

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	
運用方針	わ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	わ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	わ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14期

(決算日 2019年11月18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14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
(第13期) 2018年11月16日	11,394	0	△7.4	1,629.30	△7.5	97.0	2.2	323
(第14期) 2019年11月18日	12,093	0	6.1	1,700.72	4.4	97.5	2.0	334

(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) 2018年11月16日	11,394	—	1,629.30	—	97.0	2.2
11月末	11,643	2.2	1,667.45	2.3	97.0	2.2
12月末	10,442	△8.4	1,494.09	△8.3	97.9	1.1
2019年 1月末	10,973	△3.7	1,567.49	△3.8	98.7	0.7
2月末	11,201	△1.7	1,607.66	△1.3	98.7	0.7
3月末	11,154	△2.1	1,591.64	△2.3	97.9	1.5
4月末	11,320	△0.6	1,617.93	△0.7	97.5	1.9
5月末	10,581	△7.1	1,512.28	△7.2	97.4	1.9
6月末	10,866	△4.6	1,551.14	△4.8	97.0	2.3
7月末	10,996	△3.5	1,565.14	△3.9	98.1	1.1
8月末	10,630	△6.7	1,511.86	△7.2	97.9	1.1
9月末	11,295	△0.9	1,587.80	△2.5	97.5	2.0
10月末	11,866	4.1	1,667.01	2.3	97.4	2.0
(期末) 2019年11月18日	12,093	6.1	1,700.72	4.4	97.5	2.0

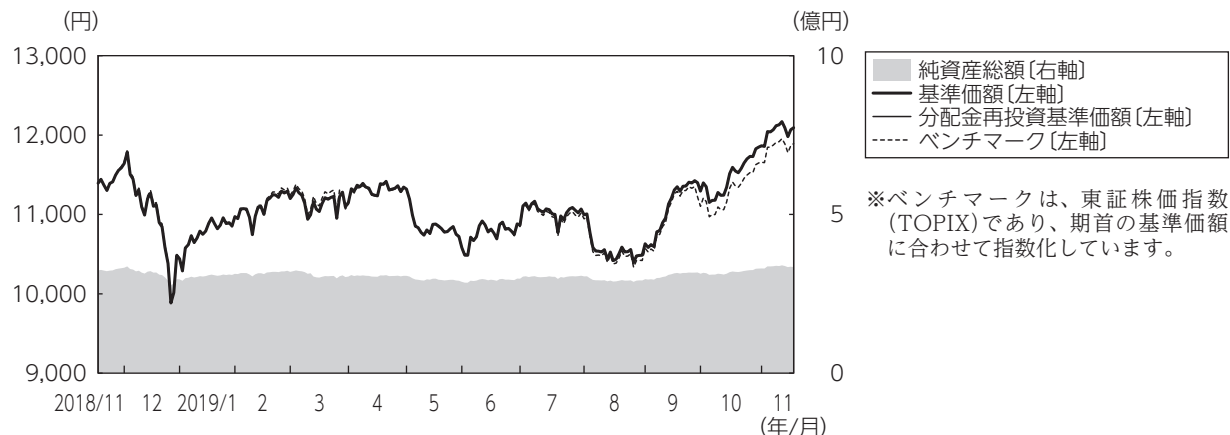
(注1) 騰落率は期首比です。

(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。

運用経過の説明

■ 基準価額等の推移



第14期首(2018年11月16日)：11,394円

第14期末(2019年11月18日)：12,093円(既払分配金0円)

騰落率：6.1%(分配金再投資ベース)

※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。

※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。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。

■ 基準価額の主な変動要因

ファンドの運用方針に従い「日本株式エンハンスインデックスマザーファンド」を通じて、わが国の株式を主要投資対象としました。投資対象資産の価格変動等による基準価額の変動要因は以下の通りとなりました。

(上昇要因)

- ・2019年9月から期末にかけて米中貿易協議が進展するとの見方やユーロ圏の金融緩和姿勢が鮮明になったことが好感され、国内株式相場が上昇基調となったこと

(下落要因)

- ・2018年12月に米中貿易摩擦への警戒感や世界的な景気減速懸念から国内株式相場が下落したこと

■投資環境

当期の国内株式相場は上昇しました。期首から12月にかけて、米中貿易摩擦への警戒感や世界的な景気減速懸念から下落しましたが、2019年1月から4月にかけては米国の利上げ休止観測や12月の株式相場急落を受けた自律反発狙いの買いなどから上昇基調となりました。その後、米中貿易摩擦への再燃などから下落しましたが、9月から期末にかけては米中貿易協議が進展するとの見方やユーロ圏の金融緩和姿勢が鮮明になったことが好感され、大きく上昇しました。

■当該投資信託のポートフォリオ

明治安田DCトピックスプラス

期首の運用方針に基づき、期を通じて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比率を高位に維持しました。

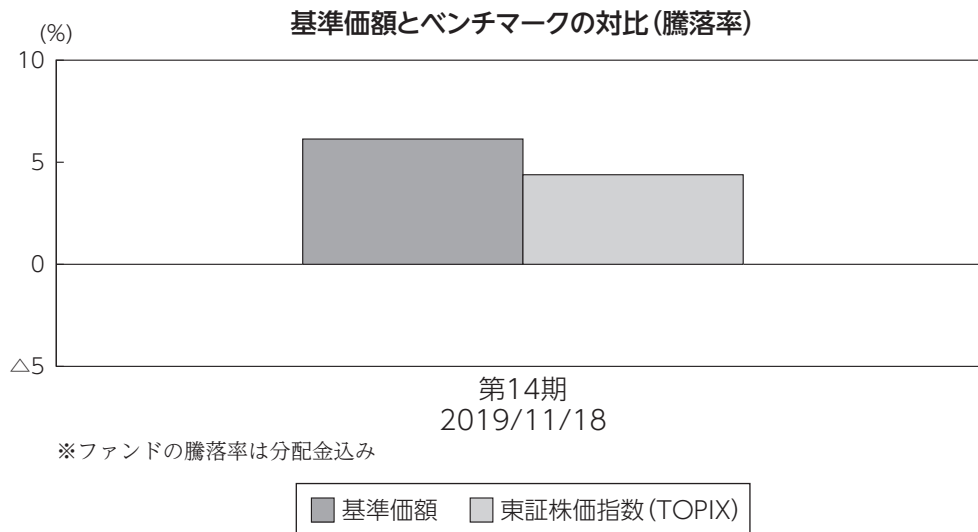
日本株式エンハンストインデックスマザーファンド

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。

投資行動としては、期を通じて、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。）

期中のファクターウェイトは、ファクター間のバランスを重視した均等ウェイトを適用しました。

■当該投資信託のベンチマークとの差異



当期の基準価額の騰落率は+6.1%となりました。一方、ベンチマーク騰落率は+4.4%となり、騰落率の差異は+1.8%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)

- ・通期では「成長性」および「安定性他」ファクターの説明力が良好だったこと、2019年7月および9月において最終合成ファクターの説明力が上昇し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)

- ・2019年2月および3月において「バリュースコア」ファクターの不冴えを主因に最終合成ファクターの説明力が低下し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。

■ 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いただきます。
- ・ 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14期
	(2018年11月17日~2019年11月18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	6,855

(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。

今後の運用方針

明治安田DCトピックスプラス

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比率を高位に維持する方針です。

日本株式エンハンストインデックスマザーファンド

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
	(2018年11月17日～2019年11月18日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	80 円	0.719 %	(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11,080円です。
(投信会社)	(47)	(0.420)	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)	(26)	(0.232)	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)	(0.066)	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	1	0.009	(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)	(1)	(0.008)	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	1	0.006	(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)	(0.002)	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	82	0.734	

(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。

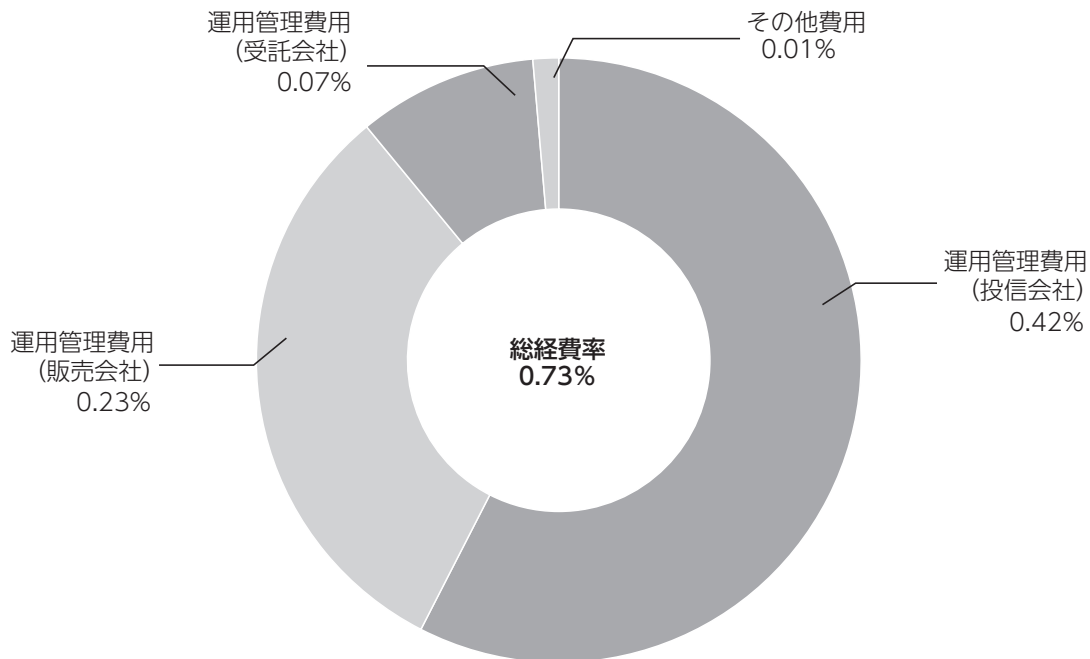
(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(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。

(参考情報) 総経費率

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0.73%です。



(注) 費用は、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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

◎**売買及び取引の状況**(2018年11月17日～2019年11月18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 インデックスマザーファンド	千口 24,409	千円 33,380	千口 32,485	千円 44,590

(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インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	8,562,918千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,099,892千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.08

(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**(2018年11月17日～2019年11月18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 インデックスマザーファンド	千口 229,433	千口 221,357	千円 332,456

(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(2,881,965千口)です。

◎投資信託財産の構成

2019年11月18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	332,456	98.1
コール・ローン等、その他	6,602	1.9
投資信託財産総額	339,058	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

2019年11月18日現在

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	339,058,757
コール・ローン等	3,522,266
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)	332,456,491
未 収 入 金	3,080,000
(B)負 債	4,938,692
未 払 解 約 金	3,832,576
未 払 信 託 報 酬	1,099,268
そ の 他 未 払 費 用	6,848
(C)純資産総額(A - B)	334,120,065
元 本	276,291,485
次 期 繰 越 損 益 金	57,828,580
(D)受 益 権 総 口 数	276,291,485口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,093円

◎損益の状況

自 2018年11月17日
至 2019年11月18日

項 目	当 期
	円
(A)有価証券売買損益	22,600,215
売 買 益	24,275,381
売 買 損	△ 1,675,166
(B)信 託 報 酬 等	△ 2,191,901
(C)当期損益金(A + B)	20,408,314
(D)前 期 繰 越 損 益 金	48,983,377
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	△ 11,563,111
(配 当 等 相 当 額)	(106,839,056)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△118,402,167)
(F)計(C + D + E)	57,828,580
(G)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F + G)	57,828,580
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 11,563,111
(配 当 等 相 当 額)	(106,920,505)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△118,483,616)
分 配 準 備 積 立 金	82,478,279
繰 越 損 益 金	△ 13,086,588

(注1)当ファンドの期首元本額は284,227,963円、期中追加設定元本額は39,646,692円、期中一部解約元本額は47,583,170円です。

(注2)1口当たり純資産額は1,2093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(7,275,557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(106,920,505円)および分配準備積立金(75,202,722円)より分配対象収益は189,398,784円(10,000口当たり6,855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トインデックスマザーファンド

運用報告書

第14期

(決算日 2019年11月18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、2019年11月18日に第14期決算を行いました。

以下、当マザーファンドの第14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	わ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	わ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
	円	騰落率 %	円	騰落率 %			
(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
(第13期) 2018年11月16日	14,047	△ 6.8	2,419.19	△ 5.5	97.5	2.2	4,398
(第14期) 2019年11月18日	15,019	6.9	2,590.37	7.1	97.9	2.0	4,328

(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(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)配当込み (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
	円	騰落率 %	円	騰落率 %		
(期首) 2018年11月16日	14,047	—	2,419.19	—	97.5	2.2
11月末	14,359	2.2	2,475.92	2.3	97.5	2.2
12月末	12,877	△8.3	2,223.11	△8.1	98.4	1.1
2019年 1月末	13,544	△3.6	2,332.52	△3.6	99.1	0.7
2月末	13,835	△1.5	2,393.08	△1.1	99.2	0.7
3月末	13,784	△1.9	2,395.21	△1.0	98.4	1.5
4月末	13,998	△0.3	2,434.82	0.6	98.0	1.9
5月末	13,089	△6.8	2,275.96	△5.9	97.9	1.9
6月末	13,450	△4.3	2,338.89	△3.3	97.6	2.3
7月末	13,621	△3.0	2,360.18	△2.4	98.5	1.1
8月末	13,173	△6.2	2,280.58	△5.7	98.4	1.1
9月末	14,009	△0.3	2,418.29	△0.0	98.0	2.0
10月末	14,731	4.9	2,539.02	5.0	97.9	2.0
(期末) 2019年11月18日	15,019	6.9	2,590.37	7.1	97.9	2.0

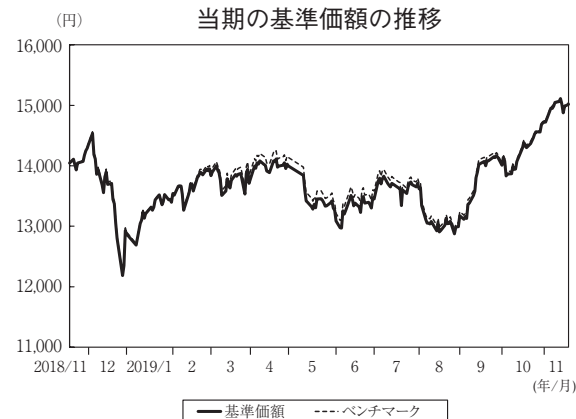
(注1) 騰落率は期首比です。

(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(2018年11月17日～2019年11月18日)

1 基準価額

(1) 基準価額の推移と主な変動要因



※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14,047円で始まり期末15,019円で終わりました。騰落率は+6.9%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)

- ・2019年9月から期末にかけて米中貿易協議が進展するとの見方やユーロ圏の金融緩和姿勢が鮮明になったことが好感され、国内株式相場が上昇基調となったこと

(下落要因)

- ・2018年12月に米中貿易摩擦への警戒感や世界的な景気減速懸念から国内株式相場が下落したこと

(2) ベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+6.9%となりました。一方、ベンチマーク騰落率は+7.1%となり、騰落率の差異は $\Delta 0.2\%$ 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)

- ・通期では「成長性」および「安定性他」ファクターの説明力が良好だったこと、2019年7月および9月

において最終合成ファクターの説明力が上昇し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)

- ・2019年2月および3月において「バリュエ指標」ファクターの不冴えを主因に最終合成ファクターの説明力が低下し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。

投資行動としては、期を通じて、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。)

期中のファクターウェイトは、ファクター間のバランスを重視した均等ウェイトを適用しました。

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
	(2018年11月17日～2019年11月18日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1 円	0.009 %	(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13,705円です。
(株式)	(1)	(0.008)	
(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
(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	1	0.010	

(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(2018年11月17日～2019年11月18日)

○株式

	買 付	付 金 額		株 数	付 金 額			
		株 数	金 額		株 数	金 額		
国内 上 場	2,501 (32)	千株	4,174,371 (-)	千円	2,750	千株	4,388,546	千円

(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	393	百万円	409	百万円
		百万円		百万円

(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	8,562,918千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,099,892千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.08

(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(2018年11月17日～2019年11月18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
水産・農林業 (0.2%)			
日本水産	2.3	—	—
マルハニチロ	0.4	—	—
サカタのタネ	0.3	—	—
ホクク	2.5	5	9,615
鉱業 (0.5%)			
国際石油開発帝石	9.9	18.9	19,533
建設業 (2.5%)			
ショーボンドホールディングス	—	0.6	2,598
ミライト・ホールディングス	1.4	—	—
東急建設	0.8	—	—
大成建設	2	1.3	5,499
大林組	5.4	2.8	3,267
清水建設	4.9	3.1	3,354
長谷工コーポレーション	1.7	—	—
鹿島建設	4	1.7	2,465
西松建設	—	4.8	11,409
前田建設工業	—	8.3	8,358
戸田建設	—	1.8	1,243
大東建設	1.2	1.3	17,641
住友林業	—	5	7,805
大和ハウス工業	8.7	6.1	20,660
ライオン工業	0.8	—	—
積水ハウス	7.3	6.5	15,226
日揮ホールディングス	—	2.5	4,247
高砂熱学工業	—	0.3	575
東芝プラントシステム	0.7	—	—
レイズネクスト	—	1.3	1,586
食料品 (4.4%)			
日本製粉	—	1.4	2,437
日清製粉グループ本社	2.1	—	—
三井製糖	2.7	1.1	2,578
江崎グリコ	0.6	—	—
山崎製パン	1.5	—	—
寿スピリッツ	—	0.3	2,313
カルビー	0.8	2	7,180
森永乳業	0.2	—	—
ヤクルト本社	1.4	2.6	16,458
明治ホールディングス	1.2	1.9	14,383
日本ハム	0.7	1	4,810
丸大食品	—	2.1	5,054
サッポロホールディングス	0.3	—	—
アサヒグループホールディングス	3.9	5.4	28,447

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キリンホールディングス	8.7	11.4	28,591
宝ホールディングス	—	0.8	866
コ・コーポレーション	1.3	—	—
サントリー食品インターナショナル	1.4	1.6	7,688
伊藤園	0.6	—	—
日清オイリオグループ	—	0.7	2,821
J-オイルミルズ	—	0.4	1,808
キッコーマン	1.2	0.1	565
味の素	4.3	7.3	13,351
キューピー	0.4	4.4	10,793
東洋水産	1	0.1	479
日清食品ホールディングス	0.7	—	—
フジッコ	—	0.8	1,597
日本たばこ産業	11.1	13.3	33,163
繊維製品 (0.7%)			
グンゼ	—	1.2	6,264
東洋紡	5.4	4.7	7,529
帝人	6.5	—	—
東レ	12	15.1	11,243
T S Iホールディングス	—	1.5	861
ゴールドウイン	—	0.4	2,988
パルプ・紙 (0.1%)			
王子ホールディングス	17.9	3.5	2,194
レンゴ	6.5	0.8	628
ザ・パックス	1	—	—
化学 (6.4%)			
クラレ	8.5	8.9	11,792
旭化成	11.2	10.6	12,725
昭和電工	2.7	1.1	3,454
住友化学	30	31.8	16,186
日産化学	—	2.5	11,575
クレハ	—	0.5	3,385
石原産業	—	7.7	9,240
日本曹達	—	0.4	1,191
東ソー	2.5	0.7	1,134
トクヤマ	0.4	—	—
セントラル硝子	—	1.8	4,856
デノン	2.7	—	—
信越化学工業	2.9	2.4	28,956
エア・ウォーター	5.3	6	12,522
日本触媒	0.7	—	—
カネ	—	0.4	1,478
三菱瓦斯化学	3.4	—	—

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三井化学	2.8	0.7	1,875
J S R	6.4	—	—
三菱ケミカルホールディングス	22.1	20.4	17,631
K H ネ オ ケ ム	1.3	—	—
ダイセル	6.3	0.6	663
積水化学工業	1.8	2.4	4,519
日本ゼオ	—	0.9	1,272
宇部興産	4.8	—	—
日立化成	4.2	0.8	2,720
日本化薬	—	2.1	2,933
A D E K A	—	3.5	6,016
花王	4.5	4.4	37,254
日本ペイントホールディングス	—	0.2	1,232
関西ペイント	0.4	—	—
中国塗料	—	5.9	6,130
D I C	0.6	—	—
富士フイルムホールディングス	2.2	3	15,507
資生堂	4.1	2.7	21,270
ライオン	1	0.6	1,302
高砂香料工業	—	2.4	6,156
ファンケル	—	1.2	3,654
コーセー	0.3	—	—
ポーラ・オルビスホールディングス	0.3	—	—
ノビアホールディングス	—	1.2	7,428
コニシ	—	0.3	452
日東電工業	2.2	0.2	1,246
藤森工業	—	0.5	1,777
エフピコ	—	0.1	660
ユニファ	0.2	—	—
ユニ・チャーム	3.9	3.7	12,698
医薬品 (6.2%)			
協和キリン	1.5	—	—
武田薬品工業	9.2	14.2	64,027
アステラス製薬	22.6	18.7	34,351
日本住友製薬	2	0.3	559
塩野義製薬	2.4	3.7	23,565
田辺三菱製薬	6.6	4.3	5,753
中外製薬	1.9	2	18,416
科研製薬	1.7	1.7	9,945
エーザイ	2.8	1.1	8,184
小野薬品工業	6.8	6.1	14,179
参天製薬	1.7	4.3	8,724
日医工	4.9	—	—
栄研化学	—	4	7,556
東和薬品	0.4	3.1	8,503
沢井製薬	2.2	1.2	7,572
ゼリア新薬工業	2.8	—	—

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
第一三共	3	4.7	31,259
大塚ホールディングス	3.5	3.8	18,331
ペプチドリーム	0.8	—	—
石油・石炭製品 (0.3%)			
昭和シェル石油	3.8	—	—
出光興産	0.7	0.6	1,815
J X T G ホールディングス	44.5	22	10,929
ゴム製品 (0.6%)			
横浜ゴム	5.4	0.4	940
ブリヂストン	7	3.2	14,086
住友ゴム工業	6	—	—
三ツ星ベルト	—	3.9	8,482
ガラス・土石製品 (0.8%)			
A G C	4.1	3.2	12,576
日本電気硝子	1.2	—	—
太平洋セメント	0.7	0.7	2,236
日本カーボン	1.2	—	—
日本碍子	0.3	7.8	14,086
日本特殊陶業	3	3.3	7,230
鉄鋼 (0.7%)			
日本製鉄	7	11.6	18,444
神戸製鋼所	2.9	10.6	5,904
日鉄工業	8.1	3.7	4,821
日本冶金工業	34.1	—	—
非鉄金属 (0.5%)			
三井金属鉱業	0.3	—	—
三菱マテリアル	—	3.6	11,016
住友金属鉱山	1.1	—	—
古河電気工業	0.3	—	—
住友電気工業	4.6	2.8	4,352
フジクラ	2.2	8.3	3,975
金属製品 (0.7%)			
トカロ	—	3.4	3,842
S U M C O	2	3.9	6,821
文化シヤッター	—	0.5	493
L I X I L グループ	—	4.4	8,861
リンナイ	—	1.3	11,141
東プレ	0.3	0.3	548
機械 (5.5%)			
日本製鋼所	4.2	—	—
オークマ	1.6	—	—
アマダホールディングス	—	7	8,813
牧野フライス製作所	—	0.4	2,140
オーエスジー	2.4	0.2	463
D M G 森精機	6.8	—	—
ソディック	—	0.7	690
デイスコ	—	0.1	2,427

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
オプトラン	—	2.8	8,456
ヤマビ	—	6.2	7,105
ナブテスコ	0.4	2.4	8,172
S M C	0.5	0.5	24,935
サトーホールディングス	—	2.4	7,884
小松製作所	8.2	11.1	28,954
住友重機械工業	3	0.6	1,926
クボタ	7.5	7.2	12,088
ダイキン工業	2	1.9	29,535
栗田工業	0.2	3.1	9,532
椿本チエイン	—	2.6	9,971
タダノ	—	1.1	1,158
理想科学工業	0.2	—	—
S A N K Y O	0.8	—	—
ダローリー	—	1.5	5,100
セガサミーホールディングス	—	4.2	6,686
ホシザキ	0.1	0.2	1,888
日本精工	9	2.9	3,146
N T N	23.4	—	—
ジェイテクト	3.5	6.8	9,683
不二越	0.2	—	—
T H K	0.7	—	—
三菱重工業	1	1.4	5,131
I H I	5.1	4.5	19,471
スター精密	0.7	4.6	11,927
電気機器 (14.7%)	5.1	3	4,680
コニカミノルタ	0.9	3.1	2,303
ブラザー工業	4.7	—	—
三菱製作所	2.1	—	—
日立製作所	11.2	10.4	42,796
三菱電機	21.4	22.5	34,357
富田電機	1.4	—	—
安川電機	1	—	—
明電舎	—	1.2	2,487
マブチモーター	—	0.1	449
日本電産	2	2.2	35,112
ヤマハ	2.2	—	—
日立新電機	—	4	4,628
日立東工業	1.2	1.2	7,908
日立東工業	—	1.8	4,219
ジーエス・エアサージコーポレーション	—	0.4	900
日本電気	1.4	1	4,365
富士通	0.5	1.9	18,506
サンケン電気	1.2	—	—
ルネサスエレクトロニクス	3.3	1.7	1,283
セイコーエプソン	—	0.9	1,420

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ワコム	12.2	—	—
能美防災	0.4	3.3	7,464
エレクトラム	—	0.6	2,460
パナソニック	21.5	16.9	16,737
シャープ	0.7	—	—
アソシエーツ	2.1	2.8	6,036
ソニー	12.7	11.6	79,390
T D K	—	0.6	6,846
アルプスアルパイン	0.9	0.3	732
フォスター電機	1.2	—	—
ホシデン	6.5	—	—
日立ロセ電機	0.9	0.7	9,723
日本航空電子工業	4.5	—	—
横河電機	—	5.5	10,417
アズビル	—	2.2	7,051
日本光電工業	—	3.4	10,036
堀場製作所	0.3	1.1	8,162
アドバンテス	5.8	2.3	12,995
キーエンス	1.1	0.8	59,376
日置電機	—	1.6	5,968
システムックス	1	2.2	16,764
オプテックスグループ	—	3.2	5,155
レーザテック	0.4	0.5	4,540
スタンレー電気	3.7	1.9	5,766
日本電子	0.9	—	—
カシオ計算機	—	3.4	6,871
ファナック	2	1.4	29,589
ロクム	0.4	0.3	2,682
浜松ホニクス	0.6	3	13,620
京セラ	1.9	2.8	19,885
太陽誘電	—	1.2	3,591
村田製作所	1.4	6.3	39,123
小糸製作所	0.7	0.7	3,962
キヤノン電子	2.8	—	—
キヤノン	9.4	9.7	29,400
リコー	—	11.2	12,398
東京エレクトロン	1.8	1.2	27,792
輸送用機器 (7.2%)	—	—	—
ユニプレス	4.4	—	—
豊田自動織機	0.8	2.1	13,629
デンソー	4.3	5.7	28,448
東海理化電機製作所	—	0.3	630
三井E&Sホールディングス	2.2	—	—
日産自動車	18.6	15.5	10,550
いすゞ自動車	2.1	3.7	4,817
トヨタ自動車	21.8	19.7	154,369
三菱自動車工業	1.9	1.7	846

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
N O K	6.1	—	—
アイシン精機	1.1	0.3	1,249
マツダ	3	0.8	780
本田技研工業	14.8	16.4	51,774
スズキ	3.2	2.3	11,348
SUBARU	2.9	3.5	10,237
ヤマハ発動機	0.7	0.7	1,620
シャープ	3.8	—	—
エプソン	0.3	2.6	6,229
エフ・シー・シー	—	2.5	5,850
シマノ	0.2	0.2	3,480
精密機器 (2.1%)			
ルネサス	1.3	5.4	20,887
日機装	1.5	—	—
島津製作所	2.9	1.2	3,858
東京精密	—	0.9	3,532
マニ	1	0.6	1,752
ニコン	6.5	2	3,034
トプコン	—	0.9	1,318
オリパス	0.2	3.9	6,561
HOYA	5.3	3.6	35,323
朝日インテック	—	0.2	624
メニコン	—	1.5	6,277
セイコーホールディングス	—	2.8	7,705
その他製品 (1.6%)			
パラマウントベッドホールディングス	1.3	—	—
バンダイナムコホールディングス	0.8	0.5	3,297
パイロットコーポレーション	—	1.6	6,864
タカラトミー	6.6	6.5	8,229
凸版印刷	0.7	0.8	1,739
大日本印刷	1	0.4	1,193
NISSHA	3.9	6.3	7,276
アシックス	0.7	2.1	3,561
ピジョン	0.3	—	—
リンテック	4.1	0.4	944
任天堂	1.3	0.8	33,656
美津濃	—	0.4	1,154
電気・ガス業 (1.4%)			
東京電力ホールディングス	14.2	13.9	6,797
中部電力	2.6	1.3	1,962
関西電力	4.6	5.3	6,548
東北電力	—	10.3	11,319
九州電力	8.3	5.3	5,019
北海道電力	16.6	1.6	849
電源開発	3.8	3.7	9,586
東京瓦斯	7.3	5.3	13,684
大阪瓦斯	0.8	0.8	1,652

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
西部瓦斯	1.1	—	—
陸運業 (4.3%)			
東武鉄道	—	0.9	3,573
相模鉄道	1.4	—	—
東急	1.6	6.1	13,157
京浜急行電鉄	2.8	0.6	1,349
小田急電鉄	3.2	3.1	8,509
京成電鉄	0.3	—	—
東日本旅客鉄道	4.2	4.1	41,184
西日本旅客鉄道	2.6	2.5	24,277
東海旅客鉄道	2	1.6	36,048
西武ホールディングス	4.9	4.9	9,329
ハマキョウレックス	0.3	2.1	7,791
近鉄グループホールディングス	1.1	0.5	3,090
阪急阪神ホールディングス	4.5	0.8	3,768
南海電気鉄道	4.5	—	—
日本通運	0.3	—	—
ヤマトホールディングス	1.8	—	—
山九	—	0.1	594
センコーグループホールディングス	2.4	6.2	5,666
ニッコンホールディングス	3.8	2.1	5,760
福山通運	0.7	—	—
セイノーホールディングス	0.4	—	—
九州旅客鉄道	3.2	3.6	13,680
SGホールディングス	0.4	1.9	5,143
海運業 (—%)			
商船三井	0.5	—	—
飯野海運	20.6	—	—
空運業 (0.5%)			
日本航空	5.7	5.5	18,331
ANAホールディングス	0.7	0.5	1,872
倉庫・運輸関連業 (0.4%)			
住友倉庫	3.9	3.6	5,461
近鉄エクスプレス	5.2	5.7	10,801
情報・通信業 (9.4%)			
NECネットエスアイ	3	—	—
デジタルアーツ	—	1.4	8,246
コーエーテクモホールディングス	5	—	—
ネクソン	2	7.2	10,778
コロプラ	10.1	1.2	1,438
ブロードリーフ	10.5	13.3	8,352
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	43.2	3.9	9,231
アカツキ	—	0.8	4,848
野村総合研究所	2	5.4	12,992
フジメディア・ホールディングス	4.1	4.2	6,216
オビツク	—	0.2	2,876
Zホールディングス	39.7	16.8	7,089

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
トレンドマイクロ	1.6	2.1	12,033
日本オラクル	1.5	0.7	6,923
フューチャー	—	5.1	9,506
オービックビジネスコンサルタント	0.1	2.2	10,417
大塚商会	2.8	1.8	7,848
電通国際情報サービス	—	0.4	1,552
アルゴグラフィックス	—	0.6	1,926
エイベックス	—	4.8	6,259
東京放送ホールディングス	0.5	—	—
日本テレビホールディングス	2.9	0.7	1,003
テレビ朝日ホールディングス	4.2	—	—
スカパーJ SATホールディングス	6.6	2.7	1,236
テレビ東京ホールディングス	2.9	—	—
日本電信電話	12.5	13.3	73,189
KDDI	19.5	14.7	47,216
ソフトバンク	—	17	25,551
光通信	0.3	—	—
NTTドコモ	11.9	12.6	37,863
東宝	0.3	1.4	6,258
エヌ・ティ・ティ・データ	—	6.1	9,101
DT S	0.2	—	—
スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.4	—	—
SCSK	—	0.2	1,152
TKC	2.4	—	—
コナミホールディングス	0.3	—	—
ミロク情報サービス	—	1.9	5,747
ソフトバンクグループ	7.3	13.9	60,187
卸売業 (4.2%)			
双日	10.5	5.2	1,778
アルフレッサホールディングス	1.9	0.6	1,435
神戸物産	—	0.6	2,010
あいホールディングス	2.3	—	—
TOKAIホールディングス	3.4	0.5	547
シップヘルスケアホールディングス	1.3	0.2	945
コマダホールディングス	1	—	—
ナガイレーベン	—	0.7	1,822
メディバルホールディングス	1.7	0.3	742
伊藤忠商事	13.5	15.5	37,479
丸紅	18.1	18.5	14,996
長瀬産業	6.1	0.8	1,285
豊田通商	2	2.8	10,822
三井物産	15.5	17.5	33,626
日立ハイテクノロジーズ	—	0.5	3,440
山善	2.8	—	—
住友商事	11.5	9.5	15,917
三菱商事	13.1	9.3	26,537
キヤノンマーケティングジャパン	—	2.1	5,056

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
阪和興業	0.2	—	—
岩谷産業	—	2.6	9,620
東邦ホールディングス	1	—	—
サンゲツ	—	0.6	1,274
伊藤忠エネクス	1.6	—	—
リョーサン	—	0.5	1,451
加賀電子	—	2.1	5,264
オートバックスセブン	3.5	—	—
イエローハット	2.5	1	1,884
因幡電機産業	1.3	—	—
ミスミグループ本社	1.9	—	—
スズケン	0.8	0.2	1,028
小売業 (5.1%)			
ローソン	0.6	2	11,880
ゲオホールディングス	5.7	—	—
アダストリア	—	2.8	7,478
くら寿司	—	1.5	7,200
ジーンズホールディングス	1.6	—	—
DCMホールディングス	—	3.6	3,837
MonotaRO	1.2	—	—
J. フロントリテイリング	2.2	8	11,440
マツモトキヨシホールディングス	0.7	—	—
ZOZO	2	0.3	693
ココカラファイン	1.7	—	—
三越伊勢丹ホールディングス	3.4	—	—
ジョイフル本田	—	5.7	8,259
セブン&アイホールディングス	7.7	9.1	37,874
ツルハホールディングス	0.3	—	—
サンマルクホールディングス	0.9	—	—
トリドールホールディングス	3.1	—	—
クスリのアオキホールディングス	0.2	—	—
スシローグローバルホールディングス	1	0.6	5,166
良品計画	0.2	—	—
コーナン商事	0.3	—	—
ワタ	—	1.8	2,336
パルティック・インターナショナルホールディングス	1	4.5	7,825
サイゼリヤ	1.2	—	—
ユナイテッドアローズ	0.3	—	—
スギホールディングス	0.9	1.3	8,151
ファミリーマート	0.5	0.5	1,361
木曾路	2.2	0.5	1,421
上新電機	0.7	—	—
日本瓦斯	—	3.3	10,296
ロイヤルホールディングス	—	0.8	2,012
島忠	1.2	2.1	6,426
コメリ	1.8	0.2	467
しまむら	0.4	—	—

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
高松屋	6.7	4.8	6,244
エイチ・ツー・オー リテイリング	5.6	—	—
丸井グループ	4.7	6.2	7,588
イオン	1.7	2.2	5,720
イズミ	7.3	9.2	20,930
平和堂	—	0.2	856
フジ	—	0.4	848
ケーズホールディングス	4.2	—	—
ヤマダ電機	2	4.3	5,779
アークランドサカモト	6.1	1.3	744
ニトリホールディングス	—	6.6	8,652
吉野家ホールディングス	0.7	0.5	8,402
王将フードサービス	—	1.7	4,607
バローホールディングス	—	0.1	660
ファーストリテイリング	—	2.8	5,636
サンドラッグ	0.3	0.1	6,786
銀行業 (5.5%)	0.7	—	—
めぶきフィナンシャルグループ	4.6	—	—
九州フィナンシャルグループ	16.8	—	—
ゆうちょ銀行	6.2	2.1	2,242
コンソルディア・フィナンシャルグループ	1.7	6.7	3,068
西日本フィナンシャルホールディングス	3.3	—	—
あおぞら銀行	2.2	—	—
三菱UFJフィナンシャル・グループ	119.4	126.7	73,752
りそなホールディングス	10.8	12.8	6,080
三井住友トラスト・ホールディングス	2.8	2.6	10,862
三井住友フィナンシャルグループ	12.7	14.5	57,884
千葉銀行	1.4	16	10,064
群馬銀行	—	23.7	9,669
武蔵野銀行	—	1.9	3,870
静岡岡銀	9.6	15.8	13,208
十八銀	3.5	—	—
北国銀	21.4	—	—
滋賀銀	2.5	—	—
南都銀	2.5	—	—
はくはくフィナンシャルグループ	—	0.7	1,971
広島銀行	8.2	—	—
伊予銀行	—	1.1	616
百十四銀行	14.1	—	—
宮崎銀行	—	0.8	1,862
みずほフィナンシャルグループ	0.9	—	—
山口フィナンシャルグループ	263.7	206.2	35,198
池田泉州ホールディングス	—	3.9	2,921
証券、商品先物取引業 (1.0%)	—	8.7	1,844
SBIホールディングス	0.4	0.3	688

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	2.1	1.6	6,752
大和証券グループ本社	9.9	19.3	10,032
野村ホールディングス	25.2	49.6	26,451
岡三証券グループ	8.8	—	—
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19	—	—
カブドットコム証券	15.8	—	—
保険業 (2.2%)			
かんぽ生命保険	1.2	3.7	6,874
SOMPOホールディングス	2.1	2.8	12,244
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	7.7	2.7	9,409
ソニーフィナンシャルホールディングス	2.6	1.9	4,539
第一生命ホールディングス	8.2	7.6	13,748
東京海上ホールディングス	8	4.6	27,066
T&Dホールディングス	8.7	13.4	17,688
その他金融業 (1.4%)			
アルヒ	—	0.3	759
クレディセゾン	—	0.7	1,243
イオンフィナンシャルサービス	1.3	0.6	970
ジャックス	4.8	—	—
日立キャピタル	—	4.5	11,542
オリックス	12.3	15.3	26,599
三菱UFJリース	4.6	11.4	7,820
日本取引所グループ	5	5.4	9,903
不動産業 (3.0%)			
いちご	—	20.9	8,882
ビューリック	11.5	8.8	10,392
野村不動産ホールディングス	0.3	—	—
ユニゾホールディングス	4.9	—	—
東急不動産ホールディングス	—	2.8	1,951
飯田グループホールディングス	—	4.6	8,473
パーク24	1.1	3.9	9,769
三井不動産	7.7	5.9	16,272
三菱地所	16.8	11.8	23,765
東京建物	—	2.7	4,117
ダイビル	—	1.5	1,728
京阪神ビルディング	—	1.4	1,947
住友不動産	3	4.2	16,023
スターツコーポレーション	—	1.9	5,169
イオンモール	4	6.1	10,510
カチタス	—	0.5	2,650
日本空港ビルデング	—	1.4	7,700
サービス業 (5.9%)			
日本工営	—	0.2	688
日本M&Aセンター	—	1.7	5,941
コシダカホールディングス	2.7	2.9	4,613
エス・エム・エス	—	1.4	4,057
パーソルホールディングス	0.3	0.4	788

○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	T O P I X	百万円	百万円
		85	—

(注1)単位未満は切り捨て。

(注2)－印は組み入れなし。

銘柄	期 首	当 期	期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
カカクコム	2.9	2.3	5,791	
デイトップ	—	1.8	5,409	
エムスリー	2.3	0.2	561	
博報堂DYホールディングス	0.3	0.6	1,091	
ケネディクス	18.3	—	—	
電通	3.7	2	8,200	
みらかホールディングス	3.8	0.3	801	
オリエンタルランド	1.6	1.3	19,623	
ダスキン	2.9	2.8	7,991	
ラウンドワン	7.6	3.4	3,974	
リゾートトラスト	4.5	4.4	8,087	
ビー・エム・エル	0.7	—	—	
りらいあコミュニケーションズ	—	4.6	6,614	
リソー教育	—	8.6	3,491	
ユー・エス・エス	0.7	5.7	12,009	
楽天	17.5	1.1	1,039	
エン・ジャパン	—	1.9	9,937	
テクノプロ・ホールディングス	0.7	—	—	
ジャパンマテリアル	0.5	—	—	
M&Aキャピタルパートナーズ	—	0.6	4,986	
リクルートホールディングス	13.4	10.5	40,666	
日本郵政	10.1	10.6	11,018	
ベルシステム24ホールディングス	1.9	—	—	
ベйкаレント・コンサルティング	—	1.6	9,136	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	—	1.5	4,170	
東京都競馬	2	—	—	
カナモト	2	1.4	4,347	
東京ドーム	10.2	1.1	1,091	
西尾レントオール	1.4	—	—	
乃村工藝社	—	7	9,926	
セコム	1.3	1.9	18,287	
丹青社	—	4.3	5,039	
メイテック	—	1.8	10,386	
ベネッセホールディングス	3.8	3.8	11,274	
ニチイ学館	—	2.6	4,316	
ダイセキ	0.6	1.3	4,153	
合 計	株 数 ・ 金 額	2,241	2,024	4,239,216
計	銘柄数〈比率〉	413	417	<97.9%〉

(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。

◎投資信託財産の構成

2019年11月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	4,239,216	97.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	92,248	2.1
投 資 信 託 財 産 総 額	4,331,464	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

2019年11月18日現在

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	4,331,464,398
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	48,894,684
株 式 (評価額)	4,239,216,920
未 収 入 金	6,374,880
未 収 配 当 金	40,707,114
差 入 委 託 証 拠 金	△ 3,729,200
(B)負 債	3,082,467
未 払 解 約 金	3,080,000
そ の 他 未 払 費 用	2,467
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	4,328,381,931
元 本	2,881,965,206
次 期 繰 越 損 益 金	1,446,416,725
(D)受 益 権 総 口 数	2,881,965,206口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C/D)	15,019円

◎損益の状況

自 2018年11月17日
至 2019年11月18日

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	109,337,927
受 取 配 当 金	109,221,053
そ の 他 収 益 金	116,874
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	164,238,323
売 買 益	556,185,846
売 買 損	△ 391,947,523
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	3,833,100
取 引 益	9,448,964
取 引 損	△ 5,615,864
(D)信 託 報 酬 等	△ 60,364
(E)当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	277,348,986
(F)前 期 繰 越 損 益 金	1,267,083,510
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	19,233,415
(H)解 約 差 損 益 金	△ 117,249,186
(I)計 (E + F + G + H)	1,446,416,725
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	1,446,416,725

(注1)当親ファンドの期首元本額は3,131,159,435円、期中追加設定元本額は55,846,585円、期中一部解約元本額は305,040,814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)2,660,607,931円、明治安田DCTピックスプラス221,357,275円です。

(注3)1口当たり純資産額は1,5019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。