

一歩先いく NASDAQ-100 毎月カバコ戦略 (QYLD)

運用報告書 (全体版)

第19期 (決算日 2025年10月20日)
第20期 (決算日 2025年11月19日)
第21期 (決算日 2025年12月19日)
第22期 (決算日 2026年1月19日)
第23期 (決算日 2026年2月19日)
第24期 (決算日 2026年3月19日)

(作成対象期間 2025年9月20日～2026年3月19日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、CBOE NASDAQ-100 BuyWrite V2 指数 (円ベース) の動きに連動した投資成果をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先 (コールセンター)
TEL 0120-106212
(営業日の9:00～17:00)
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

★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	2024年3月21日～2034年3月17日
運用方針	投資成果を CBOE NASDAQ-100 BuyWrite V2 指数 (円ベース) の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	米国の金融商品取引所上場のETF (上場投資信託証券)
株式組入制限	無制限
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等とし、原則として、経費控除後の配当等収益等を中心に分配することをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			CBOE NASDAQ-100 BuyWrite V2 指数 (円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	純資産額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
1 期末 (2024年 4月19日)	10,111	0	1.1	10,123	1.2	106.3	37
2 期末 (2024年 5月20日)	10,202	90	1.8	10,317	1.9	95.1	35
3 期末 (2024年 6月19日)	10,468	60	3.2	10,678	3.5	98.3	44
4 期末 (2024年 7月19日)	10,484	70	0.8	10,804	1.2	98.6	55
5 期末 (2024年 8月19日)	9,887	75	△ 5.0	10,268	△ 5.0	96.0	52
6 期末 (2024年 9月19日)	9,663	75	△ 1.5	10,119	△ 1.4	98.1	55
7 期末 (2024年10月21日)	10,217	65	6.4	10,833	7.0	98.5	86
8 期末 (2024年11月19日)	10,458	85	3.2	11,218	3.6	97.2	79
9 期末 (2024年12月19日)	10,628	65	2.2	11,498	2.5	96.7	82
10期末 (2025年 1月20日)	10,833	160	3.4	12,056	4.8	97.3	85
11期末 (2025年 2月19日)	10,742	70	△ 0.2	12,029	△ 0.2	98.0	108
12期末 (2025年 3月19日)	9,533	55	△ 10.7	10,668	△ 11.3	97.0	124
13期末 (2025年 4月21日)	8,616	65	△ 8.9	9,701	△ 9.1	93.9	150
14期末 (2025年 5月19日)	9,094	50	6.1	10,351	6.7	99.2	207
15期末 (2025年 6月19日)	9,200	65	1.9	10,570	2.1	97.6	221
16期末 (2025年 7月22日)	9,464	65	3.6	10,989	4.0	98.6	240
17期末 (2025年 8月19日)	9,529	70	1.4	11,158	1.5	97.4	235
18期末 (2025年 9月19日)	9,653	65	2.0	11,386	2.0	99.3	265
19期末 (2025年10月20日)	9,994	90	4.5	11,937	4.8	99.7	291
20期末 (2025年11月19日)	10,321	90	4.2	12,448	4.3	94.7	349
21期末 (2025年12月19日)	10,487	95	2.5	12,784	2.7	98.7	369
22期末 (2026年 1月19日)	10,783	95	3.7	13,290	4.0	88.8	418
23期末 (2026年 2月19日)	10,476	90	△ 2.0	13,037	△ 1.9	98.7	390
24期末 (2026年 3月19日)	10,747	95	3.5	13,518	3.7	99.1	452

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) CBOE NASDAQ-100 BuyWrite V2 指数 (円ベース) は、Nasdaq, Inc. が算出する CBOE NASDAQ-100 BuyWrite V2 指数 (米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。

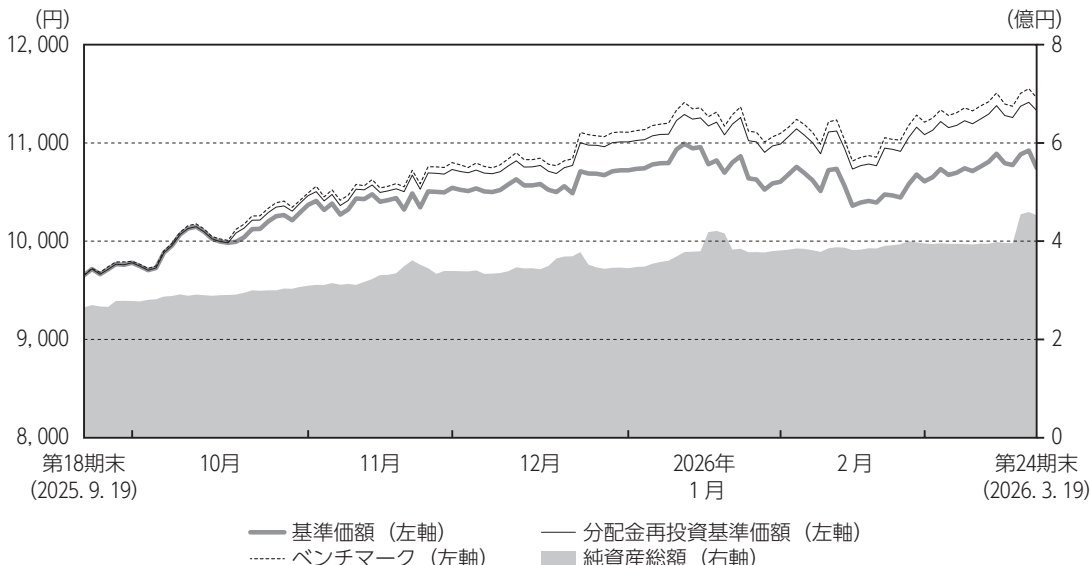
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

* 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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。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、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

* ベンチマークは CBOE NASDAQ-100 BuyWrite V2 指数（円ベース）です。

基準価額・騰落率

第19期首：9,653円

第24期末：10,747円（既払分配金555円）

騰落率：17.4%（分配金再投資ベース）

基準価額の主な変動要因

Global X が運用する Global X NASDAQ 100 Covered Call ETF に投資した結果、オプションプレミアムや為替の円安がプラス要因となったことから、当ファンドの基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

一歩先いく NASDAQ-100 毎月カバコ戦略 (QYLD)

	年 月 日	基 準 価 額		CBOE NASDAQ-100 BuyWrite V2 指数 (円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
第19期	(期首) 2025年 9 月19日	円 9,653	% —	11,386	% —	% 99.3
	9 月末	9,780	1.3	11,553	1.5	98.1
	(期末) 2025年10月20日	10,084	4.5	11,937	4.8	99.7
第20期	(期首) 2025年10月20日	9,994	—	11,937	—	99.7
	10 月末	10,369	3.8	12,372	3.6	98.9
	(期末) 2025年11月19日	10,411	4.2	12,448	4.3	94.7
第21期	(期首) 2025年11月19日	10,321	—	12,448	—	94.7
	11 月末	10,543	2.2	12,738	2.3	96.4
	(期末) 2025年12月19日	10,582	2.5	12,784	2.7	98.7
第22期	(期首) 2025年12月19日	10,487	—	12,784	—	98.7
	12 月末	10,721	2.2	13,104	2.5	98.0
	(期末) 2026年 1 月19日	10,878	3.7	13,290	4.0	88.8
第23期	(期首) 2026年 1 月19日	10,783	—	13,290	—	88.8
	1 月末	10,605	△ 1.7	13,089	△ 1.5	98.6
	(期末) 2026年 2 月19日	10,566	△ 2.0	13,037	△ 1.9	98.7
第24期	(期首) 2026年 2 月19日	10,476	—	13,037	—	98.7
	2 月末	10,608	1.3	13,225	1.4	97.3
	(期末) 2026年 3 月19日	10,842	3.5	13,518	3.7	99.1

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2025. 9. 20 ~ 2026. 3. 19)

■ 米国株式市況

米国株式市況は、史上最高値圏で横ばいに推移しました。

米国株式市況は、当作成期首より、2025年9月中旬のF R B（米国連邦準備制度理事会）による利下げ決定などを受け、上昇しました。さらに10月下旬にかけては、成長期待が高まったA I（人工知能）・半導体関連企業が相場上昇をけん引し、株価は史上最高値を更新しました。11月には、政府機関の一部閉鎖の影響が嫌気されて下落しましたが、同月下旬には利下げ観測が再び高まったことを好感し、反発しました。12月以降も、F R Bによる利下げの決定や流動性供給の開始、半導体関連企業の好業績などが好感され、株価は上昇しました。2026年1月以降は、経済指標の改善やインフレの沈静化が好感された一方で、「A I 脅威論」の台頭を受け、情報サービスやソフトウェア関連の企業が急落しました。その後、中東の地政学リスクの高まりが意識されて上値の重い展開となり、当作成期末を迎えました。

■ 為替相場

米ドル為替相場は対円で上昇（円安）しました。

米ドル対円為替相場は、当作成期首より2025年11月半ばにかけて、自民党総裁選挙の結果を受けた積極財政や緩和的な金融環境の継続への期待などから、投資家のリスク選好度が高まり、円安が進行しました。2026年1月には、日本の衆議院解散による積極財政推進への思惑などから円安が進行する場面もありましたが、為替介入の前段階とされるレートチェックを日米双方の当局が実施したとの観測を受け、円高が進行しました。2月は、米国財務長官による強い米ドル政策を支持する発言や、高市首相が日銀の利上げに難色を示したとの報道などを受け、円安となりました。その後、原油価格の高騰などが意識されて円安が加速し、当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

主として、Global X が運用する Global X NASDAQ 100 Covered Call ETF に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行います。

E T F（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

ポートフォリオについて

(2025. 9. 20 ~ 2026. 3. 19)

主として、Global X が運用する Global X NASDAQ 100 Covered Call ETF に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行いました。

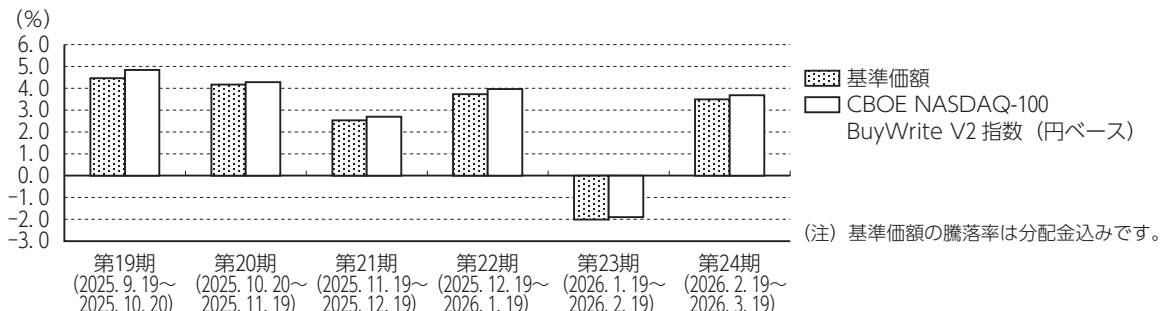
E T F (上場投資信託証券) の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本としました。

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は18.7%、当ファンドの基準価額の騰落率は17.4%となりました。

投資対象である E T F (上場投資信託証券) と指数の動きの不一致や、投資対象である E T F の終値と基準価額の不一致、当ファンドの資金の流出入のタイミングと当ファンドが投資対象である E T F を売買するタイミング、当該 E T F が組入証券を売買するタイミングの不一致が、かい離要因となりました。その他、当ファンドおよび投資対象である E T F の運用管理費用、売買委託手数料等の費用負担がかい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



*ベンチマークは CBOE NASDAQ-100 BuyWrite V2 指数 (円ベース) です。

分配金について

当作成期の1万口当り分配金(税込み)は下記「分配原資の内訳(1万口当り)」の「当期分配金(税込み)」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程(1万口当り)」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳(1万口当り)

項 目	第19期	第20期	第21期	第22期	第23期	第24期
	2025年9月20日 ～2025年10月20日	2025年10月21日 ～2025年11月19日	2025年11月20日 ～2025年12月19日	2025年12月20日 ～2026年1月19日	2026年1月20日 ～2026年2月19日	2026年2月20日 ～2026年3月19日
当期分配金(税込み)(円)	90	90	95	95	90	95
対基準価額比率(%)	0.89	0.86	0.90	0.87	0.85	0.88
当期の収益(円)	75	74	75	75	74	91
当期の収益以外(円)	14	15	19	19	15	3
翌期繰越分配対象額(円)	1,515	1,789	1,931	2,166	2,159	2,172

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の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4) 投資信託の計上上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

収益分配金の計算過程(1万口当り)

項 目	第19期	第20期	第21期	第22期	第23期	第24期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 75.28円	✓ 74.73円	✓ 75.32円	✓ 75.89円	✓ 74.94円	✓ 91.31円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	327.93	271.79	145.84	234.36	0.00	0.00
(c) 収益調整金	✓ 1,115.57	✓ 1,207.07	✓ 1,331.91	✓ 1,459.06	✓ 1,524.77	✓ 1,639.95
(d) 分配準備積立金	✓ 87.16	325.75	473.58	491.82	649.61	536.42
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,605.96	1,879.35	2,026.67	2,261.15	2,249.33	2,267.69
(f) 分配金	90.00	90.00	95.00	95.00	90.00	95.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	1,515.96	1,789.35	1,931.67	2,166.15	2,159.33	2,172.69

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

主として、Global X が運用する Global X NASDAQ 100 Covered Call ETF に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行います。

ETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

1万口当りの費用の明細

項 目	第19期～第24期 (2025. 9. 20～2026. 3. 19)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	4円	0.040%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10,472円です。
(投 信 会 社)	(2)	(0.016)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(2)	(0.016)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(1)	(0.008)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	5	0.052	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成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
(投 資 信 託 受 益 証 券)	(5)	(0.052)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	3	0.025	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.021)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	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)	(0)	(0.002)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	12	0.117	

(注1) 当作成期中の費用（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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

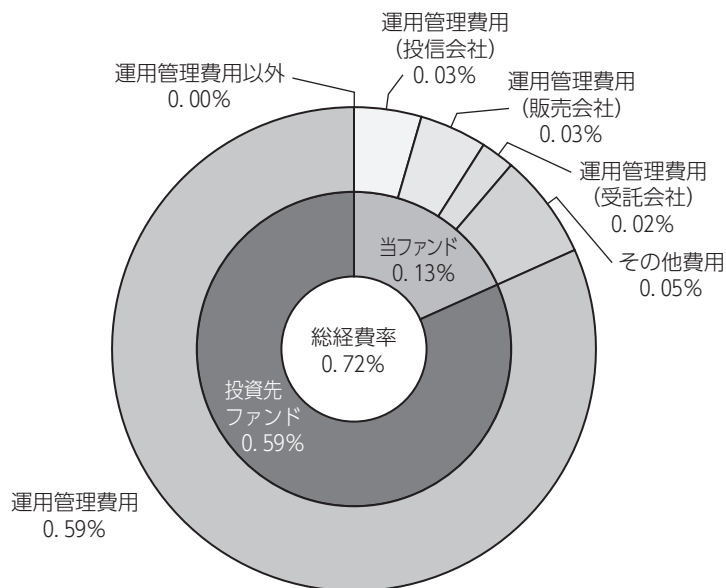
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.72%です。



総経費率 (① + ② + ③)	0.72%
①当ファンドの費用の比率	0.13%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.59%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.00%

(注1) 投資先ファンドとは、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) 投資先ファンドにおいて、上記以外に含まれていない費用は認識しておりません。

(注4) 各比率は、年率換算した値です。

(注5) ①の費用は、1万口当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6) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注7) 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8) 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異なります。

■売買および取引の状況
投資信託受益証券

(2025年9月20日から2026年3月19日まで)

決 算 期		第 19 期 ~ 第 24 期			
		買 付		売 付	
銘 柄		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外 国	アメリカ GLOBAL X NASDAQ COVERED CALL ETF (ETF)	千□ 85	千アメリカ・ドル 1,492	千□ 29.5	千アメリカ・ドル 517

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■投資信託財産の構成

2026年3月19日現在

項 目	第 24 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 448,995	% 97.1
コール・ローン等、その他	13,284	2.9
投資信託財産総額	462,280	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、3月19日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=159.88円です。

(注3) 第24期末における外貨建純資産 (451,441千円) の投資信託財産総額 (462,280千円) に対する比率は、97.7%です。

■組入資産明細表

外国投資信託受益証券

銘 柄	第18期末	第 24 期 末			
	□ 数	□ 数	評 価 額		
	千□	千□	外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円	
(アメリカ) GLOBAL X NASDAQ COVERED CALL ETF (ETF)	104.61	160.11	2,808	448,995	
合 計	□ 数、金額	104.61	160.11	2,808	448,995
	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄	<99.1%>	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

* 同じ銘柄名が複数表示される場合、同一銘柄名であっても市場や通貨等が異なる場合があります。また、銘柄名称が長い場合、名称の一部が表記されない場合があります。

一步先いく NASDAQ-100 毎月カバコ戦略 (QYLD)

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2025年10月20日)、(2025年11月19日)、(2025年12月19日)、(2026年1月19日)、(2026年2月19日)、(2026年3月19日)現在

項目	第19期末	第20期末	第21期末	第22期末	第23期末	第24期末
(A) 資産	294,964,784円	355,645,999円	374,209,305円	423,298,741円	394,156,877円	462,280,006円
コール・ローン等	4,264,899	25,071,051	9,508,803	51,427,363	8,911,423	13,284,302
投資信託受益証券 (評価額)	290,699,885	330,574,948	364,700,502	371,871,378	385,245,454	448,995,704
(B) 負債	3,465,691	6,640,583	4,754,356	4,720,626	3,648,463	9,341,853
未払金	777,348	2,968,481	821,953	—	—	5,102,410
未払収益分配金	2,625,127	3,043,223	3,346,745	3,687,622	3,354,802	4,003,884
未払解約金	42,211	605,116	558,080	1,002,051	253,015	200,956
未払信託報酬	19,712	21,082	23,348	25,067	27,032	25,257
その他未払費用	1,293	2,681	4,230	5,886	13,614	9,346
(C) 純資産総額 (A - B)	291,499,093	349,005,416	369,454,949	418,578,115	390,508,414	452,938,153
元本	291,680,829	338,135,968	352,288,976	388,170,743	372,755,823	421,461,483
次期繰越損益金	△ 181,736	10,869,448	17,165,973	30,407,372	17,752,591	31,476,670
(D) 受益権総口数	291,680,829口	338,135,968口	352,288,976口	388,170,743口	372,755,823口	421,461,483口
1万口当り基準価額 (C/D)	9,994円	10,321円	10,487円	10,783円	10,476円	10,747円

* 当作成期首における元本額は274,850,462円、当作成期間 (第19期~第24期) 中における追加設定元本額は382,102,416円、同解約元本額は235,491,395円です。

* 第24期末の計算口数当りの純資産額は10,747円です。

■損益の状況

第19期 自 2025年9月20日 至 2025年10月20日

第20期 自 2025年10月21日 至 2025年11月19日

第21期 自 2025年11月20日 至 2025年12月19日

第22期 自 2025年12月20日 至 2026年1月19日

第23期 自 2026年1月20日 至 2026年2月19日

第24期 自 2026年2月20日 至 2026年3月19日

項目	第19期	第20期	第21期	第22期	第23期	第24期
(A) 配当等収益	2,202,248円	2,534,019円	2,664,578円	2,954,707円	2,842,314円	3,862,567円
受取配当金	2,200,061	2,532,005	2,660,580	2,950,115	2,833,884	3,857,968
受取利息	2,187	2,014	3,998	4,592	8,430	4,599
(B) 有価証券売買損益	9,593,206	9,215,982	5,158,859	9,123,733	△ 10,340,546	9,628,199
売買益	9,683,627	9,283,199	5,530,839	9,517,294	777,028	12,687,668
売買損	△ 90,421	△ 67,217	△ 371,980	△ 393,561	△ 11,117,574	△ 3,059,469
(C) 信託報酬等	△ 34,374	△ 32,636	△ 31,738	△ 34,988	△ 48,546	△ 48,274
(D) 当期損益金 (A + B + C)	11,761,080	11,717,365	7,791,699	12,043,452	△ 7,546,778	13,442,492
(E) 前期繰越損益金	2,542,461	11,014,985	16,683,883	19,091,174	24,214,696	12,953,665
(F) 追加信託差損益金	△ 11,860,150	△ 8,819,679	△ 3,962,864	2,960,368	4,439,475	9,084,397
(配当等相当額)	(32,539,250)	(40,815,505)	(46,921,812)	(56,636,641)	(56,836,937)	(69,117,678)
(売買損益相当額)	(△ 44,399,400)	(△ 49,635,184)	(△ 50,884,676)	(△ 53,676,273)	(△ 52,397,462)	(△ 60,033,281)
(G) 合計 (D + E + F)	2,443,391	13,912,671	20,512,718	34,094,994	21,107,393	35,480,554
(H) 収益分配金	△ 2,625,127	△ 3,043,223	△ 3,346,745	△ 3,687,622	△ 3,354,802	△ 4,003,884
次期繰越損益金 (G + H)	△ 181,736	10,869,448	17,165,973	30,407,372	17,752,591	31,476,670
追加信託差損益金	△ 11,966,754	△ 9,335,923	△ 4,655,841	2,218,895	3,878,441	8,929,259
(配当等相当額)	(32,432,646)	(40,299,261)	(46,228,835)	(55,895,168)	(56,275,903)	(68,962,540)
(売買損益相当額)	(△ 44,399,400)	(△ 49,635,184)	(△ 50,884,676)	(△ 53,676,273)	(△ 52,397,462)	(△ 60,033,281)
分配準備積立金	11,785,018	20,205,371	21,821,814	28,188,477	24,214,696	22,608,165
繰越損益金	—	—	—	—	△ 10,340,546	△ 60,754

(注1) 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おります。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程 (総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	第19期	第20期	第21期	第22期	第23期	第24期
(a) 経費控除後の配当等収益	2,195,830円	2,526,979円	2,653,768円	2,946,149円	2,793,768円	3,848,746円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	9,565,250	9,190,386	5,137,931	9,097,303	0	0
(c) 収益調整金	32,539,250	40,815,505	46,921,812	56,636,641	56,836,937	69,117,678
(d) 分配準備積立金	2,542,461	11,014,985	16,683,883	19,091,174	24,214,696	22,608,165
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	46,842,791	63,547,855	71,397,394	87,771,267	83,845,401	95,574,589
(f) 分配金	2,625,127	3,043,223	3,346,745	3,687,622	3,354,802	4,003,884
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	44,217,664	60,504,632	68,050,649	84,083,645	80,490,599	91,570,705
(h) 受益権総口数	291,680,829口	338,135,968口	352,288,976口	388,170,743口	372,755,823口	421,461,483口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1 万口当り分配金 (税込み)	第19期	第20期	第21期	第22期	第23期	第24期
		90円	90円	95円	95円	90円

- (分配金再投資コース) をご利用の方の税引き分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金 (特別分配金)」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金 (特別分配金)、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金 (特別分配金) が発生した場合は、分配金発生時における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。

当ファンドは、Nasdaq, Inc. またはその関連会社 (以下、Nasdaq, Inc. およびその関連会社を「株式会社」と総称します。) 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。株式会社は、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記述および開示の正確性もしくは妥当性について認定するものではありません。株式会社は、当ファンドの保有者または公衆一般のいかなる者に対しても、一般的な証券投資または特に当ファンドへの投資についての妥当性や、CBOE NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index[®] の一般的な株式市況への追従可能性について、明示的か黙示的かを問わず、何らの表明もしくは保証も行ないません。株式会社と大和アセットマネジメント株式会社との関係は、Nasdaq[®]、CBOE NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index[™] および BXNT[™] の登録商標ならびに株式会社の一定の商号について使用を許諾すること、ならびに、大和アセットマネジメント株式会社または当ファンドとは無関係に、ナスダックが決定、構築および算出を行なう CBOE NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index の使用を許諾することに限られます。ナスダックは、CBOE NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index の決定、構築および計算に関し、大和アセットマネジメント株式会社または当ファンドの保有者の要望を考慮する義務を負いません。株式会社は、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、また関与をしていません。株式会社は、当ファンドの管理、マーケティング、取引に関連して一切の責任を負いません。株式会社は、CBOE NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index とそれに含まれるデータの正確性および中断されない算出を保証しません。株式会社は、CBOE NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index またはそれに含まれるデータの利用により、大和アセットマネジメント株式会社、当ファンドの保有者またはその他いかなる者もしくは組織に生じた結果についても、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行ないません。株式会社は、明示的か黙示的かを問わず、何らの保証も行わず、かつ CBOE NASDAQ-100 BuyWrite V2 Index またはそれに含まれるデータの利用に関する、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、株式会社は、いかなる逸失利益または特別、付随的、懲罰的、間接的もしくは派生的損害や損失について、たとえも当該損害等の可能性につき通知されていたとしても、何らの責任も負いません。