

T&Dダブルブル・ ベア・シリーズ7 (中国・ダブルブル7)

◆当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／特殊型（ブル・ベア型）	
信託期間	2020年3月10日から2022年3月10日まで	
運用方針	信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	<p>円建の外国投資信託「バッシ ム・トラスト - チャイナ 2x ブル・ファンド - クラスC証券」および国内投資信託「マネーアカウント マザーファンド」を主要投資対象とします。なお、短期金融商品等に直接投資する場合があります。</p>	
	バッシ ム・トラスト - チャイナ 2x ブル・ファンド - クラスC証券	<p>主として円建の日本国債を投資対象とします。 J Pモルガンチェースバンク N. A. ロンドン支店、または J Pモルガンチェースグループに属する金融機関をカウンターパーティとしたスワップ取引を行います。概ね純資産相当額程度で行うものとします。 スワップ取引を利用して、実質的に日々の基準価額の値動きが中国の株価指数であるハンセン中国企業株指数（H株指数）の日々の騰落率の概ね2倍程度となる投資成果を目指して運用を行います。</p>
	マネーアカウント マザーファンド	<p>わが国の国債、公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。</p>
組入制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。</p>	
	バッシ ム・トラスト - チャイナ 2x ブル・ファンド - クラスC証券	<p>店頭オプション、上場オプション、ETFに原則として直接投資は行いません。 有価証券の空売りは行いません。</p>
	マネーアカウント マザーファンド	<p>株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資は行いません。</p>
分配方針	<p>分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。</p>	

運用報告書（全体版）（満期償還） （償還日 2022年3月10日）

お客様へ

毎々格別のお引立てにあずかり厚く御礼申し上げます。

さて、「T&Dダブルブル・ベア・シリーズ7（中国・ダブルブル7）」は、信託約款の規定に基づき、2022年3月10日に信託期間を満了し償還となりましたので、運用経過と償還内容をご報告申し上げます。

これまでのご愛顧に対しまして、厚く御礼申し上げます。

 **T&Dアセットマネジメント株式会社**

〒108-0014 東京都港区芝5-36-7

お問い合わせ先

投信営業部 03-6722-4810

（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

<https://www.tdasset.co.jp/>

設定以来の運用実績、基準価額の推移等

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			債組入比率	債券先物比率	パッシブ・トラスト・チャイナ2xブル・ファンドクラスC証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率				
設定日 2020年3月10日	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	% —	百万円 1
1期 (2021年3月10日)	10,476	0	4.8	—	—	94.7	223
償還日 2期 (2022年3月10日)	(償還価額) 4,918.06		△53.1	—	—	—	14

(注) 基準価額および分配金は1口当たり。基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 設定日の基準価額および純資産総額には、当初元本を用いております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、債券組入比率および債券先物比率は実質比率を記載しております。

(注) 先物比率=買建比率-売建比率

(注) 当ファンドは、日々の基準価額の値動きが、対象とする国の株価指数の日々の値動きの概ね2倍程度となる投資成果を目指して運用を行います。したがって、たとえ正確に運用目標が達成されたとしても、2日以上離れた日との比較においては概ね2倍程度の投資成果が得られる訳ではないため比較が出来ないことから、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

当期中の基準価額等の推移

年月日	基準価額		債組入比率	債券先物比率	パッシブ・トラスト・チャイナ2xブル・ファンドクラスC証券組入比率
	騰落率				
期首 (前期末) 2021年3月10日	円 10,476	% —	% —	% —	% 94.7
3月末	10,548	0.7	—	—	95.1
4月末	10,503	0.3	—	—	95.0
5月末	10,046	△4.1	—	—	95.2
6月末	9,956	△5.0	—	—	95.1
7月末	7,584	△27.6	—	—	95.3
8月末	6,861	△34.5	—	—	95.0
9月末	6,511	△37.8	—	—	94.8
10月末	6,895	△34.2	—	—	94.9
11月末	6,089	△41.9	—	—	94.7
12月末	5,670	△45.9	—	—	95.1
2022年1月末	5,627	△46.3	—	—	94.4
2月末	5,299	△49.4	—	—	94.9
償還日 2022年3月10日	(償還価額) 4,918.06	△53.1	—	—	—

(注) 基準価額は1口当たり。騰落率は期首比。

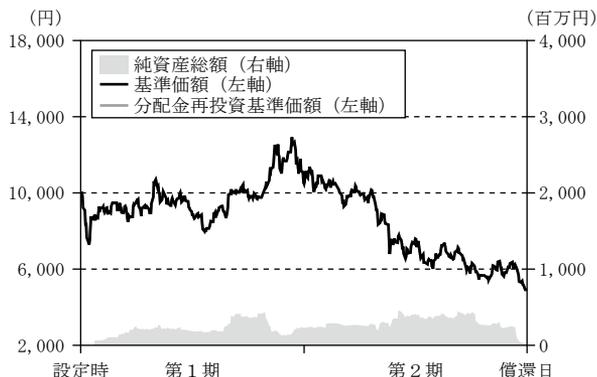
(注) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、債券組入比率および債券先物比率は実質比率を記載しております。

(注) 先物比率=買建比率-売建比率

(注) 当ファンドは、日々の基準価額の値動きが、対象とする国の株価指数の日々の値動きの概ね2倍程度となる投資成果を目指して運用を行います。したがって、たとえ正確に運用目標が達成されたとしても、2日以上離れた日との比較においては概ね2倍程度の投資成果が得られる訳ではないため比較が出来ないことから、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

設定以来の運用経過

■ 基準価額等の推移



(注) 分配金再投資基準価額は、設定日（2020年3月10日）の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

(注) 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税込み）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はありません。

(注) 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) 設定日の基準価額および純資産総額には、当初元本を用いております。

■ 基準価額の主な変動要因

「パッシブ・トラスト - チャイナ 2x ブル・ファンド - クラスC証券」への投資を通じて、日々の基準価額の値動きが、中国の株価指数であるハンセン中国企業株指数（H株指数）の日々の騰落率の概ね2倍程度となる投資成果を目指して運用を行いました。ハンセン中国企業株指数が下落した結果、基準価額（分配金再投資ベース）は下落しました。

■ 投資環境

【中国株式市況】

第1期（設定日～2021年3月10日）

期初から2020年7月上旬にかけては、新型コロナウイルスによる世界的感染拡大により世界経済停滞の懸念が高まったことを背景に大幅下落して始まりました。その後は、米中両政府による金融・財政支援策を受けて上昇に転じましたが、中国政府による経済正常化、景気刺激策への期待が高まる一方で、米中対立を巡り一喜一憂する値の荒い展開が続きました。7月中旬から9月にかけては、新型コロナウイルスの感染再拡大に加え、米中対立の激化や印中、豪中関係の悪化が重荷となり下落しました。10月から2021年2月中旬にかけては、世界景気減速懸念や米国政府による中国企業への制裁措置が重しとなり上値の重い局面もありましたが、中国通信

（指数）ハンセン中国企業株指数（H株指数）の推移



大手3社の米国での上場廃止決定を受け、香港市場への資金流入期待や米国の金融緩和長期化観測が強まったことなどを背景に上昇しました。2月下旬から期末にかけては、米長期金利の断続的な上昇や香港政府が株式取引の印紙税率の引上げを発表したことなどから反落しました。

第2期（2021年3月11日～償還日）

期初から2021年5月中旬にかけては、中国政府による財政・金融政策の正常化が意識され、金融・不動産部門への引締め懸念から軟調に推移しました。5月下旬から10月上旬にかけては、金融引締め懸念が後退したことから上昇する局面もありましたが、中国政府による規制強化に伴う景気減速懸念に加え、中国恒大集団の資金操り問題への警戒感から軟調推移しました。10月中旬から2022年2月上旬にかけては、不動産規制の緩和や景気刺激策への期待から反発したものの、オミクロン株の感染拡大や、FRB（米連邦準備制度理事会）の金融引締めによる海外資金の流出懸念から軟調な展開となりました。2月中旬から期末にかけては、海外の金融政策、ウクライナ情勢を巡る混乱から下落しました。

【国内短期金融市況】

第1期（設定日～2021年3月10日）

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、期首の $\Delta 0.34\%$ から期末は $\Delta 0.10\%$ となりました。期中においては、国庫短期証券の発行増加に伴う需給悪化懸念などが金利上昇要因となり、日銀の買入オペや担保需要などが金利低下要因となりました。

第2期（2021年3月11日～償還日）

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、期首の $\Delta 0.10\%$ から期末は $\Delta 0.09\%$ となりました。期中においては、国庫短期証券の入札に伴う需給悪化懸念などが金利上昇要因となり、日銀の買入オペや金融機関の担保需要などが金利低下要因となりました。

■ 当該投資信託のポートフォリオ

【当ファンド】

信託期間を通じて、「パッシブ・トラスト - チャイナ 2x ブル・ファンド - クラスC証券」を高位に組み入れました。組入比率は、追加設定・解約や組入投資信託証券の価格の変動による運用資産の増減はありましたが、概ね高位で推移しました。残りの資産につきましては、「マネーアカウンタマザーファンド」およびコールローン等で運用を行いました。満期償還に伴い、2022年3月初めに「パッシブ・トラスト - チャイナ 2x ブル・ファンド - クラスC証券」および「マネーアカウンタマザーファンド」を売却し、償還日までコールローン等による安定運用を行いました。

【パッシブ・トラスト - チャイナ 2x ブル・ファンド - クラスC証券】

主として日本国債等の現物資産へ投資する一方で、JPモルガンチェースバンクN. A.などを相手方とするスワップ取引（元本交換を伴わない）を高位に組み入れ、実質的に日々の基準価額の値動きが、中国の株価指数であるハンセン中国企業株指数（H株指数）の日々の騰落率の概ね2倍程度となる投資成果を目指して運用を行いました。

【マネーアカウントマザーファンド】

国庫短期証券の利回りがマイナスで推移したため組入れを見送り、信託期間を通じて組入比率は0%としました。資産については、全額コールローン等で運用を行いました。

■ 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドはベンチマークおよび参考指数がないため、本項目は記載していません。

1口当たりの費用明細 (2021年3月11日から2022年3月10日まで)

費用の明細

項目	当期		項目の概要
	2021/3/11~2022/3/10		
	金額	比率	
平均基準価額	7,632円		期中の平均基準価額です。
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社)	71円 (34) (34) (3)	0.924% (0.440) (0.440) (0.044)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 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等の対価 運用財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) その他費用 (監査費用)	1 (1)	0.018 (0.018)	(b) その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合計	72	0.942	

(注) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

なお、その他費用は、当ファンドが組入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 平均基準価額の円未満は切捨て、それ以外の各金額は項目ごとに四捨五入してあります。

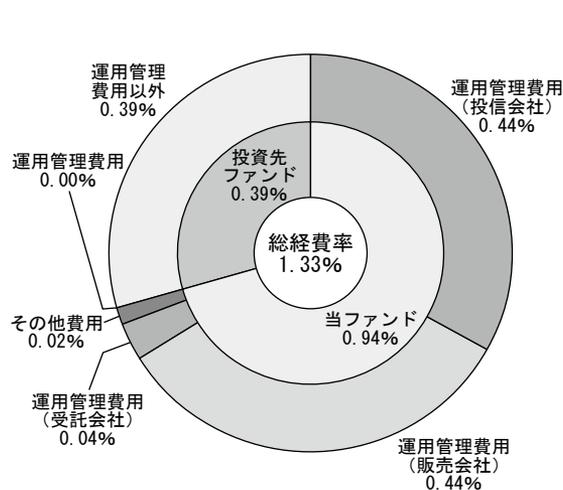
(注) 各項目の費用は、当ファンドが組入れている投資信託証券(親投資信託を除く。)が支払った費用を含みません。

(注) 「比率」欄は1口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)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あります。

(参考情報)

■ 総経費率

当期中の運用・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(1万口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は、1.33%です。



総経費率 (①+②+③)	1.33%
①当ファンドの費用の比率	0.94%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.00%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.39%

(注) ①の費用は、1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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券(親投資信託を除く)です。

(注) ①の費用は、親投資信託が支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 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) 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。

売買および取引の状況 (2021年3月11日から2022年3月10日まで)

(1) 投資信託証券

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国 (邦貨建)	パッシム・トラスト - チャイナ 2x ブル・ファンド - クラスC証券	口 65,550	千円 497,055	口 85,910	千円 534,050

(注) 金額は受渡代金。単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
マネーアカウントマザーファンド	千口 -	千円 -	千口 19	千円 19

(注) 単位未満は切捨て。

利害関係人との取引状況等 (2021年3月11日から2022年3月10日まで)

当期における利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

組入資産の明細 (2022年3月10日現在)

償還時における組入れはありません。

投資信託財産の構成 (2022年3月10日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 19,262	%
投 資 信 託 財 産 総 額	19,262	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

資産、負債、元本および償還価額ならびに損益の状況

資産、負債、元本および償還価額の状況

2022年3月10日現在

項 目	償 還 時
(A) 資 産	19,262,795円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	19,262,795
(B) 負 債	4,395,507
未 払 解 約 金	2,944,200
未 払 信 託 報 酬	1,424,209
未 払 利 息	24
そ の 他 未 払 費 用	27,074
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	14,867,288
元 本	30,230,000
償 還 差 損 益 金	△15,362,712
(D) 受 益 権 総 口 数	3,023口
1 口 当 たり 償 還 価 額 (C / D)	4,918円06銭

(注) 期首元本額 213,130,000円
 期中追加設定元本額 667,160,000円
 期中一部解約元本額 850,060,000円

(注) 元本の欠損
 償還時現在、純資産総額は元本を下回っており、その差額は15,362,712円です。

(注) 1口当たり純資産額は4,918.06円です。

損益の状況

当期 自2021年3月11日 至2022年3月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 824円
受 取 利 息	30
支 払 利 息	△ 854
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 6,876,089
売 買 益	29,716,957
売 買 損	△36,593,046
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,827,973
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 9,704,886
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 247,216
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 5,410,610
(配 当 等 相 当 額)	(△ 2,049)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 5,408,561)
償 還 差 損 益 金 (D + E + F)	△15,362,712

(注) 損益の状況の中で

(C) 信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差引いた差額分をいいます。

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2020年3月10日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年3月10日		資産総額	19,262,795円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は追加信託	負債総額	4,395,507円
				純資産総額	14,867,288円
受益権口数	110口	3,023口	2,913口	受益権口数	3,023口
元本額	1,100,000円	30,230,000円	29,130,000円	1口当たり償還金	4,918.06円
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	213,130,000円	223,280,963円	10,476円	0円	0.0000%

償還金のご案内

1口（元本10,000円）当たり償還金（税込み）	4,918円06銭
--------------------------	-----------

補足情報

マネーアカウントマザーファンドにおける主要な売買銘柄

当期における売買はありません。

組入投資信託証券の内容

パッシム・トラスト - チャイナ 2x ブル・ファンド - クラスC証券

◆当ファンドの仕組みは次の通りです。

分 類	ケイマン籍／外国投資信託／円建
運用の基本方針 主な投資対象	主として円建の日本国債およびスワップ取引に投資を行い、安定的なインカム収益の獲得と信託財産の成長を目指して運用を行います。 主として円建の日本国債を投資対象とします。 スワップ取引等のデリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
投資態度	①主として円建の日本国債を投資対象とします。 ②J PモルガンチェースバンクN. A. ロンドン支店、またはJ Pモルガンチェースグループに属する金融機関をカウンターパーティとしたスワップ取引を行います。概ね純資産相当額程度で行うものとします。 ③スワップ取引を利用して、実質的に日々の基準価額の値動きが以下の通りとなる投資成果を目指して運用を行います。 【チャイナ 2x ブル・ファンド - クラスC証券】 中国の株価指数であるハンセン中国企業株指数（H株指数）の日々の騰落率の概ね2倍程度 資金動向や市況動向等によっては、上記のような運用が行われない場合があります。
主な投資制限	①店頭オプション、上場オプション、ETFに原則として直接投資を行いません。 ②有価証券の空売りは行いません。 ③純資産総額の10%を超える借入れは行いません。 ④一発行会社の発行済株式総数の50%を超えて、当該発行会社の株式に投資しません。 ⑤流動性に欠ける資産の組入れは15%以下とします。 ⑥運用会社および管理会社は、自己または投資信託受益証券以外の第三者の利益を図る目的で行う取引等は行いません。
決 算 日	6月30日
分 配 方 針	原則として、年1回分配を行います。
投資運用会社 管 理 会 社	J. P. モルガン・マンサール・マネジメント・リミテッド

※「パッシム・トラスト - チャイナ 2x ブル・ファンド - クラスC証券」は、円建ての外国投資信託「パッシム・トラスト」のサブファンドです。次ページ以降の記載は、「パッシム・トラスト - チャイナ 2x ブル・ファンド」の状況です。
※次ページ以降の記載は、J Pモルガン証券株式会社より入手した情報をもとに作成しております。(1)は入手可能な直近の監査済報告書を当社が一部和訳したもの、(2)は保有明細をもとに当社が作成したものです。当社は、その内容の正確性・完全性を保証するものではありません。

パッシム・トラスト - チャイナ 2x ブル・ファンド

(1) 損益計算書

計算期間：2020年7月1日～2021年6月30日

単位：千円

収益	
投資に係る実現損益	24,815
受取利息（アモチゼーションによるものを含む）	(255)
収益合計	24,560
費用	
管理報酬	2,129
監査費用	247
保管費用	248
投資運用会社報酬	(3,360)
受託手数料	305
弁護士報酬	528
その他費用	878
運用費用合計	975
税引前損益	23,585
源泉徴収税	(10)
運用による純資産増減額	23,575

(注) 日付は現地基準です。

(注) () 書きは負数です。

(注) 「パッシム・トラスト - チャイナ 2x ブル・ファンド」における「クラスC証券」の決算期末の持分比率は100.0%です。なお、持分比率は監査済報告書の情報をもとに当社が算出したものです。

(2) 組入資産の明細

作成基準日：2021年6月30日

債券現物

単位：円

銘柄名	利率	償還日	額面	評価額
第404回利付国債（2年）	0.1%	2021/9/1	94,000,000	94,030,080
第129回利付国債（5年）	0.1%	2021/9/20	77,000,000	77,031,570
第410回利付国債（2年）	0.1%	2022/3/1	60,000,000	60,083,400
合計				231,145,050

スワップ

単位：円

想定元本額	評価額
501,830,000	(3,462,627)

(注) 日付は現地基準です。

(注) () 書きは負数です。

マネーアカウントマザーファンド

運用報告書（全体版） 第24期（決算日 2021年12月10日）
（計算期間 2021年6月11日から2021年12月10日まで）

「マネーアカウントマザーファンド」は、2021年12月10日に第24期決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

◆当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は原則無期限です。
運用方針	安定した収益の確保を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の国債、公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資は行いません。外貨建資産への投資は行いません。

最近5期の運用実績、基準価額の推移等

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		債組入比率	債先物比率	純資産総額
	円	期騰落中率 %			
20期（2019年12月10日）	10,011	△0.0	—	—	百万円 243
21期（2020年6月10日）	10,007	△0.0	—	—	517
22期（2020年12月10日）	10,004	△0.0	—	—	716
23期（2021年6月10日）	10,001	△0.0	—	—	390
24期（2021年12月10日）	9,998	△0.0	—	—	658

(注) 基準価額は1万口当たり。

(注) 先物比率＝買建比率－売建比率

(注) 当ファンドは安定した収益の確保を目指すファンドであり、ベンチマークおよび参考指数はありません。

当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額 円	騰 落 率	債券組入比率 %	債券先物比率 %
		%		
期首 (前期末) 2021年6月10日	10,001	—	—	—
6月末	10,001	0.0	—	—
7月末	10,000	△0.0	—	—
8月末	9,999	△0.0	—	—
9月末	9,999	△0.0	—	—
10月末	9,999	△0.0	—	—
11月末	9,998	△0.0	—	—
期 末 2021年12月10日	9,998	△0.0	—	—

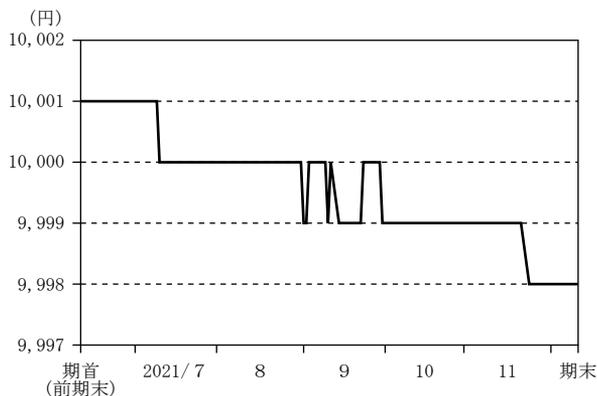
(注) 基準価額は1万円当たり。騰落率は期首比。

(注) 先物比率=買建比率-売建比率

(注) 当ファンドは安定した収益の確保を目指すファンドであり、ベンチマークおよび参考指数はありません。

当期の運用状況と今後の運用方針

■ 基準価額の推移



■ 基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首の10,001円から期末は9,998円となりました。運用対象であるコールローン等の利回りがマイナスで推移したことにより下落しました。

■ 投資環境

【国内短期金融市況】

国庫短期証券3ヵ月物利回りは、期首の△0.10%から期末は△0.12%となりました。期中においては、国庫短期証券の入札に伴う需給悪化懸念などが金利上昇要因となり、日銀の買入オペや金融機関の担保需要などが金利低下要因となりました。

■ 当該投資信託のポートフォリオ

国庫短期証券の利回りがマイナスで推移したため組入れを見送り、期を通じて組入比率は0%としました。資産については、全額コールローン等で運用を行いました。

■ 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドはベンチマークおよび参考指数がないため、本項目は記載しておりません。

■ 今後の運用方針

日本経済は、国内外における新型コロナウイルスの流行の影響による下押しから、持ち直す動きがみられます。また、インフレ率については、エネルギー価格の上昇を反映してプラス幅を緩やかに拡大していくと予想されます。こうしたなか、日銀の「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」が金利抑制要因として作用することから、国内金利は低位で推移すると予想します。

相対的に金利リスクの高い長期債への投資は見送り、国庫短期証券や短期金融商品等を中心とした安定的な運用を行います。

1万口当たりの費用明細 (2021年6月11日から2021年12月10日まで)

当期において発生した費用はありません。

売買および取引の状況 (2021年6月11日から2021年12月10日まで)

当期における売買はありません。

利害関係人との取引状況等 (2021年6月11日から2021年12月10日まで)

当期における利害関係人との取引はありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

組入資産の明細 (2021年12月10日現在)

当期末における組入れはありません。

投資信託財産の構成 (2021年12月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 698,033	% 100.0
投資信託財産総額	698,033	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

資産、負債、元本および基準価額ならびに損益の状況

資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年12月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	698,033,886円
コー ル ・ ロ ー ン 等	698,033,886
(B) 負 債	40,000,698
未 払 解 約 金	40,000,000
未 払 利 息	698
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	658,033,188
元 本	658,155,374
次 期 繰 越 損 益 金	△ 122,186
(D) 受 益 権 総 口 数	658,155,374口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	9,998円

(注) 期首元本額 390,630,736円
 期中追加設定元本額 1,845,201,972円
 期中一部解約元本額 1,577,677,334円

(注) 元本の欠損
 当期末現在、純資産総額は元本を下回っており、その差額は122,186円です。

(注) 1口当たり純資産額は0.9998円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本の内訳

リビング・アース戦略ファンド (年2回決算コース)	99,632円
リビング・アース戦略ファンド (年4回決算コース)	99,632円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ7 (インド・ダブルプル7)	19,983円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ7 (インド・ダブルベア7)	19,983円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ7 (中国・ダブルプル7)	19,983円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ7 (中国・ダブルベア7)	19,983円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ7 (ナスダック100・ダブルプル7)	19,983円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ7 (ナスダック100・ダブルベア7)	19,983円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ7 (金・ダブルプル7)	19,983円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ7 (金・ダブルベア7)	19,983円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ7 (マネーボールファンド7)	637,128,516円
デジタルヘルス株式ファンド	19,907,569円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ8 (インド・ダブルプル8)	20,005円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ8 (インド・ダブルベア8)	20,005円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ8 (中国・ダブルプル8)	20,005円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ8 (中国・ダブルベア8)	20,005円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ8 (ナスダック100・ダブルプル8)	20,005円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ8 (ナスダック100・ダブルベア8)	20,005円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ8 (金・ダブルプル8)	20,005円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ8 (金・ダブルベア8)	20,005円
T&Dダブルプル・ベア・シリーズ8 (マネーボールファンド8)	600,121円

損益の状況

当期 自2021年6月11日 至2021年12月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△196,190円
受 取 利 息	3,385
支 払 利 息	△199,575
(B) 当 期 損 益 金 (A)	△196,190
(C) 前 期 繰 越 損 益 金	42,333
(D) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 71,972
(E) 解 約 差 損 益 金	103,643
(F) 合 計 (B + C + D + E)	△122,186
次 期 繰 越 損 益 金 (F)	△122,186

(注) 損益の状況の中で

(D)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差引いた差額分をいいます。

(E)解約差損益金とあるのは、一部解約の際、元本から解約価額を差引いた差額分をいいます。