

Jプレミアム・インカムファンド (年1回決算型)

第1期運用報告書（全体版）

（決算日 2022年10月28日）

◆当ファンドの仕組みは次の通りです。

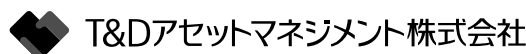
商品分類	追加型投信／国内／株式	
信託期間	2022年7月27日から2027年10月28日まで	
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。	
主要運用対象	外国投資信託証券である「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト(ケイマン)Ⅲ-日本株式プレミアム戦略ファンド(適格機関投資家限定)(資産成長型クラス)」および国内の証券投資信託である「マネーアカウンタマザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。	
	クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト(ケイマン)Ⅲ-日本株式プレミアム戦略ファンド(適格機関投資家限定)(資産成長型クラス)	担保付スワップ取引を通じて、実質的に代表的な日本の株価指数を原資産としたプットオプションを売却する想定上の取引戦略に対するエクスポージャーを提供することにより、中長期的な資本成長の提供を目指して運用を行います。
	マネーアカウンタマザーファンド	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	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資は行いません。	
分配方針	毎決算時(10月28日、休業日の場合は翌営業日)に分配を行います。 分配金額は、分配対象額の範囲内で、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。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、「Jプレミアム・インカムファンド(年1回決算型)」は、2022年10月28日に第1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。

今後ともより一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。



〒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 券 組入比率	債 券 先物比率	クレディ・スイス・ユニバーサル・ トラスト(ケイマン)Ⅲ-日本株式 プレミアム戦略ファンド (適格機関投資家限定) (資産成長型クラス) 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	円	円	%	%	%	%	百万円
2022年 7 月 27 日	10, 000	—	—	—	—	—	637
1 期(2022年10月28日)	10, 095	0	1. 0	—	—	98. 5	1, 950

(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、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、特定の指数に連動すること、特定の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存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

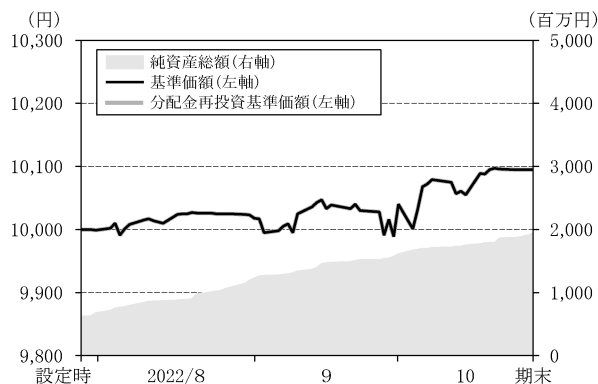
当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額		債 券 組入比率	債 券 先物比率	クレディ・スイス・ユニバーサル・ トラスト(ケイマン)Ⅲ-日本株式 プレミアム戦略ファンド (適格機関投資家限定) (資産成長型クラス) 組 入 比 率
		騰落率			
設定日	円	%	%	%	%
2022年 7 月 27 日	10, 000	—	—	—	—
7 月末	9, 999	△ 0. 0	—	—	91. 5
8 月末	10, 018	0. 2	—	—	98. 5
9 月末	10, 040	0. 4	—	—	98. 5
期 末					
2022年10月28日	10, 095	1. 0	—	—	98. 5

(注) 基準価額は1万円当たり。期末基準価額は分配金込み。騰落率は設定日比。
(注) 設定日の基準価額には、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、特定の指数に連動すること、特定の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存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

当期の運用状況と今後の運用方針

■ 基準価額等の推移



設定日：10,000円

第1期末：10,095円(既払分配金0円)

騰落率：1.0%(分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、設定日(2022年7月27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。

■ 基準価額の主な変動要因

高位に組入れている「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト(ケイマン)Ⅲ-日本株式プレミアム戦略ファンド(適格機関投資家限定)(資産成長型クラス)」において、プットオプションの売却によるプレミアムがプラス寄与した結果、基準価額(分配金再投資ベース)は上昇しました。

■ 組入ファンドの当期中の騰落率

組入ファンド	騰落率
クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト(ケイマン)Ⅲ-日本株式プレミアム戦略ファンド(適格機関投資家限定)(資産成長型クラス)	1.3%
マネーアカウンタマザーファンド	△ 0.0

■ 投資環境

【株式市況】

日経平均株価は、設定日から2022年8月中旬にかけては、4-6月期決算の発表が本格化するなかで、好決算銘柄を中心に買いが入ったことや、米国のインフレ懸念がやや和らぎFRB(米連邦準備制度理事会)が利上げペースを緩めるとの見方が広がったことなどを受け上昇しました。8月下旬から9月末にかけては、政府が新型コロナウイルスの水際対策の緩和を検討していると報じられたことなどが支えとなる場面もありましたが、欧米の中央銀行高官からタカ派的な発言が相次いだことや、欧米で長期金利が上昇したことなどから、世界的な景気減速が懸念され下落基調で推移しました。期末にかけては、堅調な米雇用統計の結果を受け、米国の金融引締めに対する警戒感が高まる場面もありましたが、FRBが利上げペースを減速するとの思惑が広がったことや、米長期金利の上昇に一服感が見られたことを背景に米国株式市場が上昇したことなどを受け、やや値を戻す展開となりました。

【国内短期金融市況】

国庫短期証券 3 ヶ月物利回りは、期首の $\Delta 0.15\%$ に対し、期末も $\Delta 0.15\%$ 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】

「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト(ケイマン)Ⅲ-日本株式プレミアム戦略ファンド(適格機関投資家限定)(資産成長型クラス)」を概ね高位に組入れ、「マネーアカウントマザーファンド」にも投資を行いました。

【クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト(ケイマン)Ⅲ-日本株式プレミアム戦略ファンド(適格機関投資家限定)(資産成長型クラス)】

クレディ・スイス・インターナショナルを相手方とする担保付スワップ取引を通じて、日経平均株価を原資産とした満期約 1 ヶ月、権利行使価格が日経平均株価の92%となるプットオプションの売却を行う戦略である日本株式プレミアム戦略の投資成果を実質的に享受することを目指す運用を行いました。

【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、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。

■ 分配金

1 万口当たりの分配金(税込み)は基準価額水準、市況動向等を勘案し、見送らせていただきました。収益分配に充てなかった利益は、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■ 今後の運用方針

【当ファンド】

「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト(ケイマン)Ⅲ-日本株式プレミアム戦略ファンド(適格機関投資家限定)(資産成長型クラス)」の組入比率を高位に保ち、もう一方の投資対象である「マネーアカウントマザーファンド」への投資も継続する方針です。

【クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト(ケイマン)Ⅲ-日本株式プレミアム戦略ファンド(適格機関投資家限定)(資産成長型クラス)】

担保付スワップ取引を通じて、実質的に日経平均株価を原資産とした満期約 1 ヶ月のプットオプションの売却を行います。売却するプットオプションの権利行使価格をプットオプション構築時の日経平均株価の92%とすることで、日経平均株価の下落による損失を低減しつつ、プレミアムの獲得を目指します。

【マネーアカウントマザーファンド】

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り、持ち直しの動きに弱さがみられます。インフレ率については、プラス圏で推移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 (2022年 7 月 27 日から2022年10月28日まで)

費用の明細

項目	当期		項目の概要
	2022/ 7 /27～2022/10/28		
	金額	比率	
平均基準価額	10, 019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)	30円 (12) (17) (1)	0. 296% (0. 118) (0. 170) (0. 008)	(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) (その他)	0 (0) (0)	0. 005 (0. 005) (0. 000)	(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 その他は、金銭信託に係る手数料
合計	30	0. 301	

(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。

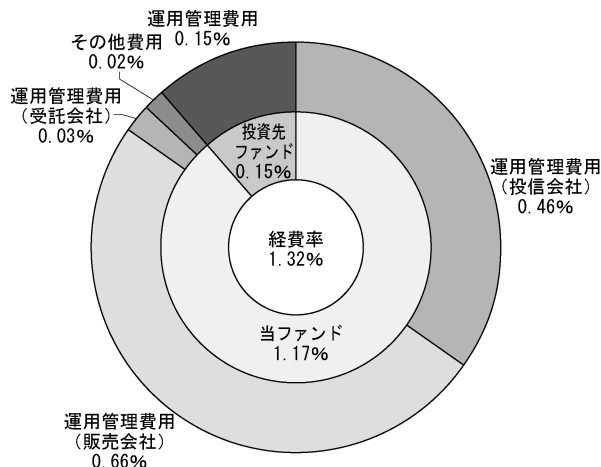
(注) 各項目の費用は、当ファンドが組入れている投資信託証券(親投資信託を除く。)が支払った費用を含みません。

(注) 「比率」欄は 1 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)

■経費率(投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く)

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経費率(年率)は、1. 32%です。



経費率 (①+②)	1. 32%
①当ファンドの費用の比率	1. 17%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0. 15%

(注) 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) 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②の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(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 (2022年7月27日から2022年10月28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)	クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト (ケイマン)Ⅲ-日本株式プレミアム戦略ファンド (適格機関投資家限定)(資産成長型クラス)	口 189,737	千円 1,903,400	口 —	千円 —

(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 9,766	千円 9,760	千口 —	千円 —

(注) 単位未満は切捨て。

利害関係人との取引状況等 (2022年7月27日から2022年10月28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10月28日現在)

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

フ ン ド 名	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
	口	千円	%
クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト (ケイマン)Ⅲ-日本株式プレミアム戦略ファンド (適格機関投資家限定)(資産成長型クラス)	189,737	1,921,466	98.5

(注) 比率は純資産総額に対する評価額の比率。

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
マ ネ ー ア カ ウ ン ト マ ザ ー フ ァ ン ド	9,766	9,759

(注) マネーアカウントマザーファンド全体の受益権口数は389,269千口です。

(注) 単位未満は切捨て。

投資信託財産の構成 (2022年10月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト (ケイマン)Ⅲ-日本株式プレミアム戦略ファンド (適格機関投資家限定)(資産成長型クラス)	1,921,466	96.1
マ ネ ー ア カ ウ ン ト マ ザ ー フ ァ ン ド	9,759	0.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	67,547	3.4
投 資 信 託 財 産 総 額	1,998,772	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

2022年10月28日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,998,772,429円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	67,546,376
クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト (ケイマン)Ⅲ-日本株式プレミアム戦略ファンド (適格機関投資家限定)(資産成長型クラス)(評価額)	1,921,466,629
マネーアカウントマザーファンド(評価額)	9,759,424
(B) 負 債	48,037,517
未 払 金	44,100,000
未 払 信 託 報 酬	3,881,708
未 払 利 息	120
そ の 他 未 払 費 用	55,689
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,950,734,912
元 本	1,932,471,240
次 期 繰 越 損 益 金	18,263,672
(D) 受 益 権 総 口 数	1,932,471,240口
1 万口当たり基準価額 (C / D)	10,095円

損益の状況

当期 自2022年7月27日 至2022年10月28日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 8,540円
受 取 利 息	106
支 払 利 息	△ 8,646
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	18,011,550
売 買 益	18,066,629
売 買 損	△ 55,079
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,937,401
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	14,065,609
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,198,063
(配 当 等 相 当 額)	(△ 4,599)
(売 買 損 益 相 当 額)	(4,202,662)
(F) 合 計 (D + E)	18,263,672
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F + G)	18,263,672
追 加 信 託 差 損 益 金	4,198,063
(配 当 等 相 当 額)	(△ 4,599)
(売 買 損 益 相 当 額)	(4,202,662)
分 配 準 備 積 立 金	14,074,149
繰 越 損 益 金	△ 8,540

(注) 設定時元本額 637,680,668円
期中追加設定元本額 1,304,575,309円
期中一部解約元本額 9,784,737円

(注) 1口当たり純資産額は1.0095円です。

(注) 損益の状況の中で
(B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。
(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。
(E)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。

分配金の計算過程

計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券売買等損益(14,074,149円)および収益調整金(4,194,122円)より、分配対象収益は18,268,271円(1万口当たり94円)となりましたが、当期の分配は見送らせていただきました。

分配金のご案内

分配金および分配原資の内訳 (単位: 円・%、1 万口当たり・税引前)

項目	当期
	2022年 7 月 27 日 ～2022年10月28日
当期分配金	0
(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	94

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)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。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切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。

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。

マネーアカウントマザーファンドの組入資産の明細

当期末における組入れはありません。

〈ご参考〉

組入投資信託証券の内容

クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト(ケイマン)Ⅲ-日本株式プレミアム戦略ファンド(適格機関投資家限定)
(資産成長型クラス)(分配型クラス)

◆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	担保付スワップ取引を通じて、実質的に代表的な日本の株価指数を原資産としたプットオプションを売却する想定上の取引戦略に対するエクスポージャーを提供することにより、中長期的な資本成長の提供を目指して運用を行います。
投資態度	①担保付スワップ取引を通じて、実質的に代表的な日本の株価指数(参照指数)を原資産としたプットオプション(期間約1ヵ月)を売却する想定上の取引戦略に対するエクスポージャーを提供することにより、中長期的な資本成長の提供を目指して運用を行います。 ②売却するプットオプションの権利行使価格をプットオプション構築時の参照指数値の92%とすることで、参照指数の下落による損失を低減しつつ、プレミアムの獲得を目指します。 ③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原則として、店頭オプションおよび上場オプションへの直接投資は行いません。 ②空売りを行った有価証券の時価総額が純資産総額を超える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総株式数の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投資運用会社は、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の取引等を行いません。
決 算 日	9月末日
分 配 方 針	(資産成長型クラス) 原則として、分配を行いません。 (分配型クラス) 原則として、3ヵ月毎に分配を行います。
投資運用会社	クレディ・スイス・マネジメント(ケイマン)リミテッド

《お知らせ》

2022年10月28日現在、「クレディ・スイス・ユニバーサル・トラスト(ケイマン)Ⅲ-日本株式プレミアム戦略ファンド(適格機関投資家限定)」は第1期決算を迎えておりませんので、開示対象となる情報はありません。

マネーアカウントマザーファンド

運用報告書（全体版） 第25期（決算日 2022年6月10日）
（計算期間 2021年12月11日から2022年6月10日まで）

「マネーアカウントマザーファンド」は、2022年6月10日に第25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 %			
21期（2020年6月10日）	10,007	△0.0	—	—	百万円 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
25期（2022年6月10日）	9,995	△0.0	—	—	666

（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。

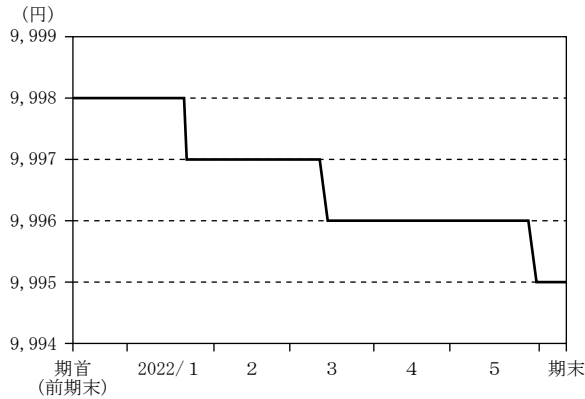
当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債券組入比率	債券先物比率
		円		
期首（前期末） 2021年12月10日	9,998	—	—	—
12月末	9,998	0.0	—	—
2022年1月末	9,997	△0.0	—	—
2月末	9,997	△0.0	—	—
3月末	9,996	△0.0	—	—
4月末	9,996	△0.0	—	—
5月末	9,995	△0.0	—	—
期 末 2022年6月10日	9,995	△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9,998円から期末は9,995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△0.12%から期末は△0.10%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り、持ち直しの動きに弱さがみられます。インフレ率については、エネルギー価格の上昇等を反映してプラス圏で推移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12月11日から2022年6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12月11日から2022年6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12月11日から2022年6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 (2022年6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 (2022年6月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	666,774	100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	666,774	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

2022年6月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	666,774,495円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	666,774,495
(B) 負 債	1,187
未 払 利 息	1,187
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	666,773,308
元 本	667,095,794
次 期 繰 越 損 益 金	△ 322,486
(D) 受 益 権 総 口 数	667,095,794口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,995円

(注) 期首元本額 658,155,374円
期中追加設定元本額 1,231,438,386円
期中一部解約元本額 1,222,497,966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322,486円です。

(注) 1口当たり純資産額は0.9995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
デジタルヘルス株式ファンド 14,906,068円
T&Dダブルブル・ベア・シリーズ8(インド・ダブルブル8) 20,005円
T&Dダブルブル・ベア・シリーズ8(インド・ダブルベア8) 20,005円
T&Dダブルブル・ベア・シリーズ8(中国・ダブルブル8) 20,005円
T&Dダブルブル・ベア・シリーズ8(中国・ダブルベア8) 20,005円
T&Dダブルブル・ベア・シリーズ8(ナスダック100・ダブルブル8) 20,005円
T&Dダブルブル・ベア・シリーズ8(ナスダック100・ダブルベア8) 20,005円
T&Dダブルブル・ベア・シリーズ8(金・ダブルブル8) 20,005円
T&Dダブルブル・ベア・シリーズ8(金・ダブルベア8) 20,005円
T&Dダブルブル・ベア・シリーズ8(マネーボールファンド8) 651,830,422円

損益の状況

当期 自2021年12月11日 至2022年6月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△119,185円
受 取 利 息	4,497
支 払 利 息	△123,682
(B) 当 期 損 益 金 (A)	△119,185
(C) 前 期 繰 越 損 益 金	△122,186
(D) 追 加 信 託 差 損 益 金	△438,386
(E) 解 約 差 損 益 金	357,271
(F) 合 計 (B＋C＋D＋E)	△322,486
次 期 繰 越 損 益 金 (F)	△322,486

(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。