

第102期末 (2023年8月10日)

基準価額 2,679円

純資産総額 271億円

第97期～第102期
(2023年2月11日～2023年8月10日)

騰落率 20.5%

分配金合計 200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。

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

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：2023年2月11日～2023年8月10日

第97期 (決算日2023年3月10日) 第100期 (決算日2023年6月12日)
第98期 (決算日2023年4月10日) 第101期 (決算日2023年7月10日)
第99期 (決算日2023年5月10日) 第102期 (決算日2023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102期の決算を行いました。

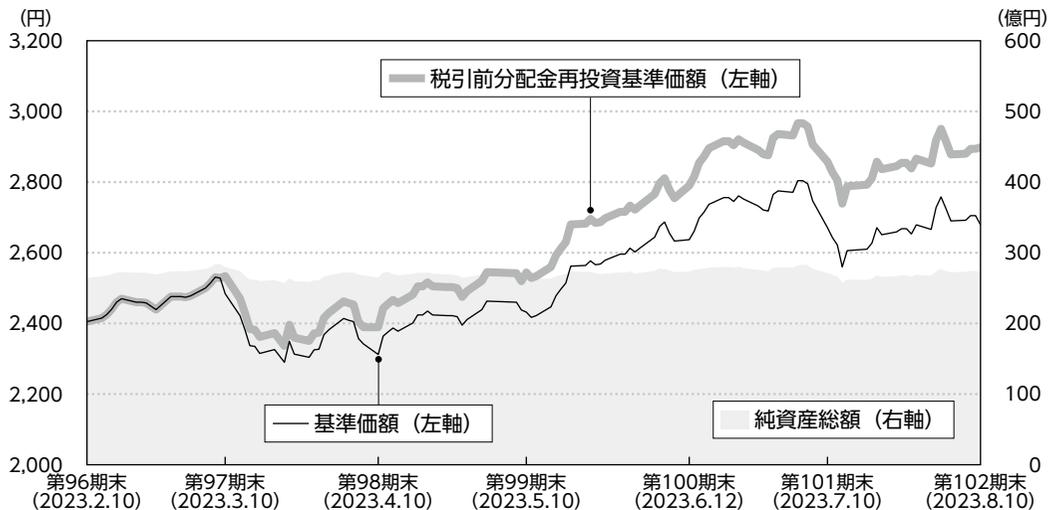
当ファンドは、「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト(ケイマン)Ⅱーニッセイ・ジャパン・エクイティ・アクティブ・ファンド(適格機関投資家限定)カバード・コール・クラス」への投資を通じて、国内の金融商品取引所上場株式を実質的な主要投資対象とするとともに、為替取引を活用し米ドルへの投資効果の享受、株式および通貨のカバードコール戦略によるオプションプレミアムの獲得をめざすことにより、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

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。

運用経過

2023年2月11日～2023年8月10日

基準価額等の推移



第97期首	2,405円	既払分配金	200円
第102期末	2,679円	騰落率(分配金再投資ベース)	20.5%

(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>

- ・ 4月から6月にかけて、円安の進行に伴い国内企業の堅調な決算が期待されたことから、外国人投資家による日本株の買い入れが進み、国内株式市場が上昇したこと
- ・ 7月以降発表された第1四半期決算において、市場全般に予想を上回る業績内容や業績見通しであったことから、国内株式市場が比較的堅調に推移したこと

<下落要因>

- ・ 8月以降、中国不動産関連の不良債権問題が明らかになりつつあり、中国全体の景気見通しが悪化したことに加え、米国において高金利を意識した景気減速への懸念も高まり、国内株式市場が若干下落したこと
- ・ カバードコール戦略がいずれも基準価額に対してマイナス寄与したこと

*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97期～第102期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	14円	0.554%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は2,537円です。
（投信会社）	（ 4）	（0.162）	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）	（10）	（0.380）	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	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）	（0.000）	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
（その他）	（ 0）	（0.000）	・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	14	0.554	

（注1）作成中の費用（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。

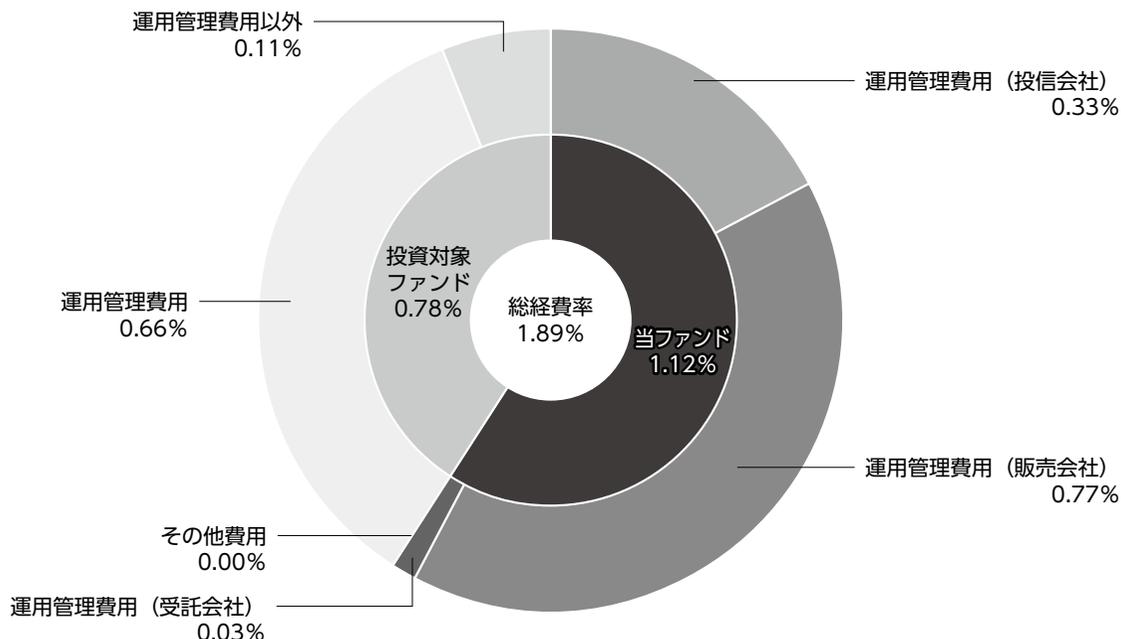
（注3）比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

（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1.89%**です。



項目	比率
総経費率 (①+②+③)	1.89%
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	0.11%

(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。

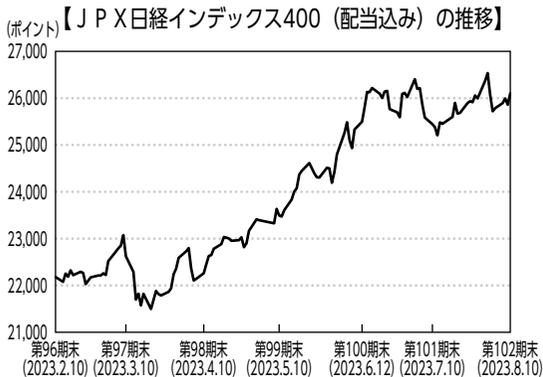
(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資対象ファンドが支払った費用を含みません。

(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



(注) 指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当作成期の国内株式市場は、良好な企業業績や外国人投資家の日本株への資金流入が力強かったことなどから、堅調に上昇しました。

3月には米金融機関の破綻により市場全体が動揺する場面もありましたが、当作成期初は比較的落ち着いた展開で推移しました。円安を背景とした日本企業の業績見通しが良好であるとの見方もあり、4月以降は外国人投資家の買い入れが本格化し、市場全体が堅調に推移しました。その後は日米金融当局の金融政策やコメントに左右される場面もありましたが、円安トレンドも明確であったことから、当作成期末にかけては積極的に売却する動きは少なく、市場全体は穏やかに推移し、当作成期を通じて見ると堅調に上昇して当作成期末を迎えました。

為替市況



(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

米ドル／円相場は、一時円高に向かう場面もありましたが、日米の金融政策にほとんど変化は見られなかったことから、当作成期は円安トレンドを示す展開となりました。

当作成期初を131円付近でスタートした後、緩やかな円安トレンドにありましたが、3月後半にかけて米金融機関の破綻報道などから、一時、円高傾向が顕著になり130円台まで上昇しました。その後は米金融当局の迅速な対応を受けて落ちつきを取り戻しました。日米において大きな金融政策の変更はないとの思惑から円安傾向が継続し、143円台後半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を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。

■クレディ・スイス・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、クレディ・スイス・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（34.1%）、銀行業（8.5%）、医薬品（8.2%）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10.8%、カバー率は50.0%、平均行使期間は30.5日、通貨カバードコール戦略のオプションプレミアムは6.3%、カバー率は50.0%、平均行使期間は30.5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97期 2023年2月11日	第98期 2023年3月11日	第99期 2023年4月11日	第100期 2023年5月11日	第101期 2023年6月13日	第102期 2023年7月11日
	～ 2023年3月10日	～ 2023年4月10日	～ 2023年5月10日	～ 2023年6月12日	～ 2023年7月10日	～ 2023年8月10日
当期分配金（税引前）	50円	30円	30円	30円	30円	30円
対基準価額比率	1.97%	1.28%	1.22%	1.12%	1.11%	1.11%
当期の収益	50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	3,445円	3,513円	3,587円	3,600円	3,612円	3,623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。

■クレディ・スイス・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

今後も内外の金融政策の行方やウクライナ情勢等の不透明要因に加え、中国の景気動向など、引き続き相場の上値を抑える波乱要因が懸念される状況であると想定しています。ただし、日本経済はすでに「コロナ後」のステージに突入しており、むしろ経済正常化がどのように進むのかを確認する状況にあります。また、インバウンド経済も同時に進行するステージにあると考えています。このため、中長期の成長シナリオが不変な銘柄に関しては、購入機会を探る局面であるとも考えており、各国の経済・金融政策や地政学リスクなどの外部要因による相場変動には柔軟に対応していく方針です。

当ファンドのポートフォリオ構築にあたっては、「構造的な背景からROE（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」をコア銘柄としています。

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直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102期末 2023年8月10日
クレディ・スイス・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。

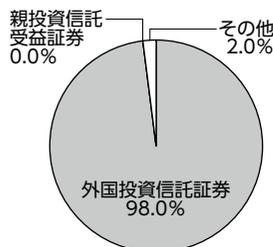
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

純資産等

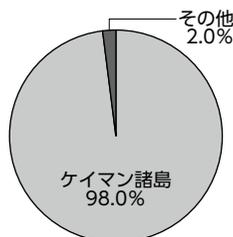
項目	第97期末 2023年3月10日	第98期末 2023年4月10日	第99期末 2023年5月10日	第100期末 2023年6月12日	第101期末 2023年7月10日	第102期末 2023年8月10日
純資産総額	27,960,354,986円	26,496,468,725円	26,662,870,141円	27,339,465,101円	27,119,146,805円	27,166,813,000円
受益権総口数	112,541,471,346口	114,596,111,702口	109,614,338,816口	103,665,367,360口	101,516,267,029口	101,397,377,322口
1万口当たり基準価額	2,484円	2,312円	2,432円	2,637円	2,671円	2,679円

(注) 当作成期間（第97期～第102期）中における追加設定元本額は18,301,025,168円、同解約元本額は26,742,073,635円です。

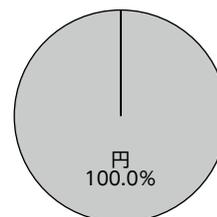
資産別配分



国別配分



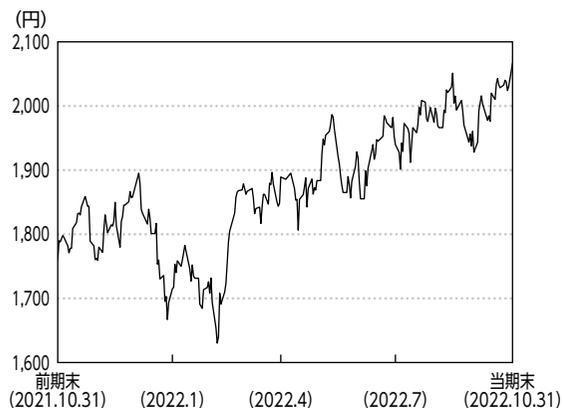
通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2023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。

クレディ・スイス・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

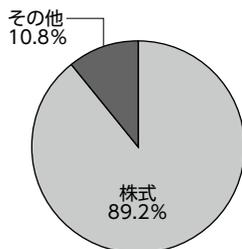
■ 税引前分配金再投資基準価額の推移



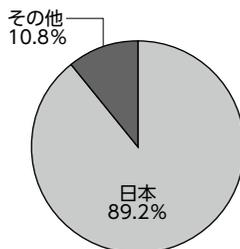
■ 上位銘柄

銘柄名	通貨	比率
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL	円	6.4%
TOKIO MARINE HOLDINGS INC	円	5.6
TOYOTA MOTOR CORP	円	5.5
HITACHI LTD	円	4.8
KEYENCE CORP	円	4.2
NISSAN CHEMICAL CORP	円	2.9
SONY GROUP CORP	円	2.9
NIPPON YUSEN KK	円	2.8
FUJITSU LIMITED	円	2.8
MARUBENI CORP	円	2.7
組入銘柄数		46

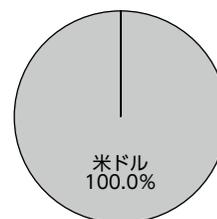
■ 資産別配分



■ 国別配分



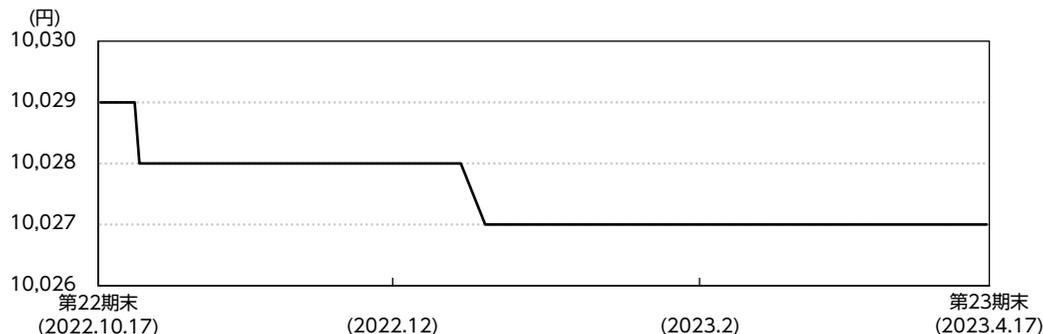
■ 通貨別配分



- (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、国別配分はクレディ・スイス・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

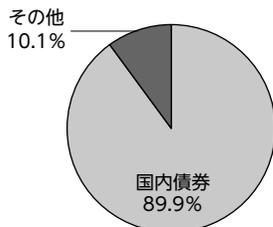
銘柄名	通貨	比率
第132回 共同発行市場公募地方債	円	22.1%
平成30年度第2回 北海道公募公債（5年）	円	21.9
第202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	円	14.2
第26回 政保日本政策金融公庫債券	円	14.2
第49回 政保地方公共団体金融機構債券	円	14.2
第1121回 国庫短期証券	円	2.0
第374回 大阪府公募公債	円	1.4
組入銘柄数		7

■ 1万口当たりの費用明細

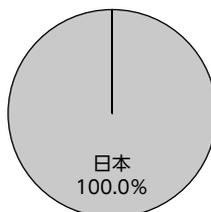
2022.10.18～2023.4.17

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

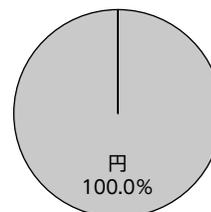
■ 資産別配分



■ 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（2023年4月17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	クレディ・スイス・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	純資産 総額	
								円
73期 (2021年 3月10日)	2,808	50	△ 3.9	11,538		98.2	0.0	29,406
74期 (2021年 4月12日)	2,932	50	6.2	11,712		98.0	0.0	30,267
75期 (2021年 5月10日)	2,797	50	△ 2.9	11,627		97.9	0.0	28,495
76期 (2021年 6月10日)	2,790	50	1.5	11,670		98.0	0.0	28,115
77期 (2021年 7月12日)	2,761	50	0.8	11,691		97.8	0.0	27,650
78期 (2021年 8月10日)	2,794	50	3.0	11,774		98.0	0.0	27,781
79期 (2021年 9月10日)	2,956	50	7.6	11,986		98.1	0.0	28,753
80期 (2021年10月11日)	2,789	50	△ 4.0	11,869		97.9	0.0	26,850
81期 (2021年11月10日)	2,901	50	5.8	12,031		98.0	0.0	27,618
82期 (2021年12月10日)	2,922	50	2.4	12,102		98.2	0.0	27,474
83期 (2022年 1月11日)	2,896	50	0.8	12,126		98.0	0.0	27,081
84期 (2022年 2月10日)	2,746	50	△ 3.5	12,026		98.1	0.0	25,813
85期 (2022年 3月10日)	2,496	50	△ 7.3	11,826		97.6	0.0	23,395
86期 (2022年 4月11日)	2,742	50	11.9	12,122		97.8	0.0	25,755
87期 (2022年 5月10日)	2,735	50	1.6	12,165		97.8	0.0	25,793
88期 (2022年 6月10日)	2,842	50	5.7	12,322		97.6	0.0	27,600
89期 (2022年 7月11日)	2,689	50	△ 3.6	12,219		97.9	0.0	26,545
90期 (2022年 8月10日)	2,699	50	2.2	12,279		97.3	0.0	27,131
91期 (2022年 9月12日)	2,732	50	3.1	12,362		97.5	0.0	28,007
92期 (2022年10月11日)	2,656	50	△ 1.0	12,336		97.8	0.0	27,771
93期 (2022年11月10日)	2,688	50	3.1	12,418		97.5	0.0	28,322
94期 (2022年12月12日)	2,531	50	△ 4.0	12,311		97.9	0.0	27,131
95期 (2023年 1月10日)	2,353	50	△ 5.1	12,183		97.5	0.0	25,442
96期 (2023年 2月10日)	2,405	50	4.3	12,285		97.8	0.0	26,418
97期 (2023年 3月10日)	2,484	50	5.4	12,414		97.7	0.0	27,960
98期 (2023年 4月10日)	2,312	30	△ 5.7	12,272		97.5	0.0	26,496
99期 (2023年 5月10日)	2,432	30	6.5	12,422		97.9	0.0	26,662
100期 (2023年 6月12日)	2,637	30	9.7	12,657		98.0	0.0	27,339
101期 (2023年 7月10日)	2,671	30	2.4	12,721		97.4	0.0	27,119
102期 (2023年 8月10日)	2,679	30	1.4	12,759		98.0	0.0	27,166

(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	クレディ・スイス・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97期	(期首) 2023年2月10日	円 2,405	% -	% 97.8	% 0.0
	2月末	2,476	3.0	98.0	0.0
	(期末) 2023年3月10日	2,534	5.4	97.7	0.0
第98期	(期首) 2023年3月10日	2,484	-	97.7	0.0
	3月末	2,382	△4.1	97.7	0.0
	(期末) 2023年4月10日	2,342	△5.7	97.5	0.0
第99期	(期首) 2023年4月10日	2,312	-	97.5	0.0
	4月末	2,411	4.3	98.0	0.0
	(期末) 2023年5月10日	2,462	6.5	97.9	0.0
第100期	(期首) 2023年5月10日	2,432	-	97.9	0.0
	5月末	2,613	7.4	98.2	0.0
	(期末) 2023年6月12日	2,667	9.7	98.0	0.0
第101期	(期首) 2023年6月12日	2,637	-	98.0	0.0
	6月末	2,775	5.2	98.4	0.0
	(期末) 2023年7月10日	2,701	2.4	97.4	0.0
第102期	(期首) 2023年7月10日	2,671	-	97.4	0.0
	7月末	2,666	△0.2	98.3	0.0
	(期末) 2023年8月10日	2,709	1.4	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

2023年2月11日～2023年8月10日

(1) 投資信託証券

	第97期～第102期			
	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
クレディ・スイス・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	516,845	5,821,546	474,351	5,470,220

(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97期～第102期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	－	－	－	－

(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

2023年2月11日～2023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

2023年8月10日現在

(1) 投資信託証券

ファンド名	第96期末	第102期末		
	口数	口数	評価額	比率
クレディ・スイス・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 2,172,463	千口 2,214,958	千円 26,623,797	% 98.0
合計	2,172,463	2,214,958	26,623,797	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96期末	第102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734,402千口です。

投資信託財産の構成

2023年8月10日現在

項目	第102期末	
	評価額	比率
クレディ・スイス・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 26,623,797	% 96.7
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	894,975	3.3
投資信託財産総額	27,518,783	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

	(2023年3月10日)	(2023年4月10日)	(2023年5月10日)	(2023年6月12日)	(2023年7月10日)	(2023年8月10日) 現在
項目	第97期末	第98期末	第99期末	第100期末	第101期末	第102期末
(A) 資産	28,629,989,947円	27,144,124,306円	27,467,311,261円	27,838,763,167円	27,519,427,149円	27,518,783,684円
コール・ローン等	1,307,265,342	1,303,445,091	979,188,799	1,048,199,644	1,100,976,692	894,975,704
クレディ・スイス・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(評価額)	27,322,714,603	25,840,669,213	26,102,662,460	26,790,553,522	26,418,440,456	26,623,797,979
ニッセイマネーマーケットマザーファンド(評価額)	10,002	10,002	10,002	10,001	10,001	10,001
未 収 入 金	-	-	385,450,000	-	-	-
(B) 負債	669,634,961	647,655,581	804,441,120	499,298,066	400,280,344	351,970,684
未 払 金	-	258,010,000	-	-	-	-
未払収益分配金	562,707,356	343,788,335	328,843,016	310,996,102	304,548,801	304,192,131
未 払 解 約 金	83,336,096	20,405,400	450,633,211	160,732,988	71,678,672	22,129,987
未 払 信 託 報 酬	23,545,312	25,401,231	24,915,656	27,515,019	24,005,805	25,597,165
その他未払費用	46,197	50,615	49,237	53,957	47,066	51,401
(C) 純資産総額(A-B)	27,960,354,986	26,496,468,725	26,662,870,141	27,339,465,101	27,119,146,805	27,166,813,000
元 本	112,541,471,346	114,596,111,702	109,614,338,816	103,665,367,360	101,516,267,029	101,397,377,322
次期繰越損益金	△ 84,581,116,360	△ 88,099,642,977	△ 82,951,468,675	△ 76,325,902,259	△ 74,397,120,224	△ 74,230,564,322
(D) 受益権総口数	112,541,471,346口	114,596,111,702口	109,614,338,816口	103,665,367,360口	101,516,267,029口	101,397,377,322口
1万口当たり基準価額(C/D)	2,484円	2,312円	2,432円	2,637円	2,671円	2,679円

(注1) 当作成期首元本額 109,838,425,789円
 当作成期中追加設定元本額 18,301,025,168円
 当作成期中一部解約元本額 26,742,073,635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74,230,564,322円です。

損益の状況

	(第97期 第98期 第99期)	2023年2月11日～2023年3月10日) 2023年3月11日～2023年4月10日) 2023年4月11日～2023年5月10日)	(第100期 第101期 第102期)	2023年5月11日～2023年6月12日) 2023年6月13日～2023年7月10日) 2023年7月11日～2023年8月10日)		
項目	第97期	第98期	第99期	第100期	第101期	第102期
(A) 配当等収益	1,086,360,336円	1,129,278,730円	1,136,757,049円	441,182,753円	431,476,061円	435,446,858円
受取配当金	1,086,376,061	1,129,298,114	1,136,782,635	441,221,868	431,514,012	435,484,958
受取利息	1,253	1,879	19	253	2,047	946
支払利息	△ 16,978	△ 21,263	△ 25,605	△ 39,368	△ 39,998	△ 39,046
(B) 有価証券売買損益	361,215,416	△ 2,692,958,760	512,766,240	1,976,703,079	211,865,460	△ 30,478,845
売買益	363,721,832	28,196,024	545,117,447	2,056,532,610	242,646,302	10,529,707
売買損	△ 2,506,416	△ 2,721,154,784	△ 32,351,207	△ 79,829,531	△ 30,780,842	△ 41,008,552
(C) 信託報酬等	△ 23,591,144	△ 25,451,341	△ 24,964,352	△ 27,568,720	△ 24,052,532	△ 25,647,762
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,423,984,608	△ 1,589,131,371	1,624,558,937	2,390,317,112	619,288,989	379,320,251
(E) 前期繰越損益金	△37,702,891,936	△36,051,440,128	△35,635,161,474	△31,727,293,225	△28,261,656,444	△27,310,259,230
(分配準備積立金)	(15,188,407,134)	(15,357,744,309)	(15,120,955,451)	(14,701,288,915)	(14,133,171,450)	(13,919,475,723)
(繰越欠損金)	(△52,891,299,070)	(△51,409,184,437)	(△50,756,116,925)	(△46,428,582,140)	(△42,394,827,894)	(△41,229,734,953)
(F) 追加信託差損益金*	△47,739,501,676	△50,115,283,143	△48,612,023,122	△46,677,930,044	△46,450,203,968	△46,995,433,212
(配当等相当額)	(23,076,621,706)	(24,150,145,539)	(23,412,226,628)	(22,495,983,965)	(22,424,451,613)	(22,712,436,454)
(売買損益相当額)	(△70,816,123,382)	(△74,265,428,682)	(△72,024,249,750)	(△69,173,914,009)	(△68,874,655,581)	(△69,707,869,666)
(G) 合計(D+E+F)	△84,018,409,004	△87,755,854,642	△82,622,625,659	△76,014,906,157	△74,092,571,423	△73,926,372,191
(H) 収益分配金	△ 562,707,356	△ 343,788,335	△ 328,843,016	△ 310,996,102	△ 304,548,801	△ 304,192,131
次期繰越損益金(G+H)	△84,581,116,360	△88,099,642,977	△82,951,468,675	△76,325,902,259	△74,397,120,224	△74,230,564,322
追加信託差損益金	△47,739,501,676	△50,115,283,143	△48,612,023,122	△46,677,930,044	△46,450,203,968	△46,995,433,212
(配当等相当額)	(23,076,621,706)	(24,150,145,539)	(23,412,226,628)	(22,495,983,965)	(22,424,451,613)	(22,712,436,454)
(売買損益相当額)	(△70,816,123,382)	(△74,265,428,682)	(△72,024,249,750)	(△69,173,914,009)	(△68,874,655,581)	(△69,707,869,666)
分配準備積立金	15,694,354,960	16,117,783,363	15,911,666,549	14,826,444,275	14,243,966,677	14,025,082,688
繰越欠損金	△52,535,969,644	△54,102,143,197	△50,251,112,102	△44,474,416,490	△42,190,882,933	△41,260,213,798

(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97期	第98期	第99期	第100期	第101期	第102期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,068,655,182円	1,103,827,389円	1,119,554,114円	436,151,462円	415,344,028円	409,799,096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	23,076,621,706円	24,150,145,539円	23,412,226,628円	22,495,983,965円	22,424,451,613円	22,712,436,454円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	15,188,407,134円	15,357,744,309円	15,120,955,451円	14,701,288,915円	14,133,171,450円	13,919,475,723円
(e) 分配対象額(a + b + c + d)	39,333,684,022円	40,611,717,237円	39,652,736,193円	37,633,424,342円	36,972,967,091円	37,041,711,273円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	3,495.04円	3,543.90円	3,617.48円	3,630.28円	3,642.07円	3,653.12円
(g) 分配金	562,707,356円	343,788,335円	328,843,016円	310,996,102円	304,548,801円	304,192,131円
(h) 分配金(1万口当たり)	50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

■自社の実質保有比率

2023年7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6.8%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。

当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／国内／株式	
信 託 期 間	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)	「クレディ・スイス・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」
	クレディ・スイス・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。 <ul style="list-style-type: none"> ・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、「クレディ・スイス・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「クレディ・スイス・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2022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 (2021年11月1日～2022年10月31日)

<クレディ・スイス・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)	(2,474,954,041)
受取配当金	996,337,138
スワップ収益 (損失)	7,691,590,843
金融資産投資純収益	<u>6,212,973,940</u>
利息収入	726
収益合計	<u>6,212,974,666</u>
投資運用報酬	132,324,417
管理事務代行報酬および信託報酬	29,684,180
名義書換代行報酬	60,884,815
取引費用	20,556,540
その他費用	31,683,169
費用合計	<u>275,133,121</u>
税引前利益	<u>5,937,841,545</u>
源泉税	<u>(152,589,033)</u>
分配前純資産増減額	<u>5,785,252,512</u>
分配金	<u>(10,001,672,426)</u>
分配後純資産増減額	<u><u>(4,216,419,914)</u></u>

(2) 投資有価証券明細表 (2022年10月31日現在)
NISSAY JAPAN EQUITY ACTIVE FUND

Description	Holding / Shares	Issue/ Settle Curr	Market Value (Base)
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL	3,192,500.0000	JPY	2,233,153,750.00
TOKIO MARINE HOLDINGS INC	725,400.0000	JPY	1,952,051,400.00
TOYOTA MOTOR CORP	928,300.0000	JPY	1,911,833,850.00
HITACHI LTD	247,000.0000	JPY	1,669,720,000.00
KEYENCE CORP	25,800.0000	JPY	1,453,056,000.00
NISSAN CHEMICAL CORP	152,500.0000	JPY	1,021,750,000.00
SONY GROUP CORP	102,200.0000	JPY	1,020,773,600.00
NIPPON YUSEN KK	365,700.0000	JPY	987,024,300.00
FUJITSU LIMITED	56,300.0000	JPY	964,137,500.00
MARUBENI CORP	712,400.0000	JPY	928,257,200.00
KDDI CORP	206,600.0000	JPY	908,007,000.00
NIPPON TELEGRAPH & TELEPH	208,000.0000	JPY	851,552,000.00
HOYA CORP	61,100.0000	JPY	847,762,500.00
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL	201,100.0000	JPY	839,190,300.00
NINTENDO CO LTD	134,000.0000	JPY	813,380,000.00
DAIICHI SANKYO CO LTD	161,900.0000	JPY	771,777,300.00
SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	49,500.0000	JPY	769,230,000.00
RECRUIT HOLDINGS CO LTD	149,200.0000	JPY	684,828,000.00
SHIONOGI & CO LTD	98,600.0000	JPY	679,354,000.00
BANDAI NAMCO HOLDINGS INC	64,200.0000	JPY	631,856,400.00
CHUGAI PHARMACEUTICAL CO	177,200.0000	JPY	611,340,000.00
ROHTO PHARMACEUTICAL CO L	130,000.0000	JPY	601,250,000.00
ITOCHU CORP	150,800.0000	JPY	580,429,200.00
mitsui & CO LTD	164,300.0000	JPY	541,039,900.00
DAIKIN INDUSTRIES LTD	22,100.0000	JPY	494,708,500.00
FANUC CORP	24,600.0000	JPY	482,898,000.00
TOKYO ELECTRON LTD	11,500.0000	JPY	454,135,000.00
NOMURA RESEARCH INSTITUTE	129,000.0000	JPY	426,345,000.00
RENASAS ELECTRONICS CORP	341,200.0000	JPY	425,305,800.00
NIDEC CORP	49,600.0000	JPY	408,604,800.00
MURATA MANUFACTURING CO L	55,800.0000	JPY	407,340,000.00
OBIC CO LTD	17,800.0000	JPY	398,186,000.00
SOFTBANK GROUP CORP	60,100.0000	JPY	384,640,000.00
FAST RETAILING CO LTD	4,600.0000	JPY	381,754,000.00
FUJI ELECTRIC CO LTD	62,900.0000	JPY	362,304,000.00
MITSUBISHI ESTATE CO LTD	164,200.0000	JPY	307,546,600.00
SHIMADZU CORP	64,900.0000	JPY	254,732,500.00
KUBOTA CORP	121,400.0000	JPY	252,087,100.00
LASERTEC CORP	11,400.0000	JPY	242,706,000.00
ADVANTEST CORP	30,200.0000	JPY	237,372,000.00
JFE HOLDINGS INC	158,700.0000	JPY	216,308,100.00
UNICHARM CORP	36,600.0000	JPY	165,871,200.00
YASKAWA ELECTRIC CORP	39,800.0000	JPY	164,374,000.00
IHI CORP	44,800.0000	JPY	148,736,000.00
CALBEE INC	37,600.0000	JPY	112,236,000.00
USD CLASS SWAP	6,546,941,529.0000	JPY	91,002,487.00
KOTOBUKI SPIRITS CO LTD	10,600.0000	JPY	80,878,000.00
COVERED CALL CLASS SWAP	26,930,899,445.0000	JPY	-393,191,132.00

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 23 期

(計算期間：2022年10月18日～2023年4月17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。



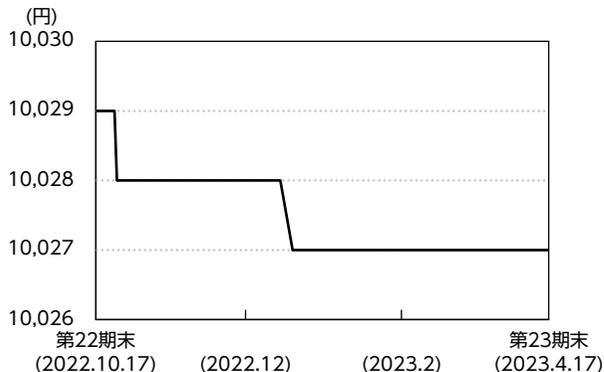
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2022年10月18日～2023年4月17日

基準価額等の推移



(注) 当マザー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>

- ・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

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
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
22期 (2022年10月17日)	10,029	0.0	79.4	50
23期 (2023年 4月17日)	10,027	△0.0	89.9	706

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)2022年10月17日	10,029	—	79.4
10月末	10,028	△0.0	59.6
11月末	10,028	△0.0	59.5
12月末	10,028	△0.0	70.6
2023年 1月末	10,027	△0.0	71.7
2月末	10,027	△0.0	70.1
3月末	10,027	△0.0	68.4
(期末)2023年 4月17日	10,027	△0.0	89.9

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2022年10月18日～2023年4月17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)	・ 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（10,027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

2022年10月18日～2023年4月17日

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	14,014	—
	地方債証券	311,009	—
	特殊債券	301,574	(30,000)

(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

2022年10月18日～2023年4月17日

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
千円		千円	
第132回 共同発行市場公募地方債	155,957	—	—
平成30年度第2回 北海道公募公債（5年）	155,051		
第202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,619		
第26回 政保日本政策金融公庫債券	100,528		
第49回 政保地方公共団体金融機構債券	100,427		
第1121回 国庫短期証券	14,014		

(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

2023年4月17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			
					5年以上	2年以上	2年未満	
千円	千円	%	%	%	%	%	%	
国債証券	14,000 (14,000)	14,009 (14,009)	2.0 (2.0)	—	—	—	—	2.0 (2.0)
地方債証券	320,000 (320,000)	320,968 (320,968)	45.4 (45.4)	—	—	—	—	45.4 (45.4)
特殊債券 (除く金融債券)	300,000 (300,000)	300,773 (300,773)	42.6 (42.6)	—	—	—	—	42.6 (42.6)
合計	634,000 (634,000)	635,751 (635,751)	89.9 (89.9)	—	—	—	—	89.9 (89.9)

(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
国債証券	第1121回 国庫短期証券	—	2023/11/20	14,000	14,009
	小計	—	—	—	14,009
地方債証券	平成30年度第2回 北海道公募公債(5年)	0.0300	2023/ 5 /31	155,000	155,014
	第374回 大阪府公募公債	0.9380	2023/ 7 /28	10,000	10,026
	第132回 共同発行市場公募地方債	0.6600	2024/ 3 /25	155,000	155,928
	小計	—	—	—	320,968
特殊債券 (除く金融債券)	第202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.6990	2023/10/31	100,000	100,390
	第49回 政保地方公共団体金融機構債券	0.8820	2023/ 6 /16	100,000	100,146
	第26回 政保日本政策金融公庫債券	0.9110	2023/ 7 /19	100,000	100,236
	小計	—	—	—	300,773
	合計	—	—	—	635,751

投資信託財産の構成

2023年4月17日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	635,751	89.9
コール・ローン等、その他	71,405	10.1
投資信託財産総額	707,157	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

(2023年4月17日現在)

項目	当期末
(A)資産	707,157,019円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	70,979,907
公 社 債 (評 価 額)	635,751,552
未 収 利 息	302,240
前 払 費 用	123,320
(B)負債	323,519
未 払 解 約 金	323,355
そ の 他 未 払 費 用	164
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	706,833,500
元 本	704,956,153
次 期 繰 越 損 益 金	1,877,347
(D)受 益 権 総 口 数	704,956,153口
1万口当たり基準価額 (C / D)	10,027円

(注1) 期首元本額 50,381,791円
 期中追加設定元本額 700,353,019円
 期中一部解約元本額 45,778,657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)	49,952,679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
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・通貨ヘッジあり)	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・高替ヘッジあり)	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・高替ヘッジなし)	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 関連株式ファンド(為替ヘッジあり)	9,967円
ニッセイ A 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 2 0 2 5	654,584,564円
ニッセイ/コムジエスト新興成長株ファンド(資産成長型)	9,969円
ニッセイ/コムジエスト新興成長株ファンド(年2回決算型)	9,969円
ニッセイ A 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 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
既定追加型・繰上償還条項付ニッセイ世界リカバリー株式厳選ファンド(為替ヘッジあり)	9,973円
既定追加型・繰上償還条項付ニッセイ世界リカバリー株式厳選ファンド(為替ヘッジなし)	9,973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・既定追加型)	9,974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 (2022年10月18日~2023年4月17日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	860,754円
受 取 利 息	882,935
支 払 利 息	△ 22,181
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 957,608
売 損	△ 957,608
買 益	△ 957,608
(C)信 託 報 酬 等	△ 1,213
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 98,067
(E)前 期 繰 越 損 益 金	143,762
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	1,955,725
(G)解 約 差 損 益 金	△ 124,073
(H)合 計 (D + E + F + G)	1,877,347
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	1,877,347

(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) (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、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) (G)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。