

# T&D日本株式投信 (通貨選択型) 米ドルコース 愛称:ダブルウィン

運用報告書 (全体版) (満期償還)  
(償還日 2024年11月7日)

◆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／国内／株式	
信託期間	2013年8月30日から2024年11月7日まで	
運用方針	<p>わが国の株式ならびに株価指数先物取引を実質的な主要投資対象とし、現物株式への投資は「日本株式マザーファンド」を通じて行います。</p> <p>株式の運用にあたっては、主としてわが国の代表的な株価指数を構成する銘柄に投資を行い、当該株価指数の動きを概ね捉える投資成果を目指してポートフォリオを構築することを基本とします。また、わが国の株価指数を対象とする株価指数先物取引にも投資を行います。</p> <p>ファンドは、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追求します。為替取引を行うにあたっては、通貨オプション取引ならびに外国為替予約取引等を利用します。ただし、どちらか一つの取引のみ利用する場合があります。通貨オプション取引と外国為替予約取引等の円売り米ドル買い相当合計額の信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として純資産総額を上限として高位を維持することを基本とします。</p>	
主要運用対象	ベビーファンド	「日本株式マザーファンド」を主要投資対象とします。また、わが国の株価指数先物取引および為替取引等を利用します。
	マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。わが国の株価指数先物取引を利用する場合があります。
組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合には制限を設けません。外国為替予約取引の利用は、ヘッジ目的に限定しません。有価証券先物取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。
	マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。有価証券先物取引の利用はヘッジ目的に限定しません。外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	分配金額は、分配対象額の範囲内で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。	

## 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日本株式投信（通貨選択型）米ドルコース」は、信託約款の規定に基づき、2024年11月7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			株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率			
設 定 日 2013年8月30日	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	百万円 3,549
1期 (2014年5月7日)	10,610	200	8.1	68.3	29.0	6,265
2期 (2014年11月7日)	11,409	3,000	35.8	73.5	21.7	3,508
3期 (2015年5月7日)	11,065	2,400	18.0	73.5	24.5	4,007
4期 (2015年11月9日)	11,287	300	4.7	74.7	22.2	8,037
5期 (2016年5月9日)	8,115	0	△28.1	77.0	22.7	6,437
6期 (2016年11月7日)	8,321	0	2.5	81.7	16.6	6,024
7期 (2017年5月8日)	10,463	0	25.7	75.7	21.9	5,524
8期 (2017年11月7日)	11,327	900	16.9	71.4	26.1	4,324
9期 (2018年5月7日)	10,768	0	△4.9	67.6	28.9	3,579
10期 (2018年11月7日)	10,960	169	3.4	77.4	18.0	3,080
11期 (2019年5月7日)	10,747	105	△1.0	87.7	10.6	2,693
12期 (2019年11月7日)	11,044	365	6.2	75.9	22.4	2,502
13期 (2020年5月7日)	9,212	0	△16.6	60.4	38.3	1,799
14期 (2020年11月9日)	11,287	0	22.5	67.1	31.0	2,006
15期 (2021年5月7日)	11,298	2,800	24.9	71.9	26.4	1,556
16期 (2021年11月8日)	10,949	900	4.9	72.7	26.2	1,573
17期 (2022年5月9日)	10,869	440	3.3	64.8	33.4	1,578
18期 (2022年11月7日)	11,661	1,280	19.1	66.0	31.8	1,648
19期 (2023年5月8日)	11,138	400	△1.1	67.7	29.5	1,602
20期 (2023年11月7日)	12,855	1,300	27.1	72.1	25.7	1,723
21期 (2024年5月7日)	14,676	1,600	26.6	72.8	25.6	1,971
償 還 日 22期 (2024年11月7日)	(償還価額) 14,888.91		1.5	—	—	1,816

(注) 基準価額および分配金は1万円当たり。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、株式組入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) 当ファンドは通貨選択型であり、特定の指数に連動すること・指数を上回ることを目的として運用していないため、また、運用方針に対し適切な指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を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	騰 落 率		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		
期首 (前期末) 2024年5月7日	円 14,676	% —		% 72.8	% 25.6
5月末	14,852	1.2		71.5	26.9
6月末	15,741	7.3		69.9	26.6
7月末	14,773	0.7		74.6	24.2
8月末	13,777	△6.1		79.8	18.6
9月末	13,436	△8.4		72.8	25.9
10月末	14,892	1.5		—	—
償 還 日 2024年11月7日	(償還価額) 14,888.91	1.5		—	—

(注) 基準価額は1万円当たり。騰落率は期首比。

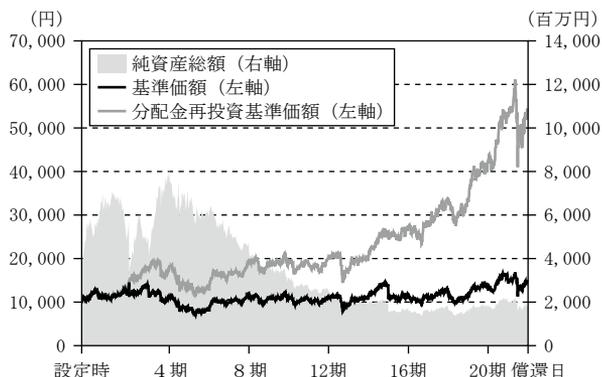
(注) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、株式組入比率は実質比率を記載しております。

(注) 先物比率＝買建比率－売建比率

(注) 当ファンドは通貨選択型であり、特定の指数に連動すること・指数を上回ることを目的として運用していないため、また、運用方針に対し適切な指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を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（2013年8月30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す。
- (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。

### ■ 基準価額の変動要因

基準価額（分配金再投資ベース）は上昇しました。当ファンドが投資する「日本株式マザーファンド」で保有する現物株式や当ファンドで保有する株式先物が上昇したこと、当ファンドが投資する米ドルが対円で上昇したことによるものです。

### ■ 投資環境

#### 【国内株式市場】

国内株式市場は、上昇しました。アベノミクスや日銀による2013年の「量的・質的金融緩和」や2014年の追加緩和などの金融緩和策に支えられ、上昇しました。2020年には新型コロナウイルスの世界的な感染拡大により急激に下落する局面もありましたが、その後の財政支援策と経済再開に伴い上昇に転じました。その後も世界的なインフレ圧力の上昇や米国の金利上昇が株式市場に影響を与えましたが、AI（人工知能）や脱炭素の流れが相場を支え、上昇しました。

#### 【為替動向】

米ドルは、対円で上昇しました。アベノミクスや日銀による2013年の「量的・質的金融緩和」政策導入以降、円は急激に下落し円安米ドル高が進行しました。その後、2019年にかけては、米国の金融政策や世界経済の変動に影響され、円・米ドル相場は上下動を繰り返す展開が続きました。2020年の新型コロナウイルスの世界的な感染拡大により、一時的に円高米ドル安が進んだものの、2022年以降、米国の利上げと日本の低金利政策の継続により再び円安米ドル高が進行しました。

## ■ 当該投資信託のポートフォリオ

### 【当ファンド】

「日本株式マザーファンド」および株価指数先物取引に投資することにより、株式（株式先物を含む）の実質的な組入比率を概ね高位に保ちました。

また、外国為替予約取引を通じ、米ドルへの投資効果を追求しました。円売り米ドル買い相当合計額の信託財産の純資産総額に対する比率は概ね高位に保ちました。

満期償還に伴い、2024年10月下旬に「日本株式マザーファンド」および株価指数先物取引を売却、外国為替予約取引を解消し、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。

### 【日本株式マザーファンド】

わが国の株式市場全体の動きを概ね捉えることを目指し、期を通じて約200銘柄への分散投資を行いました。期中の株式組入比率は、概ね高位に保ちました。繰上償還に伴い、2024年10月下旬に保有する株式を売却しました。

## ■ 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。

1万口当たりの費用明細 (2024年5月8日から2024年11月7日まで)

費用の明細

項目	当期		項目の概要
	2024/5/8～2024/11/7		
	金額	比率	
平均基準価額	14,578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)	84円 ( 28) ( 53) ( 3)	0.577% (0.194) (0.360) (0.022)	(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) 売買委託手数料 ( 株式) ( 先物・オプション)	7 ( 4) ( 2)	0.046 (0.029) (0.017)	(b) 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 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う 手数料
(c) その他費用 ( 監査費用) ( その他)	1 ( 1) ( 0)	0.007 (0.006) (0.001)	(c) 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 その他は、C L S 決済 (多通貨同時決済) に係る手数料
合計	92	0.630	

(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、売買委託手数料およびその他費用は、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。

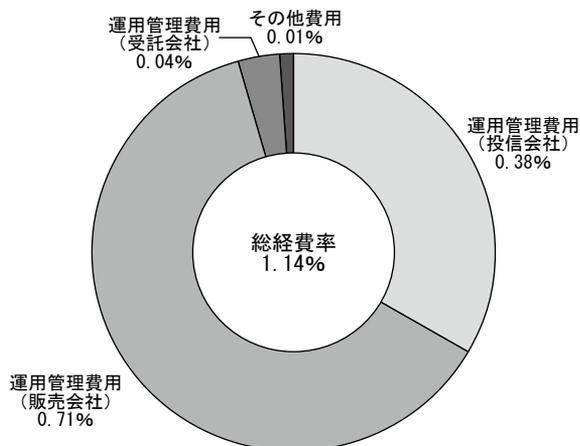
(注) 平均基準価額の円未満は切捨て、それ以外の各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 「比率」欄は1万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口当たり) を乗じた数で除した総経費率 (年率) は、1.14%です。



(注) 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) 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) 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 (2024年5月8日から2024年11月7日まで)

(1) 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
国 内	株式先物取引	百万円 2,544	百万円 3,075	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金。単位未満は切捨て。

(2) オプション取引の種類別取引状況

当期における通貨オプションの取引はありません。

(3) 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
日本株式マザーファンド	千口 -	千円 -	千口 413,465	千円 1,430,893

(注) 単位未満は切捨て。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合 (2024年5月8日から2024年11月7日まで)

項 目	当 期	
	T & D 日本株式投信 (通貨選択型) 米ドルコース	日本株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	-	1,417,977千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	-	1,407,680千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	-	1.00

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注) 単位未満は切捨て。

利害関係人との取引状況等 (2024年5月8日から2024年11月7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 (2024年11月7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 (2024年11月7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 1,827,281	100.0
投資信託財産総額	1,827,281	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

特定資産の価格等の調査 (2024年5月8日から2024年11月7日まで)

調査対象期間中 (2024年5月1日から2024年11月7日) に該当した取引はありません。

## 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

2024年11月7日現在

項 目	償 還 時
(A) 資 産	1,827,281,040円
コール・ローン等	1,827,270,866
未 収 利 息	10,174
(B) 負 債	11,080,304
未 払 信 託 報 酬	10,974,837
そ の 他 未 払 費 用	105,467
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,816,200,736
元 本	1,219,834,866
償 還 差 損 益 金	596,365,870
(D) 受 益 権 総 口 数	1,219,834,866口
1 万 口 当 たり 償 還 価 額 (C / D)	14,888円91銭

- (注) 期首元本額 1,343,668,488円  
 期中追加設定元本額 39,036,634円  
 期中一部解約元本額 162,870,256円  
 (注) 1口当たり純資産額は1,488891円です。

### 損益の状況

当期 自2024年5月8日 至2024年11月7日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	393,729円
受 取 利 息	393,729
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	10,468,215
売 買 益	178,906,789
売 買 損	△168,438,574
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	26,009,973
取 引 益	69,910,476
取 引 損	△ 43,900,503
(D) 信 託 報 酬 等	△ 11,105,786
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	25,766,131
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	443,260,072
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	127,339,667
(配 当 等 相 当 額)	( 102,309,375)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 25,030,292)
償 還 差 損 益 金 (E + F + G)	596,365,870

- (注) 損益の状況の中で  
 (D) 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。  
 (G) 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	2013年8月30日			投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024年11月7日			資産総額	1,827,281,040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	11,080,304円	
				純資産総額	1,816,200,736円	
受益権口数	3,549,988,946口	1,219,834,866口	△2,330,154,080口	受益権口数	1,219,834,866口	
元本額	3,549,988,946円	1,219,834,866円	△2,330,154,080円	1万口当たり償還金	14,888.91円	
毎計算期末の状況						
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金		
				金額	分配率	
第1期	5,904,913,220円	6,265,381,874円	10,610円	200円	2.0000%	
第2期	3,075,347,029	3,508,776,708	11,409	3,000	30.0000	
第3期	3,621,491,853	4,007,257,585	11,065	2,400	24.0000	
第4期	7,121,473,939	8,037,799,742	11,287	300	3.0000	
第5期	7,932,683,235	6,437,254,091	8,115	0	0.0000	
第6期	7,240,402,737	6,024,667,651	8,321	0	0.0000	
第7期	5,280,256,024	5,524,891,017	10,463	0	0.0000	
第8期	3,817,424,879	4,324,049,815	11,327	900	9.0000	
第9期	3,324,007,192	3,579,127,838	10,768	0	0.0000	
第10期	2,810,434,918	3,080,308,896	10,960	169	1.6900	
第11期	2,506,702,241	2,693,892,345	10,747	105	1.0500	
第12期	2,266,343,733	2,502,957,836	11,044	365	3.6500	
第13期	1,953,129,355	1,799,162,140	9,212	0	0.0000	
第14期	1,777,364,208	2,006,178,400	11,287	0	0.0000	
第15期	1,377,439,200	1,556,165,311	11,298	2,800	28.0000	
第16期	1,437,396,334	1,573,806,349	10,949	900	9.0000	
第17期	1,452,536,800	1,578,703,084	10,869	440	4.4000	
第18期	1,413,617,739	1,648,394,892	11,661	1,280	12.8000	
第19期	1,438,470,763	1,602,128,541	11,138	400	4.0000	
第20期	1,340,539,482	1,723,280,992	12,855	1,300	13.0000	
第21期	1,343,668,488	1,971,955,657	14,676	1,600	16.0000	

### 償還金のご案内

1万口（元本10,000円）当たり償還金（税込み）

14,888円91銭

## 日本株式マザーファンド

運用報告書（全体版）（繰上償還）（償還日 2024年11月6日）  
（計算期間 2024年5月8日から2024年11月6日）

「日本株式マザーファンド」は、2024年11月6日に信託約款の規定に基づき繰上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。

◆当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2013年8月30日から2024年11月6日（当初無期限）
運用方針	信託財産の成長を目標に運用を行います。
主要運用対象	わが国の株式を主要投資対象とします。 わが国の株価指数先物取引を利用する場合があります。
組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 有価証券先物取引の利用はヘッジ目的に限定しません。 外貨建資産への投資は行いません。

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		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率			
設 定 日 2013年 8 月 30 日	円 10,000	% —	% —	% —	百万円 2,200
1 期 (2014年 5 月 7 日)	10,607	6.1	98.1	—	4,360
2 期 (2014年 11 月 7 日)	12,802	20.7	98.3	—	2,623
3 期 (2015年 5 月 7 日)	14,750	15.2	98.7	—	2,986
4 期 (2015年 11 月 9 日)	15,140	2.6	99.1	—	6,056
5 期 (2016年 5 月 9 日)	12,653	△16.4	99.1	—	5,005
6 期 (2016年 11 月 7 日)	13,521	6.9	99.1	—	4,965
7 期 (2017年 5 月 8 日)	15,783	16.7	98.4	—	4,251
8 期 (2017年 11 月 7 日)	18,303	16.0	97.5	—	3,168
9 期 (2018年 5 月 7 日)	18,094	△ 1.1	95.8	—	2,526
10期 (2018年 11 月 7 日)	17,971	△ 0.7	94.9	—	2,509
11期 (2019年 5 月 7 日)	18,106	0.8	98.7	—	2,393
12期 (2019年 11 月 7 日)	19,446	7.4	99.0	—	1,920
13期 (2020年 5 月 7 日)	16,652	△14.4	98.5	—	1,102
14期 (2020年 11 月 9 日)	21,075	26.6	99.0	—	1,359
15期 (2021年 5 月 7 日)	25,117	19.2	98.7	—	1,133
16期 (2021年 11 月 8 日)	25,518	1.6	98.8	—	1,157
17期 (2022年 5 月 9 日)	23,050	△ 9.7	98.8	—	1,035
18期 (2022年 11 月 7 日)	24,303	5.4	98.4	—	1,105
19期 (2023年 5 月 8 日)	25,809	6.2	98.2	—	1,103
20期 (2023年 11 月 7 日)	28,984	12.3	98.8	—	1,256
21期 (2024年 5 月 7 日)	35,155	21.3	98.8	—	1,453
償 還 日 22期 (2024年 11 月 6 日)	(償還価額) 34,584.72	△ 1.6	—	—	25

(注) 基準価額は1万円当たり。

(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) 先物比率=買建比率-売建比率

(注) 当ファンドは、特定の指数に連動すること・指数を上回ることを目的として運用していないため、また、運用方針に対し適切な指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を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	騰 落 率	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
期首（前期末） 2024年5月7日	円 35,155	% —	% 98.8	% —
5月末	34,892	△0.7	98.7	—
6月末	35,930	2.2	98.7	—
7月末	35,502	1.0	99.7	—
8月末	35,009	△0.4	99.6	—
9月末	34,562	△1.7	98.9	—
10月末	34,584	△1.6	—	—
償 還 日 2024年11月6日	(償還価額) 34,584.72	△1.6	—	—

(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、特定の指数に連動すること・指数を上回ることを目的として運用していないため、また、運用方針に対し適切な指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を設定していません。

## 設定以来の運用状況

### ■ 基準価額の推移



(注) 設定日の基準価額には、当初元本を用いております。

### ■ 基準価額の変動要因

基準価額は上昇しました。基準価額上昇の主な要因は、保有する現物株式の値上がりによるものです。

## ■ 投資環境

### 【国内株式市況】

国内株式市場は、上昇しました。アベノミクスや日銀による2013年の「量的・質的金融緩和」や2014年の追加緩和などの金融緩和策に支えられ、上昇しました。2020年には新型コロナウイルスの世界的な感染拡大により急激に下落する局面もありましたが、その後の財政支援策と経済再開に伴い上昇に転じました。その後も世界的なインフレ圧力の上昇や米国の金利上昇が株式市場に影響を与えましたが、A I（人工知能）や脱炭素の流れが相場を支え、上昇しました。

## ■ 当該投資信託のポートフォリオ

わが国の株式市場全体の動きを概ね捉えることを目指し、期を通じて約200銘柄への分散投資を行いました。期中の株式組入比率は、概ね高位に保ちました。繰上償還に伴い、2024年10月下旬に保有する株式を売却しました。

## ■ 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。

1万口当たりの費用明細 (2024年5月8日から2024年11月6日まで)

費用の明細

項目	当期	
	2024/5/8～2024/11/6	
	金額	比率
平均基準価額	35,079円	
売買委託手数料 (株式)	16円 ( 16)	0.046% (0.046)
合計	16	0.046

(注) 費用項目につきましては5ページ(1万口当たりの費用明細の項目の概要)をご参照ください。

売買および取引の状況 (2024年5月8日から2024年11月6日まで)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 3 (50.7)	千円 8,367 ( -)	千株 389.5	千円 1,409,610

(注) 金額は受渡代金。単位未満は切捨て。ただし株数が単位未満の場合は小数で記載。

(注) ( ) 内は、株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合 (2024年5月8日から2024年11月6日まで)

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	1,417,977千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,407,680千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	1.00

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注) 単位未満は切捨て。

当期中の主要な売買銘柄 (2024年5月8日から2024年11月6日まで)

国内株式 (上位10銘柄)

買				売			
銘柄	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
野村総合研究所	1	5,305	5,305	ファーストリテイリング	3	148,883	49,627
良品計画	1	2,636	2,636	東京エレクトロン	3.6	83,125	23,090
コニカミノルタ	1	424	424	アドバンテスト	9.8	75,612	7,715
				ソフトバンクグループ	7.3	63,484	8,696
				信越化学工業	6.1	35,304	5,787
				KDDI	7.4	35,105	4,744
				TDK	16.9	33,927	2,007
				リクルートホールディングス	3.7	33,759	9,124
				テルモ	9.8	28,239	2,881
				中外製薬	3.7	25,469	6,883

(注) 金額は受渡代金。単位未満は切捨て。ただし株数が単位未満の場合は小数で記載。

(注) 株式分割、合併等による増減分の調整は行っていません。

利害関係人との取引状況等 (2024年5月8日から2024年11月6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 (2024年11月6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 (2024年11月6日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	25,893	100.0
投資信託財産総額	25,893	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

2024年11月6日現在

項 目	償 還 時
(A) 資 産	25,893,530円
コール・ローン等	25,893,387
未 収 利 息	143
(B) 純 資 産 総 額 (A)	25,893,530
元 本	7,486,986
償 還 差 損 益 金	18,406,544
(C) 受 益 権 総 口 数	7,486,986口
1万口当たり償還価額(B/C)	34,584円72銭

(注) 期首元本額 413,465,943円  
 期中追加設定元本額 0円  
 期中一部解約元本額 405,978,957円

(注) 1口当たり純資産額は3.458472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償還時元本の内訳  
 T&D日本株式投信(通貨選択型)米ドルコース 7,486,986円

損益の状況

当期 自2024年5月8日 至2024年11月6日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	12,090,049円
受 取 配 当 金	12,083,600
受 取 利 息	5,027
そ の 他 収 益 金	1,422
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 34,737,344
売 買 益	115,301,281
売 買 損	△ 150,038,625
(C) 当 期 損 益 金 (A+B)	△ 22,647,295
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	1,040,074,882
(E) 解 約 差 損 益 金	△ 999,021,043
償 還 差 損 益 金 (C+D+E)	18,406,544

(注) 損益の状況の中で

(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。