

<毎月決算型>

第108期末 (2022年7月20日)

| | |
|--|--------|
| 基準価額 | 3,921円 |
| 純資産総額 | 12億円 |
| 第103期～第108期 (2022年1月21日～2022年7月20日) | |
| 騰落率 | 3.5% |
| 分配金合計 | 360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。

<年2回決算型>

第18期末 (2022年7月20日)

| | |
|-------|---------|
| 基準価額 | 17,264円 |
| 純資産総額 | 353百万円 |
| 騰落率 | 3.4% |
| 分配金 | 0円 |

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

通貨選択型ニッセイ 世界高配当株ファンド

(毎月決算型) / (年2回決算型)

追加型投信 / 内外 / 資産複合 **特化型**

運用報告書 (全体版)

作成対象期間：2022年1月21日～2022年7月20日

<毎月決算型>

第103期 (決算日2022年2月21日) 第106期 (決算日2022年5月20日)
第104期 (決算日2022年3月22日) 第107期 (決算日2022年6月20日)
第105期 (決算日2022年4月20日) 第108期 (決算日2022年7月20日)

<年2回決算型>

第18期 (決算日2022年7月20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「通貨選択型ニッセイ世界高配当株ファンド(毎月決算型) / (年2回決算型)」は、2022年7月20日に決算を行いました。

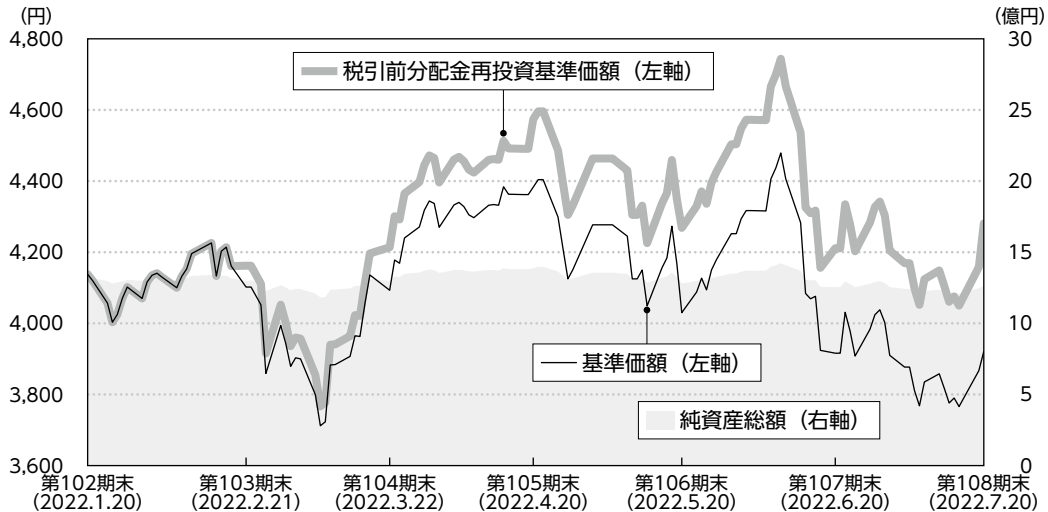
各ファンドは、「NAM・グローバル・ハイディビデンド・エクイティ・ファンド カレンシー・セレクト・クラス」への投資を通じて、日本を含む各国の株式およびリート(不動産投資信託)等を実質的な主要投資対象とするとともに、為替取引を活用し、配当等収益の確保と信託財産の成長を図ることを目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

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。

運用経過

2022年1月21日～2022年7月20日

基準価額等の推移



| | | | |
|--------|--------|----------------|------|
| 第103期首 | 4,138円 | 既払分配金 | 360円 |
| 第108期末 | 3,921円 | 騰落率（分配金再投資ベース） | 3.5% |

（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）当ファンドはベンチマークを設けていません。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・3月中旬から4月中旬にかけて、ロシア・ウクライナ情勢とグローバル景気に対する過度な懸念が一時後退したこと
- ・6月下旬から商品市況の一服などによるインフレのピークアウトへの期待感や米長期金利が落ち着いたこと
- ・世界的に高配当バリュー（割安）株が選別され、保有銘柄の株価が上昇したこと
- ・3月から4月に選定通貨が対円でおおむね上昇したこと

<下落要因>

- ・2月中旬から3月中旬にかけて、ロシア・ウクライナ情勢に対する懸念とインフレによる悪影響が嫌気され、世界株式市場が下落したこと
- ・4月下旬から5月中旬にかけて、米連邦準備制度理事会（F R B）の積極的な金融引き締め姿勢やロシア・ウクライナ情勢、中国のロックダウン（都市封鎖）長期化などがもたらすグローバル景気に対する懸念
- ・6月上旬から中旬にかけて、世界的な景気後退や金融引き締め加速への懸念

1 万口当たりの費用明細

| 項目 | 第103期～第108期 | | 項目の概要 |
|--------|-------------|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| 信託報酬 | 25円 | 0.611% | $\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は4,113円です。</p> |
| （投信会社） | （ 7） | （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） | （18） | （0.436） | 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） | （ 1） | （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 | 0.004 | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 |
| （監査費用） | （ 0） | （0.004） | 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 |
| （その他） | （ 0） | （0.000） | <ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息 |
| 合計 | 25 | 0.616 | |

（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。

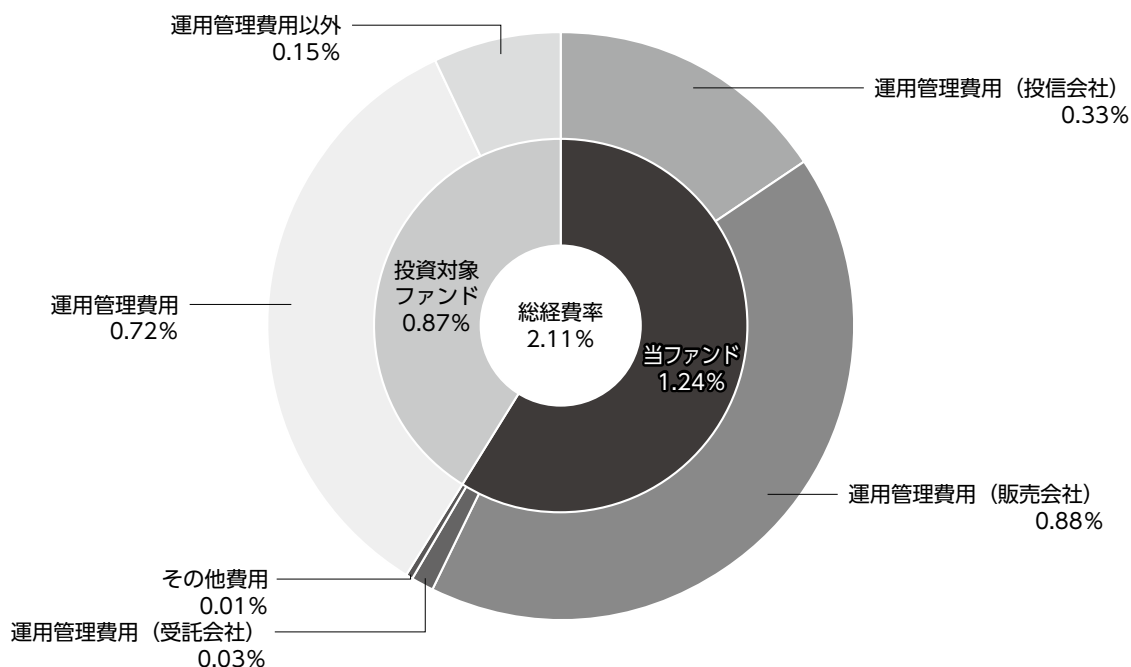
（注 3）比率欄は「1 万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第 3 位未満は四捨五入しています。

（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2.11%**です。



| 総経費率（①＋②＋③） | 2.11% |
|-----------------------|-------|
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.24% |
| ②投資対象ファンドの運用管理費用の比率 | 0.72% |
| ③投資対象ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.15% |

（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。

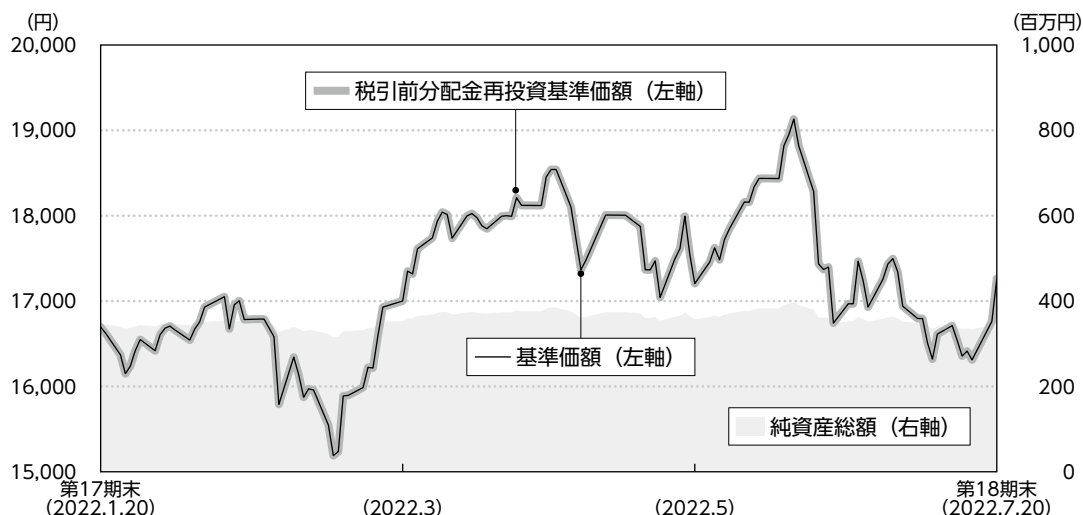
（注4）投資対象ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く）です。

（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。

基準価額等の推移



| | | | |
|-------|---------|-----------------|------|
| 第18期首 | 16,696円 | 既払分配金 | 0円 |
| 第18期末 | 17,264円 | 騰落率 (分配金再投資ベース) | 3.4% |

(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) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・ 3月中旬から4月中旬にかけて、ロシア・ウクライナ情勢とグローバル景気に対する過度な懸念が一時的に後退したこと
- ・ 6月下旬から商品市況の一服などによるインフレのピークアウトへの期待感や米長期金利が落ち着いたこと
- ・ 世界的に高配当バリュー（割安）株が選別され、保有銘柄の株価が上昇したこと
- ・ 3月から4月に選定通貨が対円でおおむね上昇したこと

<下落要因>

- ・ 2月中旬から3月中旬にかけて、ロシア・ウクライナ情勢に対する懸念とインフレによる悪影響が嫌気され、世界株式市場が下落したこと
- ・ 4月下旬から5月中旬にかけて、米連邦準備制度理事会（F R B）の積極的な金融引き締め姿勢やロシア・ウクライナ情勢、中国のロックダウン（都市封鎖）長期化などがもたらすグローバル景気に対する懸念
- ・ 6月上旬から中旬にかけて、世界的な景気後退や金融引き締め加速への懸念

1 万口当たりの費用明細

| 項目 | 第18期 | | 項目の概要 |
|--------|-------|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| 信託報酬 | 105円 | 0.612% | $\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は17,219円です。</p> |
| (投信会社) | (28) | (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) | (75) | (0.436) | 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) | (2) | (0.014) | 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 | 1 | 0.005 | $\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$ |
| (監査費用) | (1) | (0.005) | 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 |
| (その他) | (0) | (0.000) | <ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息 |
| 合計 | 106 | 0.618 | |

(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。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。

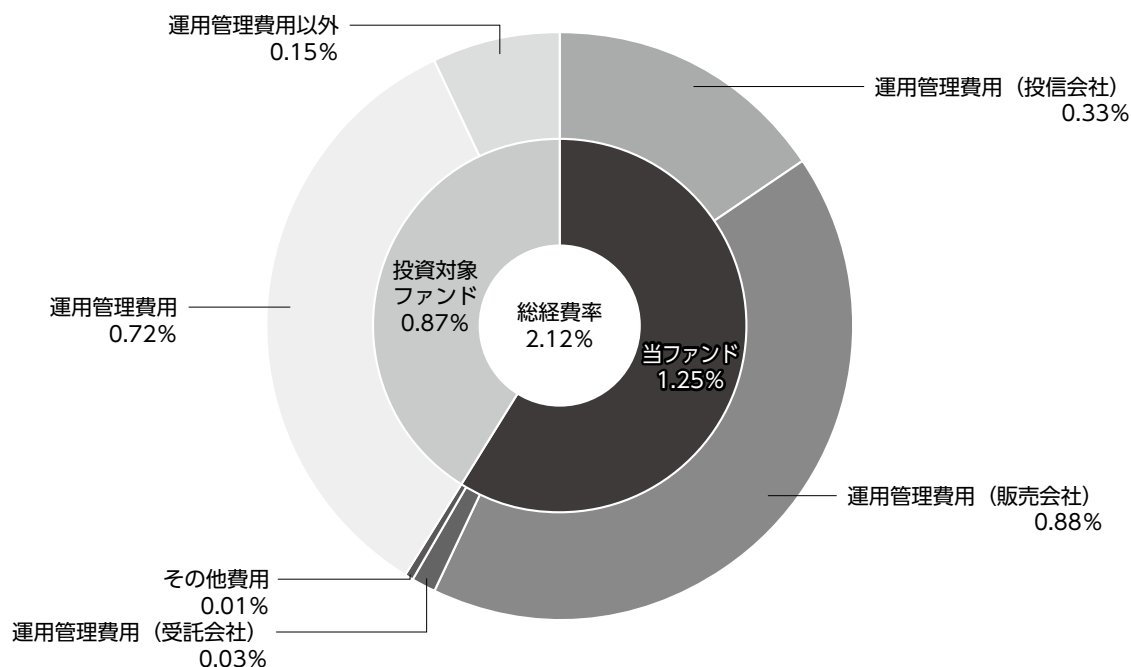
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

(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

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2.12%**です。



| 総経費率（①+②+③） | 2.12% |
|-----------------------|-------|
| ①当ファンドの費用の比率 | 1.25% |
| ②投資対象ファンドの運用管理費用の比率 | 0.72% |
| ③投資対象ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.15% |

（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。

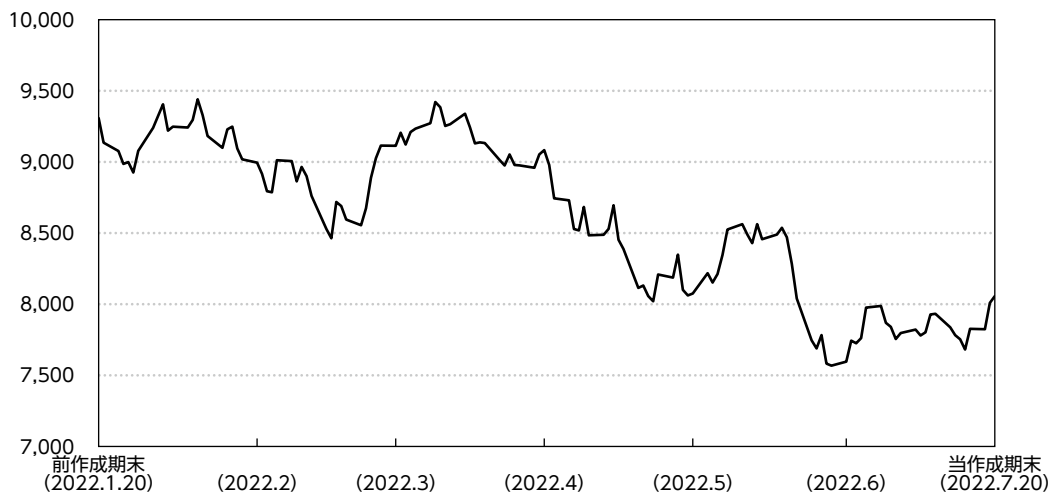
（注6）①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

（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

■ 海外株式市況

【MSCI World（配当込み、米ドルベース）の推移】

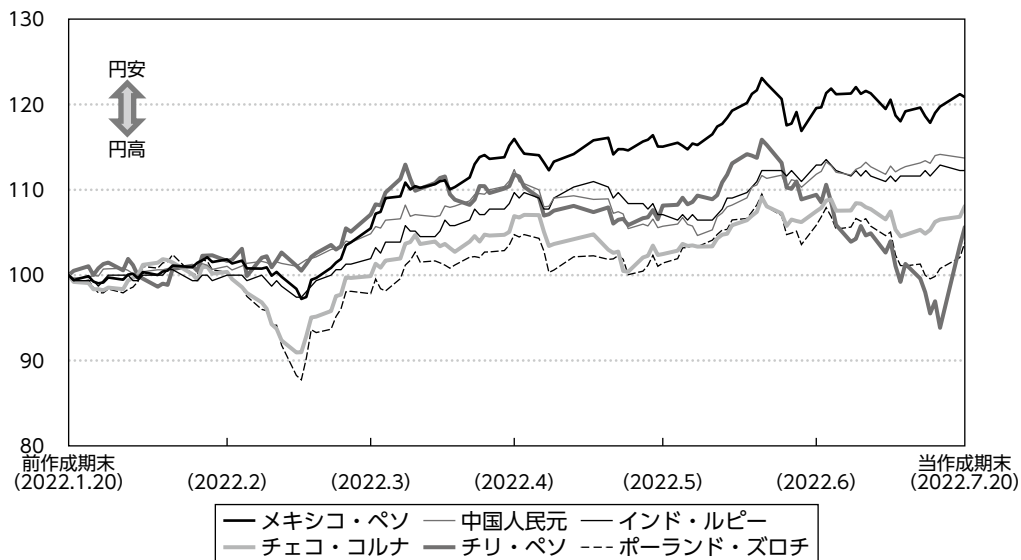


(注) 指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当作成期の世界株式市場は、世界的な金融引き締めやロシア・ウクライナ情勢、インフレへの悪影響や景気後退が嫌気され、下落する展開となりました。F R Bは積極的な金融緩和引き締めを進め、新型コロナウイルス禍での上昇をけん引してきたグロース（成長）株が大きく下落する傾向が続き、セクターローテーション（景気の局面ごとに有望な業種別銘柄群に投資対象を切り替えていく戦略）の動きも継続しました。特にロシア・ウクライナ情勢の悪化により世界的にエネルギー価格が高騰するなど、インフレ懸念と相まって金融市場でリスク回避の動きが強まりました。中国のロックダウン長期化やインフレによる消費への悪影響、エネルギーをめぐる混乱などがもたらすグローバル景気への懸念が高まりました。

■為替市況

【為替レートの推移】



(注) 上のグラフは、ファンドで当作成期において投資実績のある通貨の対円為替レートを前作成期末を100として指数化したものです。

当作成期の選定通貨は、当作成期初から6月上旬にかけてロシア・ウクライナ情勢の長期化などによるリスク回避的な動きから下押しする場面もあったものの、物価上昇に対応した各国中央銀行の利上げや商品価格の上昇を受けて、おおむね堅調に推移しました。一方、日本は金融緩和を維持したことで各国の金融政策との方向性の違いが意識され、円は主要通貨に対して下落し、選定通貨高円安基調が続きました。当作成期末にかけては、急速な利上げによる景気減速懸念が意識され、横ばいまたは選定通貨安円高へと移行しました。

個別通貨については、2月から3月上旬にかけてのロシア・ウクライナ情勢悪化局面において、ウクライナから相対的に距離の近い国の通貨であるチェコ・コルナやポーランド・ズロチが大きく下落する一方で、相対的に影響が軽微との見方が広がった中国人民元は堅調な動きとなりました。6月上旬から7月中旬にかけては、銅価格の下落等を背景にチリ・ペソが大幅に下落しました。

ポートフォリオ

■各ファンド

当作成期も外国投資信託証券への投資を通じて、日本を含む各国の株式およびリート等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、配当等収益の確保と信託財産の成長を図ることを目標に運用を行いました。

■NAM・グローバル・ハイディビデンド・エクイティ・ファンド カレンシー・セレクト・クラス

*現地における当作成期末の前営業日基準についての説明です。

<個別銘柄>

主に日本を含む各国の株式およびリート等に分散投資し、予想配当利回り、配当政策、流動性および個別企業分析・株価評価等を勘案してポートフォリオを構築しました。

当作成期末においても、配当利回りが相対的に高い銘柄を保有しています。総合エネルギー企業、世界的なIT（情報技術）サービス企業、飲料メーカー、医薬品メーカー、通信サービス会社など、インフレ環境下で価格決定力があり、優れた経営戦略を有し、強固なビジネス基盤や内部の自助努力、今後も高い配当が期待できるキャッシュフロー創出力に優れたものが多く、今後の利益成長も期待できバリュエーション（企業の利益・資産など、本来の企業価値と比較して、相対的な株価の割高・割安を判断する指標）も魅力的な水準にあると判断される企業を中心に上位に保有しています。

<国・地域別配分>

当作成期末では組入比率の高い順にアメリカ（48.2%）、台湾（9.5%）、イギリス（9.3%）としています。

（注1）国、地域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2）比率は対組入株式等評価額比です。

<業種配分>

当作成期末では、デジタル社会が進む中で強い需要が継続しているクラウド・データセンター向けなどのエンド市場の成長を背景に高い需要が見込まれているITサービスや半導体などの関連企業を中心とした「情報技術」、金融緩和の正常化過程において安定した業績環境が見込めるBDC（ビジネス・デベロップメント・カンパニー）や銀行などの「金融」、コスト競争力のある資産と厳格な投資ディシプリン（規律）・株主還元のパラメータが取れた総合エネルギー企業を中心とした「エネルギー」の組入比率が高いポートフォリオとしています。

（注）業種はGICS分類（セクター）によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&PおよびMSCI Inc.に帰属します。

<為替取引>

原則として「原資産通貨」売り／「選定通貨」買いの為替取引を利用し、選定通貨で実質的な運用を行いました。

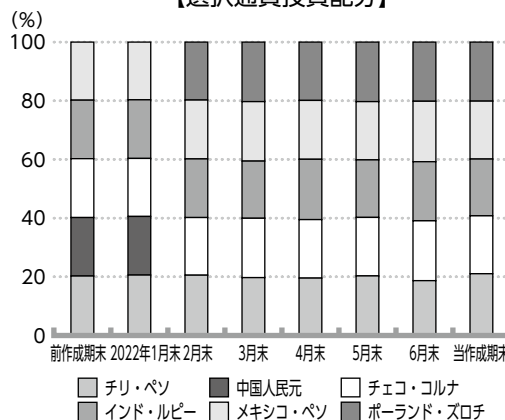
（注1）原資産通貨とは、保有資産の表示通貨です。

（注2）選定通貨とは、運用会社が選定した複数の通貨です。

<選定通貨投資配分>

金利水準やファンダメンタルズ（経済の諸条件、経済の基礎的条件）、流動性等を勘案し、適宜見直しを行いました。その結果、当作成期末ではチリ・ペソ、ポーランド・ズロチ、メキシコ・ペソ、チェコ・コルナ、インド・ルピーの5通貨としています。

【選定通貨投資配分】



(注) 比率は対選定通貨評価額比です。

■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

■毎月決算型

当ファンドは、外国投資信託証券への投資を通じて、日本を含む各国の株式およびリート等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、配当等収益の確保と信託財産の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ため、ベンチマークなどを設けていません。

■年2回決算型

当ファンドは、外国投資信託証券への投資を通じて、日本を含む各国の株式およびリート等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、配当等収益の確保と信託財産の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ため、ベンチマークなどを設けていません。

分配金

■ 毎月決算型

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103期 2022年1月21日 ～ 2022年2月21日 | 第104期 2022年2月22日 ～ 2022年3月22日 | 第105期 2022年3月23日 ～ 2022年4月20日 | 第106期 2022年4月21日 ～ 2022年5月20日 | 第107期 2022年5月21日 ～ 2022年6月20日 | 第108期 2022年6月21日 ～ 2022年7月20日 |
|------------|--|--|--|--|--|--|
| 当期分配金（税引前） | 60円 | 60円 | 60円 | 60円 | 60円 | 60円 |
| 対基準価額比率 | 1.44% | 1.44% | 1.35% | 1.47% | 1.51% | 1.51% |
| 当期の収益 | 60円 | 60円 | 60円 | 60円 | 60円 | 60円 |
| 当期の収益以外 | — | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,958円 | 2,974円 | 2,994円 | 3,011円 | 3,028円 | 3,046円 |

■ 年2回決算型

当期の分配金は、基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案した結果、見送らせていただきました。

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 | 当期 2022年1月21日～2022年7月20日 |
|------------|-----------------------------|
| 当期分配金（税引前） | — |
| 対基準価額比率 | — |
| 当期の収益 | — |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 23,610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

■各ファンド

今後も、外国投資信託証券への投資を通じて、日本を含む各国の株式およびリート等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、配当等収益の確保と信託財産の成長を図ることを目標に運用を行います。

■NAM・グローバル・ハイディビデンド・エクイティ・ファンド カレンシー・セレクト・クラス

不透明な相場環境が続く株式市場の物色も目まぐるしく変化する中で、高配当銘柄はインフレヘッジ（インフレによる資産価値の相対的下落による損失回避）目的に適しているものがあり、投資対象として比較的良好な位置にあると判断しています。当ファンドの高配当銘柄は強固なビジネス基盤や内部の自助努力、今後も高い配当が期待できるキャッシュフロー創出力に優れたものが多く、バリュエーションも魅力的な水準にあると判断しています。引き続き、適切な財務レバレッジ（借入金などを利用して多くの資金を事業に投下すること）により、着実なキャッシュフローの創出で配当支払いをしっかりとカバーでき、今後の業績・配当成長と利回りのバランスがとれた銘柄を選別していくことが重要であると考えています。

このような環境のもと、投資の視点で注目すべきことは引き続き、先進国株式市場においては確かな経営執行能力を持つ企業への厳選投資であると考えています。一方、新興国株式市場においては魅力ある成長性とバリュエーションを持つ企業への選別投資が必要であると考えており、そのためには業績の裏付けがある個別企業の成長性や、豊富な手元流動性（すぐに支払いにあてることのできる資産）の有効活用など、企業の資本政策に対する考え方に注目すべきであると考えています。

当ファンドでは特に高配当銘柄に着目し投資銘柄を厳選しています。しかし、単純に配当利回り水準のみに注目すると、成長力が乏しく、万年割安な銘柄（株価上昇が見込めない銘柄）を選択する懸念があります。そのため、個別企業の徹底した調査・分析を実施し、企業の資本政策を見極め、配当利回りが高いだけでなく、成長性が見込め、かつ、株価の上昇が期待できる銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築します。

今後も個別企業とのコンタクトに力点を置き、企業の配当政策や成長戦略を把握した上で、事業の収益性と安定性のバランス、今後の利益成長も見込める企業を厳選し、投資を行う方針です。

選定通貨については、金利水準やファンダメンタルズ、流動性等を勘案し、為替取引による「プレミアム（金利差相当分の収益）」と「為替差益」の獲得をめざして運用を行う方針です。

■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

通貨選択型ニッセイ世界高配当株ファンド（毎月決算型）の組入資産の内容

組入ファンド

| | 第108期末 2022年7月20日 |
|--|----------------------|
| NAM・グローバル・ハイディビデンド・エクイティ・ファンド カレンシー・セレクト・クラス | 98.1% |
| 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。

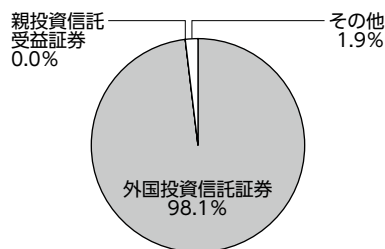
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

純資産等

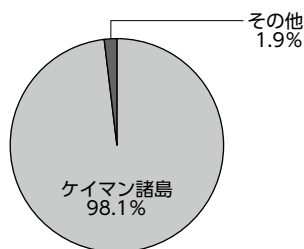
| 項目 | 第103期末 2022年2月21日 | 第104期末 2022年3月22日 | 第105期末 2022年4月20日 | 第106期末 2022年5月20日 | 第107期末 2022年6月20日 | 第108期末 2022年7月20日 |
|------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| 純資産総額 | 1,298,059,464円 | 1,298,729,645円 | 1,387,374,572円 | 1,279,959,084円 | 1,254,196,106円 | 1,264,078,658円 |
| 受益権総口数 | 3,164,260,609口 | 3,172,756,500口 | 3,165,419,508口 | 3,176,354,506口 | 3,202,346,666口 | 3,224,064,755口 |
| 1万口当たり基準価額 | 4,102円 | 4,093円 | 4,383円 | 4,030円 | 3,916円 | 3,921円 |

(注) 当作成期間（第103期～第108期）中における追加設定元本額は177,947,263円、同解約元本額は145,371,882円です。

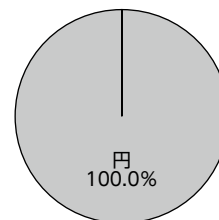
資産別配分



国別配分



通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2022年7月20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。

通貨選択型ニッセイ世界高配当株ファンド（年2回決算型）の組入資産の内容

■組入ファンド

| | 第18期末 2022年7月20日 |
|--|---------------------|
| NAM・グローバル・ハイディビダンド・エクイティ・ファンド カレンシー・セレクト・クラス | 98.1% |
| 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。

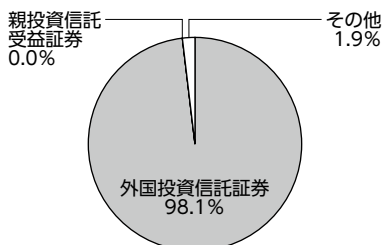
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

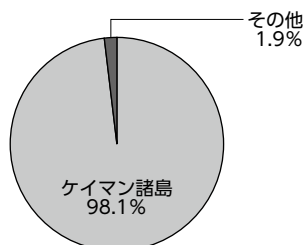
| 項目 | 第18期末 2022年7月20日 |
|------------|---------------------|
| 純資産総額 | 353,419,913円 |
| 受益権総口数 | 204,712,447口 |
| 1万口当たり基準価額 | 17,264円 |

(注) 当期間中における追加設定元本額は286,470円、同解約元本額は3,102,009円です。

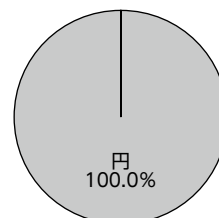
■資産別配分



■国別配分



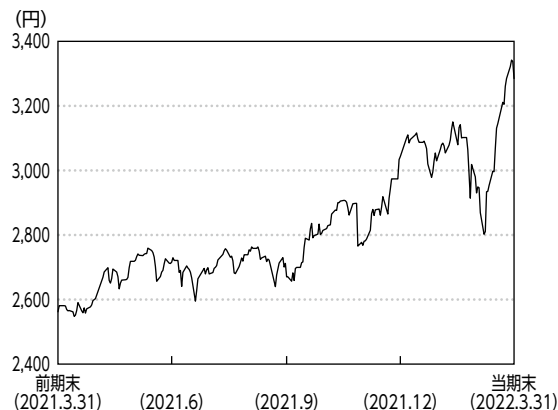
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2022年7月20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。

NAM・グローバル・ハイディビデンド・エクイティ・ファンド カレンシー・セレクト・クラスの概要

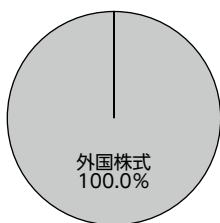
■ 税引前分配金再投資基準価額の推移



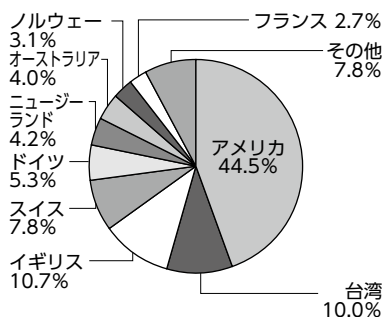
■ 上位銘柄

| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|---------------------------|-------------|------|
| CHEVRON CORP | 米ドル | 7.6% |
| BROADCOM INC | 米ドル | 6.2% |
| PFIZER INC | 米ドル | 4.9% |
| ARES CAPITAL CORP | 米ドル | 4.7% |
| INTL BUSINESS MACHINES CO | 米ドル | 4.6% |
| COCA-COLA CO/THE | 米ドル | 4.5% |
| SWISS RE AG | スイス・フラン | 4.4% |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANU | 台湾ドル | 4.4% |
| SPARK NEW ZEALAND LTD | ニュージーランド・ドル | 4.2% |
| RIO TINTO PLC | イギリス・ポンド | 4.1% |
| 組入銘柄数 | | 46 |

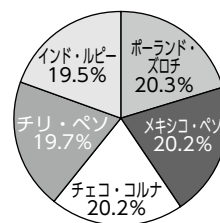
■ 資産別配分



■ 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。

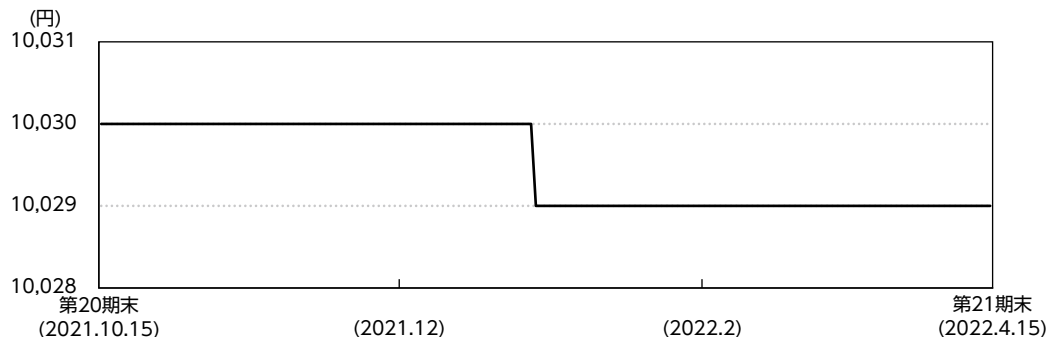
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、外国投資信託証券決算日（2022年3月31日現在）のものであり、比率は上位銘柄、資産別・国別配分は、外国投資信託証券のポートフォリオ部分に対する評価額の割合、通貨別配分は、選定通貨に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注3) 1万口当たりの費用明細は、入手が困難であるため記載していません。

(注4) 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



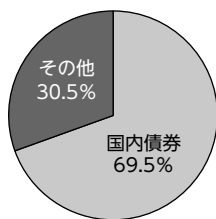
■上位銘柄

| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------------------|----|-------|
| 第710回 東京都公募公債 | 円 | 29.7% |
| 第193回 神奈川県公募公債 | 円 | 19.9 |
| 第115回 共同発行市場公募地方債 | 円 | 19.9 |
| 組入銘柄数 | 3 | |

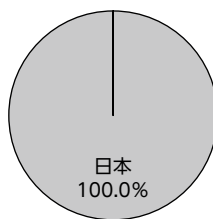
■1万口当たりの費用明細

| 2021.10.16～2022.4.15 | |
|----------------------|-----|
| 項目 | 金額 |
| その他費用 | 0円 |
| (その他) | (0) |
| 合計 | 0 |

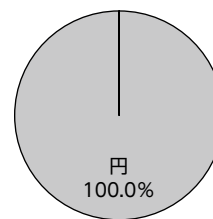
■資産別配分



■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（2022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 | NAM・グローバル・ ハイディビデンド・ エクイティ・ファンド カレンシー・ セレクト・クラス | 債券 組入比率 | 純資産 総額 |
|---------------------|---------------|------------|-----------|-------------------------|---|------------|-----------|
| | 円 | 円 | % | 円 | % | % | 百万円 |
| 79 期 (2020年 2 月20日) | 5,103 | 90 | △ 1.2 | 12,123 | 97.7 | 0.0 | 2,545 |
| 80 期 (2020年 3 月23日) | 3,186 | 90 | △35.8 | 10,296 | 97.8 | 0.0 | 1,584 |
| 81 期 (2020年 4 月20日) | 3,447 | 90 | 11.0 | 10,647 | 97.9 | 0.0 | 1,728 |
| 82 期 (2020年 5 月20日) | 3,429 | 90 | 2.1 | 10,719 | 97.9 | 0.0 | 1,748 |
| 83 期 (2020年 6 月22日) | 3,511 | 90 | 5.0 | 10,891 | 97.8 | 0.0 | 1,503 |
| 84 期 (2020年 7 月20日) | 3,529 | 60 | 2.2 | 10,969 | 97.7 | 0.0 | 1,508 |
| 85 期 (2020年 8 月20日) | 3,514 | 60 | 1.3 | 11,014 | 98.0 | 0.0 | 1,472 |
| 86 期 (2020年 9 月23日) | 3,494 | 60 | 1.1 | 11,054 | 98.1 | 0.0 | 1,445 |
| 87 期 (2020年10月20日) | 3,488 | 60 | 1.5 | 11,108 | 98.0 | 0.0 | 1,432 |
| 88 期 (2020年11月20日) | 3,595 | 60 | 4.8 | 11,275 | 98.1 | 0.0 | 1,465 |
| 89 期 (2020年12月21日) | 3,670 | 60 | 3.8 | 11,410 | 98.1 | 0.0 | 1,480 |
| 90 期 (2021年 1 月20日) | 3,778 | 60 | 4.6 | 11,578 | 98.0 | 0.0 | 1,474 |
| 91 期 (2021年 2 月22日) | 3,858 | 60 | 3.7 | 11,718 | 97.9 | 0.0 | 1,480 |
| 92 期 (2021年 3 月22日) | 3,989 | 60 | 5.0 | 11,909 | 98.0 | 0.0 | 1,511 |
| 93 期 (2021年 4 月20日) | 3,987 | 60 | 1.5 | 11,967 | 98.3 | 0.0 | 1,490 |
| 94 期 (2021年 5 月20日) | 4,029 | 60 | 2.6 | 12,069 | 97.9 | 0.0 | 1,475 |
| 95 期 (2021年 6 月21日) | 4,000 | 60 | 0.8 | 12,100 | 97.8 | 0.0 | 1,433 |
| 96 期 (2021年 7 月20日) | 3,847 | 60 | △ 2.3 | 12,007 | 97.9 | 0.0 | 1,324 |
| 97 期 (2021年 8 月20日) | 3,911 | 60 | 3.2 | 12,131 | 98.1 | 0.0 | 1,304 |
| 98 期 (2021年 9 月21日) | 3,882 | 60 | 0.8 | 12,162 | 98.0 | 0.0 | 1,287 |
| 99 期 (2021年10月20日) | 3,976 | 60 | 4.0 | 12,316 | 98.0 | 0.0 | 1,307 |
| 100期 (2021年11月22日) | 3,972 | 60 | 1.4 | 12,372 | 98.0 | 0.0 | 1,264 |
| 101期 (2021年12月20日) | 3,967 | 60 | 1.4 | 12,427 | 98.0 | 0.0 | 1,258 |
| 102期 (2022年 1 月20日) | 4,138 | 60 | 5.8 | 12,658 | 98.0 | 0.0 | 1,320 |
| 103期 (2022年 2 月21日) | 4,102 | 60 | 0.6 | 12,682 | 97.9 | 0.0 | 1,298 |
| 104期 (2022年 3 月22日) | 4,093 | 60 | 1.2 | 12,733 | 98.2 | 0.0 | 1,298 |
| 105期 (2022年 4 月20日) | 4,383 | 60 | 8.6 | 13,083 | 98.0 | 0.0 | 1,387 |
| 106期 (2022年 5 月20日) | 4,030 | 60 | △ 6.7 | 12,790 | 98.0 | 0.0 | 1,279 |
| 107期 (2022年 6 月20日) | 3,916 | 60 | △ 1.3 | 12,736 | 97.8 | 0.0 | 1,254 |
| 108期 (2022年 7 月20日) | 3,921 | 60 | 1.7 | 12,801 | 98.1 | 0.0 | 1,264 |

(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。

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 | NAM・グローバル・ ハイディビデンド・ エクイティ・ファンド カレンシー・ セレクト・クラス | 債券 組入比率 |
|---------------|--------------------|------------|--------|---|------------|
| 第 103 期 | (期首) 2022年1月20日 | 円 4,138 | % － | % 98.0 | % 0.0 |
| | 1月末 | 4,070 | △1.6 | 98.0 | 0.0 |
| | (期末) 2022年2月21日 | 4,162 | 0.6 | 97.9 | 0.0 |
| 第 104 期 | (期首) 2022年2月21日 | 4,102 | － | 97.9 | 0.0 |
| | 2月末 | 3,994 | △2.6 | 97.5 | 0.0 |
| | (期末) 2022年3月22日 | 4,153 | 1.2 | 98.2 | 0.0 |
| 第 105 期 | (期首) 2022年3月22日 | 4,093 | － | 98.2 | 0.0 |
| | 3月末 | 4,337 | 6.0 | 98.4 | 0.0 |
| | (期末) 2022年4月20日 | 4,443 | 8.6 | 98.0 | 0.0 |
| 第 106 期 | (期首) 2022年4月20日 | 4,383 | － | 98.0 | 0.0 |
| | 4月末 | 4,151 | △5.3 | 97.8 | 0.0 |
| | (期末) 2022年5月20日 | 4,090 | △6.7 | 98.0 | 0.0 |
| 第 107 期 | (期首) 2022年5月20日 | 4,030 | － | 98.0 | 0.0 |
| | 5月末 | 4,252 | 5.5 | 97.7 | 0.0 |
| | (期末) 2022年6月20日 | 3,976 | △1.3 | 97.8 | 0.0 |
| 第 108 期 | (期首) 2022年6月20日 | 3,916 | － | 97.8 | 0.0 |
| | 6月末 | 4,002 | 2.2 | 97.7 | 0.0 |
| | (期末) 2022年7月20日 | 3,981 | 1.7 | 98.1 | 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

2022年1月21日～2022年7月20日

(1) 投資信託証券

| | 第103期～第108期 | | | |
|--|-------------|---------------|-------------|---------------|
| | 買付 | | 売付 | |
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| NAM・グローバル・ハイディビデンド・ エクイティ・ファンド カレンシー・セレクト・クラス | 千口 7,779 | 千円 188,877 | 千口 5,704 | 千円 140,580 |

(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103期～第108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

2022年1月21日～2022年7月20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

2022年7月20日現在

(1) 投資信託証券

| ファンド名 | 第102期末 | 第108期末 | | |
|--|--------------|--------------|-----------------|-----------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | 比率 |
| NAM・グローバル・ハイディビデンド・ エクイティ・ファンド カレンシー・セレクト・クラス | 千口 51,234 | 千口 53,309 | 千円 1,239,984 | % 98.1 |
| 合計 | 51,234 | 53,309 | 1,239,984 | 98.1 |

(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102期末 | 第108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50,381千口です。

通貨選択型ニッセイ世界高配当株ファンド（毎月決算型）

投資信託財産の構成

2022年7月20日現在

| 項目 | 第108期末 | |
|--|-----------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| NAM・グローバル・ハイディビデンド・ エクイティ・ファンド カレンシー・セレクト・クラス | 千円 1,239,984 | % 95.9 |
| 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 | 53,556 | 4.1 |
| 投資信託財産総額 | 1,293,551 | 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

| | (2022年2月21日) | (2022年3月22日) | (2022年4月20日) | (2022年5月20日) | (2022年6月20日) | (2022年7月20日) 現在 |
|--|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| 項目 | 第103期末 | 第104期末 | 第105期末 | 第106期末 | 第107期末 | 第108期末 |
| (A) 資産 | 1,324,967,468円 | 1,325,944,103円 | 1,407,725,971円 | 1,301,267,102円 | 1,274,831,525円 | 1,293,551,203円 |
| コール・ローン等 | 28,976,657 | 50,944,708 | 29,478,508 | 46,666,416 | 30,865,211 | 53,556,460 |
| NAM・グローバル・ ハイディビデンド・エクイティ・ ファンドカレンシー・ セレクト・クラス(評価額) | 1,270,730,799 | 1,274,989,383 | 1,360,157,451 | 1,254,590,674 | 1,227,116,302 | 1,239,984,731 |
| ニッセイマネーマーケット マザーファンド(評価額) | 10,012 | 10,012 | 10,012 | 10,012 | 10,012 | 10,012 |
| 未収入金 | 25,250,000 | — | 18,080,000 | — | 16,840,000 | — |
| (B) 負債 | 26,908,004 | 27,214,458 | 20,351,399 | 21,308,018 | 20,635,419 | 29,472,545 |
| 未払金 | — | — | — | — | — | 6,550,000 |
| 未払収益分配金 | 18,985,563 | 19,036,539 | 18,992,517 | 19,058,127 | 19,214,079 | 19,344,388 |
| 未払解約金 | 6,485,217 | 6,933,626 | 8,726 | 876,190 | 4,997 | 2,303,576 |
| 未払信託報酬 | 1,426,354 | 1,234,662 | 1,340,127 | 1,363,380 | 1,405,698 | 1,264,612 |
| その他未払費用 | 10,870 | 9,631 | 10,029 | 10,321 | 10,645 | 9,969 |
| (C) 純資産総額(A－B) | 1,298,059,464 | 1,298,729,645 | 1,387,374,572 | 1,279,959,084 | 1,254,196,106 | 1,264,078,658 |
| 元本 | 3,164,260,609 | 3,172,756,500 | 3,165,419,508 | 3,176,354,506 | 3,202,346,666 | 3,224,064,755 |
| 次期繰越損益金 | △1,866,201,145 | △1,874,026,855 | △1,778,044,936 | △1,896,395,422 | △1,948,150,560 | △1,959,986,097 |
| (D) 受益権総口数 | 3,164,260,609口 | 3,172,756,500口 | 3,165,419,508口 | 3,176,354,506口 | 3,202,346,666口 | 3,224,064,755口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 4,102円 | 4,093円 | 4,383円 | 4,030円 | 3,916円 | 3,921円 |

(注1) 当作成期首元本額 3,191,489,374円

当作成期中追加設定元本額 177,947,263円

当作成期中一部解約元本額 145,371,882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1,959,986,097円です。

通貨選択型ニッセイ世界高配当株ファンド（毎月決算型）

損益の状況

| | (第103期 第104期 第105期) | 2022年1月21日～2022年2月21日) 2022年2月22日～2022年3月22日) 2022年3月23日～2022年4月20日) | (第106期 第107期 第108期) | 2022年4月21日～2022年5月20日) 2022年5月21日～2022年6月20日) 2022年6月21日～2022年7月20日) | | |
|----------------------|---------------------------|--|---------------------------|--|------------------|------------------|
| 項目 | 第103期 | 第104期 | 第105期 | 第106期 | 第107期 | 第108期 |
| (A) 配 当 等 収 益 | 25,362,989円 | 25,487,466円 | 25,688,882円 | 25,733,373円 | 25,837,941円 | 26,238,878円 |
| 受 取 配 当 金 | 25,364,578 | 25,488,199 | 25,689,316 | 25,734,178 | 25,839,717 | 26,239,715 |
| 受 取 利 息 | 54 | 89 | 16 | - | 33 | 102 |
| 支 払 利 息 | △ 1,643 | △ 822 | △ 450 | △ 805 | △ 1,809 | △ 939 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 16,266,471 | △ 7,583,784 | 86,150,555 | △ 117,334,213 | △ 42,579,282 | △ 3,815,045 |
| 売 買 益 | 201,619 | 541,496 | 86,498,228 | 81,811 | 274,009 | 162,549 |
| 売 買 損 | △ 16,468,090 | △ 8,125,280 | △ 347,673 | △ 117,416,024 | △ 42,853,291 | △ 3,977,594 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 1,437,249 | △ 1,244,306 | △ 1,350,171 | △ 1,373,719 | △ 1,416,365 | △ 1,274,626 |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | 7,659,269 | 16,659,376 | 110,489,266 | △ 92,974,559 | △ 18,157,706 | 21,149,207 |
| (E) 前期繰越損益金 | △1,132,237,585 | △1,134,856,971 | △1,129,748,690 | △1,035,947,390 | △1,142,336,619 | △1,172,599,750 |
| (分配準備積立金) | (612,135,853) | (612,377,714) | (613,519,306) | (618,529,562) | (620,764,344) | (622,199,874) |
| (繰越欠損金) | (△1,744,373,438) | (△1,747,234,685) | (△1,743,267,996) | (△1,654,476,952) | (△1,763,100,963) | (△1,794,799,624) |
| (F) 追加信託差損益金* | △ 722,637,266 | △ 736,792,721 | △ 739,792,995 | △ 748,415,346 | △ 768,442,156 | △ 789,191,166 |
| (配当等相当額) | (318,965,868) | (326,230,703) | (328,131,662) | (332,794,951) | (343,753,748) | (354,314,802) |
| (売買損益相当額) | (△1,041,603,134) | (△1,063,023,424) | (△1,067,924,657) | (△1,081,210,297) | (△1,112,195,904) | (△1,143,505,968) |
| (G) 合 計(D + E + F) | △1,847,215,582 | △1,854,990,316 | △1,759,052,419 | △1,877,337,295 | △1,928,936,481 | △1,940,641,709 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △ 18,985,563 | △ 19,036,539 | △ 18,992,517 | △ 19,058,127 | △ 19,214,079 | △ 19,344,388 |
| 次期繰越損益金(G + H) | △1,866,201,145 | △1,874,026,855 | △1,778,044,936 | △1,896,395,422 | △1,948,150,560 | △1,959,986,097 |
| 追加信託差損益金 | △ 722,637,266 | △ 736,792,721 | △ 739,792,995 | △ 748,415,346 | △ 768,442,156 | △ 789,191,166 |
| (配当等相当額) | (318,965,868) | (326,230,703) | (328,131,662) | (332,794,951) | (343,753,748) | (354,314,802) |
| (売買損益相当額) | (△1,041,603,134) | (△1,063,023,424) | (△1,067,924,657) | (△1,081,210,297) | (△1,112,195,904) | (△1,143,505,968) |
| 分配準備積立金 | 617,076,030 | 617,584,335 | 619,905,537 | 623,831,089 | 625,971,841 | 627,819,738 |
| 繰越欠損金 | △1,760,639,909 | △1,754,818,469 | △1,658,157,478 | △1,771,811,165 | △1,805,680,245 | △1,798,614,669 |

(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103期 | 第104期 | 第105期 | 第106期 | 第107期 | 第108期 |
|--------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 23,925,740円 | 24,243,160円 | 25,378,748円 | 24,359,654円 | 24,421,576円 | 24,964,252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 | 318,965,868円 | 326,230,703円 | 328,131,662円 | 332,794,951円 | 343,753,748円 | 354,314,802円 |
| (d) 信託約款に定める分配準備積立金 | 612,135,853円 | 612,377,714円 | 613,519,306円 | 618,529,562円 | 620,764,344円 | 622,199,874円 |
| (e) 分配対象額(a + b + c + d) | 955,027,461円 | 962,851,577円 | 967,029,716円 | 975,684,167円 | 988,939,668円 | 1,001,478,928円 |
| (f) 分配対象額(1万口当たり) | 3,018.17円 | 3,034.75円 | 3,054.98円 | 3,071.71円 | 3,088.17円 | 3,106.26円 |
| (g) 分配金 | 18,985,563円 | 19,036,539円 | 18,992,517円 | 19,058,127円 | 19,214,079円 | 19,344,388円 |
| (h) 分配金(1万口当たり) | 60円 | 60円 | 60円 | 60円 | 60円 | 60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。

最近5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 | NAM・グローバル・ ハイディビデンド・ エクイティ・ファンド カレンシー・ セレクト・クラス | 債券 組入比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|---------------|------------|-----------|-------------------------|---|------------|-----------|
| | 円 | 円 | % | 円 | % | % | 百万円 |
| 14期（2020年7月20日） | 10,787 | 0 | △22.6 | 10,787 | 98.0 | 0.0 | 294 |
| 15期（2021年1月20日） | 12,758 | 0 | 18.3 | 12,758 | 98.5 | 0.0 | 296 |
| 16期（2021年7月20日） | 14,197 | 0 | 11.3 | 14,197 | 97.9 | 0.0 | 300 |
| 17期（2022年1月20日） | 16,696 | 0 | 17.6 | 16,696 | 97.9 | 0.0 | 346 |
| 18期（2022年7月20日） | 17,264 | 0 | 3.4 | 17,264 | 98.1 | 0.0 | 353 |

(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。

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 | NAM・グローバル・ ハイディビデンド・ エクイティ・ファンド カレンシー・ セレクト・クラス | 債券 組入比率 |
|-----------------|--------|------|---|------------|
| | 円 | % | % | % |
| (期首) 2022年1月20日 | 16,696 | － | 97.9 | 0.0 |
| 1月末 | 16,418 | △1.7 | 97.9 | 0.0 |
| 2月末 | 16,343 | △2.1 | 98.0 | 0.0 |
| 3月末 | 18,014 | 7.9 | 98.3 | 0.0 |
| 4月末 | 17,477 | 4.7 | 97.9 | 0.0 |
| 5月末 | 18,159 | 8.8 | 98.1 | 0.0 |
| 6月末 | 17,340 | 3.9 | 98.1 | 0.0 |
| (期末) 2022年7月20日 | 17,264 | 3.4 | 98.1 | 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

2022年1月21日～2022年7月20日

(1) 投資信託証券

| | 買付 | | 売付 | |
|--|-------------|--------------|-----------|--------------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| NAM・グローバル・ハイディビデンド・ エクイティ・ファンド カレンシー・セレクト・クラス | 千口 1,903 | 千円 46,042 | 千口 431 | 千円 10,080 |

(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

| | 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

2022年1月21日～2022年7月20日

当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

2022年7月20日現在

(1) 投資信託証券

| ファンド名 | 期首(前期末) | 当期末 | | |
|--|--------------|--------------|---------------|-----------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | 比率 |
| NAM・グローバル・ハイディビデンド・ エクイティ・ファンド カレンシー・セレクト・クラス | 千口 13,435 | 千口 14,907 | 千円 346,737 | % 98.1 |
| 合計 | 13,435 | 14,907 | 346,737 | 98.1 |

(注1) 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 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------|---------|---------|----------|
| | 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50,381千口です。

投資信託財産の構成

2022年7月20日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--|---------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| NAM・グローバル・ハイディビデンド・ エクイティ・ファンド カレンシー・セレクト・クラス | 千円 346,737 | % 97.5 |
| 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 | 8,881 | 2.5 |
| 投資信託財産総額 | 355,628 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

通貨選択型ニッセイ世界高配当株ファンド（年2回決算型）

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年7月20日現在)

| 項目 | 当期末 |
|---|--------------|
| (A) 資産 | 355,628,753円 |
| コール・ローン等 | 7,211,406 |
| N A M・グローバル・ハイディビデンド・エグイティ・ファンド カレンジャー・セレクト・クラス(評価額) | 346,737,335 |
| ニッセイマネーマーケット マザーファンド(評価額) | 10,012 |
| 未収入金 | 1,670,000 |
| (B) 負債 | 2,208,840 |
| 未払信託報酬 | 2,189,463 |
| その他未払費用 | 19,377 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 353,419,913 |
| 元本 | 204,712,447 |
| 次期繰越損益金 | 148,707,466 |
| (D) 受益権総口数 | 204,712,447口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 17,264円 |

| | |
|-----------|--------------|
| (注) 期首元本額 | 207,527,986円 |
| 期中追加設定元本額 | 286,470円 |
| 期中一部解約元本額 | 3,102,009円 |

損益の状況

当期 (2022年1月21日～2022年7月20日)

| 項目 | 当期 |
|--------------------------|-------------------------------|
| (A) 配当等収益 | 41,762,932円 |
| 受取配当金 | 41,764,483 |
| 受取利息 | 75 |
| 支払利 | △ 1,626 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 27,936,970 |
| 売買益 | 573,548 |
| 売買損 | △ 28,510,518 |
| (C) 信託報酬等 | △ 2,208,912 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 11,617,050 |
| (E) 前期繰越損益金 (分配準備積立金) | 135,001,035 (434,254,588) |
| (繰越欠損金) | (△299,253,553) |
| (F) 追加信託差損益金* | 2,089,381 |
| (配当等相当額) | (9,533,713) |
| (売買損益相当額) | (△ 7,444,332) |
| (G) 合計(D+E+F) | 148,707,466 |
| 次期繰越損益金(G) | 148,707,466 |
| 追加信託差損益金 | 2,089,381 |
| (配当等相当額) | (9,533,713) |
| (売買損益相当額) | (△ 7,444,332) |
| 分配準備積立金 | 473,808,608 |
| 繰越欠損金 | △327,190,523 |

(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 | 当期 |
|---------------------|--------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 39,554,020円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0円 |
| (c) 信託約款に定める収益調整金 | 9,533,713円 |
| (d) 信託約款に定める分配準備積立金 | 434,254,588円 |
| (e) 分配対象額(a+b+c+d) | 483,342,321円 |
| (f) 分配対象額(1万口当たり) | 23,610.79円 |
| (g) 分配金 | 0円 |
| (h) 分配金(1万口当たり) | 0円 |

お知らせ

■運用体制の変更について

運用部門については、ＣＯ－ＣＩＯ（取締役執行役員、統括部長）の２名体制からＣＩＯ（取締役執行役員）１名とＣＯ－ＣＩＯ（統括部長）１名の体制に変更しました。

新たにＣＩＯが就任し、従来のＣＯ－ＣＩＯのうちの１名（統括部長）が、引き続きＣＯ－ＣＩＯを務めています。

（2022年３月25日）

■《毎月決算型》の自社の実質保有比率

2022年６月末現在、当ファンドの主要投資対象であるニッセイマネーマーケットマザーファンドの信託財産において、当社は、当該マザーファンド受益証券を他のベビーファンドを通じて実質的に99.1%保有しています。当該実質保有分は、当社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

■《年２回決算型》の自社の実質保有比率

2022年６月末現在、当ファンドの主要投資対象であるニッセイマネーマーケットマザーファンドの信託財産において、当社は、当該マザーファンド受益証券を他のベビーファンドを通じて実質的に99.1%保有しています。当該実質保有分は、当社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

各ファンドの概要

| | | | | 毎月決算型 | 年2回決算型 |
|--------|--|---|---|---|--|
| 商 | 品 | 分 | 類 | 追加型投信／内外／資産複合 特化型 | |
| 信 | 託 | 期 | 間 | 2013年7月23日～2023年7月20日 | |
| 運 | 用 | 方 | 針 | 外国投資信託証券への投資を通じて、日本を含む各国の株式およびリート（不動産投資信託）等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、配当等収益の確保と信託財産の成長を図ることを目標に運用を行います。 | |
| 主要運用対象 | 通貨選択型ニッセイ世界高配当株ファンド | | | 「NAM・グローバル・ハイディビデンド・エクイティ・ファンド カレンシー・セレクト・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」 | |
| | NAM・グローバル・ハイディビデンド・エクイティ・ファンド カレンシー・セレクト・クラス | | | 日本を含む各国の株式およびリート等 | |
| | 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、委託会社が基準価額水準、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。 | 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、信託財産の成長に資することを目的に、委託会社が基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して決定します。 |

以下は、「NAM・グローバル・ハイディビデンド・エクイティ・ファンド F X・オープン・クラス」および「NAM・グローバル・ハイディビデンド・エクイティ・ファンド カレンシー・セレクト・クラス」（ケイマン籍外国投資信託証券）の2022年3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（2021年4月1日～2022年3月31日）

＜NAM・グローバル・ハイディビデンド・エクイティ・ファンド F X・オープン・クラス
／カレンシー・セレクト・クラス＞

| | (円) |
|---|------------------------|
| 収益 | |
| 配当金 | 421,569,601 |
| 受取利息 | 25,719,976 |
| 外国為替取引益（損） | 103,954,040 |
| 有価証券取引益（評価損益を含む） | 1,548,559,414 |
| 収益（損失）合計 | 2,099,803,031 |
| 費用 | |
| 管理事務代行報酬 | 5,531,270 |
| 管理報酬 | 47,662,715 |
| 年次規制手数料 | 849,388 |
| 名義書換代行報酬 | 4,140,182 |
| 信託報酬 | 2,637,037 |
| 監査報酬 | 4,361,501 |
| 外部専門家支払報酬 | 1,227,223 |
| 受託者報酬 | 2,261,325 |
| 取引費用 | 10,298,862 |
| サービス手数料 | 247,716 |
| 費用合計 | 79,217,219 |
| 税引前利益（損失） | 2,020,585,812 |
| 源泉税 | (86,075,409) |
| 運用による買戻可能参加受益証券保有者に帰属する純資産の純増（減）（受益者に対する分配前） | 1,934,510,403 |
| 受益者に対する分配 | (1,226,700,631) |
| 運用による買戻可能参加受益証券保有者に帰属する純資産の純増（減） | 707,809,772 |

(2) 投資有価証券明細表 (2022年3月31日現在)
NAM GLOBAL HIGH DIVIDEND EQUITY FUND

| Description | Holding / Shares | Issue/ Settle Curr | Market Value (Base) |
|-----------------------------|------------------|--------------------|---------------------|
| CHEVRON CORP | 33,985.0000 | U S D | 671,656,457.00 |
| BROADCOM INC | 7,201.0000 | U S D | 550,349,033.00 |
| PFIZER INC | 69,174.0000 | U S D | 434,656,873.00 |
| ARES CAPITAL CORP | 164,108.0000 | U S D | 417,291,249.00 |
| INTL BUSINESS MACHINES CO | 25,500.0000 | U S D | 402,416,555.00 |
| COCA-COLA CO/THE | 53,064.0000 | U S D | 399,316,422.00 |
| SWISS RE AG | 33,529.0000 | C H F | 389,682,865.00 |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANU | 154,000.0000 | T W D | 389,472,079.00 |
| SPARK NEW ZEALAND LTD | 954,468.0000 | N Z D | 369,055,588.00 |
| RIO TINTO PLC | 37,070.0000 | G B P | 360,272,767.00 |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCH | 6,185.0000 | C H F | 298,930,790.00 |
| NATIONAL GRID PLC | 146,525.0000 | G B P | 274,549,960.00 |
| TOTALENERGIES SE | 38,363.0000 | E U R | 238,467,102.00 |
| MACQUARIE GROUP LTD | 12,856.0000 | A U D | 238,195,162.00 |
| SIEMENS AG-REG | 14,035.0000 | E U R | 238,168,548.00 |
| DNB BANK ASA | 78,072.0000 | N O K | 216,851,615.00 |
| ABBVIE INC | 10,347.0000 | U S D | 203,586,864.00 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 17,523.0000 | U S D | 199,794,953.00 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 75,593.0000 | G B P | 199,003,980.00 |
| PROSPECT CAPITAL CORP | 180,270.0000 | U S D | 181,167,083.00 |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD | 47,400.0000 | S G D | 152,317,668.00 |
| VODACOM GROUP LTD | 93,076.0000 | Z A R | 123,698,283.00 |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG | 14,172.0000 | E U R | 122,122,258.00 |
| NEWELL BRANDS INC | 45,494.0000 | U S D | 118,221,452.00 |
| RURAL FUNDS GROUP | 439,174.0000 | A U D | 117,289,201.00 |
| ROYAL BANK OF CANADA | 8,448.0000 | C A D | 112,990,256.00 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 18,686.0000 | E U R | 109,895,381.00 |
| AMCOR PLC | 77,958.0000 | U S D | 107,205,260.00 |
| WILLIAMS COS INC | 25,033.0000 | U S D | 101,511,413.00 |
| DOW INC | 12,693.0000 | U S D | 98,167,006.00 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE | 17,510.0000 | U S D | 95,147,797.00 |
| GETAC HOLDINGS CORP | 425,000.0000 | T W D | 89,570,148.00 |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO | 199,000.0000 | T W D | 87,251,862.00 |
| VOLVO AB-B SHS | 34,618.0000 | S E K | 79,622,031.00 |
| REALTEK SEMICONDUCTOR COR | 41,000.0000 | T W D | 74,771,878.00 |
| MEDIATEK INC | 19,000.0000 | T W D | 72,842,268.00 |
| IBERDROLA SA | 51,253.0000 | E U R | 68,660,332.00 |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B | 168.0000 | D K K | 62,130,719.00 |
| HON HAI PRECISION INDUSTR | 137,000.0000 | T W D | 61,518,779.00 |
| NOVATEK MICROELECTRONICS | 34,000.0000 | T W D | 61,429,818.00 |
| ATEA ASA | 29,255.0000 | N O K | 53,684,860.00 |
| LENOVO GROUP LTD | 342,000.0000 | H K D | 45,160,410.00 |
| KINDRED GROUP PLC | 32,887.0000 | S E K | 44,202,266.00 |
| SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD | 32,000.0000 | T W D | 42,091,350.00 |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | 47,297.0000 | U S D | 40,413,992.00 |
| KYNDRYL HOLDINGS INC-W/I | 5,100.0000 | U S D | 8,121,374.00 |

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 21 期

(計算期間：2021年10月16日～2022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。



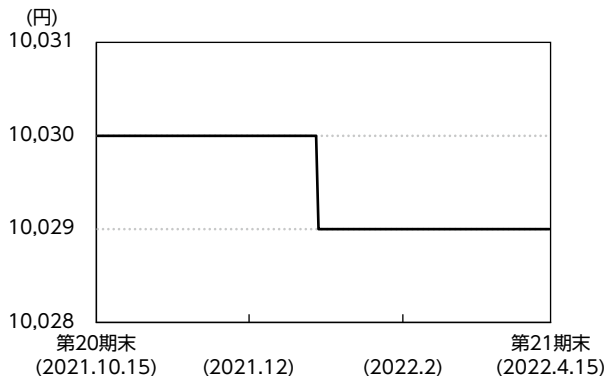
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2021年10月16日～2022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

<下落要因>

- ・前期末以降、無担保コールレート翌日物のマイナス金利等が影響したこと

(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。

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 |
| 17期 (2020年 4 月15日) | 10,031 | 0.0 | 61.6 | 50 |
| 18期 (2020年10月15日) | 10,030 | △0.0 | 61.6 | 50 |
| 19期 (2021年 4 月15日) | 10,029 | △0.0 | 77.5 | 50 |
| 20期 (2021年10月15日) | 10,030 | 0.0 | 69.5 | 50 |
| 21期 (2022年 4 月15日) | 10,029 | △0.0 | 69.5 | 50 |

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)2021年10月15日 | 10,030 | — | 69.5 |
| 10月末 | 10,030 | 0.0 | 69.5 |
| 11月末 | 10,030 | 0.0 | 69.6 |
| 12月末 | 10,030 | 0.0 | 69.5 |
| 2022年 1 月末 | 10,029 | △0.0 | 69.6 |
| 2 月末 | 10,029 | △0.0 | 69.6 |
| 3 月末 | 10,029 | △0.0 | 69.5 |
| (期末)2022年 4 月15日 | 10,029 | △0.0 | 69.5 |

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2021年10月16日～2022年4月15日

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-------|-----|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| その他費用 | 0円 | 0.000% | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 |
| (その他) | (0) | (0.000) | <ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息 |
| 合計 | 0 | 0.000 | |

(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（10,029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

2021年10月16日～2022年4月15日

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|-------|--------|---------------|
| 国内 | 地方債証券 | 千円 | 千円 |
| | | 20,143 | — (20,000) |

(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

2021年10月16日～2022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115回 共同発行市場公募地方債 | 10,074 | — | — |
| 第193回 神奈川県公募公債 | 10,069 | | |

(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

2022年4月15日現在

国内（邦貨建）公社債

| 区分 | 当期末 | | | | | | |
|-------|--------------------|--------------------|----------------|-----------------|-----------|------|----------------|
| | 額面金額 | 評価額 | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | 千円 | 千円 | % | % | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| 地方債証券 | 35,000 (35,000) | 35,113 (35,113) | 69.5 (69.5) | — | — | — | 69.5 (69.5) |
| 合計 | 35,000 (35,000) | 35,113 (35,113) | 69.5 (69.5) | — | — | — | 69.5 (69.5) |

- (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710回 東京都公募公債 | 0.8100 | 2022/6/20 | 15,000 | 15,021 |
| | 第193回 神奈川県公募公債 | 0.7390 | 2022/12/20 | 10,000 | 10,050 |
| | 第115回 共同発行市場公募地方債 | 0.8000 | 2022/10/25 | 10,000 | 10,041 |
| | 合計 | — | — | — | 35,113 |

投資信託財産の構成

2022年4月15日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|--------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 35,113 | 69.5 |
| コール・ローン等、その他 | 15,415 | 30.5 |
| 投資信託財産総額 | 50,528 | 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

(2022年4月15日現在)

| 項目 | 当期末 |
|-----------------|-------------|
| (A)資産 | 50,528,956円 |
| コール・ローン等 | 15,364,920 |
| 公社債(評価額) | 35,113,594 |
| 未収利息 | 45,583 |
| 前払費用 | 4,859 |
| (B)負債 | 19 |
| 未払解約金 | 3 |
| その他未払費用 | 16 |
| (C)純資産総額(A-B) | 50,528,937 |
| 元本 | 50,381,974 |
| 次期繰越損益金 | 146,963 |
| (D)受益権総口数 | 50,381,974口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,029円 |

(注1) 期首元本額 50,382,156円
 期中追加設定元本額 -円
 期中一部解約元本額 182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) | 49,953,044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 |
| ビムコ世界債券戦略ファンド(毎月決算型)Aコース(為替ヘッジあり) | 9,986円 |
| ビムコ世界債券戦略ファンド(毎月決算型)Bコース(為替ヘッジなし) | 9,986円 |
| ビムコ世界債券戦略ファンド(年1回決算型)Cコース(為替ヘッジあり) | 9,984円 |
| ビムコ世界債券戦略ファンド(年1回決算型)Dコース(為替ヘッジなし) | 9,984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 |
| 通貨選択型ニッセイ世界高配当株ファンド(毎月決算型) | 9,984円 |
| 通貨選択型ニッセイ世界高配当株ファンド(年2回決算型) | 9,984円 |
| ニッセイ世界ハイブリッド証券戦略ファンド(毎月決算型・通貨プレミアムコース) | 9,977円 |
| ニッセイ世界ハイブリッド証券戦略ファンド(毎月決算型・為替ヘッジありコース) | 9,977円 |
| ニッセイ世界ハイブリッド証券戦略ファンド(毎月決算型・為替ヘッジなしコース) | 9,977円 |
| J P X日経400アクティブ・オープン米ドル投資型 | 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/MF S外国株低ボラティリティ運用ファンド | 9,967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 |
| ニッセイ/コムジエスト新興国成長株ファンド(資産成長型) | 9,969円 |
| ニッセイ/コムジエ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 |
| ニッセイ/T C W債券戦略ファンド(3ヵ月決算型・為替ヘッジあり) | 9,969円 |
| ニッセイ/T C W債券戦略ファンド(3ヵ月決算型・為替ヘッジなし) | 9,969円 |
| ニッセイ/T C W債券戦略ファンド(資産成長型・為替ヘッジあり) | 9,969円 |
| ニッセイ/T C W債券戦略ファンド(資産成長型・為替ヘッジなし) | 9,969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 (2021年10月16日～2022年4月15日)

| 項目 | 当期 |
|-----------------|----------|
| (A)配当等収益 | 145,200円 |
| 受取利息 | 149,089 |
| 支払利息 | △ 3,889 |
| (B)有価証券売買損益 | △148,474 |
| 売却損 | △148,474 |
| (C)信託報酬等 | △ 131 |
| (D)当期損益金(A+B+C) | △ 3,405 |
| (E)前期繰越損益金 | 150,368 |
| (F)合計(D+E) | 146,963 |
| 次期繰越損益金(F) | 146,963 |

(注) (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。