

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 DC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 DC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 DC日経平均ファンド

第12期

(決算日 2016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 DC日経平均ファンド」は、2016年11月15日に第12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：<http://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]	期騰落率	株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配	み期騰 落率					
	円	円	%		%	%	%	百万円
8期(2012年11月15日)	8,412	0	5.2	8,829.72	3.4	86.7	13.3	492
9期(2013年11月15日)	14,615	0	73.7	15,165.92	71.8	80.9	17.5	835
10期(2014年11月17日)	16,591	0	13.5	16,973.80	11.9	76.2	23.8	880
11期(2015年11月16日)	19,196	0	15.7	19,393.69	14.3	79.1	9.6	982
12期(2016年11月15日)	17,783	0	△ 7.4	17,668.15	△ 8.9	96.2	3.2	879

(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) 2015年11月16日	円 19,196	% —	19,393.69	% —	% 79.1	% 9.6
11月末	19,546	1.8	19,747.47	1.8	92.2	7.0
12月末	18,863	△ 1.7	19,033.71	△ 1.9	92.9	6.6
2016年1月末	17,367	△ 9.5	17,518.30	△ 9.7	95.0	4.1
2月末	15,898	△17.2	16,026.76	△17.4	95.1	4.0
3月末	16,758	△12.7	16,758.67	△13.6	94.5	4.9
4月末	16,647	△13.3	16,666.05	△14.1	95.2	4.8
5月末	17,217	△10.3	17,234.98	△11.1	94.4	4.8
6月末	15,591	△18.8	15,575.92	△19.7	94.0	5.2
7月末	16,574	△13.7	16,569.27	△14.6	94.9	4.5
8月末	16,886	△12.0	16,887.40	△12.9	96.8	2.8
9月末	16,567	△13.7	16,449.84	△15.2	96.0	3.2
10月末	17,546	△ 8.6	17,425.02	△10.2	96.0	3.2
(期 末) 2016年11月15日	17,783	△ 7.4	17,668.15	△ 8.9	96.2	3.2

(注) 基準価額は1万口当たりの値です。

(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。

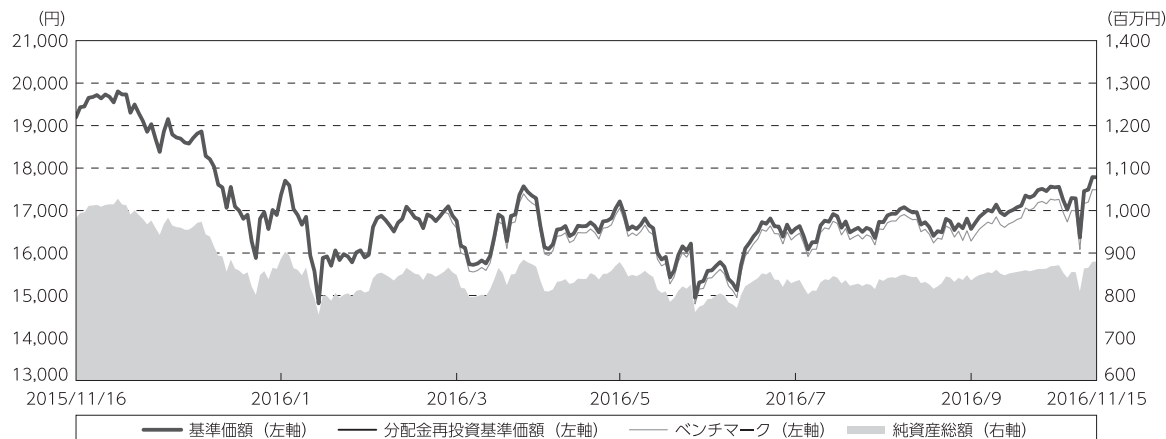
(注) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので株式組入比率、株式先物比率は実質比率で記載しています。

(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

当期中の基準価額等の推移 (2015年11月17日～2016年11月15日)



期 首：19,196円

期 末：17,783円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 7.4% (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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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(2015年11月16日)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、米国の良好な経済指標やFRB(米連邦準備理事会)高官の発言を受けた利上げ観測の高まりによる円安ドル高の進行、参議院選挙での与党勝利による政策期待の高まり、日銀によるETF(指数連動型上場投資信託)買入れの増額、大統領選挙後の米国の株高や長期金利の上昇などが挙げられます。

主な下落要因として、OPEC(石油輸出国機構)総会で原油生産量の目標設定が見送られ原油価格が下落したこと、中国株式や人民元の下落、円高進行に伴う企業業績の下方修正懸念、日銀の追加金融緩和が相次いで見送られたこと、FOMC(米連邦公開市場委員会)で政策金利が据え置かれたこと、英国のEU(欧州連合)離脱懸念の高まりなどが挙げられます。

○投資環境

当期の株式市場は、日経平均株価が19,393.69円(2015年11月16日)から、米国の良好な経済指標を受けて利上げ観測が高まり円安ドル高が進行したことから上昇して始まり、2015年12月1日に日経平均株価は期中最高値となる20,012.40円まで上昇しました。その後は、ECB(欧州中央銀行)の追加金融緩和やOPEC総会における原油生産量の目標設定の見送りへの失望から円高ドル安および原油安が進行し下落に転じました。

2016年年明け後も、中国株式や人民元下落を受けて一段安となり、日銀のマイナス金利導入により一時的に反発したものの、原油価格の急落、円高進行に伴う企業業績の下方修正懸念、ドイツ銀行の利払い停止懸念を背景に2月中旬にかけて大幅に下落しました。その後は、産油国4カ国で原油増産凍結が合意されて原油価格が反発すると上昇に転じましたが、日銀の追加金融緩和が相次いで見送られたことやFOMCで政策金利が据え置かれたことが嫌気され軟調に推移し、6月下旬の英国のEU離脱を巡る国民投票で離脱派が勝利し急激に円高が進行すると、6月24日に日経平均株価は期中最安値となる14,952.02円まで下落しました。

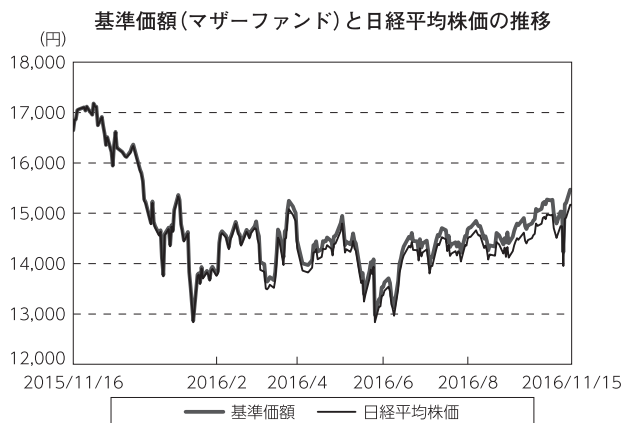
7月以降は、参議院選挙で与党が勝利し政策期待が高まったことや日銀がETF買入れの増額を発表したことが好感されて大幅に上昇し、8月も、予想を上回る米雇用統計やFRB高官の発言を受けて早期利上げ観測の高まりから円安ドル高が進行し続伸しました。しかし、9月FOMCでの利上げの見送りやドイツ銀行に対する経営不安が嫌気され、その後は下落に転じました。

10月に入ると、米国大統領選挙でクリントン候補が優位との見方が強まり上昇しましたが、11月上旬の投開票の結果、予想を覆しトランプ候補が勝利したことを受けて一時急落したものの、経済政策への期待の高まりを背景とした米国株高や、長期金利の上昇を受けた円安ドル高の進行から急反発し、結果、当期末の日経平均株価の終値は17,668.15円となりました。

○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す。期首に225銘柄による等株数投資でスタートし、期末も全225銘柄に等株数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。

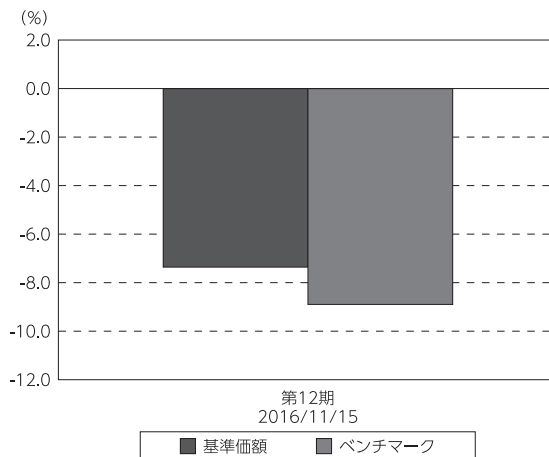
ベンチマークが8.9%下落したのに対し、基準価額は7.4%の下落となり、ベンチマークを1.5%上回る結果となりました。マザーファンドの組入銘柄にかかる受取配当金は、マザーファンドに収益計上され、当ファンドの基準価額にも反映されます。一方でベンチマークは受取配当金を加味していないため、この差がプラスの乖離要因となりました。また、ファンドから信託報酬等のコストが控除されたことが、マイナスの乖離要因となりました。

実績トラッキングエラー

過去1年(2015年11月～2016年10月)の実績トラッキングエラーは1.01%(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12期
	2015年11月17日～ 2016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	10,289

(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に等株数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

(2015年11月17日～2016年11月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 46	% 0.269	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(19)	(0.113)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(19)	(0.113)	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 ）	(7)	(0.043)	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	1	0.004	(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)	(0.002)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.002)	
(c) そ の 他 費 用	1	0.005	(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)	(0.005)	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	48	0.278	
期中の平均基準価額は、17,121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。

○売買及び取引の状況

(2015年11月17日～2016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 89	百万円 107	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 51,550	千円 76,000	千口 61,945	千円 90,500

○株式売買比率

(2015年11月17日～2016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	1,593,408千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,834,277千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.41	

(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

(2015年11月17日～2016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

(2016年11月15日現在)

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 17	百万円 -

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	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 565,977	千口 555,583	千円 859,153

(注) 親投資信託の当期末の受益権総口数は、2,719,948千口です。

○投資信託財産の構成

(2016年11月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
朝日ライフ 日経平均マザーファンド	859,153	97.1
コール・ローン等、その他	25,597	2.9
投資信託財産総額	884,750	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年11月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	883,930,787
コール・ローン等	24,036,873
朝日ライフ 日経平均マザーファンド(評価額)	859,153,914
未収入金	809,500
差入委託証拠金	△ 69,500
(B) 負債	4,158,205
未払解約金	3,008,709
未払信託報酬	1,126,956
未払利息	62
その他未払費用	22,478
(C) 純資産総額(A-B)	879,772,582
元本	494,728,637
次期繰越損益金	385,043,945
(D) 受益権総口数	494,728,637口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,783円

(注) 期首元本額は511,756,521円、期中追加設定元本額は101,810,879円、期中一部解約元本額は118,838,763円です。

○損益の状況 (2015年11月17日～2016年11月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 8,288
受取利息	690
支払利息	△ 8,978
(B) 有価証券売買損益	△ 44,705,969
売買益	23,063,074
売買損	△ 67,769,043
(C) 先物取引等取引損益	△ 1,711,091
取引益	1,599,100
取引損	△ 3,310,191
(D) 信託報酬等	△ 2,354,012
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 48,779,360
(F) 前期繰越損益金	212,733,989
(G) 追加信託差損益金	221,089,316
(配当等相当額)	(282,841,594)
(売買損益相当額)	(△ 61,752,278)
(H) 計(E+F+G)	385,043,945
(I) 収益分配金	0
次期繰越損益金(H+I)	385,043,945
追加信託差損益金	221,089,316
(配当等相当額)	(283,045,298)
(売買損益相当額)	(△ 61,955,982)
分配準備積立金	225,996,197
繰越損益金	△ 62,041,568

(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(13,262,208円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(一円)、信託約款に規定する収益調整金(283,045,298円)および分配準備積立金(212,733,989円)より分配可能額は509,041,495円(10,000口当たり10,289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]		株組入比率	株先物比率	純資産額
	期騰落	期中率	期騰落	期中率			
12期(2012年11月15日)	円	%		%	%	%	百万円
	7,219	5.6	8,829.72	3.4	95.1	4.8	1,855
13期(2013年11月15日)	12,609	74.7	15,165.92	71.8	81.3	17.6	2,851
14期(2014年11月17日)	14,334	13.7	16,973.80	11.9	80.8	19.1	2,675
15期(2015年11月16日)	16,647	16.1	19,393.69	14.3	82.4	5.9	3,598
16期(2016年11月15日)	15,464	△ 7.1	17,668.15	△ 8.9	98.5	1.3	4,206

(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) 2015年11月16日	16,647	—	19,393.69	—	82.4	5.9
11月末	16,954	1.8	19,747.47	1.8	96.4	3.2
12月末	16,367	△ 1.7	19,033.71	△ 1.9	97.0	2.9
2016年1月末	15,068	△ 9.5	17,518.30	△ 9.7	97.4	2.1
2月末	13,794	△17.1	16,026.76	△17.4	97.4	2.1
3月末	14,542	△12.6	16,758.67	△13.6	96.5	2.9
4月末	14,451	△13.2	16,666.05	△14.1	96.8	2.9
5月末	14,949	△10.2	17,234.98	△11.1	96.6	2.9
6月末	13,537	△18.7	15,575.92	△19.7	96.6	3.4
7月末	14,401	△13.5	16,569.27	△14.6	97.1	2.5
8月末	14,680	△11.8	16,887.40	△12.9	98.8	0.8
9月末	14,406	△13.5	16,449.84	△15.2	98.0	1.3
10月末	15,255	△ 8.4	17,425.02	△10.2	98.5	1.3
(期 末) 2016年11月15日	15,464	△ 7.1	17,668.15	△ 8.9	98.5	1.3

(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

(2015年11月17日～2016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)	% 0.004 (0.003) (0.001)	(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	0.004	
期中の平均基準価額は、14,867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

(2015年11月17日～2016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		668 (△110)	1,574,225 ()	36	19,182

(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 448	百万円 599	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

○株式売買比率

(2015年11月17日～2016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	1,593,408千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,834,277千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.41

(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

(2015年11月17日～2016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

(2016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 (0.2%)			
日本水産	6	9	4,275
マルハニチロ	0.6	0.9	2,540
鉱業 (0.1%)			
国際石油開発帝石	2.4	3.6	3,654
建設業 (2.8%)			
コムシスホールディングス	6	9	16,380
大成建設	6	9	6,723
大林組	6	9	9,126
清水建設	6	9	8,919
長谷工コーポレーション	1.2	1.8	1,890
鹿島建設	6	9	6,408
大和ハウス工業	6	9	27,513
積水ハウス	6	9	15,498
日揮	6	9	16,830
千代田化工建設	6	9	7,803
食料品 (5.0%)			
日清製粉グループ本社	6	9	13,905
明治ホールディングス	1.2	1.8	15,948
日本ハム	6	9	24,426
サッポロホールディングス	6	1.8	5,130
アサヒグループホールディングス	6	9	32,085
キリンホールディングス	6	9	16,483
宝ホールディングス	6	9	9,414
キッコーマン	6	9	29,340
味の素	6	9	18,306
ニチレイ	6	4.5	9,585
日本たばこ産業	6	9	33,624
繊維製品 (0.3%)			
東洋紡	6	9	1,431
ユニチカ	6	9	738
帝人	6	1.8	3,583
東レ	6	9	7,978
パルプ・紙 (0.3%)			
王子ホールディングス	6	9	3,933

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本製紙	0.6	0.9	1,722
北越紀州製紙	6	9	5,346
化学 (8.5%)			
クラレ	6	9	14,139
旭化成	6	9	8,892
昭和電工	6	0.9	1,377
住友化学	6	9	4,455
日産化学工業	6	9	34,695
日本曹達	6	—	—
東ソー	6	9	6,651
トクヤマ	6	9	3,753
デンカ	6	9	4,239
信越化学工業	6	9	74,502
三井化学	6	9	4,446
三菱ケミカルホールディングス	3	4.5	3,090
宇部興産	6	9	2,034
日本化薬	6	9	11,259
花王	6	9	44,856
富士フイルムホールディングス	6	9	36,648
資生堂	6	9	25,902
日東電工	6	9	70,920
医薬品 (7.4%)			
協和発酵キリン	6	9	14,859
武田薬品工業	6	9	41,877
アステラス製薬	30	45	71,550
大日本住友製薬	6	9	16,461
塩野義製薬	6	9	48,357
中外製薬	6	9	29,475
エーザイ	6	9	61,443
第一三共	6	9	21,469
石油・石炭製品 (0.3%)			
昭和シェル石油	6	9	8,946
JXホールディングス	6	9	3,806
ゴム製品 (1.1%)			
横浜ゴム	3	4.5	9,130

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ブリヂストン	6	9	37,386
ガラス・土石製品 (1.5%)			
旭硝子	6	9	6,480
日本板硝子	6	0.9	711
日本電気硝子	9	14	7,924
住友大阪セメント	6	9	3,492
太平洋セメント	6	9	3,078
東海カーボン	6	9	3,339
TOTO	3	4.5	19,305
日本碍子	6	9	18,342
鉄鋼 (0.2%)			
新日鐵住金	0.6	0.9	2,113
神戸製鋼所	6	0.9	902
ジェイ エフ イー ホールディングス	0.6	0.9	1,443
日新製鋼	0.6	0.9	1,260
大太平洋金属	6	9	3,222
非鉄金属 (1.4%)			
日本軽金属ホールディングス	6	9	2,187
三井金属鉱業	6	9	2,214
東邦亜鉛	6	9	3,897
三菱マテリアル	6	0.9	3,127
住友金属鉱山	6	9	13,824
DOWAホールディングス	6	9	7,416
古河機械金属	6	9	1,638
古河電気工業	6	0.9	3,010
住友電気工業	6	9	13,765
フジクラ	6	9	5,634
金属製品 (0.5%)			
SUMCO	0.6	0.9	1,123
東洋製罐グループホールディングス	6	9	18,603
機械 (5.4%)			
日本製鋼所	6	1.8	3,583
オークマ	6	9	8,568
アマダホールディングス	6	9	11,151
小松製作所	6	9	22,729
住友重機械工業	6	9	5,778
日立建機	6	9	20,880
クボタ	6	9	15,075
荏原製作所	6	1.8	5,295
ダイキン工業	6	9	92,835

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本精工	6	9	11,007
NTN	6	9	3,609
ジェイテクト	6	9	15,786
日立造船	1.2	1.8	1,051
三菱重工業	6	9	4,368
I H I	6	9	2,808
電気機器 (17.1%)			
日清紡ホールディングス	6	9	9,612
コニカミノルタ	6	9	8,730
ミネベア	6	9	9,252
日立製作所	6	9	5,277
東芝	6	9	3,499
三菱電機	6	9	13,617
富士電機	6	9	5,022
安川電機	6	9	15,750
明電舎	6	9	3,033
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6	9	4,095
日本電気	6	9	2,664
富士通	6	9	5,834
沖電気工業	6	0.9	1,268
パナソニック	6	9	9,202
シャープ	6	—	—
ソニー	6	9	28,827
TDK	6	9	66,690
ミツミ電機	6	9	5,409
アルプス電気	6	9	23,913
パイオニア	6	9	2,016
横河電機	6	9	14,400
アドバンテスト	12	18	26,874
カシオ計算機	6	9	11,979
ファナック	6	9	176,760
京セラ	12	18	95,148
太陽誘電	6	9	10,530
S C R E E Nホールディングス	6	1.8	11,898
キャノン	9	13.5	41,107
リコー	6	9	8,001
東京エレクトロン	6	9	89,379
輸送用機器 (6.8%)			
デンソー	6	9	43,020
三井造船	6	9	1,368

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
川崎重工業	6	9	2,889
日産自動車	6	9	9,000
いすゞ自動車	3	4.5	5,899
トヨタ自動車	6	9	54,576
日野自動車	6	9	10,863
三菱自動車工業	0.6	0.9	468
マツダ	1.2	1.8	2,918
本田技研工業	12	18	55,764
スズキ	6	9	33,147
富士重工業	6	9	37,593
ヤマハ発動機	—	9	22,680
精密機器 (2.9%)			
テルモ	12	18	69,570
ニコン	6	9	14,049
オリンパス	6	9	33,030
シチズン時計	6	9	5,769
その他製品 (1.2%)			
凸版印刷	6	9	8,892
大日本印刷	6	9	9,162
ヤマハ	6	9	30,015
電気・ガス業 (0.3%)			
東京電力ホールディングス	0.6	0.9	365
中部電力	0.6	0.9	1,378
関西電力	0.6	0.9	958
東京瓦斯	6	9	4,269
大阪瓦斯	6	9	3,813
陸運業 (2.3%)			
東武鉄道	6	9	4,680
東京急行電鉄	6	9	7,434
小田急電鉄	6	4.5	9,490
京王電鉄	6	9	7,830
京成電鉄	6	4.5	11,043
東日本旅客鉄道	0.6	0.9	8,382
西日本旅客鉄道	0.6	0.9	5,728
東海旅客鉄道	0.6	0.9	15,462
日本通運	6	9	5,022
ヤマトホールディングス	6	9	20,313
海運業 (0.2%)			
日本郵船	6	9	1,800
商船三井	6	9	2,493

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
川崎汽船	6	9	2,241
空運業 (0.1%)			
ANAホールディングス	6	9	2,643
倉庫・運輸関連業 (0.3%)			
三菱倉庫	6	9	13,194
情報・通信業 (11.2%)			
ヤフー	2.4	3.6	1,425
トレンドマイクロ	6	9	35,865
スカパーJ S A Tホールディングス	0.6	0.9	439
日本電信電話	1.2	1.8	7,660
KDD I	36	54	150,579
NTTドコモ	0.6	0.9	2,156
東宝	0.6	0.9	2,781
エヌ・ティ・ティ・データ	6	9	49,590
コナミホールディングス	6	9	38,295
ソフトバンクグループ	18	27	176,904
卸売業 (2.2%)			
双日	0.6	0.9	246
伊藤忠商事	6	9	12,928
丸紅	6	9	5,367
豊田通商	6	9	23,850
三井物産	6	9	13,770
住友商事	6	9	11,763
三菱商事	6	9	22,369
小売業 (12.1%)			
J. フロント リテイリング	3	4.5	7,020
三越伊勢丹ホールディングス	6	9	10,818
セブン&アイ・ホールディングス	6	9	39,240
ユニー・ファミリーマートホールディングス	—	9	60,930
高島屋	6	9	8,190
丸井グループ	6	9	13,185
イオン	6	9	13,455
ユニーグループ・ホールディングス	6	—	—
ファーストリテイリング	6	9	347,130
銀行業 (1.0%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	—	9	4,463
新生銀行	6	9	1,701
あおぞら銀行	6	9	3,195
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6	9	5,787
りそなホールディングス	0.6	0.9	464

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	6	0.9	3,528
三井住友フィナンシャルグループ	0.6	0.9	3,582
千葉銀行	6	9	6,183
横浜銀行	6	—	—
ふくおかフィナンシャルグループ	6	9	4,293
静岡銀行	6	9	8,073
みずほフィナンシャルグループ	6	9	1,685
証券、商品先物取引業 (0.4%)			
大和証券グループ本社	6	9	5,952
野村ホールディングス	6	9	5,337
松井証券	6	9	7,641
保険業 (1.1%)			
SOMPOホールディングス	1.5	2.2	7,937
MS&ADインシュアランスグループ ホールディングス	1.8	2.7	8,961
ソニーフィナンシャルホールディングス	1.2	1.8	2,858
第一生命ホールディングス	0.6	0.9	1,584
東京海上ホールディングス	3	4.5	21,010
T&Dホールディングス	1.2	1.8	2,514
その他金融業 (0.4%)			
クレディセゾン	6	9	17,064

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 (2.0%)			
東急不動産ホールディングス	6	9	5,823
三井不動産	6	9	23,494
三菱地所	6	9	19,858
東京建物	3	4.5	6,259
住友不動産	6	9	27,162
サービス業 (3.4%)			
ディー・エヌ・エー	1.8	2.7	9,450
電通	6	9	46,980
楽天	—	9	10,327
東京ドーム	6	4.5	4,927
セコム	6	9	71,505
合 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 < 比率 >	1,263 225	1,784 225 < 98.5% >

(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 52	百万円 —

○投資信託財産の構成

(2016年11月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 4,144,307	% 98.5
コール・ローン等、その他	64,560	1.5
投資信託財産総額	4,208,867	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年11月15日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	4,328,508,571	
コール・ローン等	34,027,431	
株式(評価額)	4,144,307,670	
未収入金	2,787,920	
未収配当金	27,744,550	
差入委託証拠金	119,641,000	
(B) 負債	122,460,088	
未払利息	88	
差入委託証拠金代用有価証券	122,460,000	
(C) 純資産総額(A-B)	4,206,048,483	
元本	2,719,948,316	
次期繰越損益金	1,486,100,167	
(D) 受益権総口数	2,719,948,316口	
1万口当たり基準価額(C/D)	15,464円	

(注) 期首元本額は2,161,918,980円、期中追加設定元本額は877,147,935円、期中一部解約元本額は319,118,599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	2,164,365,081円
朝日ライフ DC日経平均ファンド	555,583,235円

○損益の状況 (2015年11月17日～2016年11月15日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	74,458,746	
受取配当金	74,485,986	
受取利息	4,584	
その他収益金	12,934	
支払利息	△ 44,758	
(B) 有価証券売買損益	△ 377,039,483	
売買益	146,106,938	
売買損	△ 523,146,421	
(C) 先物取引等取引損益	△ 8,846,280	
取引益	9,020,400	
取引損	△ 17,866,680	
(D) 保管費用等	△ 2,854	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 311,429,871	
(F) 前期繰越損益金	1,437,059,374	
(G) 追加信託差損益金	558,852,065	
(H) 解約差損益金	△ 198,381,401	
(I) 計(E+F+G+H)	1,486,100,167	
次期繰越損益金(I)	1,486,100,167	

(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。