

第2期末 (2024年9月20日)

基準価額 16,771円

純資産総額 1,938億円

騰落率 26.8%

分配金 0円

<購入・換金手数料なし> ニッセイNASDAQ100 インデックスファンド

追加型投信/海外/株式/インデックス型

運用報告書(全体版)

作成対象期間:2023年9月21日~2024年9月20日

第2期(決算日 2024年9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「<購入・換金手数料なし>ニッセイNASDAQ100インデックスファンド」は、このたび第2期の決算を行いました。

当ファンドは「ニッセイNASDAQ100インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に米国の株式等(DR(預託証券)を含みます)に投資することにより、NASDAQ100指数(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

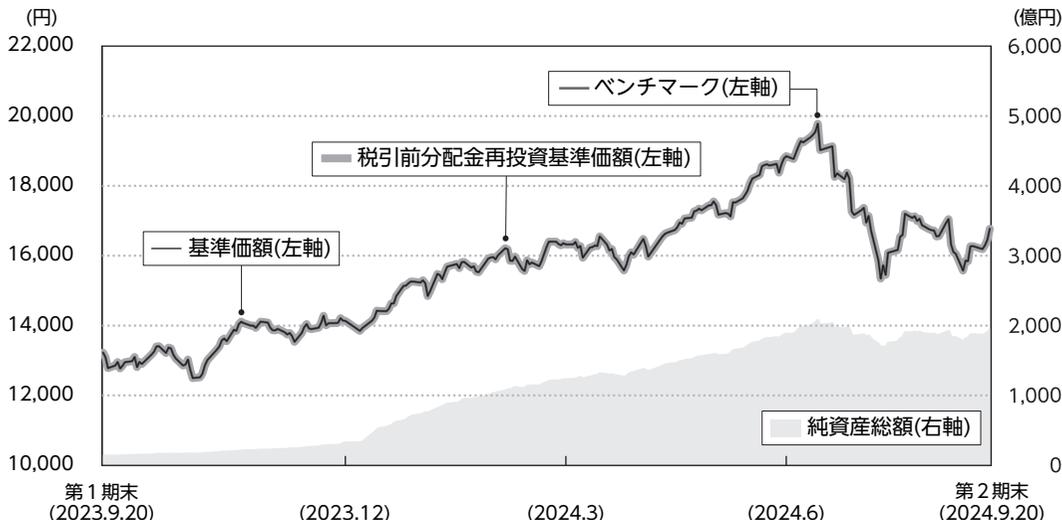
NISSAY
ASSET MANAGEMENT

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2023年9月21日～2024年9月20日

基準価額等の推移



第2期首	13,225円	既払分配金	0円
第2期末	16,771円	騰落率 (分配金再投資ベース)	26.8%

(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) ベンチマークはNASDAQ100指数(配当込み、円換算ベース)で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・2023年12月および2024年3月に米連邦準備制度理事会(FRB)のパウエル議長が金融引き締めに慎重な姿勢を示したことを好感し株価が上昇したこと
- ・年初から3月にかけて、人工知能(AI)関連銘柄が市場全体をけん引し、株価が上昇したこと

<下落要因>

- ・4月に中東情勢の緊迫化を背景に株価が下落したこと
- ・7月から9月初めにかけて、米大統領選を巡る混乱や雇用統計の悪化などによる景気減速懸念を受けて株価が下落したこと
- ・7月から当期末にかけて、米利下げ観測や日銀の追加利上げを受け、内外金利差の縮小などから円高が進行したこと

1万口当たりの費用明細

項目	第2期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	32円	0.203%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は15,729円です。</p>
(投信会社)	(20)	(0.126)	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)	(9)	(0.055)	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)	(3)	(0.022)	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
売買委託手数料	1	0.004	$\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$ 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.002)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
有価証券取引税	0	0.000	$\text{有価証券取引税} = \text{期中の有価証券取引税} / \text{期中の平均受益権口数}$ 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.000)	
その他費用	1	0.009	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$
(保管費用)	(1)	(0.008)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.001)	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	34	0.217	

(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、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

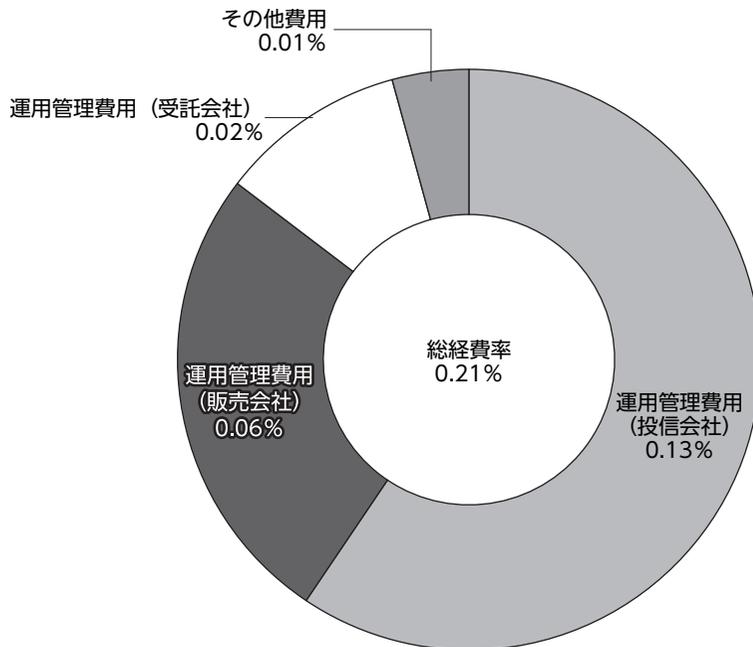
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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。

(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0.21%**です。



(注1) 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。

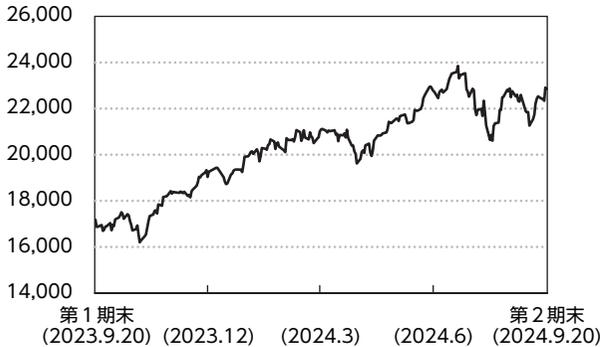
(注3) 各比率は年率換算した値です。

(注4) 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

■米国株式市況

【NASDAQ100指数
(配当込み、米ドルベース)の推移】

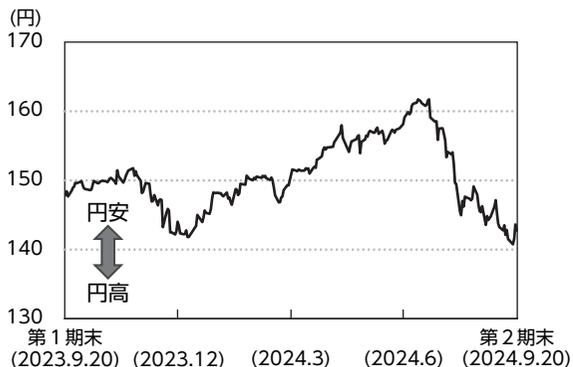


(注) Nasdaq社のデータを使用しています。

米国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。期初から2023年10月にかけては、7-9月の企業決算において多くの企業が慎重な見通しの姿勢を示したことから株価は下落しました。しかし、その後は米消費者物価指数(CPI)が市場予想を下回ったことを受けて長期金利が低下したことや、パウエルFRB議長の金融引き締めに慎重な姿勢を好感し上昇しました。2024年初から3月にかけては、台湾のTSMCやエヌビディアの好決算をきっかけにAI関連銘柄が市場全体をけん引したことに加え、パウエルFRB議長が議会証言で金融引き締めに慎重な姿勢を示したことを好感し上昇しました。4月には中東情勢の緊迫化を背景に下落したものの、5月以降は米長期金利が低下したことや好決算を発表したAI関連銘柄が市場の上昇をけん引しました。7月から9月初めにかけては、トランプ氏を狙った銃撃事件やバイデン米大統領の大統領選からの撤退表明など米大統領選を巡る混乱や雇用統計の悪化などによる景気減速懸念を受け下落する場面もありましたが、米連邦公開市場委員会(FOMC)で0.5%の大幅な利下げが決定され、米経済のソフトランディング(軟着陸)への期待感から上昇して当期末を迎えました。

■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。

米ドル/円レートは期を通じてみると米ドル安円高となりました。

期初から2023年10月にかけては、FRBによる金融引き締めや日銀の金融緩和策の継続を背景に、米ドル高円安が進行しました。

11月以降、FRBの利下げ観測や日銀の金融緩和策の修正観測から米ドル安円高となりましたが、2024年1月以降はFRBの早期利下げ観測が後退すると、再び米ドル高円安が進行しました。

7月以降は日本の当局による円買い介入とみられる動きや日銀の追加利上げ、米国のインフレ鈍化による米利下げへの期待感の高まりなどから、米ドル安円高となりました。

ポートフォリオ

■当ファンド

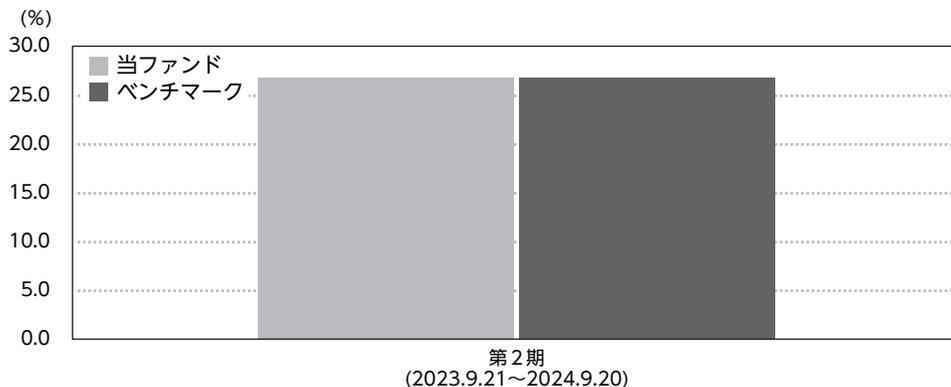
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

■マザーファンド

米国の株式等（DRを含みます）に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

*ベンチマークはNASDAQ100指数（配当込み、円換算ベース）です。ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

ベンチマークとの差異



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+26.8%となり、ベンチマーク騰落率（+26.9%）にほぼ連動しました。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金

当期の分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案した結果、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
	2023年9月21日～2024年9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	6,770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

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に米国の株式等（DRを含みます）に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

■マザーファンド

米国の株式等（DRを含みます）に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

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2期末 2024年9月20日
ニッセイNASDAQ100 インデックスマザーファンド	100.0%

(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

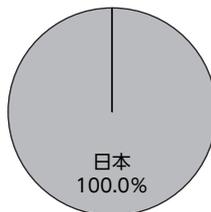
項目	第2期末 2024年9月20日
純資産総額	193,817,607,487円
受益権総口数	115,568,666,201口
1万口当たり基準価額	16,771円

(注) 当期間中における追加設定元本額は128,126,380,500円、同解約元本額は22,726,798,166円です。

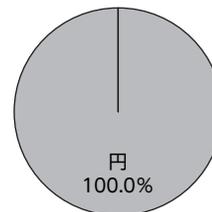
■資産別配分



■国別配分



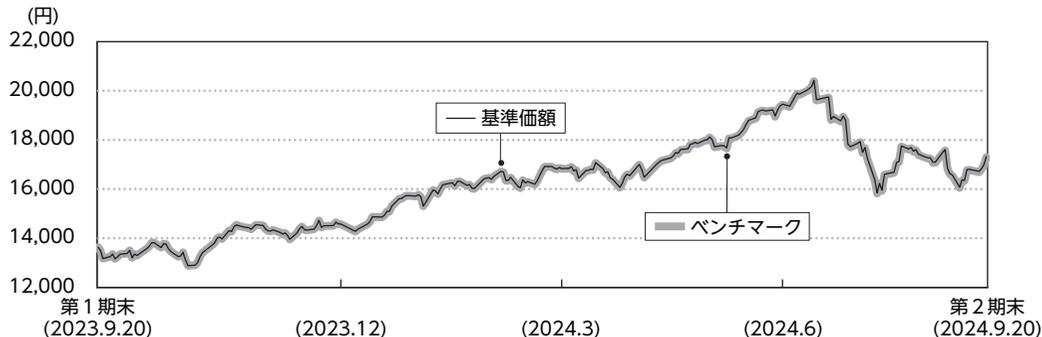
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年9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。

ニッセイNASDAQ100インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

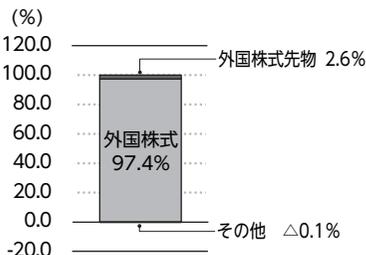
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	8.8%
MICROSOFT CORP	米ドル	8.2
NVIDIA CORP	米ドル	7.3
BROADCOM INC	米ドル	5.0
AMAZON.COM INC	米ドル	5.0
META PLATFORMS INC-A	米ドル	4.9
TESLA, INC.	米ドル	3.0
NASDAQ 100 E-MINI FUTURES 202412 買	米ドル	2.6
COSTCO WHOLESALE CORP	米ドル	2.6
ALPHABET INC-CL A	米ドル	2.4
組入銘柄数		102

■ 1万口当たりの費用明細

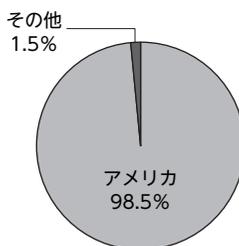
2023.9.21~2024.9.20

項目	金額
売買委託手数料	1円
(株式)	(0)
(先物・オプション)	(0)
有価証券取引税	0
(株式)	(0)
その他費用	1
(保管費用)	(1)
(その他)	(0)
合計	2

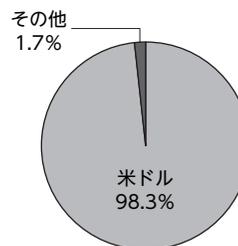
■ 資産別配分



■ 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9月20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) 国別配分における海外先物は上場取引所の国・地域に基づき開示しています。

(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)の組入有価証券明細表をご参照ください。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	ベンチ マーク	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
				基準価額+ 累計分配金					
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	百万円
2023年3月31日	10,000	—	—	10,000	10,000	—	—	—	1
1期(2023年9月20日)	13,225	0	32.3	13,225	13,225	32.3	95.0	6.1	13,448
2期(2024年9月20日)	16,771	0	26.8	16,771	16,777	26.9	97.4	2.6	193,817

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

(注3) 「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4) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注5) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注6) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

(注7) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

(注8) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

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		ベンチ マーク	騰落率		株式 組入比率	株式 先物比率
(期首)2023年9月20日	円		%			%	%	%
	13,225		—	13,225		—	95.0	6.1
9月末	12,952	△	2.1	12,953	△	2.1	95.6	5.1
10月末	12,625	△	4.5	12,627	△	4.5	91.5	9.3
11月末	13,859		4.8	13,863		4.8	90.2	10.8
12月末	14,134		6.9	14,135		6.9	94.0	8.7
2024年1月末	15,209		15.0	15,212		15.0	91.6	9.6
2月末	15,893		20.2	15,897		20.2	95.7	4.9
3月末	16,320		23.4	16,325		23.4	97.8	2.2
4月末	16,477		24.6	16,483		24.6	94.3	5.7
5月末	17,174		29.9	17,177		29.9	96.8	3.2
6月末	18,848		42.5	18,854		42.6	96.8	3.4
7月末	16,947		28.1	16,952		28.2	97.8	2.2
8月末	16,560		25.2	16,566		25.3	97.9	2.2
(期末)2024年9月20日	16,771		26.8	16,777		26.9	97.4	2.6

(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。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2023年9月21日～2024年9月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイNASDAQ100インデックスマザーファンド	124,202,008	203,005,388	22,152,319	36,896,011

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
	ニッセイNASDAQ100インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	165,667,055千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	99,627,073千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.66

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) 外国株式の(a)は各月末(決算日の属する月については決算日)、(b)は各月末の国内の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2023年9月21日～2024年9月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

親投資信託残高

2024年9月20日現在

種類	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイNASDAQ100インデックスマザーファンド	9,867,777	111,917,467	193,818,669

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるニッセイNASDAQ100インデックスマザーファンド全体の口数は111,917,467千口です。

投資信託財産の構成

2024年9月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイNASDAQ100インデックスマザーファンド	193,818,669	99.8
コール・ローン等、その他	372,486	0.2
投資信託財産総額	194,191,155	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお9月20日における邦貨換算レートは、1米ドル142.76円です。

(注2) ニッセイNASDAQ100インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(190,516,951千円)の投資信託財産総額(194,032,410千円)に対する比率は98.2%です。

(注3) 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9月20日現在)

項目	当期末
(A) 資産	194,191,155,933円
コール・ローン等	165,963,959
ニッセイNASDAQ100インデックスマザーファンド(評価額)	193,818,669,551
未収入金	206,522,423
(B) 負債	373,548,446
未払解約金	204,430,966
未払信託報酬	168,208,336
その他未払費用	909,144
(C) 純資産総額(A-B)	193,817,607,487
元本	115,568,666,201
次期繰越損益金	78,248,941,286
(D) 受益権総口数	115,568,666,201口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,771円

(注) 期首元本額 10,169,083,867円
 期中追加設定元本額 128,126,380,500円
 期中一部解約元本額 22,726,798,166円

損益の状況

当期(2023年9月21日~2024年9月20日)

項目	当期
(A) 配当等収益	48,184円
受取利息	48,960
支払利息	776
(B) 有価証券売買損益	11,336,338,960
売買益	14,232,530,754
売買損	△ 2,896,191,794
(C) 信託報酬等	△ 217,143,585
(D) 当期損益金(A+B+C)	11,119,243,559
(E) 前期繰越損益金	512,983,909
(分配準備積立金)	(512,984,205)
(繰越欠損金)	(△ 296)
(F) 追加信託差損益金*	66,616,713,818
(配当等相当額)	(8,660,102,924)
(売買損益相当額)	(57,956,610,894)
(G) 合計(D+E+F)	78,248,941,286
次期繰越損益金(G)	78,248,941,286
追加信託差損益金	66,616,713,818
(配当等相当額)	(8,660,102,924)
(売買損益相当額)	(57,956,610,894)
分配準備積立金	11,632,227,468

(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	48,184円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	11,119,195,079円
(c) 信託約款に定める収益調整金	66,616,713,818円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	512,984,205円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	78,248,941,286円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	6,770.77円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

お知らせ

■ 自社による当ファンドの設定解約状況

前期末 残高 (元本)	当期 設定元本	当期 解約元本	当期末残高			取引の理由
			元本	評価額	比率	
百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	%	
1	-	1	-	-	-	当初設定時における取得分の処分

(注) 元本の単位未満は切捨てています。

当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／海外／株式／インデックス型	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	ニッセイNASDAQ100インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に米国の株式等（DR（預託証券）を含みます）に投資することにより、NASDAQ100指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。	
主要運用対象	<購入・換金手数料なし> ニッセイNASDAQ100 インデックスファンド	ニッセイNASDAQ100インデックスマザーファンド受益証券
	ニッセイNASDAQ100 インデックスマザーファンド	米国の株式等（DRを含みます）
運用方法	<購入・換金手数料なし> ニッセイNASDAQ100 インデックスファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	ニッセイNASDAQ100 インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
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、市況動向等を勘案して決定します。	

ニッセイNASDAQ100インデックス マザーファンド

運用報告書

第 2 期

(計算期間：2023年9月21日～2024年9月20日)

運用方針

主に米国の株式等（DR（預託証券）を含みます）に投資することにより、NASDAQ100指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

主要運用 対象

米国の株式等（DRを含みます）

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

- ・ 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。



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

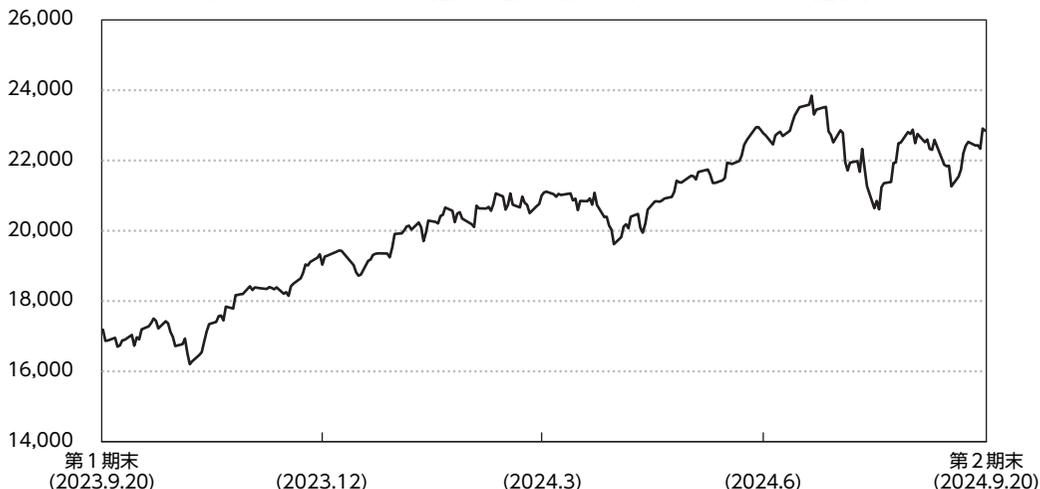
運用経過

2023年9月21日～2024年9月20日

投資環境

■ 米国株式市況

【NASDAQ100指数（配当込み、米ドルベース）の推移】

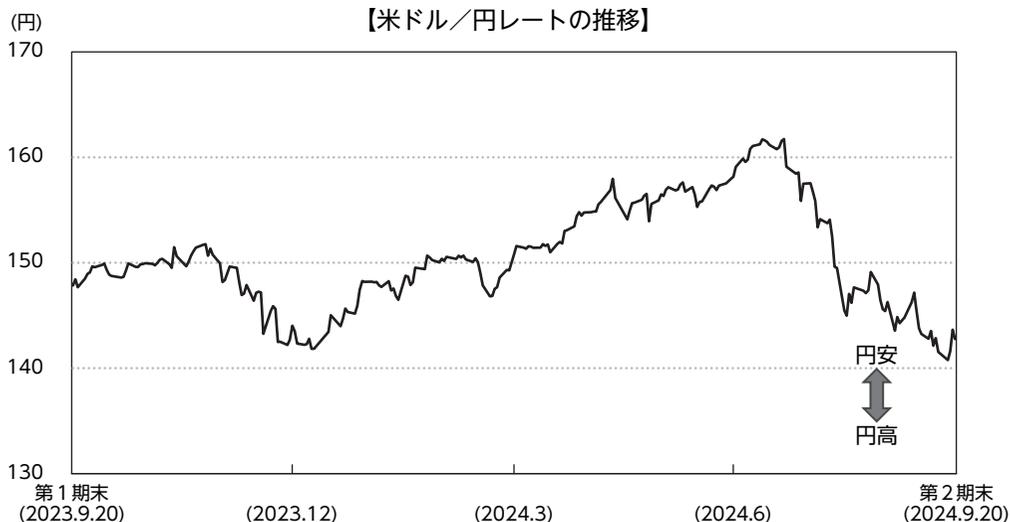


(注) Nasdaq社のデータを使用しています。

米国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初から2023年10月にかけては、7～9月の企業決算において多くの企業が慎重な見通しの姿勢を示したことから株価は下落しました。しかし、その後は米消費者物価指数（CPI）が市場予想を下回ったことを受けて長期金利が低下したことや、パウエルFRB議長の金融引き締めに関心し上昇しました。2024年初から3月にかけては、台湾のTSMCやエヌビディアの好決算をきっかけにAI関連銘柄が市場全体をけん引したことに加え、パウエルFRB議長が議会証言で金融引き締めに関心したことを好感し上昇しました。4月は中東情勢の緊迫化を背景に下落したものの、5月以降は米長期金利が低下したことや好決算を発表したAI関連銘柄が市場の上昇をけん引しました。7月から9月初めにかけては、トランプ氏を狙った銃撃事件やバイデン米大統領の大統領選からの撤退表明など米大統領選を巡る混乱や雇用統計の悪化などによる景気減速懸念を受け下落する場面もありましたが、米連邦公開市場委員会（FOMC）で0.5%の大幅な利下げが決定され、米経済のソフトランディング（軟着陸）への期待感から上昇して当期末を迎えました。

■為替市況



(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

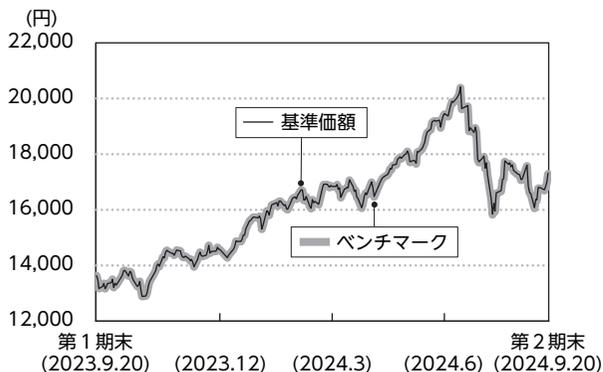
米ドル／円レートは期を通じてみると米ドル安円高となりました。

期初から2023年10月にかけては、F R Bによる金融引き締めや日銀の金融緩和策の継続を背景に、米ドル高円安が進行しました。

11月以降、F R Bの利下げ観測や日銀の金融緩和策の修正観測から米ドル安円高となりましたが、2024年1月以降はF R Bの早期利下げ観測が後退すると、再び米ドル高円安が進行しました。

7月以降は日本の当局による円買い介入とみられる動きや日銀の追加利上げ、米国のインフレ鈍化による米利下げへの期待感の高まりなどから、米ドル安円高となりました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・2023年12月および2024年3月に米連邦準備制度理事会（FRB）のパウエル議長が金融引き締めに慎重な姿勢を示したことを好感し株価が上昇したこと
- ・年初から3月にかけて、人工知能（AI）関連銘柄が市場全体をけん引し、株価が上昇したこと

<下落要因>

- ・4月に中東情勢の緊迫化を背景に株価が下落したこと
- ・7月から9月初めにかけて、米大統領選を巡る混乱や雇用統計の悪化などによる景気減速懸念を受けて株価が下落したこと
- ・7月から当期末にかけて、米利下げ観測や日銀の追加利上げを受け、内外金利差の縮小などから円高が進行したこと

ポートフォリオ

米国の株式等（DRを含みます）に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+27.1%となり、ベンチマーク騰落率（+26.9%）にほぼ連動しました。

今後の運用方針

米国の株式等（DRを含みます）に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
(設定日)	円	%		%	%	%	百万円
2023年3月28日	10,000	—	10,000	—	—	—	699
1期(2023年9月20日)	13,629	36.3	13,600	36.0	95.0	6.1	14,243
2期(2024年9月20日)	17,318	27.1	17,252	26.9	97.4	2.6	193,819

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注3) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注4) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

(注5) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

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	ベンチマーク	騰落率	株式組入比率	株式先物比率
	円	%		%	%	%
(期首)2023年9月20日	13,629	—	13,600	—	95.0	6.1
9月末	13,348	△ 2.1	13,320	△ 2.1	95.6	5.1
10月末	13,013	△ 4.5	12,985	△ 4.5	91.5	9.3
11月末	14,288	4.8	14,255	4.8	90.2	10.8
12月末	14,574	6.9	14,535	6.9	94.0	8.7
2024年1月末	15,685	15.1	15,643	15.0	91.6	9.6
2月末	16,393	20.3	16,347	20.2	95.7	4.9
3月末	16,836	23.5	16,787	23.4	97.8	2.2
4月末	17,001	24.7	16,950	24.6	94.3	5.7
5月末	17,723	30.0	17,664	29.9	96.8	3.2
6月末	19,454	42.7	19,388	42.6	96.8	3.4
7月末	17,495	28.4	17,432	28.2	97.8	2.2
8月末	17,098	25.5	17,035	25.3	97.9	2.2
(期末)2024年9月20日	17,318	27.1	17,252	26.9	97.4	2.6

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2023年9月21日～2024年9月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	1円 (0) (0)	0.004% (0.002) (0.002)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
有価証券取引税 (株式)	0 (0)	0.000 (0.000)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用 (保管費用)	1 (1)	0.008 (0.008)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(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	2	0.012	

(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（16,227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9月21日～2024年9月20日

(1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株	千米ドル	百株	千米ドル
		69,189 (9,960)	1,089,684	4,299	8,262

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

(注2) ()内は株式分割、合併などによる増減分で、上段の数字には含まれていません。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
	127,860	124,453	-	-

(注1) 外貨建取引の金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）における国内の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2023年9月21日～2024年9月20日

株式

銘柄	買付			売付			
	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
MICROSOFT CORP	228	13,989,684	61,183	SPLUNK INC	8	212,353	23,755
APPLE INC	471	13,560,270	28,776	APPLE INC	5	140,213	28,020
NVIDIA CORP	204	9,230,392	45,077	SIRIUS XM HOLDINGS INC	283	133,710	471
AMAZON.COM INC	320	8,195,787	25,582	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	69	116,700	1,678
BROADCOM INC	68	7,328,901	107,266	MICROSOFT CORP	2	112,886	52,578
META PLATFORMS INC-A	107	7,153,092	66,465	SEAGEN INC	2	76,813	32,479
TESLA, INC.	153	4,761,126	31,110	AMAZON.COM INC	2	61,936	21,269
ALPHABET INC-CL A	180	4,165,968	23,066	NVIDIA CORP	0.717	49,752	69,390
ALPHABET INC-CL C	172	4,014,623	23,237	ALPHABET INC-CL C	2	43,110	19,143
COSTCO WHOLESALE CORP	35	3,957,597	111,152	EBAY INC	6	39,695	5,921

(注1) 金額は受渡代金で、外国株式は各月末（決算日の属する月については決算日）における国内の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注2) 株数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数および金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

組入有価証券明細表

2024年9月20日現在

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ADOBE INC	35	394	20,747	2,961,841	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES INC	124	1,421	22,286	3,181,582	半導体・半導体製造装置
AIRBNB INC-CLASS A	32	388	5,000	713,856	消費者サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	5	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
ALPHABET INC-CL A	212	2,000	32,437	4,630,810	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL C	207	1,913	31,229	4,458,268	メディア・娯楽
AMAZON.COM INC	369	3,544	67,296	9,607,258	一般消費財・サービス流通・小売り
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	39	463	4,717	673,511	公益事業
AMGEN INC	41	471	15,853	2,263,194	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANALOG DEVICES INC	38	436	10,190	1,454,770	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	6	76	2,475	353,357	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	560	5,222	119,528	17,063,888	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	64	728	14,327	2,045,431	半導体・半導体製造装置
ARM HOLDINGS PLC-ADR	-	103	1,461	208,694	半導体・半導体製造装置
ASML HOLDING NV	6	80	6,629	946,416	半導体・半導体製造装置
ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR	44	512	4,041	576,975	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ATLASSIAN CORP-CL A	11	140	2,285	326,257	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	16	189	5,113	730,013	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	31	360	9,998	1,427,347	商業・専門サービス
BAKER HUGHES COMPANY	77	877	3,192	455,711	エネルギー
BIOGEN INC	11	128	2,580	368,327	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOOKING HOLDINGS INC	2	29	11,992	1,712,016	消費者サービス
BROADCOM INC	31	4,076	68,251	9,743,528	半導体・半導体製造装置
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	20	239	6,711	958,104	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	-	118	2,693	384,578	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	11	126	4,198	599,317	メディア・娯楽
CINTAS CORP	7	357	7,274	1,038,483	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	313	3,544	18,230	2,602,628	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COCA-COLA EUROPA PACIFIC PARTNERS PLC	-	403	3,281	468,436	食品・飲料・タバコ
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	38	437	3,289	469,551	ソフトウェア・サービス
COMCAST CORP	316	3,443	13,865	1,979,499	メディア・娯楽
CONSTELLATION ENERGY	24	277	5,781	825,396	公益事業
COPART INC	73	846	4,384	625,998	商業・専門サービス
COSTAR GROUP INC	31	359	2,849	406,741	不動産管理・開発
COSTCO WHOLESALE CORP	34	390	35,141	5,016,796	生活必需品流通・小売り
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	17	202	5,628	803,538	ソフトウェア・サービス
CSX CORP	154	1,719	5,984	854,365	運輸

ニッセイNASDAQ100インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
DATADOG INC - CLASS A	22	271	3,134	447,500	ソフトウェア・サービス
DEXCOM INC	29	349	2,516	359,191	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	13	156	2,849	406,781	エネルギー
DOLLAR TREE INC	16	191	1,417	202,388	生活必需品流通・小売り
DOORDASH INC - A	-	335	4,609	658,093	消費者サービス
EBAY INC	40	-	-	-	一般消費財・サービス流通・小売り
ELECTRONIC ARTS INC	20	234	3,297	470,816	メディア・娯楽
ENPHASE ENERGY INC	10	-	-	-	半導体・半導体製造装置
EXELON CORP	76	879	3,456	493,427	公益事業
FASTENAL CO	43	503	3,595	513,240	資本財
FORTINET INC	60	672	5,084	725,874	ソフトウェア・サービス
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	34	401	3,638	519,481	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	95	1,095	9,195	1,312,681	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBALFOUNDRIES INC	42	485	1,990	284,139	半導体・半導体製造装置
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	51	572	11,668	1,665,830	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	6	72	3,756	536,269	ヘルスケア機器・サービス
ILLUMINA INC	12	140	1,883	268,846	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTEL CORP	321	3,744	7,916	1,130,163	半導体・半導体製造装置
INTUIT INC	21	245	16,088	2,296,782	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	27	312	15,289	2,182,769	ヘルスケア機器・サービス
JD.COM INC-ADR	34	-	-	-	一般消費財・サービス流通・小売り
KEURIG DR PEPPER INC	107	1,192	4,471	638,394	食品・飲料・タバコ
KLA CORPORATION	10	118	9,149	1,306,173	半導体・半導体製造装置
KRAFT HEINZ CO/THE	94	1,068	3,737	533,584	食品・飲料・タバコ
LAM RESEARCH CORP	10	115	9,075	1,295,560	半導体・半導体製造装置
LINDE PLC	-	422	19,840	2,832,395	素材
LUCID GROUP INC	174	-	-	-	自動車・自動車部品
LULULEMON ATHLETICA INC	9	106	2,877	410,734	耐久消費財・アパレル
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	22	251	6,142	876,875	消費者サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	66	761	5,701	813,990	半導体・半導体製造装置
MERCADOLIBRE INC	3	44	9,407	1,343,075	一般消費財・サービス流通・小売り
META PLATFORMS INC-A	111	1,187	66,388	9,477,564	メディア・娯楽
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	41	472	3,722	531,493	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	84	974	8,694	1,241,183	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	266	2,531	111,046	15,853,057	ソフトウェア・サービス
MODERNA INC	29	337	2,293	327,371	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	104	1,179	8,823	1,259,698	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	-	64	1,831	261,459	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	80	916	4,749	678,059	食品・飲料・タバコ
NETFLIX INC	34	379	26,697	3,811,299	メディア・娯楽
NVIDIA CORP	88	8,377	98,749	14,097,459	半導体・半導体製造装置

ニッセイNASDAQ100インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
NXP SEMICONDUCTORS NV	19	224	5,369	766,519	半導体・半導体製造装置	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8	191	3,909	558,076	運輸	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	33	378	2,776	396,312	半導体・半導体製造装置	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4	51	5,780	825,178	一般消費財・サービス流通・小売り	
PACCAR INC	40	461	4,588	655,078	資本財	
PALO ALTO NETWORKS INC	23	284	9,502	1,356,590	ソフトウェア・サービス	
PAYCHEX INC	27	316	4,216	601,994	商業・専門サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	84	920	7,137	1,019,019	金融サービス	
PDD HOLDINGS INC(ADR)	50	587	5,874	838,647	一般消費財・サービス流通・小売り	
PEPSICO INC	105	1,209	21,123	3,015,523	食品・飲料・タバコ	
QUALCOMM INC	85	981	17,074	2,437,494	半導体・半導体製造装置	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8	95	10,964	1,565,329	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ROPER TECHNOLOGIES INC	-	94	5,281	753,923	ソフトウェア・サービス	
ROSS STORES INC	26	294	4,555	650,323	一般消費財・サービス流通・小売り	
SEAGEN INC	14	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	295	-	-	-	メディア・娯楽	
STARBUCKS CORP	88	996	9,655	1,378,392	消費者サービス	
SUPER MICRO COMPUTER INC	-	51	2,252	321,497	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SYNOPSIS INC	11	134	6,929	989,228	ソフトウェア・サービス	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	-	150	2,316	330,714	メディア・娯楽	
TESLA, INC.	113	1,644	40,103	5,725,192	自動車・自動車部品	
TEXAS INSTRUMENTS INC	69	800	16,627	2,373,743	半導体・半導体製造装置	
T-MOBILE US INC	90	1,030	20,580	2,938,042	電気通信サービス	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	34	391	4,313	615,814	メディア・娯楽	
VERISK ANALYTICS INC	11	125	3,338	476,542	商業・専門サービス	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19	227	10,848	1,548,775	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	66	-	-	-	生活必需品流通・小売り	
WARNER BROS DISCOVERY INC	187	2,155	1,810	258,484	メディア・娯楽	
WORKDAY INC-CLASS A	15	186	4,614	658,740	ソフトウェア・サービス	
XCEL ENERGY INC	42	488	3,131	447,008	公益事業	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	19	-	-	-	ソフトウェア・サービス	
ZSCALER INC	11	131	2,275	324,821	ソフトウェア・サービス	
合計	株数・金額	6,951	81,802	1,322,689	188,827,217	
	銘柄数<比率>	101	101	-	<97.4%>	

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。以下同じです。

(注2) 邦貨換算金額の< >内は、当期末の純資産総額に対する株式評価額の比率です。

(注3) 株数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数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。

(注4) 業種はGICS分類（産業グループ）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。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
外国 NASDAQ 100 E-MINI FUTURES	百万円 5,104	百万円 -

(注1) 外貨建ての評価額は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2024年9月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 188,827,217	% 97.3
コール・ローン等、その他	5,205,192	2.7
投資信託財産総額	194,032,410	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお9月20日における邦貨換算レートは、1米ドル142.76円です。

(注2) 外貨建純資産 (190,516,951千円) の投資信託財産総額 (194,032,410千円) に対する比率は98.2%です。

(注3) 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9月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	197,252,125,608円
コール・ローン等	3,623,608,400
株式(評価額)	188,827,217,927
未収入金	3,326,979,374
未収配当金	107,603,040
差入委託証拠金	1,366,716,867
(B)負債	3,432,829,196
未払金	3,226,306,773
未払解約金	206,522,423
(C)純資産総額(A-B)	193,819,296,412
元本	111,917,467,116
次期繰越損益金	81,901,829,296
(D)受益権総口数	111,917,467,116口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,318円

- (注1) 期首元本額 10,451,165,896円
 期中追加設定元本額 124,202,008,711円
 期中一部解約元本額 22,735,707,491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。
 <購入・換金手数料なし>ニッセイNASDAQ100
 インデックスファンド 111,917,467,116円

損益の状況

当期(2023年9月21日~2024年9月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	849,720,843円
受取配当金	787,142,086
受取利息	5,312,342
その他収益金	57,463,089
支払利息	△ 196,674
(B)有価証券売買損益	12,483,390,368
売買益	27,942,741,824
売買損	△ 15,459,351,456
(C)先物取引等損益	971,366,214
取引益	2,019,027,199
取引損	△ 1,047,660,985
(D)信託報酬等	△ 7,708,800
(E)当期損益金(A+B+C+D)	14,296,768,625
(F)前期繰越損益金	3,792,495,521
(G)追加信託差損益金	78,803,380,005
(H)解約差損益金	△ 14,990,814,855
(I)合計(E+F+G+H)	81,901,829,296
次期繰越損益金(I)	81,901,829,296

- (注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
- (注2) (G)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) (H)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。

指数に関して

■ ファンドのベンチマーク等について

- ・ NASDAQ 100 指数（配当込み、円換算ベース）

当ファンドは、Nasdaq, Inc.またはその関連会社（以下、Nasdaq, Inc.およびその関連会社を「Nasdaq社」と総称します）によって、支援、推奨、販売または販売促進されるものではありません。Nasdaq社は、当ファンドの合法性もしくは適合性について、または当ファンドに関する記述および開示の正確性もしくは妥当性について認定するものではありません。Nasdaq社は、当ファンドの保有者または公衆一般のいかなる者に対しても、一般的な証券投資または特に当ファンドへの投資についての妥当性やNasdaq-100 Index®の一般的な株式市況への追従可能性について、明示的か黙示的かを問わず、何らの表明もしくは保証も行いません。Nasdaq社とニッセイアセットマネジメント株式会社との関係は、Nasdaq®およびNasdaq-100 Index®の登録商標ならびにNasdaq社の一定の商号について使用を許諾すること、ならびにニッセイアセットマネジメント株式会社または当ファンドとは無関係に、Nasdaq社が決定、構築および算出を行うNasdaq-100 Index®の使用を許諾することに限られます。Nasdaq社は、Nasdaq-100 Index®の決定、構築および計算に関し、ニッセイアセットマネジメント株式会社または当ファンドの保有者の要望を考慮する義務を負いません。Nasdaq社は、当ファンドの発行に関してその時期、価格もしくはその数量の決定について、または当ファンドを換金する際の算式の決定もしくは計算についての責任を負っておらず、また関与をしていません。Nasdaq社は、当ファンドの管理、マーケティングまたは取引について責任を負いません。Nasdaq社は、Nasdaq-100 Index®とそれに含まれるデータの正確性および中断されない算出を保証しません。Nasdaq社は、Nasdaq-100 Index®またはそれに含まれるデータの利用により、ニッセイアセットマネジメント株式会社、当ファンドの保有者またはその他いかなる者もしくは組織に生じた結果についても、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行いません。Nasdaq社は、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行わず、かつNasdaq-100 Index®またはそれに含まれるデータの利用に関する特定の目的または利用のための市場商品性または適合性については、いかなる保証についても明示的に否認します。上記に限らず、いかなる場合においても、Nasdaq社は、いかなる逸失利益または特別、付随的、懲罰的、間接的もしくは派生的損害や損失について、たとえもし当該損害等の可能性につき通知されていたとしても、何らの責任も負いません。なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。