

# 明治安田DCトピックスプラス

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／国内／株式	
信託期間	無期限です。	
運用方針	我が国の株式を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	明治安田DCトピックスプラス	我が国の株式を主要投資対象とする「日本株式エンハンストインデックスマザーファンド」を主要投資対象とします。なお、当該株式に直接投資する場合があります。
	日本株式エンハンストインデックスマザーファンド	我が国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	明治安田DCトピックスプラス	株式への実質投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	日本株式エンハンストインデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	年1回（毎年11月16日。休業日の場合は翌営業日。）決算を行い、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配します。ただし、分配を行わないこともあります。	

## 運用報告書(全体版)

第11期

(決算日 2016年11月16日)

受益者のみなさまへ

平素は「明治安田DCトピックスプラス」にご投資いただき、厚くお礼申し上げます。

さて、当ファンドは、第11期の決算を行いましたので、期中の運用状況につきましてご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

 明治安田アセットマネジメント株式会社

東京都港区虎ノ門三丁目4番7号

<http://www.myam.co.jp/>

〈運用報告書のお問い合わせ先〉

サポートデスク 0120-565787

(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額			東証株価指数(TOPIX)		株式組入率	株式先物比率	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			
	円	円	%		%	%	%	百万円
(第7期) 2012年11月16日	4,856	0	4.3	751.34	3.8	97.5	1.7	77
(第8期) 2013年11月18日	8,097	0	66.7	1,241.67	65.3	97.0	2.2	153
(第9期) 2014年11月17日	9,023	0	11.4	1,366.13	10.0	97.7	1.8	194
(第10期) 2015年11月16日	10,594	0	17.4	1,571.53	15.0	98.0	1.3	262
(第11期) 2016年11月16日	9,759	0	△ 7.9	1,421.65	△ 9.5	98.0	1.3	238

(注1) 当ファンドは親投資信託を組み合わせますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注3) 東証株価指数 (TOPIX) は、株式会社東京証券取引所 (株東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、(株東京証券取引所) が有しています。なお、本商品は、(株東京証券取引所) により提供、保証又は販売されるものではなく、(株東京証券取引所) は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

◎当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首) 2015年11月16日	10,594	—	1,571.53	—	98.0	1.3
11月末	10,671	0.7	1,580.25	0.6	98.5	0.8
12月末	10,431	△ 1.5	1,547.30	△ 1.5	98.4	1.0
2016年 1月末	9,663	△ 8.8	1,432.07	△ 8.9	99.1	0.3
2月末	8,704	△ 17.8	1,297.85	△ 17.4	98.6	0.5
3月末	9,131	△ 13.8	1,347.20	△ 14.3	97.5	1.8
4月末	9,056	△ 14.5	1,340.55	△ 14.7	97.2	2.3
5月末	9,342	△ 11.8	1,379.80	△ 12.2	98.2	1.0
6月末	8,398	△ 20.7	1,245.82	△ 20.7	97.8	1.6
7月末	8,940	△ 15.6	1,322.74	△ 15.8	98.2	1.3
8月末	8,981	△ 15.2	1,329.54	△ 15.4	98.6	0.8
9月末	9,011	△ 14.9	1,322.78	△ 15.8	98.3	1.0
10月末	9,533	△ 10.0	1,393.02	△ 11.4	97.9	1.6
(期末) 2016年11月16日	9,759	△ 7.9	1,421.65	△ 9.5	98.0	1.3

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み合わせますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

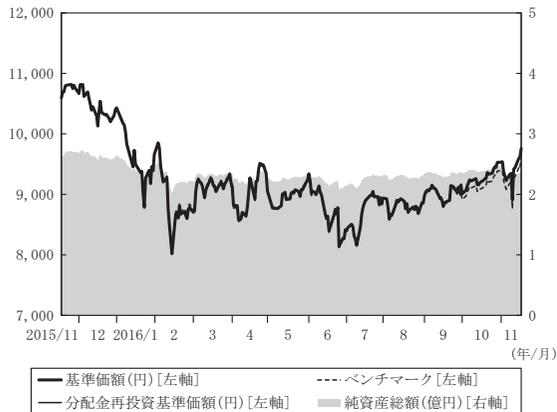
(注3) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎当期中の運用経過と今後の運用方針(2015年11月17日～2016年11月16日)

1 基準価額と収益分配金

(1) 基準価額の推移と主な変動要因

明治安田DCトピックスプラス  
基準価額の推移



※ベンチマークは東証株価指数(TOPIX)であり、期首の基準価額に合わせて指数化しております。

基準価額は期首10,594円で始まり期末9,759円で終わりました。騰落率(分配金込み)は、 $\Delta 7.9\%$ でした。

基準価額の主な変動要因は以下の通りです。

(上昇要因)

- ・2016年2月中旬から5月にかけて中国や欧州での金融緩和の動きに加え、原油価格や米国株式相場の上昇を受けて国内株式相場が上昇したこと。
- ・7月から期末にかけて良好な米国経済指標、参議院選挙における与党の勝利、日銀による新たな金融緩和の枠組みの導入、外国株式相場の上昇などを背景に国内株式相場が上昇基調で推移したこと。

(下落要因)

- ・期首から2016年2月中旬にかけて原油価格の下落や中国景気への先行き不安、円高進行による国内企業の業績不振懸念等から、国内株式相場が下落したこと。
- ・6月に英国のEU(欧州連合)離脱を問う国民投票の結果を受けて投資家のリスク回避の動きが強まり、国内株式相場が急落したこと。

(2) ベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は $\Delta 7.9\%$ となりました。一方ベンチマーク騰落率は $\Delta 9.5\%$ となり、騰落率の差異は $+1.7\%$ となりました。この差異に関する主な要因は以下の通りです。

(プラス要因)

期を通じて最大ウェイトの「バリュースコア」および「収益性」ファクターの説明力が良好だったこと等がプラスとなりました。また、保有株式に係る配当金の計上もプラス要因となりました。

(マイナス要因)

期を通じて「成長性」ファクターの説明力が不調だったこと、2016年2月と6月において最大ウェイトの「バリュースコア」の説明力が不冴えとなったこと等がマイナスとなりました。また、信託報酬等のファンド運営上の諸費用計上もマイナス要因となりました。

※説明力とは、投資対象ユニバース銘柄について、モデルが示す前月末の個別銘柄の魅力度(アルファ)の順位と、翌月の実際のリターン順位との相関を表した数値です。これがプラス(マイナス)であれば、モデルやファクターが有効(不冴え)だったことを示します。

### (3) 収益分配金

- ・収益分配は信託財産の長期的な成長を図るため見送りとさせて頂きました。
- ・収益分配にあてず信託財産内に留保した利益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

### 分配原資の内訳

(単位：円・%、1万口当たり、税引前)

項 目	第11期
	(2015年11月17日～2016年11月16日)
当期分配金	－
(対基準価額比率)	－
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	4,630

(注1) 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)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## 2 運用経過

### (1) 運用概況

当ファンドは、「日本株式エンハンストインデックスマザーファンド」に投資することにより実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みになっています。マザーファンドへの投資比率を高位に保つとの期首の運用方針を踏まえ、当期を通じてマザーファンドへの組入比率を高位に保ちました。

### (2) 日本株式エンハンストインデックスマザーファンドの運用概況

(2015年11月17日～2016年11月16日)

後述の同マザーファンドの運用報告書をご参照ください。

## 3 今後の運用方針

### (1) 当ファンドの運用方針

引き続き、「日本株式エンハンストインデックスマザーファンド」への投資を通じてわが国の株式を中心に投資を行い、マザーファンドの組入比率を高位に保つ方針です。

### (2) 日本株式エンハンストインデックスマザーファンドの運用方針

後述の同マザーファンドの運用報告書をご参照下さい。

◎1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2015年11月17日～2016年11月16日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	65 円	0.702 %	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 期末の信託報酬率 ※期中の平均基準価額は9,321円です。
(投信会社)	(38)	(0.410)	ファンドの運用、基準価額の算出、法定書類の作成等の対価
(販売会社)	(21)	(0.227)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(6)	(0.065)	ファンド財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 ÷ 期中の平均受益権口数
(株式)	(0)	(0.000)	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)	(0.001)	
(c) その他費用	0	0.005	(c) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(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)	(0.001)	信託事務の処理等に要する諸費用、信託財産に関する租税等
合 計	65	0.708	

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

◎**売買及び取引の状況**(2015年11月17日～2016年11月16日)

○親投資信託の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日本株式エンハンス トインデックスマザーファンド	千口 36,111	千円 40,370	千口 39,610	千円 43,940

(注)単位未満は切り捨て。

◎**親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合**

項 目	当 期
	日本株式エンハンス トインデックスマザーファンド
( a ) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	8,945,192千円
( b ) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	5,186,853千円
( c ) 売 買 高 比 率 ( a ) / ( b )	1.72

(注)(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

◎**利害関係人との取引状況等**(2015年11月17日～2016年11月16日)

期中の利害関係人との取引はございません。

(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。

◎**組入資産明細表**

○親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
日 本 株 式 エ ン ハ ン ス ト イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 204,022	千口 200,522	千円 237,679

(注1)口数・評価額の単位未満は切り捨て。

(注2)日本株式エンハンストインデックスマザーファンド全体の当期末受益権口数は(4,620,884千口)です。

◎投資信託財産の構成

2016年11月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本株式エンハンストインデックスマザーファンド	237,679	99.1
コール・ローン等、その他	2,097	0.9
投資信託財産総額	239,776	100.0

(注)評価額の単位未満は切り捨て。

◎資産、負債、元本及び基準価額の状況

2016年11月16日現在

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	239,776,632
コール・ローン等	2,097,080
日本株式エンハンスト インデックスマザーファンド(評価額)	237,679,552
(B)負 債	838,945
未 払 解 約 金	22,974
未 払 信 託 報 酬	810,966
そ の 他 未 払 費 用	5,005
(C)純資産総額(A - B)	238,937,687
元 本	244,848,610
次 期 繰 越 損 益 金	△ 5,910,923
(D)受 益 権 総 口 数	244,848,610口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,759円

(注1)当ファンドの期首元本額は247,509,154円、期中追加設定元本額は64,833,741円、期中一部解約元本額は67,494,285円です。

(注2)1口当たり純資産額は0.9759円です。

(注3)純資産総額が元本額を下回っており、その額は5,910,923円です。

(注4)損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注5)損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬等に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注6)損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注7)計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,480,164円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(56,602,821円)および分配準備積立金(53,290,219円)より分配対象収益は113,373,204円(10,000口当たり4,630円)ですが、当期に分配した金額はありません。

◎損益の状況

自 2015年11月17日

至 2016年11月16日

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	25
受 取 利 息	25
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 11,139,209
売 買 益	7,618,697
売 買 損	△ 18,757,906
(C)信 託 報 酬 等	△ 1,659,802
(D)当期損益金(A + B + C)	△ 12,798,986
(E)前期繰越損益金	53,290,219
(F)追加信託差損益金	△ 46,402,156
(配当等相当額)	( 56,501,184)
(売買損益相当額)	(△102,903,340)
(G)計(D + E + F)	△ 5,910,923
(H)収 益 分 配 金	0
次期繰越損益金(G + H)	△ 5,910,923
追加信託差損益金	△ 46,402,156
(配当等相当額)	( 56,602,821)
(売買損益相当額)	(△103,004,977)
分配準備積立金	56,770,383
繰 越 損 益 金	△ 16,279,150

## 日本株式エンハンストインデックスマザーファンド

## 運用報告書

第11期

(決算日 2016年11月16日)

「日本株式エンハンストインデックスマザーファンド」は、2016年11月16日に第11期決算を行いました。

以下、当マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

当マザーファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	我が国の株式を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	我が国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	・株式への投資割合には制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は、行いません。

## ◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)配当込み (ベンチマーク)		株式 組入 比率	株式 先物 比率	純資産 総額
	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
(第7期) 2012年11月16日	5,713	5.0	987.14	6.3	98.2	1.7	6,540
(第8期) 2013年11月18日	9,624	68.5	1,662.70	68.4	97.7	2.3	6,058
(第9期) 2014年11月17日	10,806	12.3	1,866.48	12.3	98.2	1.8	7,008
(第10期) 2015年11月16日	12,788	18.3	2,187.96	17.2	98.5	1.3	6,009
(第11期) 2016年11月16日	11,853	△ 7.3	2,023.85	△ 7.5	98.5	1.3	5,476

(注1) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注2) 東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(㈱東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、(株)東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

## ◎当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証株価指数(TOPIX)配当込み (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首) 2015年11月16日	12,788	—	2,187.96	—	98.5	1.3
11月末	12,884	0.8	2,200.15	0.6	99.0	0.8
12月末	12,601	△ 1.5	2,157.78	△ 1.4	98.8	1.1
2016年 1月末	11,673	△ 8.7	1,997.22	△ 8.7	99.5	0.3
2月末	10,514	△ 17.8	1,810.63	△ 17.2	99.3	0.5
3月末	11,040	△ 13.7	1,898.02	△ 13.3	98.1	1.8
4月末	10,953	△ 14.3	1,888.68	△ 13.7	97.7	2.3
5月末	11,308	△ 11.6	1,944.06	△ 11.1	98.8	1.0
6月末	10,166	△ 20.5	1,757.69	△ 19.7	98.2	1.6
7月末	10,830	△ 15.3	1,866.36	△ 14.7	98.6	1.3
8月末	10,888	△ 14.9	1,876.60	△ 14.2	99.1	0.8
9月末	10,931	△ 14.5	1,883.03	△ 13.9	98.8	1.0
10月末	11,574	△ 9.5	1,983.08	△ 9.4	98.3	1.6
(期末) 2016年11月16日	11,853	△ 7.3	2,023.85	△ 7.5	98.5	1.3

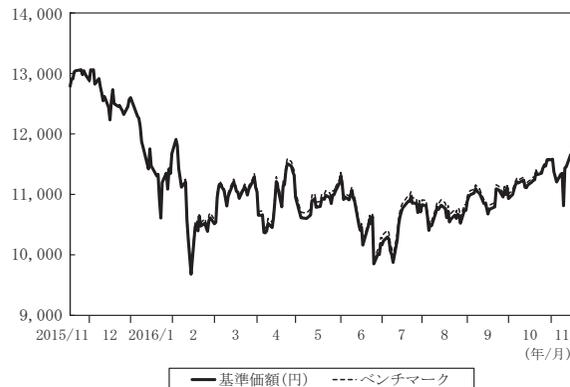
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎当期中の運用経過と今後の運用方針(2015年11月17日～2016年11月16日)

## 1 基準価額

## (1) 基準価額の推移と主な変動要因

日本株式エンハンスインデックスマザーファンド  
当期の基準価額の推移

※ベンチマークは東証株価指数(TOPIX)配当込みであり、期首の基準価額に合わせて指数化しております。

基準価額は期首12,788円で始まり期末11,853円で終わりました。騰落率は、 $\Delta 7.3\%$ でした。

基準価額の主な変動要因は以下の通りです。

## (上昇要因)

- ・2016年2月中旬から5月にかけて中国や欧州での金融緩和の動きに加え、原油価格や米国株式相場の上昇を受けて国内株式相場が上昇したこと。
- ・7月から期末にかけて良好な米国経済指標、参議院選挙における与党の勝利、日銀による新たな金融緩和の枠組みの導入、外国株式相場の上昇などを背景に国内株式相場が上昇基調で推移したこと。

## (下落要因)

- ・期首から2016年2月中旬にかけて原油価格の下落や中国景気への先行き不安、円高進行による国内企業の業績不振懸念等から、国内株式相場が下落したこと。
- ・6月に英国のEU(欧州連合)離脱を問う国民投票の結果を受けて投資家のリスク回避の動きが強まり、国内株式相場が急落したこと。

## (2) ベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は $\Delta 7.3\%$ となりました。一方ベンチマーク騰落率は $\Delta 7.5\%$ となり、騰落率の差異は $+0.2\%$ となりました。この差異に関する主な要因は以下の通りです。

## (プラス要因)

期を通じて最大ウェイトの「バリュエ指標」および「収益性」ファクターの説明力が良好だったこと等がプラスとなりました。

## (マイナス要因)

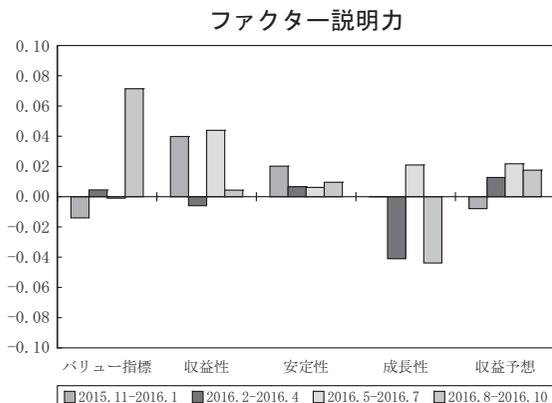
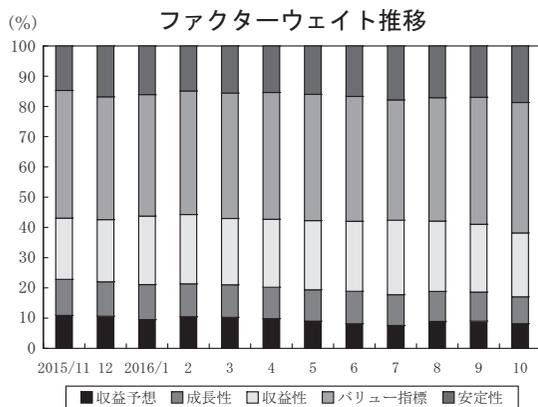
期を通じて「成長性」ファクターの説明力が不調だったこと、2016年2月と6月において最大ウェイトの「バリュエ指標」の説明力が不冴えとなったこと等がマイナスとなりました。

※説明力とは、投資対象ユニバース銘柄について、モデルが示す前月末の個別銘柄の魅力度(アルファ)の順位と、翌月の実際のリターン順位との相関を表した数値です。これがプラス(マイナス)であれば、モデルやファクターが有効(不冴え)だったことを示します。

2 運用経過  
運用概況

期首の運用方針に基づき、ベンチマークである東証株価指数(TOPIX)配当込みとの乖離を一定限度内に抑制しつつ、中長期的に安定した超過リターンの獲得を目指して運用を行いました。独自の株式魅力度ランキング等、エンハンスインデックス運用に適したクオンツ手法を用いてポートフォリオを構築しました。クオンツ手法とは、マーケットや個別銘柄の価格変動に影響を与える要素(ファクターといいます)を分析・解析したうえで数値化し、計量分析によってポートフォリオを構築する手法です。ファクター説明力の推移に基づき定量的手法を用いて各ファクターのウェイトを決定しました。期初のファクターウェイトは「バリュエ指標」次いで「収益性」に高いウェイトを付与しました。期中に相対的に説明力が高まった「バリュエ指標」、「収益性」、「安定性」のファクターウェイトを引き上げ、相対的に説明力が低下した「成長性」、「収益予想」

のファクターウェイトを引き下げました。結果として期末のファクター順位は変わらず、「バリュースコア」次いで「収益性」の順に高いウェイトを付与しました。



### 3 今後の運用方針

引き続き、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）配当込みとの乖離を一定限度内に抑制しつつ、中長期的に安定した超過リターンの獲得を目指して運用を行います。独自の株式魅力度ランキング等、エンハンスインデックス運用に適したクオンツ手法を用いてポートフォリオを構築します。業種配分については中立の方針です。

## ◎1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項目の概要
	(2015年11月17日～2016年11月16日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0 円	0.001 %	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷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 ※期中の平均基準価額は11,280円です。
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) その他費用	0	0.001	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要する諸費用、信託財産に関する租税等
(その他)	(0)	(0.001)	
合 計	0	0.002	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、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は四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ◎売買及び取引の状況(2015年11月17日～2016年11月16日)

## ○株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株	千円	千株	千円
		4,797 (△ 529)	4,486,898 ( - )	4,326	4,458,293

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) ( )内は株式分割、予約権行使、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。

## ○先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	百万円	百万円	百万円	百万円
	株式先物取引	465	466	-

(注) 単位未満は切り捨て。

## ◎株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
( a ) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	8,945,192千円
( b ) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	5,186,853千円
( c ) 売 買 高 比 率 ( a ) / ( b )	1.72

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ◎主要な売買銘柄

○株式

買 付				当 期				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	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		千株	千円	円
T&Dホールディングス	37	47,604	1,286	T&Dホールディングス	40.9	56,390	1,378	T&Dホールディングス	40.9	56,390	1,378
SBIホールディングス	32.3	37,360	1,156	旭硝子	59	36,434	617	旭硝子	59	36,434	617
旭硝子	51	32,641	640	日本特殊陶業	13.3	33,284	2,502	日本特殊陶業	13.3	33,284	2,502
協和発酵キリン	18.2	31,139	1,710	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	9	28,657	3,184	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	9	28,657	3,184
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	9.5	31,065	3,270	久光製薬	5.1	28,342	5,557	久光製薬	5.1	28,342	5,557
コカ・コーラウエスト	11.7	30,080	2,571	日立化成	13	28,059	2,158	日立化成	13	28,059	2,158
関西電力	27.7	27,358	987	リンナイ	2.7	28,052	10,389	リンナイ	2.7	28,052	10,389
シスメックス	3.7	26,996	7,296	オリックス	18	28,047	1,558	オリックス	18	28,047	1,558
群馬銀行	55.1	26,924	488	横河電機	20.5	27,525	1,342	横河電機	20.5	27,525	1,342
シチズン時計	39	25,456	652	HOYA	6.2	27,116	4,373	HOYA	6.2	27,116	4,373

(注)金額は受渡し代金。

## ◎利害関係人との取引状況等(2015年11月17日～2016年11月16日)

期中の利害関係人との取引はございません。

(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。

## ◎組入資産明細表

○国内株式  
上場株式

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
<b>鉱業 (0.2%)</b>			
国際石油開発帝石	11	9.9	10,345
<b>建設業 (3.1%)</b>			
ミライト・ホールディングス	12.1	1	1,036
大成建設	5	9	6,912
大林組	4	5.1	5,207
清水建設	5	3	3,003
長谷工コーポレーション	1.2	9	9,549
鹿島建設	20	7	5,103
西松建設	23	—	—
大東建託	0.7	0.7	11,707
前田道路	—	1	1,919
住友林業	10.3	9.6	14,736
パナホーム	—	13	9,893
大和ハウス工業	5.4	10.4	31,834
積水ハウス	12.1	13.8	23,922
関電工	—	6	5,772
きんでん	8.9	9.6	13,651
協和エクシオ	9.7	—	—
日揮	7	—	—
太平電業	—	9	10,080
大気社	—	4.4	12,205
<b>食料品 (4.8%)</b>			
日本製粉	16	8	12,208
日清製粉グループ本社	0.7	7.8	12,136
昭和産業	—	19	11,210
三井製糖	—	4	9,244
森永製菓	21	—	—
山崎製パン	—	4.5	9,909
カルビー	1.6	0.3	1,048
ヤクルト本社	0.4	0.3	1,515
明治ホールディングス	1	1.2	10,608
日本ハム	6	—	—
丸大食品	—	20	9,460
アサヒグループホールディングス	4.2	6.3	22,566
キリンホールディングス	16	14.9	27,222
コカ・コーラウエスト	—	2.7	8,127
コカ・コーライーストジャパン	—	4.4	9,886
サントリー食品インターナショナル	2.4	3	13,680
伊藤園	5	3.9	14,176

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
不二製油グループ本社	7.7	—	—
キッコーマン	1	3	9,990
味の素	8	10.1	20,503
東洋水産	2.9	0.7	2,758
日清食品ホールディングス	0.4	0.3	1,722
日本たばこ産業	14.7	14.3	53,353
<b>繊維製品 (0.7%)</b>			
帝人	41	7.4	14,933
東レ	10	11	9,885
ワコールホールディングス	—	11	13,739
三陽商会	27	—	—
デサント	5.1	—	—
<b>パルプ・紙 (0.4%)</b>			
王子ホールディングス	2	2	898
日本製紙	5.7	—	—
北越紀州製紙	—	12.6	7,786
ザ・パックス	2.8	4.2	11,083
<b>化学 (6.4%)</b>			
クラレ	12.1	9.3	14,647
旭化成	33	20	19,766
昭和電工	6	—	—
住友化学	38	40	20,080
東ソー	21	19	14,003
セントラル硝子	—	25	10,200
デケン	—	21	10,122
信越化学工業	3.9	3.5	28,871
エア・ウォーター	—	0.4	748
大陽日酸	5.5	—	—
カネ	—	16	13,632
三菱瓦斯化学	12	—	—
三井化学	3	28	13,860
J S R	—	4.4	6,740
三菱ケミカルホールディングス	30.3	35.8	25,128
ダイセル	7.2	10.8	13,748
住友ベークライト	—	12	6,540
積水化学工業	11.7	9.4	15,735
日本ゼオン	12	—	—
日部興産	—	61	13,725
日立化成	7.4	—	—
ダイキョーニシカワ	—	7.5	10,095

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
A D E K A	—	6.3	9,538
花 王	5.7	5.7	28,448
関 西 ペ イ ン ト	1	—	—
中 国 塗 料	15	11.9	9,079
太陽ホールディングス	2.1	—	—
D I C	36	—	—
東洋インキSCホールディングス	24	—	—
富士フイルムホールディングス	5.3	7.3	29,791
資 生 堂	0.7	2.7	7,743
フ ァ ン ケ ル	—	5.9	9,150
日 東 電 工	3.1	1.1	8,701
ユ ニ ・ チ ャ ー ム	2.4	1.2	2,793
<b>医 薬 品 ( 5.2%)</b>			
協 和 発 酵 キ リ ン	1	8.5	14,263
武 田 薬 品 工 業	9.5	8	37,536
ア ス テ ラ ス 製 薬	34.9	33.7	54,155
大 日 本 住 友 製 薬	9.4	—	—
塩 野 義 製 薬	2.8	4.6	25,024
田 辺 三 菱 製 薬	7.7	8.4	17,808
中 外 製 薬	3.9	1	3,330
科 研 製 薬	—	0.1	622
エ ー ザ イ	2.4	3.9	27,140
ロ ー ト 製 薬	4	0.5	810
小 野 薬 品 工 業	0.4	2.8	7,658
久 光 製 薬	3	—	—
参 天 製 薬	9.2	7.4	11,470
生 化 学 工 業	—	5.3	8,798
栄 研 化 学	4.6	—	—
J C R フ ェ ー マ	—	3.7	10,600
第 一 三 共	9.8	9.9	24,037
キョーリン製薬ホールディングス	6.5	5.3	12,905
大塚ホールディングス	4.5	4.6	22,034
<b>石 油 ・ 石 炭 製 品 ( 0.2%)</b>			
東 燃 ゼ ネ ラ ル 石 油	—	1	1,058
J X ホールディングス	36.2	27.5	11,803
<b>ゴ ム 製 品 ( 1.2%)</b>			
横 浜 ゴ ム	—	7.6	15,291
ブ リ ゼ ス ト ン	12	11.4	47,811
住 友 ゴ ム 工 業	0.9	—	—
<b>ガ ラ ス ・ 土 石 製 品 ( 1.0%)</b>			
日 東 紡 績	—	19	7,771
旭 硝 子	28	20	14,380
住 友 大 阪 セ メ ン ト	15	29	11,629

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
太 平 洋 セ メ ン ト	46	44	15,224
日 本 碍 子	1	—	—
日 本 特 殊 陶 業	5	1.2	2,751
<b>鉄 鋼 ( 1.2%)</b>			
新 日 鐵 住 金	8.8	9.7	22,945
神 戸 製 鋼 所	90	—	—
ジェイエフイーホールディングス	3.1	1.5	2,454
共 英 製 鋼	—	4.8	9,696
大 同 特 殊 鋼	—	21	9,618
山 陽 特 殊 製 鋼	—	21	11,487
愛 知 製 鋼	24	—	—
日 立 金 属 属	10.3	7.1	10,429
三 菱 製 鋼	11	—	—
<b>非 鉄 金 属 ( 1.0%)</b>			
日本軽金属ホールディングス	—	44.3	10,809
三 菱 マ テ リ ア ル	40	4	13,900
住 友 金 属 鉦 山	11	—	—
住 友 電 気 工 業	4.6	17.7	27,364
アサヒホールディングス	7.1	—	—
<b>金 属 製 品 ( 0.6%)</b>			
文 化 シ ャ ッ タ ー	8.3	—	—
三 協 立 山	—	5.5	8,756
L I X I L グ ル ー プ	6.2	1	2,423
ノ ー リ ッ ツ	—	4	7,860
リ ン ナ イ	1.7	0.1	917
日 本 発 條	12	13.2	13,200
<b>機 械 ( 4.9%)</b>			
オ ー ク マ	12	14	13,678
アマダホールディングス	12.7	13.4	16,910
富 士 機 械 製 造	11.1	—	—
牧 野 フ ラ イ ス 製 作 所	14	15	11,490
ソ デ イ ッ ク	6.8	13.1	10,886
ナ ブ テ ス コ	3.9	—	—
S M C	0.5	0.5	15,930
小 松 製 作 所	16.1	9.1	23,100
住 友 重 機 械 工 業	29	26	16,952
ク ボ タ	7	10.1	17,104
ダ イ キ ン 工 業	3	3	31,410
栗 田 工 業	—	0.9	2,111
椿 本 チ エ イ ン	12	13	11,336
タ ダ	1	8	9,888
平 和	—	0.4	949
ア マ ノ	—	3.4	6,640

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サンデンホールディングス	29	—	—
マックス	—	5	6,480
セガサミーホールディングス	6.5	—	—
日本精工	8	11.3	14,012
NTN	20	—	—
ジェイテクト	4.2	7.1	12,595
日本トムソン	22	—	—
THK	6.2	—	—
マキタ	—	0.9	6,912
三菱重工業	38	53	25,323
IHI	—	30	9,300
<b>電気機器 (11.6%)</b>			
イビデン	4.4	7	10,255
コニカミノルタ	10.8	15.2	14,865
ブラザー工業	10.6	1	1,991
ミネベア	12	1.5	1,588
日立製作所	77	77	45,399
東芝	54	26	10,056
三菱電機	36	34.4	53,543
富士電機	—	4	2,268
芝浦電機	12	—	—
三菱モーター	0.2	—	—
日本電産	1.8	2.3	23,782
オムロン	3.5	1.7	6,961
日東工業	4.2	—	—
ジーエス・ユアサコーポレーション	—	28	12,908
日本電気	48	68	20,468
富士通	28	28	18,342
沖電気工業	53	—	—
セイコーエプソン	7	—	—
ジャパニクス	2.9	—	—
パナソニック	25.3	34.1	35,276
富士通ゼネラル	7	—	—
ソニー	15	16.4	52,578
TDK	2.6	2.8	21,280
アルプス電気	3.9	—	—
フォスター電機	4.1	—	—
ヒロセ電機	—	0.2	2,706
日本航空電子工業	4	—	—
アルパイン	6.5	—	—
横河電機	10.1	0.7	1,127
アズビル	—	2.6	7,852
キーエンス	0.4	0.4	30,292

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
システムックス	1.1	2.3	15,295
スタンレー電気	6.1	—	—
カシオ計算機	—	9.3	12,462
ファナック	2.2	2	39,320
ローム	0.5	0.4	2,512
新光電気工業	—	9.2	6,421
京セラ	3.3	6.2	32,977
太陽誘電	—	7.3	8,577
村田製作所	2.4	3.1	43,493
小糸製作所	0.4	0.6	3,438
ミツバ	—	8.1	12,109
キヤノン	14.2	16.4	50,544
リコー	4	10.5	9,534
東京エレクトロン	1.6	1.5	14,958
<b>輸送用機器 (9.4%)</b>			
ユニプレス	—	5.8	11,803
豊田自動織機	1.3	1.2	6,060
デンソー	5.1	6.3	30,095
三井造船	4	—	—
川崎重工業	28	—	—
日産自動車	31.8	37.1	38,231
いすゞ自動車	10.1	3.5	4,651
トヨタ自動車	31.3	31.3	193,621
日野自動車	0.5	—	—
三菱自動車工業	5.1	—	—
新明和工業	9	—	—
トピー工業	—	0.4	1,066
NOK	5.2	—	—
ケーヒン	—	6.8	11,886
アイシン精機	—	1.3	5,999
アマツ	11.1	13.9	23,866
ダイハツ工業	1	—	—
本田技研工業	21.9	25.1	78,839
スズキ	2.8	7.2	26,726
富士重工業	11	10.6	46,247
ヤマハ発動機	7.9	2.3	5,837
エクトセディ	4.2	3.5	10,692
ヨロズ	1.9	3.7	6,005
シマノ	1.4	0.4	7,224
<b>精密機器 (1.7%)</b>			
テールモ	2.1	2.7	10,665
島津製作所	6	8	13,104
東京精密	1.9	—	—

銘柄	株数	期首	当期	期末
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
ニコン	1.6	9.1	14,196	
オリオン	1.4	1.7	6,383	
タムロン	5.1	—	—	
H O Y A	8.3	4.3	19,225	
シチズン時計	1	22.1	14,387	
セイコーホールディングス	—	28	10,304	
ニプロ	—	4.9	5,855	
<b>その他製品 (1.8%)</b>				
バンダイナムコホールディングス	5.9	4.7	14,593	
トッパン・フォームズ	—	9.4	9,973	
凸版印刷	11	15	15,015	
大日本印刷	14	4	4,160	
アシックス	—	0.4	969	
ヤマハ	0.4	0.8	2,724	
リンテック	3.1	—	—	
任天堂	1.2	1.1	28,105	
コクヨ	9.7	8.9	11,570	
岡村製作所	—	10.4	10,296	
アデランス	9.7	—	—	
<b>電気・ガス業 (1.9%)</b>				
東京電力ホールディングス	21.9	21.9	9,088	
中部電力	14.8	15	23,160	
関西電力	6.5	15.9	16,790	
中国電力	0.9	—	—	
北陸電力	5.1	—	—	
東北電力	2.1	3.2	4,016	
四国電力	—	11.7	11,711	
九州電力	—	0.7	752	
沖縄電力	—	2.7	6,164	
電源開発	4.5	6.4	14,534	
東京瓦斯	41	11	5,227	
大阪瓦斯	21	10	4,249	
東邦瓦斯	14	1	880	
西部瓦斯	—	13	3,172	
<b>陸運業 (4.3%)</b>				
東武鉄道	7	24	12,672	
相鉄ホールディングス	—	22	10,934	
東京急行電鉄	9	10	8,240	
小田急電鉄	1	1.3	2,769	
京王電鉄	2	1	880	
京成電鉄	8	0.5	1,233	
東日本旅客鉄道	5.5	6.1	57,559	
西日本旅客鉄道	3.3	3.8	24,536	

銘柄	株数	期首	当期	期末
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
東海旅客鉄道	2.7	2.6	45,513	
西武ホールディングス	—	0.7	1,405	
鴻池運輸	6.5	—	—	
近鉄グループホールディングス	6	36	15,228	
阪急阪神ホールディングス	26	3.7	12,672	
南海電気鉄道	—	23	11,638	
名古屋鉄道	32	1	523	
日本通運	30	4	2,272	
ヤマトホールディングス	2.5	1.1	2,527	
センコー	—	15.7	12,261	
セイノーホールディングス	1.1	6.9	8,452	
<b>海運業 (0.0%)</b>				
日本郵船	9	3	603	
<b>空運業 (0.4%)</b>				
日本航空	3.7	3.5	11,413	
ANAホールディングス	61	33	9,840	
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>				
住友倉庫	21	21	11,718	
上組	1	—	—	
<b>情報・通信業 (7.9%)</b>				
NECネットエスアイ	5.5	5.2	10,488	
T I S	—	4.3	10,057	
ネクソン	5.9	—	—	
野村総合研究所	—	0.3	1,093	
フジメディア・ホールディングス	7.4	1	1,475	
ヤフー	7.8	2.1	852	
日本オラクル	2.6	—	—	
伊藤忠テクノソリューションズ	3.1	3.3	9,612	
エイベックス・グループ・ホールディングス	8	—	—	
日本ユニシス	—	6.1	8,070	
東京放送ホールディングス	—	7.3	12,395	
日本テレビホールディングス	—	7.9	14,923	
テレビ朝日ホールディングス	—	3.4	6,932	
日本電信電話	21.8	22.7	97,201	
K D D I	27.1	25.9	72,999	
N T T ドコモ	23	23.2	57,257	
東宝	5.1	0.2	625	
東映	—	13	11,752	
エヌ・ティ・ティ・データ	0.8	2.6	14,430	
D T S	4.3	1.2	2,988	
富士ソフト	3.7	3.4	8,666	
ソフトバンクグループ	14.3	12.8	85,504	

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
<b>卸売業 (4.8%)</b>			
双日	4.2	51.5	14,523
ダイワボウホールディングス	57	22	5,962
メディバルホールディングス	0.7	0.4	644
伊藤忠商事	16.7	22.8	33,117
丸紅	38.2	37.5	22,526
長瀬産業	7.8	8.7	12,093
豊田通商	1.1	6	16,098
兼松	51	69	12,489
三井物産	19.8	17.5	26,556
カメイ	2.9	—	—
山善	—	12.6	10,710
住友商事	22.6	23.5	30,855
三菱商事	22.8	14.7	35,912
キヤノンマーケティングジャパン	4.3	3.8	6,623
稲畑産業	—	10.1	11,564
ワキタ	12.8	—	—
伊藤忠エネクス	—	13.5	11,448
加藤産業	—	2.4	5,884
因幡電機産業	3.1	—	—
スズケン	—	0.2	680
<b>小売業 (4.7%)</b>			
ローソン	2	2.3	17,848
エービーシー・マート	1.4	—	—
ゲオホールディングス	—	7.5	8,872
アダストリア	1.5	2.2	6,179
バルグループホールディングス	3.4	—	—
DCMホールディングス	—	11	10,285
Monotaro	4.4	2.7	6,382
マツモトキヨシホールディングス	—	2.4	12,504
スタートトゥデイ	1.1	7	11,914
ココカラファイン	—	2.7	10,665
三越伊勢丹ホールディングス	1.2	—	—
すかいらーく	6	6	9,390
エイトード・スーパーマーケット・ホールディングス	—	4	3,736
セブン&アイ・ホールディングス	9.3	9.4	40,777
ツルハホールディングス	1.4	1.1	12,276
サンマルクホールディングス	3.5	2.7	9,112
良品計画	0.7	0.7	15,239
サイゼリヤ	4.6	—	—
ユニイテッドアローズ	—	4.3	12,083
コロワイド	—	4.1	7,810
ユニ・ファミリーマートホールディングス	2.1	—	—

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コメリ	—	0.4	1,030
しまむら	0.7	1	12,890
アクシアルリテイリング	2.6	0.7	2,649
イオン	9.4	6.4	9,625
ヤオコー	2.4	—	—
ニトリホールディングス	0.6	0.7	8,176
アークス	4.9	4	10,180
ファーストリテイリング	0.8	0.3	11,820
サンドラッグ	—	0.2	1,436
<b>銀行業 (8.7%)</b>			
めぶきフィナンシャルグループ	—	38.2	14,668
ゆうちょ銀行	—	7.7	10,248
コンソリア・フィナンシャルグループ	—	9.6	5,030
あおぞら銀行	31	5	1,935
三菱UFJフィナンシャル・グループ	193.9	200.4	136,833
りそなホールディングス	48	47.2	25,407
三井住友トラスト・ホールディングス	73	3.8	15,891
三井住友フィナンシャルグループ	21.3	20.5	85,895
西日本シティ銀行	5	—	—
千葉銀行	12	12	8,436
横浜銀行	30	—	—
常陽銀行	2	—	—
群馬銀行	13	26	14,430
秋田銀行	2	8	2,896
東邦銀行	26	—	—
ふくおかフィナンシャルグループ	22	24	11,496
スルガ銀行	0.7	—	—
八十二銀行	—	14.2	8,434
山梨中央銀行	—	17	8,755
北國銀行	21	—	—
ほくほくフィナンシャルグループ	33	—	—
山陰合同銀行	—	15.8	12,719
大分銀行	—	21	8,505
宮崎銀行	31	39	12,870
十八銀行	4	4	1,368
セブン銀行	13.9	—	—
みずほフィナンシャルグループ	386.1	398.7	79,341
栃木銀行	—	12.9	6,166
池田泉州ホールディングス	24.9	—	—
<b>証券、商品先物取引業 (1.1%)</b>			
FPG	5.5	—	—
SBIホールディングス	—	11.4	15,732
大和証券グループ本社	35	29	19,589

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
野村ホールディングス	38.4	39	23,279
いちよし証券	—	3.9	3,186
<b>保 険 業 ( 2.6%)</b>			
SOMPOホールディングス	2.4	2.1	7,736
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	5.6	6.1	20,770
ソニーフィナンシャルホールディングス	1	10.6	17,341
第一生命ホールディングス	20	21.2	39,209
東京海上ホールディングス	8.8	8.3	38,968
T&Dホールディングス	16.8	12.9	18,447
<b>その他金融業 ( 1.7%)</b>			
全 国 保 証	3	—	—
クレディセゾン	0.7	7.9	15,239
リコーリース	3.1	3.2	10,416
イオンフィナンシャルサービス	3.6	3.7	6,541
ア コ ム	—	18.3	10,010
日立キャピタル	4.1	3.4	9,220
オリックス	21.1	15.4	27,165
三菱UFJリース	—	24.8	13,020
日本取引所グループ	4.1	1.1	1,809
<b>不 動 産 業 ( 1.9%)</b>			
ヒューリック	0.9	0.9	894
野村不動産ホールディングス	4.1	—	—
東急不動産ホールディングス	0.9	14.4	9,288
飯田グループホールディングス	4.9	1	2,099
パーク24	0.4	2.1	6,730
三井不動産	12	12	31,074
三菱地所	17	16	34,688
住友不動産	5	4	11,784
イオンモール	2.8	—	—
日本空港ビルデング	1.5	0.7	3,010
<b>サ ー ビ ス 業 ( 4.4%)</b>			
日本M&Aセンター	—	2.8	9,030
テンブホールディングス	7.5	4.2	7,186
クックパッド	—	8.8	8,703
総合警備保障	—	2.1	9,324
カカクコム	5.8	7.9	14,441
デイツプ	4.6	2.3	5,924
エムスリー	0.6	—	—
博報堂DYホールディングス	12	12.3	15,965
ファンコミュニケーションズ	14.4	13.3	9,988
電 通	2.2	3.7	19,203
みらかホールディングス	1.6	—	—
オリエンタルランド	1.8	1.5	8,847

銘柄	期首	当期	期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
ダ ス キ ン	5.1	5.5	12,023	
ビー・エム・エル	3	—	—	
サイバーエージェント	3	4.5	12,604	
楽 天	5.6	5.5	6,429	
テクノプロ・ホールディングス	—	3.3	11,715	
リクルートホールディングス	6.9	7.8	33,657	
日 本 郵 政	—	9.7	13,560	
トランス・コスモス	2.5	—	—	
セ コ ム	2.1	3.6	29,062	
メイテック	2.7	2.7	10,962	
ベネッセホールディングス	—	0.3	856	
合 計	株 数 ・ 金 額	4,289	4,230	5,396,361
計	銘 柄 数 < 比 率 >	340	353	< 98.5% >

(注1) 銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注2) 評価額欄の< >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り捨て。

(注4) -印は組み入れなし。

### ○先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国 内	百万円	百万円
T O P I X	71	—

(注1) 単位未満は切り捨て。

(注2) -印は組み入れなし。

## ◎投資信託財産の構成

2016年11月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	5,396,361	98.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	80,566	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	5,476,927	100.0

(注)評価額の単位未満は切り捨て。

## ◎資産、負債、元本及び基準価額の状況

2016年11月16日現在

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	5,476,927,863
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	30,023,808
株 式(評価額)	5,396,361,900
未 収 入 金	3,990,680
未 収 配 当 金	46,671,475
差 入 委 託 証 拠 金	△ 120,000
(B)負 債	1,441
そ の 他 未 払 費 用	1,441
(C)純 資 産 総 額 ( A - B )	5,476,926,422
元 本	4,620,884,576
次 期 繰 越 損 益 金	856,041,846
(D)受 益 権 総 口 数	4,620,884,576口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 ( C / D )	11,853円

## ◎損益の状況

自 2015年11月17日  
至 2016年11月16日

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	118,556,173
受 取 配 当 金	118,447,250
受 取 利 息	1,964
そ の 他 収 益 金	106,959
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 551,329,721
売 買 益	338,968,557
売 買 損	△ 890,298,278
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 7,112,568
取 引 益	8,435,720
取 引 損	△ 15,548,288
(D)信 託 報 酬 等	△ 28,865
(E)当 期 損 益 金 ( A + B + C + D )	△ 439,914,981
(F)前 期 繰 越 損 益 金	1,310,033,840
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	9,622,301
(H)解 約 差 損 益 金	△ 23,699,314
(I)計 ( E + F + G + H )	856,041,846
次 期 繰 越 損 益 金 ( I )	856,041,846

(注1)当親ファンドの期首元本額は4,699,177,563円、期中追加設定元本額は100,547,699円、期中一部解約元本額は178,840,686円です。

(注2)当親ファンドの当期末元本の内訳は、日本株式私募エンハンスインデックスファンド(適格機関投資家専用)4,420,361,879円、明治安田DCトビックスプラス200,522,697円です。

(注3)1口当たり純資産額は1,1853円です。

(注4)損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注5)損益の状況の中で(D)信託報酬等には信託報酬等に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注6)損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注7)損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。