

# iFreeNEXT NASDAQ100 インデックス

## 運用報告書（全体版） 第5期

（決算日 2023年8月30日）

（作成対象期間 2022年8月31日～2023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／インデックス型	
信託期間	無期限（設定日：2018年8月31日）	
運用方針	投資成果をNASDAQ100指数（配当込み、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	ベビーファンド	NASDAQ100インデックス・マザーファンドの受益証券
	NASDAQ100インデックス・マザーファンド	イ. 米国の金融商品取引所上場および店頭登録（上場予定および店頭登録予定を含みます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。） ロ. 株価指数先物取引 ハ. 米国株式の指数との連動をめざすETF（上場投資信託証券）
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	
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、米国の株式に投資し、NASDAQ100指数（配当込み、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/>

## 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			NASDAQ100指数 (税引後配当込み、円ベース)		株式組入率 比	株式先物率 比	投資信託 組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
1 期末(2019年 8月30日)	円 9,705	円 0	% △ 3.0	9,734	% △ 2.7	% -	% 5.3	% 94.8	百万円 928
2 期末(2020年 8月31日)	14,944	0	54.0	15,107	55.2	82.7	5.2	13.5	8,779
3 期末(2021年 8月30日)	20,043	0	34.1	20,342	34.7	97.6	1.3	1.3	34,669
4 期末(2022年 8月30日)	20,506	0	2.3	20,890	2.7	95.5	2.5	2.0	52,091
5 期末(2023年 8月30日)	26,685	0	30.1	27,284	30.6	92.8	2.7	4.5	73,988

(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、円ベース) は、NASDAQ100指数 (税引後配当込み、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。

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

(注6) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

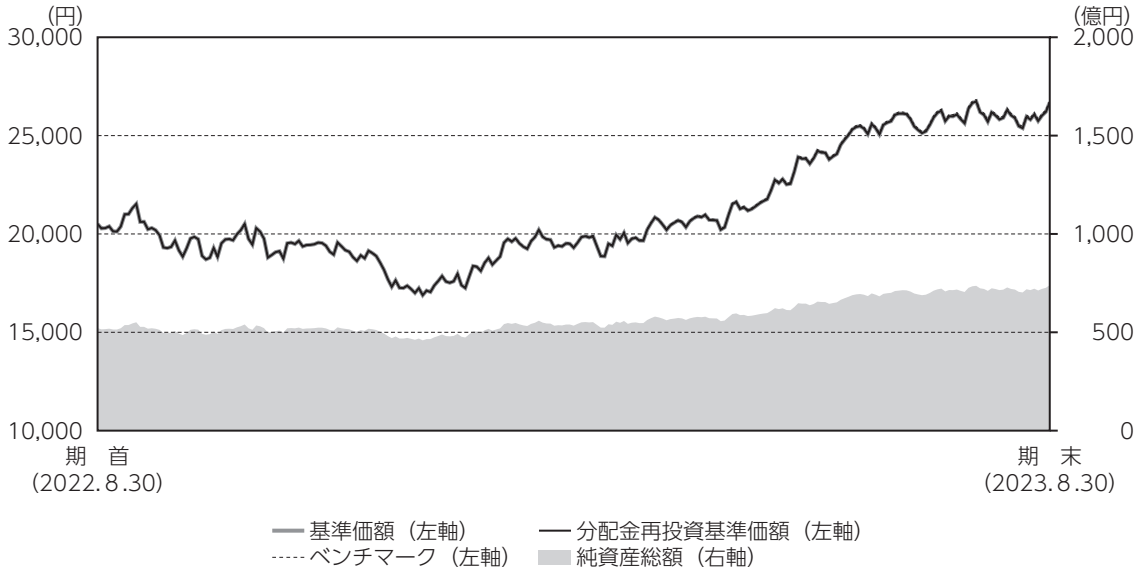
※ベンチマークを「NASDAQ100指数 (円ベース)」から「NASDAQ100指数 (税引後配当込み、円ベース)」に変更しました。

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®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®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NASDAQ100指数（税引後配当込み、円ベース）です。  
 ※ベンチマークを「NASDAQ100指数（円ベース）」から「NASDAQ100指数（税引後配当込み、円ベース）」に変更しました。

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：20,506円

期末：26,685円（分配金0円）

騰落率：30.1%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドの受益証券を通じて、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った結果、米国株式市況が上昇し、為替相場において米ドルが上昇（円安）したことを受けて、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。

## iFreeNEXT NASDAQ100インデックス

年 月 日	基 準 価 額		N A S D A Q 100 指 数 (税引後配当込み、円ベース) (ベンチマーク)		株 式 組 入 率 株 比	株 式 先 物 率 株 比	投 資 組 資 益 入 信 証 比	託 券 率 信 証 比
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
(期首) 2022年 8 月30日	円 20,506	% -	20,890	% -	% 95.5	% 2.5		% 2.0
8 月末	20,282	△ 1.1	20,662	△ 1.1	95.5	2.5		2.1
9 月末	19,168	△ 6.5	19,533	△ 6.5	96.1	2.6		1.3
10月末	20,294	△ 1.0	20,688	△ 1.0	93.9	2.6		3.6
11月末	18,951	△ 7.6	19,323	△ 7.5	92.4	3.0		4.5
12月末	17,241	△15.9	17,586	△15.8	93.9	3.0		3.1
2023年 1 月末	18,440	△10.1	18,814	△ 9.9	92.5	2.9		4.5
2 月末	19,516	△ 4.8	19,916	△ 4.7	92.2	3.1		4.8
3 月末	20,554	0.2	20,982	0.4	95.0	3.1		1.9
4 月末	20,957	2.2	21,401	2.4	96.0	3.1		1.0
5 月末	23,833	16.2	24,344	16.5	95.1	2.6		2.1
6 月末	25,732	25.5	26,293	25.9	94.5	2.6		2.9
7 月末	26,372	28.6	26,958	29.0	93.5	2.7		3.8
(期末) 2023年 8 月30日	26,685	30.1	27,284	30.6	92.8	2.7		4.5

(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

(2022.8.31～2023.8.30)

### ■米国株式市況

米国株式市況は、2022年10月半ばにかけて下落した後、大幅に上昇しました。

米国株式市況は、当作成期首より、米国の予想以上のインフレ率の上昇や英国の財政悪化懸念などで欧米の金利が上昇したこと、さらに企業業績見通しの下方修正が相次いだことなどが嫌気され、2022年10月半ばにかけて下落しました。11月末にかけては、英国市場の混乱が収束して欧米の金利上昇が一服したことや、米国のインフレ率が予想を下回ったことなどが好感されて上昇しましたが、年末にかけては、米国の景況感や企業業績の悪化懸念などから下落しました。2023年に入ると、賃金上昇率の鈍化でF R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げペースが減速するとの期待などから上昇しました。2月から3月半ばにかけては、予想を上回る経済指標の発表が相次ぎ金利が上昇したことや、米国の地方銀行の経営破綻を受けて下落しましたが、その後は、F R Bによる緊急融資枠の新設で資金繰り懸念が後退したことなどが好感され、成長株を中心に上昇に転じました。4月以降は、地方銀行の経営不安や米国の債務上限問題への懸念が上値を抑えた一方、予想を上回る企業決算の発表が好感され、底堅い展開となりました。5月下旬以降は、A I（人工知能）関連で使用される半導体メーカーの強気見通しや債務上限問題の解決、インフレ率の鈍化などが好感されて大幅に上昇しました。8月は、長期金利が上昇したことやF R B高官発言への警戒感が高まったことなどから中旬にかけて下落しましたが、雇用の減速を示す統計の発表を受けて長期金利が低下したことが好感されて反発し、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しました。

米ドル対円為替相場は、当作成期首より、F R B（米国連邦準備制度理事会）が大幅な金融引き締めを決定したのに対し、日銀は金融緩和政策の維持を決定したことで、上昇しました。これを受けて日本政府・日銀は円買い介入を実施しましたが、米国金利が引き続き上昇し、日米金利差が意識されたことで円安米ドル高基調のまま推移しました。2022年11月に入ると、インフレ率の低下期待などから米国金利が低下したことで日米金利差の縮小が意識され、米ドルは下落（円高）に転じました。12月は、日銀が想定外の政策修正を行ったことで金融緩和政策の転換などが意識され、日本の長期金利が大きく上昇するとともに円高米ドル安が進行しました。2023年1月には、日銀が金融緩和政策の維持を決定したことで一時的に米ドルが上昇する局面もありましたが、日米金利差の縮小などにより円高米ドル安基調が継続しました。2月に入り、堅調な米国の経済指標を受けて米国金利が大きく上昇したことで、米ドルは対円で上昇に転じました。3月は、信用不安の拡大により米国金利が大きく低下したことやリスク回避による円買い需要の高まりなどから、下落しました。4月には、米国金利に連れる格好でレンジでの推移となりましたが、月末にかけては、次回のF O M C（米国連邦公開市場委員会）での利上げが意識される展開となり、小幅に上昇しました。その後は、経済指標の上振れなどを背景に米国金利が上昇するに連れて、米ドルは対円で上昇基調を強めました。6月に入ると、F R Bが政策金利見通しを引き上げた一方で、日銀は現状の金融緩和政策の維持を決定したことなどから、月末にかけて米ドルは対円での上昇幅を拡大しました。7月は、日本の政府要人等による円安けん制発言や日銀の政策運営の柔軟化決定を受けて米ドルは対円で下落しました。当作成期末にかけては、米国金利の上昇による日米金利差の拡大が意識され、米ドルは対円で上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

「NASDAQ100インデックス・マザーファンド」の受益証券の組入比率を高位に維持します。

### ■NASDAQ100インデックス・マザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

## ポートフォリオについて

(2022.8.31～2023.8.30)

### ■当ファンド

「NASDAQ100インデックス・マザーファンド」の受益証券の組入比率は、当作成期を通じておおむね100%程度に維持しました。

### ■NASDAQ100インデックス・マザーファンド

米国株式を中心に、E T F（上場投資信託証券）および外国株式先物も一部利用し、株式組入比率（E T F、株式先物を含む。）につきましては、当作成期を通じておおむね100%程度の水準を維持しました。

\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

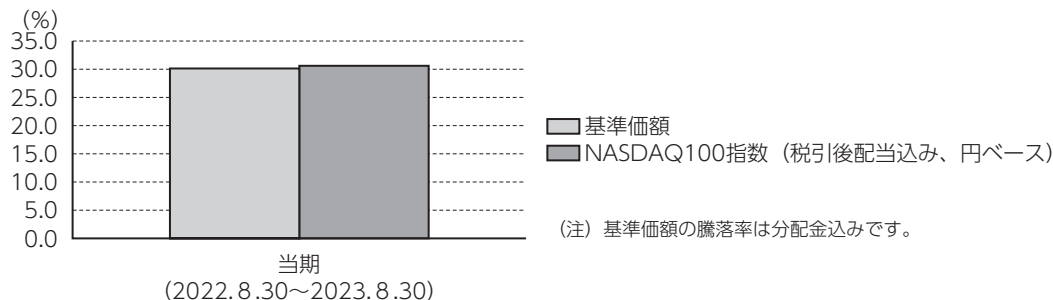
組入ファンド	ベンチマーク
NASDAQ100インデックス・マザーファンド	NASDAQ100指数（税引後配当込み、円ベース）

## 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30.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は30.1%となりました。

現物株式ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、先物取引やE T F（上場投資信託証券）の影響、運用管理費用およびマザーファンドにおける売買委託手数料や保管費用等のコスト負担が、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NASDAQ100指数（税引後配当込み、円ベース）です。

## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、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	
	2022年8月31日 ～2023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）	16,684

（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

「NASDAQ100インデックス・マザーファンド」の受益証券の組入比率を高位に維持します。

### ■NASDAQ100インデックス・マザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2022.8.31~2023.8.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	105円	0.495%	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21,191円です。
(投 信 会 社)	(50)	(0.236)	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)	(50)	(0.236)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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)	(5)	(0.022)	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	1	0.005	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
(株 式)	(1)	(0.004)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.001)	
有 価 証 券 取 引 税	0	0.000	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
(株 式)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
そ の 他 費 用	3	0.016	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)	(0.011)	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)	(1)	(0.004)	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	109	0.516	

(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。

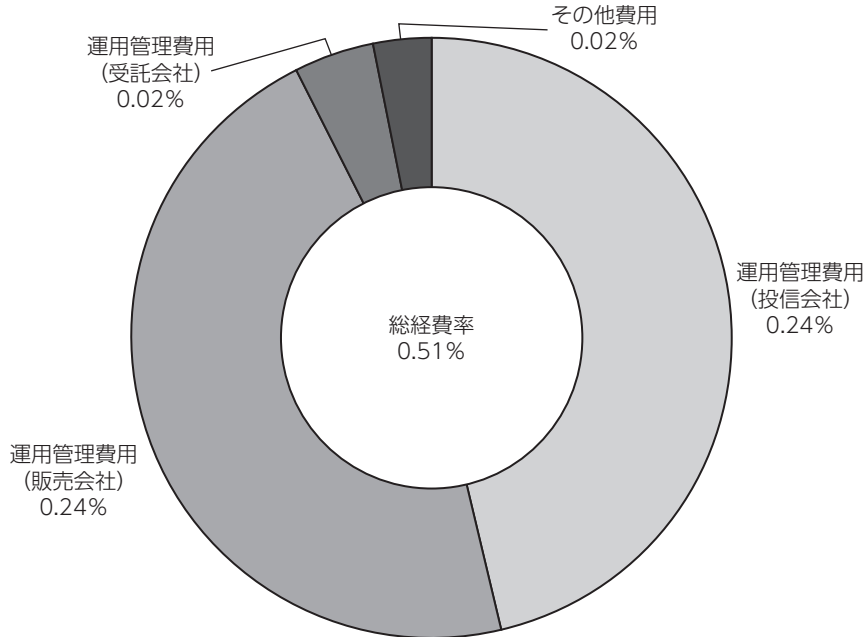
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



## 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0.51%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

(2022年8月31日から2023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
NASDAQ100インデックス・マザーファンド	3,526,239	7,458,551	1,384,702	3,042,541

(注) 単位未満は切捨て。

## ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2022年8月31日から2023年8月30日まで)

項 目	当 期
	NASDAQ100インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	26,929,294千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	53,329,959千円
(c) 売買高比率(a)÷(b)	0.50

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 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
NASDAQ100インデックス・マザーファンド	24,889,516	27,031,053	73,981,290

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2023年8月30日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
NASDAQ100インデックス・マザーファンド	73,981,290	99.6
コール・ローン等、その他	276,972	0.4
投資信託財産総額	74,258,263	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＝146.05円です。

(注3) NASDAQ100インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(72,821,552千円)の投資信託財産総額(74,045,430千円)に対する比率は、98.3%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年8月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	74,258,263,531円
コール・ローン等	276,972,843
NASDAQ100インデックス・マザーファンド(評価額)	73,981,290,688
(B) 負債	269,563,929
未払解約金	110,701,613
未払信託報酬	157,769,881
その他未払費用	1,092,435
(C) 純資産総額(A-B)	73,988,699,602
元本	27,726,784,446
次期繰越損益金	46,261,915,156
(D) 受益権総口数	27,726,784,446口
1万口当り基準価額(C/D)	26,685円

\* 期首における元本額は25,403,418,410円、当作成期間中における追加設定元本額は8,908,455,195円、同解約元本額は6,585,089,159円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は26,685円です。

## ■損益の状況

当期 自2022年8月31日 至2023年8月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 71,662円
受取利息	7,502
支払利息	△ 79,164
(B) 有価証券売買損益	16,823,486,492
売買益	17,894,232,475
売買損	△ 1,070,745,983
(C) 信託報酬等	△ 285,821,091
(D) 当期損益金(A + B + C)	16,537,593,739
(E) 前期繰越損益金	4,060,284,611
(F) 追加信託差損益金	25,664,036,806
(配当等相当額)	( 13,095,576,619)
(売買損益相当額)	( 12,568,460,187)
(G) 合計(D + E + F)	46,261,915,156
次期繰越損益金(G)	46,261,915,156
追加信託差損益金	25,664,036,806
(配当等相当額)	( 13,095,576,619)
(売買損益相当額)	( 12,568,460,187)
分配準備積立金	20,597,950,012
繰越損益金	△ 71,662

(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	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	16,537,636,033
(c) 収益調整金	25,664,036,806
(d) 分配準備積立金	4,060,313,979
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	46,261,986,818
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	46,261,986,818
(h) 受益権総口数	27,726,784,446口

## 《お知らせ》

## ■ベンチマークの変更について

当ファンドおよび当ファンドの主要投資対象である「NASDAQ100インデックス・マザーファンド」のベンチマークとしていた株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。

変更前：NASDAQ100指数（円ベース）

変更後：NASDAQ100指数（配当込み、円ベース）

# NASDAQ100インデックス・マザーファンド

## 運用報告書 第5期（決算日 2023年8月30日）

（作成対象期間 2022年8月31日～2023年8月30日）

NASDAQ100インデックス・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。

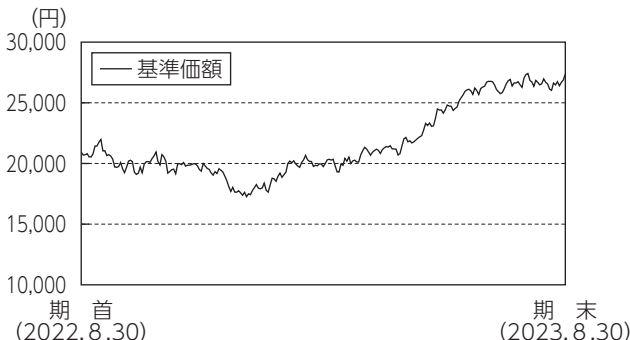
運用方針	投資成果をNASDAQ100指数（配当込み、円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	イ. 米国の金融商品取引所上場および店頭登録（上場予定および店頭登録予定を含みます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。） ロ. 株価指数先物取引 ハ. 米国株式の指数との連動をめざすETF（上場投資信託証券）
株式組入制限	無制限

## 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		NASDAQ100指数 (税引後配当込み、円ベース)		株式 組入比率	株式先物 比率	投資信託 受益証券 組入比率	
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率			%	%
期首2022年8月30日	20,926	-	20,890	-	95.5	2.5	2.0	
8月末	20,698	△ 1.1	20,662	△ 1.1	95.5	2.5	2.1	
9月末	19,569	△ 6.5	19,533	△ 6.5	96.1	2.6	1.3	
10月末	20,728	△ 0.9	20,688	△ 1.0	94.0	2.6	3.6	
11月末	19,364	△ 7.5	19,323	△ 7.5	92.5	3.0	4.5	
12月末	17,624	△ 15.8	17,586	△ 15.8	93.9	3.0	3.1	
2023年1月末	18,858	△ 9.9	18,814	△ 9.9	92.5	2.9	4.5	
2月末	19,966	△ 4.6	19,916	△ 4.7	92.2	3.1	4.8	
3月末	21,037	0.5	20,982	0.4	95.0	3.1	1.9	
4月末	21,457	2.5	21,401	2.4	96.1	3.1	1.0	
5月末	24,413	16.7	24,344	16.5	95.1	2.6	2.1	
6月末	26,370	26.0	26,293	25.9	94.5	2.6	2.9	
7月末	27,037	29.2	26,958	29.0	93.5	2.7	3.8	
期末2023年8月30日	27,369	30.8	27,284	30.6	92.8	2.7	4.5	

- (注1) 騰落率は期首比。  
(注2) NASDAQ100指数(税引後配当込み、円ベース)は、NASDAQ100指数(税引後配当込み、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。  
(注5) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。  
※ベンチマークを「NASDAQ100指数(円ベース)」から「NASDAQ100指数(税引後配当込み、円ベース)」に変更しました。

## 《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：20,926円 期末：27,369円 騰落率：30.8%

## 【基準価額の主な変動要因】

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った結果、米国株式市況が上昇し、為替相場において米ドルが上昇(円安)したことを受けて、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。

## ◆ 投資環境について

## ○ 米国株式市況

米国株式市況は、2022年10月半ばにかけて下落した後、大幅に上昇しました。

米国株式市況は、当作成期首より、米国の予想以上のインフレ率の上昇や英国の財政悪化懸念などで欧米の金利が上昇したこと、さらに企業業績見通しの下方修正が相次いだことなどが嫌気され、2022年10月半ばにかけて下落しました。11月末にかけては、英国市場の混乱が収束して欧米の金利上昇が一服したことや、米国の

インフレ率が予想を下回ったことなどが好感されて上昇しましたが、年末にかけては、米国の景況感や企業業績の悪化懸念などから下落しました。2023年に入ると、賃金上昇率の鈍化でF R B(米国連邦準備制度理事会)の利上げペースが減速するとの期待などから上昇しました。2月から3月半ばにかけては、予想を上回る経済指標の発表が相次ぎ金利が上昇したことや、米国の地方銀行の経営破綻を受けて下落しましたが、その後は、F R Bによる緊急融資枠の新設で資金繰り懸念が後退したことなどが好感され、成長株を中心に上昇に転じました。4月以降は、地方銀行の経営不安や米国の債務上限問題への懸念が上値を抑えた一方、予想を上回る企業決算の発表が好感され、底堅い展開となりました。5月下旬以降は、AI(人工知能)関連で使用される半導体メーカーの強気見通しや債務上限問題の解決、インフレ率の鈍化などが好感されて大幅に上昇しました。8月は、長期金利が上昇したことやF R B高官発言への警戒感が高まったことなどから中旬にかけて下落しましたが、雇用の減速を示す統計の発表を受けて長期金利が低下したことが好感されて反発し、当作成期末を迎えました。

## ○ 為替相場

米ドルが為替相場は対円で上昇しました。

米ドル対円為替相場は、当作成期首より、F R B(米国連邦準備制度理事会)が大幅な金融引き締めを決定したのに対し、日銀は金融緩和と政策の維持を決定したことで、上昇しました。これを受けて日本政府・日銀は円買い介入を実施しましたが、米国金利が引き続き上昇し、日米金利差が意識されることで円安米ドル高基調のまま推移しました。2022年11月に入ると、インフレ率の低下期待などから米金利が低下したことで日米金利差の縮小が意識され、米ドルは下落(円高)に転じました。12月は、日銀が想定外の政策修正を行ったことで金融緩和と政策の転換などが意識され、日本の長期金利が大きく上昇するとともに円高米ドル安が進行しました。2023年1月には、日銀が金融緩和と政策の維持を決定したことで一時的に米ドルが上昇する局面もありましたが、日米金利差の縮小などにより円高米ドル安基調が継続しました。2月に入り、堅調な米国の経済指標を受けて米金利が大きく上昇したことで、米ドルは対円で上昇に転じました。3月は、信用不安の拡大により米金利が大きく低下したことやリスク回避による円買い需要の高まりなどから、下落しました。4月には、米国金利に連れる格好でレンジでの推移となりましたが、月末にかけては、次回のF O M C(米国連邦公開市場委員会)での利上げが意識される展開となり、小幅に上昇しました。その後は、経済指標の上振れなどを背景に米国金利が上昇するに連れて、米ドルは対円で上昇基調を強めました。6月に入ると、F R Bが政策金利見通しを引き上げた一方で、日銀は現状の金融緩和と政策の維持を決定したことなどから、月末にかけて米ドルは対円での上昇幅を拡大しました。7月は、日本の政府要人等による円安けん制発言や日銀の政策運営の柔軟化決定を受けて米ドルは対円で下落しました。当作成期末にかけては、米国金利の上昇による日米金利差の拡大が意識され、米ドルは対円で上昇しました。

## ◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

## ◆ ポートフォリオについて

米国株式を中心に、E T F(上場投資信託証券)および外国株式先物も一部利用し、株式組入比率(E T F、株式先物を含む。)につきましては、当作成期を通じておおむね100%程度の水準を維持しました。

## ◆ 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30.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は30.8%となりました。現物株式ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、先物取引やE T F(上場投資信託証券)の影響、運用管理費用および売買委託手数料や保管費用等のコスト負担が大きい離要因としてあげられます。

\*ベンチマークはNASDAQ100指数(税引後配当込み、円ベース)です。

## 《今後の運用方針》

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

## ■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (株式)	1円 (1)
(先物・オプション)	(0)
(投資信託受益証券)	(0)
有価証券取引税 (株式)	0 (0)
(投資信託受益証券)	(0)
その他費用 (保管費用)	3 (2)
(その他)	(0)
合計	4

(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

## (1) 株 式

(2022年8月31日から2023年8月30日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
外国	百株	千アメリカ・ドル	百株	千アメリカ・ドル
アメリカ	10,859.22 (541.52)	106,923 (-)	5,686.8	86,848

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ( )内は株式分割、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。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

## (2) 投資信託受益証券

(2022年8月31日から2023年8月30日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	192.372 (-)	59,872 (-)	156.029 (-)	47,233 (-)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付( )内は分割割当、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。

(注3) 売付( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

## (3) 先物取引の種類別取引状況

(2022年8月31日から2023年8月30日まで)

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	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	6,830	6,556	-	-

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■ 主要な売買銘柄

## (1) 株 式

(2022年8月31日から2023年8月30日まで)

当				期					
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
MICROSOFT CORP (アメリカ)		39,768	1,333,939	33,543	MICROSOFT CORP (アメリカ)		45,525	2,193,362	48,179
AMAZON.COM INC (アメリカ)		58,647	736,357	12,555	NVIDIA CORP (アメリカ)		33,267	2,060,092	61,926
BROADCOM INC (アメリカ)		4,459	515,957	115,711	AMAZON.COM INC (アメリカ)		63,845	1,156,271	18,110
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)		34,546	429,222	12,424	APPLE INC (アメリカ)		34.51	816,736	23,666
TESLA INC (アメリカ)		18,772	426,614	22,726	TESLA INC (アメリカ)		19,721	702,488	35,621
PEPSICO INC (アメリカ)		13.82	362,338	26,218	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)		39,889	676,170	16,951
COSTCO WHOLESALE CORP (アメリカ)		4,494	343,844	76,511	ALPHABET INC-CL C (アメリカ)		38,609	658,290	17,050
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)		27,306	336,458	12,321	META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)		13,984	569,298	40,710
APPLE INC (アメリカ)		15,478	326,518	21,095	FISERV INC (アメリカ)		20,999	343,289	16,347
NVIDIA CORP (アメリカ)		11,907	302,889	25,437	ACTIVISION BLIZZARD INC (アメリカ)		26,108	327,037	12,526

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

## (2) 投資信託受益証券

(2022年8月31日から2023年8月30日まで)

当					期				
買			付		売			付	
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	柄	口数	金額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
INVESCO QQQ TRUST SERIES 1 (アメリカ)		192,372	8,404,810	43,690	INVESCO QQQ TRUST SERIES 1 (アメリカ)		156,029	6,459,712	41,400

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

## (1) 外国株式

銘柄	期首		当期		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	千アメリカ・ドル	千円	
PALO ALTO NETWORKS INC	31.09	119.03	2,784	406,654	情報技術
VERISK ANALYTICS INC	49.28	56.35	1,347	196,810	資本財・サービス
ADOBE INC	147.46	178.51	9,649	1,409,340	情報技術
LULULEMON ATHLETICA INC	38.33	47.56	1,782	260,292	一般消費・サービス
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	212.44	259.06	4,909	717,062	資本財・サービス
DOLLAR TREE INC	70.08	85.77	1,055	154,203	生活必需品
AUTODESK INC	67.89	83.34	1,828	267,049	情報技術
AUTOMATIC DATA PROCESSING	130.37	160.77	4,089	597,225	資本財・サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	160.27	200.34	1,595	232,994	公益事業
APPLE INC	3,044.48	2,854.16	52,550	7,675,043	情報技術
ANSYS INC	27.15	33.73	1,059	154,788	情報技術
CADENCE DESIGN SYS INC	86.06	106.12	2,523	368,546	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,292.3	1,585.87	8,969	1,310,021	情報技術
BROADCOM INC	127.41	162.25	14,439	2,108,832	情報技術
SPLUNK INC	50.21	—	—	—	情報技術
MONSTER BEVERAGE CORP	165.3	407.34	2,382	347,968	生活必需品
ASML HOLDING NV-NY REG SHS	26.73	34.16	2,280	333,025	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	138.32	172.59	9,367	1,368,147	生活必需品
ACTIVISION BLIZZARD INC	244.01	—	—	—	情報技術
COSTAR GROUP INC	—	158.99	1,309	191,267	不動産
OLD DOMINION FREIGHT LINE	35.38	42.67	1,825	266,602	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	15.72	19.54	2,549	372,326	一般消費・サービス
DEXCOM INC	122.49	150.85	1,517	221,594	ヘルスケア
COPART INC	74.17	371.6	1,653	241,511	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	70.48	1,065	155,628	エネルギー
BAIDU INC - SPON ADR	67.45	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SEAGEN INC	57.45	72.97	1,510	220,562	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	24.59	29.78	1,094	159,891	ヘルスケア
T-MOBILE US INC	391.21	466.96	6,385	932,560	コミュニケーション・サービス
CSX CORP	678.54	791.2	2,432	355,330	資本財・サービス
AMAZON.COM INC	1,913.84	1,861.86	25,118	3,668,535	一般消費・サービス
FORTINET INC	250.48	305.57	1,852	270,582	情報技術
FASTENAL CO	179.63	222.23	1,278	186,755	資本財・サービス
FISERV INC	201.72	—	—	—	金融
ALPHABET INC-CL A	1,131.49	1,078.06	14,507	2,118,813	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	1,178.94	1,065.91	14,442	2,109,256	コミュニケーション・サービス
NXP SEMICONDUCTORS NV	81.94	101.08	2,073	302,872	情報技術
KRAFT HEINZ CO/THE	382	477.6	1,612	235,487	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	—	53.33	688	100,515	情報技術
KLA CORP	46.57	53.39	2,658	388,227	情報技術
LAM RESEARCH CORP	43.29	52.28	3,579	522,764	情報技術

銘柄	期首		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
META PLATFORMS INC CLASS A	646	562.68	16,767	2,448,864	コミュニケーション・サービス
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	44.62	59.11	1,175	171,710	情報技術
MARVELL TECHNOLOGY INC	265.23	334.68	1,878	274,314	情報技術
BAKER HUGHES CO	—	393.98	1,422	207,722	エネルギー
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	102.14	118.6	2,444	357,083	一般消費・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	62.1	80.17	1,937	282,967	情報技術
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	173.05	212.24	1,739	254,087	情報技術
OKTA INC	47.04	—	—	—	情報技術
JD.COM INC-ADR	158.15	176.68	609	89,024	一般消費・サービス
PAYCHEX INC	112.67	140.3	1,711	249,946	資本財・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	20.51	23.69	2,242	327,523	一般消費・サービス
XCEL ENERGY INC	169.97	214.18	1,241	181,273	公益事業
PINDUODUO INC-ADR	138.32	237.63	2,215	323,528	一般消費・サービス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	78.55	97.63	671	98,115	情報技術
EXELON CORP	305.9	387.05	1,567	228,941	公益事業
DOCUSIGN INC	62.39	—	—	—	情報技術
PEPSICO INC	431.5	536.15	9,700	1,416,767	生活必需品
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	66.58	87.22	1,279	186,873	情報技術
ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR	180.34	230.35	1,592	232,605	ヘルスケア
QUALCOMM INC	349.53	433.53	4,932	720,421	情報技術
DATADOG INC - CLASS A	88.35	115.3	1,081	157,971	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	33.71	41.99	3,485	509,125	ヘルスケア
BOOKING HOLDINGS INC	12.68	14.37	4,470	652,888	一般消費・サービス
ROOST STORES INC	109.66	133.11	1,610	235,271	一般消費・サービス
MODERNA INC	124.13	148.35	1,720	251,309	ヘルスケア
TRADE DESK INC/THE-CLASS A	—	173.11	1,364	199,227	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	89.13	—	—	—	コミュニケーション・サービス
ZSCALER INC	44.03	56.48	815	119,105	情報技術
TESLA INC	584.63	575.14	14,791	2,160,291	一般消費・サービス
SYNOPSYS INC	47.74	59.22	2,674	390,566	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	52.38	58.6	2,643	386,075	コミュニケーション・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	119.29	160.49	2,122	309,988	一般消費・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	—	168.07	1,640	239,599	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	287.78	353.23	6,029	880,576	情報技術
VERISIGN INC	34.19	—	—	—	情報技術
LUCID GROUP INC	520.49	884.43	559	81,765	一般消費・サービス
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	269.56	335.77	857	125,246	生活必需品
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	101.89	126.25	1,332	194,603	公益事業
W A R N E R B R O S . DISCOVERY INC SERIES	—	948.05	1,227	179,309	コミュニケーション・サービス
GLOBALFOUNDRIES INC	—	213.17	1,162	169,770	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
NVIDIA CORP	661.81	448.21	21,865	3,193,452	情報技術
NETFLIX INC	138.65	173	7,438	1,086,440	コミュニケーション・サービス
NETEASE INC-ADR	56.69	-	-	-	コミュニケーション・サービス
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	-	176.94	1,247	182,135	ヘルスケア
ANALOG DEVICES INC	162.22	195.13	3,562	520,272	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	505.72	626.7	6,638	969,480	情報技術
SKYWORKS SOLUTIONS INC	50.22	-	-	-	情報技術
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	162.65	197.49	1,410	205,941	情報技術
AMGEN INC	166.71	207.94	5,398	788,517	ヘルスケア
APPLIED MATERIALS INC	271.49	326.8	4,901	715,841	情報技術
GILEAD SCIENCES INC	391.44	485.43	3,796	554,485	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	442.7	546.3	1,851	270,478	生活必需品
INTEL CORP	1,276.08	1,623.21	5,569	813,386	情報技術
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,228.37	1,505.45	644	94,104	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	49.03	61.53	996	145,517	ヘルスケア
INTUITIVE SURGICAL INC	112.02	136.36	4,232	618,153	ヘルスケア
CINTAS CORP	31.93	39.58	1,988	290,385	資本財・サービス
MICROSOFT CORP	1,406.83	1,349.26	44,311	6,471,628	情報技術
MICRON TECHNOLOGY INC	348.49	425.9	2,839	414,767	情報技術
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	431.89	529.99	3,788	553,291	生活必需品
EBAY INC	174.71	208.1	922	134,701	一般消費・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	361.4	434.2	2,713	396,343	金融
PACCAR INC	108.5	203.37	1,685	246,112	資本財・サービス
BIOGEN INC	45.7	56.33	1,509	220,483	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	26.22	32.3	1,652	241,291	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	357.92	446.14	4,423	646,048	資本財・サービス
INTUIT INC	88.03	108.99	5,847	853,984	情報技術
ELECTRONIC ARTS INC	87.35	106.13	1,283	187,491	コミュニケーション・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	79.82	100.23	3,520	514,195	ヘルスケア
COMCAST CORP-CLASS A	1,395.16	1,618.69	7,572	1,105,924	コミュニケーション・サービス
ファンド合計	株数、金額 総銘柄数<比率>	29,540.06 102銘柄	35,254 101銘柄	470,102 68,658,416 <92.8%>	-----

(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中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。

## (2) 外国投資信託受益証券

銘柄	期首		期末		業種等
	口数	口数	評価額	評価額	
(アメリカ)					
INVESCO QQQ TRUST SERIES 1	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	
	24.71	61.053	22,880	3,341,745	
合計	口数、金額 銘柄数<比率>	24.71 1銘柄	61.053 1銘柄	22,880 3,341,745 <4.5%>	

(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中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。

## (3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	期末	
	買建額	売建額
NASDAQ 100 E-MINI(アメリカ)	百万円 1,981	百万円 -

(注1) 外貨建の評価額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の中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) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2023年8月30日現在

項目	期末	
	評価額	比率
株式	千円 68,658,416	% 92.7
投資信託受益証券	3,341,745	4.5
コール・ローン等、その他	2,045,268	2.8
投資信託財産総額	74,045,430	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中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=146.05円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(72,821,552千円)の投資信託財産総額(74,045,430千円)に対する比率は、98.3%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年8月30日現在

項目	期末
(A) 資産	75,168,838,680円
コール・ローン等	1,215,933,782
株式(評価額)	68,658,416,452
投資信託受益証券(評価額)	3,341,745,632
未収入金	1,208,441,769
未収配当金	41,700,590
差入委託証拠金	702,600,455
(B) 負債	1,187,221,458
未払金	1,187,221,458
(C) 純資産総額(A-B)	73,981,617,222
元本	27,031,053,633
次期繰越損益金	46,950,563,589
(D) 受益権総口数	27,031,053,633口
1万口当り基準価額(C/D)	27,369円

\*期首における元本額は24,889,516,374円、当作成期間中における追加設定元本額は3,526,239,967円、同解約元本額は1,384,702,708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：iFreeNEXT NASDAQ100インデックス 27,031,053,633円

\*当期末の計算口数当りの純資産額は27,369円です。



## ■損益の状況

当期 自2022年8月31日 至2023年8月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	478,172,293円
受取配当金	454,574,662
受取利息	8,713,565
その他収益金	15,295,102
支払利息	△ 411,036
(B) 有価証券売買損益	16,664,012,016
売買益	18,509,791,747
売買損	△ 1,845,779,731
(C) 先物取引等損益	346,359,372
取引益	474,327,396
取引損	△ 127,968,024
(D) その他費用	△ 6,788,018
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	17,481,755,663
(F) 前期繰越損益金	27,194,335,499
(G) 解約差損益金	△ 1,657,839,062
(H) 追加信託差損益金	3,932,311,489
(I) 合計(E + F + G + H)	46,950,563,589
次期繰越損益金(I)	46,950,563,589

(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。

## 《お知らせ》

## ■ベンチマークの変更について

ベンチマークとしている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。

変更前：NASDAQ100指数（円ベース）

変更後：NASDAQ100指数（配当込み、円ベース）

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の一般的な株式市場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®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請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®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なくても、何らの責任も負いません。