

第138期末（2026年8月10日）

基準価額 3,205円

純資産総額 219億円

第133期～第138期
(2026年2月11日～2026年8月10日)

騰落率 7.6%

分配金合計 180円

(注) 騰落率は分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

J P X日経400

アクティブ・プレミアム・オープン

(毎月決算型)

【愛称】 J P Xプレミアム

追加型投信／国内／株式

運用報告書（全体版）

作成対象期間：2026年2月11日～2026年8月10日

第133期 (決算日2026年3月10日) 第136期 (決算日2026年6月10日)
第134期 (決算日2026年4月10日) 第137期 (決算日2026年7月10日)
第135期 (決算日2026年5月11日) 第138期 (決算日2026年8月10日)

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「J P X日経400アクティブ・プレミアム・オープン（毎月決算型）」は、このたび第138期の決算を行いました。

当ファンドは、「U B Sユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱーニッセイ・ジャパン・エフティ・アクティブ・ファンド（適格機関投資家限定）カバード・コール・クラス」への投資を通じて、国内の金融商品取引所上場株式を実質的な主要投資対象とするとともに、為替取引を活用し米ドルへの投資効果の享受、株式および通貨のカバードコール戦略によるオプションプレミアムの獲得をめざすことにより、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

お客様の口座内容に関するご照会は、
お申し込みされた販売会社にお問い合わせください。



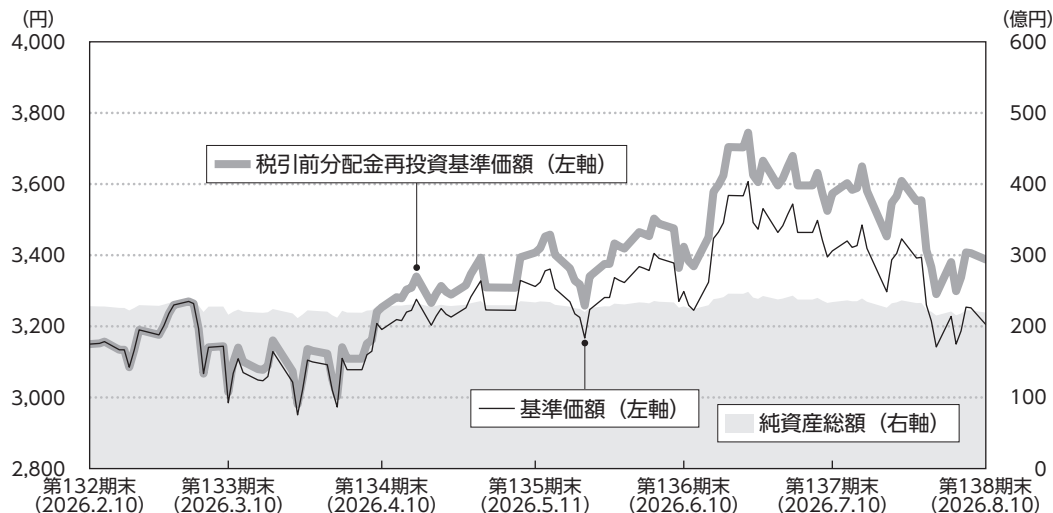
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2026年2月11日～2026年8月10日

基準価額等の推移



第133期首	3,150円	既払分配金	180円
第138期末	3,205円	騰落率（分配金再投資ベース）	7.6%

（注1）税引前分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、前作成期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

（注2）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

（注3）当ファンドはコンセプトに適った指数が存在しないことから、ベンチマークなどを設けていません。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・4月から6月中旬にかけて、不安定な中東情勢は継続したものの、各国による備蓄原油の放出などを受けたエネルギー価格の下落や米ハイパースケーラー（大規模クラウド事業者）による人工知能（AI）データセンター投資見通しの引き上げ、1－3月期の良好な国内企業決算を背景に、景気減速への懸念が和らいだこと
- ・8月上旬以降、4－6月期の国内企業決算が堅調に推移し、特に内需関連銘柄の業績の底堅さが好感されたこと

<下落要因>

- ・3月上旬から下旬にかけて、イランによるホルムズ海峡封鎖の発表を受けてエネルギー価格が急騰し、インフレ長期化に伴う世界的な景気減速懸念が高まったこと
- ・6月下旬から7月下旬にかけて、中東情勢の混乱が継続したことでエネルギー価格が再び上昇し、景気減速リスクへの警戒感が高まったこと
- ・通貨カバードコール戦略が基準価額に対してマイナスに働いたこと

*カバードコール戦略は、株式カバードコール戦略と通貨カバードコール戦略に分かれます。詳細につきましては後掲のポートフォリオをご参照ください。

1 万口当たりの費用明細

項目	第133期～第138期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	18円	0.557%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は3,265円です。
(投信会社)	(5)	(0.163)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(12)	(0.381)	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および事務手続き等の対価
(受託会社)	(0)	(0.013)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
その他費用	0	0.000	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$
(監査費用)	(0)	(0.000)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
合計	18	0.557	

(注1) 作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

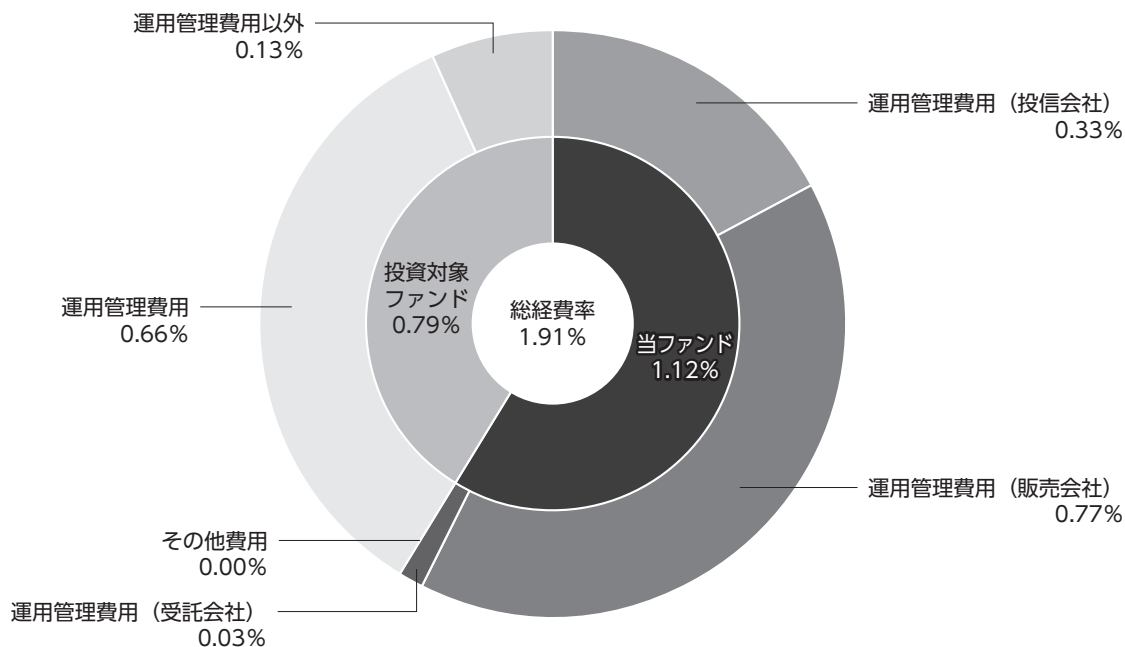
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

(注4) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている外国投資信託証券が支払った費用を含みません（マザーファンドを除く）。

（参考情報）

■総経費率

作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.91%**です。



総経費率（①+②+③）	1.91%
①当ファンドの費用の比率	1.12%
②投資対象ファンドの運用管理費用の比率	0.66%
③投資対象ファンドの運用管理費用以外の比率	0.13%

（注1）①の費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

（注2）各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

（注3）各比率は、年率換算した値です。

（注4）投資対象ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く）です。

（注5）①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資対象ファンドが支払った費用を含みません。

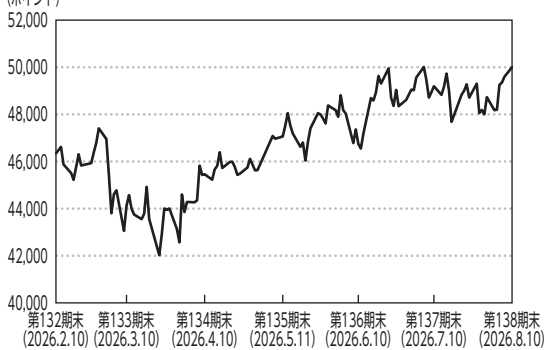
（注6）①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

（注7）上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

投資環境

■国内株式市況

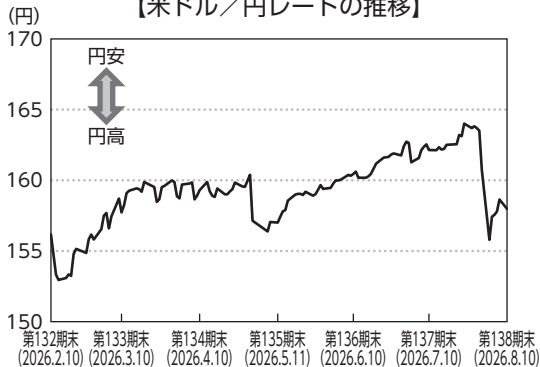
【J P X 日経インデックス400（配当込み）の推移】



(注) ブルームバークのデータを使用しています。

■為替市況

【米ドル／円レートの推移】



(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当作成期の国内株式市場は上昇しました。

当作成期中は、中東情勢の混乱やエネルギー価格の高騰などを背景に、3月を中心に軟調に推移する場面も見られました。

しかし、米ハイパースケーラーによるA I データセンター投資見通しの引き上げを受けて高水準のA I 投資が続くとの期待が高まったことや、1－3月期および4－6月期の双方において国内企業の良好な業績が確認されたことなどから、日本株の再評価が進みました。結局、当作成期を通じて見ると上昇して当作成期末を迎えました。

当作成期の米ドル／円相場は米ドル高円安となりました。

当作成期初は1ドル＝156円近辺でスタートしましたが、衆院選における自民党勝利を受けた財政拡大懸念の余波が残る中、米インフレ継続に伴う利上げ観測などを背景に、円安が進行しました。4月末および7月末には当局による為替介入が実施され、一時的に円高方向に修正される場面も見られましたが、結局、1ドル＝158円近辺で当作成期末を迎えました。

ポートフォリオ

■当ファンド

外国投資信託証券への投資を通じて、国内の金融商品取引所上場株式を実質的な主要投資対象とするとともに、為替取引を活用し米ドルへの投資効果の享受、株式および通貨のカバードコール戦略によるオプションプレミアムの獲得をめざすことにより、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行いました。

（注1）株式カバードコール戦略とは、株価指数のコールオプション（注3）を売る戦略です。株価の一定水準以上の値上がり益を放棄する見返りとして、オプション料（プレミアム）を受け取る取引を行います。通貨カバードコール戦略とは、米ドル（対円）のコールオプションを売る戦略です。米ドル（対円）の一定水準以上の値上がり益を放棄する見返りとして、オプション料（プレミアム）を受け取る取引を行います。

（注2）オプションプレミアムとは、オプションの買い手が売り手に支払う対価です。

（注3）コールオプションとは、特定の商品（株式・通貨など）を特定の価格（権利行使価格）で将来のある期日（オプションの満期日など）に買うことができる権利です。

■UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ-ニッセイ・ジャパン・エクイティ・アクティブ・ファンド（適格機関投資家限定）カバード・コール・クラス

*カバードコール戦略の概要については、UBS マネジメント（ケイマン）リミテッドの資料（現地における当作成期末の前月末営業日基準）に基づき、ニッセイアセットマネジメントが作成しています。

国内株式の銘柄選択については、J P X日経インデックス400構成銘柄および同指数に採用が見込まれる銘柄の中から、株価上昇が期待される銘柄に厳選して投資を行い、中長期的観点からJ P X日経インデックス400（配当込み）を上回る投資成果の獲得をめざしました。円建て資産については、原則として「円売り／米ドル買い」の為替取引を行い、米ドルへの投資効果を享受することをめざしました。

業種配分については、当作成期末時点で組入比率の高い順に、電気機器（26.8%）、銀行業（19.2%）、卸売業（8.9%）としています。

また、7月末時点での株式カバードコール戦略のオプションプレミアムは16.2%、カバー率は50.0%、平均行使期間は31.0日、通貨カバードコール戦略のオプションプレミアムは3.8%、カバー率は50.0%、平均行使期間は31.0日としています。

（注1）業種配分の比率は対組入株式評価額比で、当作成期末の基準価額に反映される海外前営業日基準のデータです。

（注2）業種は東証33業種分類によるものです。

（注3）オプションプレミアムは、純資産総額に対する年率調整後のプレミアム収入です。

（注4）カバー率は、純資産総額に対するオプションポジションの割合です。

■ニッセイマネーマーケットマザーファンド

円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざしました。

ベンチマークとの差異

当ファンドは外国投資信託証券への投資を通じて、国内の金融商品取引所上場株式を実質的な主要投資対象とするとともに、為替取引を活用し米ドルへの投資効果の享受、株式および通貨のカバードコール戦略によるオプションプレミアムの獲得をめざすことにより、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。このため、コンセプトに適った指数が存在しないことから、ベンチマークなどを設けていません。

分配金

当作成期の分配金は、基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を考慮の上、下表の通りとさせていただきます。

なお、分配に充てずに信託財産に留保した収益につきましては、元本部分と同一の運用を行います。

【分配原資の内訳（1万口当たり）】

項目	第133期 2026年2月11日 ～ 2026年3月10日	第134期 2026年3月11日 ～ 2026年4月10日	第135期 2026年4月11日 ～ 2026年5月11日	第136期 2026年5月12日 ～ 2026年6月10日	第137期 2026年6月11日 ～ 2026年7月10日	第138期 2026年7月11日 ～ 2026年8月10日
当期分配金（税引前）	30円	30円	30円	30円	30円	30円
対基準価額比率	1.00%	0.93%	0.90%	0.90%	0.87%	0.93%
当期の収益	30円	30円	30円	30円	30円	30円
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	4,101円	4,122円	4,143円	4,162円	4,184円	4,204円

（注1）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切り捨てで算出しているため、合計が当期分配金と一致しない場合があります。

（注2）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

今後の運用方針

■当ファンド

引き続き、外国投資信託証券への投資を通じて、国内の金融商品取引所上場株式を実質的な主要投資対象とするとともに、為替取引を活用し米ドルへの投資効果の享受、株式および通貨のカバードコール戦略によるオプションプレミアムの獲得をめざすことにより、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

■UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ-ニッセイ・ジャパン・エクイティ・アクティブ・ファンド（適格機関投資家限定）カバード・コール・クラス

米国を中心に、中長期的な視点から生成A I インフラの構築に向けた投資が加速しています。A I データセンターの収益化懸念はくすぶるものの、急速な需要の高まりに伴いエネルギー・電源関連や最先端の部素材の不足が深刻化しており、生産能力の増強が急務となっています。こうした変化は、関連製品で強みを持つ日本企業にとって巨大なビジネスチャンスになると期待されます。一方で、中東情勢や米中間の国際的な覇権争いに伴うサプライチェーン（供給網）の混乱、各国の防衛費拡大がもたらす財政悪化やインフレの動向には警戒が必要です。こうした環境下、強力な業績成長ドライバーを有する企業、高い事業競争力を背景に独自成長が可能な企業、あるいは資本効率改善による収益性向上が期待できる企業など、銘柄を厳選した投資が必要であると考えます。

上記見通しのもと、ポートフォリオの構築にあたっては「構造的な背景からR O E（自己資本利益率）水準や営業利益水準を高位に保ち、今後さらに改善が見込まれる銘柄」をコア銘柄とする方針を継続します。

今後も個別企業とのミーティングや徹底した調査・分析に基づく中長期業績予測をもとに、割安と判断される銘柄に投資を行い、中長期的に株式市場全体の動きを上回る運用成果の獲得をめざします。

*上記は投資対象ファンドにおける国内株式の見通しおよび運用方針です。

今後も為替取引を活用し、米ドルへの投資効果の享受、株式および通貨のカバードコール戦略によるオプションプレミアムの獲得をめざします。

*上記は投資ファンドにおけるカバードコール戦略の運用方針です。

■ニッセイマネーマーケットマザーファンド

円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざします。

ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

■組入ファンド

	第138期末 2026年8月10日
U B Sユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－ニッセイ・ジャパン・エクイティ・アクティブ・ファンド（適格機関投資家限定）カバード・コール・クラス	98.0%
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	0.0

（注1）組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

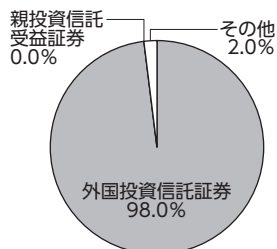
（注2）組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

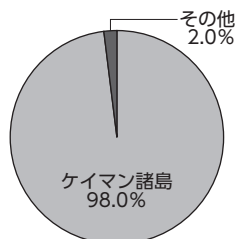
項目	第133期末 2026年3月10日	第134期末 2026年4月10日	第135期末 2026年5月11日	第136期末 2026年6月10日	第137期末 2026年7月10日	第138期末 2026年8月10日
純資産総額	21,624,299,710円	22,680,816,228円	23,361,703,289円	22,798,724,301円	23,407,506,373円	21,928,298,139円
受益権総口数	72,446,909,721口	71,079,764,334口	70,546,042,931口	69,130,487,123口	68,606,321,244口	68,411,414,095口
1万口当たり基準価額	2,985円	3,191円	3,312円	3,298円	3,412円	3,205円

（注）当作成期間（第133期～第138期）中における追加設定元本額は2,291,880,325円、同解約元本額は6,368,663,889円です。

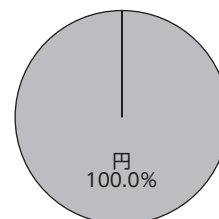
■資産別配分



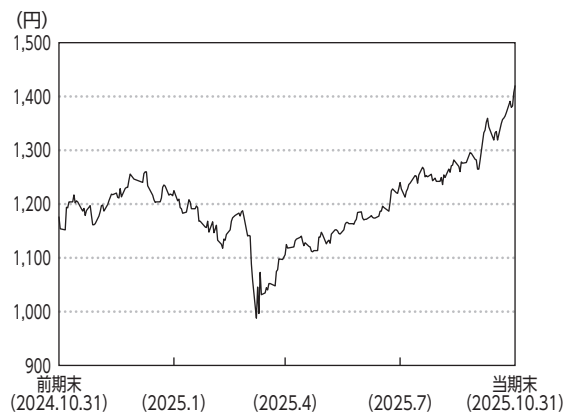
■国別配分



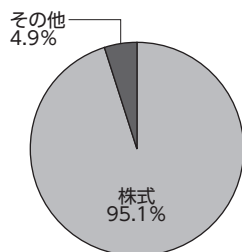
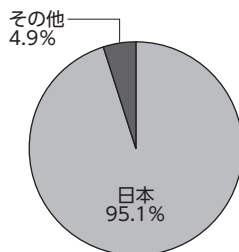
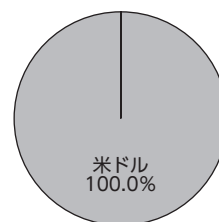
■通貨別配分



（注）資産別・国別・通貨別配分は、2026年8月10日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱーニッセイ・ジャパン・エクイティ・アクティブ・ファンド（適格機関投資家限定）カバード・コール・クラスの概要
■ 税引前分配金再投資基準価額の推移

■ 上位銘柄

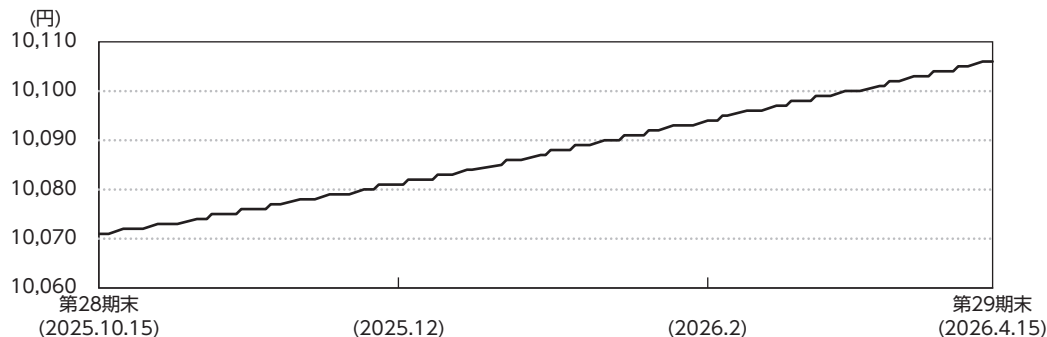
銘柄名	通貨	比率
MITSUBISHI HEAVY INDUSTRI	円	4.3%
NEC CORP	円	4.2
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL	円	4.0
MITSUBISHI CORP	円	3.9
SOFTBANK GROUP CORP	円	3.7
HITACHI LTD	円	3.4
FUJIKURA LTD	円	3.4
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL	円	3.3
TOYOTA TSUSHO CORP	円	3.1
TOKIO MARINE HOLDINGS INC	円	3.0
組入銘柄数	44	

■ 資産別配分

■ 国別配分

■ 通貨別配分


- (注1) 税引前分配金再投資基準価額の推移は、外国投資信託証券の直近の決算期のものであり、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。
- (注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、外国投資信託証券決算日（2025年10月31日現在）のものであり、比率は外国投資信託証券の純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はUBSマネジメント（ケイマン）リミテッドの分類によるものです。
- (注3) 1万口当たりの費用明細につきましては、入手が困難であるため記載していません。
- (注4) 通貨別配分については、実質組入比率を記載しています。
- (注5) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書（全体版）の投資有価証券明細表をご参照下さい。

ニッセイマネーマーケットマザーファンドの概要

■基準価額の推移



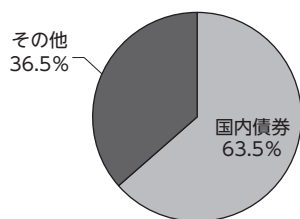
■上位銘柄

銘柄名	通貨	比率
第1回 東京都公募公債 (東京ソーシャルボンド (5年))	円	10.4%
令和3年度第6回 埼玉県公募公債 (5年)	円	10.4
平成28年度第4回 京都市公募公債	円	6.2
第760回 東京都公募公債	円	6.0
平成28年度第1回 静岡市公募公債	円	6.0
第160回 共同発行市場公募地方債	円	5.7
第291回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	円	3.8
第158回 共同発行市場公募地方債	円	3.8
第756回 東京都公募公債	円	3.8
平成28年度第5回 愛知県公募公債	円	3.8
組入銘柄数	11	

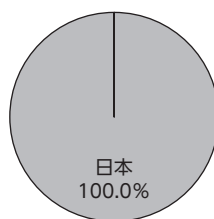
■1万口当たりの費用明細

当期（2025年10月16日～2026年4月15日）における費用はありません。

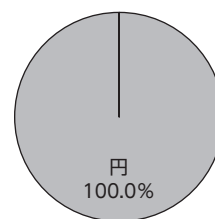
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日（2026年4月15日現在）のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注3) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書（全体版）の組入有価証券明細表をご参照ください。

最近30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額＋ 累計分配金	UBSユニバーサル・ トラスト(ケイマン)IIーニッセイ・ ジャパン・エクイティ・アクティブ・ ファンド(適格機関投資家限定) カバード・コール・クラス	債券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%	円	%	%	百万円
109期 (2024年 3 月11日)	3,006	30	3.9	13,296	98.0	0.0	28,070
110期 (2024年 4 月10日)	3,047	30	2.4	13,367	98.1	0.0	27,657
111期 (2024年 5 月10日)	3,043	30	0.9	13,393	97.9	0.0	27,436
112期 (2024年 6 月10日)	3,149	30	4.5	13,529	98.0	0.0	28,239
113期 (2024年 7 月10日)	3,401	30	9.0	13,811	98.2	0.0	30,206
114期 (2024年 8 月13日)	2,592	30	△22.9	13,032	97.9	0.0	22,817
115期 (2024年 9 月10日)	2,591	30	1.1	13,061	97.7	0.0	22,975
116期 (2024年10月10日)	2,785	30	8.6	13,285	98.0	0.0	24,533
117期 (2024年11月11日)	2,865	30	3.9	13,395	98.1	0.0	25,132
118期 (2024年12月10日)	2,820	30	△ 0.5	13,380	98.1	0.0	24,361
119期 (2025年 1 月10日)	2,927	30	4.9	13,517	98.2	0.0	25,014
120期 (2025年 2 月10日)	2,719	30	△ 6.1	13,339	98.1	0.0	23,143
121期 (2025年 3 月10日)	2,575	30	△ 4.2	13,225	97.8	0.0	21,878
122期 (2025年 4 月10日)	2,240	30	△11.8	12,920	97.8	0.0	19,028
123期 (2025年 5 月12日)	2,510	30	13.4	13,220	98.0	0.0	21,437
124期 (2025年 6 月10日)	2,515	30	1.4	13,255	98.0	0.0	21,457
125期 (2025年 7 月10日)	2,532	30	1.9	13,302	98.0	0.0	21,368
126期 (2025年 8 月12日)	2,635	30	5.3	13,435	98.0	0.0	21,244
127期 (2025年 9 月10日)	2,644	30	1.5	13,474	98.1	0.0	21,134
128期 (2025年10月10日)	2,819	30	7.8	13,679	98.4	0.0	22,108
129期 (2025年11月10日)	2,892	30	3.7	13,782	98.0	0.0	22,443
130期 (2025年12月10日)	2,931	30	2.4	13,851	98.1	0.0	22,014
131期 (2026年 1 月13日)	3,011	30	3.8	13,961	98.1	0.0	22,020
132期 (2026年 2 月10日)	3,150	30	5.6	14,130	98.1	0.0	22,831
133期 (2026年 3 月10日)	2,985	30	△ 4.3	13,995	97.9	0.0	21,624
134期 (2026年 4 月10日)	3,191	30	7.9	14,231	98.2	0.0	22,680
135期 (2026年 5 月11日)	3,312	30	4.7	14,382	98.3	0.0	23,361
136期 (2026年 6 月10日)	3,298	30	0.5	14,398	98.0	0.0	22,798
137期 (2026年 7 月10日)	3,412	30	4.4	14,542	98.0	0.0	23,407
138期 (2026年 8 月10日)	3,205	30	△ 5.2	14,365	98.0	0.0	21,928

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

(注2) 「基準価額＋累計分配金」は、当該決算期の基準価額(分配落)に当該決算期以前の税引前分配金の累計額を加えたものです。

(注3) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

(注4) 作成期とは運用報告書を作成する期間をいい、上表の網掛け部分が当作成期です。以下同じです。

(注5) 当ファンドはコンセプトに適った指数が存在しないことから、ベンチマークなどを設けていません。

当作成期中の基準価額と市況等の推移

年月日		基準価額	騰落率	UBSユニバーサル・ トラスト(ケイマン)Ⅱ－ニッセイ・ ジャパン・エクイティ・アクティブ・ ファンド(適格機関投資家限定) カバード・コール・クラス	債券 組入比率
第 133 期	(期首)	円	%	%	%
	2026年2月10日	3,150	－	98.1	0.0
	2月末	3,260	3.5	98.5	0.0
	(期末)				
第 134 期	2026年3月10日	3,015	△4.3	97.9	0.0
	(期首)				
	2026年3月10日	2,985	－	97.9	0.0
	3月末	3,021	1.2	98.4	0.0
第 135 期	(期末)				
	2026年4月10日	3,221	7.9	98.2	0.0
	(期首)				
	2026年4月10日	3,191	－	98.2	0.0
第 136 期	4月末	3,328	4.3	98.2	0.0
	(期末)				
	2026年5月11日	3,342	4.7	98.3	0.0
	(期首)				
第 137 期	2026年5月11日	3,312	－	98.3	0.0
	5月末	3,323	0.3	98.2	0.0
	(期末)				
	2026年6月10日	3,328	0.5	98.0	0.0
第 138 期	(期首)				
	2026年6月10日	3,298	－	98.0	0.0
	6月末	3,483	5.6	98.3	0.0
	(期末)				
第 139 期	2026年7月10日	3,442	4.4	98.0	0.0
	(期首)				
	2026年7月10日	3,412	－	98.0	0.0
	7月末	3,142	△7.9	98.0	0.0
第 140 期	(期末)				
	2026年8月10日	3,235	△5.2	98.0	0.0

(注) 期末基準価額は分配金（税引前）込み、騰落率は期首比です。

売買および取引の状況

2026年2月11日～2026年8月10日

(1) 投資信託証券

	第133期～第138期			
	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－ ニッセイ・ジャパン・エクイティ・アクティブ・ファンド （適格機関投資家限定）カバード・コール・クラス	千口 182,442	千円 2,194,960	千口 222,190	千円 2,711,110

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 口数および金額の単位未満は切り捨てています。以下同じです。

(2) 親投資信託受益証券の設定、解約状況

	第133期～第138期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	千口 －	千円 －	千口 －	千円 －

(注) 当作成期における親投資信託受益証券の設定、解約はありません。

利害関係人との取引状況等

2026年2月11日～2026年8月10日

当作成期における利害関係人との取引はありません。

組入有価証券明細表

2026年8月10日現在

(1) 投資信託証券

ファンド名	第132期末	第138期末		
	口数	口数	評価額	比率
UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱー ニッセイ・ジャパン・エクイティ・アクティブ・ファンド （適格機関投資家限定）カバード・コール・クラス	千口 1,855,510	千口 1,815,762	千円 21,498,628	% 98.0
合計	1,855,510	1,815,762	21,498,628	98.0

(注1) 比率は、当作成期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 口数および評価額の単位未満は切り捨てています。以下同じです。

(2) 親投資信託残高

種類	第132期末	第138期末	
	口数	口数	評価額
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	千口 9	千口 9	千円 10

(注) 当作成期末におけるニッセイマネーマーケットマザーファンド全体の口数は5,066,525千口です。

投資信託財産の構成

2026年8月10日現在

項目	第138期末	
	評価額	比率
UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱー ニッセイ・ジャパン・エクイティ・アクティブ・ファンド （適格機関投資家限定）カバード・コール・クラス	千円 21,498,628	% 97.0
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	10	0.0
コール・ローン等、その他	662,743	3.0
投資信託財産総額	22,161,382	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

	(2026年3月10日)	(2026年4月10日)	(2026年5月11日)	(2026年6月10日)	(2026年7月10日)	(2026年8月10日) 現在
項目	第133期末	第134期末	第135期末	第136期末	第137期末	第138期末
(A) 資産	21,877,077,432円	22,951,709,084円	23,664,954,566円	23,050,789,289円	23,642,960,604円	22,161,382,409円
コール・ローン等	699,041,822	684,048,965	703,220,873	711,655,267	712,117,352	662,743,801
UBSユニバーサル・トラスト (ケイマン)Ⅱーニッセイ・ ジャパン・エクイティ・ アクティブ・ファンド (適格機関投資家限定) カバード・コール・ ク ラ ス(評価額)	21,178,025,536	22,267,650,039	22,961,723,607	22,339,123,929	22,930,833,151	21,498,628,498
ニッセイマネーマーケット マザーファンド(評価額)	10,074	10,080	10,086	10,093	10,101	10,110
(B) 負債	252,777,722	270,892,856	303,251,277	252,064,988	235,454,231	233,084,270
未払収益分配金	217,340,729	213,239,293	211,638,128	207,391,461	205,818,963	205,234,242
未払解約金	15,589,371	36,503,180	69,505,691	23,275,940	7,553,759	5,910,530
未払信託報酬	19,806,374	21,105,518	22,061,662	21,353,265	22,036,519	21,893,863
その他未払費用	41,248	44,865	45,796	44,322	44,990	45,635
(C) 純資産総額(A-B)	21,624,299,710	22,680,816,228	23,361,703,289	22,798,724,301	23,407,506,373	21,928,298,139
元 本	72,446,909,721	71,079,764,334	70,546,042,931	69,130,487,123	68,606,321,244	68,411,414,095
次期繰越損益金	△50,822,610,011	△48,398,948,106	△47,184,339,642	△46,331,762,822	△45,198,814,871	△46,483,115,956
(D) 受益権総口数	72,446,909,721口	71,079,764,334口	70,546,042,931口	69,130,487,123口	68,606,321,244口	68,411,414,095口
1万口当たり基準価額(C/D)	2,985円	3,191円	3,312円	3,298円	3,412円	3,205円

(注1) 当作成期首元本額 72,488,197,659円

 当作成期中追加設定元本額 2,291,880,325円

 当作成期中一部解約元本額 6,368,663,889円

(注2) 元本の欠損

 当作成期末の純資産総額は元本額を下回っており、その差額は46,483,115,956円です。

損益の状況

	(第133期 第134期 第135期)	2026年2月11日～2026年3月10日) 2026年3月11日～2026年4月10日) 2026年4月11日～2026年5月11日)	(第136期 第137期 第138期)	2026年5月12日～2026年6月10日) 2026年6月11日～2026年7月10日) 2026年7月11日～2026年8月10日)		
項目	第133期	第134期	第135期	第136期	第137期	第138期
(A) 配 当 等 収 益	367,814,011円	365,770,358円	367,369,628円	361,786,457円	361,018,593円	360,328,877円
受 取 配 当 金	367,555,891	365,486,684	367,102,382	361,519,626	360,691,381	359,924,982
受 取 利 息	258,120	283,674	267,246	266,831	327,212	403,895
(B) 有価証券売買損益	△ 1,318,680,414	1,332,362,601	717,268,005	△ 227,084,626	646,100,484	△ 1,544,668,243
売 買 益	3,488,945	1,338,894,159	720,671,633	7,552,634	656,667,392	6,549,315
売 買 損	△ 1,322,169,359	△ 6,531,558	△ 3,403,628	△ 234,637,260	△ 10,566,908	△ 1,551,217,558
(C) 信 託 報 酬 等	△ 19,847,622	△ 21,150,383	△ 22,107,458	△ 21,397,587	△ 22,081,509	△ 21,939,498
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 970,714,025	1,676,982,576	1,062,530,175	113,304,244	985,037,568	△ 1,206,278,864
(E) 前期繰越損益金	△ 8,863,035,157	△ 9,820,207,920	△ 8,270,080,673	△ 7,240,381,587	△ 7,249,137,410	△ 6,423,721,869
(分準備積立金)	(8,791,770,724)	(8,717,441,431)	(8,773,771,509)	(8,706,989,123)	(8,737,139,496)	(8,820,985,773)
(繰越欠損金)	(△17,654,805,881)	(△18,537,649,351)	(△17,043,852,182)	(△15,947,370,710)	(△15,986,276,906)	(△15,244,707,642)
(F) 追加信託差損益金*	△40,771,520,100	△40,042,483,469	△39,765,151,016	△38,997,294,018	△38,728,896,066	△38,647,880,981
(配当等相当額)	(20,793,459,868)	(20,437,940,942)	(20,309,726,257)	(19,938,702,457)	(19,823,884,106)	(19,806,220,272)
(売買損益相当額)	(△61,564,979,968)	(△60,480,424,411)	(△60,074,877,273)	(△58,935,996,475)	(△58,552,780,172)	(△58,454,101,253)
(G) 合 計(D + E + F)	△50,605,269,282	△48,185,708,813	△46,972,701,514	△46,124,371,361	△44,992,995,908	△46,277,881,714
(H) 収 益 分 配 金	△ 217,340,729	△ 213,239,293	△ 211,638,128	△ 207,391,461	△ 205,818,963	△ 205,234,242
次期繰越損益金(G + H)	△50,822,610,011	△48,398,948,106	△47,184,339,642	△46,331,762,822	△45,198,814,871	△46,483,115,956
追加信託差損益金	△40,771,520,100	△40,042,483,469	△39,765,151,016	△38,997,294,018	△38,728,896,066	△38,647,880,981
(配当等相当額)	(20,793,459,868)	(20,437,940,942)	(20,309,726,257)	(19,938,702,457)	(19,823,884,106)	(19,806,220,272)
(売買損益相当額)	(△61,564,979,968)	(△60,480,424,411)	(△60,074,877,273)	(△58,935,996,475)	(△58,552,780,172)	(△58,454,101,253)
分配準備積立金	8,922,396,384	8,865,416,704	8,922,015,213	8,839,986,532	8,884,422,905	8,954,140,910
繰越欠損金	△18,973,486,295	△17,221,881,341	△16,341,203,839	△16,174,455,336	△15,354,341,710	△16,789,375,885

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。

(注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越欠損金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

(注4) (F)追加信託差損益金*とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

分配金の計算過程

項目	第133期	第134期	第135期	第136期	第137期	第138期
(a) 経費控除後の配当等収益	347,966,389円	361,214,566円	359,881,832円	340,388,870円	353,102,372円	338,389,379円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0円	0円	0円	0円	0円	0円
(c) 信託約款に定める収益調整金	20,793,459,868円	20,437,940,942円	20,309,726,257円	19,938,702,457円	19,823,884,106円	19,806,220,272円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	8,791,770,724円	8,717,441,431円	8,773,771,509円	8,706,989,123円	8,737,139,496円	8,820,985,773円
(e) 分配対象額(a + b + c + d)	29,933,196,981円	29,516,596,939円	29,443,379,598円	28,986,080,450円	28,914,125,974円	28,965,595,424円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	4,131.74円	4,152.60円	4,173.64円	4,192.95円	4,214.50円	4,234.03円
(g) 分配金	217,340,729円	213,239,293円	211,638,128円	207,391,461円	205,818,963円	205,234,242円
(h) 分配金(1万口当たり)	30円	30円	30円	30円	30円	30円

<課税上の取り扱いについて>

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、「普通分配金」と「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となり、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）、残りの部分が普通分配金となります。
- ・受益者は普通分配金に対し課税されます。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合、個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の新しい個別元本となります。

お知らせ

■約款変更

「一般社団法人投資信託協会」と「一般社団法人日本投資顧問業協会」の合併に伴い関連条項に所要の変更を行いました。

（2026年4月1日）

運用者情報

■当社運用担当者情報について

・当社の運用担当者情報はHP上よりご確認ください。

■J P X日経400アクティブ・プレミアム・オープン（毎月決算型）



<https://www.nam.co.jp/fundinfo/njn4apom/main.html>

当ファンドの概要

商 信	品 託	分 期	類 間	追加型投信／国内／株式 2015年2月12日～2028年8月10日
運	用	方	針	外国投資信託証券への投資を通じて、国内の金融商品取引所上場株式を実質的な主要投資対象とするとともに、為替取引を活用し米ドルへの投資効果の享受、株式および通貨のカバードコール戦略によるオプションプレミアムの獲得をめざすことにより、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。
主要運用対象	J P X日経400アクティブ・プレミアム・オープン(毎月決算型)			「UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－ニッセイ・ジャパン・エクイティ・アクティブ・ファンド（適格機関投資家限定）カバード・コール・クラス」および「ニッセイマネーマーケットマザーファンド」
	UBSユニバーサル・トラスト(ケイマン)Ⅱ－ニッセイ・ジャパン・エクイティ・アクティブ・ファンド(適格機関投資家限定)カバード・コール・クラス			国内の金融商品取引所に上場している日本企業の株式
	ニッセイマネーマーケットマザーファンド			円建ての短期公社債および短期金融商品
運	用	方	法	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ・外貨建資産への直接投資は行いません。 ・株式への直接投資は行いません。
分	配	方	針	毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向、残存信託期間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には、分配を行わないこともあります。

以下は、「UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－ニッセイ・ジャパン・エクイティ・アクティブ・ファンド（適格機関投資家限定）米ドル・クラス」および「UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－ニッセイ・ジャパン・エクイティ・アクティブ・ファンド（適格機関投資家限定）カバード・コール・クラス」（ケイマン籍外国投資信託証券）の2025年10月31日現在の財務諸表のうち、同ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。

同ファンドの財務諸表は、現地の諸法規に準拠して作成されており、独立監査人の監査を受けております。なお、「投資有価証券明細表」については、独立監査人の監査を受けておりません。

(1) 損益計算書（2024年11月1日～2025年10月31日）

＜UBSユニバーサル・トラスト（ケイマン）Ⅱ－ニッセイ・ジャパン・エクイティ・アクティブ・ファンド（適格機関投資家限定）＞

	(円)
投資純収益（損失）	5,056,234,898
外国為替取引における純収益（損失）	(2,439)
受取配当金	569,493,000
スワップ収益（損失）	216,520,334
金融資産投資純収益	5,842,245,793
利息収入	101
収益合計	5,842,245,894
投資運用報酬	113,343,307
管理事務代行報酬および信託報酬	26,519,256
名義書換代行報酬	51,465,037
取引費用	22,362,926
その他費用	27,582,245
費用合計	241,272,771
税引前利益	5,600,973,123
源泉税	(87,217,857)
分配前純資産増減額	5,513,755,266
分配金	(4,813,844,317)
分配後純資産増減額	699,910,949

(2) 投資有価証券明細表 (2025年10月31日現在)

NISSAY JAPAN EQUITY ACTIVE FUND

Description	Holding / Shares	Issue/ Settle Curr	Market Value (Base)
MITSUBISHI HEAVY INDUSTRI	271,100.0000	JPY	1,261,428,300.00
NEC CORP	219,400.0000	JPY	1,232,589,200.00
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL	283,200.0000	JPY	1,178,961,600.00
MITSUBISHI CORP	309,500.0000	JPY	1,148,864,000.00
SOFTBANK GROUP CORP	39,900.0000	JPY	1,079,893,500.00
HITACHI LTD	191,100.0000	JPY	1,016,269,800.00
FUJIKURA LTD	46,800.0000	JPY	990,756,000.00
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL	423,200.0000	JPY	986,056,000.00
TOYOTA TSUSHO CORP	193,700.0000	JPY	913,682,900.00
TOKIO MARINE HOLDINGS INC	154,100.0000	JPY	891,006,200.00
ITOCHU CORP	98,000.0000	JPY	875,238,000.00
MITSUBISHI ELECTRIC CORP	196,300.0000	JPY	847,427,100.00
NINTENDO CO LTD	64,000.0000	JPY	834,880,000.00
TOYOTA MOTOR CORP	265,100.0000	JPY	831,883,800.00
ADVANTEST CORP	34,900.0000	JPY	807,411,500.00
SONY GROUP CORP	179,600.0000	JPY	778,027,200.00
RESONA HOLDINGS INC	481,900.0000	JPY	719,717,650.00
OBIC CO LTD	141,800.0000	JPY	678,796,600.00
HOYA CORP	25,800.0000	JPY	647,193,000.00
KAJIMA CORP	119,400.0000	JPY	594,134,400.00
RECRUIT HOLDINGS CO LTD	75,500.0000	JPY	581,954,000.00
SUMITOMO REALTY & DEVELOP	88,300.0000	JPY	581,102,300.00
KEYENCE CORP	9,800.0000	JPY	562,226,000.00
ZOZO INC	412,900.0000	JPY	550,602,150.00
TOKYO ELECTRON LTD	15,700.0000	JPY	536,626,000.00
TOHO CO LTD	59,200.0000	JPY	536,115,200.00
MITSUMI FUDOSAN CO LTD	320,200.0000	JPY	512,800,300.00
FAST RETAILING CO LTD	9,000.0000	JPY	509,940,000.00
KYUSHU ELECTRIC POWER CO	334,500.0000	JPY	506,767,500.00
CAPCOM CO LTD	124,100.0000	JPY	500,619,400.00
KDDI CORP	185,300.0000	JPY	456,115,950.00
NOMURA RESEARCH INSTITUTE	66,600.0000	JPY	401,598,000.00
CHUGAI PHARMACEUTICAL CO	53,800.0000	JPY	379,236,200.00
SHIONOGI & CO LTD	145,900.0000	JPY	376,422,000.00
MITSUMI KINZOKU CO LIMITED	21,500.0000	JPY	338,840,000.00
FUKUOKA FINANCIAL GROUP I	73,000.0000	JPY	327,405,000.00
OTSUKA CORP	103,300.0000	JPY	315,065,000.00
DISCO CORP	5,400.0000	JPY	278,694,000.00
DAIICHI SANKYO CO LTD	75,200.0000	JPY	275,908,800.00
OTSUKA HOLDINGS CO LTD	32,600.0000	JPY	272,992,400.00
NIPPON GAS CO LTD	89,500.0000	JPY	263,890,750.00
DAIFUKU CO LTD	53,500.0000	JPY	263,648,000.00
MIURA CO LTD	67,500.0000	JPY	201,926,250.00
MURATA MANUFACTURING CO L	52,900.0000	JPY	179,436,800.00
EAST JAPAN RAILWAY CO	0.0000	JPY	0.00
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO	0.0000	JPY	0.00

ニッセイマネーマーケット マザーファンド

運用報告書

第 29 期

(計算期間：2025年10月16日～2026年4月15日)

運用方針

- ① 円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざします。
- ② 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場合があります。

主要運用 対象

円建ての短期公社債および短期金融商品

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。
・ 外貨建資産への投資は行いません。



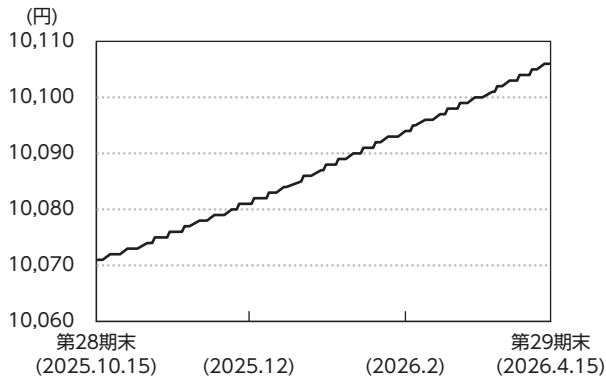
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2025年10月16日～2026年4月15日

基準価額等の推移



■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・前期末以降、利子等収益等が積み上がったこと

(注) 当マザーファンドはベンチマークを設けていません。

ポートフォリオ

円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざしました。

ベンチマークとの差異

当マザーファンドは、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざして運用を行うことから、コンセプトに適った指数が存在しないため、ベンチマークなどを設けていません。

今後の運用方針

当マザーファンドは、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざします。
今後も引き続き、安定した収益確保のため、短期証券を中心に投資していく方針です。

お知らせ

■約款変更

「一般社団法人投資信託協会」と「一般社団法人日本投資顧問業協会」の合併に伴い関連条項に所要の変更を行いました。

(2026年4月1日)

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	債券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		
	円	%	%	百万円
25期 (2024年 4 月15日)	10,025	0.0	83.1	1,391
26期 (2024年10月15日)	10,028	0.0	92.2	1,375
27期 (2025年 4 月15日)	10,043	0.1	73.1	2,007
28期 (2025年10月15日)	10,071	0.3	75.5	2,053
29期 (2026年 4 月15日)	10,106	0.3	63.5	4,800

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	債券 組入比率
	円	%	%
(期首)2025年10月15日	10,071	—	75.5
10月末	10,073	0.0	74.8
11月末	10,078	0.1	79.6
12月末	10,084	0.1	70.8
2026年 1 月末	10,091	0.2	68.3
2 月末	10,096	0.2	68.5
3 月末	10,103	0.3	63.3
(期末)2026年 4 月15日	10,106	0.3	63.5

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2025年10月16日～2026年4月15日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料	－円	－％	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	－	－	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	－	－	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
合計	－	－	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（10,088円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2025年10月16日～2026年4月15日

公社債

		買付額	売付額
国内		千円	千円
	地方債証券	1,865,937	－
	特殊債券	181,642	(557,000)
			－

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 金額の単位未満は切り捨てています。ただし、金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

主要な売買銘柄

2025年10月16日～2026年4月15日

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
第1回 東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年))	498,120	－	－
令和3年度第6回 埼玉県公募公債(5年)	497,630		
平成28年度第4回 京都市公募公債	298,041		
第760回 東京都公募公債	286,297		
平成28年度第1回 静岡市公募公債	285,848		
第291回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,642		

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2026年4月15日現在

国内（邦貨建）公社債

区分	額面金額	評価額	組入比率	当期末 うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	2,875,000 (2,875,000)	2,868,386 (2,868,386)	59.8 (59.8)	—	—	—	59.8 (59.8)
特殊債券 (除く金融債券)	183,000 (183,000)	182,220 (182,220)	3.8 (3.8)	—	—	—	3.8 (3.8)
合計	3,058,000 (3,058,000)	3,050,606 (3,050,606)	63.5 (63.5)	—	—	—	63.5 (63.5)

(注1) 評価については、原則として証券会社、価格情報会社等よりデータを入手しています。ただし、残存期間1年以内の公社債については、償却原価法により評価しています。以下同じです。

(注2) ()内は非上場債であり、上段の数字の内訳です。

(注3) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注4) 額面金額および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、額面金額および評価額が単位未満の場合は、小数で記載しています。以下同じです。

(国内公社債の内訳)

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
地方債証券	第756回 東京都公募公債	0.0500	2026/ 6 /19	182,000	181,821
	第760回 東京都公募公債	0.0450	2026/ 9 /18	288,000	287,005
	第1回 東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年))	0.0050	2026/ 6 /19	500,000	499,305
	平成28年度第5回 愛知県公募公債	0.0700	2026/ 6 /29	182,000	181,792
	平成28年度第1回 広島県公募公債	0.0800	2026/ 5 /25	181,000	180,885
	令和3年度第6回 埼玉県公募公債(5年)	0.0050	2026/ 7 /28	500,000	498,853
	第158回 共同発行市場公募地方債	0.0800	2026/ 5 /25	182,000	181,883
	第160回 共同発行市場公募地方債	0.0500	2026/ 7 /24	272,000	271,516
	平成28年度第1回 静岡市公募公債	0.0600	2026/11/25	288,000	286,561
	平成28年度第4回 京都市公募公債	0.0700	2026/10/23	300,000	298,760
	小計	—	—	—	2,868,386
特殊債券 (除く金融債券)	第291回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.0050	2026/10/30	183,000	182,220
	小計	—	—	—	182,220
	合計	—	—	—	3,050,606

投資信託財産の構成

2026年4月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	3,050,606	63.3
コール・ローン等、その他	1,766,379	36.7
投資信託財産総額	4,816,986	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイマネーマーケットマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2026年4月15日現在)

項目	当期末
(A)資産	4,816,986,155円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,766,041,463
公 社 債 (評価額)	3,050,606,642
未 収 利 息	284,533
前 払 費 用	53,517
(B)負債	16,465,227
未 払 解 約 金	16,465,227
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	4,800,520,928
元 本	4,750,142,861
次 期 繰 越 損 益 金	50,378,067
(D)受 益 権 総 口 数	4,750,142,861口
1万口当たり基準価額 (C / D)	10,106円

- (注1) 期首元本額 2,038,753,014円
 期中追加設定元本額 3,167,158,192円
 期中一部解約元本額 455,768,345円

- (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。

ニッセイグローバル好配当株式プラス (毎月決算型)	10,000円
ニッセイマネーマーケットファンド (適格機関投資家限定)	49,754,738円
ニッセイ豪州ハイ・インカム株式ファンド (毎月決算型)	9,994円
ニッセイアメリカ高配当株ファンド (毎月決算型)	9,984円
ニッセイアメリカ高配当株ファンド (年2回決算型)	9,984円
ニッセイ世界高配当株ファンド (毎月決算型)	9,984円
ニッセイ世界高配当株ファンド (年2回決算型)	9,984円
J P X日経400アクティブ・オープンミドル投資型	9,976円
J P X日経400アクティブ・プレミアム・オープン (毎月決算型)	9,976円
ニッセイ・オーストラリア・リート・オープン (毎月決算型)	9,974円
ニッセイ・オーストラリア・リート・オープン (年2回決算型)	9,974円
ニッセイA I 関連株式ファンド (為替ヘッジあり)	9,967円
ニッセイA I 関連株式ファンド (為替ヘッジなし)	9,967円
ニッセイ豪州ハイ・インカム株式ファンド (資産成長型)	9,968円
D Cニッセイターゲットデットファンド2035	466,742,032円
D Cニッセイターゲットデットファンド2025	2,683,450,997円
ニッセイ/コムジェスト新興国成長株ファンド (資産成長型)	9,969円
ニッセイ/コムジェスト新興国成長株ファンド (年2回決算型)	9,969円
ニッセイA I 関連株式ファンド (年2回決算型・為替ヘッジあり)	9,969円
ニッセイA I 関連株式ファンド (年2回決算型・為替ヘッジなし)	9,969円
D Cニッセイターゲットデットファンド2030	1,549,776,508円
ニッセイ/シュローダー・グローバルCBファンド (年2回決算型・為替ヘッジあり)	9,970円
ニッセイ/シュローダー・グローバルCBファンド (年2回決算型・為替ヘッジなし)	9,970円
ニッセイ/シュローダー・グローバルCBファンド (資産成長型・為替ヘッジあり)	9,970円
ニッセイ/シュローダー・グローバルCBファンド (資産成長型・為替ヘッジなし)	9,970円
グローバル・ディスラプター成長株ファンド (予想分配金提示型)	9,972円
グローバル・ディスラプター成長株ファンド (資産成長型)	9,972円
ニッセイ新興国テクノロジー関連株式ファンド (予想分配金提示型)	9,972円
ニッセイ新興国テクノロジー関連株式ファンド (資産成長型)	9,972円
ニッセイ/シュローダー好利回りCBファンド2023-02 (為替ヘッジあり・既定創価型)	9,974円
既定創価型・最上乗額回生ニッセイ世界1カ国株式厳選ファンド2023-07 (為替ヘッジあり)	9,975円
ニッセイ・マルチアセット・インカム戦略ファンド (資産成長型)	9,975円
ニッセイ・マルチアセット・インカム戦略ファンド (毎月決算型)	9,975円
ニッセイS & P 500リカバリー戦略株式ファンド	9,973円
ニッセイ・インド中小型株式ファンド	9,969円
ニッセイ・インド株式ファンド<購入・換金手数料なし>	9,964円
ニッセイ・インド株式オープン (資産成長型)	9,939円
ニッセイ・インド株式オープン (3ヵ月決算型)	9,939円
ニッセイ/シュローダー好利回りCBファンド2025-09 (為替ヘッジなし・既定創価型)	9,934円
ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド (毎月決算・予想分配金提示型)	9,910円
ニッセイ米国株式ブースト戦略ファンド<為替リスク限定型> (毎月決算・予想分配金提示型)	9,910円
ニッセイ/シュローダー好利回りCBファンド2026-03 (為替ヘッジなし・既定創価型)	9,901円
ニッセイ米国不動産投資法人債ファンド (毎月決算型・為替ヘッジあり)	9,968円
ニッセイ米国不動産投資法人債ファンド (毎月決算型・為替ヘッジなし)	9,968円
ニッセイ米国不動産投資法人債ファンド (年2回決算型・為替ヘッジあり)	9,968円
ニッセイ米国不動産投資法人債ファンド (年2回決算型・為替ヘッジなし)	9,968円

損益の状況

当期 (2025年10月16日～2026年4月15日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	4,472,125円
受 取 利 息	4,472,125
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	8,863,414
売 買 益	8,863,414
(C)当 期 損 益 金 (A + B)	13,335,539
(D)前 期 繰 越 損 益 金	14,433,829
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	26,792,804
(F)解 約 差 損 益 金	△ 4,184,105
(G)合 計 (C + D + E + F)	50,378,067
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	50,378,067

- (注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

- (注2) (E)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。

- (注3) (F)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。