

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17期

(決算日 2022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17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

東京都千代田区大手町二丁目3番2号
ホームページ <https://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
(第15期) 2020年11月16日	12,348	0	2.1	1,731.81	1.8	98.5	0.7	349
(第16期) 2021年11月16日	14,851	0	20.3	2,050.83	18.4	97.6	1.5	484
(第17期) 2022年11月16日	14,773	0	△ 0.5	1,963.29	△ 4.3	97.6	1.4	468

(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JPX総研が算出する株価指数であり、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。東証株価指数(TOPIX)の指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

◎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) 2021年11月16日	14,851	—	2,050.83	—	97.6	1.5
11月末	13,983	△5.8	1,928.35	△ 6.0	98.0	0.7
12月末	14,479	△2.5	1,992.33	△ 2.9	97.8	0.7
2022年 1月末	13,799	△7.1	1,895.93	△ 7.6	98.1	0.7
2月末	13,716	△7.6	1,886.93	△ 8.0	98.4	0.8
3月末	14,244	△4.1	1,946.40	△ 5.1	97.0	2.2
4月末	13,907	△6.4	1,899.62	△ 7.4	96.7	2.2
5月末	14,038	△5.5	1,912.67	△ 6.7	96.7	2.2
6月末	13,790	△7.1	1,870.82	△ 8.8	96.4	2.2
7月末	14,403	△3.0	1,940.31	△ 5.4	98.2	0.7
8月末	14,594	△1.7	1,963.16	△ 4.3	98.4	0.7
9月末	13,782	△7.2	1,835.94	△10.5	94.7	4.2
10月末	14,480	△2.5	1,929.43	△ 5.9	97.8	1.4
(期末) 2022年11月16日	14,773	△0.5	1,963.29	△ 4.3	97.6	1.4

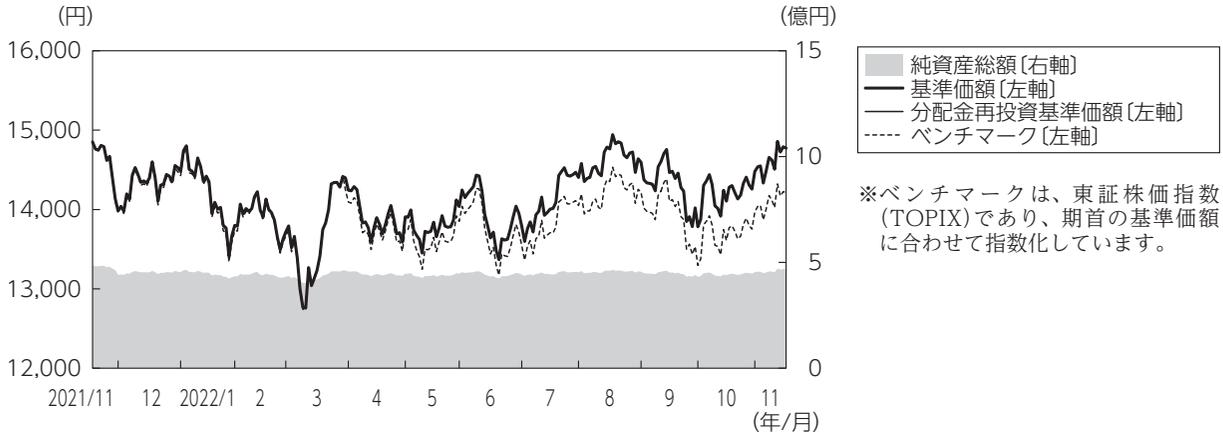
(注1) 騰落率は期首比です。

(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17期首(2021年11月16日)：14,851円

第17期末(2022年11月16日)：14,773円(既払分配金0円)

騰落率：△0.5%(分配金再投資ベース)

※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います。

※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)

- ・ 2022年3月中旬から下旬にかけて円安傾向で推移し日本企業の業績拡大期待が高まったことから、国内株式相場が上昇したこと

(下落要因)

- ・ 期首から2022年3月上旬にかけて、世界的なインフレを背景とする金融引き締め動き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下落しました。期首から2022年3月上旬にかけて、世界的なインフレを背景とする金融引き締め動きやウクライナ情勢を巡る警戒感などから下落基調となりましたが、3月中旬から下旬にかけて円安傾向で推移し日本企業の業績拡大期待が高まったことから反発しました。その後は日銀による緩和的な金融政策の継続が相場の下支えとなった一方で、世界的なインフレの加速による景気の減速懸念もあり、もみ合いとなりました。

■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。

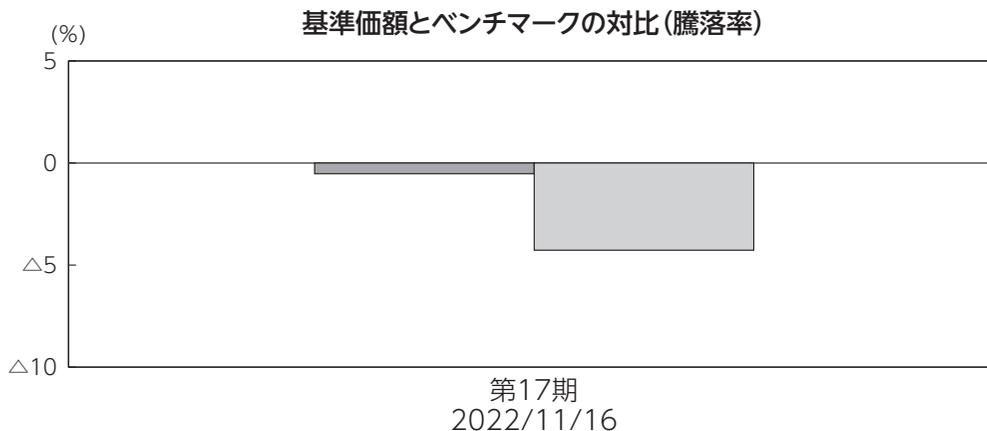
日本株式エンハンストインデックスマザーファンド

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



※ファンドの騰落率は分配金込み

■ 基準価額 ■ 東証株価指数 (TOPIX)

当期の基準価額の騰落率は $\Delta 0.5\%$ となりました。一方、ベンチマーク騰落率は $\Delta 4.3\%$ となり、騰落率の差異は $+3.7\%$ 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)

- ・「バリュエーション」、「リビジョン」および「グロース」ファクターの説明力が良好だったこと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)

- ・「クオリティ」ファクターの説明力が不冴え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。

■ 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17期
	(2021年11月17日~2022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	9,384

(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
	(2021年11月17日～2022年11月16日)		
	金額	比率	
(a)信託報酬	101 円	0.715 %	(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14,101円です。
(投信会社)	(59)	(0.418)	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)	(33)	(0.231)	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)	(9)	(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	0.006	(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)	(0.005)	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	0.007	(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)	(0.004)	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	103	0.728	

(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。

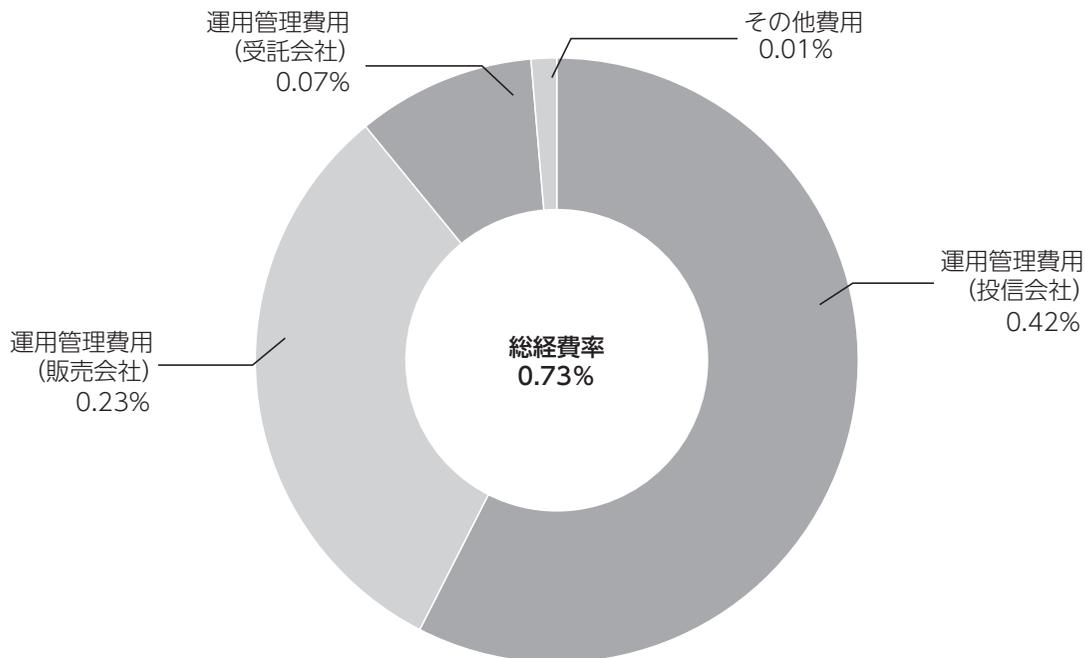
(注2)消費税は報告日の税率を採用しています。

(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**(2021年11月17日～2022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 31,447	千円 55,680	千口 40,413	千円 72,320

(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	6,651,431千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,539,079千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.61

(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**(2021年11月17日～2022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 257,462	千口 248,495	千円 466,252

(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(1,491,085千口)です。

◎投資信託財産の構成

2022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	466,252	99.1
コール・ローン等、その他	4,187	0.9
投資信託財産総額	470,439	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

2022年11月16日現在

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	470,439,367
コール・ローン等	3,987,163
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)	466,252,204
未 収 入 金	200,000
(B)負 債	1,828,814
未 払 解 約 金	203,449
未 払 信 託 報 酬	1,615,313
そ の 他 未 払 費 用	10,052
(C)純資産総額(A - B)	468,610,553
元 本	317,206,467
次 期 繰 越 損 益 金	151,404,086
(D)受 益 権 総 口 数	317,206,467口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,773円

◎損益の状況

自 2021年11月17日
至 2022年11月16日

項 目	当 期
	円
(A)有価証券売買損益	4,340,509
売 買 益	7,383,552
売 買 損	△ 3,043,043
(B)信託報酬等	△ 3,221,609
(C)当期損益金(A + B)	1,118,900
(D)前期繰越損益金	111,847,579
(E)追加信託差損益金	38,437,607
(配 当 等 相 当 額)	(176,669,853)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△138,232,246)
(F)計(C + D + E)	151,404,086
(G)収益分配金	0
次期繰越損益金(F + G)	151,404,086
追加信託差損益金	38,437,607
(配 当 等 相 当 額)	(176,850,850)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△138,413,243)
分 配 準 備 積 立 金	120,844,967
繰 越 損 益 金	△ 7,878,488

(注1)当ファンドの期首元本額は326,298,515円、期中追加設定元本額は47,038,806円、期中一部解約元本額は56,130,854円です。

(注2)1口当たり純資産額は1,4773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(8,997,388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(176,850,850円)および分配準備積立金(111,847,579円)より分配対象収益は297,695,817円(10,000口当たり9,384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17期

(決算日 2022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、2022年11月16日に第17期決算を行いました。

以下、当マザーファンドの第17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	純資産額 総
	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
(第15期) 2020年11月16日	15,446	2.8	2,702.14	4.3	99.0	0.8	4,615
(第16期) 2021年11月16日	18,728	21.2	3,267.40	20.9	98.0	1.5	2,735
(第17期) 2022年11月16日	18,763	0.2	3,211.87	△ 1.7	98.1	1.4	2,797

(注1) 株式先物比率は買い建て比率ー売り建て比率。

(注2) 東証株価指数(TOPIX)は、株式会社J P X総研が算出する株価指数であり、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。東証株価指数(TOPIX)の指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

◎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) 2021年11月16日	18,728	—	3,267.40	—	98.0	1.5
11月末	17,633	△5.8	3,073.26	△5.9	98.6	0.7
12月末	18,272	△2.4	3,179.28	△2.7	98.3	0.8
2022年 1月末	17,421	△7.0	3,025.69	△7.4	98.6	0.8
2月末	17,325	△7.5	3,012.57	△7.8	98.9	0.8
3月末	18,006	△3.9	3,142.06	△3.8	97.5	2.2
4月末	17,588	△6.1	3,066.68	△6.1	97.2	2.2
5月末	17,766	△5.1	3,090.73	△5.4	97.2	2.2
6月末	17,461	△6.8	3,027.34	△7.3	96.9	2.2
7月末	18,251	△2.5	3,140.07	△3.9	98.7	0.7
8月末	18,506	△1.2	3,177.98	△2.7	98.9	0.7
9月末	17,482	△6.7	3,003.39	△8.1	95.2	4.3
10月末	18,383	△1.8	3,156.44	△3.4	98.3	1.4
(期末) 2022年11月16日	18,763	0.2	3,211.87	△1.7	98.1	1.4

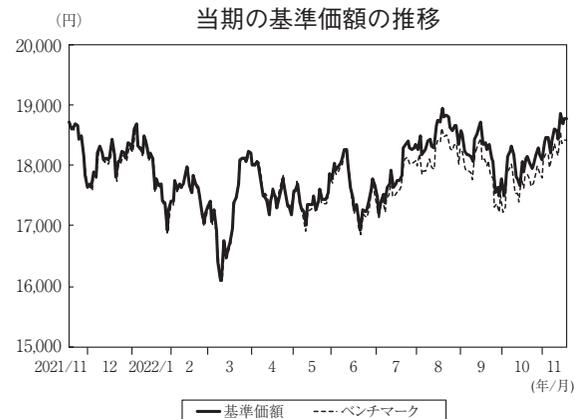
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は買い建て比率ー売り建て比率。

◎当期中の運用経過と今後の運用方針(2021年11月17日～2022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



※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18,728円で始まり期末18,763円で終わりました。騰落率は+0.2%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)

- ・2022年3月中旬から下旬にかけて円安傾向で推移し日本企業の業績拡大期待が高まったことから、国内株式相場が上昇したこと

(下落要因)

- ・期首から2022年3月上旬にかけて、世界的なインフレを背景とする金融引き締め動き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+0.2%となりました。一方、ベンチマーク騰落率は△1.7%となり、騰落率の差異は+1.9%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)

- ・「バリュエ」、 「リビジョン」 および 「グロース」 ファクターの説明力が良好だったことがプラスとなりました。

(マイナス要因)

- ・「クオリティー」 ファクターの説明力が不冴え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。

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
	(2021年11月17日～2022年11月16日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1 円	0.006 %	(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17,841円です。
(株式)	(1)	(0.005)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) その他費用	0	0.002	(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)	(0.002)	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	1	0.008	

(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(2021年11月17日～2022年11月16日)

○株式

	買 付	株 数	金 額	売 付	株 数	金 額
国内 上 場	1,751 (15)	3,388,477 (-)	1,691	3,262,954		

(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	284 百万円	287 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	6,651,431千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	2,539,079千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	2.61

(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(2021年11月17日～2022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
水産・農林業 (0.3%)			
日本水産	—	17.8	8,971
マルハニチロ	1.2	—	—
サカタのタネ	1.9	—	—
ホク	1.3	—	—
鉱業 (0.7%)			
I N P E X	0.9	13	20,241
建設業 (2.2%)			
ショーボンドホールディングス	0.9	—	—
安藤・間	0.5	—	—
東急建設	—	0.9	571
大成建設	0.5	0.2	782
大林組	—	15.2	14,789
清水建設	—	1	713
長谷工コーポレーション	—	3.1	4,513
鹿島建設	5.9	0.6	885
三井住友建設	—	19.7	7,899
熊谷組	0.1	—	—
大東建託	0.1	—	—
東洋建設	5.1	—	—
五洋建設	5.7	—	—
大和ハウス工業	4.1	3.2	9,878
積水ハウス	5.8	4.2	10,386
中電工	—	3.4	6,936
日揮ホールディングス	2.3	—	—
日比谷総合設備	—	1.7	3,209
食料品 (2.8%)			
日清製粉グループ本社	—	0.3	469
森永製菓	—	2.2	7,876
江崎グリコ	0.7	—	—
カルビー	1.8	2	5,532
ヤクルト本社	—	0.1	783
明治ホールディングス	1.1	0.1	649
日本ハム	1.5	—	—
伊藤ハム米久ホールディングス	9.1	—	—
アサヒグループホールディングス	1.8	4.8	20,515
キリンホールディングス	5	2.8	5,958
サントリー食品インターナショナル	1.8	0.2	895
ダイドーグループホールディングス	0.7	—	—
伊藤園	—	0.1	537

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キッコーマン	0.2	0.1	761
味の素	1.1	0.3	1,223
キユーピー	0.2	—	—
カゴメ	1.8	—	—
東洋水産	0.6	—	—
日清食品ホールディングス	—	0.1	1,023
日本たばこ産業	7.9	10.9	29,833
繊維製品 (0.6%)			
グンゼ	—	0.4	1,512
帝人	2.6	8.4	10,424
東レ	15.1	0.6	424
ワコールホールディングス	2.2	1.9	4,590
パルプ・紙 (0.2%)			
王子ホールディングス	0.8	0.7	370
日本製紙	—	5.8	5,475
北越コーポレーション	6.9	—	—
大王製紙	3.4	—	—
化学 (6.1%)			
クラレ	2	—	—
旭化成	4.8	7.2	7,214
昭和電工	3	—	—
住友化学	16.5	0.7	338
日産化学	0.6	0.3	1,965
東ソニー	0.6	0.7	1,115
関東電化工業	3.6	—	—
信越化学工業	1.7	1.3	22,990
エア・ウォーター	3	—	—
日本酸素ホールディングス	—	0.2	444
日本触媒	1.1	—	—
カネカ	1.3	—	—
三菱瓦斯化学	0.2	1.5	2,889
三井化学	0.4	0.2	616
J S R	—	0.2	559
東京応化工業	—	1.5	10,380
三菱ケミカルグループ	7.2	8.7	6,250
ダイセル	—	1.4	1,341
積水化学工業	0.7	5.6	10,668
日本ゼオン	0.3	—	—
アイカ工業	—	1	3,260
積水樹脂	—	0.2	344

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本化薬	—	9.4	11,110
花王	2.2	3.4	18,465
日本ペイントホールディングス	—	0.3	328
太陽ホールディングス	2.2	—	—
DI C	0.2	3.9	9,516
サカタインクス	2.6	—	—
東洋インキSCホールディングス	—	3.6	6,660
富士フイルムホールディングス	1.7	0.3	2,210
資生堂	2.3	2.3	13,622
ライオン	0.2	—	—
マンダム	—	2.3	3,116
コーセー	0.5	—	—
ノエビアホールディングス	—	1.2	6,864
小林製薬	—	0.9	7,605
小カラバイオ	2.2	—	—
アース製薬	0.9	—	—
日東電工	1.1	0.9	7,668
エフピコ	0.2	—	—
ニフコ	1.2	—	—
バルカー	—	2.1	5,703
ユニ・チャーム	1.4	0.7	3,483
医薬品 (6.1%)			
協和キリン	0.6	5.3	16,483
武田薬品工業	6.7	8.5	32,733
アステラス製薬	6.8	13.8	28,434
塩野義製薬	0.4	0.6	4,072
中外製薬	3.2	7.5	25,710
エーザイ	0.4	0.1	852
ロート製薬	1.3	—	—
小野薬品工業	4.5	6.4	21,305
参天製薬	2.9	9.7	10,573
栄研化学	3.3	—	—
JCRファーマ	1.3	—	—
東和薬品	0.9	—	—
第一三共	8.4	5.5	25,393
キョーリン製薬ホールディングス	—	1	1,776
大塚ホールディングス	2.9	0.1	450
ペプチドリム	2.6	—	—
石油・石炭製品 (0.8%)			
出光興産	—	4.8	15,168
ENEOSホールディングス	0.8	14.9	7,046
コスモエネルギーホールディングス	0.3	—	—

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ゴム製品 (0.9%)			
横浜ゴム	3.6	0.7	1,433
TOYO TIRE	0.3	—	—
ブリヂストン	2	4.5	23,719
住友ゴム工業	0.3	—	—
ガラス・土石製品 (0.9%)			
A G C	1.4	3.6	16,146
太平洋セメント	0.2	—	—
日本カーボン	—	1.5	6,480
T O T O	1.8	0.1	475
日本碍子	4.2	0.3	522
日本特殊陶業	3.1	0.5	1,294
鉄鋼 (0.4%)			
日本製鉄	6.9	0.8	1,777
神戸製鋼所	10.4	—	—
JFEホールディングス	1.4	0.3	450
東京製鉄	3.3	—	—
淀川製鋼所	—	1.9	4,797
丸一鋼管	—	1	2,812
非鉄金属 (0.7%)			
三井金属鉱業	0.2	—	—
住友金属鉱山	—	0.1	476
DOWAホールディングス	0.2	—	—
古河機械金属	—	4.4	5,517
U A C J	2.4	—	—
住友電気工業	1.6	7.5	11,988
アサヒホールディングス	—	1.1	2,153
金属製品 (0.3%)			
S U M C O	—	0.2	421
三和ホールディングス	0.5	—	—
L I X I L	—	1.5	3,199
ノーリツ	—	3.5	5,208
リンナイ	0.7	—	—
日本発條	0.6	—	—
機械 (4.6%)			
三浦工業	0.2	—	—
オークマ	—	0.3	1,515
アマダ	0.7	13.7	14,919
F U J I	0.2	—	—
牧野フライス製作所	—	2.4	10,644
D M G 森精機	0.2	1.6	2,859
デイスコ	0.3	0.1	4,100

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
やまびこ	3.6	—	—
S M C	0.3	0.4	26,104
オイレス工業	1.3	—	—
サトーホールディングス	1.2	—	—
小松製作所	5.5	1.7	5,188
住友重機械工業	0.8	1.3	3,630
日立建機	—	0.1	305
T O W A	—	0.5	1,061
クボタ	3.6	1.6	3,296
荏原製作所	0.1	1.8	9,162
ダイキン工業	1	0.5	11,337
栗田工業	—	0.1	605
椿本チエイン	0.9	—	—
ダイフク	0.2	1.6	11,808
C K D	2.3	—	—
グローリー	2.1	—	—
リケン	—	0.5	1,114
ツバキ・ナカシマ	—	0.7	672
ホシザキ	0.5	0.1	449
N T N	20.9	—	—
ジェイテクト	6.5	—	—
T H K	—	0.9	2,408
マキタ	1.4	5	14,815
三菱重工業	—	0.2	1,010
電気機器 (18.3%)			
イビデン	—	0.1	577
ブラザー工業	3.4	0.3	650
ミネベアミツミ	0.5	0.2	458
日立製作所	3.8	2.9	20,894
日立製作所	1.2	0.6	2,919
三菱電機	12.5	5	6,860
富士電機	—	0.1	596
安川電機	0.2	0.1	453
マブチモーター	1.6	—	—
日本電産	2.1	1.1	9,847
オムロン	1	0.6	4,406
I D E C	—	0.4	1,208
日本電気	0.3	0.1	480
富士通	0.6	0.9	16,326
ルネサスエレクトロニクス	7.1	14.4	20,232
セイコーエプソン	3.1	0.3	630
ワコム	4.3	—	—

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
能美防災	1	—	—
パナソニックホールディングス	13.9	2.4	2,913
シャープ	0.2	—	—
アシックス	2.6	—	—
ソニーグループ	5.8	5.2	59,228
T D K	0.9	2.9	14,587
ヒロセ電機	0.4	0.8	14,448
横河電機	—	4.9	12,122
アズビル	—	0.1	408
日本光電工業	0.2	—	—
堀場製作所	0.9	0.1	644
アドバンテスト	0.4	2.3	21,229
キーエンス	0.9	1	60,370
日置電機	0.4	—	—
シスメックス	0.6	1.5	13,200
OBARA GROUP	1.5	—	—
オプテックスグループ	3.9	—	—
レーザーテック	0.5	1.1	31,718
図研	—	0.6	1,890
ファナック	1.1	1.3	27,170
ローム	0.2	1.7	18,751
浜松ホトニクス	1.4	2.8	20,132
新光電気工業	1.1	—	—
京セラ	0.8	1.3	8,927
太陽誘電	0.1	—	—
村田製作所	3.3	4.6	35,843
小糸製作所	1.1	0.2	448
SCREENホールディングス	0.5	—	—
キヤノン電子	0.4	—	—
キヤノン	5.5	7.7	24,101
リコー	—	4.3	4,510
東京エレクトロン	0.6	0.9	41,760
輸送用機器 (7.2%)			
豊田自動織機	0.5	2.2	16,852
デンソー	1.7	0.5	3,793
川崎重工業	—	3.8	10,982
日産自動車	2.4	2.4	1,195
いすゞ自動車	5.1	0.6	1,030
トヨタ自動車	46.3	45	89,820
三菱自動車工業	—	18.7	10,789
アイシン	0.6	0.6	2,274
マツダ	7.8	1	1,092

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
本田技研工業	6.6	10.1	33,461
スズキ	1.7	0.5	2,490
SUBARU	1.8	8	18,104
ヤマハ発動機	0.9	0.3	1,012
エクセディ	—	1.1	1,798
豊田合成	0.6	—	—
シマノ	0.6	0.1	2,384
精密機器 (2.8%)			
テルモ	3.7	0.7	2,777
島津製作所	1.9	0.8	3,344
東京精密	0.2	—	—
ニコン	—	4.4	5,588
トプコン	—	3.5	5,673
オリンパス	5.9	10.8	29,203
理研計器	0.4	0.2	1,006
HOYA	2.1	2	29,100
ノーリツ銅機	0.9	—	—
朝日インテック	3	0.2	503
その他製品 (2.1%)			
バンダイナムコホールディングス	0.6	0.3	2,673
凸版印刷	—	0.2	413
日本印刷	—	0.2	539
NISSHA	3.3	—	—
アシックス	—	1.6	4,808
ローランド	—	1.7	6,723
ヤマハ	1	2	10,860
ピジョン	2.2	1.4	2,807
リンテック	—	1.6	3,536
任天堂	0.7	4.4	25,586
美津濃	1.6	—	—
電気・ガス業 (1.0%)			
東京電力ホールディングス	8	8.7	3,932
中部電力	0.4	0.6	738
関西電力	—	0.4	451
北陸電力	9	—	—
九州電力	5.7	—	—
電源開発	3.8	—	—
東京瓦斯	4.7	6	14,478
大阪瓦斯	0.9	0.3	598
東邦瓦斯	2	2.5	6,537
静岡ガ	—	2	1,910

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
陸運業 (2.6%)			
東武鉄道	0.4	0.2	622
相鉄ホールディングス	—	2.1	4,401
東急	4.8	0.4	636
小田急電鉄	1.8	0.2	340
京王電鉄	—	0.1	478
京成電鉄	—	0.1	360
東日本旅客鉄道	2.5	2	15,268
西日本旅客鉄道	0.7	2.2	12,029
東海旅客鉄道	0.7	0.9	14,310
ハマキョウレックス	1.2	—	—
近鉄グループホールディングス	0.2	0.1	452
阪急阪神ホールディングス	—	0.1	404
名古屋鉄道	2.8	—	—
日本通運	0.1	—	—
ヤマトホールディングス	0.3	2.5	5,865
丸全昭和運輸	—	0.9	2,844
センコーグループホールディングス	5.9	—	—
ニッコンホールディングス	2.5	1.4	3,362
セイノーホールディングス	0.3	—	—
九州旅客鉄道	1.4	3.2	8,902
SGホールディングス	1.1	0.7	1,446
NIPPON EXPRESSホールディングス	—	0.1	776
海運業 (0.6%)			
日本郵船	—	4.5	12,566
商船三井	0.3	0.2	627
NSユナイテッド海運	—	0.7	2,607
空運業 (0.5%)			
日本航空	0.3	0.2	518
ANAホールディングス	—	4.3	11,913
倉庫・運輸関連業 (0.5%)			
三菱倉庫	—	2.4	7,860
住友倉庫	2.3	—	—
上組	—	2.1	5,766
情報・通信業 (8.0%)			
日鉄ソリューションズ	1	—	—
TIS	0.2	0.1	407
グリー	—	8.9	7,378
コーエーテクモホールディングス	—	6.5	15,528
ネクソン	4.7	0.2	541
コロプラ	7.3	—	—
ブロードリーフ	8.2	—	—

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
S H I F T	0.1	0.2	5,582
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.2	—	—
コムチユア	—	0.3	771
野村総合研究所	1.1	2.5	8,687
アルテリア・ネットワークス	—	0.7	878
フジ・メディア・ホールディングス	—	12.3	12,656
オービック	0.2	0.1	2,191
Zホールディングス	6.3	44.5	16,554
トレンドマイクロ	0.8	0.3	2,103
日本オラクル	0.3	1.8	15,030
オービックビジネスコンサルタント	1.1	—	—
伊藤忠テクノソリューションズ	—	0.3	969
大塚商会	0.1	2.6	11,791
ネットワンシステムズ	—	2.4	8,448
エイベックス	—	5.4	8,359
日本テレビホールディングス	0.5	—	—
スカパーJ SATホールディングス	14.5	—	—
日本電信電話	10.8	7.2	27,014
K D D I	6.4	5.9	23,812
ソフトバンク	14.6	12.3	18,093
光通信	0.2	—	—
GM0インターネットグループ	—	3.4	8,850
ゼンリン	1.7	—	—
東宝	—	0.1	522
エヌ・ティ・ティ・データ	2.9	0.2	415
D T S	1.8	—	—
スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.9	0.2	1,328
カブコン	2.1	0.4	1,738
S C S K	—	0.4	852
T K C	1	—	—
コナミグループ	0.1	0.1	672
ソフトバンクグループ	5.5	2.8	17,718
卸売業 (6.3%)			
双日	—	1.2	2,895
アルフレッサホールディングス	0.6	—	—
神戸物産	—	2.3	8,360
あいホールディングス	1.7	—	—
マクニカホールディングス	0.8	1.9	6,517
コマダホールディングス	2.1	—	—
メデイバルホールディングス	0.2	—	—
I D O M	0.8	—	—
伊藤忠商事	6	7.8	32,892

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
丸紅	6.7	14.9	22,156
長瀬産業	1.3	—	—
豊田通商	—	0.3	1,533
兼松	0.5	8.8	13,182
三井物産	9.4	5	19,700
住友商事	9.1	1	2,197
三菱商事	6	8.6	37,676
阪和興業	—	2	7,200
サンゲツ	4	—	—
リョーサン	2.7	—	—
モスフードサービス	0.9	—	—
オートバックスセブン	0.2	—	—
ミスミグループ本社	1.8	5.5	18,425
小売業 (5.5%)			
ローソン	0.8	1.6	7,824
アスクル	1.9	2.1	3,454
アルペン	0.9	—	—
ジズホールディングス	—	0.7	2,943
MonotaRO	0.4	4.1	10,311
J. フロントリテイリング	5.1	—	—
ドトール・日レスホールディングス	0.6	—	—
ZOZO	1.7	4.7	15,251
ウエルシアホールディングス	—	5.2	16,068
オイシックス・ラ・大地	1.2	—	—
ネクステージ	0.5	2.3	6,334
ジョイフル本田	4.4	—	—
すかいらーくホールディングス	4.6	—	—
セブン&アイホールディングス	3.1	3.4	18,812
ツルハホールディングス	0.3	—	—
トリドールホールディングス	1.3	3.4	9,166
アドヴァングループ	1.5	—	—
パナソニック・インテリジェントソリューションズ	—	0.2	469
サイゼリヤ	0.4	—	—
日本瓦葺	—	2.5	5,130
しまむら	0.1	—	—
イオン	3.9	2.2	6,014
イズミ	0.1	—	—
平和堂	2.8	—	—
ヤマダホールディングス	1.3	—	—
ニトリホールディングス	0.5	1.5	23,430
吉野家ホールディングス	2.8	—	—
プレナス	2.2	—	—

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
バローホールディングス	2.2	—	—
ファーストリテイリング	0.1	0.3	25,005
銀行業 (5.4%)			
しずおかフィナンシャルグループ	—	0.8	728
めぶきフィナンシャルグループ	—	28.4	8,264
東京きらほしフィナンシャルグループ	—	0.9	1,906
ゆうちょ銀行	8	2.1	2,116
コンコルディア・フィナンシャルグループ	—	16.7	7,414
西日本フィナンシャルホールディングス	8.1	13	10,491
第四北越フィナンシャルグループ	1.8	—	—
あおぞら銀行	—	5.6	14,168
三菱UFJフィナンシャル・グループ	51.5	58.6	42,162
りそなホールディングス	—	1.6	967
三井住友トラスト・ホールディングス	1.3	2.3	9,505
三井住友フィナンシャルグループ	8	7.9	35,352
千葉銀行	—	0.8	618
武蔵野銀行	—	0.8	1,393
七十七銀行	0.3	—	—
八十二銀行	1.4	—	—
大垣共立銀行	2.1	—	—
南都銀行	—	0.2	422
はくはくフィナンシャルグループ	7.8	—	—
阿波銀行	2.7	—	—
セブン銀行	—	7.1	1,789
みずほフィナンシャルグループ	11.4	6.4	10,281
証券、商品先物取引業 (0.9%)			
SBIホールディングス	0.4	5.5	14,344
ジャフコグループ	0.6	—	—
大和証券グループ本社	—	18.5	10,896
野村ホールディングス	10.4	1.3	638
松井証券	7.7	—	—
保険業 (2.2%)			
かんぽ生命保険	1.5	0.2	430
SOMPOホールディングス	1.2	4.2	25,200
アニコムホールディングス	3.2	5.7	3,853
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	1.6	2.1	8,213
第一生命ホールディングス	1.8	3.6	8,445
東京海上ホールディングス	2	4.7	12,537
T&Dホールディングス	7.1	0.5	740
その他金融業 (1.5%)			
芙蓉総合リース	—	0.9	7,551
東京センチュリー	0.1	—	—

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
リコーリース	1.4	—	—
イオンフィナンシャルサービス	3.2	—	—
ジャックス	—	0.8	2,936
オリックス	7.4	5.2	10,899
三菱HCキャピタル	0.7	7	4,389
日本取引所グループ	0.2	7.2	14,220
不動産業 (1.4%)			
大東建託	—	0.1	1,459
いちご	11.3	—	—
ビューリック	4.1	4	4,468
野村不動産ホールディングス	—	0.1	320
オープンハウスグループ	—	1.9	11,495
飯田グループホールディングス	—	2.3	5,066
ケイアイスター不動産	—	2	9,870
三井不動産	6.3	0.7	1,853
三菱地所	6.9	1.1	2,060
住友不動産	2.2	0.1	359
スターツコーポレーション	—	1	2,768
イオンモール	4	—	—
カチタス	0.4	—	—
サービス業 (5.6%)			
日本M&Aセンターホールディングス	0.9	10.1	19,361
夢真ビーネックスグループ	—	3.4	6,470
パーソルホールディングス	—	0.1	277
総合警備保障	1.1	0.8	2,884
カカクコム	—	5.9	13,752
ベネフィット・ワン	0.5	1.1	2,362
エムスリー	2.3	0.8	3,715
アウトソーシング	—	1.8	1,852
ディー・エヌ・エー	0.4	—	—
博報堂DYホールディングス	0.2	0.3	398
電通グループ	1.8	0.1	449
H.U.グループホールディングス	2.3	—	—
オリエンタルランド	0.7	1.2	23,190
ダスキン	1.7	—	—
ビー・エム・エル	1.5	—	—
りらいあコミュニケーションズ	2.3	0.3	302
ユー・エス・エス	3.6	2.5	5,395
サイバーエージェント	5.2	0.9	1,119
楽天グループ	9.4	0.4	282
アイ・アールジャパンホールディングス	0.4	—	—
リクルートホールディングス	6.2	8.9	41,135

銘柄	期首	当期	期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
日本郵政	17.2	4.1	4,210	
ソラスタ	—	2.7	2,305	
ベйкаレント・コンサルティング	0.2	—	—	
トランス・コスモス	1.5	—	—	
セコム	1.6	0.1	803	
メイテック	—	3.9	9,629	
ベネッセホールディングス	2.1	6.4	12,640	
イオンデイライト	—	0.3	877	
ダイセキ	0.3	—	—	
合計	株数・金額	1,022	1,098	2,745,264
	銘柄数〈比率〉	352	328	〈98.1%〉

(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	39	—

(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

2022年11月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	2,745,264	98.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	52,732	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	2,797,996	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

2022年11月16日現在

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	2,797,996,858
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	23,667,372
株 式 (評価額)	2,745,264,300
未 収 入 金	2,433,240
未 収 配 当 金	27,416,946
差 入 委 託 証 拠 金	△ 785,000
(B)負 債	200,870
未 払 解 約 金	200,000
そ の 他 未 払 費 用	870
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	2,797,795,988
元 本	1,491,085,076
次 期 繰 越 損 益 金	1,306,710,912
(D)受 益 権 総 口 数	1,491,085,076口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	18,763円

◎損益の状況

自 2021年11月17日
至 2022年11月16日

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	71,158,308
受 取 配 当 金	71,142,865
そ の 他 収 益 金	15,443
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 62,718,209
売 買 益	262,709,069
売 買 損	△ 325,427,278
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,389,600
取 引 益	6,941,680
取 引 損	△ 5,552,080
(D)信 託 報 酬 等	△ 42,838
(E)当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	9,786,861
(F)前 期 繰 越 損 益 金	1,275,020,646
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	58,684,314
(H)解 約 差 損 益 金	△ 36,780,909
(I)計 (E + F + G + H)	1,306,710,912
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	1,306,710,912

(注1)当親ファンドの期首元本額は1,460,789,481円、期中追加設定元本額は76,834,686円、期中一部解約元本額は46,539,091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)1,242,589,524円、明治安田DCトビックスプラス248,495,552円です。

(注3)1口当たり純資産額は1.8763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。