | 279,089 |
| 委託計算費 | 403,078 | 657,400 |
| 営業雑経費 | 33,949 | 72,111 |
| 通信費 | 715 | 1,965 |
| 印刷費 | 25,129 | 57,926 |
| 協会費 | 8,050 | 12,004 |
| 諸会費 | 54 | 215 |
| 営業費用計 | 2,356,872 | 4,012,163 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | 268,902 | 530,816 |
| 役員報酬 | 41,915 | 73,064 |
| 給料・手当 | 215,025 | 418,939 |
| 賞与 | 11,961 | 38,813 |
| 福利厚生費 | 33,604 | 85,313 |
| 交際費 | 15 | |
| 寄付金 | 2,352 | 1,637 |
| 旅費交通費 | 1,182 | 2,623 |
| 租税公課 | 28,732 | 40,582 |
| 不動産賃借料 | 20,989 | 40,413 |
| 退職給付費用 | 5,529 | 31,515 |
| 固定資産減価償却費 | 10,208 | 42,089 |
| 業務委託費 | 54,710 | 56,992 |
| 消耗品費 | 2,298 | 3,711 |
| 諸経費 | 18,323 | 637,135 |
| 一般管理費計 | 446,850 | 1,472,831 |
| 営業利益 | 1,084,473 | 1,175,602 |
| 営業外収益 | | |
| 受取利息 | 21,136 | 53,147 |
| 受取配当金 | 80,435 | 1,250 |
| 投資有価証券売却益 | | 131,942 |
| 雑収入 | 847 | 1,375 |
| 営業外収益計 | 102,419 | 187,715 |
| 営業外費用 | | |
| 為替差損 | 121 | 1,040 |
| 株式交付費償却 | 1,516 | 1,764 |
| 営業外費用計 | 1,638 | 2,805 |
| 経常利益 | 1,185,254 | 1,360,512 |
| 特別損失 | | |
| 投資有価証券売却損 | 297,096 | |
| 投資有価証券評価損 | 2,562 | |

| | | |
|--------------|---------|-----------|
| 特別損失合計 | 299,658 | |
| 税引前当期純利益 | 885,596 | 1,360,512 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 276,030 | 326,163 |
| 法人税等調整額 | 3,861 | 94,943 |
| 法人税等合計 | 272,169 | 421,107 |
| 当期純利益 | 613,427 | 939,405 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | | | | 自己株式 | 株主資本 合計 |
|-------------------------|---------|------------------|-----------------|-----------|-----------------------------|-------------|----|-----------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益剰余金 | | | | | |
| | | その他 資本 剰余金 | 資本 剰余金 合計 | 利益 準備金 | その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金 | 利益剰余金 合計 | | | |
| 当期首残高 | 400,200 | 1,350,000 | 1,350,000 | 100,050 | 240,094 | 340,144 | | 2,090,344 | |
| 当期変動額 | | | | | | | | | |
| 合併による増加 | | 2,002,137 | 2,002,137 | | | | | 2,002,137 | |
| 当期純利益 | | | | | 613,427 | 613,427 | | 613,427 | |
| 自己株式の取得 | | | | | | | 63 | 63 | |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | | 2,002,137 | 2,002,137 | | 613,427 | 613,427 | 63 | 2,615,501 | |
| 当期末残高 | 400,200 | 3,352,137 | 3,352,137 | 100,050 | 853,521 | 953,571 | 63 | 4,705,845 | |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|-------------------------|------------------|----------------|-----------|
| | その他有価証券 評価差額金 | 評価・換算差額等合 計 | |
| 当期首残高 | 135,145 | 135,145 | 1,955,198 |
| 当期変動額 | | | |
| 合併による増加 | | | 2,002,137 |
| 当期純利益 | | | 613,427 |
| 自己株式の取得 | | | 63 |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | 174,445 | 174,445 | 174,445 |
| 当期変動額合計 | 174,445 | 174,445 | 2,789,946 |
| 当期末残高 | 39,299 | 39,299 | 4,745,145 |

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

| | 株主資本 | | | | | | | 自己株式 | 株主資本 合計 |
|-------------------------|---------|------------------|-----------------|-----------|--------------|-------------|-------------|-----------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益 準備金 | 利益剰余金 | | 利益剰余金 合計 | | |
| | | その他 資本 剰余金 | 資本 剰余金 合計 | | その他利益 剰余金 | 繰越利益 剰余金 | | | |
| 当期首残高 | 400,200 | 3,352,137 | 3,352,137 | 100,050 | 853,521 | 953,571 | 63 | 4,705,845 | |
| 当期変動額 | | | | | | | | | |
| 合併による増加 | | 495,000 | 495,000 | | 793,930 | 793,930 | | 1,288,930 | |
| 当期純利益 | | | | | 939,405 | 939,405 | | 939,405 | |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額(純額) | | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | | 495,000 | 495,000 | | 1,733,335 | 1,733,335 | | 2,228,335 | |
| 当期末残高 | 400,200 | 3,847,137 | 3,847,137 | 100,050 | 2,586,857 | 2,686,907 | 63 | 6,934,181 | |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|-------------------------|------------------|----------------|-----------|
| | その他有価証券 評価差額金 | 評価・換算差額等 合計 | |
| 当期首残高 | 39,299 | 39,299 | 4,745,145 |
| 当期変動額 | | | |
| 合併による増加 | | | 1,288,930 |
| 当期純利益 | | | 939,405 |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額(純額) | 20,562 | 20,562 | 20,562 |
| 当期変動額合計 | 20,562 | 20,562 | 2,207,773 |
| 当期末残高 | 18,737 | 18,737 | 6,952,919 |

【注記事項】

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1)子会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2)その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3．固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

主として定額法を採用しております。なお主な耐用年数は、建物が8-18年、器具備品が3-15年であります。

無形固定資産

定額法を採用しております。自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

4．繰延資産の処理方法

株式交付費

3年間で均等償却しております。

5．収益及び費用の計上基準

当社の事業である投資運用業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は、以下のとおりであります。

| | |
|--------|---|
| 委託者報酬 | 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき公募・私募の投資信託財産の運用指図を行うことが主な履行義務の内容であり、運用期間の経過とともにその履行義務が充足されると判断しております。投資信託約款に定められた信託報酬として、ファンド設定以降、日々の純資産残高に一定の報酬率を乗じて算出された額が、当該ファンドの運用期間に渡り収益として認識されます。 |
| 運用受託報酬 | 運用受託報酬は、投資家である対象顧客と投資一任契約を締結し、資産の運用を行うことが主な履行義務の内容であり、運用期間の経過とともにその履行義務が充足されると判断しております。投資一任契約ごとに定められた運用対象資産、残高、期間、料率等の条件に基づき算出された額が、運用を受託した期間に渡り収益として認識されます。 |
| 投資助言報酬 | 投資助言報酬は、対象顧客と投資助言（顧問）契約を締結し、当該顧客の資産運用に係る助言を行うことが主な履行義務の内容であり、助言期間の経過とともにその履行義務が充足されると判断しております。投資助言（顧問）契約ごとに定められた助言対象資産、残高、期間、料率等の条件に基づき算出された額が、助言期間に渡り収益として認識されます。 |

(会計方針の変更)
該当事項はありません。

(貸借対照表関係)

| 前事業年度 (2023年3月31日) | | 当事業年度 (2024年3月31日) | |
|-----------------------|----------------------------------|-----------------------|----------------------------------|
| 1 | 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。 | 1 | 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。 |
| | 建物 9,215千円 | | 建物 12,573千円 |
| | 器具備品 5,643千円 | | 器具備品 6,916千円 |
| | 合計 14,859千円 | | 合計 19,490千円 |
| 2 | 関係会社との取引に基づいて発生した債権は以下のとおりであります。 | 2 | 関係会社との取引に基づいて発生した債権は以下のとおりであります。 |
| | 関係会社短期貸付金 2,900,000千円 | | 関係会社短期貸付金 4,500,000千円 |
| | その他流動資産 23,099千円 | | 未収運用受託報酬 954千円 |
| | 合計 2,923,099千円 | | 合計 4,500,954千円 |

(損益計算書関係)

- 顧客との契約から生じる収益
営業収益は全て顧客との契約から生じる収益であり、その他の収益に該当するものではありません。
- 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

| 前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) | | 当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日) | |
|--|----------|--|-----------|
| | | 経営管理報酬 | 607,052千円 |
| 関係会社からの受取利息 | 21,130千円 | 関係会社からの受取利息 | 48,341千円 |

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首株式数 | 増加 | 減少 | 当事業年度末株式数 |
|---------|------------|-----------|----|-----------|
| 普通株式(株) | 57,400 | 1,042,011 | | 1,099,411 |

(注1) 当社は、2022年7月28日付で普通株式1株につき10株の割合で株式分割を行っております。

これに伴い、普通株式の発行済株式総数は、516,600株増加いたしました。

(注2) 2022年8月1日を効力発生とする吸収合併に伴い、結合当事企業の既存株主に対し、存続会社である当社普通株式の割当交付を行ったことにより、525,411株増加しております。

2. 自己株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首株式数 | 増加 | 減少 | 当事業年度末株式数 |
|---------|------------|----|----|-----------|
| 普通株式(株) | | 18 | | 18 |

(注) 普通株式の自己株式の株式数の増加18株は、単元未満株式の買取りによる増加18株であります。

3. 新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首株式数 | 増加 | 減少 | 当事業年度末株式数 |
|---------|------------|---------|----|-----------|
| 普通株式(株) | 1,099,411 | 308,937 | | 1,408,348 |

(注) 2023年4月1日を効力発生とする吸収合併に伴い、結合当事企業の既存株主に対し、存続会社である当社普通株式の割当交付を行ったことにより、308,937株増加しております。

2. 自己株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首株式数 | 増加 | 減少 | 当事業年度末株式数 |
|---------|------------|----|----|-----------|
| 普通株式(株) | 18 | | | 18 |

3. 新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を投資有価証券として保有しております。また、デリバティブ取引については、保有する特定の投資有価証券の価格変動リスクを低減させる目的で利用しており、投機的な取引は行わない方針であります。その他、一時的な余剰資金の運用については短期的な預金等に限定しております。なお、事業及び設備投資に必要な自己資金を有しているため、外部からの資金調達の計画はありません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されておりますが、これらの債権は、受託銀行にて分別管理されている信託財産及び年金資産より生じる信託報酬債権であり、その信用リスクは軽微であります。投資有価証券はファンドの自己設定に関連する投資信託であり、基準価額の変動リスクに晒されております。この自己設定投資信託の一部につきましては、指数先物によるデリバティブ取引にてリスクの低減を図っております。このほか、親会社に対し短期貸付を行っております。

営業債務である未払手数料等は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

営業債権については経理規程に従い、取引先ごとに期日及び残高を管理しております。

市場リスク(価格、為替や金利等の変動リスク)の管理

投資有価証券については、定期的に基準価額を把握することにより管理しております。

デリバティブ取引は、取引執行部門とヘッジ有効性の評価部門を分離し、日々評価額及び評価損益の管理を行っております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。また、「デリバティブ取引関係」注記におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、「現金・預金」「関係会社短期貸付金」「未収委託者報酬」「未収運用受託報酬」「未払金」は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

前事業年度（2023年3月31日）

| | 貸借対照表 計上額 (千円) | 時価 (千円) | 差額 (千円) |
|--------------|----------------------|------------|------------|
| 投資有価証券 | 688,191 | 688,191 | |
| 資産計 | 688,191 | 688,191 | |
| デリバティブ取引(注1) | 203 | 203 | |

(注1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は、純額で表示しております。

(注2) 市場価格のない株式等は、「投資有価証券」には含まれておりません。当該金融商品の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

| 区分 | 前事業年度 貸借対照表計上額 (千円) |
|-----------------|---------------------------|
| 関係会社株式 子会社株式 | 22,031 |

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|-----------|-----------|-------------|--------------|------|
| 現金・預金 | 801,610 | | | |
| 関係会社短期貸付金 | 2,900,000 | | | |
| 未収委託者報酬 | 930,483 | | | |
| 未収運用受託報酬 | 27,192 | | | |
| 投資有価証券 | 2,246 | | | |
| 合計 | 4,661,531 | | | |

当事業年度（2024年3月31日）

| | 貸借対照表 計上額 (千円) | 時価 (千円) | 差額 (千円) |
|--------|----------------------|------------|------------|
| 投資有価証券 | 746,394 | 746,394 | |
| 資産計 | 746,394 | 746,394 | |

(注1) 市場価格のない株式等は、「投資有価証券」には含まれておりません。当該金融商品の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

| 区分 | 当事業年度 貸借対照表計上額 (千円) |
|-----------------|---------------------------|
| 関係会社株式 子会社株式 | 22,031 |

(注2) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|-----------|-----------|-------------|--------------|------|
| 現金・預金 | 1,318,220 | | | |
| 関係会社短期貸付金 | 4,500,000 | | | |
| 未収委託者報酬 | 1,476,224 | | | |
| 未収運用受託報酬 | 20,429 | | | |
| 合計 | 7,314,874 | | | |

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価： 観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価で貸借対照表に計上している金融商品

前事業年度（2023年3月31日）

| 区分 | 時価（千円） | | | |
|----------|--------|---------|------|---------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| 投資有価証券 | | | | |
| 投資信託 | | 688,191 | | 688,191 |
| デリバティブ取引 | | | | |
| 指数先物関連 | | 203 | | 203 |
| 資産計 | | 687,988 | | 687,988 |

(注)時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

投資信託

市場における取引価格が存在せず、かつ、解約等に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がないことから、基準価額を時価としており、その時価をレベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル2の時価に分類しております。

当事業年度（2024年3月31日）

| 区分 | 時価（千円） | | | |
|--------|--------|---------|------|---------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| 投資有価証券 | | | | |
| 投資信託 | | 746,394 | | 746,394 |
| 資産計 | | 746,394 | | 746,394 |

(注)時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

投資信託

市場における取引価格が存在せず、かつ、解約等に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がないことから、基準価額を時価としており、その時価をレベル2の時価に分類しております。

（有価証券関係）

1. 子会社株式

前事業年度(2023年3月31日)

市場価格のない株式等の貸借対照表計上額

| 区分 | 貸借対照表計上額 (千円) |
|-------|------------------|
| 子会社株式 | 22,031 |

当事業年度(2024年3月31日)

市場価格のない株式等の貸借対照表計上額

| 区分 | 貸借対照表計上額 (千円) |
|-------|------------------|
| 子会社株式 | 22,031 |

2. その他有価証券

前事業年度(2023年3月31日)

(単位：千円)

| 区分 | | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|----------------------|--------|----------|---------|--------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | (1)株式 | | | |
| | (2)債券 | | | |
| | (3)その他 | 684,519 | 627,800 | 56,719 |
| | 小計 | 684,519 | 627,800 | 56,719 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | (1)株式 | | | |
| | (2)債券 | | | |
| | (3)その他 | 3,672 | 3,747 | 75 |
| | 小計 | 3,672 | 3,747 | 75 |
| 合計 | | 688,191 | 631,547 | 56,644 |

(注)表中の「取得原価」は減損処理後の帳簿価額であります。

当事業年度(2024年3月31日)

(単位：千円)

| 区分 | | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|----------------------|--------|----------|---------|--------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | (1)株式 | | | |
| | (2)債券 | | | |
| | (3)その他 | 127,373 | 78,187 | 49,186 |
| | 小計 | 127,373 | 78,187 | 49,186 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | (1)株式 | | | |
| | (2)債券 | | | |
| | (3)その他 | 619,020 | 641,200 | 22,179 |
| | 小計 | 619,020 | 641,200 | 22,179 |
| 合計 | | 746,394 | 719,387 | 27,007 |

(注)表中の「取得原価」は減損処理後の帳簿価額であります。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(2023年3月31日)

(単位：千円)

| 区分 | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|--------|---------|---------|---------|
| (1)株式 | | | |
| (2)債券 | | | |
| (3)その他 | 311,403 | | 297,096 |
| 合計 | 311,403 | | 297,096 |

当事業年度(2024年3月31日)

(単位：千円)

| 区分 | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|--------|---------|---------|---------|
| (1)株式 | | | |
| (2)債券 | | | |
| (3)その他 | 682,102 | 131,942 | |
| 合計 | 682,102 | 131,942 | |

4. 減損処理を行ったその他有価証券

前事業年度において、投資有価証券（その他有価証券の投資信託）について2,562千円の減損処理を行っております。なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30～50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

(デリバティブ取引関係)

前事業年度（2023年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

| 区分 | 取引の種類 | 契約額等 (千円) | 契約額等の うち1年超 (千円) | 時価 (千円) | 評価損益 (千円) |
|------|--------------|--------------|------------------------|------------|--------------|
| 市場取引 | 指数先物取引 買建 | 7,735 | | 203 | 203 |
| 合計 | | 7,735 | | 203 | 203 |

(注) 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づいております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

当事業年度（2024年3月31日）

該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型年金制度を採用しております。このほか、グループ会社との出向者の取り扱いに関する協定書に基づき、グループ会社に支払った金額を退職給付費用として計上しております。なお、当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）の支払額は23,640千円であります。

2. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）5,529千円、当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）7,875千円であります。

(税効果会計関係)

| 前事業年度 (2023年3月31日) | 当事業年度 (2024年3月31日) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|-----------------------|-------|-----------|---------|-------|-------|---------|-------|-----|--------|-----|-----|----------|---------|--------|--|----------|---------|--------------|--------|----------|--------|-----------|---------|--|-------|-------|-----------|--------|-------|-------|---------|-------|-----|--------|-----|-----|----------|--------|--------|--|----------|--------|--------------|-------|----------|-------|-----------|--------|
| <p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">電話加入権</td> <td style="text-align: right;">438千円</td> </tr> <tr> <td>投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">100,697</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">7,131</td> </tr> <tr> <td>その他未払税金</td> <td style="text-align: right;">5,470</td> </tr> <tr> <td>未払金</td> <td style="text-align: right;">18,485</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">258</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">132,482</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 1px solid black;">132,482</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">17,344</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">17,344</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 1px solid black;">115,138</td> </tr> </table> | 電話加入権 | 438千円 | 投資有価証券評価損 | 100,697 | 未払事業税 | 7,131 | その他未払税金 | 5,470 | 未払金 | 18,485 | その他 | 258 | 繰延税金資産小計 | 132,482 | 評価性引当額 | | 繰延税金資産合計 | 132,482 | その他有価証券評価差額金 | 17,344 | 繰延税金負債合計 | 17,344 | 繰延税金資産の純額 | 115,138 | <p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">電話加入権</td> <td style="text-align: right;">714千円</td> </tr> <tr> <td>投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">12,489</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">6,662</td> </tr> <tr> <td>その他未払税金</td> <td style="text-align: right;">6,300</td> </tr> <tr> <td>未払金</td> <td style="text-align: right;">29,896</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">195</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">56,258</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 1px solid black;">56,258</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">8,269</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">8,269</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 1px solid black;">47,988</td> </tr> </table> | 電話加入権 | 714千円 | 投資有価証券評価損 | 12,489 | 未払事業税 | 6,662 | その他未払税金 | 6,300 | 未払金 | 29,896 | その他 | 195 | 繰延税金資産小計 | 56,258 | 評価性引当額 | | 繰延税金資産合計 | 56,258 | その他有価証券評価差額金 | 8,269 | 繰延税金負債合計 | 8,269 | 繰延税金資産の純額 | 47,988 |
| 電話加入権 | 438千円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 投資有価証券評価損 | 100,697 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払事業税 | 7,131 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他未払税金 | 5,470 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払金 | 18,485 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 258 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産小計 | 132,482 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 評価性引当額 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産合計 | 132,482 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他有価証券評価差額金 | 17,344 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金負債合計 | 17,344 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産の純額 | 115,138 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 電話加入権 | 714千円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 投資有価証券評価損 | 12,489 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払事業税 | 6,662 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他未払税金 | 6,300 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払金 | 29,896 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 195 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産小計 | 56,258 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 評価性引当額 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産合計 | 56,258 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他有価証券評価差額金 | 8,269 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金負債合計 | 8,269 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産の純額 | 47,988 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>当事業年度は、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。</p> | 同左 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

（企業結合等関係）

（共通支配下の取引等）

2023年3月30日開催の当社臨時株主総会において、当社を吸収合併存続会社とし、同一の親会社を持つ会社である新生インベストメント・マネジメント株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併契約締結の決議が承認可決され、効力発生日である2023年4月1日付をもって吸収合併いたしました。

1．取引の概要

(1)結合当事企業の名称及びその事業の内容

存続会社：当社

消滅会社：新生インベストメント・マネジメント株式会社

なお、事業の内容は、いずれも投資運用業を主とする金融商品取引業であります。

(2)企業結合日

2023年4月1日

(3)企業結合の法的形式

当社を存続会社とし、新生インベストメント・マネジメント株式会社を消滅会社とする吸収合併。

(4)結合後企業の名称

SBIアセットマネジメント株式会社

(5)取引の目的

経営資源の有効活用及び最適化を図ることを目的としております。

2．実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」に基づき、共通支配下の取引として会計処理を行いました。

（収益認識関係）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は投資運用業及び投資助言・代理業の単一セグメントであり、顧客との契約から生じる収益の区分は概ね単一であることから、顧客との契約から生じる収益を分解した情報の記載は重要性が乏しいため、記載を省略しております。

2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

「重要な会計方針5．収益及び費用の計上基準」記載のとおりであります。

3．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報）

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

（セグメント情報）

当社の事業は、投資運用業及び投資助言・代理業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

（関連情報）

1．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

(1)営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2)有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

（報告セグメントごとの減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

(セグメント情報)

当社の事業は、投資運用業及び投資助言・代理業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連情報)

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

| 顧客の名称 | 営業収益 |
|----------------|---------|
| SBI・UTIインドファンド | 680,260 |

(報告セグメントごとの減損損失に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者との取引

(ア)財務諸表提出会社の親会社

| 種類 | 会社等の名称 又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金 (百万円) | 事業の内容 又は職業 | 議決権等の所有 (被所有) 割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末 残高 (千円) |
|-----|--------------------------------|-------|-------------------|--------------------------|---------------------------|--|-------|--------------|-----------|------------------|
| 親会社 | SBIグローバルアセットマネジメント株式会社 (注1) | 東京都港区 | 3,363 | 資産運用業、金融情報サービス事業子会社の持株会社 | (被所有)間接 93.3% | 役員の兼任 データ購入 人員出向・受入 資金の貸付 (注2) | 資金の貸付 | 2,300,000 | 関係会社短期貸付金 | 2,300,000 |
| | | | | | | | 貸付利息 | 16,111 | 未収利息 | 17,188 |

(注1) SBIグローバルアセットマネジメント株式会社（旧商号モーニングスター株式会社）は、2023年3月30日付で商号を変更しております。

(注2) 資金貸付は、市場金利を勘案した合理的な利率を定め、その返済条件を協議によって決定しております。

(イ)財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等

| 種類 | 会社等の名称 又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金 (百万円) | 事業の内容 又は職業 | 議決権等の所有 (被所有) 割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末 残高 (千円) |
|-------------|------------------------|-------|-------------------|------------------|---------------------------|-------------------------|-----------|--------------|-----------|------------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | ウエルスアドバイザー株式会社 (注1) | 東京都港区 | 30 | 投資助言業、金融情報サービス事業 | | 運用への助言 資金の貸付 (注2) | 資金の貸付 | 600,000 | 関係会社短期貸付金 | 600,000 |
| | | | | | | | 貸付利息 | 5,019 | 未収利息 | 5,019 |
| | 株式会社SBI証券 | 東京都港区 | 48,323 | 証券業 | | 販売委託(注3) | 販売委託支払手数料 | 770,398 | 未払金 | 186,563 |

(注1) ウエルスアドバイザー株式会社（旧商号モーニングスター・アセット・マネジメント株式会社）は、2023年3月30日付で商号を変更しております。また、同日付で同一の親会社をもつイー・アドバイザー株式会社と吸収合併しております。

(注2) 資金貸付は、市場金利を勘案した合理的な利率を定め、その返済条件を協議によって決定しております。

(注3) 販売委託の条件は、市場価格を勘案し、取引先との協議によって決定しております。

2. 親会社に関する注記

親会社情報

SBIグローバルアセットマネジメント株式会社

(旧商号モーニングスター株式会社。東京証券取引所プライム市場に上場)

SBIアセットマネジメント・グループ株式会社

(旧商号SBIグローバルアセットマネジメント株式会社。非上場)

SBIホールディングス株式会社

（東京証券取引所プライム市場に上場）

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者との取引

(ア)財務諸表提出会社の親会社

| 種類 | 会社等の名称 又は氏名 | 所在地 | 資本金又は 出資金 (百万円) | 事業の内容 又は職業 | 議決権等 の所有 (被所有) 割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の 内容 | 取引 金額 (千円) | 科目 | 期末 残高 (千円) |
|-----|--------------------------------|-------|-----------------------|--|-------------------------------|--|-------------|------------------|-------------------|------------------|
| 親会社 | SBIグローバル アセットマネジ メント株式会社 | 東京都港区 | 3,363 | 資産運用 業、金融情 報サービス 事業子会社 の持株会社 | (被所有) 間接 97.9% | 役員の兼任 経営管理 人員出向・受入 資金の貸付 (注1, 2) | 貸付金の 回収 | 3,250,000 | - | - |
| | | | | | | | 貸付利息 の受取 | 68,587 | - | - |
| | | | | | | | 資金貸付 | 4,500,000 | 関係会 社短期 貸付金 | 4,500,000 |
| | | | | | | | 貸付利息 | 48,244 | 未収利 息 | 1,010 |
| | | | | | | | 経営管理 報酬 | 607,052 | 未払金 | 333,878 |

(注1) 経営管理報酬は、業務内容を勘案し、双方協議のうえで締結した経営管理契約に基づき決定しております。

(注2) 資金貸付は、市場金利を勘案した合理的な利率を定め、その返済条件を協議によって決定しております。

(イ)財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等

| 種類 | 会社等の名称 又は氏名 | 所在地 | 資本金又は 出資金 (百万円) | 事業の内容 又は職業 | 議決権等 の所有 (被所有) 割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の 内容 | 取引 金額 (千円) | 科目 | 期末 残高 (千円) |
|-------------------------|--------------------|-------|-----------------------|------------------------------|-------------------------------|--|---------------|------------------|-----|------------------|
| 同一の 親会社 を持つ 会社 | ウエルスアドバイ ザー株式会社 | 東京都港区 | 30 | 金融情報 サービス 事業、 投資助言業 | | 資金の貸付 運用への助言 人員出向・受入 データ購入等 (注1) | 貸付金の 回収 | 600,000 | - | - |
| | | | | | | | 貸付利息 の受取 | 5,019 | - | - |
| | | | | | | | 貸付利息 | 96 | - | - |
| | 株式会社SBI証券 | 東京都港区 | 54,323 | 証券業 | | 販売委託 (注2) | 販売委託 支払手数料 | 1,057,030 | 未払金 | 266,069 |

(注1) 資金貸付は、市場金利を勘案した合理的な利率を定め、その返済条件を協議によって決定しております。

(注2) 販売委託の条件は、市場価格を勘案し、取引先との協議によって決定しております。

2. 親会社に関する注記

親会社情報

SBIグローバルアセットマネジメント株式会社

（東京証券取引所プライム市場に上場）

SBIアセットマネジメント・グループ株式会社

（非上場）

SBIホールディングス株式会社

（東京証券取引所プライム市場に上場）

(1株当たり情報)

| | 前事業年度 | 当事業年度 |
|------------|---|---|
| | 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日 | 自 2023年4月1日 至 2024年3月31日 |
| 1株当たり純資産額 | 4,316円15銭 | 4,936円99銭 |
| 1株当たり当期純利益 | 664円03銭 | 667円03銭 |
| | なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。 | なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。 |

(注) 当社は、2022年7月28日付で普通株式1株につき10株の割合で株式分割を行っております。

前事業年度の期首に当該株式分割が行われたと仮定して1株あたり純資産及び1株当たり当期純利益を算定しております。

1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 前事業年度 | 当事業年度 |
|------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日 | 自 2023年4月1日 至 2024年3月31日 |
| 当期純利益(千円) | 613,427 | 939,405 |
| 普通株主に帰属しない金額(千円) | | |
| 普通株式に係る当期純利益(千円) | 613,427 | 939,405 |
| 期中平均株式数(株) | 923,786 | 1,408,330 |

(注) 当社は、2022年7月28日付で普通株式1株につき10株の割合で株式分割を行っております。

前事業年度の期首に当該株式分割が行われたと仮定して、前事業年度の期中平均株式数を算定しております。

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

委託者は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等(委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。)または子法人等(委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行うこと。

委託者の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記に掲げるものの他、委託者の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

(1) 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

2022年6月22日付で、発行可能株式総数を変更する定款の変更を行いました。

(ロ) その他の重要事項

SBIアセットマネジメント株式会社は、2022年8月1日に、SBIアセットマネジメント株式会社、SBIボンド・インベストメント・マネジメント株式会社、SBI地方創生アセットマネジメント株式会社の3社合併をいたしました。なお、SBIアセットマネジメント株式会社を存続会社とし、合併後は同商号を継承いたしました。

また、合併後のSBIアセットマネジメント株式会社は、2023年4月1日に、新生インベストメント・マネジメント株式会社と合併をいたしました。なお、SBIアセットマネジメント株式会社を存続会社とし、合併後は同商号を継承いたしました。

(2) 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

| | 名 称 | 資本金の額 (2024年3月末日現在) | 事業の内容 |
|---------|--------------------|------------------------|--|
| 受託会社 | 三菱UFJ信託銀行株式会社 | 324,279百万円 | 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。 |
| 再信託受託会社 | 日本マスタートラスト信託銀行株式会社 | 10,000百万円 | 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。 |
| 販売会社 | 株式会社SBI証券 | 54,323百万円 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| | 楽天証券株式会社 | 19,495百万円 | |
| | auカブコム証券株式会社 | 7,196百万円 | |
| | 松井証券株式会社 | 11,945百万円 | |
| | 東海東京証券株式会社 | 6,000百万円 | |
| 投資顧問会社 | ウエルスアドバイザー株式会社 | 30百万円 | 「金融商品取引法」に定める金融商品取引業として投資助言・代理業を営んでいます。 |

東海東京証券株式会社は、「2025」「2045」の募集・販売等の取扱いを行っております。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

本ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

(2) 再信託受託会社

本ファンドの受託会社と再信託契約を締結し、信託事務の一部を行います。

(3) 販売会社

本ファンドの販売会社として募集・販売の取扱い、一部解約事務および収益分配金・解約金・償還金の支払い等を行います。

(4) 投資顧問会社

本ファンドの投資顧問会社として委託会社に対して運用に関する情報提供及び投資助言等を行います。

3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 再信託受託会社

該当事項はありません。

(3) 販売会社

該当事項はありません。

(4) 投資顧問会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

当計算期間において、ファンドにかかる金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は以下の通り提出されております。

| | |
|---------|-------------|
| 有価証券報告書 | 2023年12月14日 |
| 有価証券届出書 | 2023年12月14日 |
| 半期報告書 | 2024年6月14日 |
| 有価証券届出書 | 2024年6月14日 |

独立監査人の監査報告書

2024年5月24日

SBIアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員
公認会計士 田 篤 照 夫

指定有限責任社員
業務執行社員
公認会計士 郷 右 近 隆 也

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているSBIアセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において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、SBIアセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

経営者の責任は、我が国において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財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

-
1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
 2. XBRLデータは監査の対象に含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2024年12月9日

SBIアセットマネジメント株式会社
取締役会 御 中

監査法人 ナ カ チ
東京都千代田区

代表社員 公認会計士 高村 俊行
業務執行社員

代表社員 公認会計士 家富 義則
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているセブライフ・ストーリー2025の2023年9月15日から2024年9月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において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、セブライフ・ストーリー2025の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、SBIアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において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財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

SBIアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

-
1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
 2. XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2024年12月9日

SBIアセットマネジメント株式会社
取締役会 御 中監査法人 ナ カ チ
東京都千代田区代表社員 公認会計士 高村 俊行
業務執行社員代表社員 公認会計士 家富 義則
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているセブライフ・ストーリー2035の2023年9月15日から2024年9月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において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、セブライフ・ストーリー2035の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、SBIアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において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財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

SBIアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

-
1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
 2. XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2024年12月9日

SBIアセットマネジメント株式会社
取締役会 御 中

監査法人 ナ カ チ
東京都千代田区

代表社員 公認会計士 高村 俊行
業務執行社員

代表社員 公認会計士 家富 義則
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているセブライフ・ストーリー2045の2023年9月15日から2024年9月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において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、セブライフ・ストーリー2045の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、SBIアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において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財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

SBIアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

-
1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
 2. XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2024年12月9日

SBIアセットマネジメント株式会社
取締役会 御 中

監査法人 ナ カ チ
東京都千代田区

代表社員 公認会計士 高村 俊行
業務執行社員

代表社員 公認会計士 家富 義則
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているセレブライフ・ストーリー-2055の2023年9月15日から2024年9月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において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、セレブライフ・ストーリー-2055の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、SBIアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において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財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

SBIアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

-
1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
 2. XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

