

auAMレバレッジ NASDAQ100

運用報告書（全体版）

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）

●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	
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
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	無期限
分配方針	<ul style="list-style-type: none">・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。・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。	

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。

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）

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			NASDAQ100指数 (米ドルベース)		株式先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率		
(設定日)	円	円	%			%	百万円
2022年7月28日	10,000	—	—	10,000	—	—	1
1期(2023年7月27日)	12,723	0	27.2	12,187	21.9	201.9	8,919

(注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。また、期中騰落率は、期末の基準価額(税引前分配金含む)を設定日の基準価額で除して算出したものです。

(注2) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

(注3) NASDAQ100指数(米ドルベース)は、NASDAQ100指数(米ドルベース)の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として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。

(注6) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

(注7) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式先物比率」は、実質組入比率を記載しております。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		NASDAQ100指数(米ドルベース)		株式先物 比 率
		騰落率	(参考指数)	期 中 騰落率	
(設定日)2022年7月28日	円 10,000	% —	10,000	—	% —
7月末	9,998	△ 0.0	10,000	0.0	196.6
8月末	9,315	△ 6.9	9,816	△ 1.8	204.3
9月末	7,503	△25.0	8,779	△12.2	204.0
10月末	7,880	△21.2	9,079	△ 9.2	194.4
11月末	7,694	△23.1	9,045	△ 9.5	201.8
12月末	6,842	△31.6	8,611	△13.9	197.1
2023年1月末	8,013	△19.9	9,367	△ 6.3	206.1
2月末	8,096	△19.0	9,481	△ 5.2	202.2
3月末	9,258	△ 7.4	10,193	1.9	201.3
4月末	9,448	△ 5.5	10,348	3.5	198.1
5月末	11,160	11.6	11,287	12.9	204.7
6月末	11,943	19.4	11,747	17.5	202.8
(期 末)2023年7月27日	12,723	27.2	12,187	21.9	201.9

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。

(注2) NASDAQ100指数(米ドルベース)は、NASDAQ100指数(米ドルベース)の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000としてau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。

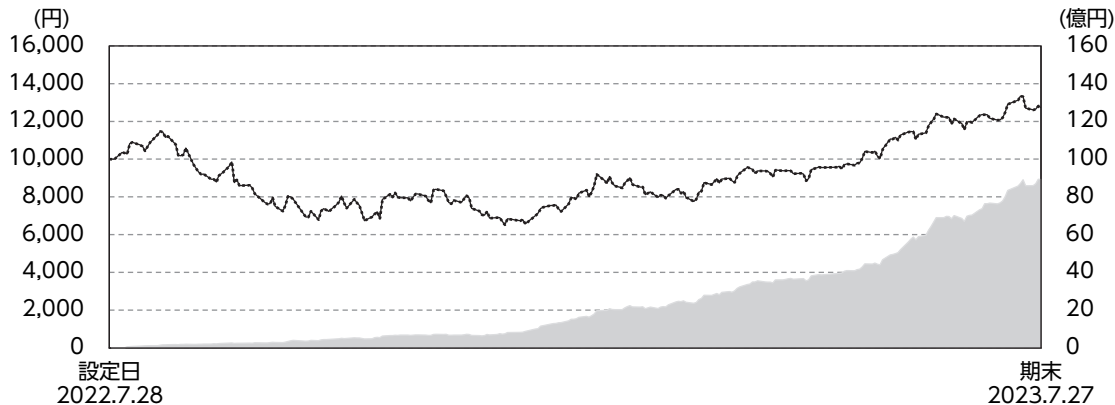
(注5) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

(注6) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式先物比率」は、実質組入比率を記載しております。

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au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、au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、au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、au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



.....基準価額 (左軸) — 分配金再投資基準価額 (左軸)
 ■ 純資産総額 (右軸)

設定日：10,000円

第1期末：12,723円 (既払分配金0円)

騰落率：27.2% (分配金再投資ベース)

(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。

□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>

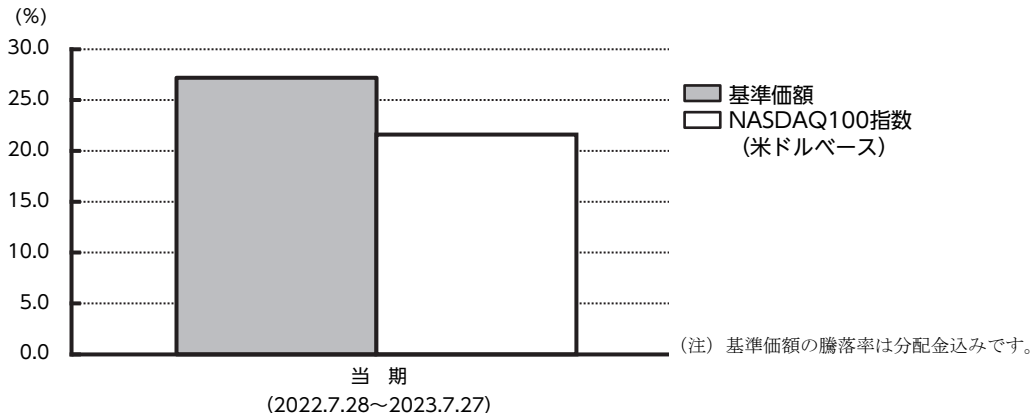
株価指数先物取引の買建玉の時価総額が、原則として、信託財産の純資産総額の2倍程度になるように調整しました。また、コール・ローン等による運用も行いました。為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

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。

※上記見通しと投資方針については、作成日時点における見通し、投資方針であり、今後予告なく変更される場合があります。

■ 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 当期中の平均基準価額は9,182円です。
(投信会社)	(19)	(0.203)	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)	(19)	(0.203)	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)	(3)	(0.027)	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	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
(先物・オプション)	(3)	(0.033)	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
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)	(1)	(0.011)	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)	(6)	(0.066)	信託事務の処理等に関するその他の費用
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。

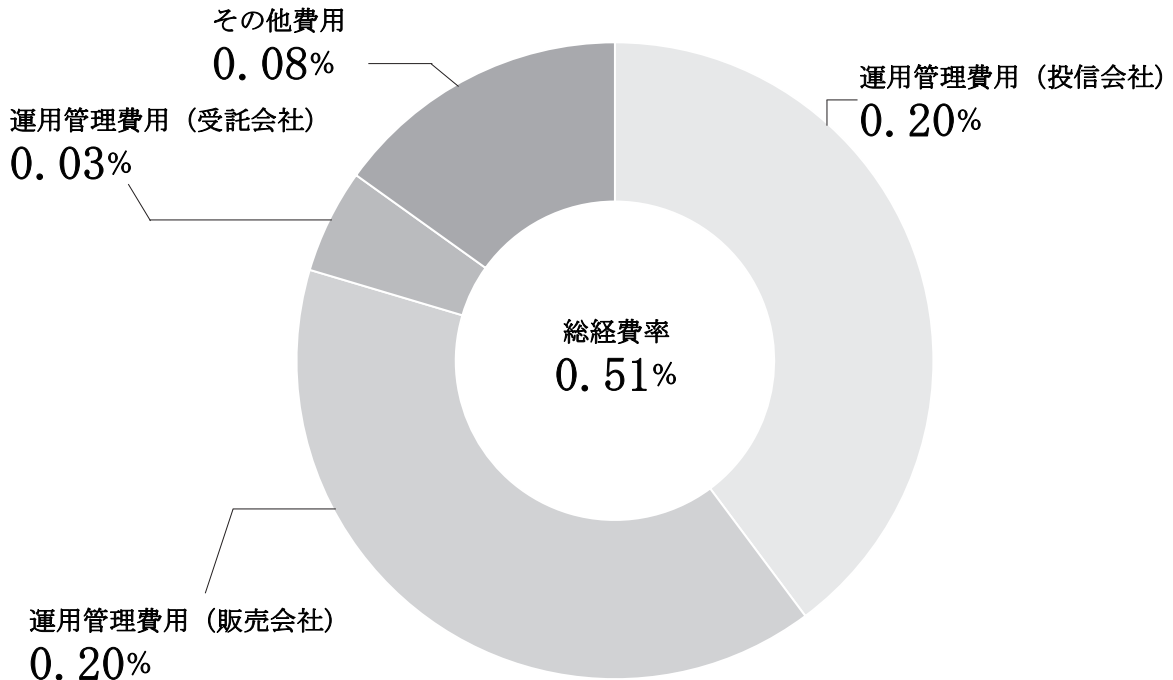
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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。

(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。

■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7月28日から2023年7月27日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
auAM レバレッジ NASDAQ100マザーファンド	千口 7,089,900	千円 6,890,870	千口 107,695	千円 95,600

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等 (2022年7月28日から2023年7月27日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■自社による当ファンドの設定・解約状況 (2022年7月28日から2023年7月27日まで)

期首残高 (元 本)	当期設定 元 本	当期解約 元 本	期末残高 (元 本)	取引の理由
百万円 1	百万円 —	百万円 1	百万円 —	当初設定時における取得及び当初設定時における取得分の解約

■組入資産明細表

親投資信託残高

	当 期 末	
	口 数	評 価 額
auAM レバレッジ NASDAQ100マザーファンド	千口 6,982,204	千円 8,903,009

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年7月27日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
auAM レバレッジ NASDAQ100マザーファンド	千円 8,903,009	% 99.2
コール・ローン等、その他	69,812	0.8
投資信託財産総額	8,972,822	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、7月27日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=140.34円です。

(注3) auAM レバレッジ NASDAQ100マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(2,113,276千円)の投資信託財産総額(8,947,117千円)に対する比率は、23.6%です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2023年7月27日現在

項目	当期末
(A) 資産	8,972,822,346円
コール・ローン等	69,812,843
auAMレバレッジNASDAQ100 マザーファンド(評価額)	8,903,009,503
(B) 負債	53,605,134
未払解約金	44,057,126
未払信託報酬	9,351,892
その他未払費用	196,116
(C) 純資産総額(A-B)	8,919,217,212
元本	7,010,314,442
次期繰越損益金	1,908,902,770
(D) 受益権総口数	7,010,314,442口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,723円

(注1) 設定日における元本額は1,000,000円、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。

(注2) 当期末の計算口数当りの純資産額は12,723円です。

■損益の状況

当期 自2022年7月28日 至2023年7月27日

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 6,634円
受取利息	507
支払利息	△ 7,141
(B) 有価証券売買損益	1,860,815,991
売買益	2,126,037,786
売買損	△ 265,221,795
(C) 信託報酬等	△ 10,703,016
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,850,106,341
(E) 追加信託差損益金	58,796,429
(配当等相当額)	(△ 2,831)
(売買損益相当額)	(58,799,260)
(F) 合計(D+E)	1,908,902,770
次期繰越損益金(F)	1,908,902,770
追加信託差損益金	58,796,429
(配当等相当額)	(2,611,666)
(売買損益相当額)	(56,184,763)
分配準備積立金	1,850,106,341

(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「分配金の計算過程」をご参照ください。

分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	11,557,477円
(b) 経費控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	1,838,548,864円
(c) 収益調整金	58,796,429円
(d) 分配準備積立金	0円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	1,908,902,770円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	2,722.99円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金(1万口当たり)	0円

■お知らせ

該当事項はございません。

収益分配金のお知らせ

1 万口当り分配金

0 円

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

auAM レバレッジ NASDAQ100マザーファンド

運用報告書 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）

auAM レバレッジ NASDAQ100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した。

運用方針	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	米国の株価指数先物取引、米国の債券および国内の債券
株式組入制限	無制限

auアセットマネジメント株式会社

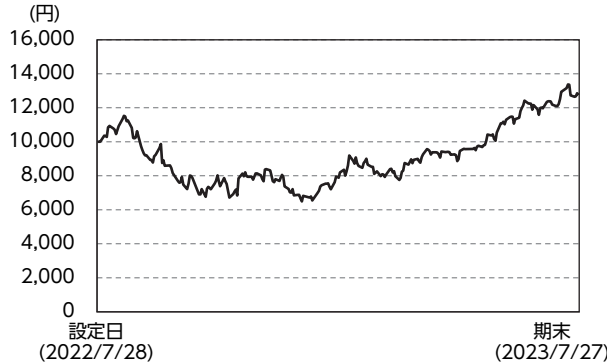
東京都千代田区西神田三丁目2番1号



ホームページ

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

■当期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		NASDAQ100指数 (米ドルベース)		株式先物 比率
	円	騰落率 (%)	(参考指数)	期中 騰落率	%
(設定日)2022年7月28日	10,000	—	10,000	—	—
7月末	9,998	△ 0.0	10,000	0.0	198.5
8月末	9,314	△ 6.9	9,816	△ 1.8	208.9
9月末	7,475	△25.3	8,779	△12.2	207.8
10月末	7,858	△21.4	9,079	△ 9.2	196.6
11月末	7,673	△23.3	9,045	△ 9.5	203.8
12月末	6,817	△31.8	8,611	△13.9	199.5
2023年1月末	8,001	△20.0	9,367	△ 6.3	207.7
2月末	8,088	△19.1	9,481	△ 5.2	203.7
3月末	9,259	△ 7.4	10,193	1.9	202.1
4月末	9,453	△ 5.5	10,348	3.5	198.7
5月末	11,173	11.7	11,287	12.9	204.8
6月末	11,964	19.6	11,747	17.5	203.2
(期 末)2023年7月27日	12,751	27.5	12,187	21.9	202.3

- (注1) 騰落率は設定日比です。
- (注2) NASDAQ100指数(米ドルベース)は、NASDAQ100指数(米ドルベース)の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000としてau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。

■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 期末時：12,751円

騰落率：27.5%

【基準価額の変動要因】

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倍程度になるように調整し、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27.5%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

＜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

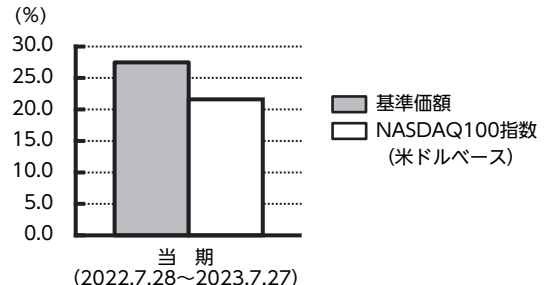
株価指数先物取引の買建玉の時価総額が、原則として、信託財産の純資産総額の2倍程度になるように調整しました。また、コール・ローン等による運用も行いました。為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

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。



■今後の運用方針

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。

■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)	3円 (3)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	6 (6)
合計	9

(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

先物取引の種類別取引状況

(2022年7月28日から2023年7月27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	45,028	29,350	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 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

(2022年7月28日から2023年7月27日まで)

銘 柄 別	買 建		売 建		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	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
株式	45,028	29,350	—	—	18,008	—	461
NASDAQ 100 E-MINI (アメリカ)							

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

先物取引の銘柄別取引状況

銘柄別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外国		百万円	百万円
	NASDAQ 100 E-MINI	18,008	—

(注1) 外貨建の評価額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

当期中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7月27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	8,947,117	100.0
投資信託財産総額	8,947,117	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、7月27日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=140.34円です。

(注3) 当期末における外貨建資産(2,113,276千円)の投資信託財産総額(8,947,117千円)に対する比率は、23.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年7月27日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	13,490,799,872円
コール・ローン等	3,145,066,053
未 収 入 金	5,046,581,962
差 入 委 託 証 拠 金	5,299,151,857
(B) 負 債	4,587,442,757
未 払 金	4,587,442,757
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	8,903,357,115
元 本	6,982,204,928
次 期 繰 越 損 益 金	1,921,152,187
(D) 受 益 権 総 口 数	6,982,204,928口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	12,751円

(注1) 設定日における元本額は500,990,000円、当期中における追加設定元本額は7,088,910,020円、同解約元本額は607,695,092円です。

(注2) 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、auAMレバレッジ NASDAQ100 6,982,204,928円です。

(注3) 当期末の計算口数当りの純資産額は12,751円です。

■損益の状況

当期 自2022年7月28日 至2023年7月27日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	11,707,980円
そ の 他 収 益 金	12,003,350
支 払 利 息	△ 295,370
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 96,291,387
売 買 益	155,278,701
売 買 損	△ 251,570,088
(C) 先 物 取 引 等 損 益	2,112,487,493
取 引 益	2,418,810,748
取 引 損	△ 306,323,255
(D) そ の 他 費 用	△ 14,266,971
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	2,013,637,115
(F) 解 約 差 損 益 金	106,545,092
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 199,030,020
(H) 合 計 (E + F + G)	1,921,152,187
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	1,921,152,187

(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。