

第114期末 (2024年8月13日)

基準価額 2,592円

純資産総額 228億円

第109期～第114期
(2024年2月14日～2024年8月13日)

騰落率 Δ 5.8%

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。

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：2024年2月14日～2024年8月13日

第109期 (決算日2024年3月11日) 第112期 (決算日2024年6月10日)
第110期 (決算日2024年4月10日) 第113期 (決算日2024年7月10日)
第111期 (決算日2024年5月10日) 第114期 (決算日2024年8月13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114期の決算を行いました。

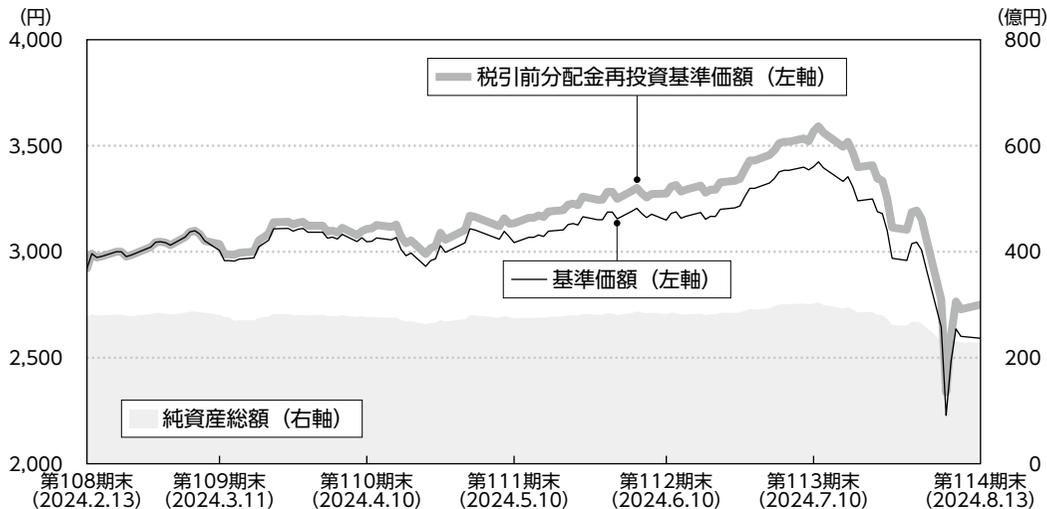
当ファンドは、「U B Sユニバーサル・トラスト (ケイマン) II - ニッセイ・ジャパン・エフティ・アクティブ・ファンド (適格機関投資家限定) カバード・コール・クラス」への投資を通じて、国内の金融商品取引所上場株式を実質的な主要投資対象とするとともに、為替取引を活用し米ドルへの投資効果の享受、株式および通貨のカバードコール戦略によるオプションプレミアムの獲得をめざすことにより、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

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。

運用経過

2024年2月14日～2024年8月13日

基準価額等の推移



第109期首	2,921円	既払分配金	180円
第114期末	2,592円	騰落率(分配金再投資ベース)	△5.8%

(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 >

- ・ 期初から3月にかけて、人工知能(AI)普及による中長期的な需要拡大への期待が高まったことから半導体関連株を中心に株価が上昇したこと
- ・ 5月から7月上旬にかけて、AI普及による業績への恩恵の期待感を受けて電力・電線関連銘柄にも物色が拡大したことや、国内において利上げへの期待感が高まり銀行株などが上昇したこと

< 下落要因 >

- ・ 4月に米国の粘着的なインフレと利下げ期待の後退などから成長期待の高い銘柄を中心に株価が下落したこと
- ・ 7月中旬から8月上旬にかけて、米大統領選に向けて要人発言が増える中、半導体輸出規制に対する懸念が増加し半導体関連株が総じて売られたことやこれまで株価が堅調に推移していた銘柄の下落、加えて、米国の景気悪化懸念が拡大したことや米国の利下げ観測が高まり米ドル安円高に推移したことで、円安の恩恵を受ける企業の業績悪化懸念が増加したこと
- ・ 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109期～第114期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	17円	0.558%	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3,085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）	（0.382）	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	17	0.558	

（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。

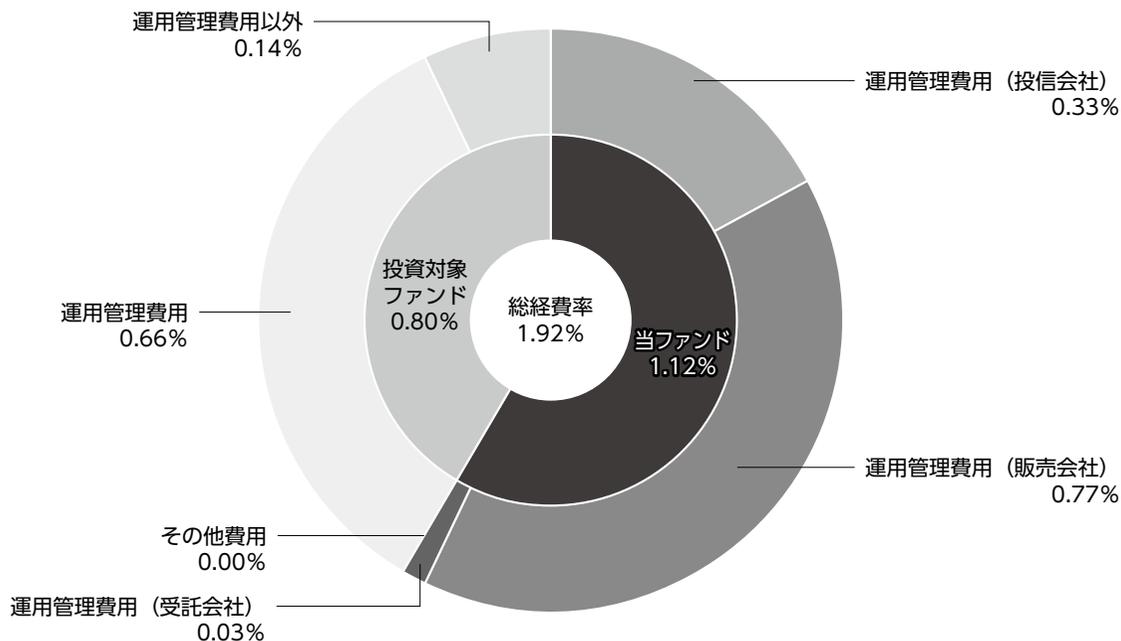
（注3）比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

（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1.92%**です。



総経費率 (①+②+③)	1.92%
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	0.14%

(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当作成期初以降、AI普及による中長期的な需要拡大への期待感が高まったことから半導体関連株を中心に上昇基調で推移しました。米国の粘着的なインフレと利下げ期待の後退などで一時的に株価は軟調に推移する場面もありましたが、AI普及による業績への恩恵の期待感が電力・電線などの幅広い業界に広がったことから上昇基調で推移しました。7月中旬以降は米国の景気悪化懸念等が急速に高まり株価は急落したものの、その後は過度な景気悪化懸念が和らいだことで上昇し、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。

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。

当作成期の米ドル／円相場は当作成期初を1米ドル＝149円近辺でスタートした後、底堅い米景気と相対的に弱い日本景気を受け、日米金利のikai離状態が継続するとの見方から円安基調が続き、一時161円台の円安水準となりました。

しかし、7月末に日銀が政策金利の引き上げを決定し追加的な利上げの可能性を示したことに加え、米国では景気悪化懸念が高まり利下げ観測が高まったことを背景に日米金利差の縮小が意識されたことから米ドル円安高となり、結局、147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（21.2%）、銀行業（10.6%）、医薬品（10.5%）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28.0日、通貨カバードコール戦略のオプションプレミアムは5.1%、カバー率は50.0%、平均行使期間は28.0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109期 2024年2月14日	第110期 2024年3月12日	第111期 2024年4月11日	第112期 2024年5月11日	第113期 2024年6月11日	第114期 2024年7月11日
	～ 2024年3月11日	～ 2024年4月10日	～ 2024年5月10日	～ 2024年6月10日	～ 2024年7月10日	～ 2024年8月13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	0.99%	0.97%	0.98%	0.94%	0.87%	1.14%
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	3,714円	3,727円	3,739円	3,754円	3,769円	3,781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

今後も国内外の金融政策の行方やインフレ、米中通商政策などの不透明要因が相場の上値を抑える波乱要因になると想定されます。加えて、ロシアとウクライナ、中東近辺において地政学リスクが高い状況が続いており、注視が必要であると考えます。

一方で、先行きが不透明な環境下にあっても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、引き続き、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114期末 2024年8月13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）カバード・コール・クラス	97.9%
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。

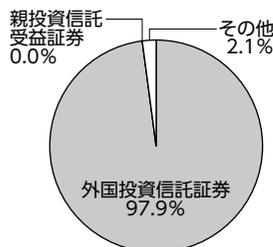
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

純資産等

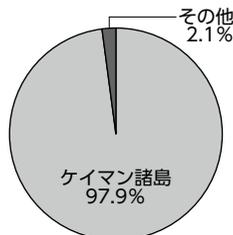
項目	第109期末 2024年3月11日	第110期末 2024年4月10日	第111期末 2024年5月10日	第112期末 2024年6月10日	第113期末 2024年7月10日	第114期末 2024年8月13日
純資産総額	28,070,362,912円	27,657,587,650円	27,436,795,768円	28,239,491,716円	30,206,739,820円	22,817,762,468円
受益権総口数	93,395,600,637口	90,773,281,223口	90,161,479,931口	89,672,162,653口	88,812,409,830口	88,044,345,477口
1万口当たり基準価額	3,006円	3,047円	3,043円	3,149円	3,401円	2,592円

(注) 当作成期間（第109期～第114期）中における追加設定元本額は8,533,248,539円、同解約元本額は15,353,256,049円です。

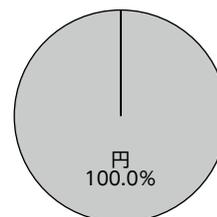
資産別配分



国別配分



通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年8月13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－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

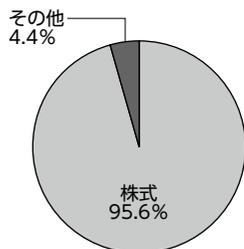
■ 税引前分配金再投資基準価額の推移



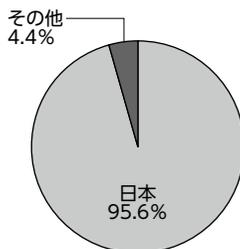
■ 上位銘柄

銘柄名	通貨	比率
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL	円	8.0%
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL	円	6.2
HITACHI LTD	円	6.1
TOKIO MARINE HOLDINGS INC	円	5.1
TOYOTA MOTOR CORP	円	4.9
KEYENCE CORP	円	4.1
MARUBENI CORP	円	3.9
RECRUIT HOLDINGS CO LTD	円	3.5
ROHTO PHARMACEUTICAL CO L	円	3.3
SONY GROUP CORP	円	3.2
組入銘柄数		40

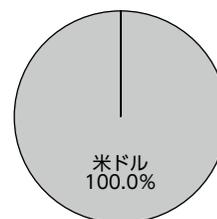
■ 資産別配分



■ 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（2023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

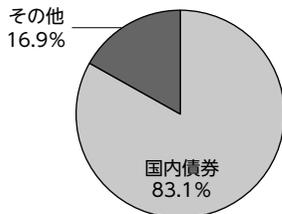
銘柄名	通貨	比率
平成26年度第1回 滋賀県公募公債	円	14.4%
令和元年度第8回 神戸市公募公債（5年）	円	14.4
第213回 神奈川県公募公債	円	12.6
令和元年度第1回 鹿児島県公募公債（5年）	円	12.6
平成26年度第4回 京都府公募公債	円	7.2
第69回 政保地方公共団体金融機構債券	円	6.3
第227回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	円	5.9
第231回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	円	5.7
令和元年度第1回 長崎県公募公債	円	4.0
組入銘柄数		9

■ 1万口当たりの費用明細

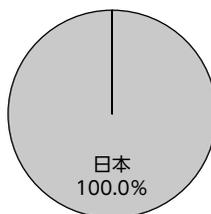
2023.10.17～2024.4.15

項目	金額
その他費用	0円
（その他）	(0)
合計	0

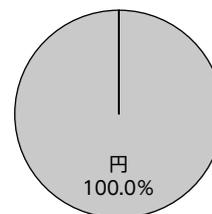
■ 資産別配分



■ 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（2024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-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
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
103期 (2023年 9月11日)	2,767	30	4.4	12,877		98.0	0.0	27,766
104期 (2023年10月10日)	2,654	30	△ 3.0	12,794		98.0	0.0	26,342
105期 (2023年11月10日)	2,763	30	5.2	12,933		98.0	0.0	27,004
106期 (2023年12月11日)	2,643	30	△ 3.3	12,843		97.7	0.0	25,633
107期 (2024年 1月10日)	2,713	30	3.8	12,943		98.0	0.0	26,139
108期 (2024年 2月13日)	2,921	30	8.8	13,181		98.3	0.0	27,714
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

(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	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 109 期	(期首) 2024年2月13日	円 2,921	% -	% 98.3	% 0.0
	2月末	3,043	4.2	98.5	0.0
	(期末) 2024年3月11日	3,036	3.9	98.0	0.0
第 110 期	(期首) 2024年3月11日	3,006	-	98.0	0.0
	3月末	3,092	2.9	98.0	0.0
	(期末) 2024年4月10日	3,077	2.4	98.1	0.0
第 111 期	(期首) 2024年4月10日	3,047	-	98.1	0.0
	4月末	3,042	△ 0.2	98.1	0.0
	(期末) 2024年5月10日	3,073	0.9	97.9	0.0
第 112 期	(期首) 2024年5月10日	3,043	-	97.9	0.0
	5月末	3,155	3.7	98.1	0.0
	(期末) 2024年6月10日	3,179	4.5	98.0	0.0
第 113 期	(期首) 2024年6月10日	3,149	-	98.0	0.0
	6月末	3,299	4.8	98.1	0.0
	(期末) 2024年7月10日	3,431	9.0	98.2	0.0
第 114 期	(期首) 2024年7月10日	3,401	-	98.2	0.0
	7月末	3,045	△10.5	97.9	0.0
	(期末) 2024年8月13日	2,622	△22.9	97.9	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

2024年2月14日～2024年8月13日

(1) 投資信託証券

	第109期～第114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 262,350	千円 3,486,957	千口 367,650	千円 4,875,790

(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109期～第114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

2024年2月14日～2024年8月13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

2024年8月13日現在

(1) 投資信託証券

ファンド名	第108期末	第114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 2,128,946	千口 2,023,646	千円 22,341,060	% 97.9
合計	2,128,946	2,023,646	22,341,060	97.9

(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108期末	第114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1,358,558千口です。

投資信託財産の構成

2024年8月13日現在

項目	第114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 22,341,060	% 96.6
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	788,463	3.4
投資信託財産総額	23,129,534	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

	(2024年3月11日)	(2024年4月10日)	(2024年5月10日)	(2024年6月10日)	(2024年7月10日)	(2024年8月13日) 現在
項目	第109期末	第110期末	第111期末	第112期末	第113期末	第114期末
(A) 資産	28,625,215,805円	28,034,056,324円	27,749,274,430円	28,571,806,348円	30,552,528,919円	23,129,534,095円
コール・ローン等	1,128,868,289	914,194,066	875,307,548	903,221,707	900,170,271	788,463,969
UBSユニバーサル・トラスト (ケイマン)II-ニッセイ・ ジャパン・エグイティ・ 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))	27,496,337,516	27,119,852,258	26,873,956,882	27,668,574,640	29,652,348,647	22,341,060,124
ニッセイマネーマーケット マザーファンド(評価額)	10,000	10,000	10,000	10,001	10,001	10,002
(B) 負債	554,852,893	376,468,674	312,478,662	332,314,632	345,789,099	311,771,627
未払金	206,540,000	-	-	-	-	-
未払収益分配金	280,186,801	272,319,843	270,484,439	269,016,487	266,437,229	264,133,036
未払解約金	44,628,103	78,355,020	16,601,263	36,410,343	52,483,989	19,565,418
未払信託報酬	23,452,242	25,744,267	25,344,739	26,837,344	26,818,227	28,019,213
その他未払費用	45,747	49,544	48,221	50,458	49,654	53,960
(C) 純資産総額(A-B)	28,070,362,912	27,657,587,650	27,436,795,768	28,239,491,716	30,206,739,820	22,817,762,468
元本	93,395,600,637	90,773,281,223	90,161,479,931	89,672,162,653	88,812,409,830	88,044,345,477
次期繰越損益金	△65,325,237,725	△63,115,693,573	△62,724,684,163	△61,432,670,937	△58,605,670,010	△65,226,583,009
(D) 受益権総口数	93,395,600,637口	90,773,281,223口	90,161,479,931口	89,672,162,653口	88,812,409,830口	88,044,345,477口
1万口当たり基準価額(C/D)	3,006円	3,047円	3,043円	3,149円	3,401円	2,592円

(注1) 当作成期首元本額 94,864,352,987円
 当作成期中追加設定元本額 8,533,248,539円
 当作成期中一部解約元本額 15,353,256,049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65,226,583,009円です。

損益の状況

	(第109期 第110期 第111期)	2024年2月14日～2024年3月11日) 2024年3月12日～2024年4月10日) 2024年4月11日～2024年5月10日)	(第112期 第113期 第114期)	2024年5月11日～2024年6月10日) 2024年6月11日～2024年7月10日) 2024年7月11日～2024年8月13日)		
項目	第109期	第110期	第111期	第112期	第113期	第114期
(A) 配当等収益	413,935,841円	405,524,219円	404,443,348円	401,340,655円	399,573,805円	398,930,201円
受取配当金	413,939,529	405,506,598	404,411,397	401,305,333	399,539,033	398,866,907
受取利息	57	18,915	31,951	35,322	34,772	63,294
支払利息	△ 3,745	△ 1,294	-	-	-	-
(B) 有価証券売買損益	655,710,637	259,878,223	△ 142,554,249	830,262,524	2,111,392,972	△ 7,173,089,806
売買益	670,348,702	275,544,528	7,486,599	838,718,356	2,126,336,836	68,893,488
売買損	△ 14,638,065	△ 15,666,305	△ 150,040,848	△ 8,455,832	△ 14,943,864	△ 7,241,983,294
(C) 信託報酬等	△ 23,497,682	△ 25,793,094	△ 25,392,960	△ 26,887,802	△ 26,867,881	△ 28,073,173
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,046,148,796	639,609,348	236,496,139	1,204,715,377	2,484,098,896	△ 6,802,232,778
(E) 前期繰越損益金	△19,869,136,629	△18,291,174,381	△17,576,345,317	△17,236,288,212	△15,872,377,811	△13,320,044,750
(分配準備積立金)	(11,985,329,876)	(11,595,237,824)	(11,485,617,157)	(11,347,921,388)	(11,170,130,470)	(11,022,058,780)
(繰越欠損金)	(△31,854,466,505)	(△29,886,412,205)	(△29,061,962,474)	(△28,584,209,600)	(△27,042,508,281)	(△24,342,103,530)
(F) 追加信託差損益金*	△46,222,063,091	△45,191,808,697	△45,114,350,546	△45,132,081,615	△44,950,953,866	△44,840,172,445
(配当等相当額)	(22,577,254,038)	(22,122,599,754)	(22,125,449,037)	(22,193,561,934)	(22,177,066,168)	(22,168,026,056)
(売買損益相当額)	(△68,799,317,129)	(△67,314,408,451)	(△67,239,799,583)	(△67,325,643,549)	(△67,128,020,034)	(△67,008,198,501)
(G) 合計(D+E+F)	△65,045,050,924	△62,843,373,730	△62,454,199,724	△61,163,654,450	△58,339,232,781	△64,962,449,973
(H) 収益分配金	△ 280,186,801	△ 272,319,843	△ 270,484,439	△ 269,016,487	△ 266,437,229	△ 264,133,036
次期繰越損益金(G+H)	△65,325,237,725	△63,115,693,573	△62,724,684,163	△61,432,670,937	△58,605,670,010	△65,226,583,009
追加信託差損益金	△46,222,063,091	△45,191,808,697	△45,114,350,546	△45,132,081,615	△44,950,953,866	△44,840,172,445
(配当等相当額)	(22,577,254,038)	(22,122,599,754)	(22,125,449,037)	(22,193,561,934)	(22,177,066,168)	(22,168,026,056)
(売買損益相当額)	(△68,799,317,129)	(△67,314,408,451)	(△67,239,799,583)	(△67,325,643,549)	(△67,128,020,034)	(△67,008,198,501)
分配準備積立金	12,109,985,313	11,712,723,889	11,594,183,106	11,471,482,821	11,298,992,366	11,128,782,772
繰越欠損金	△31,213,159,947	△29,636,608,765	△29,204,516,723	△27,772,072,143	△24,953,708,510	△31,515,193,336

(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109期	第110期	第111期	第112期	第113期	第114期
(a) 経費控除後の配当等収益	404,842,238円	389,805,908円	379,050,388円	392,577,920円	395,299,125円	370,857,028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	22,577,254,038円	22,122,599,754円	22,125,449,037円	22,193,561,934円	22,177,066,168円	22,168,026,056円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	11,985,329,876円	11,595,237,824円	11,485,617,157円	11,347,921,388円	11,170,130,470円	11,022,058,780円
(e) 分配対象額(a + b + c + d)	34,967,426,152円	34,107,643,486円	33,990,116,582円	33,934,061,242円	33,742,495,763円	33,560,941,864円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	3,744.01円	3,757.45円	3,769.92円	3,784.24円	3,799.30円	3,811.82円
(g) 分配金	280,186,801円	272,319,843円	270,484,439円	269,016,487円	266,437,229円	264,133,036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

主要投資対象である外国投資信託の名称変更のため、関連条項に所要の変更を行いました。

(2024年5月11日)

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)	「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」
	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、「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2023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 (2022年11月1日～2023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)	6,479,522,145
受取配当金	758,956,098
スワップ収益 (損失)	(448,138,539)
金融資産投資純収益	<u>6,790,339,704</u>
利息収入	(1)
収益合計	<u>6,790,339,703</u>
投資運用報酬	132,171,155
管理事務代行報酬および信託報酬	28,911,893
名義書換代行報酬	60,796,620
取引費用	18,354,360
その他費用	38,046,329
費用合計	<u>278,280,357</u>
税引前利益	<u>6,512,059,346</u>
源泉税	<u>(116,234,127)</u>
分配前純資産増減額	<u>6,395,825,219</u>
分配金	<u>(9,109,129,941)</u>
分配後純資産増減額	<u><u>(2,713,304,722)</u></u>

(2) 投資有価証券明細表 (2023年10月31日現在)
 NISSAY JAPAN EQUITY ACTIVE FUND

Description	Holding / Shares	Issue/ Settle Curr	Market Value (Base)
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL	2,086,400.0000	JPY	2,622,604,800.00
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL	281,700.0000	JPY	2,033,874,000.00
HITACHI LTD	209,700.0000	JPY	1,987,326,900.00
TOKIO MARINE HOLDINGS INC	501,700.0000	JPY	1,677,183,100.00
TOYOTA MOTOR CORP	616,400.0000	JPY	1,596,476,000.00
KEYENCE CORP	22,900.0000	JPY	1,331,635,000.00
MARUBENI CORP	586,500.0000	JPY	1,277,397,000.00
RECRUIT HOLDINGS CO LTD	265,600.0000	JPY	1,150,844,800.00
ROHTO PHARMACEUTICAL CO L	306,500.0000	JPY	1,070,298,000.00
SONY GROUP CORP	84,100.0000	JPY	1,044,942,500.00
ITOCHU CORP	186,300.0000	JPY	1,000,989,900.00
NIPPON TELEGRAPH & TELEPH	5,380,300.0000	JPY	951,237,040.00
SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	203,400.0000	JPY	908,791,200.00
RENASAS ELECTRONICS CORP	464,100.0000	JPY	907,547,550.00
TOKYO ELECTRON LTD	40,300.0000	JPY	796,126,500.00
HOYA CORP	54,200.0000	JPY	776,957,000.00
NISSAN CHEMICAL CORP	125,500.0000	JPY	764,922,500.00
ADVANTEST CORP	194,400.0000	JPY	741,636,000.00
NINTENDO CO LTD	110,400.0000	JPY	686,798,400.00
CHUGAI PHARMACEUTICAL CO	145,900.0000	JPY	650,714,000.00
OBIC CO LTD	28,500.0000	JPY	633,982,500.00
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO	143,700.0000	JPY	583,853,100.00
SHIONOGI & CO LTD	81,100.0000	JPY	566,645,700.00
FUJI ELECTRIC CO LTD	98,800.0000	JPY	560,986,400.00
NIPPON YUSEN KK	145,900.0000	JPY	536,474,300.00
UNICHARM CORP	98,300.0000	JPY	503,394,300.00
BANDAI NAMCO HOLDINGS INC	158,600.0000	JPY	492,135,800.00
SOCIONEXT INC	34,100.0000	JPY	491,722,000.00
NOMURA RESEARCH INSTITUTE	120,700.0000	JPY	476,040,800.00
LASERTEC CORP	16,900.0000	JPY	425,964,500.00
TOYOTA TSUSHO CORP	50,100.0000	JPY	396,090,600.00
FAST RETAILING CO LTD	11,600.0000	JPY	383,032,000.00
DAIKIN INDUSTRIES LTD	17,300.0000	JPY	374,199,000.00
MURATA MANUFACTURING CO L	137,700.0000	JPY	341,151,750.00
COVERED CALL CLASS SWAP	25,808,411,058.0000	JPY	291,635,045.00
SOFTBANK GROUP CORP	37,800.0000	JPY	231,487,200.00
ROHM CO LTD	50,000.0000	JPY	119,300,000.00
USD CLASS SWAP	7,142,535,505.0000	JPY	117,137,582.00
KOTOBUKI SPIRITS CO LTD	44,000.0000	JPY	87,692,000.00
YASKAWA ELECTRIC CORP	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 25 期

(計算期間：2023年10月17日～2024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。



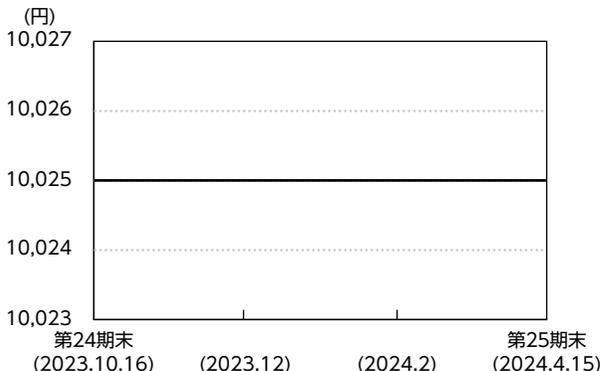
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2023年10月17日～2024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
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
24期 (2023年10月16日)	10,025	△0.0	82.1	720
25期 (2024年 4月15日)	10,025	0.0	83.1	1,391

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)2023年10月16日	10,025	—	82.1
10月末	10,025	0.0	68.2
11月末	10,025	0.0	66.2
12月末	10,025	0.0	68.6
2024年 1月末	10,025	0.0	80.8
2月末	10,025	0.0	81.3
3月末	10,025	0.0	82.8
(期末)2024年 4月15日	10,025	0.0	83.1

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2023年10月17日～2024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（10,025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

2023年10月17日～2024年4月15日

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	—	—
	地方債証券	751,688	(14,000)
	特殊債券	250,006	(320,000)
			—
			(100,000)

(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

2023年10月17日～2024年4月15日

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
		千円	
平成26年度第1回 滋賀県公募公債	200,932	—	—
令和元年度第8回 神戸市公募公債(5年)	200,018		
第213回 神奈川県公募公債	175,738		
令和元年度第1回 鹿児島県公募公債(5年)	175,000		
第69回 政保地方公共団体金融機構債券	88,292		
第227回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	82,335		
第231回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	79,379		

(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

2024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			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
地方債証券	906,000 (906,000)	907,454 (907,454)	65.2 (65.2)	—	—	—	65.2 (65.2)	
特殊債券 (除く金融債券)	249,000 (249,000)	249,693 (249,693)	17.9 (17.9)	—	—	—	17.9 (17.9)	
合計	1,155,000 (1,155,000)	1,157,148 (1,157,148)	83.1 (83.1)	—	—	—	83.1 (83.1)	

(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213回 神奈川県公募公債	0.5340	2025/ 3 /19	175,000	175,697
	平成26年度第4回 京都府公募公債	0.6640	2024/ 6 /20	100,000	100,121
	令和元年度第1回 長崎県公募公債	0.0100	2024/ 6 /26	56,000	56,001
	平成26年度第1回 滋賀県公募公債	0.4950	2024/11/28	200,000	200,624
	令和元年度第8回 神戸市公募公債(5年)	0.0010	2024/10/25	200,000	200,011
	令和元年度第1回 鹿児島県公募公債(5年)	0.0010	2024/10/31	175,000	175,000
	小計	—	—	—	907,454
特殊債券 (除く金融債券)	第227回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.5440	2024/ 9 /30	82,000	82,196
	第231回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.4950	2024/11/29	79,000	79,240
	第69回 政保地方公共団体金融機構債券	0.4140	2025/ 2 /17	88,000	88,257
	小計	—	—	—	249,693
	合計	—	—	—	1,157,148

投資信託財産の構成

2024年4月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	1,157,148	82.9
コール・ローン等、その他	238,985	17.1
投資信託財産総額	1,396,133	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

(2024年4月15日現在)

項目	当期末
(A)資産	1,396,133,758円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	238,112,222
公 社 債 (評 価 額)	1,157,148,717
未 収 利 息	772,952
前 払 費 用	99,867
(B)負債	4,451,868
未 払 解 約 金	4,451,868
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	1,391,681,890
元 本	1,388,192,825
次 期 繰 越 損 益 金	3,489,065
(D)受 益 権 総 口 数	1,388,192,825口
1万口当たり基準価額 (C / D)	10,025円

(注1) 期首元本額 718,501,875円
 期中追加設定元本額 788,774,139円
 期中一部解約元本額 119,083,189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)	49,951,688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
ニッセイ世界ハイ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
D C ニッセイターゲットデットファンド 2 0 2 5	1,337,812,268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 CW 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 CW 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 CW 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 CW 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(予想配分金提示型)	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(予想配分金提示型)	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・横上償還条項付ニッセイ世界リカバリー株式戦略ファンド(為替ヘッジあり)	9,973円
ニッセイ/シュロダー・グローバルCBファンド2023-02(為替ヘッジあり・既定追加型)	9,974円
既定追加型・横上償還条項付ニッセイ世界リカバリー株式戦略ファンド2023-07(為替ヘッジあり)	9,975円
既定追加型・横上償還条項付ニッセイ世界リカバリー株式戦略ファンド2023-07(為替ヘッジなし)	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 (2023年10月17日～2024年4月15日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	1,802,484円
受 取 利 息	1,841,178
支 払 利 息	△ 38,694
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 1,814,569
売	△ 1,814,569
買	△ 1,814,569
(C)信 託 報 酬 等	△ 4,705
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 16,790
(E)前 期 繰 越 損 益 金	1,831,616
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	1,971,882
(G)解 約 差 損 益 金	△ 297,643
(H)合 計 (D + E + F + G)	3,489,065
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	3,489,065

(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。