

iFree レバレッジ S & P 500

運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2024年8月30日)

(作成対象期間 2023年8月31日～2024年8月30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／海外／株式／特殊型(ブル・ベア型)		
信託期間	無期限(設定日:2018年8月31日)		
運用方針	日々の基準価額の値動きがS & P 500指数(配当込み、米ドルベース)の値動きの2倍程度となることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	米国の株価指数先物取引、米国の債券、わが国の債券およびダイワ・マネーストック・マザーファンドの受益証券。なお、米国の金融商品取引所上場株式およびETF(上場投資信託証券)に投資する場合があります。	
	ダイワ・マネーストック・マザーファンド	円建ての債券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下	
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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

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、日々の基準価額の値動きがS & P 500指数(配当込み、米ドルベース)の値動きの2倍程度となること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/>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			S & P 500指数 (税引後配当込み、 米ドルベース)		株式組入 比率	株式先物 比率	公社債 組入比率	債券先物 比率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税 分 配 金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
2期末 (2020年8月31日)	12,915	0	32.4	12,431	21.6	—	202.9	8.0	—	—	1,983
3期末 (2021年8月30日)	20,981	0	62.5	16,148	29.9	—	200.9	6.7	—	—	13,144
4期末 (2022年8月30日)	16,097	0	△ 23.3	14,585	△ 9.7	—	200.4	—	—	—	19,222
5期末 (2023年8月30日)	17,843	0	10.8	16,470	12.9	—	200.0	—	—	—	25,248
6期末 (2024年8月30日)	24,460	0	37.1	20,690	25.6	—	198.4	36.8	—	—	22,338

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P 500指数 (税引後配当込み、米ドルベース) は、同指数の原データをもとに、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。

(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 先物比率は買建比率-売建比率です。

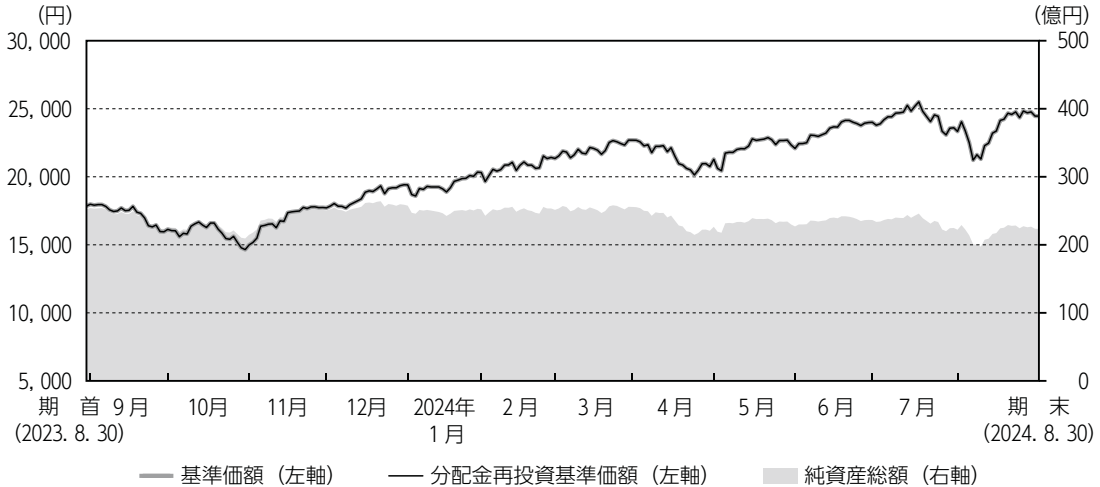
(注7) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

S & P 500指数は S & P Dow Jones Indices LLC またはその関連会社 (「S P D J I」) の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S & P[®]、S & P 500[®]、US 500、The 500、iBoxx[®]、iTraxx[®] および CDX[®] は、S & P Global, Inc. またはその関連会社 (「S & P」) の商標です。Dow Jones[®] は、Dow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」) の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスは S P D J I に付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。iFree レバレッジ S & P 500は、S P D J I、Dow Jones、S & P、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 500 指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。



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は、当完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。

基準価額・騰落率

期首：17,843円

期末：24,460円（分配金0円）

騰落率：37.1%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

日々の基準価額の値動きがS & P 500指数（配当込み、米ドルベース）の値動きの2倍程度となることをめざした運用を行った結果、米国株式が上昇基調だったことから、当ファンドの基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

iFree レバレッジ S & P 500

年 月 日	基 準 価 額		S & P 500指数 (税引後配当込み、米ドルベース)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 比 率	公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
	円	騰 落 率 %	(参考指数)	騰 落 率 %					
(期首) 2023年 8月30日	17,843	—	16,470	—	—	200.0	—	—	—
8月末	17,981	0.8	16,535	0.4	—	199.7	—	—	—
9月末	16,137	△ 9.6	15,761	△ 4.3	—	200.7	—	—	—
10月末	14,985	△ 16.0	15,284	△ 7.2	—	201.1	—	—	—
11月末	17,715	△ 0.7	16,712	1.5	—	199.4	—	—	—
12月末	19,404	8.7	17,584	6.8	—	199.7	—	—	—
2024年 1月末	20,313	13.8	18,116	10.0	—	198.9	—	—	—
2月末	21,344	19.6	18,667	13.3	—	199.6	—	—	—
3月末	22,694	27.2	19,365	17.6	—	199.9	20.4	—	—
4月末	21,283	19.3	18,866	14.5	—	200.8	24.9	—	—
5月末	22,080	23.7	19,325	17.3	—	199.2	37.0	—	—
6月末	24,008	34.6	20,255	23.0	—	199.7	28.5	—	—
7月末	23,340	30.8	20,096	22.0	—	199.3	30.7	—	—
(期末) 2024年 8月30日	24,460	37.1	20,690	25.6	—	198.4	36.8	—	—

(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

(2023. 8. 31 ~ 2024. 8. 30)

■ 米国株式市況

米国株式市況は、一時的な調整を挟みながら大幅に上昇しました。

米国株式市況は、当作成期首より、F R B（米国連邦準備制度理事会）の政策金利見通しの引き上げ、政府機関の閉鎖懸念などによる長期金利の大幅な上昇、パレスチナ情勢の悪化などが嫌気され、2023年10月末にかけて下落しました。しかし11月以降は、欧米のインフレ率が予想以上に低下したことや、F R B 議長が将来の利下げについての議論を始めたことを受けて利下げ期待が高まったことなどが好感され、上昇しました。2024年1月以降も、製造業の景況感が改善したことやA I（人工知能）関連企業が良好な決算を発表したことなどが好感され、押し目らしい押し目もなく上昇が継続しました。4月に入ると、インフレ再燃が懸念され米国の利下げ開始が後ずれするとの見方が強まり、反落しました。4月下旬以降は、インフレ率が低下傾向となり利下げ期待が再び高まったことなどから上昇基調となり、高成長が期待されるA I 関連企業の株価急騰が相場をけん引して高値を更新しました。しかし7月中旬以降は、対中輸出規制強化への懸念などから半導体関連株主導で下落しました。さらに8月初旬には、雇用統計が市場予想よりも弱い内容であったことから景気の先行きに対する不透明感がにわかに強まり、急落しました。その後は、米国の経済指標の改善やF R B 議長の実質的な利下げ開始発言などを好感して株価は急反発し、ほぼ当作成期中の高値で当作成期末を迎えました。

■ 国内短期金融市況

当作成期首より、日銀によるマイナス金利政策が継続していましたが、2024年3月にマイナス金利政策が解除されました。このような日銀の金融政策を背景に、短期金利は上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■ 当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、主として、米国の債券、わが国の債券および「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」の受益証券に投資するとともに、株式の組入総額と株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、原則として、信託財産の純資産総額の2倍程度になるように調整することにより、日々の基準価額の値動きがS & P 500指数（配当込み、米ドルベース）の値動きの2倍程度となることをめざします。

また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

ポートフォリオについて

(2023. 8. 31 ~ 2024. 8. 30)

■当ファンド

米国の株価指数先物取引の買建玉の時価総額が、純資産総額の2倍程度となるよう調整しました。また、「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の受益証券への投資も行いました。為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

米国の株価指数先物取引については、E-mini S & P 500 株価指数先物取引を利用しました。米国の株式への直接投資は行っていません。

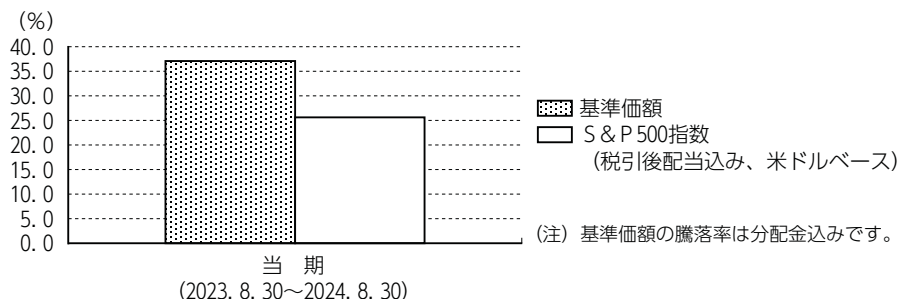
■ダイワ・マネースtock・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、信託財産の成長に資することを目的に、収益分配を見送らせていただきました。
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（1万口当たり）

項 目	当期	
	2023年 8月31日 ～2024年 8月30日	
当期分配金（税込み）	（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）	14,459

- (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) 投資信託の計理上、「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。



今後の運用方針

当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、主として、米国の債券、わが国の債券および「ダイワ・マネーストック・マザーファンド」の受益証券に投資するとともに、株式の組入総額と株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、原則として、信託財産の純資産総額の2倍程度になるように調整することにより、日々の基準価額の値動きがS & P 500指数（配当込み、米ドルベース）の値動きの2倍程度となることをめざします。

また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

ダイワ・マネーストック・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2023. 8. 31～2024. 8. 30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	203円	0.990%	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20,528円です。
(投 信 会 社)	(98)	(0.478)	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)	(98)	(0.478)	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)	(7)	(0.033)	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	4	0.019	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
(先物・オプション)	(4)	(0.019)	
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	1	0.006	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
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	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)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	208	1.015	

(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。

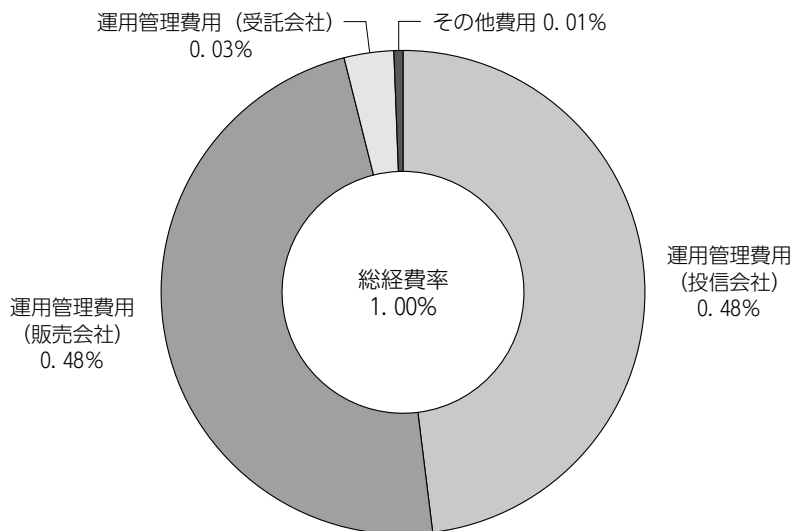
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.00%です。



(注1) 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) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2023年8月31日から2024年8月30日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	10,566,162	10,566,162	14,685,719	14,686,493

(注) 単位未満は切捨て。

■先物・オプション取引|状況等

先物取引の銘柄別取引・残高状況

(2023年8月31日から2024年8月30日まで)

銘 柄 別		買 建		売 建		当 作 成 期 末 評 価 額		
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額	買 建 額	売 建 額	評 価 損 益
外 国 株 式	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	百万円 239,790	百万円 254,295	百万円 —	百万円 —	百万円 44,312	百万円 —	百万円 744

(注) 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。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	13,902,643	9,783,086	9,785,043

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年8月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・マネースtock・マザーファンド	9,785,043	43.3
コール・ローン等、その他	12,808,707	56.7
投資信託財産総額	22,593,751	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、8月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=144.80円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(6,638,275千円)の投資信託財産総額(22,593,751千円)に対する比率は、29.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年8月30日現在

項目	当期末
(A) 資産	29,192,097,130円
コール・ローン等	5,925,595,714
ダイワ・マネーストック・マザーファンド(評価額)	9,785,043,118
未収入金	7,588,137,673
差入委託証拠金	5,893,320,625
(B) 負債	6,853,554,785
未払金	6,633,868,435
未払解約金	102,791,419
未払信託報酬	116,249,199
その他未払費用	645,732
(C) 純資産総額 (A - B)	22,338,542,345
元本	9,132,756,194
次期繰越損益金	13,205,786,151
(D) 受益権総口数	9,132,756,194口
1万口当り基準価額 (C/D)	24,460円

* 期首における元本額は14,150,292,219円、当作成期間中における追加設定元本額は3,870,172,767円、同解約元本額は8,887,708,792円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,460円です。

■損益の状況

当期 自2023年8月31日 至2024年8月30日

項目	当期
(A) 配当等収益	244,973,121円
受取利息	2,693,320
その他収益金	242,983,663
支払利息	△ 703,862
(B) 有価証券売買損益	△ 296,770,075
売買益	1,380,434,210
売買損	△ 1,677,204,285
(C) 先物取引等損益	5,786,217,355
取引益	7,221,773,631
取引損	△ 1,435,556,276
(D) 信託報酬等	△ 238,541,153
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	5,495,879,248
(F) 前期繰越損益金	467,695,768
(G) 追加信託差損益金	7,242,211,135
(配当等相当額)	(5,444,339,561)
(売買損益相当額)	(1,797,871,574)
(H) 合計 (E + F + G)	13,205,786,151
次期繰越損益金 (H)	13,205,786,151
追加信託差損益金	7,242,211,135
(配当等相当額)	(5,444,339,561)
(売買損益相当額)	(1,797,871,574)
分配準備積立金	5,963,575,016

(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。

(注4) 投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用：25,158,135円(未監査)

■収益分配金の計算過程(総額)

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	234,787,414円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	5,261,091,834
(c) 収益調整金	7,242,211,135
(d) 分配準備積立金	467,695,768
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	13,205,786,151
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	13,205,786,151
(h) 受益権総口数	9,132,756,194口

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（iFree レバレッジ S & P 500）が投資対象としている「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」の決算日（2023年12月11日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2024年8月30日）現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・マネースtock・マザーファンドの主要な売買銘柄

公 社 債

（2023年8月31日から2024年8月30日まで）

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
1219国庫短期証券 2024/6/24	129,997,160		
1239国庫短期証券 2024/9/24	69,999,650		
1231国庫短期証券 2025/5/20	39,942,240		
1232国庫短期証券 2024/8/19	11,999,832		

（注1）金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

（注2）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2024年8月30日現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンド（130,909,797千円）の内容です。

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

作 成 期	2024年8月30日現在							
	区 分	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちBB格 以下組入 比	残存期間別組入比率		
						5年以上	2年以上	2年未満
		千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券		110,000,000	109,954,693	84.0	—	—	—	84.0

（注1）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

（注2）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

（注3）評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2)国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

2024年8月30日現在						
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千円	千円		
国債証券	1239国庫短期証券	—	70,000,000	69,999,904	2024/09/24	
	1231国庫短期証券	—	40,000,000	39,954,788	2025/05/20	
合 計	銘柄数 金 額				2銘柄	
			110,000,000	109,954,693		

（注）単位未満は切捨て。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

運用報告書 第14期 (決算日 2023年12月11日)

(作成対象期間 2022年12月10日～2023年12月11日)

ダイワ・マネースtock・マザーファンド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。

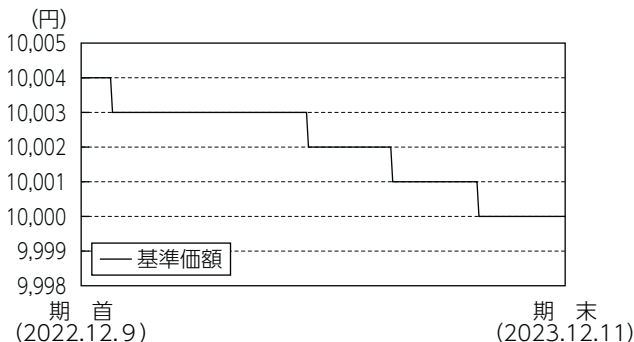
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		公 社 債 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	
(期首)2022年12月9日	円	%	%
12月末	10,004	—	—
2023年1月末	10,003	△0.0	—
2月末	10,003	△0.0	—
3月末	10,003	△0.0	—
4月末	10,003	△0.0	—
5月末	10,003	△0.0	—
6月末	10,002	△0.0	—
7月末	10,002	△0.0	—
8月末	10,001	△0.0	—
9月末	10,001	△0.0	—
10月末	10,000	△0.0	—
11月末	10,000	△0.0	—
(期末)2023年12月11日	10,000	△0.0	—

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。
 (注3) 当ファンドは、安定した収益の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,004円 期末：10,000円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

コール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市況

当作成期を通じて、日銀は長短金利操作付き量・質的金融緩和を維持しました。この金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

◆ポートフォリオについて

流動性や資産の安全性に配慮し、コール・ローン等による運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用	—
合 計	—

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。
 (注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

当作成期中における売買および取引はありません。

■主要な売買銘柄

当作成期中における主要な売買銘柄はありません。

■組入資産明細表

当作成期末における有価証券等の組み入れはありません。

■投資信託財産の構成

2023年12月11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 224,869,425	% 100.0
投資信託財産総額	224,869,425	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の状況

2023年12月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	224,869,425,628円
コール・ローン等	224,869,425,628
(B) 負債	1,500,000,000
未払解約金	1,500,000,000
(C) 純資産総額(A - B)	223,369,425,628
元本	223,366,515,143
次期繰越損益金	2,910,485
(D) 受益権総口数	223,366,515,143口
1万口当り基準価額(C/D)	10,000円

* 期首における元本額は159,095,941,234円、当作成期間中における追加設定元本額は314,669,316,126円、同解約元本額は250,398,742,217円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック	947,268円
ダイワ/ミレアセット・インド株式ファンド - インドの匠	29,910,270円
ワールド・フィンテック革命ファンド (為替ヘッジあり)	998円
ワールド・フィンテック革命ファンド (為替ヘッジなし)	998円
US短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型)	102,434円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック (為替ヘッジあり)	39,849円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド (年1回決算型)	3,985円
- ロボテック (年1回) - (為替ヘッジあり)	
iFreeレバレッジ S & P500	8,578,400,572円
iFreeレバレッジ NASDAQ100	136,597,495,537円
クリーンテック株式ファンド (資産成長型)	998,802円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック (毎月決算/予想分配金提示型)	999円
世界インフラ戦略ファンド (為替ヘッジなし/資産成長型)	499,501円
iFreeETF 日経平均レバレッジ・インデックス	3,766,275,979円
iFreeETF 日経平均ダブルインバース・インデックス	7,383,524,817円
iFreeETF TOPIXレバレッジ (2倍) 指数	1,207,970,593円
iFreeETF TOPIXダブルインバース (-2倍) 指数	926,253,680円
iFreeETF 日経平均インバース・インデックス	8,758,653,432円
iFreeETF TOPIXインバース (-1倍) 指数	11,471,375,420円
iFreeETF JPX日経400レバレッジ・インデックス	788,263,236円
iFreeETF JPX日経400インバース・インデックス	114,002,117円
iFreeETF JPX日経400ダブルインバース・インデックス	78,926,070円
iFreeETF S & P500レバレッジ	556,085,029円
iFreeETF S & P500インバース	2,883,612,458円
先進国トータルリターン戦略ファンド (リスク抑制型/適格機関投資家専用)	207,414,601円
ダイワ日本国債15-20年ダウ型ファンド・マネー・ポートフォリオ - S/Lトレード	4,992,083円
ブルベア・マネー・ポートフォリオ6	25,460,730,955円
ブル3倍日本株ポートフォリオ6	11,487,636,953円
ベア2倍日本株ポートフォリオ6	3,017,601,716円
ダイワ/ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ	44,637,919円
ダイワUS短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/年1回決算型)	9,957円
ダイワ米国バンクローン・オープン (為替ヘッジあり)	997円
ダイワ米国バンクローン・オープン (為替ヘッジなし)	997円
ダイワ/ミレアセット亜細亜株式ファンド	4,148円
通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) ミドル・コース	10,833円
通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) ブラジル・リアル・コース	10,788円
通貨選択型ダイワ/ミレアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) 通貨セレクト・コース	12,751円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド (年1回決算型) - ロボテック (年1回)	100,588円
ダイワ/ミレアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド	5,813円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,000円です。

■損益の状況

当期 自2022年12月10日 至2023年12月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△69,335,817円
支払利息	△69,335,817
(B) 当期損益金(A)	△69,335,817
(C) 前期繰越損益金	62,057,963
(D) 解約差損益金	△51,876,027
(E) 追加信託差損益金	62,064,366
(F) 合計(B + C + D + E)	2,910,485
次期繰越損益金(F)	2,910,485

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(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。