

第144期末 (2023年10月16日)

基準価額 1,697円

純資産総額 430億円

第139期～第144期  
(2023年4月18日～2023年10月16日)

騰落率 7.8%

分配金合計 120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

# ニッセイ グローバル好配当株式プラス (毎月決算型)

追加型投信／内外／株式

## 運用報告書(全体版)

作成対象期間:2023年4月18日～2023年10月16日

第139期(決算日2023年5月15日) 第142期(決算日2023年8月15日)  
第140期(決算日2023年6月15日) 第143期(決算日2023年9月15日)  
第141期(決算日2023年7月18日) 第144期(決算日2023年10月16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「ニッセイグローバル好配当株式プラス(毎月決算型)」は、このたび第144期の決算を行いました。

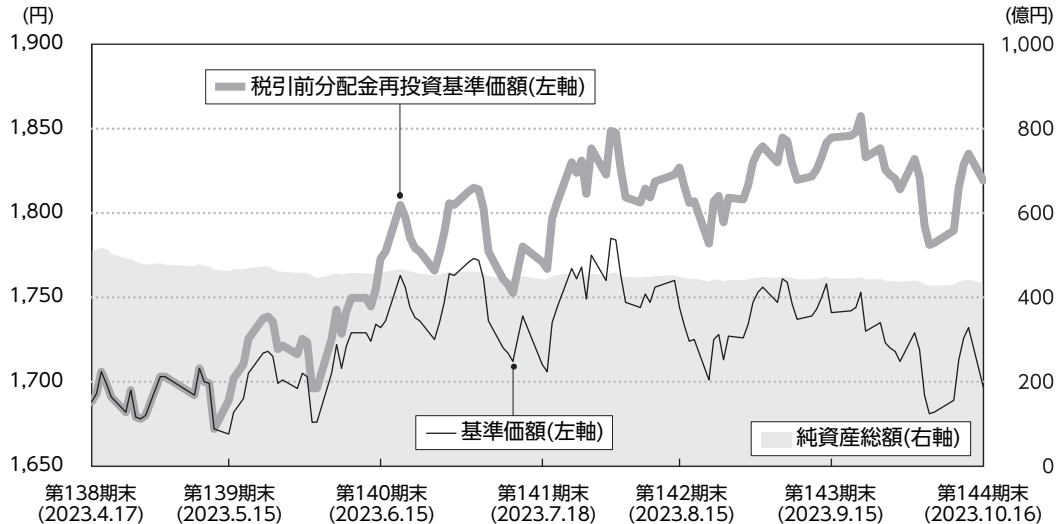
当ファンドは、「シュロダー・インターナショナル・セレクション・ファンド・グローバル・ディビデンド・マキシマイザー クラスJ」への投資を通じて、主に日本を含む各国の好配当株式への投資およびコール・オプションの売却取引を行い、信託財産の成長を図ることを目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

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

2023年4月18日～2023年10月16日

## 基準価額等の推移



第139期首	1,688円	既払分配金	120円
第144期末	1,697円	騰落率 (分配金再投資ベース)	7.8%

(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>

- ・ 6月上旬から下旬にかけて、堅調な米景気動向や生成人工知能（AI）を巡る期待感などから株価が上昇したことに加え、底堅い米経済指標の発表や追加利上げ姿勢を示す米連邦準備制度理事会（FRB）と金融緩和策を維持する日銀との金融政策の方向性の違いが明確となったことなどにより、米ドル高円安基調で推移したこと
- ・ 7月下旬から8月上旬にかけて、日銀が本格的な金融政策の正常化まで時間を要するとの見方が広がったことや米経済に対する楽観的な見方が強まったことなどを受けて米金利が上昇したことから、米ドル高円安基調で推移したこと

### <下落要因>

- ・ 7月上旬から中旬にかけて、日銀の内田副総裁の発言を受け金融緩和修正への期待感が高まったことなどから、米ドルが対円で下落したこと
- ・ 9月中旬から10月上旬にかけて、原油価格の上昇やFRBの金融引き締め長期化懸念などを背景に米金利が上昇したことが嫌気され、株価が下落したこと

## 1万口当たりの費用明細

項目	第139期～第144期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	15円	0.855%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は1,725円です。
(投信会社)	( 8)	(0.459)	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)	( 7)	(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)	(0.014)	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	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)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 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</li> <li>・ 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</li> </ul>
合計	15	0.855	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

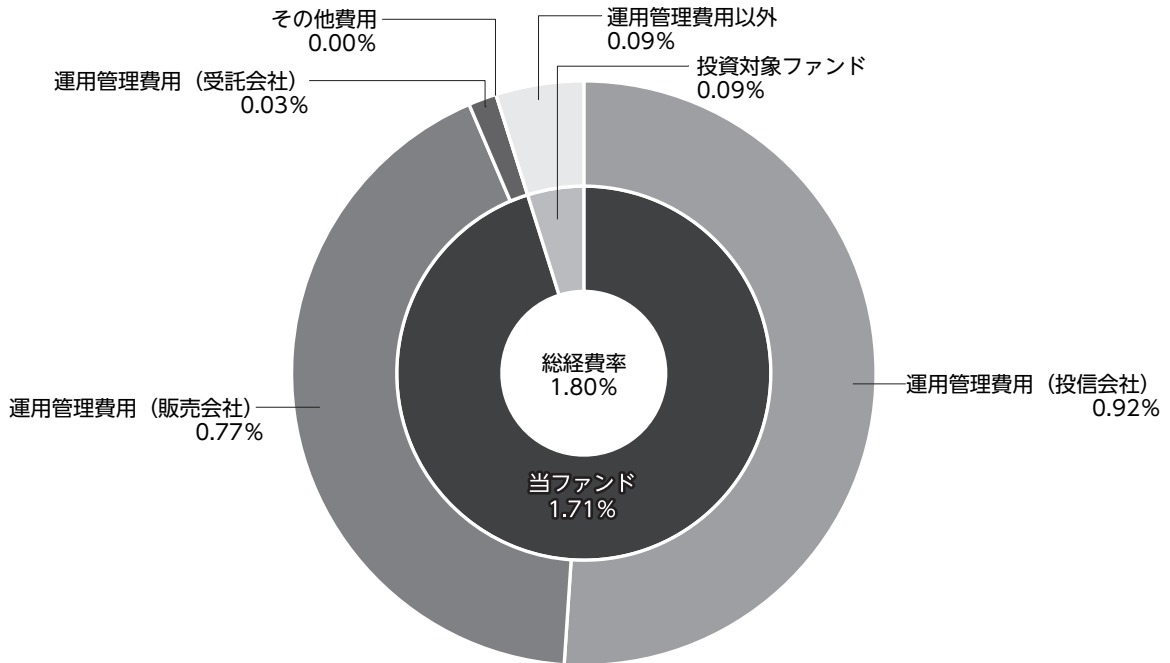
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

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

（参考情報）

■ 総経費率

作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.80%**です。



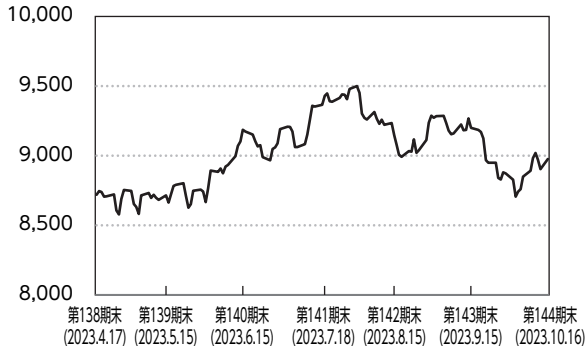
総経費率（①+②）	1.80%
①当ファンドの費用の比率	1.71%
②投資対象ファンドの運用管理費用以外の比率	0.09%

- (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②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。  
 (注8) 投資対象ファンドの運用管理費用はありません。

## 投資環境

### 株式市況

【MSCIワールド・インデックス  
（配当込み、米ドルベース）の推移】



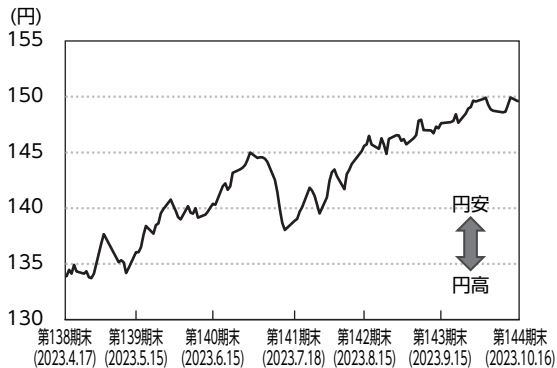
(注) 指数はブルームバーグのデータを使用しています。

株式市場は当作成期を通じて見ると上昇しました。

当作成期初から5月末にかけて、米金融機関に対する信用不安や米企業の業績発表などから株価は一進一退の動きとなりました。その後、6月は堅調な米景気動向や生成AIを巡る期待感などから、7月は米利上げ停止観測の高まりや中国政府の景気支援を強化する方針などから株価が上昇しました。8月上旬から当作成期末にかけては、生成AI需要拡大による米大手半導体企業の好業績発表などからAI関連銘柄を中心に反発する場面もありましたが、中国の景気減速や不動産問題の深刻化に加え、原油価格の上昇やFRBの金融引き締め長期化懸念などを背景に米金利が上昇したことが嫌気され、株価は下落基調で推移しました。

### 為替市況

【米ドル/円レートの推移】



(注) 為替レートは対顧客電信売相場仲値のデータを使用しています。

米ドル/円レートは当作成期を通じて見ると米ドル高円安となりました。

当作成期初から6月末にかけては、底堅い米経済指標の発表や、追加利上げ姿勢を示すFRBと金融緩和策を維持する日銀との金融政策の方向性の違いが明確となったことなどにより、米ドル高円安基調で推移しました。しかし、7月上旬から中旬にかけては、日銀の内田副総裁の発言を受け金融緩和修正への期待感が高まったことなどから、米ドルが対円で下落しました。その後、当作成期末にかけては、日銀が本格的な金融政策の正常化まで時間を要するとの見方の広まりや米経済に対する楽観的な見方の強まりなどを受けて米金利が上昇したことから、米ドル高円安基調で推移しました。

## 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、主に日本を含む各国の好配当株式への投資およびコール・オプションの売却取引を行い、信託財産の成長を図ることを目標に運用を行いました。

### ■シュロージャー・インターナショナル・セレクション・ファンド・グローバル・ディビデンド・マキシマイザー クラスJ

\* シュロージャー・インベストメント・マネジメント株式会社の資料（現地における当作成期末基準）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。

組入銘柄については、新興国を含む全世界の株式を投資対象とし、相対的に配当利回りの高い銘柄を中心に、配当の安定性や成長性、企業業績の動向等を総合的に勘案し、投資銘柄を決定しました。

当作成期末時点における業種配分は、組入比率の高い順にコミュニケーション・サービス（20.0%）、金融（16.8%）、ヘルスケア（13.1%）としており、国・地域別配分は、組入比率の高い順にアメリカ（28.3%）、イギリス（18.0%）、日本（15.3%）としています。

（注1）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。以下同じです。

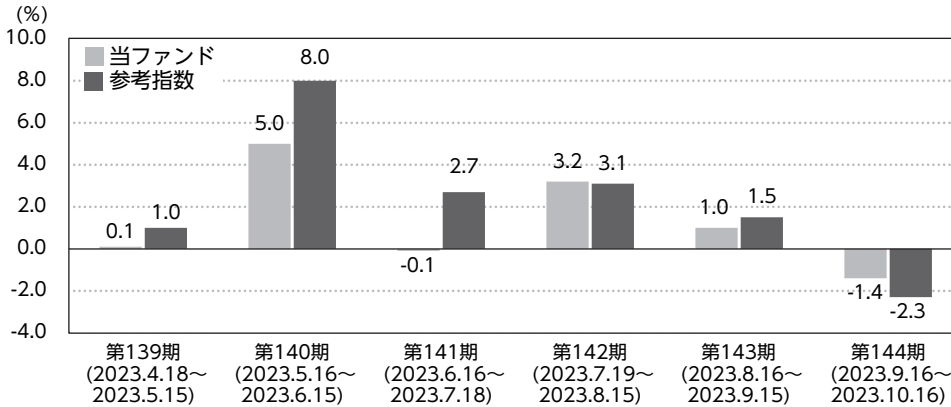
（注2）比率は対組入株式等評価額比です。

（注3）国・地域はシュロージャー・インベストメント・マネジメント株式会社の分類によるものです。

### ■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。

## 参考指数との差異



当ファンドはベンチマークを設けていません。参考指数はMSCIワールド・インデックス（配当込み、円換算ベース）です。

当作成期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+7.8%となり、参考指数騰落率(+14.6%)を下回りました。

これは「シュロダー・インターナショナル・セレクション・ファンド・グローバル・ディビデンド・マキシマイザー クラスJ」の個別銘柄選択において、コミュニケーション・サービスやヘルスケアなどの業種がマイナスに働いたことなどによるものです。

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 参考指数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。

## 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139期	第140期	第141期	第142期	第143期	第144期
	2023年4月18日 ～ 2023年5月15日	2023年5月16日 ～ 2023年6月15日	2023年6月16日 ～ 2023年7月18日	2023年7月19日 ～ 2023年8月15日	2023年8月16日 ～ 2023年9月15日	2023年9月16日 ～ 2023年10月16日
当期分配金（税引前）	20円	20円	20円	20円	20円	20円
対基準価額比率	1.18%	1.14%	1.16%	1.13%	1.14%	1.16%
当期の収益	14円	16円	13円	15円	14円	13円
当期の収益以外	5円	3円	6円	4円	5円	6円
翌期繰越分配対象額	121円	118円	112円	108円	102円	96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

今後も、外国投資信託証券への投資を通じて、主に日本を含む各国の好配当株式への投資およびコール・オプションの売却取引を行い、信託財産の成長を図ることを目標に運用を行います。

## ■シュロダー・インターナショナル・セレクション・ファンド・グローバル・ディビデンド・マキシマイザー クラスJ

賃金インフレへの圧力などから高いインフレ率が続く懸念は根強く、対処するF R Bの金融引き締め姿勢に変化はないとみられることから、今後も米国を中心とした金融政策の引き締め動向が主要なファクターになると見込みます。高インフレと高金利水準により景気への下押し圧力が強い状況ですが、企業の経営活動が保守的になる環境は継続しており、引き続き金融市場の不安心理が大きくなりやすいことから、過度な楽観には注意が必要であると判断しています。景気は減速しつつも良好な雇用環境が景気の下振れリスクを緩和し、金融引き締めの転換が図られることがベストシナリオではありますが、さまざまなリスクがくすぶっていることから、その要素に細心の注意を払う局面が続くと考えています。高インフレと高金利水準の環境下において株式のバリュエーション（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）は株価の押し上げ要因にはなりづらく、個々の企業業績を中心としたファンダメンタルズ（基礎的条件）に着目した物色や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）の激しい動きが続く可能性が想定されます。

ファンドでは、引き続き好配当株式への投資と“プレミアムプラス戦略”により、安定した収益の確保と値上がり益の獲得をめざします。

(注) プレミアムプラス戦略とは、オプション取引を活用し、オプション料（プレミアム）収入の獲得により、安定した収益の確保をめざす戦略をいいます。主に、保有株式の一定水準以上の値上がり益を放棄する見返りとして、オプション料を受け取る取引を行います。

## ■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144期末 2023年10月16日
シュローダー・インターナショナル・セレクション・ファンド・グローバル・ ディビデンド・マキシマイザー クラスJ	97.0%
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。

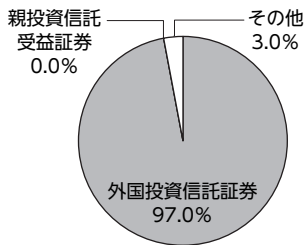
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### 純資産等

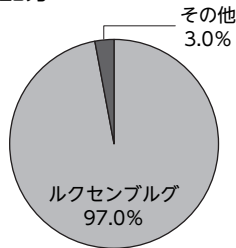
項目	第139期末 2023年5月15日	第140期末 2023年6月15日	第141期末 2023年7月18日	第142期末 2023年8月15日	第143期末 2023年9月15日	第144期末 2023年10月16日
純資産総額	45,936,349,654円	45,623,240,929円	44,004,220,228円	44,542,434,857円	44,134,646,551円	43,003,046,304円
受益権総口数	275,170,010,284口	263,408,739,479口	257,404,677,937口	255,424,996,699口	253,572,291,100口	253,333,738,309口
1万口当たり基準価額	1,669円	1,732円	1,710円	1,744円	1,741円	1,697円

(注) 当作成期間（第139期～第144期）中における追加設定元本額は24,340,492,113円、同解約元本額は70,997,852,614円です。

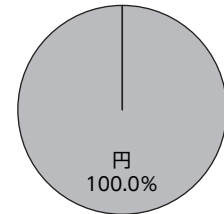
### 資産別配分



### 国別配分



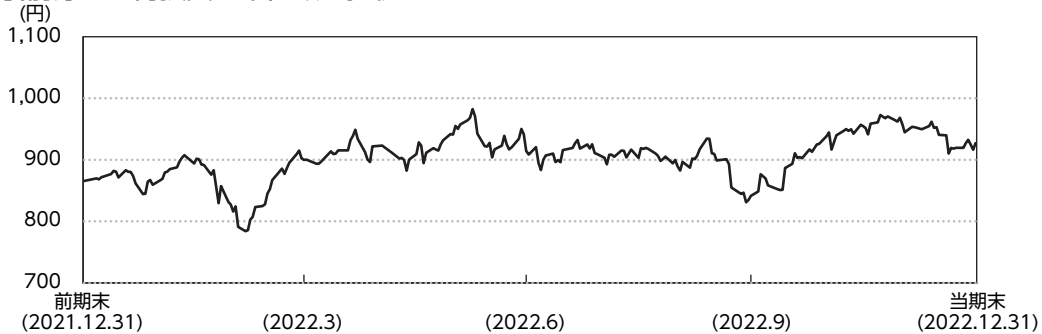
### 通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2023年10月16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。

シュローダー・インターナショナル・セレクション・ファンド・グローバル・ディビデンド・マキシマイザー クラスJの概要

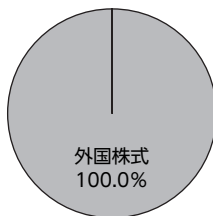
■ 税引前分配金再投資基準価額の推移



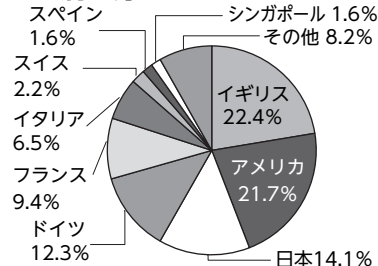
■ 上位銘柄

銘柄名	通貨	比率
STANDARD CHARTERED PLC	イギリス・ポンド	3.0%
WALGREEN BOOTS ALLIANCE INC	米ドル	2.5
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY CLAS	米ドル	2.4
SANOFI SA	ユーロ	2.4
INTEL CORPORATION CORP	米ドル	2.3
CONTINENTAL AG	ユーロ	2.3
HEIDELBERGCEMENT AG	ユーロ	2.3
HENKEL & KGAA PREF AG	ユーロ	2.2
INTESA SANPAOLO	ユーロ	2.2
UNICREDIT	ユーロ	2.2
組入銘柄数		57

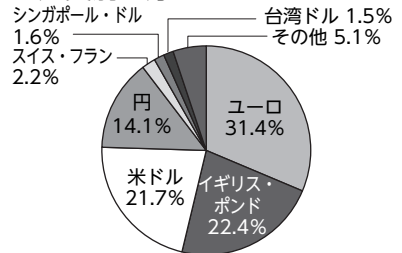
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



- (注1) 主な投資対象となる「シュローダー・インターナショナル・セレクション・ファンド・グローバル・ディビデンド・マキシマイザー クラスJ」が投資している「シュローダー・インターナショナル・セレクション・ファンズ」のうち同ファンドにかかる部分についての説明です。
- (注2) 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3) 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12月31日現在）のものであり、比率は外国投資信託証券の組入株式等に対する評価額の割合です。なお、国別配分はシュローダー・インベストメント・マネジメント株式会社の分類によるものです。
- (注4) 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をご参照ください。

## 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

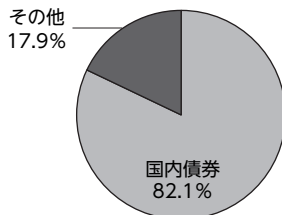
銘柄名	通貨	比率
第132回 共同発行市場公募地方債	円	21.6%
平成26年度第4回 京都府公募公債	円	13.9
第202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	円	13.9
平成25年度第11回 埼玉県公募公債	円	12.0
第727回 東京都公募公債	円	11.0
令和元年度第1回 長崎県公募公債	円	7.8
第1121回 国庫短期証券	円	1.9
組入銘柄数		7

### ■ 1万口当たりの費用明細

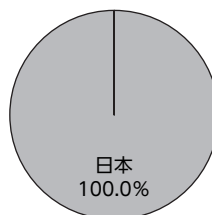
2023.4.18~2023.10.16

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

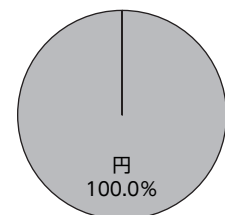
### ■ 資産別配分



### ■ 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10月16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	参考指数	期中 騰落率	シュロダー・ インターナショナル・ セレクション・ ファンド・グローバル・ ティビデンド・ アジア・プラス	債券 組入比率	純資産 総額
115期(2021年 5月17日)	2,150	50	4.1	20,490	40,807	1.4	97.8	0.0	62,866
116期(2021年 6月15日)	2,175	50	3.5	20,565	42,198	3.4	97.0	0.0	64,809
117期(2021年 7月15日)	2,061	50	△ 2.9	20,501	42,816	1.5	96.0	0.0	61,862
118期(2021年 8月16日)	2,035	50	1.2	20,525	43,700	2.1	96.7	0.0	61,867
119期(2021年 9月15日)	1,988	50	0.1	20,528	43,552	△ 0.3	97.6	0.0	60,367
120期(2021年10月15日)	2,000	50	3.1	20,590	44,754	2.8	96.8	0.0	60,773
121期(2021年11月15日)	1,949	50	△ 0.1	20,589	46,913	4.8	97.7	0.0	58,948
122期(2021年12月15日)	1,832	50	△ 3.4	20,522	45,614	△ 2.8	97.6	0.0	55,131
123期(2022年 1月17日)	1,923	50	7.7	20,663	46,187	1.3	97.4	0.0	57,758
124期(2022年 2月15日)	1,918	50	2.3	20,708	44,546	△ 3.6	96.3	0.0	59,241
125期(2022年 3月15日)	1,722	50	△ 7.6	20,562	42,770	△ 4.0	97.4	0.0	54,030
126期(2022年 4月15日)	1,872	30	10.5	20,742	47,889	12.0	97.0	0.0	60,854
127期(2022年 5月16日)	1,809	30	△ 1.8	20,709	44,989	△ 6.1	97.7	0.0	54,824
128期(2022年 6月15日)	1,820	30	2.3	20,750	43,851	△ 2.5	96.7	0.0	54,017
129期(2022年 7月15日)	1,739	30	△ 2.8	20,699	45,299	3.3	96.2	0.0	52,203
130期(2022年 8月15日)	1,745	30	2.1	20,735	48,971	8.1	97.1	0.0	52,374
131期(2022年 9月15日)	1,701	30	△ 0.8	20,721	48,327	△ 1.3	98.0	0.0	50,960
132期(2022年10月17日)	1,623	30	△ 2.8	20,673	45,707	△ 5.4	97.0	0.0	48,337
133期(2022年11月15日)	1,715	30	7.5	20,795	48,349	5.8	98.3	0.0	50,927
134期(2022年12月15日)	1,674	30	△ 0.6	20,784	47,390	△ 2.0	98.3	0.0	49,618
135期(2023年 1月16日)	1,635	30	△ 0.5	20,775	45,361	△ 4.3	96.9	0.0	48,674
136期(2023年 2月15日)	1,687	30	5.0	20,857	48,610	7.2	97.9	0.0	50,175
137期(2023年 3月15日)	1,633	30	△ 1.4	20,833	46,824	△ 3.7	97.5	0.0	48,598
138期(2023年 4月17日)	1,688	20	4.6	20,908	49,272	5.2	97.1	0.0	50,626
139期(2023年 5月15日)	1,669	20	0.1	20,909	49,769	1.0	96.9	0.0	45,936
140期(2023年 6月15日)	1,732	20	5.0	20,992	53,768	8.0	97.8	0.0	45,623
141期(2023年 7月18日)	1,710	20	△ 0.1	20,990	55,195	2.7	97.8	0.0	44,004
142期(2023年 8月15日)	1,744	20	3.2	21,044	56,896	3.1	96.9	0.0	44,542
143期(2023年 9月15日)	1,741	20	1.0	21,061	57,763	1.5	96.9	0.0	44,134
144期(2023年10月16日)	1,697	20	△ 1.4	21,037	56,453	△ 2.3	97.0	0.0	43,003

(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) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 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5) 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	参考指数	騰落率	シュローダー・ インターナショナル・ セレクション・ ファンド・グローバル・ ディビデンド・ マキシマイザー クラスJ	債券 組入比率
第 139 期	(期首)	円	%		%	%	%
	2023年 4月17日	1,688	－	49,272	－	97.1	0.0
	4月末	1,680	△0.5	49,375	0.2	96.4	0.0
第 140 期	(期末)						
	2023年 5月15日	1,689	0.1	49,769	1.0	96.9	0.0
	(期首)						
第 141 期	2023年 5月15日	1,669	－	49,769	－	96.9	0.0
	5月末	1,703	2.0	51,781	4.0	97.0	0.0
	(期末)						
第 142 期	2023年 6月15日	1,752	5.0	53,768	8.0	97.8	0.0
	(期首)						
	2023年 6月15日	1,732	－	53,768	－	97.8	0.0
第 143 期	6月末	1,763	1.8	55,684	3.6	97.5	0.0
	(期末)						
	2023年 7月18日	1,730	△0.1	55,195	2.7	97.8	0.0
第 144 期	(期首)						
	2023年 7月18日	1,710	－	55,195	－	97.8	0.0
	7月末	1,760	2.9	56,344	2.1	97.8	0.0
第 145 期	(期末)						
	2023年 8月15日	1,764	3.2	56,896	3.1	96.9	0.0
	(期首)						
第 146 期	2023年 8月15日	1,744	－	56,896	－	96.9	0.0
	8月末	1,753	0.5	57,382	0.9	98.8	0.0
	(期末)						
第 147 期	2023年 9月15日	1,761	1.0	57,763	1.5	96.9	0.0
	(期首)						
	2023年 9月15日	1,741	－	57,763	－	96.9	0.0
第 148 期	9月末	1,712	△1.7	56,203	△2.7	97.3	0.0
	(期末)						
	2023年10月16日	1,717	△1.4	56,453	△2.3	97.0	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4月18日～2023年10月16日

(1) 投資信託証券

	第139期～第144期			
	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
シュローダー・インターナショナル・セクション・ファンド・グローバル・ディビデンド・マキシマイザー クラスJ	千口 1,050	千円 969,180	千口 10,770	千円 9,596,090

(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139期～第144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

2023年4月18日～2023年10月16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10月16日現在

(1) 投資信託証券

ファンド名	第138期末	第144期末		
	口数	口数	評価額	比率
シュローダー・インターナショナル・セクション・ファンド・グローバル・ディビデンド・マキシマイザー クラスJ	千口 55,817	千口 46,097	千円 41,733,499	% 97.0
合計	55,817	46,097	41,733,499	97.0

(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138期末	第144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 10	千口 10	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718,501千口です。

投資信託財産の構成

2023年10月16日現在

項目	第144期末	
	評価額	比率
	千円	%
シュローダー・インターナショナル・セレクション・ファンド・グローバル・ディビデント・マキシマイザー クラスJ	41,733,499	95.6
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	1,918,933	4.4
投資信託財産総額	43,652,443	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5月15日) (2023年6月15日) (2023年7月18日) (2023年8月15日) (2023年9月15日) (2023年10月16日)現在

項目	第139期末	第140期末	第141期末	第142期末	第143期末	第144期末
<b>(A)資産</b>						
産	46,967,793,655円	46,344,855,323円	44,638,229,245円	45,159,307,293円	44,740,096,622円	43,652,443,251円
コール・ローン等	2,166,457,785	1,738,088,247	1,619,385,427	1,976,138,538	1,968,535,369	1,918,933,460
シュローダー・インターナショナル・セレクション・ファンド・グローバル・ディビデント・マキシマイザー・クラスJ(評価額)	44,492,995,844	44,606,757,050	43,018,833,792	43,183,158,729	42,771,551,227	41,733,499,766
ニッセイマネーマーケットマザーファンド(評価額)	10,026	10,026	10,026	10,026	10,026	10,025
未収入金	308,330,000	-	-	-	-	-
<b>(B)負債</b>						
債	1,031,444,001	721,614,394	634,009,017	616,872,436	605,450,071	649,396,947
未払収益分配金	550,340,020	526,817,478	514,809,355	510,849,993	507,144,582	506,667,476
未払解約金	417,356,961	127,912,506	48,683,562	46,673,446	33,672,268	78,981,367
未払信託報酬	63,683,884	66,816,790	70,443,596	59,287,800	64,567,374	63,682,658
その他未払費用	63,136	67,620	72,504	61,197	65,847	65,446
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>45,936,349,654</b>	<b>45,623,240,929</b>	<b>44,004,220,228</b>	<b>44,542,434,857</b>	<b>44,134,646,551</b>	<b>43,003,046,304</b>
元本	275,170,010,284	263,408,739,479	257,404,677,937	255,424,996,699	253,572,291,100	253,333,738,309
次期繰越損益金	△229,233,660,630	△217,785,498,550	△213,400,457,709	△210,882,561,842	△209,437,644,549	△210,330,692,005
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>275,170,010,284口</b>	<b>263,408,739,479口</b>	<b>257,404,677,937口</b>	<b>255,424,996,699口</b>	<b>253,572,291,100口</b>	<b>253,333,738,309口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	1,669円	1,732円	1,710円	1,744円	1,741円	1,697円

(注1) 当作成期首元本額 299,991,098,810円  
 当作成期中追加設定元本額 24,340,492,113円  
 当作成期中一部解約元本額 70,997,852,614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210,330,692,005円です。

損益の状況

(第139期 2023年 4月18日～2023年 5月15日) (第142期 2023年 7月19日～2023年 8月15日)  
 (第140期 2023年 5月16日～2023年 6月15日) (第143期 2023年 8月16日～2023年 9月15日)  
 (第141期 2023年 6月16日～2023年 7月18日) (第144期 2023年 9月16日～2023年10月16日)

項目	第139期	第140期	第141期	第142期	第143期	第144期
(A)配当等収益	466,211,563円	440,655,986円	425,078,020円	425,783,663円	422,185,165円	417,887,378円
受取配当金	466,278,633	440,735,524	425,152,570	425,861,825	422,240,747	417,945,029
受取利息	279	406	4,687	1,451	2,984	3,962
支払利息	△ 67,349	△ 79,944	△ 79,237	△ 79,613	△ 58,566	△ 61,613
(B)有価証券売買損益	△ 354,721,593	1,786,760,502	△ 422,296,585	1,008,250,658	65,942,775	△ 928,175,082
売買益	21,003,221	1,827,496,230	6,365,913	1,029,548,108	73,926,858	10,730,553
売買損	△ 375,724,814	△ 40,735,728	△ 428,662,498	△ 21,297,450	△ 7,984,083	△ 938,905,635
(C)信託報酬等	△ 63,748,307	△ 66,885,920	△ 70,517,196	△ 59,350,013	△ 64,633,863	△ 63,749,064
(D)当期損益金(A+B+C)	47,741,663	2,160,530,568	△ 67,735,761	1,374,684,308	423,494,077	△ 574,036,768
(E)前期繰越損益金	△ 4,546,716,560	△ 4,610,737,382	△ 2,763,640,186	△ 3,122,781,432	△ 2,108,839,182	△ 2,018,997,926
(繰越欠損金)	(△ 4,546,716,560)	(△ 4,610,737,382)	(△ 2,763,640,186)	(△ 3,122,781,432)	(△ 2,108,839,182)	(△ 2,018,997,926)
(F)追加信託差損益金*	△ 224,184,345,713	△ 214,808,474,258	△ 210,054,272,407	△ 208,623,614,725	△ 207,245,154,862	△ 207,230,989,835
(配当等相当額)	( 3,500,320,723)	( 3,213,456,627)	( 3,048,918,848)	( 2,869,721,200)	( 2,749,482,997)	( 2,609,255,641)
(売買損益相当額)	(△ 227,684,666,436)	(△ 218,021,930,885)	(△ 213,103,191,255)	(△ 211,493,335,925)	(△ 209,994,637,859)	(△ 209,840,245,476)
(G)合計(D+E+F)	△ 228,683,320,610	△ 217,258,681,072	△ 212,885,648,354	△ 210,371,711,849	△ 208,930,499,967	△ 209,824,024,529
(H)収益分配金	△ 550,340,020	△ 526,817,478	△ 514,809,355	△ 510,849,993	△ 507,144,582	△ 506,667,476
次期繰越損益金(G+H)	△ 229,233,660,630	△ 217,785,498,550	△ 213,400,457,709	△ 210,882,561,842	△ 209,437,644,549	△ 210,330,692,005
追加信託差損益金	△ 224,332,222,477	△ 214,907,865,785	△ 210,214,520,938	△ 208,726,302,074	△ 207,386,016,107	△ 207,383,518,997
(配当等相当額)	( 3,352,443,959)	( 3,114,065,100)	( 2,888,670,317)	( 2,767,033,851)	( 2,608,621,752)	( 2,456,726,479)
(売買損益相当額)	(△ 227,684,666,436)	(△ 218,021,930,885)	(△ 213,103,191,255)	(△ 211,493,335,925)	(△ 209,994,637,859)	(△ 209,840,245,476)
繰越欠損金	△ 4,901,438,153	△ 2,877,632,765	△ 3,185,936,771	△ 2,156,259,768	△ 2,051,628,442	△ 2,947,173,008

(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139期	第140期	第141期	第142期	第143期	第144期
(a) 経費控除後の配当等収益	402,463,256円	427,425,951円	354,560,824円	408,162,644円	366,283,337円	354,138,314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	3,500,320,723円	3,213,456,627円	3,048,918,848円	2,869,721,200円	2,749,482,997円	2,609,255,641円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	0円	0円	0円	0円	0円	0円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	3,902,783,979円	3,640,882,578円	3,403,479,672円	3,277,883,844円	3,115,766,334円	2,963,393,955円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	141.83円	138.22円	132.22円	128.33円	122.87円	116.98円
(g) 分配金	550,340,020円	526,817,478円	514,809,355円	510,849,993円	507,144,582円	506,667,476円
(h) 分配金 (1万口当たり)	20円	20円	20円	20円	20円	20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9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6.9%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／内外／株式	
信 託 期 間	2011年11月1日～2025年10月15日	
運 用 方 針	外国投資信託証券への投資を通じて、主に日本を含む各国の好配当株式への投資およびコール・オプションの売却取引を行い、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	ニッセイグローバル好配当株式プラス（毎月決算型）	「シュロージャー・インターナショナル・セレクション・ファンド・グローバル・ディビデンド・マキシマイザー クラスJ」および「ニッセイマネーマーケットマザーファンド」
	シュロージャー・インターナショナル・セレクション・ファンド・グローバル・ディビデンド・マキシマイザー クラスJ	日本を含む各国の株式およびオプション取引
	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"> <li>・投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・外貨建資産への直接投資は行いません。</li> <li>・株式への直接投資は行いません。</li> </ul>	
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、「シュロージャー・インターナショナル・セレクション・ファンド・グローバル・ディビデンド・マキシマイザー クラスJ」を含む「シュロージャー・インターナショナル・セレクション・ファンズ」の2022年12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。

(1) 損益計算書 (2022年1月1日～2022年12月31日)

シュロージャー・インターナショナル・セレクション・ ファンド・グローバル・ディビデンド・マキシマイザー (米ドル)	
収益	
配当収入 (源泉税控除後)	47,661,785
銀行利息	107,999
<b>収益(損失)合計</b>	<b>47,769,784</b>
費用	
管理費	11,848,005
事務管理費	2,203,728
加入税	438,536
預託手数料	664,944
配信費用	1,211,137
営業費	311,143
<b>収益(損失)合計</b>	<b>16,677,493</b>
<b>純投資(損)益合計</b>	<b>31,092,291</b>
実現(損)益	
運用関連	(34,260,516)
オプション契約	639,933
先渡為替予約	(20,550,949)
為替評価損益	(876,814)
<b>当期実現純(損)益合計</b>	<b>(55,048,346)</b>
未実現(損)益の変動	
運用関連	(106,386,243)
オプション契約	3,058,595
先渡為替予約	465,842
為替評価損益	38,499
<b>当期末実現(損)益の変動</b>	<b>(102,823,307)</b>
<b>運用成績による純資産額の変動</b>	<b>(126,779,362)</b>
受益証券発行に伴う正味受取額	285,359,378
受益証券買戻しに伴う正味支払額	(374,379,746)
<b>資本移転金による純資産増(減)額</b>	<b>(89,020,368)</b>
配当金	(103,083,336)
<b>期末純資産</b>	<b>1,125,998,499</b>

## (2) 投資有価証券明細 (2022年12月31日現在)

## Schroder ISF Global Dividend Maximiser

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets	Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<b>Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing</b>					<b>Swiss Re AG</b>				
<b>Equities</b>					<b>UniCredit SpA</b>				
<b>Communication Services</b>					<b>Health Care</b>				
BT Group plc	GBP	14,128,201	19,081,473	1.69	Bayer AG	EUR	403,089	20,784,387	1.85
DeNA Co. Ltd.	JPY	693,200	9,246,384	0.82	Bristol-Myers Squibb Co.	USD	279,806	20,150,681	1.79
Dentsu Group, Inc.	JPY	691,500	21,629,338	1.92	GSK plc	GBP	1,305,627	22,624,051	2.01
KDDI Corp.	JPY	740,400	22,273,837	1.97	H.U. Group Holdings, Inc.	JPY	981,500	21,378,607	1.90
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	JPY	374,900	10,649,498	0.95	Pfizer, Inc.	USD	329,080	16,858,998	1.50
Nippon Television Holdings, Inc.	JPY	694,800	5,468,868	0.49	Sanofi	EUR	272,887	26,342,189	2.33
Omnicom Group, Inc.	USD	53,000	4,296,609	0.38				<b>128,138,913</b>	<b>11.38</b>
Orange SA	EUR	2,138,825	21,367,548	1.90	<b>Industrials</b>				
RTL Group SA	EUR	415,346	17,478,790	1.55	Rolls-Royce Holdings plc	GBP	17,257,452	19,386,784	1.72
SES SA, ADR	EUR	2,387,871	15,618,372	1.39	Stanley Black & Decker, Inc.	USD	288,423	21,758,844	1.93
Verizon Communications, Inc.	USD	562,730	22,037,614	1.95	Sumitomo Heavy Industries Ltd.	JPY	338,500	6,744,986	0.60
WPP plc	GBP	2,149,528	21,250,837	1.89				<b>47,890,614</b>	<b>4.25</b>
			<b>190,399,168</b>	<b>16.90</b>	<b>Information Technology</b>				
<b>Consumer Discretionary</b>					Asustek Computer, Inc.	TWD	1,956,000	17,025,069	1.51
Bridgestone Corp.	JPY	604,200	21,356,413	1.90	Citizen Watch Co. Ltd.	JPY	3,390,600	15,158,297	1.35
Continental AG	EUR	430,277	25,700,729	2.28	Intel Corp.	USD	975,946	25,331,901	2.25
eBay, Inc.	USD	466,470	19,404,886	1.72	International Business Machines Corp.	USD	145,302	20,448,605	1.82
Genting Singapore Ltd.	SGD	24,580,500	17,498,783	1.55	Micron Technology, Inc.	USD	329,724	16,459,053	1.46
Panasonic Holdings Corp.	JPY	2,699,400	22,577,469	2.01	Samsung Electronics Co. Ltd.	KRW	377,073	16,570,653	1.47
			<b>106,538,280</b>	<b>9.46</b>	Vtech Holdings Ltd.	HKD	1,348,500	8,674,205	0.77
<b>Consumer Staples</b>					Western Union Co. (The)	USD	1,475,681	20,406,370	1.81
Carrefour SA	EUR	1,115,280	18,671,159	1.66				<b>140,074,153</b>	<b>12.44</b>
Henkel AG & Co. KGaA Preference	EUR	360,623	25,018,704	2.22	<b>Materials</b>				
Imperial Brands plc	GBP	643,344	16,059,667	1.43	Anglo American plc	GBP	445,745	17,389,026	1.54
Molson Coors Beverage Co. 'B'	USD	517,983	26,636,332	2.37	BASF SE	EUR	466,380	23,084,938	2.05
Tesco plc	GBP	7,527,350	20,341,871	1.81	HeidelbergCement AG	EUR	444,851	25,289,673	2.25
Tiger Brands Ltd.	ZAR	1,252,046	15,514,696	1.38	South32 Ltd.	AUD	6,085,933	16,536,136	1.47
Walgreens Boots Alliance, Inc.	USD	737,739	27,589,095	2.44				<b>82,299,773</b>	<b>7.31</b>
			<b>149,831,524</b>	<b>13.31</b>	<b>Utilities</b>				
<b>Energy</b>					Centrica plc	GBP	12,258,334	14,261,393	1.27
Eni SpA	EUR	1,646,053	23,629,779	2.09				<b>14,261,393</b>	<b>1.27</b>
Repsol SA	EUR	1,132,963	17,963,831	1.60	<b>Total Equities</b>				
Shell plc	GBP	817,866	22,930,052	2.04	<b>Total Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing</b>			<b>1,113,756,029</b>	<b>98.91</b>
			<b>64,523,662</b>	<b>5.73</b>				<b>1,113,756,029</b>	<b>98.91</b>
<b>Financials</b>									
Ageas SA/NV	EUR	385,793	17,004,895	1.51					
AXA SA	EUR	819,418	22,950,874	2.04					
HSBC Holdings plc	GBP	3,456,274	21,484,165	1.91					
Intesa Sanpaolo SpA	EUR	11,168,331	24,911,672	2.21					
NatWest Group plc	GBP	6,818,963	21,797,417	1.94					
Standard Chartered plc	GBP	4,414,025	33,114,450	2.94					

Investments	Currency	Quantity/ Nominal Value	Market Value USD	% of Net Assets
<b>Other transferable securities and money market instruments</b>				
<b>Equities</b>				
<b>Materials</b>				
Alrosa PJSC*	USD	17,005,745	-	-
			-	-
<b>Total Equities</b>			-	-
<b>Total Other transferable securities and money market instruments</b>			-	-
<b>Total Investments</b>			1,113,756,029	98.91
<b>Cash</b>			16,518,927	1.47
<b>Other assets/(liabilities)</b>			(4,276,457)	(0.38)
<b>Total Net Assets</b>			1,125,998,499	100.00

# 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 24 期

(計算期間：2023年4月18日～2023年10月16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。



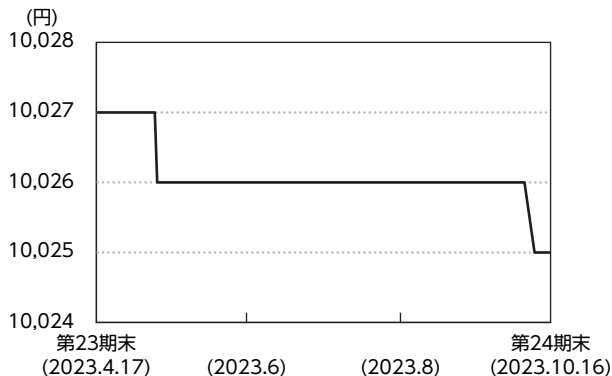
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

## 運用経過

2023年4月18日～2023年10月16日

### 基準価額等の推移



#### ■ 基準価額の主な変動要因

<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。

## お知らせ

#### ■ 約款変更

デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、関連条項に所要の変更を行いました。

(2023年7月26日)



## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	債券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		
	円	%	%	百万円
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
24期(2023年10月16日)	10,025	△0.0	82.1	720

## 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4月17日	10,027	—	89.9
4月末	10,027	0.0	89.3
5月末	10,026	△0.0	66.3
6月末	10,026	△0.0	63.0
7月末	10,026	△0.0	72.3
8月末	10,026	△0.0	81.1
9月末	10,026	△0.0	81.2
(期末)2023年10月16日	10,025	△0.0	82.1

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2023年4月18日～2023年10月16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（10,026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4月18日～2023年10月16日

## 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	地方債証券	322,340	— (165,000)
	特殊債券	—	— (200,000)

(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4月18日～2023年10月16日

## 公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
		千円	
平成26年度第4回 京都府公募公債	100,628	—	—
平成25年度第11回 埼玉県公募公債	86,450		
第727回 東京都公募公債	79,257		
令和元年度第1回 長崎県公募公債	56,004		

(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10月16日現在

国内（邦貨建）公社債

区分	額面金額	評価額	組入比率	当期末				
				うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率			2年未満
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
国債証券	14,000 ( 14,000)	14,001 ( 14,001)	1.9 ( 1.9)	—	—	—	—	1.9 ( 1.9)
地方債証券	476,000 (476,000)	477,237 (477,237)	66.3 (66.3)	—	—	—	—	66.3 (66.3)
特殊債券 (除く金融債券)	100,000 (100,000)	100,030 (100,030)	13.9 (13.9)	—	—	—	—	13.9 (13.9)
合計	590,000 (590,000)	591,269 (591,269)	82.1 (82.1)	—	—	—	—	82.1 (82.1)

- (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
国債証券	第1121回 国庫短期証券	—	2023/11/20	14,000	14,001
	小計	—	—	—	14,001
地方債証券	第727回 東京都公募公債	0.7200	2023/12/20	79,000	79,100
	平成26年度第4回 京都府公募公債	0.6640	2024/ 6 /20	100,000	100,454
	平成25年度第11回 埼玉県公募公債	0.6550	2024/ 3 /26	86,000	86,244
	第132回 共同発行市場公募地方債	0.6600	2024/ 3 /25	155,000	155,435
	令和元年度第1回 長崎県公募公債	0.0100	2024/ 6 /26	56,000	56,003
	小計	—	—	—	477,237
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	100,030
	小計	—	—	—	100,030
	合計	—	—	—	591,269

投資信託財産の構成

2023年10月16日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	591,269	82.0
コール・ローン等、その他	130,227	18.0
投資信託財産総額	721,496	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10月16日現在)

項目	当期末
(A)資産	721,496,958円
コ ー ル ・ ロ ー ン 債 (評価額)	129,585,003
公 社 債 (評価額)	591,269,516
未 収 利 息	590,905
前 払 費 用	51,534
(B)負債	1,163,467
未 払 解 約 債 金	1,163,365
そ の 他 未 払 費 用	102
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	720,333,491
元 本	718,501,875
次 期 繰 越 損 益 金	1,831,616
(D)受 益 権 総 口 数	718,501,875口
1万口当たり基準価額 (C / D)	10,025円

(注1) 期首元本額 704,956,153円  
 期中追加設定元本額 104,036,090円  
 期中一部解約元本額 90,490,368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)	49,952,497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	668,110,536円
ニッセイ/コムジ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 カ月決算型・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 カ月決算型・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・横上償還多額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・横上償還多額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
既定追加型・横上償還多額付ニッセイ世界リカバリー株式厳選ファンド 2023-07 (為替ヘッジあり)	9,975円
既定追加型・横上償還多額付ニッセイ世界リカバリー株式厳選ファンド 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4月18日~2023年10月16日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	1,734,560円
受 取 利 息	1,788,938
支 払 利 息	△ 54,378
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 1,815,052
売 買 損 益	△ 1,815,052
(C)信 託 報 酬 等	△ 1,705
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 82,197
(E)前 期 繰 越 損 益 金	1,877,347
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	271,311
(G)解 約 差 損 益 金	△ 234,845
(H)合 計 (D + E + F + G)	1,831,616
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	1,831,616

- (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。

## 指数に関して

### ■ ファンドのベンチマーク等について

- ・MSCIワールド・インデックス（配当込み、円換算ベース）

MSCIワールド・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスです。同インデックスに関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同インデックスの内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。