

# auAMレバレッジ NASDAQ100

追加型投信／海外／株式／  
特殊型(ブル・ベア型)



※ファンド名称のauAMはauアセットマネジメントの略称です。

## auAMレバレッジ NASDAQ100

第1期(決算日 2023年7月27日)

(作成対象期間 2022年7月28日～2023年7月27日)

### 受益者の皆様へ

平素より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、auAM レバレッジ NASDAQ100マザーファンドの受益証券を高位に組み入れることにより、日々の基準価額の値動きがNASDAQ100指数(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。

## auAMレバレッジ NASDAQ100

第1期末(2023年7月27日)		第1期	
基準価額	12,723円	騰落率	27.2%
純資産総額	8,919百万円	分配金合計	0円

(注)騰落率は分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

当ファンドは、信託約款において「運用報告書(全体版)」に記載すべき事項を電磁的方法によりご提供することを定めており、以下の手順で閲覧、ダウンロードいただけます。「運用報告書(全体版)」は受益者の方からのご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社へお問い合わせください。

### 「運用報告書(全体版)」の閲覧・ダウンロード方法

右記のURLにアクセス⇒「ファンド情報」を選択⇒「商品名」から当ファンドを選択⇒「運用報告書(全体版)」を選択

## auアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区西神田三丁目2番1号



ホームページ

<https://www.kddi-am.com/>

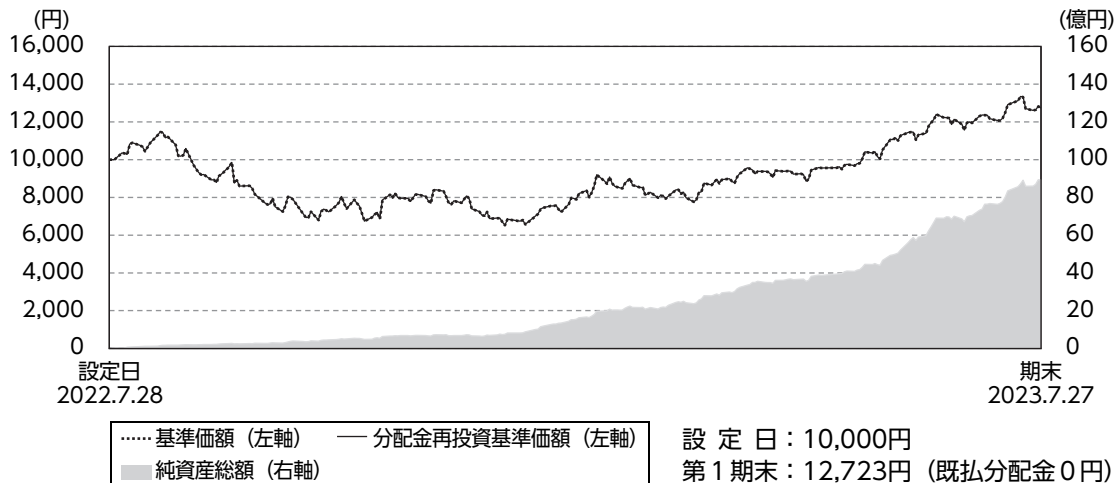


お問い合わせ先 03-5657-7185

(受付時間 営業日の午前9時～午後5時)

## ■運用経過

### □基準価額等の推移について



(注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)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。

(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額などにより課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

### □基準価額の主な変動要因

auAM レバレッジ NASDAQ100マザーファンドの受益証券を高位に組み入れることにより、日々の基準価額の値動きがNASDAQ100指数(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、当期の基準価額・分配金再投資基準価額は27.2%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。

## □ 1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2022.7.28~2023.7.27)		項目の概要
	金額(円)	比率(%)	
運用管理費用 (信託報酬)	40円	0.433%	運用管理費用(信託報酬) = 当期中の平均基準価額 × 信託報酬率 <b>当期中の平均基準価額は9,182円です。</b> 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 受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(19)	(0.203)	
(販売会社)	(19)	(0.203)	
(受託銀行)	(3)	(0.027)	
売買委託手数料	3	0.033	売買委託手数料 = 当期中の売買委託手数料 / 当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)	(3)	(0.033)	
有価証券取引税	-	-	有価証券取引税 = 当期中の有価証券取引税 / 当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	7	0.077	その他費用 = 当期中のその他費用 / 当期中の平均受益権口数 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 信託事務の処理等に関するその他の費用
(監査費用)	(1)	(0.011)	
(その他)	(6)	(0.066)	
合計	50	0.544	

(注1) 当期中の費用(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。

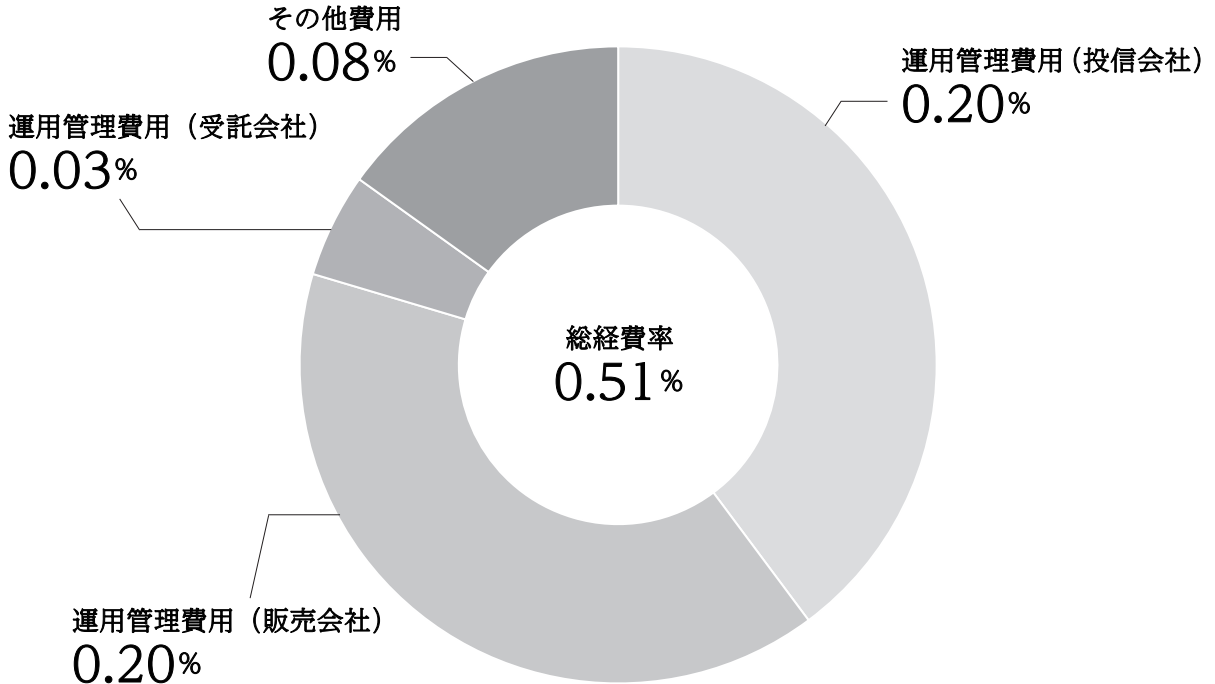
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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。当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入ファンドの概要」に表示しております。

## (参考情報)

## ■総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.51%です。**

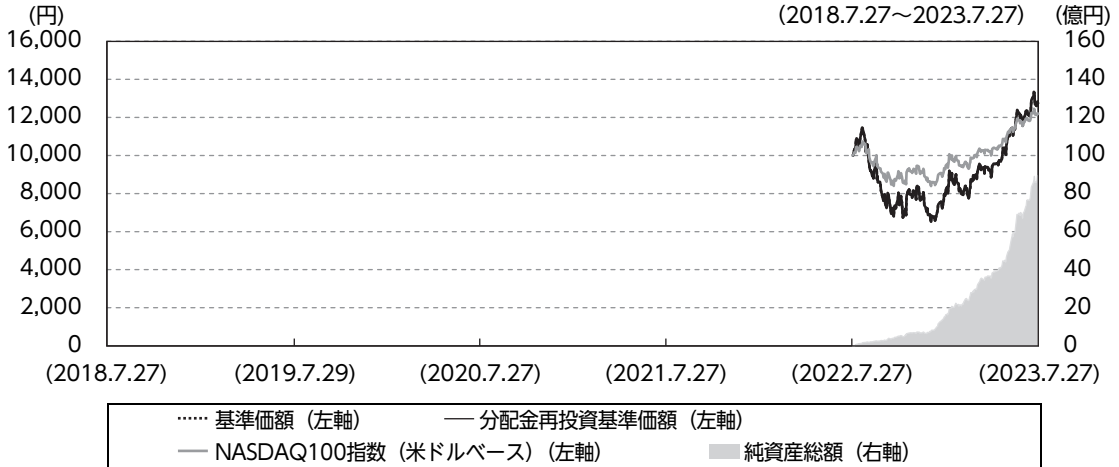


(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及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。

□最近5年間の基準価額等の推移について



(注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を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。

(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様が利用するコースにより異なります。また、ファンドの購入価額などにより課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 参考指数は、2022年7月28日を10,000として指数化したものです。

\*参考指数はNASDAQ100指数(米ドルベース)です。参考指数は投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指数として記載しております。

	2022年7月28日 設定日	2023年7月27日 決算日
基準価額 (円)	10,000	12,723
期間分配金合計(税引前) (円)	—	0
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	27.2
NASDAQ100指数 (米ドルベース) 騰落率 (%)	—	21.9
純資産総額 (百万円)	1	8,919

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

(注2) 騰落率は小数点第1位未満を四捨五入してあります。

(注3) NASDAQ100指数(米ドルベース)騰落率は、NASDAQ100指数(米ドルベース)をもとに、auアセットマネジメントが計算したものです。

(注4) 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5) 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。

---

**□投資環境について**

(2022年7月28日～2023年7月27日)

**<株式市況>**

期中の米国株式市況は上昇しました。期首は米国におけるインフレのピークアウト期待が株価上昇材料となったものの、8月中旬から年末にかけては米CPI（消費者物価指数）や雇用統計などの経済指標が市場の予想を上回ることが多く、FRB（米国連邦準備制度理事会）による金融引締めが強まるのではないかとの懸念から米国株式市場は軟調に推移しました。年明け以降は一転し、米CPIなどインフレ関連の指標が鈍化したことや米主要企業の好業績などを受けて上昇基調となりました。3月には米地方銀行の破綻を受け、金融機関への信用不安を背景に下落する局面もあったものの一時的な下落にとどまり、年明けから期末にかけては総じて堅調な動きとなりました。

## □ポートフォリオについて

### <当ファンド>

当ファンドの運用方針に基づき、auAM レバレッジ NASDAQ100マザーファンドの受益証券を高位に組み入れることにより、日々の基準価額の値動きがNASDAQ100指数（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いました。

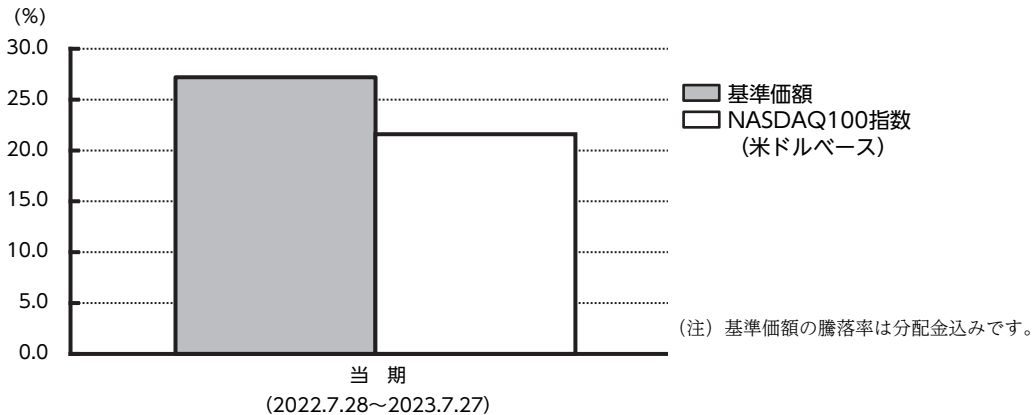
### <auAM レバレッジ NASDAQ100マザーファンド>

株価指数先物取引の買建玉の時価総額が、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しました。また、コール・ローン等による運用も行いました。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 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。

## □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

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

<分配原資の内訳（1万口当り）>

項目	当期
	2022年7月28日～2023年7月27日
当期分配金（税引前）（円）	0
（対基準価額比率）（％）	(0.00)
当期の収益（円）	－
当期の収益以外（円）	－
翌期繰越分配対象額（円）	2,722

（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・繰越欠損金補填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（税引前）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（税引前）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、auAM レバレッジ NASDAQ100マザーファンドの受益証券を主要投資対象とし、日々の基準価額の値動きがNASDAQ100指数（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。

<auAM レバレッジ NASDAQ100マザーファンド>

主として、米国の株価指数先物取引を買い建てます。株価指数先物取引の買建玉の時価総額が、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（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。



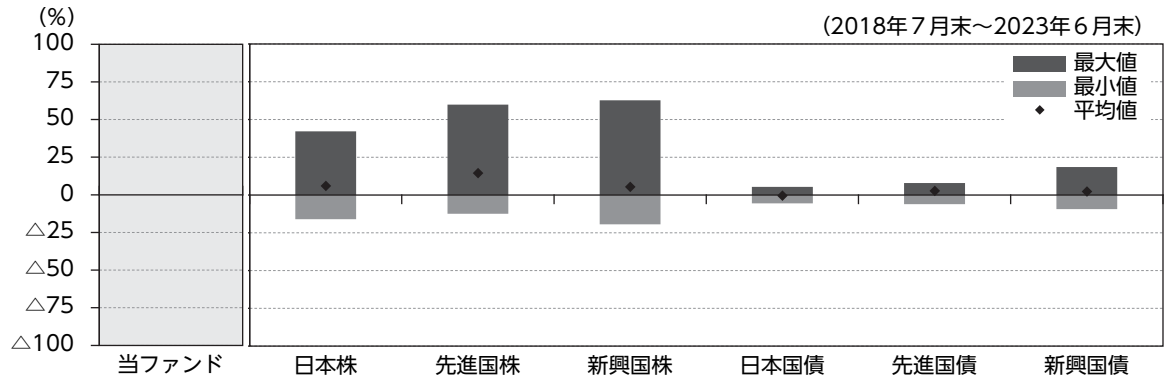
## ■お知らせ

該当事項はございません。

## ■当ファンドの概要

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	
運用方針	auAM レバレッジ NASDAQ100マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券を高位に組み入れることにより、日々の基準価額の値動きがNASDAQ100指数（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います。	
主要投資対象	ベビーファンド	auAM レバレッジ NASDAQ100マザーファンドの受益証券
	auAM レバレッジ NASDAQ100マザーファンド	米国の株価指数先物取引、米国の債券および国内の債券
ベビーファンドの運用方法	<p>①主として、マザーファンドの受益証券を主要投資対象とし、日々の基準価額の値動きがNASDAQ100指数（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。</p> <p>②実質組入外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。</p>	
マザーファンドの運用方法	<p>①主として、米国の債券および国内の債券に投資するとともに、米国の株価指数先物取引を買い建てます。</p> <p>②株価指数先物取引の買建玉の時価総額が、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（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。</p> <p>③追加設定、解約がある場合、既存受益者と新規受益者の公平性を維持するために、設定金額と解約金額の差額分に対して、原則として、当日中に株価指数先物取引を建ててもしくは転売するものとします。この結果、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倍程度にならないことがあります。</p> <p>④為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。</p>	
分配方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 分配対象額は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）および売買益（評価益を含みます。ただし、マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を除きます。）等の全額とします。</li> <li>・ 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、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。</li> </ul>	

## ■代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	－	6.0	14.5	5.3	△0.4	2.8	2.3
最大値	－	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	18.5
最小値	－	△16.0	△12.4	△19.4	△5.5	△6.1	△9.4

上記の図表は、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したもので、過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。このため、決算日に対応した数値とは異なります。

※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。

②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。

③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

資産クラス	指数名	権利者
日本株	TOPIX（配当込み）	株式会社JPX総研
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス（配当込み/円ベース）	MSCI Inc.
新興国株	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み/円ベース）	MSCI Inc.
日本国債	NOMURA-BPI国債	野村フィデューシャリー・リサーチ & コンサルティング株式会社
先進国債	FTSE世界国債インデックス（除く日本/円ベース）	FTSE Fixed Income LLC
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ベース）	J.P. Morgan Securities LLC

※上記指数に関する著作権等の知的財産権およびその他一切の権利は、各権利者に帰属します。各権利者は、当ファンドの運用に関して一切の責任を負いません。

## ■ファンドデータ

### □当ファンドの組入資産の内容

#### ○組入ファンド等

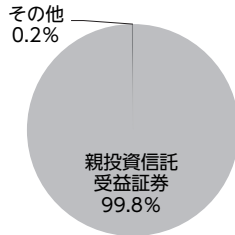
	比率
auAM レバレッジ NASDAQ100マザーファンド	99.8%
その他	0.2%
組入ファンド数	1 ファンド

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

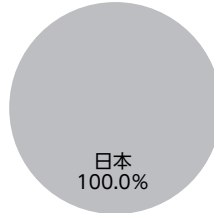
(注2) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）に記載しております。

(注3) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

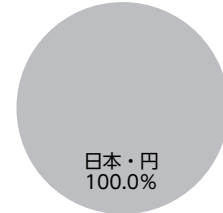
#### ○資産別配分



#### ○国別配分



#### ○通貨別配分



(注1) 上記データは2023年7月27日現在のものです。

(注2) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

※当ファンドは、上記組入ファンドを通じて実質的な運用を行っています。次ページ以降の「組入ファンドの概要」に、その内容を掲載しています。

### □純資産等

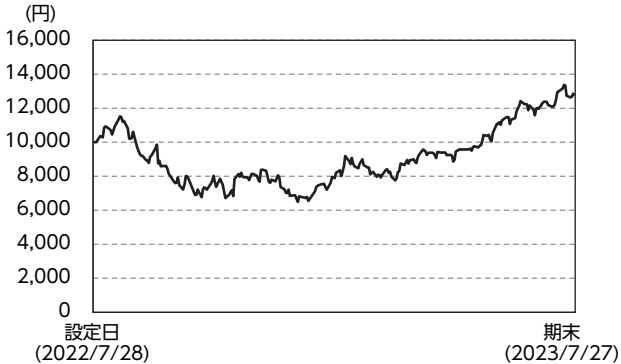
項目	当期末
	2023年7月27日
純資産総額	8,919,217,212円
受益権総口数	7,010,314,442口
1万円当たり基準価額	12,723円

(注) 当期中における追加設定元本額は8,855,090,766円、同解約元本額は1,845,776,324円です。

□組入ファンドの概要

auAM レバレッジ NASDAQ100マザーファンド

○基準価額の推移について



○1万口当たりの費用明細

(2022年7月28日～2023年7月27日)

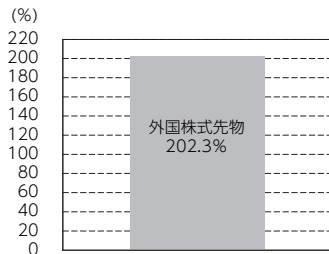
項目	当期
	金額
売買委託手数料 (先物・オプション)	3円 ( 3)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	6 ( 6)
合計	9

(注) 項目等詳細につきましては運用報告書(全体版)に記載しております。

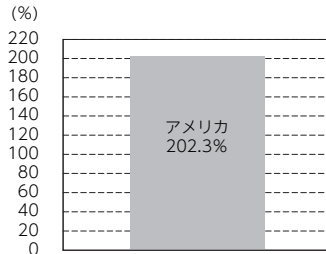
○組入上位銘柄

銘柄名	通貨	比率
NASDAQ 100 E-MINI	アメリカ・ドル	202.3%
組入銘柄数	1銘柄	

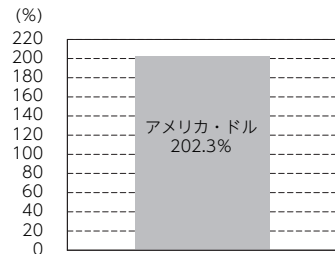
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注1) 上記データは2023年7月27日現在のものです。

(注2) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。