

# 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（2006年2月8日設定）	
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18期

（決算日 2023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18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。

**MYAM 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
(第18期) 2023年11月16日	17,718	0	19.9	2,368.62	20.6	97.6	1.6	631

(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) 2022年11月16日	14,773	—	1,963.29	—	97.6	1.4
11月末	14,901	0.9	1,985.57	1.1	97.7	1.4
12月末	14,195	△ 3.9	1,891.71	△ 3.6	98.2	0.7
2023年 1月末	14,789	0.1	1,975.27	0.6	98.1	0.7
2月末	14,952	1.2	1,993.28	1.5	98.3	0.7
3月末	15,168	2.7	2,003.50	2.0	96.6	2.1
4月末	15,546	5.2	2,057.48	4.8	97.5	1.4
5月末	16,146	9.3	2,130.63	8.5	97.3	1.4
6月末	17,262	16.8	2,288.60	16.6	97.3	2.1
7月末	17,464	18.2	2,322.56	18.3	97.2	2.1
8月末	17,351	17.5	2,332.00	18.8	97.6	1.4
9月末	17,327	17.3	2,323.39	18.3	97.1	1.6
10月末	16,796	13.7	2,253.72	14.8	96.6	2.3
(期末) 2023年11月16日	17,718	19.9	2,368.62	20.6	97.6	1.6

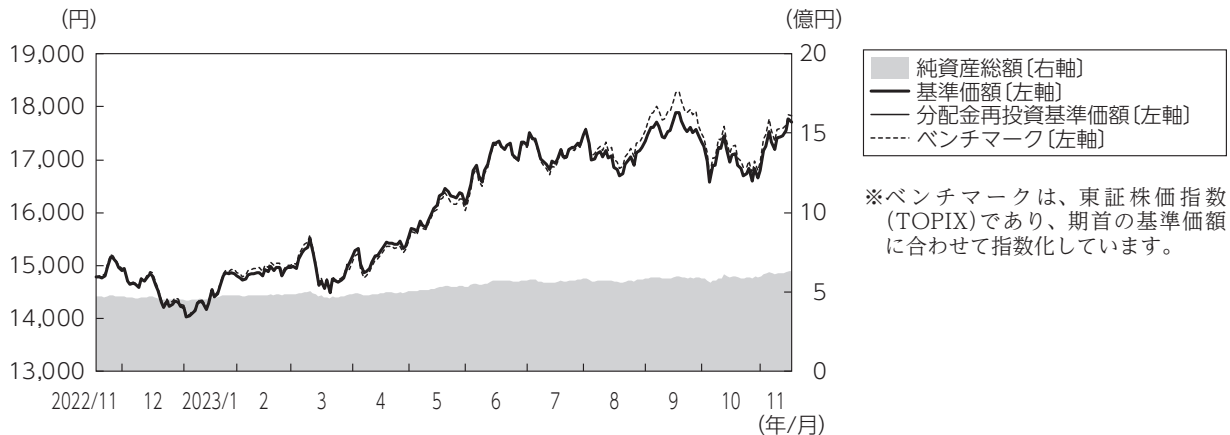
(注1) 騰落率は期首比です。

(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18期首(2022年11月16日)：14,773円

第18期末(2023年11月16日)：17,718円(既払分配金0円)

騰落率：19.9%(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)

- ・期首から2023年9月中旬にかけて、良好な2023年3月期企業決算、新型コロナウイルス感染症5類移行後のリオープニングやインバウンド需要の増加に伴う国内消費拡大への期待、円安ドル高による輸出企業の業績改善に対する期待などから、国内株式相場が大きく上昇したこと

## ■投資環境

当期の国内株式相場は上昇しました。期首から2023年9月中旬にかけて、日銀による長期金利の許容変動幅の拡大や、欧米での金融システム不安などで下げる場面があったものの、中国のゼロコロナ政策の撤廃による景気回復期待、米国著名投資家による日本の株式への強気な発言、相次ぐ良好な2023年3月期企業決算、新型コロナウイルス感染症5類移行後のリオープニングやインバウンド需要の増加に伴う国内消費拡大への期待、円安ドル高による輸出企業の業績改善に対する期待などの好材料が相次ぎ、大きく上昇しました。その後10月にかけてはインフレの高止まりを受けた米国の金融引き締め長期化観測から下落しましたが、日銀の金融政策再修正が市場予想よりも緩和的と受け取られると、期末にかけて再度上昇しました。

## ■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。

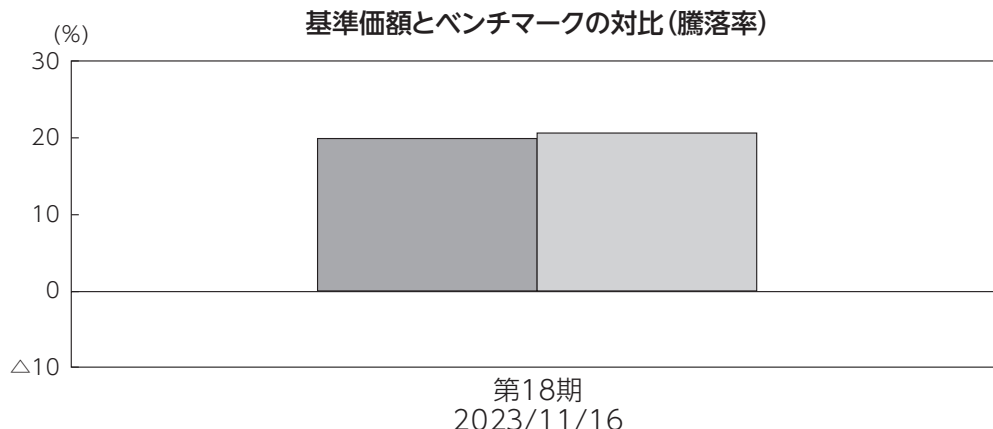
### 日本株式エンハンストインデックスマザーファンド

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を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+19.9%となりました。一方、ベンチマーク騰落率は+20.6%となり、騰落率の差異は△0.7%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)

- ・「バリュー」ファクターなどの説明力が良好だったことがプラス要因となりました。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)

- ・「リビジョン」や「クオリティ」ファクターなどの説明力が不冴えだったことがマイナス要因となりました。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18期
	(2022年11月17日~2023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	11,836

(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
	(2022年11月17日～2023年11月16日)		
	金額	比率	
(a)信託報酬	114 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15,991円です。
(投信会社)	(67)	(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)	(37)	(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)	(11)	(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	2	0.012	(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)	(2)	(0.011)	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)	(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)	(0.001)	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	117	0.733	

(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。

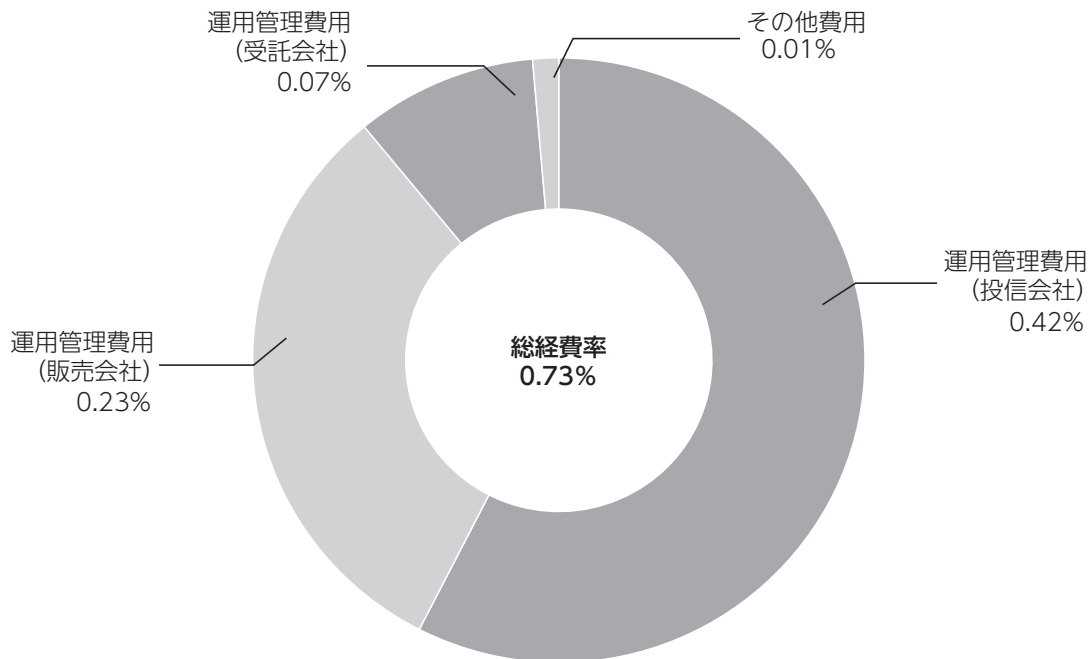
(注2)消費税は報告日の税率を採用しています。

(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**(2022年11月17日～2023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 53,210	千円 110,310	千口 24,867	千円 49,930

(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	6,094,412千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,890,057千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.10

(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**(2022年11月17日～2023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 248,495	千口 276,838	千円 628,063

(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(1,334,769千口)です。

◎投資信託財産の構成

2023年11月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本株式エンハンストインデックスマザーファンド	628,063	99.0
コール・ローン等、その他	6,623	1.0
投資信託財産総額	634,686	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

2023年11月16日現在

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	634,686,397
コール・ローン等	5,283,035
日本株式エンハンスト インデックスマザーファンド(評価額)	628,063,362
未 収 入 金	1,340,000
(B)負 債	3,438,001
未 払 解 約 金	1,360,528
未 払 信 託 報 酬	2,064,819
未 払 利 息	15
そ の 他 未 払 費 用	12,639
(C)純資産総額(A - B)	631,248,396
元 本	356,267,149
次 期 繰 越 損 益 金	274,981,247
(D)受 益 権 総 口 数	356,267,149口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,718円

◎損益の状況

自 2022年11月17日  
至 2023年11月16日

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	△ 1,808
受 取 利 息	1
支 払 利 息	△ 1,809
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	98,001,870
売 買 益	101,841,506
売 買 損	△ 3,839,636
(C)信 託 報 酬 等	△ 3,773,305
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	94,226,757
(E)前 期 繰 越 損 益 金	101,336,526
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	79,417,964
( 配 当 等 相 当 額 )	( 225,949,703 )
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( △146,531,739 )
(G)計 ( D + E + F )	274,981,247
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	274,981,247
追 加 信 託 差 損 益 金	79,417,964
( 配 当 等 相 当 額 )	( 226,141,394 )
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( △146,723,430 )
分 配 準 備 積 立 金	195,563,283

(注1)当ファンドの期首元本額は317,206,467円、期中追加設定元本額は74,418,317円、期中一部解約元本額は35,357,635円です。

(注2)1口当たり純資産額は1,7718円です。

(注3)損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注4)損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬等に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注5)損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注6)計算期末における費用控除後の配当等収益(13,074,450円)、費用控除後の有価証券等損益額(74,084,912円)、信託約款に規定する収益調整金(226,141,394円)および分配準備積立金(108,403,921円)より分配対象収益は421,704,677円(10,000口当たり11,836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18期

(決算日 2023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、2023年11月16日に第18期決算を行いました。

以下、当マザーファンドの第18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)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	期中騰落率	騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
(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
(第18期) 2023年11月16日	22,687	20.9	3,974.48	23.7	98.1	1.6	3,028

(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)		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首) 2022年11月16日	18,763	—	3,211.87	—	98.1	1.4
11月末	18,932	0.9	3,249.61	1.2	98.2	1.4
12月末	18,041	△ 3.8	3,101.25	△ 3.4	98.7	0.7
2023年 1月末	18,811	0.3	3,238.48	0.8	98.6	0.7
2月末	19,030	1.4	3,269.12	1.8	98.8	0.7
3月末	19,318	3.0	3,324.74	3.5	97.1	2.1
4月末	19,814	5.6	3,414.45	6.3	98.0	1.4
5月末	20,596	9.8	3,537.93	10.2	97.8	1.4
6月末	22,039	17.5	3,805.00	18.5	97.8	2.1
7月末	22,312	18.9	3,861.80	20.2	97.6	2.1
8月末	22,181	18.2	3,878.51	20.8	98.1	1.4
9月末	22,163	18.1	3,898.26	21.4	97.6	1.6
10月末	21,494	14.6	3,781.64	17.7	97.1	2.4
(期末) 2023年11月16日	22,687	20.9	3,974.48	23.7	98.1	1.6

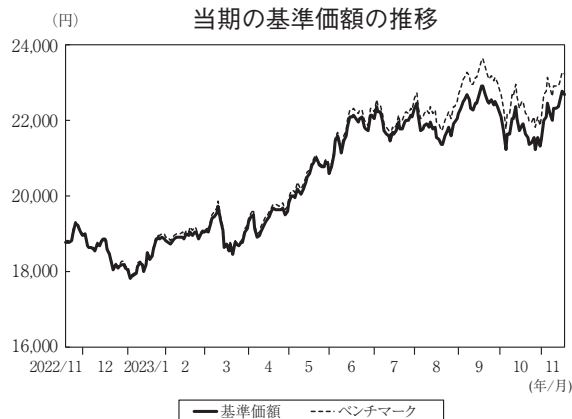
(注1) 騰落率は期首比です。

(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(2022年11月17日～2023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18,763円で始まり期末22,687円で終わりました。騰落率は+20.9%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)

- ・期首から2023年9月中旬にかけて、良好な2023年3月期企業決算、新型コロナウイルス感染症5類移行後のリオープンングやインバウンド需要の増加に伴う国内消費拡大への期待、円安ドル高による輸出企業の業績改善に対する期待などから、国内株式相場が大きく上昇したこと

## (2) ベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+20.9%となりました。一方、ベンチマーク騰落率は+23.7%となり、騰落率の差異は $\Delta$ 2.8%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)

- ・「バリュー」ファクターなどの説明力が良好だったことがプラス要因となりました。

## (マイナス要因)

- ・「リビジョン」や「クオリティ」ファクターなどの説明力が不冴えだったことが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。

## 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
	(2022年11月17日～2023年11月16日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	2 円	0.011 %	(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20,394円です。
(株式)	(2)	(0.011)	
(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	2	0.012	

(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(2022年11月17日～2023年11月16日)

## ○株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
		千株	千円	千株	千円
国内	上 場	1,387 ( 422)	2,915,950 ( - )	1,505	3,178,461

(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	
	百万円	百万円	百万円	百万円	
国内	株式先物取引	276	278	-	-

(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	6,094,412千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	2,890,057千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	2.10

(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(2022年11月17日～2023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>水産・農林業 (0.2%)</b>			
ニッスイ	17.8	7.5	5,226
<b>鉱業 (0.4%)</b>			
INPEX	13	2.3	4,771
石油資源開発	—	1.3	7,059
<b>建設業 (2.4%)</b>			
安藤・間	—	4.8	5,160
東急建設	0.9	—	—
大成建設	0.2	3.1	16,457
大林組	15.2	3.3	4,296
清水建設	1	0.7	671
長谷工コーポレーション	3.1	3.1	5,649
鹿島建設	0.6	0.6	1,363
三井住友建設	19.7	11.5	4,565
熊谷組	—	2.8	9,744
大和ハウス工業	3.2	0.7	2,956
積水ハウス	4.2	3.3	9,898
中電工	3.4	2.7	6,407
日比谷総合設備	1.7	1.5	3,316
<b>食料品 (2.3%)</b>			
日清製粉グループ本社	0.3	—	—
森永製菓	2.2	2	10,988
カルビー	2	4.3	11,616
ヤクルト本社	0.1	0.5	1,696
明治ホールディングス	0.1	0.1	335
日本ハム	—	0.4	1,709
アサヒグループホールディングス	4.8	3	17,412
キリンホールディングス	2.8	2.6	5,586
サントリー食品インターナショナル	0.2	0.2	941
伊藤園	0.1	—	—
キッコーマン	0.1	—	—
味の素	0.3	0.9	5,105
キューピー	—	0.3	754
アリアケジャパン	—	0.7	3,213
日清食品ホールディングス	0.1	—	—
日本たばこ産業	10.9	2.5	9,322
<b>繊維製品 (0.6%)</b>			
ゼン	0.4	2.3	10,948
帝人	8.4	—	—
東レ	0.6	4.6	3,587

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ワコールホールディングス	1.9	0.8	2,570
<b>パルプ・紙 (0.3%)</b>			
王子ホールディングス	0.7	15.8	9,100
日本製紙	5.8	—	—
<b>化学 (5.7%)</b>			
旭化成	7.2	8.7	8,765
住友化学	0.7	3.2	1,255
日産化学	0.3	0.2	1,111
東ソー	0.7	3.4	6,590
信越化学工業	1.3	4.9	25,195
日本酸素ホールディングス	0.2	—	—
三菱瓦斯化学	1.5	—	—
三井化学	0.2	0.2	806
JSR	0.2	—	—
東京応化工業	1.5	—	—
三菱ケミカルグループ	8.7	1.2	1,139
ダイセル	1.4	3.1	4,420
積水化学工業	5.6	—	—
アイカ工業	1	1.1	3,746
UBE	—	1.3	3,036
積水樹脂	0.2	—	—
日本化学薬	9.4	2.6	3,373
花王	3.4	4.3	24,024
日本ペイントホールディングス	0.3	—	—
DI C	3.9	4.4	10,582
サカタインクス	—	9.9	13,097
東洋インキSCホールディングス	3.6	5.1	13,290
富士フイルムホールディングス	0.3	0.2	1,729
資生堂	2.3	4.3	18,713
ライオン	—	4.1	5,344
マンダム	2.3	1.1	1,382
ポーラ・オルビスホールディングス	—	2.1	3,195
ノエビアホールディングス	1.2	1.9	9,747
小林製薬	0.9	0.3	1,989
日東電工	0.9	0.7	7,420
パルカー	2.1	—	—
ユニ・チャーム	0.7	0.1	472
<b>医薬品 (5.7%)</b>			
協和キリン	5.3	5.8	13,934
武田薬品工業	8.5	4	16,592

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アステラス製薬	13.8	13.1	22,944
塩野義製薬	0.6	0.4	2,828
中外製薬	7.5	3.9	18,544
エーザイ	0.1	—	—
小野薬品工業	6.4	7.3	19,472
参天製薬	9.7	11.5	15,306
ゼリア新薬工業	—	0.2	380
第一三共	5.5	9.2	36,468
杏林製薬	1	—	—
大塚ホールディングス	0.1	4.2	23,007
<b>石油・石炭製品 (0.8%)</b>			
出光興産	4.8	3.7	15,047
ENEOSホールディングス	14.9	15.4	9,238
<b>ゴム製品 (1.5%)</b>			
横浜ゴム	0.7	5.1	16,167
TOYO TIRE	—	3.9	9,907
ブリヂストン	4.5	2.8	16,867
<b>ガラス・土石製品 (0.9%)</b>			
AGC	3.6	2.6	13,769
住友大阪セメント	—	1.5	5,326
日本カーボン	1.5	0.4	1,814
TOTO	0.1	—	—
日本碍子	0.3	0.8	1,436
日本特殊陶業	0.5	1.2	4,146
<b>鉄鋼 (0.7%)</b>			
日本製鉄	0.8	0.5	1,687
JFEホールディングス	0.3	8.6	18,963
淀川製鋼所	1.9	—	—
丸一鋼管	1	0.1	381
新日本電工	—	1.3	378
<b>非鉄金属 (1.4%)</b>			
日本軽金属ホールディングス	—	0.3	497
三菱マテリアル	—	4.6	11,253
住友金属鉱山	0.1	2.9	12,681
古河機械金属	4.4	2.6	5,132
古河電気工業	—	0.2	469
住友電気工業	7.5	4.1	7,683
AREホールディングス	1.1	2.1	4,021
<b>金属製品 (0.8%)</b>			
SUMCO	0.2	0.5	1,087
東洋製罐グループホールディングス	—	3.9	9,262
LIXIL	1.5	7.1	12,545

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ノーリツ	3.5	—	—
<b>機械 (4.4%)</b>			
オークマ	0.3	—	—
芝浦機械	—	2.4	8,364
アマダ	13.7	—	—
牧野フライス製作所	2.4	—	—
オーエスジー	—	2.7	4,818
D M G 森精機	1.6	—	—
デイスコ	0.1	0.2	6,442
S M C	0.4	0.1	7,454
小松製作所	1.7	3.8	14,139
住友重機械工業	1.3	—	—
日立建機	0.1	—	—
T O W A	0.5	—	—
クボタ	1.6	10.4	21,866
荏原製作所	1.8	—	—
ダイキン工業	0.5	1.1	26,070
栗田工業	0.1	2.8	13,823
ダイフク	1.6	—	—
セガサミーホールディングス	—	2.2	4,776
リケン	0.5	—	—
ツバキ・ナカシマ	0.7	6.6	4,917
ホシザキ	0.1	1.3	6,054
N T N	—	11.3	3,221
T H K	0.9	—	—
マキタ	5	2	7,790
三菱重工	0.2	0.2	1,679
I H I	—	0.1	286
<b>電気機器 (18.1%)</b>			
イビデン	0.1	0.8	5,934
ブラザー工業	0.3	0.3	744
ミネベアミツミ	0.2	0.4	1,114
日立製作所	2.9	3.2	32,144
東芝	0.6	—	—
三菱電機	5	3.5	6,835
富士電機	0.1	0.2	1,215
安川電機	0.1	0.3	1,703
ソオネクスト	—	1	14,055
ニデック	1.1	—	—
オムロン	0.6	1.5	9,223
I D E C	0.4	—	—
日本電気	0.1	0.1	806



銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
富士通	0.9	0.4	8,030
ルネサスエレクトロニクス	14.4	11.7	28,641
セイコーエプソン	0.3	—	—
パナソニックホールディングス	2.4	4	5,676
ソニーグループ	5.2	4.5	59,422
TDK	2.9	2.4	15,801
ヒロセ電機	0.8	0.7	11,382
横河電機	4.9	2	5,795
アズビル	0.1	—	—
堀場製作所	0.1	0.2	1,830
アドバンテスト	2.3	6.7	31,557
キーエンス	1	0.6	37,830
シスメックス	1.5	2.4	18,916
日本マイクロニクス	—	4	13,840
レーザーテック	1.1	1	30,900
図研	0.6	—	—
ファナック	1.3	6.8	27,295
ロー Mum	1.7	6.5	17,634
浜松ホトニクス	2.8	2.8	16,791
京セラ	1.3	0.1	798
村田製作所	4.6	13	37,700
小糸製作所	0.2	—	—
キヤノン	7.7	6.2	23,076
リコー	4.3	10	11,900
東京エレクトロン	0.9	2.5	60,225
<b>輸送用機器 (8.8%)</b>			
トヨタ紡織	—	2.1	5,734
豊田自動織機	2.2	—	—
モリタホールディングス	—	0.9	1,346
デンソー	0.5	11.5	28,341
川崎重工業	3.8	—	—
日産自動車	2.4	9.4	5,721
いすゞ自動車	0.6	0.6	1,152
トヨタ自動車	45	41.4	119,190
三菱自動車工業	18.7	—	—
NOK	—	2.7	5,128
カヤバ	—	1.6	7,240
アイシン	0.6	0.2	1,116
マツダ	1	0.3	535
本田技研工業	10.1	28.6	46,074
スズキ	0.5	0.1	634
SUBARU	8	7.5	20,722

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ヤマハ発動機	0.3	0.4	1,486
エクセディ	1.1	—	—
豊田合 成	—	2	6,166
エフ・シー・シー	—	4.3	7,765
シマノ	0.1	0.1	2,241
<b>精密機器 (2.0%)</b>			
テルモ	0.7	1	4,690
島津製作所	0.8	0.3	1,137
ニコン	4.4	—	—
トプコン	3.5	—	—
オリンパス	10.8	8.8	18,849
理研計器	0.2	—	—
H O Y A	2	1	16,375
A&Dホロンホールディングス	—	2.6	4,711
朝日インテック	0.2	5.2	14,931
<b>その他製品 (2.0%)</b>			
バンダイナムコホールディングス	0.3	0.8	2,453
S H O E I	—	0.4	750
TOPPANホールディングス	0.2	0.1	330
大日本印刷	0.2	0.1	396
アシックス	1.6	—	—
ローランド	1.7	2.3	10,603
ヤマハハン	2	—	—
ピジヨン	1.4	1.7	2,822
リンテック	1.6	—	—
任天堂	4.4	5.9	41,612
<b>電気・ガス業 (1.7%)</b>			
東京電力ホールディングス	8.7	7.9	5,157
中部電力	0.6	4.7	8,490
関西電力	0.4	0.4	767
東京瓦斯	6	5.8	19,070
大阪瓦斯	0.3	4.8	13,699
東邦瓦斯	2.5	0.2	534
静岡ガス	2	3	3,063
<b>陸運業 (1.9%)</b>			
東武鉄道	0.2	—	—
相鉄ホールディングス	2.1	—	—
東急	0.4	0.2	348
小田急電鉄	0.2	—	—
京王電鉄	0.1	—	—
京成電鉄	0.1	0.1	617
東日本旅客鉄道	2	0.6	4,704

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
西日本旅客鉄道	2.2	1.8	10,445
東海旅客鉄道	0.9	0.2	698
ハマキョウレックス	—	0.8	3,116
近鉄グループホールディングス	0.1	—	—
阪急阪神ホールディングス	0.1	0.1	458
ヤマトホールディングス	2.5	6.6	17,054
山九	—	1.3	6,373
丸全昭和運輸	0.9	0.9	3,483
センコーグループホールディングス	—	5.2	5,460
ニッコンホールディングス	1.4	0.1	317
福山通運	—	0.3	1,072
九州旅客鉄道	3.2	—	—
SGホールディングス	0.7	0.5	1,070
NIPPON EXPRESSホールディングス	0.1	0.1	752
<b>海運業 (0.7%)</b>			
日本郵船	4.5	4.2	15,615
商船三井	0.2	0.5	1,915
川崎汽船	—	0.1	470
NSユナイテッド海運	0.7	—	—
飯野海運	—	1.8	2,037
<b>空運業 (0.4%)</b>			
日本航空	0.2	4.2	11,841
ANAホールディングス	4.3	—	—
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>			
三菱倉庫	2.4	—	—
住友倉庫	—	0.2	472
上組	2.1	1.9	5,977
<b>情報・通信業 (7.4%)</b>			
TIS	0.1	0.2	634
グリー	8.9	—	—
コーエーテクモホールディングス	6.5	0.2	385
ネクソン	0.2	—	—
SHIFU	0.2	—	—
GMOペイメントゲートウェイ	—	2.4	19,648
コムチュア	0.3	1	1,949
野村総合研究所	2.5	3.3	13,615
メルカリ	—	3.2	10,070
アルテリア・ネットワークス	0.7	—	—
フジ・メディア・ホールディングス	12.3	—	—
オービック	0.1	0.6	13,341
LINEヤフー	44.5	—	—
トレンドマイクロ	0.3	2.7	19,818

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本オラクル	1.8	0.1	1,106
伊藤忠テクノソリューションズ	0.3	—	—
大塚商会	2.6	0.2	1,167
ネットワンシステムズ	2.4	—	—
エイベックス	5.4	—	—
日本電信電話	7.2	299.6	51,531
KDDI	5.9	10.2	46,563
ソフトバンク	12.3	8.7	15,211
GMOインターネットグループ	3.4	2.3	5,375
東宝	0.1	—	—
NTTデータグループ	0.2	—	—
DT S	—	0.9	2,925
スクウェア・エニックス・ホールディングス	0.2	0.1	537
カブコン	0.4	0.6	3,055
SCSK	0.4	0.2	535
コナミグループ	0.1	—	—
ソフトバンクグループ	2.8	2.1	12,835
<b>卸売業 (6.0%)</b>			
あらた	—	0.1	629
円谷フィールズホールディングス	—	2.1	2,530
双日	1.2	—	—
神戸物産	2.3	3	10,776
マクニカホールディングス	1.9	1	6,829
IDOM	—	6.4	5,696
伊藤忠商事	7.8	7.9	47,352
丸紅	14.9	1.9	4,507
豊田通商	0.3	0.5	4,313
兼松	8.8	7.8	15,670
三井物産	5	4.2	23,801
住友商事	1	1.4	4,512
三菱商事	8.6	3.3	23,482
ユアサ商事	—	1	4,310
阪和興業	2	0.4	1,746
サンリオ	—	0.9	5,967
ミスミグループ本社	5.5	6.7	16,746
<b>小売業 (5.7%)</b>			
ローソン	1.6	1.6	11,494
アスクル	2.1	0.9	1,841
ジーンズホールディングス	0.7	—	—
MonotaRO	4.1	8.8	13,323
J.フロントリテイリング	—	2.1	2,965
マツキヨココカラ&カンパニー	—	0.2	519

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
Z O Z O	4.7	5.7	17,333
ウエルシアホールディングス	5.2	0.1	256
オイシックス・ラ・大地	—	1.3	1,690
ネクステージ	2.3	—	—
すかいらーくホールディングス	—	1.5	3,321
セブン&アイ・ホールディングス	3.4	3.2	18,323
トリドールホールディングス	3.4	0.8	3,369
FOOD & LIFE COMPANIES	—	4.3	11,895
良品計画	—	4	8,270
パ・パフィック・インターナショナルホールディングス	0.2	6	19,926
ゼンショーホールディングス	—	1.5	13,107
日本瓦斯	2.5	1.7	4,007
丸井グループ	—	0.9	2,005
イオン	2.2	0.4	1,246
ニトリホールディングス	1.5	0.1	1,525
ファーストリテイリング	0.3	0.9	33,165
<b>銀行業 (7.1%)</b>			
しずおかフィナンシャルグループ	0.8	0.3	357
めぶきフィナンシャルグループ	28.4	—	—
東京きらほしフィナンシャルグループ	0.9	—	—
ゆうちょ銀行	2.1	6.3	8,766
コンコルディア・フィナンシャルグループ	16.7	1.1	734
西日本フィナンシャルホールディングス	13	—	—
あおぞら銀行	5.6	5.4	16,394
三菱UFJフィナンシャル・グループ	58.6	44.5	56,248
りそなホールディングス	1.6	1	770
三井住友トラスト・ホールディングス	2.3	4	21,368
三井住友フィナンシャルグループ	7.9	5.8	42,577
千葉銀行	0.8	0.3	320
武蔵野銀行	0.8	—	—
ふくおかフィナンシャルグループ	—	1.1	3,826
南都銀行	0.2	0.3	729
山陰合同銀行	—	1.2	1,129
セブン銀行	7.1	49.5	14,528
みずほフィナンシャルグループ	6.4	13.5	33,729
山口フィナンシャルグループ	—	6.7	8,442
<b>証券、商品先物取引業 (0.8%)</b>			
SBIホールディングス	5.5	0.9	2,887
大和証券グループ本社	18.5	0.4	384
野村ホールディングス	1.3	22.9	13,948
松井証券	—	6.7	5,011

銘柄	期首	当期	期末
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
<b>保険業 (2.8%)</b>			
かんぽ生命保険	0.2	0.1	280
SOMPOホールディングス	4.2	3.5	22,452
アニコムホールディングス	5.7	4.8	2,803
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2.1	2	11,156
第一生命ホールディングス	3.6	7.6	23,271
東京海上ホールディングス	4.7	7.1	24,523
T&Dホールディングス	0.5	—	—
<b>その他金融業 (0.6%)</b>			
芙蓉総合リース	0.9	—	—
イオンフィナンシャルサービス	—	2.5	3,168
アコム	—	1.7	571
ジャックス	0.8	—	—
オリエントコーポレーション	—	0.6	637
オリックス	5.2	4.2	11,285
三菱HCキャピタル	7	0.4	375
日本取引所グループ	7.2	0.6	1,848
<b>不動産業 (1.1%)</b>			
大東建託	0.1	0.1	1,598
ビューリック	4	—	—
野村不動産ホールディングス	0.1	—	—
オープンハウスグループ	1.9	3.1	13,407
飯田グループホールディングス	2.3	0.2	456
ケイアイスター不動産	2	0.5	1,745
三井不動産	0.7	0.5	1,739
三菱地所	1.1	0.2	391
住友不動産	0.1	0.1	430
スターツコーポレーション	1	1.7	4,749
トーセイ	—	2.9	5,550
サンフロンティア不動産	—	1.3	2,020
<b>サービス業 (4.6%)</b>			
M I X I	—	3.6	8,222
日本M&Aセンターホールディングス	10.1	2.5	1,694
オープンアップグループ	3.4	—	—
パーソルホールディングス	0.1	53.1	12,558
総合警備保障	0.8	—	—
カカクコム	5.9	3.1	5,110
ベネフィット・ワン	1.1	—	—
エムスリー	0.8	0.6	1,476
アウトソーシング	1.8	—	—
博報堂DYホールディングス	0.3	—	—
インフォマート	—	3.1	1,422
電通グループ	0.1	3.9	15,319

銘柄	期首	当期	期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
オリエンタルランド	1.2	1.8	9,172	
りらいあコミュニケーションズ	0.3	—	—	
ユー・エス・エス	2.5	3.3	9,363	
サイバーエージェント	0.9	3.4	2,828	
楽天グループ	0.4	—	—	
エン・ジャパン	—	3.6	8,182	
テクノプロ・ホールディングス	—	2.4	8,376	
リクルートホールディングス	8.9	4.1	20,967	
日本郵政	4.1	8.3	10,673	
ソラスト	2.7	3.5	2,051	
ベイクレント・コンサルティング	—	0.2	912	
セコム	0.1	—	—	
メイテックグループホールディングス	3.9	4.2	12,093	
ベネッセホールディングス	6.4	2.4	6,230	
イオンデイライト	0.3	—	—	
合計	株数・金額	1,098	1,401	2,970,013
	銘柄数〈比率〉	328	308	<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
TOPIX	47	—

(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

2023年11月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	2,970,013	98.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	59,487	2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	3,029,500	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

2023年11月16日現在

項 目	当 期 末
	円
(A)資 産	3,029,500,154
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	29,805,530
株 式 (評価額)	2,970,013,480
未 収 入 金	1,828,240
未 収 配 当 金	27,144,054
差 入 委 託 証 拠 金	708,850
(B)負 債	1,340,087
未 払 解 約 金	1,340,000
未 払 利 息	87
(C)純 資 産 総 額 ( A - B )	3,028,160,067
元 本	1,334,769,504
次 期 繰 越 損 益 金	1,693,390,563
(D)受 益 権 総 口 数	1,334,769,504口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 ( C / D )	22,687円

## ◎損益の状況

自 2022年11月17日  
至 2023年11月16日

項 目	当 期
	円
(A)配 当 等 収 益	75,859,474
受 取 配 当 金	75,865,437
受 取 利 息	33
そ の 他 収 益 金	17,927
支 払 利 息	△ 23,923
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	487,260,751
売 買 益	661,765,148
売 買 損	△ 174,504,397
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	10,145,120
取 引 益	12,545,160
取 引 損	△ 2,400,040
(D)信 託 報 酬 等	△ 24,266
(E)当 期 損 益 金 ( A + B + C + D )	573,241,079
(F)前 期 繰 越 損 益 金	1,306,710,912
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	57,099,501
(H)解 約 差 損 益 金	△ 243,660,929
(I)計 ( E + F + G + H )	1,693,390,563
次 期 繰 越 損 益 金 ( I )	1,693,390,563

(注1)当親ファンドの期首元本額は1,491,085,076円、期中追加設定元本額は53,210,499円、期中一部解約元本額は209,526,071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）1,057,931,067円、明治安田DCトビックスプラス276,838,437円です。

(注3)1口当たり純資産額は2,2687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。