

iFreeNEXT NASDAQ100 インデックス

運用報告書（全体版） 第1期

（決算日 2019年8月30日）

（作成対象期間 2018年8月31日～2019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	
運用方針	投資成果をNASDAQ100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	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（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。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
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 (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	9,661	% △3.4	% -	% 5.3	% 94.8	百万円 928

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) NASDAQ100指数(円ベース)は、NASDAQ100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として大和投資信託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まず。

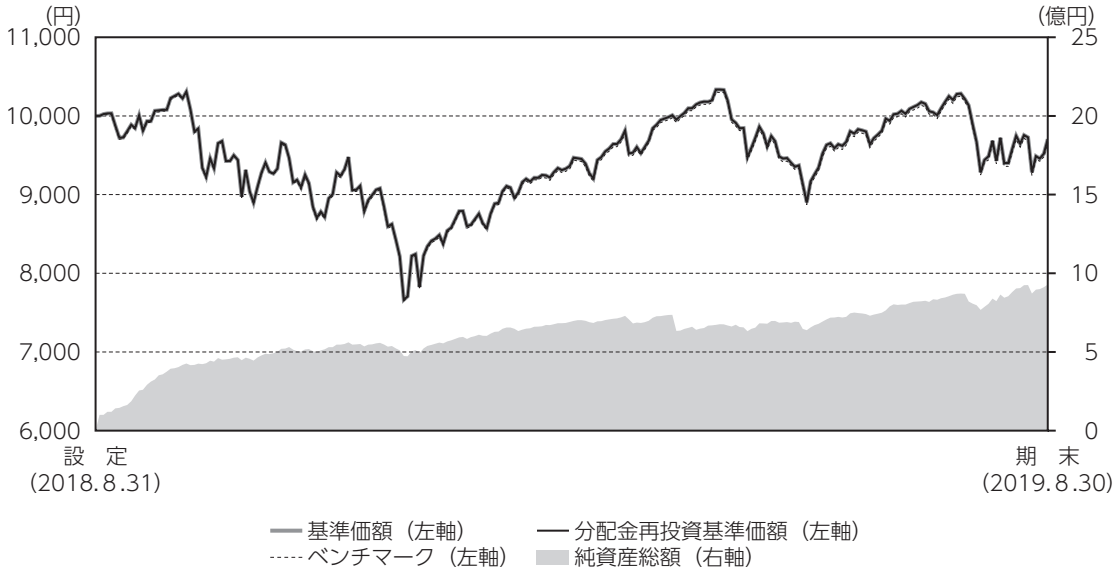
(注6) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

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ないません。株式会社と大和証券投資信託委託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、大和証券投資信託委託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、大和証券投資信託委託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り、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、大和証券投資信託委託株式会社、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®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) ベンチマークは、設定時を10,000として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（円ベース）です。

■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期末：9,705円（分配金0円）

騰落率：△3.0%（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（NASDAQ100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った結果、米国株式市況が上昇した一方で、為替相場が円高米ドル安となったことから、基準価額は下落しました。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		NASDAQ 100 指 数 (円 ベ (ベンチマーク)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期首) 2018年 8 月31日	円 10,000	% -	10,000	% -	% -	% -	% -
8 月末	10,001	0.0	10,000	0.0	-	-	-
9 月末	10,226	2.3	10,208	2.1	-	8.8	91.6
10月末	9,102	△ 9.0	9,087	△ 9.1	-	3.3	97.5
11月末	9,239	△ 7.6	9,214	△ 7.9	-	5.7	94.1
12月末	8,244	△17.6	8,223	△17.8	-	5.5	95.8
2019年 1 月末	8,757	△12.4	8,739	△12.6	-	4.8	95.6
2 月末	9,329	△ 6.7	9,296	△ 7.0	-	4.6	95.9
3 月末	9,604	△ 4.0	9,572	△ 4.3	-	4.7	95.6
4 月末	10,331	3.3	10,301	3.0	-	5.2	95.0
5 月末	9,372	△ 6.3	9,335	△ 6.6	-	4.6	91.5
6 月末	9,762	△ 2.4	9,724	△ 2.8	-	4.5	95.8
7 月末	10,216	2.2	10,179	1.8	-	4.0	91.1
(期末) 2019年 8 月30日	9,705	△ 3.0	9,661	△ 3.4	-	5.3	94.8

(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

(2018.8.31～2019.8.30)

■米国株式市況

米国株式市況は上昇しました。

当作成期首より、米中貿易摩擦への懸念や景気減速観測の台頭を受けて、株価は大きく下落しました。2019年1月以降は、米中通商協議の進展への期待やF R B（米国連邦準備制度理事会）の利下げ期待が高まったことから株価は上昇に転じ、2019年4月には、米国の主要な株価指数は過去最高値を更新しました。その後も、米中貿易摩擦懸念の再燃から株価が落ち込む場面も見られましたが、当作成期末にかけては、米国企業の2019年4－6月期決算発表の内容が総じて良好だったことなどを好感して、上昇基調となりました。

■為替相場

為替相場は円高米ドル安となりました。

当作成期首より、米国の堅調な経済情勢などを受けて円安米ドル高となったものの、その後は世界経済に対する懸念の高まりを受けて、株式市場が下落するなどのリスク回避的な動きから円高が進行しました。2019年1月以降は、米国における経済指標がおおむね良好な内容であったことが円安要因となりましたが、当作成期末にかけては、米中对立の激化を受けた逃避的な円買いや利下げ期待の高まりによって米国金利が低下したことで日米金利差の縮小を受けて、米ドルは円に対して再度下落しました。

ポートフォリオについて

(2018.8.31～2019.8.30)

■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

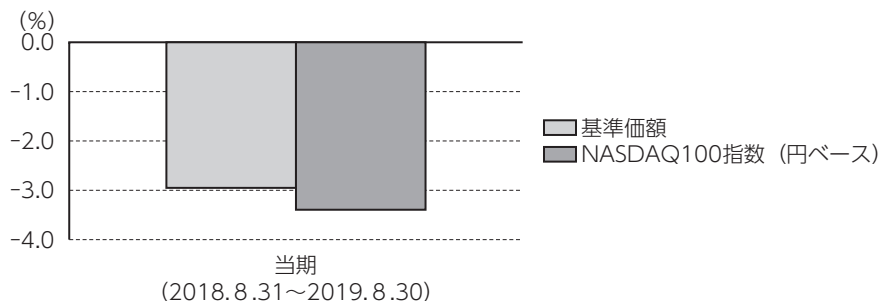
E T F（上場投資信託証券）および外国株式指数先物取引も一部利用し、株式組入比率（E T F、株式先物を含む。）は、当作成期を通じておおむね100%程度の水準を維持しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は△3.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△3.0%となりました。

マザーファンドが組み入れているETFに配当金が計上されたのに対し、ベンチマークは配当分が含まれていないため、かい離要因となりました。また、マザーファンドで組み入れているETFの原資産がベンチマークと異なっていることが、かい離要因となりました。その他、信託報酬、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。



分配金について

当作成期は、基準価額の水準等を勘案し、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	
	2018年8月31日	～2019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)	69	

(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。



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、「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

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマーク（NASDAQ100（円ベース））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 (2018.8.31~2019.8.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	46円	0.486%	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9,478円です。
(投 信 会 社)	(22)	(0.232)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(22)	(0.232)	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 銀 行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、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	2	0.017	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)	(0)	(0.002)	
(投資信託受益証券)	(1)	(0.015)	
有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	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
(投資信託受益証券)	(0)	(0.001)	
そ の 他 費 用	5	0.051	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)	(4)	(0.041)	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)	(0.005)	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)	(0.005)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	53	0.554	

(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。

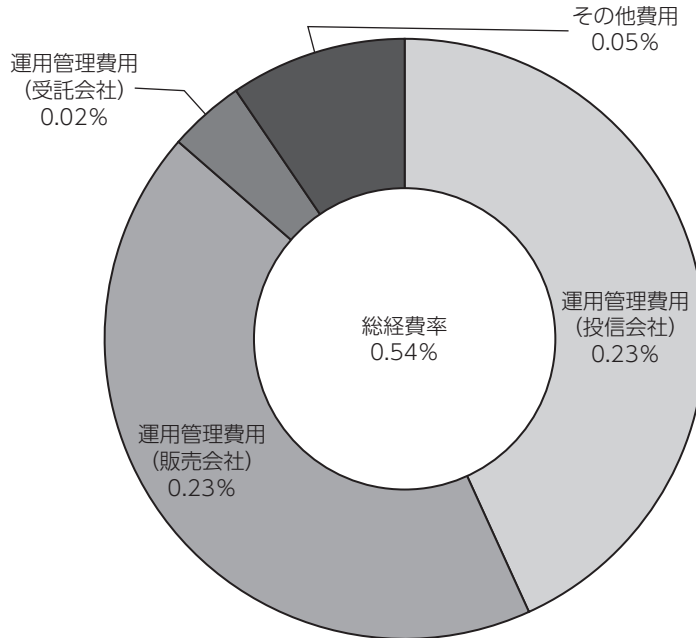
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.54%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

(2018年8月31日から2019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	1,318,964	1,271,546	367,281	356,790

(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。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首保有額	当作成期中設定額	当作成期中解約額	当作成期末保有額	取 引 の 理 由
百万円	百万円	百万円	百万円	当初設定時における取得とその処分
100	—	100	—	

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満切捨。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	□ 数	評 価 額
	千口	千円
NASDAQ100インデックス・マザーファンド	951,682	927,890

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019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	927,890	99.2
コール・ローン等、その他	7,867	0.8
投資信託財産総額	935,758	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=106.46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（892,108千円）の投資信託財産総額（930,580千円）に対する比率は、95.9%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年8月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	935,758,296円
コール・ローン等	7,127,438
NASDAQ100インデックス・マザーファンド(評価額)	927,890,858
未収入金	740,000
(B) 負債	7,660,304
未払解約金	5,836,682
未払信託報酬	1,803,682
その他未払費用	19,940
(C) 純資産総額(A - B)	928,097,992
元本	956,349,410
次期繰越損益金	△ 28,251,418
(D) 受益権総口数	956,349,410口
1万円当り基準価額(C/D)	9,705円

*期首における元本額は100,000,000円、当作成期間中における追加設定元本額は1,795,211,754円、同解約元本額は938,862,344円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は9,705円です。

*当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は28,251,418円です。

■損益の状況

当期 自2018年8月31日 至2019年8月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,876円
受取利息	1,249
支払利息	△ 3,125
(B) 有価証券売買損益	9,693,026
売買益	38,845,066
売買損	△29,152,040
(C) 信託報酬等	△ 3,008,586
(D) 当期損益金(A + B + C)	6,682,564
(E) 追加信託差損益金	△34,933,982
(配当等相当額)	(△ 2,743)
(売買損益相当額)	(△34,931,239)
(F) 合計(D + E)	△28,251,418
次期繰越損益金(F)	△28,251,418
追加信託差損益金	△34,933,982
(配当等相当額)	(△ 2,743)
(売買損益相当額)	(△34,931,239)
分配準備積立金	6,684,440
繰越損益金	△ 1,876

- (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	6,684,440
(c) 収益調整金	0
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	6,684,440
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	6,684,440
(h) 受益権総口数	956,349,410口

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

NASDAQ100インデックス・マザーファンド

運用報告書 第1期（決算日 2019年8月30日）

（作成対象期間 2018年8月31日～2019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。

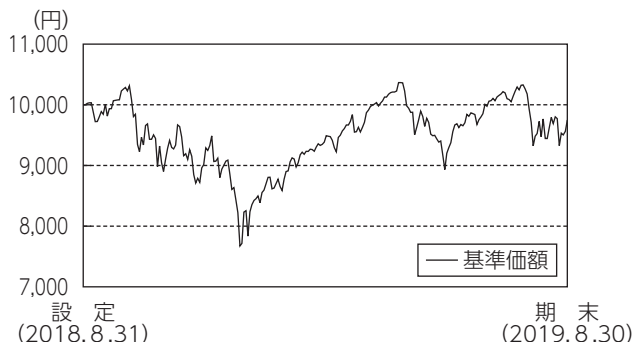
運用方針	投資成果をNASDAQ100指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	イ. 米国の金融商品取引所上場および店頭登録（上場予定および店頭登録予定を含みます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。） ロ. 株価指数先物取引 ハ. 米国株式の指数との連動をめざすETF（上場投資信託証券）
株式組入制限	無制限

大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
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 (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
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首)2018年8月31日	円	%	円	%	%	%	%
	10,000	-	10,000	-	-	-	-
8月末	10,001	0.0	10,000	0.0	-	-	-
9月末	10,229	2.3	10,208	2.1	-	8.8	91.7
10月末	9,107	△ 8.9	9,087	△ 9.1	-	3.3	97.6
11月末	9,248	△ 7.5	9,214	△ 7.9	-	5.7	94.1
12月末	8,255	△17.5	8,223	△17.8	-	5.5	95.9
2019年1月末	8,772	△12.3	8,739	△12.6	-	4.8	95.6
2月末	9,349	△ 6.5	9,296	△ 7.0	-	4.6	96.0
3月末	9,629	△ 3.7	9,572	△ 4.3	-	4.7	95.7
4月末	10,362	3.6	10,301	3.0	-	5.2	95.0
5月末	9,404	△ 6.0	9,335	△ 6.6	-	4.6	91.5
6月末	9,799	△ 2.0	9,724	△ 2.8	-	4.5	95.8
7月末	10,260	2.6	10,179	1.8	-	4.0	91.2
(期末)2019年8月30日	9,750	△ 2.5	9,661	△ 3.4	-	5.3	94.8

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) NASDAQ100指数 (円ベース) は、NASDAQ100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として大和投資信託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。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

設定時：10,000円 期末：9,750円 騰落率：△2.5%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク (NASDAQ100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った結果、米国株式市況が上昇した一方で、為替相場が円高米ドル安となったことから、基準価額は下落しました。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

米国株式市況は上昇しました。

当作成期首より、米中貿易摩擦への懸念や景気減速観測の台頭を受けて、株価は大きく下落しました。2019年1月以降は、米中通商協議の進展への期待やFRB (米連邦準備制度理事会) の利下げ期待が高まったことから株価は上昇に転じ、2019年4月には、米国の主要な株価指数は過去最高値を更新しました。その後も、米中貿易摩擦懸念の再燃から株価が落ち込む場面も見られましたが、当作成期末にかけては、米国企業の2019年4 - 6月期決算発表の内容が総じて良好だったことなどを好感して、上昇基調となりました。

○為替相場

為替相場は円高米ドル安となりました。

当作成期首より、米国の堅調な経済情勢などを受けて円安米ドル高となったものの、その後は世界経済に対する懸念の高まりを受けて、株式市場が下落するなどのリスク回避的な動きから円高が進行しました。2019年1月以降は、米国における経済指標がおおむね良好な内容であったことが円安要因となりましたが、当作成期末にかけては、米中対立の激化を受けた逃避的な円買いや利下げ期待の高まりによって米国金利が低下したことで日米金利差の縮小を受けて、米ドルは円に対して再度下落しました。

◆ポートフォリオについて

ETF (上場投資信託証券) および外国株式指数先物取引も一部利用し、株式組入比率 (ETF、株式先物を含む) 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

ベンチマークの騰落率は△3.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△2.5%となりました。

組み入れているETFに配当金が計上されたのに対し、ベンチマークは配当分が含まれていないため、かい離要因となりました。また、ファンドで組み入れているETFの原資産がベンチマークと異なっていることが、かい離要因となりました。その他、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。

《今後の運用方針》

当ファンドの運用方針に基づき、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 (先物・オプション) (投資信託受益証券)	2円 (0) (1)
有価証券取引税 (投資信託受益証券)	0 (0)
その他費用 (保管費用) (その他)	4 (4) (0)
合計	6

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の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) 投資信託受益証券

(2018年8月31日から2019年8月30日まで)

	買 付		売 付	
	口数	金額	口数	金額
外国 アメリカ	千口 62.53 (-)	千アメリカ・ドル 11,196 (-)	千口 18.55 (-)	千アメリカ・ドル 3,339 (-)

(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。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2018年8月31日から2019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 株式先物取引	百万円 442	百万円 389	百万円 -	百万円 -

(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
投資信託受益証券

(2018年8月31日から2019年8月30日まで)

当 期				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
INVESCO QQQ TRUST SERIES 1 (アメリカ)		千口 62.53	千円 1,243,471	円 19,886	INVESCO QQQ TRUST SERIES 1 (アメリカ)		千口 18.55	千円 369,799	円 19,935

(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) 外国投資信託受益証券

銘 柄	当 期 末			
	口 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円	
INVESCO QQQ TRUST SERIES 1	43.98	8,264	879,862	
合 計	口数、金額	43.98	8,264	879,862
	銘柄数<比率>	1銘柄		<94.8%>

(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。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国 NASDAQ 100 E-MINI(アメリカ)	百万円 49	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) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年8月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	879,862	94.5
コール・ローン等、その他	50,718	5.5
投資信託財産総額	930,580	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＝106.46円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(892,108千円)の投資信託財産総額(930,580千円)に対する比率は、95.9%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年8月30日現在

項 目	当 期 末	
	当	末
(A) 資産	967,028,346円	
コール・ローン等	37,304,238	
投資信託受益証券(評価額)	879,862,262	
未収入金	37,804,064	
差入委託証拠金	12,057,782	
(B) 負債	39,155,581	
未払金	38,415,581	
未払解約金	740,000	
(C) 純資産総額(A-B)	927,872,765	
元本	951,682,932	
次期繰越損益金	△ 23,810,167	
(D) 受益権総口数	951,682,932口	
1万口当り基準価額(C/D)	9,750円	

* 期首における元本額は99,980,000円、当作成期間中における追加設定元本額は1,218,984,110円、同解約元本額は367,281,178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は、iFreeNEXT NASDAQ100インデックス951,682,932円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,750円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は23,810,167円です。

■損益の状況

当期 自2018年8月31日 至2019年8月30日

項 目	当 期	
	当	期
(A) 配当等収益	4,198,163円	
受取配当金	4,057,882	
受取利息	44,521	
その他収益金	108,794	
支払利息	△ 13,034	
(B) 有価証券売買損益	10,188,001	
売買益	52,647,517	
売買損	△42,459,516	
(C) 先物取引等損益	△ 993,059	
取引益	5,212,920	
取引損	△ 6,205,979	
(D) その他費用	△ 276,340	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	13,116,765	
(F) 解約差損益金	10,491,178	
(G) 追加信託差損益金	△47,418,110	
(H) 合計(E+F+G)	△23,810,167	
次期繰越損益金(H)	△23,810,167	

(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。

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随可能性について、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。株式会社と大和証券投資信託委託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との一定の商号について使用を許諾すること、ならびに、大和証券投資信託委託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、大和証券投資信託委託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り、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、大和証券投資信託委託株式会社、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たとしても、何らの責任も負いません。