

*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／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	NASDAQ100指数（配当込み、当社円換算ベース）をベンチマークとし、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、主として米国の株式に実質的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指して運用を行います。	
主運用対象	ベビーファンド	NASDAQ100インデックス・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	米国の株式を主要投資対象とします。
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。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	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。 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（原則として2月21日。同日が休業日に該当する場合は翌営業日となります。）に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、収益分配金額は、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、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。 ※＜分配金再投資（累積投資）コース＞の場合、税引き後の分配金は、自動的に無手数料で再投資されます。	

運用報告書（全体版）

第2期

（決算日 2022年2月21日）

NZAM・ベータ NASDAQ100

受益者のみなさまへ

平素は格別のお引立てに預かり厚く御礼申し上げます。

さて、ご購入いただいております「NZAM・ベータ NASDAQ100」は去る2月21日に第2期の決算を行いましたので、期中の運用状況等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

運用状況に関する問い合わせ窓口
（フリーダイヤル）0120-439-244
<受付時間> 営業日の午前9時から午後5時まで
<https://www.ja-asset.co.jp/>

 **NZAM**

農林中金全共連アセットマネジメント株式会社
〒102-0093 東京都千代田区平河町2-7-9

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		騰落率 差異状況	ドル / 円		株式 組入 比率	株式 先物 比率	純資産 総額
	(分配)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率				
(設定日) 2020年3月12日	円 10,000	円 -	% -	859,905.45	% -	% -	円 104.60	% -	% -	% -	百万円 300
1期 (2021年2月22日)	18,454	0	84.5	1,621,408.17	88.6	△4.0	105.50	0.9	95.6	3.8	1,509
2期 (2022年2月21日)	20,708	0	12.2	1,832,898.71	13.0	△0.8	115.06	9.1	95.4	3.8	1,678

(注1) 設定日の基準価額及び純資産総額は設定当初の金額です (以下同じ)。

(注2) 分配金があった場合、基準価額の期中騰落率は分配金込みです。

(注3) ベンチマークは、NASDAQ100指数 (配当込み、当社円換算ベース) です。なお、当ファンドの基準価額は組入有価証券の前営業日の時価を基に計算されることから、NASDAQ100指数 (ドルベース) は、前日の値を採用しております。(以下同じ)。

(注4) 騰落率差異状況=基準価額期中騰落率-ベンチマーク期中騰落率

(注5) 当ファンドは、マザーファンドを組入れますので、組入比率、先物比率 (=買建比率-売建比率) は、実質組入比率を記載しております (以下同じ)。

(注6) 設定日のNASDAQ100指数 (配当込み、当社円換算ベース) の値は、設定日翌日を基準として算出しております (以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		騰落率 差異状況	ドル / 円		株式 組入 比率	株式 先物 比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		騰落率			
(期首) 2021年2月22日	円 18,454	% -	1,621,408.17	% -	% -	円 105.50	% -	% 95.6	% 3.8
2月末	17,561	△ 4.8	1,542,523.78	△ 4.9	0.0	106.25	0.7	95.6	3.8
3月末	18,383	△ 0.4	1,616,514.55	△ 0.3	△0.1	110.71	4.9	95.5	3.7
4月末	19,569	6.0	1,723,322.34	6.3	△0.2	108.93	3.3	95.5	3.7
5月末	19,327	4.7	1,702,385.82	5.0	△0.3	109.76	4.0	96.2	3.7
6月末	20,721	12.3	1,826,796.67	12.7	△0.4	110.58	4.8	95.8	3.7
7月末	21,174	14.7	1,868,257.52	15.2	△0.5	109.49	3.8	95.4	3.8
8月末	22,030	19.4	1,945,746.24	20.0	△0.6	109.90	4.2	95.5	3.8
9月末	21,215	15.0	1,873,955.76	15.6	△0.6	111.92	6.1	95.1	3.7
10月末	23,017	24.7	2,035,917.04	25.6	△0.8	113.67	7.7	95.8	3.7
11月末	23,942	29.7	2,119,231.58	30.7	△1.0	113.77	7.8	95.2	3.7
12月末	24,346	31.9	2,155,158.00	32.9	△1.0	115.02	9.0	95.9	3.6
2022年1月末	21,428	16.1	1,896,391.80	17.0	△0.8	115.44	9.4	95.3	3.8
(期末) 2022年2月21日	20,708	12.2	1,832,898.71	13.0	△0.8	115.06	9.1	95.4	3.8

(注1) 分配金があった場合、期末基準価額は分配金込みです。

(注2) 騰落率は期首比です。

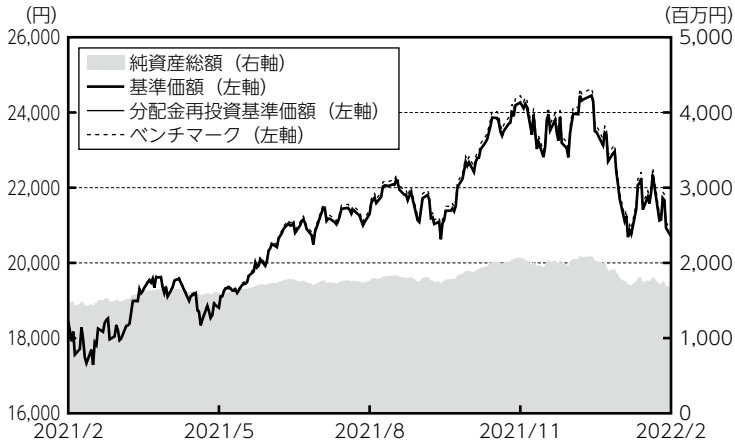
(注3) 騰落率差異状況=基準価額騰落率-ベンチマーク騰落率

当ファンドは、Nasdaq, Inc.およびその関連会社（以下、Nasdaq, Inc.およびその関連会社を「Nasdaq社」といいます）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説明および開示の正確性または妥当性について認定するものではありません。Nasdaq社は、当ファンドの受益者または公衆一般のいかなる者に対しても、一般的な有価証券投資または当ファンドへの投資の妥当性や、NASDAQ-100 Indexの一般的な株式市況へのパフォーマンスの追跡可能性について、明示的か黙示的かを問わず、何らの表明または保証するものではありません。Nasdaq社と農林中金全共連アセットマネジメント株式会社（以下、「ライセンサー」といいます）との関係は、Nasdaq®およびNASDAQ-100 Indexの登録商標ならびにNasdaq社の一定の商号の使用を許諾すること、ならびにライセンサー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、構成、または算出する際に、ライセンサーまたは当ファンドの受益者のニーズ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関連して一切の責任を負いません。Nasdaq社は、NASDAQ-100 Indexまたはそれに含まれるデータの正確性および中断されてい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、ライセンサー、当ファンドの受益者またはその他のいかなる者もしくは組織に生じた結果について、明示的か黙示的かを問わず、何ら保証するものではありません。Nasdaq社は、明示的か黙示的かを問わず何らの保証も行わず、NASDAQ-100 Index®またはそれに含まれるデータに関する、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、間接的もしくは必然的損害や損失について、たとえ当該損害等の可能性について通知されていたとしても、何らの責任を負いません。

《運用経過》

【当期中の基準価額等の推移について】

(第2期：2021年2月23日～2022年2月21日)



第2期首 : 18,454円
第2期末 : 20,708円
(既払分配金 0円)
騰落率 : 12.2%
(分配金再投資ベース)

- ・ベンチマークは、NASDAQ100指数（配当込み、当社円換算ベース）です。
なお、当ファンドの基準価額は組入有価証券の前営業日の時価を基に計算されることから、NASDAQ100指数（ドルベース）は、前日の値を採用しております。（以下同じ）。
- ・ベンチマークは、期首の値をファンドの基準価額と同一になるように指数化しています。
- ・分配金再投資基準価額は、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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- ・実際のファンドにおいては、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。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

【基準価額の主な変動要因】

基準価額は、期首18,454円で始まり、期末20,708円となり、騰落率は12.2%の上昇となりました。

□プラス要因

バイデン政権のインフラ投資法案を受けた米景気の回復期待や、堅調な経済指標および企業業績により、米国株式市場が上昇したことが基準価額の上昇要因となりました。

【投資環境について】

(第2期：2021年2月23日～2022年2月21日)

NASDAQ100指数(配当込み、当社円換算ベース)は、期を通じて上昇しました。期首は、米国10年国債利回り(以下「米国長期金利」という)の上昇を背景に株価収益率(PER)が高い銘柄が売られ、一時下落しましたが、その後は金利上昇が一服したことで値を戻すなど、5月まではほぼ横ばいの展開となりました。6月以降は、米国長期金利が低下傾向となったことや、堅調な経済指標の発表、インフラ投資法案の進展などを背景に、8月まで安定して上昇しました。9月以降はアフガニスタン情勢の緊迫化や、米国長期金利が再び上昇を始めたこと、資源価格の高騰などにより一時下落する局面もありましたが、好調な企業業績などが支えとなって持ち直し、12月まで上昇基調が継続しました。1月から期末にかけては、金融引き締め開始時期などをめぐり金融政策に関する不透明感が意識されたことで下落基調となりましたが、通期では上昇となりました。

為替市場では、期を通じて円安・ドル高となりました。期首は米景気の回復に対する期待感を織り込む形で米国長期金利が上昇したことに伴い、円安となりました。4月以降、米国長期金利は一時低下したものの、9月になると再び上昇に転じ、期末にかけては金融引き締め開始が意識され始めたことで一段高となった結果、為替市場でもさらに円安が進行する形となりました。

【ポートフォリオについて】

当ファンドは、NASDAQ100指数(配当込み、当社円換算ベース)をベンチマークとし、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、主として米国の株式に実質的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指して運用を行います。

前述のような投資環境のもと、当期におきましては、マザーファンドに概ね100%投資しました。

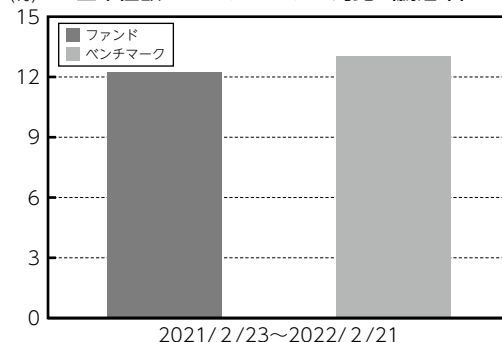
マザーファンドにおける運用では、NASDAQ100指数採用銘柄を主要投資対象とし、NASDAQ100指数(配当込み、当社円換算ベース)の動きに連動するようにポートフォリオを構築しました。なお、期末時点の組入銘柄数はベンチマークと同様の102銘柄となっております。

株式組入比率につきましては、NASDAQ100指数先物を活用しながら、期を通して実質的に概ね高位な組入比率を維持しました。

【ベンチマークとの差異要因について】

ベンチマークであるNASDAQ100指数(配当込み、当社円換算ベース)との比較では、ベンチマークの騰落率+13.0%に対し、0.8%下回りました。主に、信託報酬要因や、マザーファンドにおける海外保管銀行への支払い費用等がマイナスに寄与しました。

(%) 基準価額とベンチマークの対比(騰落率)



(注) 基準価額の騰落率は、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ています。

【分配金について】

収益分配金につきましては、信託財産の成長を優先するため、見送らせていただきました。

なお、収益分配金に充てなかった収益につきましては、信託財産に留保し元本と同様の運用を行っております。

■分配原資の内訳 (1万口当たり、税込み)

項 目	第2期 2021年2月23日 ～2022年2月21日
当期分配金 (円)	—
(対基準価額比率：%)	—
当期の収益 (円)	—
当期の収益以外 (円)	—
翌期繰越分配対象額 (円)	10,707

(注1) 「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)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なる点にご留意ください。

(注2) 「当期の収益」、「当期の収益以外」は小数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。

(注3) 分配金は、決算日から起算して5営業日までに販売会社より支払いが開始されます。

(注4) 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普通分配金となります。

分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が元本払戻金(特別分配金)、残りの部分が普通分配金となります。

(注5) 元本払戻金(特別分配金)が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

分配が行われた場合、＜分配金再投資(累積投資)コース＞をご利用の方は、税引き後の分配金が各決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資されます。

《今後の運用方針》

引き続きマザーファンドへの投資割合を高位に保ち運用を行います。また、マザーファンドにおける運用は、米国株式の投資割合(先物含む)を高位に保ち、銘柄毎の投資ウェイトはNASDAQ100指数における構成比率と同水準となるよう努め、NASDAQ100指数(配当込み、当社円換算ベース)との連動性を高めるよう運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当期 2021年2月23日 ～2022年2月21日		項目の概要
	金 額	比 率	
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社)	92 (51) (35) (7)	0.439 (0.241) (0.165) (0.033)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 投信会社によるファンドの運用の対価 分配・換金・償還金の支払、運用報告書の送付、口座管理等に係る費用 受託会社によるファンド運用財産の保管、管理、運用指図実行等の対価
(b) 売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	2 (2) (0)	0.011 (0.010) (0.000)	(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 有価証券等を売買する際に売買仲介人に支払う手数料 先物・オプションを取引する際に売買仲介人に支払う手数料
(c) 有価証券取引税 (株式)	0 (0)	0.000 (0.000)	(c) 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 有価証券の売買の都度発生する取引に係る税金
(d) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	86 (84) (1) (2)	0.408 (0.397) (0.003) (0.008)	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 海外資産等の海外保管銀行等に支払う保管・送金・受渡に係る費用 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 信託事務に係る諸費用
合 計	180	0.858	
期中の平均基準価額は、21,059円です。			

(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、簡便法により算出した結果です。

(注2) 「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を乗じたものです。

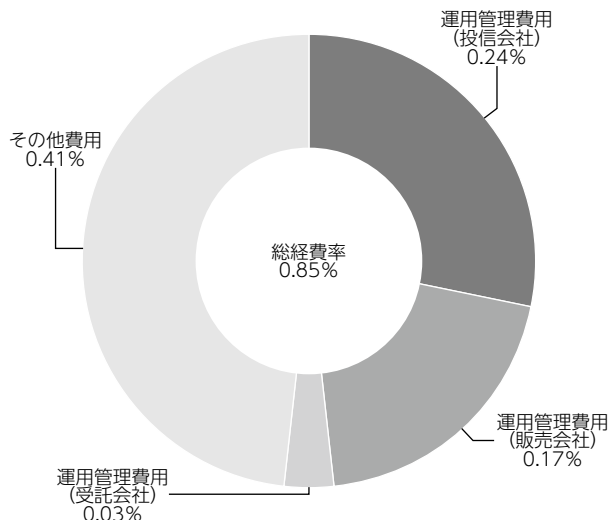
(注3) 売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注4) 各項目毎に円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、売買委託手数料及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0.85%です。



- (注1) 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、売買委託手数料及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。

■売買及び取引の状況 (2021年2月23日から2022年2月21日まで)

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
NASDAQ100インデックス・マザーファンド	千口 369,063	千円 769,605	千口 380,084	千円 799,328

■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	
	ベビーファンド	マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	-千円	827,192千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	-千円	1,680,236千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	-	0.49

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

■利害関係人との取引状況等（2021年2月23日から2022年2月21日まで）

当期における当ファンド及びマザーファンドに係る利害関係人との取引等はありません。

（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。

■第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己取引状況

該当事項はありません。

■組入資産の明細

親投資信託残高

種 類	期首（前期末）	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
NASDAQ100インデックス・マザーファンド	千円 814,050	千円 803,029	千円 1,677,287

■投資信託財産の構成

2022年2月21日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
NASDAQ100インデックス・マザーファンド	千円 1,677,287	% 99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,207	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	1,685,494	100.0

（注1）外貨建資産は、期末の時価をわが国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、2022年2月21日における邦貨換算レートは1ドル=115.06円です。

（注2）マザーファンドの外貨建資産（1,673,303千円）の投資信託財産総額に対する比率は98.5%です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2022年2月21日現在

項 目	当 期 末
(A)資 産	1,685,494,340円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,518,186
N A S D A Q 1 0 0 イ ン デ ッ ク ス ・ マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	1,677,287,033
未 収 入 金	6,689,121
(B)負 債	6,599,510
未 払 解 約 金	2,389,121
未 払 信 託 報 酬	4,152,400
そ の 他 未 払 費 用	57,989
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	1,678,894,830
元 本	810,753,007
次 期 繰 越 損 益 金	868,141,823
(D)受 益 権 総 口 数	810,753,007口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	20,708円

<注記事項>

当ファンドの期首元本額は818,142,091円、期中追加設定元本額は371,286,196円、期中一部解約元本額は378,675,280円です。

<第2期分配金の計算過程>

計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,447,612円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(100,783,260円)、信託約款に規定される収益調整金(551,473,107円)及び分配準備積立金(206,437,844円)より分配対象収益は868,141,823円(1万口当たり10,707.85円)となりますが、基準価額水準、市況動向等を勘案し分配は行っておりません。

■分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

(注1) 分配金は、決算日から起算して5営業日までに販売会社より支払いが開始されます。

(注2) 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普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が元本払戻金(特別分配金)、残りの部分が普通分配金となります。

(注3) 元本払戻金(特別分配金)が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

分配が行われた場合、<分配金再投資(累積投資)コース>をご利用の方は、税引き後の分配金が各決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資されます。

原則として、数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で記載しておりますので、合計欄の値が個別数値の合計と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数で記載する場合があります。

■損益の状況

当期 自2021年2月23日 至2022年2月21日

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	△ 306円
受 取 利 息	24
支 払 利 息	△ 330
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	118,036,746
売 買 益	197,710,475
売 買 損	△ 79,673,729
(C)信 託 報 酬 等	△ 7,805,568
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	110,230,872
(E)前 期 繰 越 損 益 金	206,437,844
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	551,473,107
(配 当 等 相 当 額)	(116,074,243)
(売 買 損 益 相 当 額)	(435,398,864)
(G) 計 (D + E + F)	868,141,823
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	868,141,823
追 加 信 託 差 損 益 金	551,473,107
(配 当 等 相 当 額)	(116,515,802)
(売 買 損 益 相 当 額)	(434,957,305)
分 配 準 備 積 立 金	316,668,716

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換え等によるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には、消費税等相当額を含めて表示しております。

(注3) (F)追加信託差損益金とは、追加設定した金額と元本との差額です。

NASDAQ100インデックス・マザーファンド

運用報告書

《第2期》

決算日：2022年2月21日

(計算期間：2021年2月23日～2022年2月21日)

法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第2期の運用状況をご報告申し上げます。

当マザーファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	NASDAQ100指数（配当込み、当社円換算ベース）をベンチマークとし、主として米国の株式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指して運用を行います。 株式への投資割合は、原則として高位に保ちます。 ベンチマークとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の投資比率が投資信託財産の純資産総額を超える場合があります。 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	米国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	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。

運用状況に関する問い合わせ窓口
（フリーダイヤル）0120-439-244
<受付時間> 営業日の午前9時から午後5時まで
<https://www.ja-asset.co.jp/>

 **NZAM**
農林中金全共連アセットマネジメント株式会社
〒102-0093 東京都千代田区平河町2-7-9

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		騰落率 差異状況	ドル / 円		株式 組入 比率	株式 先物 比率	純資産 総額
	円	%	円	%		円	%			
(設定日) 2020年3月12日	10,000	—	859,905.45	—	—	104.60	—	—	—	百万円 299
1期(2021年2月22日)	18,529	85.3	1,621,408.17	88.6	△3.3	105.50	0.9	95.7	3.8	1,508
2期(2022年2月21日)	20,887	12.7	1,832,898.71	13.0	△0.3	115.06	9.1	95.5	3.8	1,677

(注1) 設定日の基準価額及び純資産総額は設定当初の金額です(以下同じ)。

(注2) ベンチマークは、NASDAQ100指数(配当込み、当社円換算ベース)です。なお、当ファンドの基準価額は組入有価証券の前営業日の時価を基に計算されることから、NASDAQ100指数(ドルベース)は、前日値を採用しております。(以下同じ)。

(注3) 騰落率差異状況=基準価額期中騰落率-ベンチマーク期中騰落率

(注4) 株式先物比率=買建比率-売建比率(以下同じ)

(注5) 設定日のNASDAQ100指数(配当込み、当社円換算ベース)の値は、設定日翌日を基準として算出してあります(以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		騰落率 差異状況	ドル / 円		株式 組入 比率	株式 先物 比率
	円	%	円	%		円	%		
(期首) 2021年2月22日	18,529	—	1,621,408.17	—	—	105.50	—	95.7	3.8
2月末	17,633	△4.8	1,542,523.78	△4.9	0.0	106.25	0.7	95.7	3.8
3月末	18,466	△0.3	1,616,514.55	△0.3	△0.0	110.71	4.9	95.6	3.7
4月末	19,665	6.1	1,723,322.34	6.3	△0.2	108.93	3.3	95.5	3.7
5月末	19,429	4.9	1,702,385.82	5.0	△0.1	109.76	4.0	96.2	3.7
6月末	20,837	12.5	1,826,796.67	12.7	△0.2	110.58	4.8	95.8	3.7
7月末	21,300	15.0	1,868,257.52	15.2	△0.3	109.49	3.8	95.3	3.8
8月末	22,171	19.7	1,945,746.24	20.0	△0.3	109.90	4.2	95.6	3.8
9月末	21,358	15.3	1,873,955.76	15.6	△0.3	111.92	6.1	95.1	3.7
10月末	23,181	25.1	2,035,917.04	25.6	△0.5	113.67	7.7	95.8	3.7
11月末	24,122	30.2	2,119,231.58	30.7	△0.5	113.77	7.8	95.2	3.7
12月末	24,537	32.4	2,155,158.00	32.9	△0.5	115.02	9.0	95.8	3.6
2022年1月末	21,607	16.6	1,896,391.80	17.0	△0.3	115.44	9.4	95.2	3.8
(期末) 2022年2月21日	20,887	12.7	1,832,898.71	13.0	△0.3	115.06	9.1	95.5	3.8

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 騰落率差異状況=基準価額騰落率-ベンチマーク騰落率

当ファンドは、Nasdaq, Inc.およびその関連会社（以下、Nasdaq, Inc.およびその関連会社を「Nasdaq社」といいます）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説明および開示の正確性または妥当性について認定するものではありません。Nasdaq社は、当ファンドの受益者または公衆一般のいかなる者に対しても、一般的な有価証券投資または当ファンドへの投資の妥当性や、NASDAQ-100 Indexの一般的な株式市況へのパフォーマンスの追跡可能性について、明示的か黙示的かを問わず、何らの表明または保証するものではありません。Nasdaq社と農林中金全共連アセットマネジメント株式会社（以下、「ライセンサー」といいます）との関係は、Nasdaq[®]およびNASDAQ-100 Indexの登録商標ならびにNasdaq社の一定の商号の使用を許諾すること、ならびにライセンサー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、構成、または算出する際に、ライセンサーまたは当ファンドの受益者のニーズ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関連して一切の責任を負いません。Nasdaq社は、NASDAQ-100 Indexまたはそれに含まれるデータの正確性および中断されてい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、ライセンサー、当ファンドの受益者またはその他のいかなる者もしくは組織に生じた結果について、明示的か黙示的かを問わず、何ら保証するものではありません。Nasdaq社は、明示的か黙示的かを問わず何らの保証も行わず、NASDAQ-100 Index[®]またはそれに含まれるデータに関する、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、間接的もしくは必然的損害や損失について、たとえ当該損害等の可能性について通知されていたとしても、何らの責任を負いません。

《運用経過》

【当期中の基準価額等の推移について】

(第2期：2021年2月23日～2022年2月21日)



【基準価額の主な変動要因】

基準価額は、期首18,529円で始まり、期末20,887円となり、騰落率は12.7%の上昇となりました。

□プラス要因

バイデン政権のインフラ投資法案を受けた米景気の回復期待や、堅調な経済指標および企業業績により、米国株式市場が上昇したことが基準価額の上昇要因となりました。

【投資環境について】

NASDAQ100指数（配当込み、当社円換算ベース）は、期を通じて上昇しました。期首は、米国10年国債利回り（以下「米国長期金利」という）の上昇を背景に株価収益率（PER）が高い銘柄が売られ、一時下落しましたが、その後は金利上昇が一服したことで値を戻すなど、5月までほぼ横ばいの展開となりました。6月以降は、米国長期金利が低下傾向となったことや、堅調な経済指標の発表、インフラ投資法案の進展などを背景に、8月まで安定して上昇しました。9月以降はアフガニスタン情勢の緊迫化や、米国長期金利が再び上昇を始めたこと、資源価格の高騰などにより



一時下落する局面もありましたが、好調な企業業績などが支えとなって持ち直し、12月まで上昇基調が継続しました。1月から期末にかけては、金融引き締め開始時期などをめぐり金融政策に関する不透明感が意識されたことで下落基調となりましたが、通期では上昇となりました。

為替市場では、期を通じて円安・ドル高となりました。期首は米景気の回復に対する期待感を織り込む形で米国長期金利が上昇したことに伴い、円安となりました。4月以降、米国長期金利は一時低下したものの、9月になると再び上昇に転じ、期末にかけては金融引き締め開始が意識され始めたことで一段高となった結果、為替市場でもさらに円安が進行する形となりました。



【ポートフォリオについて】

当ファンドは、NASDAQ100指数（配当込み、当社円換算ベース）をベンチマークとし、主として米国の株式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指して運用を行います。

当期は前述のような投資環境のもと、以下のような運用を行いました。

ポートフォリオにつきましては、NASDAQ100指数採用銘柄を主要投資対象とし、NASDAQ100指数（配当込み、当社円換算ベース）の動きに連動するようにポートフォリオを構築しました。なお、期末時点の組入銘柄数はベンチマークと同様の102銘柄となっております。

株式組入比率につきましては、NASDAQ100指数先物を活用しながら、期を通して実質的に概ね高位な組入比率を維持しました。

【ベンチマークとの差異要因について】

ベンチマークであるNASDAQ100指数（配当込み、当社円換算ベース）との比較では、ベンチマークの騰落率+13.0%に対し、0.3%下回りました。主に、海外保管銀行へ支払った費用等がマイナスに寄与しました。

《今後の運用方針》

今後の運用につきましては、引き続き米国株式の投資割合（先物含む）を概ね98%以上に保ち、銘柄毎の投資ウェイトはNASDAQ100指数における構成比率と同水準となるよう努め、NASDAQ100指数（配当込み、当社円換算ベース）との連動性を高めるよう運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当期 2021年2月23日 ～2022年2月21日		項目の概要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	2 (2) (0)	0.011 (0.010) (0.000)	(a) 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 有価証券等を売買する際に売買仲介人に支払う手数料 先物・オプションを取引する際に売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) 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 有価証券の売買の都度発生する取引に係る税金
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	86 (84) (2)	0.405 (0.396) (0.008)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 海外資産等の海外保管銀行等に支払う保管・送金・受渡に係る費用 信託事務に係る諸費用
合 計	88	0.416	

期中の平均基準価額は、21,192円です。

(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、簡便法により算出した結果です。

(注2) 「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を乗じたものです。

(注3) 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

■ 売買及び取引の状況（2021年2月23日から2022年2月21日まで）

(1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外国	ア メ リ カ	百株 209 (59)	千ドル 3,561 (104)	百株 214 (12)	千ドル 3,784 (104)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は株式分割、株式転換・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。

(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 324	百万円 325	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

■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
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	827,192千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	1,680,236千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.49

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

■主要な売買銘柄 株式

当 期				当 期			
買 付		売 付		買 付		売 付	
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
META PLATFORMS INC(アメリカ)	0.973	36,752	37,772	APPLE INC(アメリカ)	3	53,671	17,346
APPLE INC(アメリカ)	1	26,484	15,652	MICROSOFT CORP(アメリカ)	1	42,323	33,195
MICROSOFT CORP(アメリカ)	0.789	24,517	31,073	TESLA INC(アメリカ)	0.353	35,081	99,380
AMAZON.COM INC(アメリカ)	0.057	21,212	372,152	AMAZON.COM INC(アメリカ)	0.084	31,723	377,661
HONEYWELL INTERNATIONAL INC(アメリカ)	0.811	20,323	25,059	NVIDIA CORP(アメリカ)	0.646	22,212	34,385
TESLA INC(アメリカ)	0.173	14,841	85,788	ALPHABET INC-CL C(アメリカ)	0.058	17,419	300,330
ALPHABET INC-CL A(アメリカ)	0.036	10,203	283,425	ALPHABET INC-CL A(アメリカ)	0.054	16,104	298,228
NVIDIA CORP(アメリカ)	0.228	9,422	41,327	META PLATFORMS INC(アメリカ)	0.381	14,028	36,821
LUCID GROUP INC(アメリカ)	1	8,751	4,606	PAYPAL HOLDINGS INC(アメリカ)	0.245	6,330	25,838
ALPHABET INC-CL C(アメリカ)	0.03	8,509	283,651	ADOBE INC(アメリカ)	0.102	6,319	61,955

(注) 金額は受渡し代金で、各月末（決算日の属する月については決算日）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。

■利害関係人との取引状況等（2021年2月23日から2022年2月21日まで）

当期における当ファンドに係る利害関係人との取引等はありません。

(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。

■第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己取引状況

該当事項はありません。

■組入資産の明細

(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	千ドル	千円	
TEXAS INSTRUMENTS INC	9	9	164	18,974	半導体・半導体製造装置
PEPSICO INC	14	14	248	28,578	食品・飲料・タバコ
MICRON TECHNOLOGY INC	11	11	108	12,516	半導体・半導体製造装置
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	—	7	134	15,444	資本財
CISCO SYSTEMS INC	45	45	258	29,740	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INTEL CORP	44	43	196	22,574	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	53	48	1,395	160,610	ソフトウェア・サービス
VERISIGN INC	1	1	24	2,850	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	12	17	199	22,933	半導体・半導体製造装置
EXELON CORP	10	10	43	5,019	公益事業
QUALCOMM INC	12	12	201	23,146	半導体・半導体製造装置
XILINX INC	2	—	—	—	半導体・半導体製造装置
CSX CORP	8	23	82	9,475	運輸
KLA CORPORATION	1	1	58	6,678	半導体・半導体製造装置
COMCAST CORP-CL A	49	48	227	26,209	メディア・娯楽
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	15	14	98	11,345	食品・飲料・タバコ
GILEAD SCIENCES INC	13	13	82	9,440	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	2	3	145	16,776	ソフトウェア・サービス
AMGEN INC	6	6	133	15,317	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	3	3	39	4,508	メディア・娯楽
EBAY INC	7	6	37	4,281	小売
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	9	9	43	4,971	食品・生活必需品小売り
BIOGEN INC	1	1	32	3,789	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTODESK INC	2	2	50	5,863	ソフトウェア・サービス
APPLIED MATERIALS INC	9	9	128	14,836	半導体・半導体製造装置
NVIDIA CORP	6	22	537	61,804	半導体・半導体製造装置
LAM RESEARCH CORP	1	1	86	9,903	半導体・半導体製造装置
XCEL ENERGY INC	5	5	38	4,381	公益事業
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2	2	62	7,185	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROSS STORES INC	3	3	35	4,097	小売
APPLE INC	119	105	1,772	203,910	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANALOG DEVICES INC	3	5	92	10,627	半導体・半導体製造装置
AUTOMATIC DATA PROCESSING	4	4	90	10,401	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL A	2	1	505	58,216	メディア・娯楽
AMERICAN ELECTRIC POWER	5	5	46	5,315	公益事業
AMAZON.COM INC	3	3	998	114,831	小売
BOOKING HOLDINGS INC	0.44	0.44	115	13,245	消費者サービス
INCYTE CORP	2	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADOBE INC	5	5	225	25,969	ソフトウェア・サービス
CERNER CORP	3	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CINTAS CORP	1	1	41	4,745	商業・専門サービス

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	千ドル	千円	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5	5	48	5,594	ソフトウェア・サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	4	4	242	27,901	食品・生活必需品小売り
FASTENAL CO	6	6	31	3,628	資本財
FISERV INC	7	7	66	7,657	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	1	3	107	12,373	ヘルスケア機器・サービス
MARRIOTT INTL-CL A	3	3	61	7,024	消費者サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY	2	5	42	4,905	半導体・半導体製造装置
NETFLIX INC	4	4	185	21,340	メディア・娯楽
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	0.78	0.72	48	5,608	小売
PACCAR INC	3	3	34	4,015	資本財
PAYCHEX INC	3	3	44	5,144	ソフトウェア・サービス
STARBUCKS CORP	12	12	117	13,499	消費者サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS, INC.	1	1	69	7,997	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACTIVISION BLIZZARD INC	8	8	67	7,777	メディア・娯楽
DOLLAR TREE INC	2	2	34	3,960	小売
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1	-	-	-	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	5	5	46	5,301	食品・飲料・タバコ
BAIDU INC - SPON ADR	2	2	41	4,718	メディア・娯楽
ANSYS INC	0.92	0.93	27	3,205	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	4	4	255	29,429	半導体・半導体製造装置
CHARTER COMMUNICATIONS-A	2	1	114	13,184	メディア・娯楽
META PLATFORMS INC	16	22	471	54,273	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	0.92	0.91	44	5,124	ヘルスケア機器・サービス
ILLUMINA INC	1	1	52	5,994	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LULULEMON ATHLETICA INC	1	1	41	4,723	耐久消費財・アパレル
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	7	-	-	-	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2	-	-	-	半導体・半導体製造装置
NXP SEMICONDUCTORS NV	3	2	53	6,135	半導体・半導体製造装置
OLD DOMINION FREIGHT LINE	-	1	35	4,075	運輸
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1	1	24	2,781	半導体・半導体製造装置
SYNOPSYS INC	1	1	46	5,394	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	1	1	32	3,768	商業・専門サービス
ALPHABET INC-CL C	2	2	534	61,547	メディア・娯楽
KRAFT HEINZ CO/THE	13	13	50	5,801	食品・飲料・タバコ
PAYPAL HOLDINGS INC	12	12	130	15,014	ソフトウェア・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	0.85	0.84	41	4,819	ヘルスケア機器・サービス
CADENCE DESIGN SYS INC	2	2	40	4,611	ソフトウェア・サービス
COPART INC	2	2	31	3,574	商業・専門サービス
FORTINET INC	-	1	53	6,138	ソフトウェア・サービス
ASML HOLDING NV-NY REG SHS	0.81	0.87	56	6,484	半導体・半導体製造装置
MERCADOLIBRE INC	0.53	0.54	50	5,823	小売
SIRIUS XM HOLDINGS INC	45	42	25	2,972	メディア・娯楽

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	千ドル	千円	
T-MOBILE US INC	13	13	165	19,086	電気通信サービス
TESLA INC	8	6	555	63,895	自動車・自動車部品
WORKDAY INC-CLASS A	1	2	44	5,108	ソフトウェア・サービス
TRIP.COM GROUP LTD	5	—	—	—	小売
JD.COM INC-ADR	9	7	57	6,564	小売
NETEASE INC-ADR	3	3	29	3,446	メディア・娯楽
FOX CORP CLASS A	3	—	—	—	メディア・娯楽
FOX CORP CLASS B	2	—	—	—	メディア・娯楽
CDW CORP/DE	1	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SPLUNK INC	1	1	19	2,283	ソフトウェア・サービス
SEAGEN INC	1	1	23	2,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DEXCOM INC	1	1	39	4,562	ヘルスケア機器・サービス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	2	2	32	3,783	ソフトウェア・サービス
DOCUSIGN INC	1	2	23	2,677	ソフトウェア・サービス
MODERNA INC	4	4	63	7,277	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PINDUODUO INC-ADR	3	4	24	2,868	小売
KEURIG DR PEPPER INC	15	15	58	6,725	食品・飲料・タバコ
PELTON INTERACTIVE INC-A	2	—	—	—	耐久消費財・アパレル
ATLISSIAN CORP PLC-CLASS A	1	1	44	5,144	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	2	3	32	3,749	メディア・娯楽
OKTA INC	1	1	26	2,993	ソフトウェア・サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	—	8	59	6,833	半導体・半導体製造装置
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	—	2	36	4,174	ソフトウェア・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	—	3	65	7,486	消費者サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	—	1	51	5,880	ソフトウェア・サービス
ZSCALER INC	—	1	38	4,404	ソフトウェア・サービス
LUCID GROUP INC	—	17	46	5,396	自動車・自動車部品
DATADOG INC - CLASS A	—	2	43	5,049	ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION ENERGY GROUP	—	3	15	1,823	公益事業
ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR	—	6	37	4,346	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
合 計	株 数・金 額 銘柄数<比率>	820 102	862 102	13,924 —	1,602,124 <95.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国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) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

(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	百万円	百万円
E-MINI NASDAQ100	64	—

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国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。

■投資信託財産の構成

2022年2月21日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 1,602,124	% 94.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	96,940	5.7
投 資 信 託 財 産 総 額	1,699,064	100.0

(注1) 外貨建資産は、期末の時価をわが国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、2022年2月21日における邦貨換算レートは1ドル=115.06円です。

(注2) 外貨建資産(1,673,303千円)の投資信託財産総額に対する比率は98.5%です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2022年2月21日現在

項 目	当 期 末
(A)資 産	1,699,564,263円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	41,707,262
株 式(評価額)	1,602,124,637
未 収 入 金	9,276,736
未 収 配 当 金	1,006,325
差 入 委 託 証 拠 金	45,449,303
(B)負 債	22,288,805
未 払 金	15,599,678
未 払 解 約 金	6,689,121
未 払 利 息	6
(C)純 資 産 総 額(A-B)	1,677,275,458
元 本	803,029,173
次 期 繰 越 損 益 金	874,246,285
(D)受 益 権 総 口 数	803,029,173口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,887円

<注記事項>

- ① 当マザーファンドの期首元本額は814,050,504円、期中追加設定元本額は369,063,657円、期中一部解約元本額は380,084,988円です。
- ② 当マザーファンドを投資対象とする投資元本額の内訳は、以下のとおりです。
- | | |
|---------------------|--------------|
| NZAM・ベータ NASDAQ100: | 803,029,173円 |
| 合計: | 803,029,173円 |

■損益の状況

当期 自2021年2月23日 至2022年2月21日

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	10,837,096円
受 取 配 当 金	10,839,135
受 取 利 息	2,262
支 払 利 息	△ 4,301
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	192,221,932
売 買 益	363,880,104
売 買 損	△171,658,172
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	2,965,776
取 引 益	16,674,610
取 引 損	△ 13,708,834
(D)信 託 報 酬 等	△ 7,343,455
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	198,681,349
(F)前 期 繰 越 損 益 金	694,266,253
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	400,542,266
(H)解 約 差 損 益 金	△419,243,583
(I) 計 (E+F+G+H)	874,246,285
次 期 繰 越 損 益 金(I)	874,246,285

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は、期末の評価換え等によるものを含みます。

(注2) (D)信託報酬等には、消費税等相当額を含めて表示しております。

(注3) (G)追加信託差損益金とは、追加設定した金額と元本との差額です。

(注4) (H)解約差損益金とは、元本と一部解約時の解約価額との差額です。

原則として、数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で記載しておりますので、合計欄の値が個別数値の合計と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数で記載する場合があります。