

# iFree レバレッジ NASDAQ100

## 運用報告書(全体版)

### 第6期

(決算日 2024年10月18日)

(作成対象期間 2023年10月19日～2024年10月18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10月19日)		
運用方針	日々の基準価額の値動きがNASDAQ100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tock・マザーファンドの受益証券	
	ダイワ・マネースtock・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	
	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、分配を行な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NASDAQ100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			NASDAQ100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	純資産 総額
	(分配落)	税込み 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10月19日)	23,056	0	97.7	16,896	50.2	—	202.2	6.4	32,193
3 期末 (2021年10月18日)	36,068	0	56.4	21,698	28.4	—	201.3	8.7	131,050
4 期末 (2022年10月18日)	17,207	0	△ 52.3	15,935	△ 26.6	—	200.5	—	126,307
5 期末 (2023年10月18日)	27,479	0	59.7	21,916	37.5	—	199.8	—	222,491
6 期末 (2024年10月18日)	42,350	0	54.1	29,429	34.3	—	199.5	19.9	251,387

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) NASDAQ100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) 公社債組入比率は、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) 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。

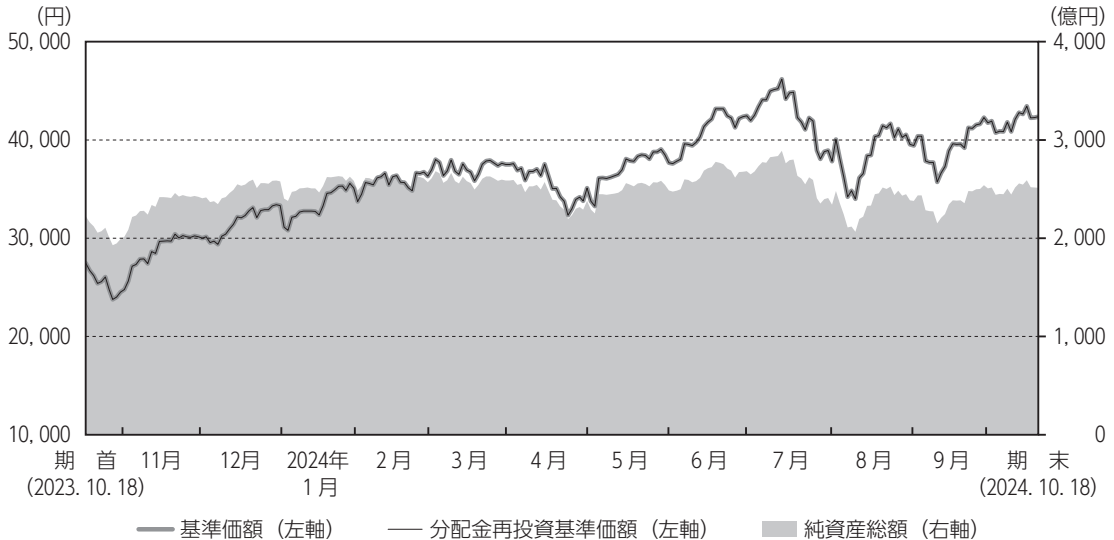
(注7) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

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、NASDAQ-100 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<sup>®</sup> および NASDAQ-100 Index 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 NASDAQ-100 Index の使用を許諾することに限られます。ナスダックは、NASDAQ-100 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、NASDAQ-100 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、NASDAQ-100 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 NASDAQ-100 Index<sup>®</sup> 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、たとえもし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。



## 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。

#### 基準価額・騰落率

期首：27,479円

期末：42,350円（分配金0円）

騰落率：54.1%（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NASDAQ100指数（税引後配当込み、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、米国株式市況が上昇したことにより、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。

iFree レバレッジ NASDAQ100

年 月 日	基 準 価 額		NASDAQ100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
	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率				
(期首)2023年10月18日	円	%			%	%	%
	27,479	—	21,916	—	—	199.8	—
10月末	24,513	△ 10.8	20,778	△ 5.2	—	200.9	—
11月末	30,152	9.7	23,190	5.8	—	199.5	—
12月末	33,323	21.3	24,519	11.9	—	200.4	—
2024年 1 月末	35,108	27.8	25,364	15.7	—	200.1	—
2 月末	36,309	32.1	25,958	18.4	—	199.4	—
3 月末	37,496	36.5	26,526	21.0	—	200.0	29.4
4 月末	35,093	27.7	25,846	17.9	—	200.9	27.6
5 月末	37,668	37.1	26,962	23.0	—	199.3	29.4
6 月末	42,461	54.5	28,798	31.4	—	199.8	27.5
7 月末	37,834	37.7	27,359	24.8	—	199.4	28.3
8 月末	39,442	43.5	28,146	28.4	—	199.8	21.7
9 月末	41,753	51.9	29,158	33.0	—	200.8	20.6
(期末)2024年10月18日	42,350	54.1	29,429	34.3	—	199.5	19.9

(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. 10. 19 ~ 2024. 10. 18)

### ■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、欧米のインフレ率が予想以上に低下したことや、F R B（米国連邦準備制度理事会）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年に入ってから、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、続伸しました。4月に入ると、インフレ再燃が懸念されて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、米国の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利下げ開始を強く示唆するF R B議長の発言などを好感して株価は急反発し、9月中旬にF R Bが0.50%ポイントの利下げを決定したことなども好感され、上昇しました。10月に入ると、トランプ前米国大統領の2024年の大統領選挙での振り返りが期待されて上昇し、当作成期中の高値で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」

### ■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tock・マザーファンド」の受益証券に投資するとともに、米国の株価指数先物取引を買建てます。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NASDAQ100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. 10. 19 ~ 2024. 10. 18)

### ■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、信託財産の純資産総額の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ったほか、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 NASDAQ100種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おりません。

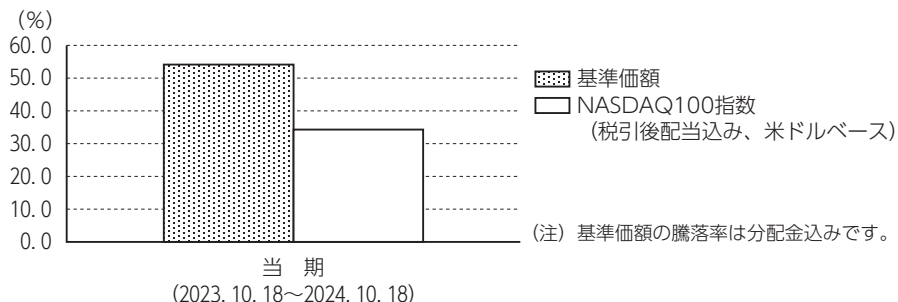
### ■ダイワ・マネースtock・マザーファンド

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、信託財産の成長を考慮し、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（1万口当り）

項 目	当 期	
	2023年10月19日 ～2024年10月18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）	32,349

- (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、米国の株価指数先物取引を買建てます。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NASDAQ100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. 10. 19~2024. 10. 18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	360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36, 389円です。
(投 信 会 社)	(174)	(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)	(174)	(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)	(12)	(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	5	0. 014	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)	(5)	(0. 014)	
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	0	0. 001	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)	(0)	(0. 001)	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. 000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	366	1. 005	

(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。

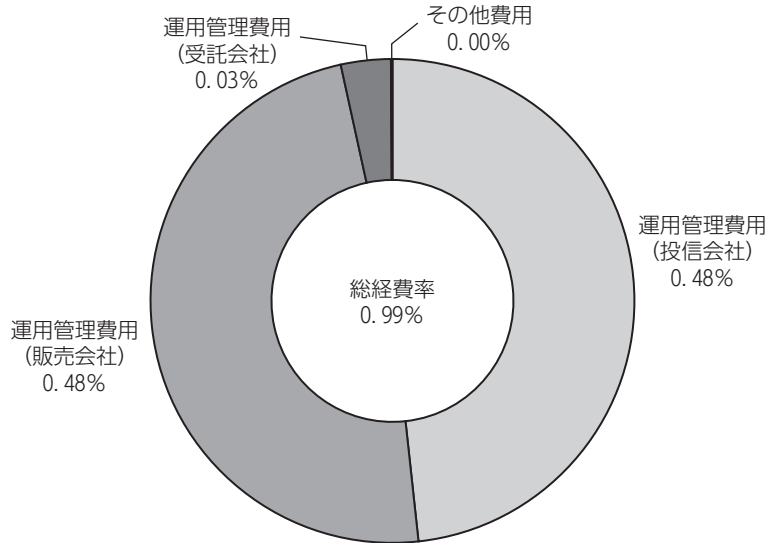
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



## 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0.99%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10月19日から2024年10月18日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネーストック・マザーファンド	246,059,422	246,073,993	225,396,736	225,410,861

(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状況・残高状況

(2023年10月19日から2024年10月18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		百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
		NASDAQ 100 E-MINI (アメリカ)	2,604,144	2,665,292	—	—	501,425	—	16,367

(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・マネーストック・マザーファンド	68,345,117	89,007,803	89,043,406

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2024年10月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・マネーストック・マザーファンド	89,043,406	34.5
コール・ローン等、その他	169,063,857	65.5
投資信託財産総額	258,107,264	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、10月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝150.13円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(99,689,323千円)の投資信託財産総額(258,107,264千円)に対する比率は、38.6%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年10月18日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>354,067,511,246円</b>
コール・ローン等	69,355,271,023
ダイワ・マネーストック・マザーファンド (評価額)	89,043,406,520
未収入金	112,351,270,825
差入委託証拠金	83,317,562,878
<b>(B) 負債</b>	<b>102,679,762,974</b>
未払金	99,858,726,946
未払解約金	1,590,117,842
未払信託報酬	1,229,826,108
その他未払費用	1,092,078
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>251,387,748,272</b>
元本	59,359,577,651
次期繰越損益金	192,028,170,621
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>59,359,577,651口</b>
1万口当り基準価額 (C / D)	42,350円

\* 期首における元本額は80,967,786,644円、当作成期間中における追加設定元本額は15,574,957,914円、同解約元本額は37,183,166,907円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は42,350円です。

## ■損益の状況

当期 自 2023年10月19日 至 2024年10月18日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>2,918,527,418円</b>
受取利息	59,749,310
その他収益金	2,861,699,679
支払利息	△ 2,921,571
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 5,867,327,053</b>
売買益	11,625,279,680
売買損	△ 17,492,606,733
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>84,161,116,995</b>
取引益	115,526,088,272
取引損	△ 31,364,971,277
<b>(D) 信託報酬等</b>	<b>△ 2,456,759,001</b>
<b>(E) 当期損益金 (A + B + C + D)</b>	<b>78,755,558,359</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>1,735,091,763</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>111,537,520,499</b>
(配当等相当額)	( 50,794,138,610)
(売買損益相当額)	( 60,743,381,889)
<b>(H) 合計 (E + F + G)</b>	<b>192,028,170,621</b>
<b>次期繰越損益金 (H)</b>	<b>192,028,170,621</b>
追加信託差損益金	111,537,520,499
(配当等相当額)	( 50,794,138,610)
(売買損益相当額)	( 60,743,381,889)
分配準備積立金	80,490,650,122

(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：260,444,322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	2,830,329,770円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	71,531,205,444
(c) 収益調整金	111,537,520,499
(d) 分配準備積立金	6,129,114,908
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	192,028,170,621
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	192,028,170,621
(h) 受益権総口数	59,359,577,651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 NASDAQ100）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10月18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10月19日から2024年10月18日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
1219国庫短期証券 2024/6/24	千円 129,997,160		千円
1239国庫短期証券 2024/9/24	69,999,650		
1258国庫短期証券 2024/12/23	53,294,723		
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10月18日現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンド（165,639,041千円）の内容です。

#### (1)国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2024年10月18日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
国債証券	千円 93,300,000	千円 93,259,342	% 56.3	% —	% —	% —	% 56.3

(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入手しています。

#### (2)国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

2024年10月18日現在						
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券	1258国庫短期証券	% —	千円 53,300,000	千円 53,296,130	2024/12/23	
	1231国庫短期証券	% —	40,000,000	39,963,212	2025/05/20	
合 計	銘 柄 数	2銘柄				
	金 額		93,300,000	93,259,342		

(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。

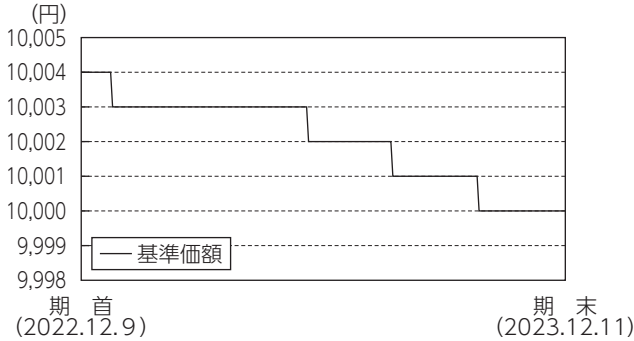
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 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	
	円	%	%
(期首)2022年12月9日	10,004	-	-
12月末	10,004	0.0	-
2023年1月1日	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的・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) 項目ごとと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
	千円	%
コール・ローン等、その他	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/ミレニアセット・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)	
i Freeレバレッジ S & P 500	8,578,400,572円
i Free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
i FreeETF 日経平均レバレッジ・インデックス	3,766,275,979円
i FreeETF 日経平均ダブルインバース・インデックス	7,383,524,817円
i FreeETF TOPIXレバレッジ (2倍) 指数	1,207,970,593円
i FreeETF TOPIXダブルインバース (-2倍) 指数	926,253,680円
i FreeETF 日経平均インバース・インデックス	8,758,653,432円
i FreeETF TOPIXインバース (-1倍) 指数	11,471,375,420円
i FreeETF JPY日経400レバレッジ・インデックス	788,263,236円
i FreeETF JPY日経400インバース・インデックス	114,002,117円
i FreeETF JPY日経400ダブルインバース・インデックス	78,926,070円
i FreeETF S & P 500レバレッジ	556,085,029円
i FreeETF S & P 500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年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ - SL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/ミレニアセット亜細亜株式ファンド	4,148円
通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・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/ミレニアセット・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/ミレニアセット・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/ミレニアセット・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。