

運用報告書(全体版)

当ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	追加型投信/国内/株式/インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	日経平均株価の動きに連動する投資成果を目指して、運用を行います。	
主要投資対象	朝日ライフ日経平均ファンド	朝日ライフ日経平均マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。
	朝日ライフ日経平均マザーファンド	国内の上場株式のうち、日経平均株価に採用されている銘柄を主要投資対象とします。
組入制限	朝日ライフ日経平均ファンド	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。
	朝日ライフ日経平均マザーファンド	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	毎決算時(11月15日。休業日の場合は翌営業日)に、配当等収益を中心に、基準価額水準等を勘案して、分配を行う方針です。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないこともあります。	

朝日ライフ 日経平均ファンド 愛称【にいにいGo】

第22期

(決算日 2022年11月15日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、ご投資いただいております「朝日ライフ日経平均ファンド」は、2022年11月15日に第22期の決算を行いました。ここに、期中の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。

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社

東京都杉並区和泉一丁目22番19号

＜お問い合わせ先＞

ホームページ：<https://www.alamco.co.jp/>

フリーダイヤル：0120-283-104

〔受付時間〕 営業日の午前9時～午後5時

○本報告書の表記について

・原則として、数量、額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数で表記する場合があります。－印は、組入れ、異動などの該当がないことを示します。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			日経平均株価 [ベンチマーク]	平均株価 騰落率	株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	(分配落)	税分配金	期騰落率					
	円	円	%		%	%	%	百万円
18期(2018年11月15日)	10,002	65	0.4	21,803.62	△ 1.0	88.3	11.2	2,211
19期(2019年11月15日)	10,000	860	8.6	23,303.32	6.9	86.0	16.3	1,986
20期(2020年11月16日)	10,435	835	12.7	25,906.93	11.2	93.1	9.8	1,931
21期(2021年11月15日)	10,207	1,900	16.0	29,776.80	14.9	82.9	24.0	1,869
22期(2022年11月15日)	9,743	0	△ 4.5	27,990.17	△ 6.0	72.1	27.7	2,036

(注) 基準価額および分配金は1万口当たりの値です。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みで計算しています。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので株式組入比率、株式先物比率は実質比率で記載しています。

(注) 株式組入比率には新株予約権証券を含んでいます。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注) ベンチマークは「日経平均株価」です。

「日経平均株価(日経平均)」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、日経平均自体および日経平均を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

「日経」および「日経平均」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属します。

ファンドは、朝日ライフ アセットマネジメント株式会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および受益権の取引に関して一切の責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社は、日経平均を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社は、日経平均の構成銘柄、計算方法、その他日経平均の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

(以下同じです。)

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率	[ベンチマーク]	騰 落 率		
(期 首) 2021年11月15日	円 10,207	% —	29,776.80	% —	% 82.9	% 24.0
11月末	9,531	△ 6.6	27,821.76	△ 6.6	94.0	5.4
12月末	9,875	△ 3.3	28,791.71	△ 3.3	94.1	5.5
2022年1月末	9,260	△ 9.3	27,001.98	△ 9.3	93.8	5.5
2月末	9,098	△10.9	26,526.82	△10.9	94.1	5.5
3月末	9,622	△ 5.7	27,821.43	△ 6.6	93.1	6.3
4月末	9,282	△ 9.1	26,847.90	△ 9.8	94.3	5.5
5月末	9,422	△ 7.7	27,279.80	△ 8.4	94.7	4.7
6月末	9,124	△10.6	26,393.04	△11.4	94.0	5.5
7月末	9,605	△ 5.9	27,801.64	△ 6.6	94.4	4.7
8月末	9,704	△ 4.9	28,091.53	△ 5.7	94.8	4.7
9月末	9,034	△11.5	25,937.21	△12.9	72.1	26.9
10月末	9,596	△ 6.0	27,587.46	△ 7.4	71.4	28.2
(期 末) 2022年11月15日	9,743	△ 4.5	27,990.17	△ 6.0	72.1	27.7

(注) 基準価額は1万円当たりの値です。

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比で計算しています。

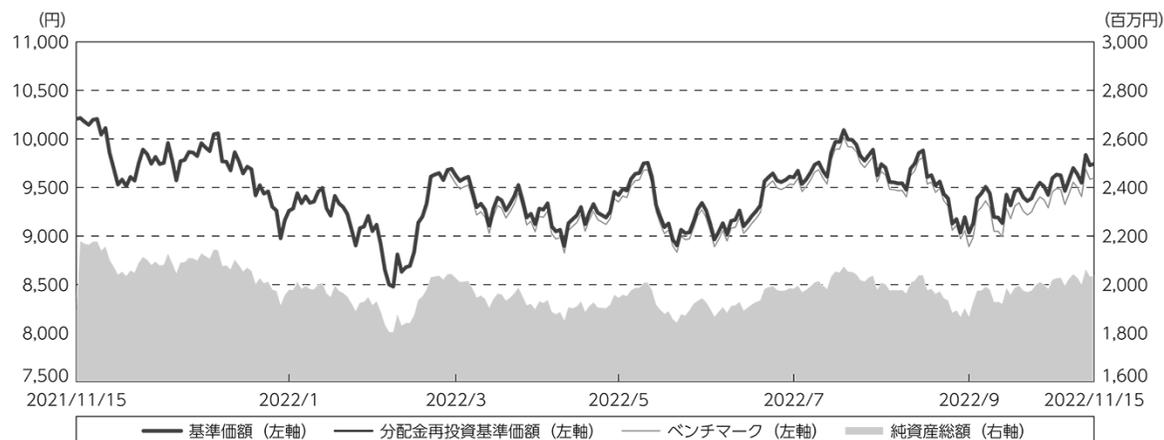
(注) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので株式組入比率、株式先物比率は実質比率で記載しています。

(注) 株式組入比率には新株予約権証券を含んでいます。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

◎運用経過(2021年11月16日～2022年11月15日)

○当期中の基準価額等の推移



期首：10,207円

期末：9,743円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 4.5% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)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) 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により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しています。
- (注) ベンチマークは「日経平均株価」です。

○基準価額の主な変動要因

主な上昇要因として、新型コロナウイルス治療薬への期待、国内企業の好調な決算、円安ドル高の進行、日銀による金融緩和維持の方針、原油価格の下落、英トラス政権による減税政策の撤回、FOMC(米連邦公開市場委員会)での金融引き締めへの減速が議論されるとの報道などが挙げられます。

主な下落要因として、強い感染力の疑われる新型コロナウイルス変異株(オミクロン株)の出現、米CPI(消費者物価指数)などインフレ指標の高い伸び率、原油価格の上昇、ロシアのウクライナ軍事侵攻による地政学リスク、FRB(米連邦準備理事会)による積極的な金融引き締め、米国株の大幅下落などが挙げられます。

○投資環境

当期の国内株式市場は、日経平均株価が29,776.80円(2021年11月15日)から期中の高値圏で始まり、11月16日に日経平均株価は期中最高値となる29,808.12円をつけました。その後は、強い感染力が疑われるオミクロン株出現による経済活動正常化の遅延懸念から下落しましたが、オミクロン株を巡る経口治療薬の製造販売承認の申請などが好感され反発しました。

2022年明け以降は、オミクロン株の国内感染者増加などから下落基調で推移し、1月下旬以降に国内企業の堅調な10-12月期決算などを背景に反発する場面も見られましたが、1月米CPIの高い伸び率を受けた米金融引き締め前倒しへの警戒感やウクライナへの軍事侵攻を開始したロシアへの経済制裁による世界経済への懸念、原油価格の上昇などが嫌気されて再度大幅に下落し、3月9日に日経平均株価は期中最安値となる24,717.53円をつけました。

その後は、米長期金利の上昇を背景とする円安ドル高の進行により急反発しましたが、4月以降は、FRBによる積極的な金融引き締めへの警戒感から米国株が下落したことなどから5月上旬まで軟調に推移しました。5月中旬以降は、日銀の黒田総裁が金融緩和継続の方針を示したことなどから上昇しましたが、5月の米CPIの大幅な伸びを受けFRBによる金融引き締め継続への懸念などから反落しました。

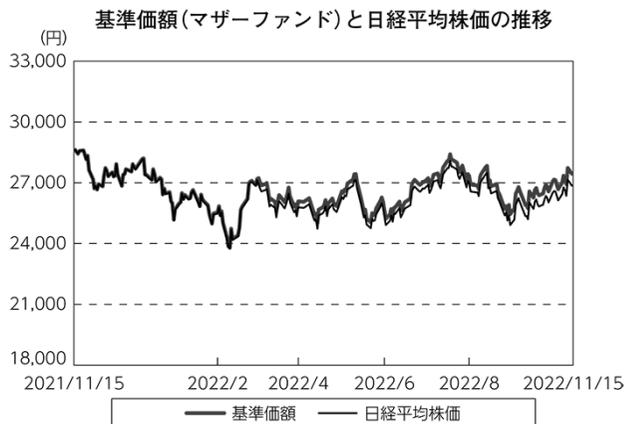
7月に入ってから、原油価格の下落を受けたインフレ懸念の後退による米国株の上昇などから上昇したものの、8月中旬以降は、ジャクソンホール会議においてパウエルFRB議長が金融引き締めに積極的な姿勢を強調したことで米国株が暴落したことなどから下落に転じました。9月中旬に、世界景気の減速懸念を背景とした原油価格の急落などから一時的に反発しましたが、8月の米CPIの伸びが市場予想を上回りFRBによる大幅利上げが継続するとの見方が広がり続落しました。

その後期末にかけては、英トラス政権が減税政策を撤回したことや、12月にFOMCで利上げ幅縮小が議論されるとの報道により利上げ幅縮小観測が強まったことなどから上昇し、期末である11月15日に日経平均株価は27,990.17円で終了しました。

○当ファンドのポートフォリオ

主要投資対象である朝日ライフ 日経平均マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券に投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行っています。また、資金流入への対応と株式の実質組入比率を高める観点から、日経平均先物取引を活用し、先物を含む実質株式組入比率については概ね高水準を維持しました。

マザーファンドは日経平均株価の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。期首に225銘柄への投資でスタートし、期末も全225銘柄への投資を継続しております。



(注) 日経平均株価は、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは「日経平均株価」をベンチマークとします。

コメント・グラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

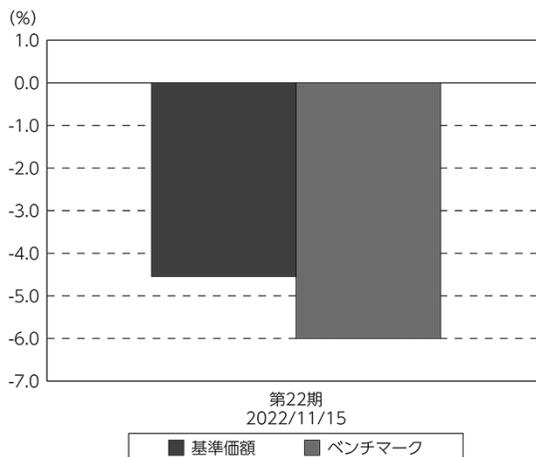
ベンチマークが6.0%下落したのに対し、基準価額は4.5%下落となり、ベンチマークを1.5%上回る結果となりました。マザーファンドの組入銘柄にかかる受取配当金は、マザーファンドに収益計上され、当ファンドの基準価額にも反映されます。一方でベンチマークは受取配当金を加味していないため、この差がプラス要因となりました。また、ファンドから信託報酬等のコストが控除されたことが、マイナス要因となりました。

実績トラッキングエラー

過去1年(2021年11月～2022年10月)の実績トラッキングエラーは1.12%(年率)となりました。

※実績トラッキングエラーとは、ファンドの基準価額騰落率からベンチマークの騰落率を差し引いたベンチマークとの差異の振れの度合いを示す指標で、この値が低いほど、ファンドのベンチマークに対する連動性が高いと考えることができます。

基準価額とベンチマークの対比(期別騰落率)



(注) 基準価額の騰落率は分配金込み(税込み)です。

○分配金

当期の分配金につきましては、収益分配方針に基づき、基準価額水準などを勘案して、見送らせていただきました。

なお、収益分配にあてず信託財産内に留保した利益につきましては、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第22期
	2021年11月16日～ 2022年11月15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	2,609

(注) 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) 当期の収益および当期の収益以外は、小数点以下を切捨てて表示しているため、合計した額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

マザーファンドと日経平均先物への投資により株式の実質組入比率を高位に保ち、日経平均株価に連動した投資成果を目指します。マザーファンドにつきましては、日経平均株価採用銘柄への投資を行うことにより、日経平均株価の動きに連動する投資成果を目指します。その際、連動性を損なわない範囲で、信用リスクが高いと判断される銘柄を除外する場合があります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年11月16日～2022年11月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(21)	(0.220)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(21)	(0.220)	交付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、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(10)	(0.110)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.003	(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 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際に支払う手数料です。
(株 式)	(0)	(0.001)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.002)	
(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)	(1)	(0.006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用です。
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	53	0.559	
期中の平均基準価額は、9,429円です。			

(注) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

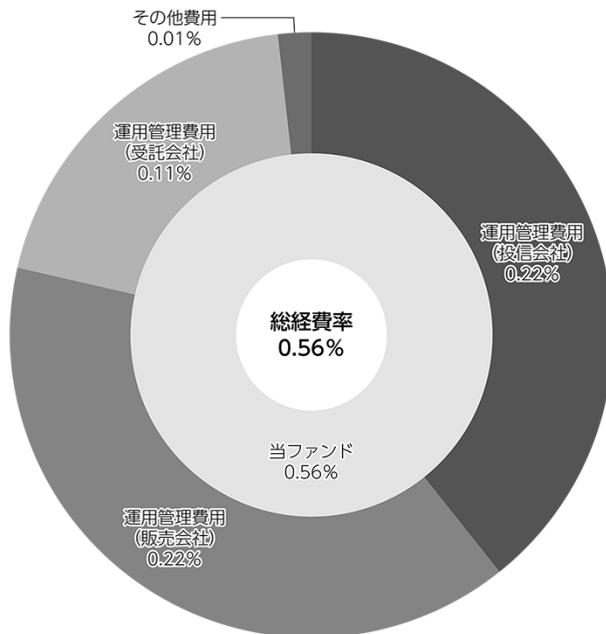
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます。)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います。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料およ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0.56%です。



(注) 当ファンドの費用は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、売買委託手数料およ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) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(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

(2021年11月16日～2022年11月15日)

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 108	百万円 109	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
朝日ライフ 日経平均マザーファンド	千口 142,485	千円 397,000	千口 172,252	千円 482,500

○株式売買比率

(2021年11月16日～2022年11月15日)

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	
	朝日ライフ 日経平均マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	1,696,669千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,989,083千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.56	

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2021年11月16日～2022年11月15日)

該当事項はございません。

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。

○組入資産の明細

(2022年11月15日現在)

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期	
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	日経225	百万円 28	百万円 -

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期	
	口 数	口 数	評 価 額
朝日ライフ 日経平均マザーファンド	千口 763,279	千口 733,512	千円 2,015,471

(注) 親投資信託の当期末の受益権総口数は、1,225,429千口です。

○投資信託財産の構成

(2022年11月15日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
朝日ライフ 日経平均マザーファンド	千円 2,015,471	% 98.2
コール・ローン等、その他	36,841	1.8
投資信託財産総額	2,052,312	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年11月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,051,762,560
コール・ローン等	34,871,111
朝日ライフ 日経平均マザーファンド(評価額)	2,015,471,999
未収入金	619,450
差入委託証拠金	800,000
(B) 負債	15,656,943
未払解約金	10,187,360
未払信託報酬	5,415,394
未払利息	95
その他未払費用	54,094
(C) 純資産総額(A - B)	2,036,105,617
元本	2,089,875,282
次期繰越損益金	△ 53,769,665
(D) 受益権総口数	2,089,875,282口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,743円

(注) 期首元本額は1,831,684,792円、期中追加設定元本額は819,509,738円、期中一部解約元本額は561,319,248円です。

(注) 投資信託財産計算規則第55条の6第10号に規定する額は以下のとおりです。

元本の欠損(当期末)53,769,665円

○損益の状況 (2021年11月16日～2022年11月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 28,943
支払利息	△ 28,943
(B) 有価証券売買損益	△ 46,474,460
売買益	33,453,744
売買損	△ 79,928,204
(C) 先物取引等取引損益	△ 131,984
取引益	3,809,769
取引損	△ 3,941,753
(D) 信託報酬等	△ 11,014,694
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	△ 57,650,081
(F) 前期繰越損益金	5,554,992
(G) 追加信託差損益金	△ 1,674,576
(配当等相当額)	(513,354,239)
(売買損益相当額)	(△515,028,815)
(H) 計(E + F + G)	△ 53,769,665
(I) 収益分配金	0
次期繰越損益金(H + I)	△ 53,769,665
追加信託差損益金	△ 1,674,576
(配当等相当額)	(514,120,845)
(売買損益相当額)	(△515,795,421)
分配準備積立金	31,265,219
繰越損益金	△ 83,360,308

(注) (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) (D)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います。

(注) (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) 分配金の計算過程
 計算期間末における費用控除後の配当等収益(25,710,227円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(-円)、信託約款に規定する収益調整金(514,120,845円)および分配準備積立金(5,554,992円)より分配可能額は545,386,064円(10,000口当たり2,609円)ですが、当期は分配を行いませんでした。

当ファンドの仕組みは次のとおりです。

運用方針	日経平均株価の動きに連動する投資成果を目指して、運用を行います。
主要運用対象	国内の上場株式のうち、日経平均株価に採用されている銘柄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		日経平均株価 [ベンチマーク]		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	期騰落	期中率	期騰落	期中率			
18期(2018年11月15日)	円	%		%	%	%	百万円
19期(2019年11月15日)	19,787	0.9	21,803.62	△ 1.0	92.0	7.5	3,196
20期(2020年11月16日)	21,594	9.1	23,303.32	6.9	79.3	15.0	3,262
21期(2021年11月15日)	24,496	13.4	25,906.93	11.2	86.9	7.9	3,306
22期(2022年11月15日)	28,603	16.8	29,776.80	14.9	71.0	19.2	3,569
	27,477	△ 3.9	27,990.17	△ 6.0	72.8	26.6	3,367

(注) 基準価額は1万口当たりの値です。

(注) 株式組入比率には新株予約権証券を含んでいます。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注) ベンチマークは「日経平均株価」です。

「日経平均株価(日経平均)」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、日経平均自体および日経平均を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

「日経」および「日経平均」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属します。

ファンドは、朝日ライフ アセットマネジメント株式会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および受益権の取引に関して一切の責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社は、日経平均を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社は、日経平均の構成銘柄、計算方法、その他日経平均の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

(以下同じです。)

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価 [ベンチマーク]	株 価 騰 落 率	株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率
	円	騰 落 率				
(期 首) 2021年11月15日	28,603	—	29,776.80	—	71.0	19.2
11月末	26,716	△ 6.6	27,821.76	△ 6.6	95.7	4.2
12月末	27,695	△ 3.2	28,791.71	△ 3.3	95.5	4.2
2022年1月末	25,983	△ 9.2	27,001.98	△ 9.3	95.7	4.2
2月末	25,540	△10.7	26,526.82	△10.9	95.7	4.2
3月末	27,027	△ 5.5	27,821.43	△ 6.6	94.4	5.0
4月末	26,086	△ 8.8	26,847.90	△ 9.8	95.3	4.2
5月末	26,500	△ 7.4	27,279.80	△ 8.4	95.8	3.4
6月末	25,670	△10.3	26,393.04	△11.4	95.5	4.2
7月末	27,036	△ 5.5	27,801.64	△ 6.6	95.8	3.4
8月末	27,331	△ 4.4	28,091.53	△ 5.7	96.5	3.4
9月末	25,453	△11.0	25,937.21	△12.9	73.4	26.0
10月末	27,057	△ 5.4	27,587.46	△ 7.4	72.7	27.3
(期 末) 2022年11月15日	27,477	△ 3.9	27,990.17	△ 6.0	72.8	26.6

(注) 基準価額は1万口当たりの値です。

(注) 騰落率は期首比で計算しています。

(注) 株式組入比率には新株予約権証券を含んでいます。

(注) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

○当期の運用経過、今後の運用方針
前述の3～6ページをご覧ください。

○1万口当たりの費用明細

(2021年11月16日～2022年11月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先物・オプション)	円 1 (0) (0)	% 0.003 (0.001) (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に支払う手数料です。
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(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関するその他の費用
合 計	1	0.003	
期中の平均基準価額は、26,507円です。			

(注) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます。)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います。

○売買及び取引の状況

(2021年11月16日～2022年11月15日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		198	916,728	192	779,940
		(7)	(-)		

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ()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いません。

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 1,753	百万円 1,562	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

○株式売買比率

(2021年11月16日～2022年11月15日)

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	1,696,669千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,989,083千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.56

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2021年11月16日～2022年11月15日)

該当事項はございません。

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。

○組入資産の明細

(2022年11月15日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
日本水産	3	3	1,530
マルハニチロ	0.3	—	—
鉱業 (0.1%)			
I N P E X	1.2	1.2	1,832
建設業 (1.6%)			
コムシスホールディングス	3	3	7,212
大成建設	0.6	0.6	2,304
大林組	3	3	2,895
清水建設	3	3	2,130
長谷工コーポレーション	0.6	0.6	871
鹿島建設	1.5	1.5	2,212
大和ハウス工業	3	3	9,303
積水ハウス	3	3	7,396
日揮ホールディングス	3	3	5,301
食料品 (3.5%)			
日清製粉グループ本社	3	3	4,731
明治ホールディングス	0.6	0.6	3,852
日本ハム	1.5	1.5	5,407
サッポロホールディングス	0.6	0.6	1,986
アサヒグループホールディングス	3	3	12,963
キリンホールディングス	3	3	6,417
宝ホールディングス	3	3	3,138
キッコーマン	3	3	22,950
味の素	3	3	12,150
ニチレイ	1.5	1.5	3,901
日本たばこ産業	3	3	8,235
繊維製品 (0.1%)			
東洋紡	0.3	0.3	308
ユニチカ	0.3	—	—
帝人	0.6	0.6	746
東レ	3	3	2,118
パルプ・紙 (0.1%)			
王子ホールディングス	3	3	1,584
日本製紙	0.3	0.3	285

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
化学 (7.0%)			
クラレ	3	3	3,162
旭化成	3	3	3,018
昭和電工	0.3	0.3	675
住友化学	3	3	1,455
日産化学	3	3	19,890
東ソー	1.5	1.5	2,404
トクヤマ	0.6	0.6	1,087
デンカ	0.6	0.6	2,034
信越化学工業	3	3	52,005
三井化学	0.6	0.6	1,878
三菱ケミカルグループ	1.5	1.5	1,104
UBE	0.3	0.3	589
花王	3	3	16,479
D I C	0.3	0.3	737
富士フイルムホールディングス	3	3	22,191
資生堂	3	3	17,775
日東電工	3	3	25,650
医薬品 (7.6%)			
協和キリン	3	3	9,450
武田薬品工業	3	3	11,517
アステラス製薬	15	15	31,507
住友ファーマ	3	3	3,168
塩野義製薬	3	3	20,514
中外製薬	9	9	31,041
エーザイ	3	3	26,259
第一三共	9	9	40,374
大塚ホールディングス	3	3	13,626
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	1.2	1.2	3,798
E N E O Sホールディングス	3	3	1,441
ゴム製品 (0.8%)			
横浜ゴム	1.5	1.5	3,159
ブリヂストン	3	3	16,164

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ガラス・土石製品 (0.9%)			
AGC	0.6	0.6	2,709
日本板硝子	0.3	0.3	166
日本電気硝子	0.9	0.9	2,296
住友大阪セメント	0.3	0.3	945
太平洋セメント	0.3	0.3	618
東海カーボン	3	3	3,279
TOTO	1.5	1.5	6,960
日本碍子	3	3	5,205
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	0.3	0.3	662
神戸製鋼所	0.3	0.3	186
JFEホールディングス	0.3	0.3	452
大太平洋金属	0.3	0.3	579
非鉄金属 (0.9%)			
日本軽金属ホールディングス	0.3	0.3	464
三井金属鉱業	0.3	0.3	942
東邦亜鉛	0.3	0.3	642
三菱マテリアル	0.3	0.3	636
住友金属鉱山	1.5	1.5	7,102
DOWAホールディングス	0.6	0.6	2,580
古河電気工業	0.3	0.3	744
住友電気工業	3	3	4,797
フジクラ	3	3	3,273
金属製品 (0.0%)			
SUMCO	0.3	0.3	629
機械 (5.5%)			
日本製鋼所	0.6	0.6	1,783
オークマ	0.6	0.6	3,006
アマダ	3	3	3,270
SMC	—	0.3	19,557
小松製作所	3	3	9,273
住友重機械工業	0.6	0.6	1,689
日立建機	3	3	9,165
クボタ	3	3	6,207
荏原製作所	0.6	0.6	3,108
ダイキン工業	3	3	68,850
日本精工	3	3	2,301
NTN	3	3	861
ジェイテクト	3	3	2,991

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井E&Sホールディングス	0.3	0.3	128
日立造船	0.6	0.6	522
三菱重工業	0.3	0.3	1,516
IHI	0.3	0.3	1,012
電気機器 (23.2%)			
コニカミノルタ	3	3	1,608
ミネベアミツミ	3	3	6,927
日立製作所	0.6	0.6	4,336
三菱電機	3	3	4,117
富士電機	0.6	0.6	3,552
安川電機	3	3	13,665
日本電産	—	2.4	21,600
オムロン	3	3	22,278
ジーエス・ユアサ コーポレーション	0.6	0.6	1,297
日本電気	0.3	0.3	1,432
富士通	0.3	0.3	5,352
沖電気工業	0.3	—	—
セイコーエプソン	6	6	12,360
パナソニック ホールディングス	3	3	3,613
シャープ	3	3	2,991
ソニーグループ	3	3	34,770
TDK	9	9	44,775
アルプスアルパイン	3	3	3,792
横河電機	3	3	7,440
アドバンテスト	6	6	54,720
キーエンス	0.3	0.3	18,012
カシオ計算機	3	3	4,128
ファナック	3	3	62,910
京セラ	6	6	40,896
太陽誘電	3	3	13,845
村田製作所	2.4	2.4	18,688
SCREENホールディングス	0.6	0.6	5,472
キャノン	4.5	4.5	14,089
リコー	3	3	3,141
東京エレクトロン	3	3	136,950
輸送用機器 (4.6%)			
デンソー	3	3	23,025
川崎重工業	0.3	0.3	860
日産自動車	3	3	1,501
いすゞ自動車	1.5	1.5	2,610

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トヨタ自動車	15	15	29,970
日野自動車	3	3	1,908
三菱自動車工業	0.3	0.3	179
マツダ	0.6	0.6	644
本田技研工業	6	6	19,986
スズキ	3	3	15,195
SUBARU	3	3	6,948
ヤマハ発動機	3	3	10,365
精密機器 (4.5%)			
テルモ	12	12	48,468
ニコン	3	3	3,852
オリンパス	12	12	33,822
HOYA	—	1.5	22,387
シチズン時計	3	3	1,668
その他製品 (2.7%)			
バンダイナムコホールディングス	3	3	26,460
凸版印刷	1.5	1.5	3,070
大日本印刷	1.5	1.5	4,041
ヤマハ	3	3	16,170
任天堂	0.3	3	17,292
電気・ガス業 (0.1%)			
東京電力ホールディングス	0.3	0.3	135
中部電力	0.3	0.3	368
関西電力	0.3	0.3	338
東京瓦斯	0.6	0.6	1,452
大阪瓦斯	0.6	0.6	1,205
陸運業 (1.4%)			
東武鉄道	0.6	0.6	1,887
東急	1.5	1.5	2,383
小田急電鉄	1.5	1.5	2,551
京王電鉄	0.6	0.6	2,904
京成電鉄	1.5	1.5	5,422
東日本旅客鉄道	0.3	0.3	2,304
西日本旅客鉄道	0.3	0.3	1,659
東海旅客鉄道	0.3	0.3	4,858
日本通運	0.3	—	—
ヤマトホールディングス	3	3	6,996
NIPPON EXPRESSホールディングス	—	0.3	2,316
海運業 (0.3%)			
日本郵船	0.3	0.9	2,502

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
商船三井	0.3	0.9	2,830
川崎汽船	0.3	0.9	2,331
空運業 (0.0%)			
ANAホールディングス	0.3	0.3	838
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	1.5	1.5	4,822
情報・通信業 (11.5%)			
ネクソン	6	6	15,996
Zホールディングス	1.2	1.2	445
トレンドマイクロ	3	3	20,970
日本電信電話	1.2	1.2	4,509
KDDI	18	18	72,828
ソフトバンク	3	3	4,405
東宝	0.3	0.3	1,524
エヌ・ティ・ティ・データ	15	15	31,110
コナミグループ	3	3	19,530
ソフトバンクグループ	18	18	110,646
卸売業 (2.6%)			
双日	0.3	0.3	720
伊藤忠商事	3	3	12,579
丸紅	3	3	4,363
豊田通商	3	3	15,450
三井物産	3	3	11,472
住友商事	3	3	6,490
三菱商事	3	3	12,957
小売業 (11.8%)			
J. フロント リテイリング	1.5	1.5	1,650
三越伊勢丹ホールディングス	3	3	3,552
セブン&アイ・ホールディングス	3	3	16,611
高島屋	1.5	1.5	2,454
丸井グループ	3	3	6,606
イオン	3	3	8,131
ファーストリテイリング	3	3	249,150
銀行業 (0.6%)			
しずおかフィナンシャルグループ	—	3	2,736
コンコルディア・フィナンシャルグループ	3	3	1,329
新生銀行	0.3	—	—
あおぞら銀行	0.3	0.3	765
三菱UFJフィナンシャル・グループ	3	3	2,167
りそなホールディングス	0.3	0.3	179

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井住友トラスト・ホールディングス	0.3	0.3	1,251
三井住友フィナンシャルグループ	0.3	0.3	1,340
千葉銀行	3	3	2,334
ふくおかフィナンシャルグループ	0.6	0.6	1,467
静岡銀行	3	—	—
みずほフィナンシャルグループ	0.3	0.3	484
証券、商品先物取引業 (0.2%)			
大和証券グループ本社	3	3	1,812
野村ホールディングス	3	3	1,496
松井証券	3	3	2,331
保険業 (0.9%)			
SOMPOホールディングス	0.6	0.6	3,715
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	0.9	0.9	3,618
第一生命ホールディングス	0.3	0.3	730
東京海上ホールディングス	1.5	4.5	12,451
T&Dホールディングス	0.6	0.6	925
その他金融業 (0.7%)			
クレディセゾン	3	3	4,920
オリックス	—	3	6,363
日本取引所グループ	3	3	5,971

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
不動産業 (1.2%)				
東急不動産ホールディングス	3	3	2,142	
三井不動産	3	3	7,915	
三菱地所	3	3	5,686	
東京建物	1.5	1.5	2,823	
住友不動産	3	3	10,968	
サービス業 (5.0%)				
エムスリー	7.2	7.2	33,501	
ディー・エヌ・エー	0.9	0.9	1,674	
電通グループ	3	3	13,245	
サイバーエージェント	2.4	2.4	2,894	
楽天グループ	3	3	2,148	
リクルートホールディングス	9	9	41,157	
日本郵政	3	3	3,066	
セコム	3	3	24,105	
合 計	株数・金額	560	574	2,452,194
	銘柄数<比率>	225	225	<72.8%>

(注) 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です。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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	株式先物取引	日経225	百万円 896	百万円 —

○投資信託財産の構成

(2022年11月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 2,452,194	% 72.1
コール・ローン等、その他	948,012	27.9
投資信託財産総額	3,400,206	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年11月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,480,459,953
コール・ローン等	892,759,173
株式(評価額)	2,452,194,570
未収入金	35,309,680
未収配当金	19,942,610
差入委託証拠金	80,253,920
(B) 負債	113,330,445
未払利息	2,445
差入委託証拠金代用有価証券	113,328,000
(C) 純資産総額(A-B)	3,367,129,508
元本	1,225,429,901
次期繰越損益金	2,141,699,607
(D) 受益権総口数	1,225,429,901口
1万口当たり基準価額(C/D)	27,477円

(注) 期首元本額は1,247,984,634円、期中追加設定元本額は176,451,248円、期中一部解約元本額は199,005,981円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、【元本の内訳】の通りです。

【元本の内訳】

朝日ライフ 日経平均ファンド	733,512,392円
朝日ライフ DC日経平均ファンド	491,917,509円

○損益の状況 (2021年11月16日～2022年11月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	61,339,712
受取配当金	61,568,626
その他収益金	4,437
支払利息	△ 233,351
(B) 有価証券売買損益	△ 219,165,449
売買益	154,773,585
売買損	△ 373,939,034
(C) 先物取引等取引損益	22,922,900
取引益	51,974,370
取引損	△ 29,051,470
(D) 保管費用等	△ 3,895
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 134,906,732
(F) 前期繰越損益金	2,321,651,606
(G) 追加信託差損益金	310,548,752
(H) 解約差損益金	△ 355,594,019
(I) 計(E+F+G+H)	2,141,699,607
次期繰越損益金(I)	2,141,699,607

(注) (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) (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) (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。