

# 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12期

(決算日 2017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12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)		株式組入比率	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
(第12期) 2017年11月16日	12,303	0	26.1	1,761.71	23.9	97.5	1.8	338

(注1) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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) 2016年11月16日	9,759	—	1,421.65	—	98.0	1.3
11月末	10,102	3.5	1,469.43	3.4	98.6	0.8
12月末	10,497	7.6	1,518.61	6.8	98.7	0.5
2017年 1月末	10,504	7.6	1,521.67	7.0	98.5	0.8
2月末	10,615	8.8	1,535.32	8.0	98.4	0.8
3月末	10,540	8.0	1,512.60	6.4	97.4	1.8
4月末	10,678	9.4	1,531.80	7.7	97.5	1.8
5月末	10,853	11.2	1,568.37	10.3	97.9	1.3
6月末	11,156	14.3	1,611.90	13.4	97.8	1.6
7月末	11,232	15.1	1,618.61	13.9	98.5	0.8
8月末	11,202	14.8	1,617.41	13.8	98.6	0.8
9月末	11,697	19.9	1,674.75	17.8	97.6	1.6
10月末	12,331	26.4	1,765.96	24.2	97.7	1.7
(期末) 2017年11月16日	12,303	26.1	1,761.71	23.9	97.5	1.8

(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入れますので、「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。

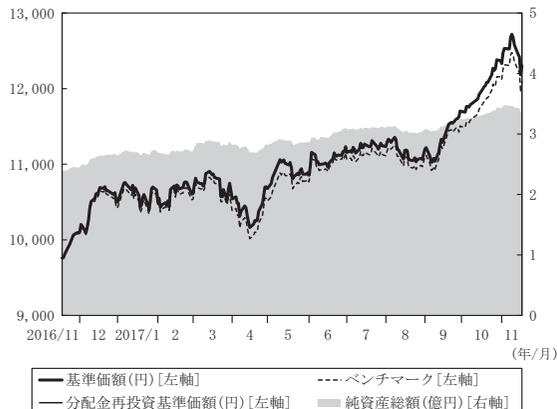
(注3) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎当期中の運用経過と今後の運用方針(2016年11月17日～2017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



※分配金再投資基準価額は分配金実績があった場合、税引前の分配金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。  
※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9,759円で始まり期末12,303円で終わりました。騰落率(分配金込み)は+26.1%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)

- ・国内企業決算が好調だったこと
- ・米国新政権による政策への期待感、良好な米経済指標、好調な企業業績などを背景とした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
- ・衆議院選挙における与党の勝利と政策への期待感が高まったこと

(下落要因)

- ・北朝鮮を巡り地政学リスクが高まったことに加え、米国大統領の保護主義的な発言や米国政権における混乱などから国内株式相場が軟調に推移したこと

(2) ベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+26.1%となりました。一方、ベンチマーク騰落率は+23.9%となり、騰落率の差異は+2.1%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「バリューストック」および「収益予想」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「収益性」ファクターの説明力が不調だったことがマイナスとなりました。また、信託報酬等のファンド運用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12期
	(2016年11月17日～2017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	6,389

(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

(2016年11月17日～2017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
	(2016年11月17日～2017年11月16日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	77 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10,950円です。
(投信会社)	(45)	(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)	(25)	(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)	(7)	(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	0.002	(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)	(0.001)	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	2	0.016	(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)	(1)	(0.012)	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	79	0.720	

(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**(2016年11月17日～2017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 53,506	千円 71,270	千口 30,585	千円 41,150

(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	10,415,967千円
( b ) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	5,887,333千円
( c ) 売 買 高 比 率 ( a ) / ( b )	1.76

(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**(2016年11月17日～2017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 200,522	千口 223,443	千円 336,662

(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(3,871,068千口)です。

◎投資信託財産の構成

2017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インデックスマザーファンド	336,662	98.9
コール・ローン等、その他	3,628	1.1
投資信託財産総額	340,290	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

2017年11月16日現在

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	340,290,865
コール・ローン等	3,028,285
日本株式エンハンス インデックスマザーファンド(評価額)	336,662,580
未 収 入 金	600,000
(B)負 債	1,928,934
未 払 解 約 金	816,324
未 払 信 託 報 酬	1,105,748
そ の 他 未 払 費 用	6,862
(C)純資産総額(A - B)	338,361,931
元 本	275,021,550
次 期 繰 越 損 益 金	63,340,381
(D)受 益 権 総 口 数	275,021,550口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	12,303円

◎損益の状況

自 2016年11月17日  
至 2017年11月16日

項 目	当 期
	円
(A)有価証券売買損益	63,887,797
売 買 益	68,845,185
売 買 損	△ 4,957,388
(B)信託報酬等	△ 2,064,594
(C)当期損益金(A + B)	61,823,203
(D)前期繰越損益金	33,933,316
(E)追加信託差損益金	△ 32,416,138
(配当等相当額)	( 79,768,274)
(売買損益相当額)	(△112,184,412)
(F)計(C + D + E)	63,340,381
(G)収益分配金	0
次期繰越損益金(F + G)	63,340,381
追加信託差損益金	△ 32,416,138
(配当等相当額)	( 79,975,318)
(売買損益相当額)	(△112,391,456)
分配準備積立金	95,756,519

(注1)当ファンドの期首元本額は244,848,610円、期中追加設定元本額は76,812,595円、期中一部解約元本額は46,639,655円です。

(注2)1口当たり純資産額は1,2303円です。

(注3)損益の状況の中で(A)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4)損益の状況の中で(B)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5)損益の状況の中で(E)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6)計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,354,612円)、費用控除後の有価証券等損益額(41,825,995円)、信託約款に規定する収益調整金(79,975,318円)および分配準備積立金(47,575,912円)より分配対象収益は175,731,837円(10,000口当たり6,389円)ですが、当期に分配した金額はありません。

# 日本株式エンハンスインデックスマザーファンド

## 運用報告書

### 第12期

(決算日 2017年11月16日)

「日本株式エンハンスインデックスマザーファンド」は、2017年11月16日に第12期決算を行いました。

以下、当マザーファンドの第12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
(第12期) 2017年11月16日	15,067	27.1	2,560.65	26.5	98.0	1.8	5,832

(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) 2016年11月16日	11,853	—	2,023.85	—	98.5	1.3
11月末	12,275	3.6	2,091.95	3.4	99.1	0.8
12月末	12,765	7.7	2,164.57	7.0	99.2	0.5
2017年 1月末	12,782	7.8	2,169.23	7.2	99.1	0.8
2月末	12,925	9.0	2,189.71	8.2	98.9	0.8
3月末	12,840	8.3	2,176.87	7.6	97.9	1.8
4月末	13,017	9.8	2,204.51	8.9	98.0	1.8
5月末	13,239	11.7	2,257.27	11.5	98.4	1.3
6月末	13,619	14.9	2,324.06	14.8	98.3	1.6
7月末	13,720	15.8	2,333.91	15.3	99.0	0.8
8月末	13,692	15.5	2,332.80	15.3	99.1	0.8
9月末	14,308	20.7	2,434.16	20.3	98.1	1.7
10月末	15,097	27.4	2,566.81	26.8	98.2	1.7
(期末) 2017年11月16日	15,067	27.1	2,560.65	26.5	98.0	1.8

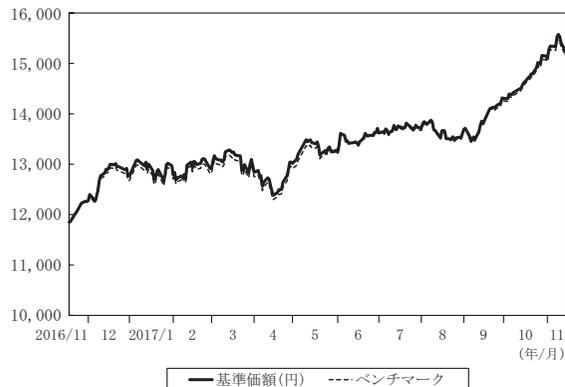
(注1) 騰落率は期首比です。

(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(2016年11月17日～2017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ト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11,853円で始まり期末15,067円で終わりました。騰落率は+27.1%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)

- ・国内企業決算が好調だったこと
- ・米国新政権による政策への期待感、良好な米経済指標、好調な企業業績などを背景とした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
- ・衆議院選挙における与党の勝利と政策への期待感が高まったこと

## (下落要因)

- ・北朝鮮を巡り地政学リスクが高まったことに加え、米国大統領の保護主義的な発言や米国政権における混乱などから国内株式相場が軟調に推移したこと

## (2) ベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+27.1%となりました。一方、ベンチマーク騰落率は+26.5%となり、騰落率の差異は+0.6%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「収益予想」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「収益性」ファクターの説明力が不調だったことがマイナスとなりました。

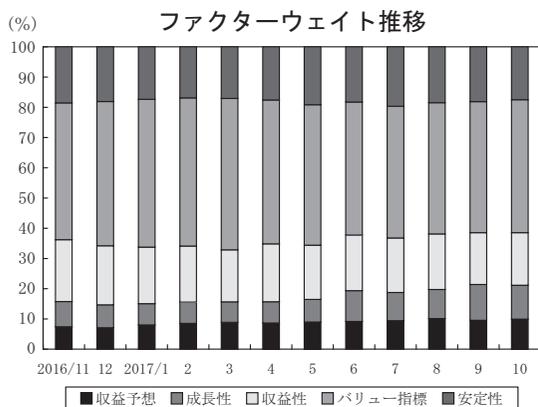
※説明力とは、投資対象ユニバース銘柄について、モデルが示す前月末の個別銘柄の魅力度(アルファ)の順位と、翌月の実際のリターン順位との相関を表した数値です。これがプラス(マイナス)であれば、モデルやファクターが有効(不冴え)だったことを示します。

## 2 運用経過

## 運用概況

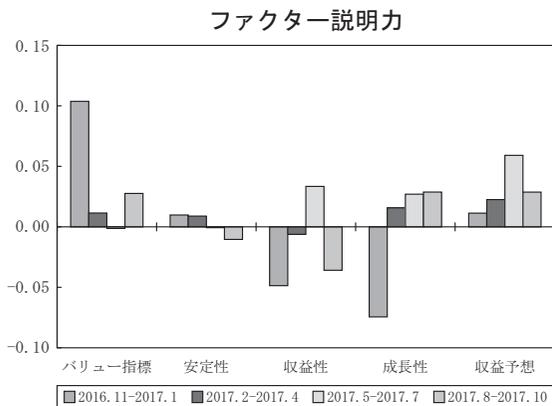
期首の運用方針に基づき、ベンチマークである東証株価指数(TOPIX)配当込みとの乖離を一定限度内に抑制しつつ、中長期的に安定した超過リターンの獲得を目指して運用を行いました。独自の株式魅力度ランキング等、エンハンストインデックス運用に適したクオンツ手法を用いてポートフォリオを構築しました。クオンツ手法とは、マーケットや個別銘柄の価格変動に影響を与える要素(ファクターといいます)を分析・解析したうえで数値化し、計量分析によってポートフォリオを構築する手法です。

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「収益予想」等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「収益性」等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「バリュエ指標」次いで「安定性」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
	(2016年11月17日～2017年11月16日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0 円	0.002 %	(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13,356円です。
(株式)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) その他費用	1	0.011	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(その他)	(1)	(0.011)	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	1	0.013	

(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(2016年11月17日～2017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
		4,272 (△1,041)	4,728,641 ( - )	4,377	5,687,326

(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	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
		757	747	-	-

(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	10,415,967千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	5,887,333千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.76

(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
横 浜 ゴ ム	19.1	41,129	2,153	横 浜 ゴ ム	21.7	48,653	2,242	横 浜 ゴ ム	21.7	48,653	2,242
野村ホールディングス	54.1	35,139	649	トヨタ自動車	6	39,837	6,639	トヨタ自動車	6	39,837	6,639
東 北 電 力	21.6	32,423	1,501	日本電信電話	7.2	38,785	5,386	日本電信電話	7.2	38,785	5,386
平 和 堂	12.9	30,857	2,392	ソフトバンクグループ	4.4	37,129	8,438	ソフトバンクグループ	4.4	37,129	8,438
ヤマハ発動機	10.1	28,220	2,794	太平洋セメント	56.3	36,060	640	太平洋セメント	56.3	36,060	640
ヤ フ ー	55.4	27,812	502	日本 発 條	26.7	31,439	1,177	日本 発 條	26.7	31,439	1,177
ジェイエフイーホールディングス	12.8	26,959	2,106	大和証券グループ本社	45	31,072	690	大和証券グループ本社	45	31,072	690
日 本 発 條	23	26,724	1,161	デ ン カ	28.2	30,052	1,065	デ ン カ	28.2	30,052	1,065
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	98.2	26,354	268	ジー・エス・ユアサ コーポレーション	58	29,846	514	ジー・エス・ユアサ コーポレーション	58	29,846	514
広 島 銀 行	56	26,269	469	T D K	3.6	29,808	8,280	T D K	3.6	29,808	8,280

(注)金額は受渡し代金。

## ◎利害関係人との取引状況等(2016年11月17日～2017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	9.9	8.8	11,066
<b>建設業 (3.1%)</b>			
ミライト・ホールディングス	1	—	—
安藤・間	—	12.5	11,075
コムシスホールディングス	—	0.4	1,180
大成建設	9	0.9	5,463
大林組	5.1	10.7	15,611
清水建設	3	1.3	1,600
長谷工コーポレーション	9	8.8	15,391
鹿島建設	7	8	9,104
西松建設	—	2.7	8,613
大東建設	0.7	0.7	14,329
前田道路	1	4	9,756
五洋建設	—	1	794
住友林業	9.6	7.6	14,181
パナホーム	13	—	—
大和ハウス工業	10.4	6.4	25,843
ライオン工業	—	9.9	11,543
積水ハウス	13.8	13.7	28,715
関電工業	6	—	—
きんでん	9.6	0.4	728
協和エクシオ	—	1.6	3,995
太平電業	9	—	—
大気	4.4	—	—
<b>食料品 (3.9%)</b>			
日本製粉	8	—	—
日清製粉グループ本社	7.8	—	—
昭和産業	19	0.9	2,507
三井製糖	4	2.5	10,862
江崎グリコ	—	0.1	556
山崎製パン	4.5	0.3	624
カルビー	0.3	—	—
ヤクルト本社	0.3	0.1	887
明治ホールディングス	1.2	2.7	26,136
プリマハム	—	8	5,984
丸大食品	20	—	—
伊藤ハム米久ホールディングス	—	11.1	11,155
アサヒグループホールディングス	6.3	6.9	36,984
キリンホールディングス	14.9	13.9	37,036
コカ・コーラボトラーズジャパン	2.7	0.6	2,484
コカ・コーライーストジャパン	4.4	—	—
サントリー食品インターナショナル	3	3.9	18,915

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
伊藤園	3.9	3.4	13,923
キッコーマン	3	0.3	1,201
味の素	10.1	3.8	7,961
ハウス食品グループ本社	—	0.2	706
カゴメ	—	0.2	795
東洋水産	0.7	—	—
日清食品ホールディングス	0.3	0.3	2,337
日本たばこ産業	14.3	11.5	42,964
<b>繊維製品 (0.7%)</b>			
ゼン	—	1.3	6,708
帝人	7.4	6.7	15,832
東レ	11	7.6	8,595
ワコールホールディングス	11	—	—
オンワードホールディングス	—	13	11,895
<b>パルプ・紙 (0.4%)</b>			
王子ホールディングス	2	4	2,704
北越紀州製紙	12.6	12.1	7,731
ザ・パツク	4.2	3.2	11,760
<b>化学 (7.3%)</b>			
クラレ	9.3	7	15,722
旭化成	20	18.2	25,944
昭和電工	—	2.9	11,875
住友化学	40	31	25,203
住友精化	—	2	13,600
日産化学工業	—	2	8,730
東ソニー	19	5.1	12,632
セントラル硝子	25	—	—
東亜合成	—	8.4	11,894
デケン	21	—	—
信越化学工業	3.5	3.2	39,632
エア・ウォーター	0.4	5.9	13,611
カネ	16	15	14,220
三菱瓦斯化学	—	0.7	2,156
三井化学	28	3.1	10,819
JSR	4.4	7.6	16,628
三菱ケミカルホールディングス	35.8	13.4	15,611
ダイセル	10.8	10.8	13,942
住友ベークライト	12	—	—
積水化学工業	9.4	6.8	14,960
日本ゼオン	—	1.1	1,651
宇アイカ工業	—	2.9	11,034
宇部興産	61	—	—
日立化成	—	4.3	13,351

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ダイキョーニシカワ	7.5	—	—
日本化薬	—	5.8	9,842
ADEKA	6.3	0.5	926
花王	5.7	4.7	33,304
中国塗料	11.9	—	—
DI	—	0.4	1,642
東洋インキSCホールディングス	—	18	11,790
富士フイルムホールディングス	7.3	6.5	29,224
資生堂	2.7	1.6	8,358
ファンケル	5.9	—	—
ポーラ・オルビスホールディングス	—	0.3	1,180
デクセリアルズ	—	8.8	12,144
東電工業	1.1	1.2	13,272
ユニ・チャーム	1.2	1.2	3,405
<b>医薬品 (4.2%)</b>			
協和発酵キリン	8.5	0.5	1,086
武田薬品工業	8	7.1	43,991
アステラス製薬	33.7	30.3	44,510
日本住友製薬	—	8.5	14,441
塩野義製薬	4.6	4.2	26,817
田辺三菱製薬	8.4	6.2	14,774
中外製薬	1	3.3	18,843
科研製薬	0.1	—	—
エーザイ	3.9	1.9	12,091
エーザイ	0.5	2.3	6,453
小野薬品工業	2.8	3.4	8,379
久光製薬	—	1.5	9,645
参天製薬	7.4	—	—
化学工業	5.3	—	—
JCRファーマ	3.7	—	—
沢井製薬	—	1.7	10,421
第一三共	9.9	2.4	6,390
キョーリン製薬ホールディングス	5.3	3.5	7,651
大塚ホールディングス	4.6	3.2	15,660
大正製薬ホールディングス	—	0.1	868
<b>石油・石炭製品 (0.3%)</b>			
東燃ゼネラル石油	1	—	—
出光興産	—	0.5	1,720
JXTGホールディングス	27.5	27.5	16,775
<b>ゴム製品 (1.1%)</b>			
横浜ゴム	7.6	5	12,100
ブリヂストン	11.4	7	34,342
住友ゴム工業	—	3.1	6,032
住友理工	—	5.1	5,849
住友三ツ星ベルト	—	4	5,720
<b>ガラス・土石製品 (0.9%)</b>			
日東紡績	19	—	—

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
旭硝子	20	4.4	20,438
日本電気硝子	—	0.3	1,374
住友大阪セメント	29	—	—
太平洋セメント	44	—	—
ノリタケカンパニーリミテド	—	0.3	1,503
日本碍子	—	0.5	1,051
日本特殊陶業	1.2	6.4	15,904
ニチアス	—	8	11,304
<b>鉄鋼 (1.2%)</b>			
新日鐵住金	9.7	7.3	18,669
神戸製鋼所	—	4.1	4,272
ジェイエフイーホールディングス	1.5	9.9	23,799
日新製鋼	—	4	6,460
東京製鐵	—	12.9	12,474
共英製鋼	4.8	—	—
丸一銅管	—	0.5	1,537
大同特殊鋼	21	—	—
山陽特殊製鋼	21	—	—
日立金属	7.1	—	—
<b>非鉄金属 (1.2%)</b>			
日本軽金属ホールディングス	44.3	41	12,792
東邦亜鉛	—	1.5	9,270
三菱マテリアル	4	3.3	13,414
住友金属鉱山	—	0.3	1,330
DOWAホールディングス	—	0.9	4,104
住友電気工業	17.7	14.2	26,518
<b>金属製品 (0.9%)</b>			
文化シヤッター	—	7	6,979
三協立山	5.5	—	—
LIXILグループ	1	1.6	4,608
ノーリツ	4	5.1	10,582
リンナイ	0.1	1.6	15,840
日本発條	13.2	9.5	11,694
<b>機械 (5.4%)</b>			
オクマ	14	—	—
アマダホールディングス	13.4	2.2	3,187
牧野フライス製作所	15	—	—
オーエスジー	—	3.3	7,854
ソデック	13.1	—	—
ナブテスコ	—	1.9	8,293
SMMC	0.5	0.5	23,210
小松製作所	9.1	8.4	30,366
住友重機械工業	26	0.2	976
クボタ	10.1	10.5	20,448
新東工	—	2.2	3,036
ダイキン工業	3	2.7	34,762
栗田工業	0.9	3.6	12,168

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
椿本チエイン	13	13	11,791
タダ	8	—	—
C K D	—	1.4	3,515
平和	0.4	—	—
竹内製作所	—	4.9	11,162
アマ	3.4	—	—
J U K I	—	5	10,255
マック	5	7.6	11,597
グロリー	—	0.3	1,195
セガサミーホールディングス	—	8	11,152
T P R	—	1.5	5,782
ホシザキ	—	0.1	1,034
日本精工	11.3	10.5	17,671
N T N	—	1.9	1,054
ジェイテクト	7.1	8.7	17,382
不二越	—	14	10,024
T H K	—	3.5	14,245
アマキ	0.9	1.3	6,077
日立造船	—	20	11,980
三菱重工	53	2.7	11,167
I H I	30	2.2	7,612
<b>電気機器 (14.5%)</b>			
イビデ	7	—	—
ニカミノルタ	15.2	16.4	17,006
ブラザー工業	1	4.7	13,771
ミネベアミツミ	1.5	1.8	4,080
日立製作所	77	63	53,965
東芝	26	—	—
三菱電機	34.4	27.1	50,622
富士電機	4	—	—
安川電機	—	1.4	6,398
明電舎	—	26	11,336
東芝テック	—	13	8,801
ブリヂストン	—	2.5	15,050
日本電産	2.3	2	31,740
J V C ケンウッド	—	36.4	13,067
日新電機	—	8.6	12,186
大崎電気工業	—	12.5	9,812
オムロン	1.7	1.9	12,597
ジーエス・ユアサコーポレーション	28	—	—
日本電気	68	2.1	6,174
富士通	28	33	27,512
沖電気工業	—	7.2	11,448
セイコーエプソン	—	1	2,666
アルパック	—	1	8,650
E I Z O	—	2.1	10,132
エレコム	—	3.4	8,367

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
パナソニック	34.1	22.5	37,766
ソニー	16.4	13	67,301
T D K	2.8	0.2	1,734
アルプス電気	—	4.4	15,994
ヒロセ電機	0.2	—	—
日本航空電子工業	—	6	12,906
横河電機	0.7	1	2,139
アズビ	2.6	0.5	2,412
堀場製作所	—	0.1	733
キーエンス	0.4	0.9	60,291
シスメック	2.3	0.7	5,593
オプテックスグループ	—	2.4	11,160
スタシオ	—	0.5	2,125
カシオ計算機	9.3	6.6	11,055
ファナック	2	1.9	52,212
ローム	0.4	1.2	14,328
新光電気工業	9.2	9.7	8,322
太陽誘電	6.2	3	24,066
村田製作所	7.3	—	—
K O A	3.1	1.9	30,314
—	—	4	9,476
小糸製作所	0.6	0.7	5,285
ミツ	8.1	—	—
SCREENホールディングス	—	0.8	8,488
キヤノ	16.4	14.9	64,219
リコー	10.5	—	—
東京エレクトロン	1.5	1.9	43,586
<b>輸送用機器 (8.9%)</b>			
トヨタ紡織	—	0.3	651
ユニブレス	5.8	2.5	7,887
豊田自動織機	1.2	0.7	4,725
デンソー	6.3	5.7	36,742
日産自動車	37.1	35.4	37,683
いすゞ自動車	3.5	5	8,502
トヨタ自動車	31.3	26.4	183,796
極東開発工業	—	4.2	8,013
トピー工業	0.4	—	—
プレス工業	—	13.5	9,207
ケーヒン	6.8	4.4	9,754
アイシン精機	1.3	3.3	19,668
アマツ	13.9	5.3	8,042
本田技研工業	25.1	20.8	76,128
スズキ	7.2	3.8	22,788
S U B A R U	10.6	9.7	35,133
ヤマハ発動機	2.3	6.5	22,912
E Y クセロ	3.5	3.6	11,808
エロ	3.7	—	—

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
精密機器 (1.9%)	0.4	0.2	3,082
シマノ			
テールモ	2.7	1	4,970
島津製作所	8	0.5	1,318
ニコン	9.1	6	13,836
トプコン	—	5.2	12,885
オリパス	1.7	4.4	19,382
H O Y A	4.3	6.5	38,181
シチズン時計	22.1	14.3	11,740
セイコーホールディングス	28	2.3	6,969
ニプロ	4.9	—	—
その他製品 (2.1%)			
パラマウントベッドホールディングス	—	2.3	11,960
バンダイナムコホールディングス	4.7	4.7	18,259
トッパン・フォームズ	9.4	—	—
凸版印刷	15	16	16,928
大日本印刷	4	3.6	8,881
アシックス	0.4	5.2	7,961
ヤマハ	0.8	—	—
ピジヨ	—	0.3	1,210
任天堂	1.1	1.1	49,269
コクヨ	8.9	2.9	5,942
岡村製作所	10.4	—	—
電気・ガス業 (1.6%)			
東京電力ホールディングス	21.9	18.1	7,982
中部電力	15	3.9	5,536
関西電力	15.9	15.7	22,922
東北電力	3.2	11	16,269
四国電力	11.7	10	14,220
九州電力	0.7	—	—
沖縄電力	2.7	—	—
電源開発	6.4	3.7	11,470
東京瓦斯	11	3.2	8,520
大阪瓦斯	10	2.3	4,922
大東瓦斯	1	—	—
西武瓦斯	13	—	—
陸運業 (3.9%)			
東武鉄道	24	1.1	3,707
相鉄ホールディングス	22	2.6	7,306
東京急行電鉄	10	12.4	20,559
小田急電鉄	1.3	0.7	1,564
京王電鉄	1	0.2	930
京成電鉄	0.5	—	—
東日本旅客鉄道	6.1	5	54,225
西日本旅客鉄道	3.8	3.4	26,785
東海旅客鉄道	2.6	1.8	36,423
西武ホールディングス	0.7	0.5	1,015

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
近鉄グループホールディングス	36	3.1	12,973
阪急阪神ホールディングス	3.7	1.6	6,744
南海電気鉄道	23	—	—
名古屋鉄道	1	4.6	11,766
日本通運	4	0.2	1,380
ヤマトホールディングス	1.1	0.9	1,896
センコーグループホールディングス	15.7	15.3	11,536
ニッコンホールディングス	—	0.3	857
セイノーホールディングス	6.9	—	—
日立物流	—	4	10,704
九州旅客鉄道	—	3.6	12,366
海運業 (0.0%)			
日本郵船	3	—	—
商船三井	—	0.5	1,792
空運業 (0.4%)			
日本航空	3.5	2.8	11,264
ANAホールディングス	33	3.1	13,308
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
住友倉庫	21	16	12,224
情報・通信業 (8.3%)			
NECネットエスアイ	5.2	2.4	6,948
新日鉄住金ソリューションズ	—	2.9	7,728
T I S	4.3	—	—
ネクスン	—	1.4	4,571
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	—	30.3	9,090
野村総合研究所	0.3	0.9	4,455
フジ・メディア・ホールディングス	1	0.6	960
ヤフー	2.1	37.7	19,113
トレンドマイクロ	—	2.7	16,821
伊藤忠テクノソリューションズ	3.3	—	—
ネットワンシステムズ	—	2.1	3,194
日本ユニシス	6.1	5.5	11,379
東京放送ホールディングス	7.3	4.9	12,563
日本テレビホールディングス	7.9	3.9	7,874
テレビ朝日ホールディングス	3.4	4.5	10,534
スカパーJ SATホールディングス	—	23.5	11,397
日本電信電話	22.7	16.3	94,817
K D D I	25.9	24.1	72,251
N T T ドコモ	23.2	20.4	57,079
東宝	0.2	3.8	13,927
東映	13	—	—
エヌ・ティ・ティ・データ	2.6	—	—
D T S	1.2	—	—
カブコン	—	4.1	12,874
富士ソフト	3.4	3.1	11,036
ソフトバンクグループ	12.8	8.8	84,004

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 (4.5%)</b>			
双日	51.5	21.9	7,161
ダイワボウホールディングス	22	—	—
TOKAIホールディングス	—	11.3	9,706
メディカルホールディングス	0.4	0.5	1,094
伊藤忠商事	22.8	19	35,710
丸紅	37.5	34.4	24,840
長瀬産業	8.7	5.3	10,854
豊田通商	6	0.8	3,324
兼松	69	4.4	5,970
三井物産	17.5	23.3	38,048
日立ハイテクノロジーズ	—	0.3	1,495
山日	12.6	—	—
住友商事	23.5	20.1	33,335
三菱商事	14.7	14.9	40,900
キャノンマーケティングジャパン	3.8	—	—
稲畑産業	10.1	7.4	12,247
ワキタ	—	9.4	12,840
伊藤忠エネクス	13.5	9.7	10,543
加藤産業	2.4	—	—
因幡電機産業	—	2.2	10,879
スズケン	0.2	—	—
<b>小売業 (5.2%)</b>			
ローソン	2.3	1.9	14,022
エービーシー・マート	—	1.6	9,136
ゲオホールディングス	7.5	—	—
アダストリア	2.2	4.9	11,642
DCMホールディングス	11	11.1	11,366
Monotaro	2.7	—	—
マツモトキヨシホールディングス	2.4	—	—
スタートトゥデイ	7	3.1	9,625
ココカラファイン	2.7	—	—
すかいらーく	6	7.4	12,380
エイトード・スーパーマーケット・ホールディングス	4	10.8	11,502
セブン&アイ・ホールディングス	9.4	7.9	36,016
ツルハホールディングス	1.1	0.1	1,419
サンマルクホールディングス	2.7	—	—
良品計画	0.7	0.2	6,620
コーナン商事	—	4.9	11,015
西松屋チェーン	—	6	7,440
ユニテッドアローズ	4.3	—	—
コロワイド	4.1	—	—
スギホールディングス	—	2.1	12,180
エニ・ファミリーマートホールディングス	—	1.8	11,952
島忠	—	1.8	5,589
コマ	0.4	—	—
青山商事	—	2.8	11,312

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
しまむら	1	0.9	11,331
高島屋	—	1	1,047
アクシアルリテイリング	0.7	0.6	2,481
イオン	6.4	5.6	9,696
イズミ	—	0.2	1,204
平和堂	—	4.4	10,472
ケーズホールディングス	—	3.9	10,530
ヤマダ電機	—	22.1	12,818
ニトリホールディングス	0.7	0.5	8,302
王将フードサービス	—	1.2	5,874
アークス	4	5.1	12,913
パローホールディングス	—	3.7	9,020
ファーストリテイリング	0.3	0.5	19,895
サンドラッグ	0.2	0.2	984
<b>銀行業 (7.4%)</b>			
めぶきフィナンシャルグループ	38.2	—	—
ゆうちょ銀行	7.7	12.9	17,750
コンソルディア・フィナンシャルグループ	9.6	5.2	3,016
あおぞら銀行	5	—	—
三菱UFJフィナンシャル・グループ	200.4	169.4	125,135
りそなホールディングス	47.2	17.9	10,548
三井住友トラスト・ホールディングス	3.8	3.4	13,831
三井住友フィナンシャルグループ	20.5	19.1	83,237
千葉銀行	12	—	—
群馬銀行	26	13.1	8,672
武蔵野銀行	—	3	10,230
七十七銀行	—	2.4	6,302
秋田銀行	8	—	—
ふくおかフィナンシャルグループ	24	25	13,875
スルガ銀行	—	0.7	1,622
八十二銀行	14.2	1.4	903
山梨中央銀行	17	—	—
南都銀行	—	3.8	11,335
百五銀行	—	10.5	5,323
ほくほくフィナンシャルグループ	—	0.8	1,300
広島島銀行	—	10.7	9,266
山陰合同銀行	15.8	—	—
伊予銀行	—	1.2	1,033
百十四銀行	—	26	9,776
大分銀行	21	0.7	3,055
宮崎銀行	39	—	—
十八銀行	4	12	3,456
みずほフィナンシャルグループ	398.7	357.7	70,824
栃木銀行	12.9	—	—
東和銀行	—	8	10,248
<b>証券、商品先物取引業 (1.3%)</b>			
SBIホールディングス	11.4	—	—

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ジャフコ	—	2.4	13,824
大和証券グループ本社	29	23	16,090
野村ホールディングス	39	57.4	36,948
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	—	8.6	5,977
いちょし証券	3.9	—	—
<b>保 険 業 (2.0%)</b>			
かんぽ生命保険	—	0.3	701
SOMPOホールディングス	2.1	1.9	8,489
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	6.1	9.3	34,614
ソニーフィナンシャルホールディングス	10.6	3.1	5,536
第一生命ホールディングス	21.2	11.1	23,798
東京海上ホールディングス	8.3	7.4	35,068
T&Dホールディングス	12.9	2.5	4,260
<b>その他金融業 (1.2%)</b>			
クレディセゾン	7.9	2.8	5,852
興銀リース	—	2.1	5,775
リコーリース	3.2	—	—
イオンフィナンシャルサービス	3.7	—	—
アコム	18.3	—	—
日立キャピタル	3.4	4.8	12,974
オリックス	15.4	20.1	37,657
三菱UFJリース	24.8	3.3	1,907
日本取引所グループ	1.1	0.9	1,767
<b>不 動 産 業 (1.7%)</b>			
ヒューリック	0.9	—	—
東急不動産ホールディングス	14.4	1.8	1,402
飯田グループホールディングス	1	5	9,825
パーク24	2.1	2.7	7,190
三井不動産	12	12.5	32,212
三菱地所	16	13.9	28,342
住友不動産	4	4	15,108
イオンモール	—	0.4	784
日本空港ビルデング	0.7	—	—
<b>サ ー ビ ス 業 (4.1%)</b>			
日本M&Aセンター	2.8	—	—
パーソルホールディングス	4.2	3.1	8,345
クックパッド	8.8	—	—
総合警備保障	2.1	1.8	10,494
カカクコム	7.9	9.2	15,226
ディップ	2.3	3.3	8,929
エムスリー	—	0.3	1,080
博報堂DYホールディングス	12.3	8.9	13,127
ぐるなび	—	7.2	9,720
ファンコミュニケーションズ	13.3	—	—
電通	3.7	1.9	9,262
オリエンタルランド	1.5	1.2	11,388
ダスキン	5.5	3.4	9,717

銘柄	期首	当期	期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
ユー・エス・エス	—	1.1	2,587	
サイバーエージェント	4.5	3.2	12,784	
楽天	5.5	3.9	4,395	
テクノプロ・ホールディングス	3.3	1.9	10,089	
リクルートホールディングス	7.8	17.4	46,632	
日本郵政	9.7	9.2	11,454	
カナモト	—	3.3	11,995	
トランス・コスモス	—	4.2	10,575	
セコム	3.6	3.5	29,158	
メイテック	2.7	—	—	
ベネッセホールディングス	0.3	—	—	
合 計	株数・金額	4,230	3,083	5,717,490
計	銘柄数<比率>	353	389	<98.0%>

(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
TOPIX	105	—

(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

2017年11月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	5,717,490	98.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	115,645	2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	5,833,135	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

2017年11月16日現在

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	5,833,135,662
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	60,206,091
株 式 (評価額)	5,717,490,420
未 収 入 金	8,619,816
未 収 配 当 金	51,154,335
差 入 委 託 証 拠 金	△ 4,335,000
(B)負 債	602,727
未 払 解 約 金	600,000
そ の 他 未 払 費 用	2,727
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	5,832,532,935
元 本	3,871,068,440
次 期 繰 越 損 益 金	1,961,464,495
(D)受 益 権 総 口 数	3,871,068,440口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	15,067円

## ◎損益の状況

自 2016年11月17日  
至 2017年11月16日

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	131,301,075
受 取 配 当 金	131,211,100
そ の 他 収 益 金	89,975
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	1,279,813,774
売 買 益	1,390,963,780
売 買 損	△ 111,150,006
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	24,654,920
取 引 益	28,020,840
取 引 損	△ 3,365,920
(D)信 託 報 酬 等	△ 652,256
(E)当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	1,435,117,513
(F)前 期 繰 越 損 益 金	856,041,846
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	17,763,600
(H)解 約 差 損 益 金	△ 347,458,464
(I)計 (E + F + G + H)	1,961,464,495
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	1,961,464,495

(注1)当親ファンドの期首元本額は4,620,884,576円、期中追加設定元本額は53,506,400円、期中一部解約元本額は803,322,536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)3,647,624,768円、明治安田DCトビックスプラス223,443,672円です。

(注3)1口当たり純資産額は1,5067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。