

第4期【償還】

運用報告書(全体版)

日本連続増配成長株ファンド 18-07 (繰上償還条項付)

【2021年8月12日償還】

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。
皆様の「日本連続増配成長株ファンド18-07 (繰上償還条項付)」は、2021年8月12日をもちまして信託約款の規定に基づき、繰上償還となりました。ここに設定以来の運用経過及び償還内容のご報告をいたしますとともに、皆様のご愛顧に対し改めてお礼申し上げます。

今後とも、弊社ファンドに対しまして、一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。



〒104-0031 東京都中央区京橋2-2-1

お問い合わせは弊社営業部 セールスサポートグループへ
フリーダイヤル ☎0120-048-214 (営業日の9:00~17:00)

[ホームページ]

<https://www.okasan-am.jp>

※アクセスにかかる通信料はお客様のご負担となります。

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	2018年7月31日から2021年8月12日(当初2028年6月15日)までです。	
運用方針	日本連続増配成長株マザーファンドへの投資を通じて、日本の連続増配銘柄に投資を行い、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。 信託期間中において、以下の条件を満たした場合は、組入資産を売却し、すみやかに短期金融商品、公社債等による安定運用に切替え、繰上償還します。 ・2021年7月30日までに分配金込基準価額が12,000円以上となった場合 ・2021年7月30日までに分配金込基準価額が12,000円以上とならず、2021年8月2日以降に10,500円以上となった場合 2021年8月2日以降、繰上償還の条件を満たし安定運用に切替えた場合であっても、満期償還日(2028年6月15日)までの期間が短い場合には繰上償還を行わず、満期償還日に償還を行う場合があります。	
主要投資対象	当ファンド	マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
	日本連続増配成長株マザーファンド	日本の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資制限	当ファンド	マザーファンドの受益証券への投資割合には制限を設けません。 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。
	日本連続増配成長株マザーファンド	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	毎年6月15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として、以下の方針に基づき、収益分配を行います。 分配対象収益の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。繰越分を含めた経費控除後の配当等収益には、マザーファンドの配当等収益のうち、投資信託財産に帰属すべき配当等収益を含むものとし、分配金額は、委託会社が分配可能額、基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、必ず収益分配を行うものではありません。	

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配額)	基準価額		東証株価指数 (TOPIX) (参考指数)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
		税金配分	期末騰落率	参考指数	騰落率			
(設定日) 2018年7月31日	円 銭 10,000	円	%	ポイント	%	%	%	百万円 4,247
1期(2019年6月17日)	8,966	0	△10.3	1,539.74	△12.9	89.2	—	6,280
2期(2020年6月15日)	9,781	0	9.1	1,530.78	△0.6	95.6	—	4,893
3期(2021年6月15日)	10,927	0	11.7	1,975.48	29.1	95.8	—	1,353
(償還時) 4期(2021年8月12日)	(償還価額) 10,883.89	—	△0.4	1,953.55	△1.1	—	—	1,273

(注) 基準価額および分配金(税引前)は1万口当たり、基準価額の騰落率は分配金(税引前)込み。

(注) 設定日の基準価額および純資産総額は当初設定元本。

(注) 東証株価指数(TOPIX)は当ファンドの参考指数であり、ベンチマークではありません。設定日の東証株価指数(TOPIX)は設定日前営業日の終値です。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、株式組入比率および株式先物比率は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率=買建比率-売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	基準価額		東証株価指数 (TOPIX) (参考指数)		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	騰落率	参考指数	騰落率		
(期首) 2021年6月15日	円 銭 10,927	%	%	ポイント	%	%	%
6月末	10,872	△0.5	△0.5	1,943.57	△1.6	95.2	—
7月末	10,723	△1.9	△1.9	1,901.08	△3.8	95.5	—
(償還時) 2021年8月12日	(償還価額) 10,883.89	△0.4	△0.4	1,953.55	△1.1	—	—

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の運用経過

設定以来の基準価額等の推移

(2018年7月31日～2021年8月12日)



(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）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) 参考指数は、東証株価指数（TOPIX）です。

(注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、設定日（2018年7月31日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

設定以来の投資環境

(2018年7月31日～2021年8月12日)

当ファンド設定後の国内株式市場は、国内企業の業績が底堅く推移したことなどを背景に、設定時から2018年10月月初にかけて堅調に推移しました。しかしその後は、米中貿易摩擦の激化に伴う世界経済の悪化が意識され、12月下旬にかけて下落しました。2019年以降は、米国の利下げ観測が強まったことや、米中通商協議の早期妥結への期待が高まったことから、エレクトロニクス関連株など景気動向によって業績が変動しやすい銘柄に牽引され上昇基調で推移しました。しかし2020年2月から3月下旬にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に対する懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まり、国内株式市場は大きく下落しました。こうした金融市場の動揺に対して、各国の財政当局や中央銀行が積極的な財政支援・資金供給を行ったことから、市場は落ち着きを取り戻し、6月にかけて戻りを試す展開となりました。その後は一進一退の展開が続きましたが、11月にかけて、米国の選挙結果や新型コロナウイルスのワクチン開発進展の報道を受けて投資家心理が改善し株式市場は急速に上昇する展開となりました。2021年の年明け以降も、世界各国でワクチンの接種が進んだことなどから景気と企業業績回復への期待が高まり株式市場は堅調に推移しました。

設定以来の当ファンドのポートフォリオ

（2018年7月31日～2021年8月12日）

当ファンドの運用はマザーファンドを通じて行いました。マザーファンドの運用につきましては、連続増配期間の長さ、時価総額、信用リスク、流動性等を考慮してユニバースを構築し、その中から、成長性や連続増配の持続可能性等を勘案しポートフォリオを構築しました。設定以来では、携帯電話料金見直しの不透明感が後退したことや、子会社再編により収益性向上が期待できると判断した日本電信電話や、新型コロナウイルスの感染拡大に伴うライフスタイルの変化に伴い国内外で戸建て住宅の需要増加が期待できると判断した積水ハウスなどの組入比率を引き上げました。一方、中長期の成長期待が織り込まれ株価指標面の割高感が強いと判断したエムスリーや日本M&Aセンターなどの組入比率を引き下げました。

2021年8月2日に分配金込基準価額が10,500円以上となったため、翌日にマザーファンドを解約し、以後償還日までは短期金融市場での安定運用を行いました。

設定以来の当ファンドのベンチマークとの差異

（2018年7月31日～2021年8月12日）

当ファンドは特定のベンチマークを設けておりませんが、設定以来の基準価額の騰落率は、参考指数としている東証株価指数（TOPIX）の騰落率を下回りました。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2021年6月16日～2021年8月12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 ）	(13)	(0.122)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(13)	(0.122)	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 ）	(1)	(0.007)	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	0.010	(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)	(0.010)	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
(c) そ の 他 費 用	0	0.002	(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)	(0.002)	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)	(0.000)	その他は、金銭信託支払手数料
合 計	28	0.264	
期中の平均基準価額は、10,797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) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

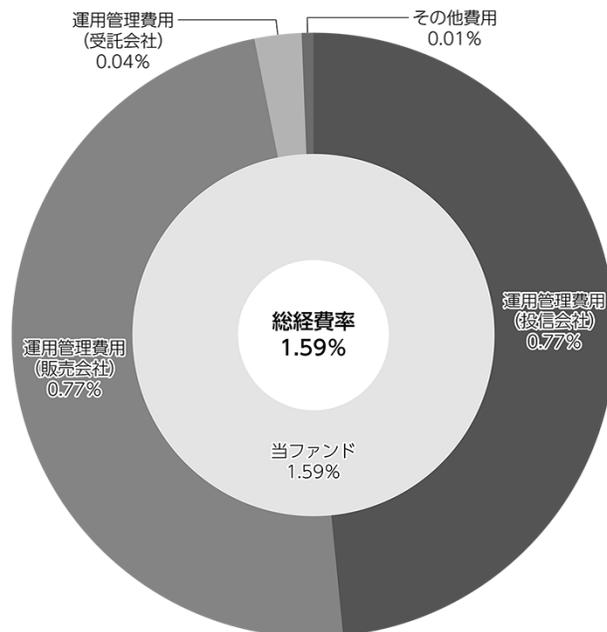
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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1.59%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6月16日～2021年8月12日)

○売買及び取引の状況とは、ファンドが購入・売却した有価証券の数量および金額です。

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
日本連続増配成長株マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 904,622	千円 1,344,529

(注) 単位未満は切捨て。

○株式売買比率

(2021年6月16日～2021年8月12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
	日本連続増配成長株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	2,192,693千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	10,373,561千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.21

(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6月16日～2021年8月12日)

利害関係人との取引状況

<日本連続増配成長株ファンド18-07（繰上償還条項付）>
該当事項はございません。

<日本連続増配成長株マザーファンド>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 503	百万円 16	% 3.2	百万円 1,688	百万円 16	% 0.9

平均保有割合 12.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	132千円
うち利害関係人への支払額 (B)	3千円
(B) / (A)	2.4%

(注) 売買委託手数料総額は、当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です。

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは岡三証券です。

○組入資産の明細

(2021年8月12日現在)

有価証券等の組入れはございません。

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	
	口	数
日本連続増配成長株マザーファンド		千円 904,622

(注) 口数の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年8月12日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 1,280,568	% 100.0
投資信託財産総額	1,280,568	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況（2021年8月12日現在）

項目	償還時
	円
(A) 資産	1,280,568,729
コール・ローン等	1,280,568,729
(B) 負債	6,742,041
未払解約金	3,415,811
未払信託報酬	3,300,548
未払利息	1,022
その他未払費用	24,660
(C) 純資産総額(A-B)	1,273,826,688
元本	1,170,378,159
償還差益金	103,448,529
(D) 受益権総口数	1,170,378,159口
1万口当たり償還価額(C/D)	10,883円89銭

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1.088389円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は1,238,650,454円、期中追加設定元本額は0円、期中一部解約元本額は68,272,295円です。

○損益の状況（2021年6月16日～2021年8月12日）

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	△ 9,284
受取利息	3
支払利息	△ 9,287
(B) 有価証券売買損益	△ 1,682,102
売買益	470,757
売買損	△ 2,152,859
(C) 信託報酬等	△ 3,325,241
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 5,016,627
(E) 前期繰越損益金	107,562,360
(F) 追加信託差損益金	902,796
(配当等相当額)	(617,613)
(売買損益相当額)	(285,183)
償還差益金(D+E+F)	103,448,529

(注) 損益の状況の中で(C)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) 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、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2018年7月31日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2021年8月12日		資産総額	1,280,568,729円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	6,742,041円
受益権口数	4,247,465,117口	1,170,378,159口	△3,077,086,958口	純資産総額	1,273,826,688円
元本額	4,247,465,117円	1,170,378,159円	△3,077,086,958円	受益権口数	1,170,378,159口
				1万口当たり償還金	10,883円89銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	7,004,618,799円	6,280,371,354円	8,966円	0円	0%
第2期	5,003,222,506	4,893,619,701	9,781	0	0
第3期	1,238,650,454	1,353,442,739	10,927	0	0

○償還金のお知らせ

1万口当たり償還金	10,883円89銭
-----------	------------

〈お知らせ〉

当ファンドの分配金込基準価額（基準価額（1万口当たり）に設定来の分配金（1万口当たり、税引前）累計額を加算した額とします。）が、2021年8月2日に10,500円以上となったため、投資信託約款の規定により繰上償還を行いました。

日本連続増配成長株マザーファンド

マザーファンドの運用報告書につきましては、ベビーファンドの運用報告書と作成対象期間が異なる場合には、データ・コメント等に不一致が生じることがありますのでご了承ください。

日本連続増配成長株マザーファンド 第5期 運用状況のご報告 決算日：2020年12月15日

当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	日本の連続増配銘柄（一定期間にわたり1株当たりの普通配当金が毎期増加している企業の株式をいいます。）に投資を行います。
主要投資対象	日本の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資制限	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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数 (TOPIX) (参考指数)		株組入比率	株先物比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
(設定日) 2015年12月28日	円 10,000	% —	ポイント 1,516.19	% —	% —	% —	百万円 2,700
1期(2016年12月15日)	10,038	0.4	1,542.72	1.7	95.0	—	17,248
2期(2017年12月15日)	12,533	24.9	1,793.47	16.3	96.2	—	7,454
3期(2018年12月17日)	12,019	△4.1	1,594.20	△11.1	95.1	—	16,980
4期(2019年12月16日)	13,298	10.6	1,736.87	8.9	96.4	—	20,695
5期(2020年12月15日)	14,826	11.5	1,782.05	2.6	97.1	—	11,234

(注) 基準価額は1万円当たり。

(注) 設定日の基準価額および純資産総額は当初設定元本。

(注) 東証株価指数 (TOPIX) は当ファンドの参考指数であり、ベンチマークではありません。設定日の東証株価指数 (TOPIX) は設定日前営業日の終値です。

(注) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

○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 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期 首) 2019年12月16日	13,298	—	ポイント 1,736.87	% —	% 96.4	% —
12月末	13,327	0.2	1,721.36	△ 0.9	96.5	—
2020年1月末	13,062	△ 1.8	1,684.44	△ 3.0	95.3	—
2月末	11,675	△12.2	1,510.87	△13.0	93.9	—
3月末	11,663	△12.3	1,403.04	△19.2	95.4	—
4月末	12,126	△ 8.8	1,464.03	△15.7	93.8	—
5月末	13,295	△ 0.0	1,563.67	△10.0	93.4	—
6月末	13,578	2.1	1,558.77	△10.3	96.3	—
7月末	13,350	0.4	1,496.06	△13.9	96.7	—
8月末	14,045	5.6	1,618.18	△ 6.8	93.4	—
9月末	14,286	7.4	1,625.49	△ 6.4	95.8	—
10月末	13,775	3.6	1,579.33	△ 9.1	95.2	—
11月末	15,045	13.1	1,754.92	1.0	92.1	—
(期 末) 2020年12月15日	14,826	11.5	1,782.05	2.6	97.1	—

(注) 騰落率は期首比。

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2019年12月17日～2020年12月15日)



(注) 参考指数は、東証株価指数 (TOPIX) です。

(注) 参考指数は、期首 (2019年12月16日) の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドにおける主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・業種配分では、サービス業、情報・通信業、小売業などが基準価額にプラスに寄与しました。
- ・個別銘柄では、エムスリー、日本M&Aセンター、シスメックスなどが基準価額にプラスに寄与しました。

(主なマイナス要因)

- ・業種配分では、陸運業、医薬品、食料品などが基準価額にマイナスに影響しました。
- ・個別銘柄では、西日本旅客鉄道、第一興商、スタンレー電気などが基準価額にマイナスに影響しました。

投資環境

(2019年12月17日～2020年12月15日)

国内株式市場は、2020年2月から3月下旬にかけて、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に対する懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まり、大きく下落しました。こうした金融市場の動揺に対して、各国の財政当局や中央銀行が積極的な財政支援・資金供給を行ったことから、市場は落ち着きを取り戻し、6月にかけて戻りを試す展開となりました。その後は、10月下旬まで一進一退の展開が続きましたが、11月に入ると、米国の選挙結果や新型コロナウイルスのワクチン開発進展報道を受けて投資家心理が改善し株式市場は急速に上昇する展開となり、期末にかけても堅調な値動きとなりました。

当ファンドのポートフォリオ

(2019年12月17日～2020年12月15日)

当ファンドの運用につきましては、連続増配期間の長さ、時価総額、信用リスク、流動性等を考慮してユニバースを構築し、その中から、成長性や連続増配の持続可能性等を勘案しポートフォリオを構築しました。当期は、新型コロナウイルスの感染拡大による巣ごもり消費の恩恵を受けると判断したセリアや、直近の業績は低調ながらも今後の回復が期待でき、株価の下落で割安感も強まったと判断したテイ・エス テックなどを新規に組み入れました。一方、物流施設への投資などによる負担増で減配見通しを示したアズワンや、旅客収入の減少で減配見通しを示した西日本旅客鉄道などを全株売却しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2019年12月17日～2020年12月15日)

当ファンドは特定のベンチマークを設けておりませんが、基準価額の騰落率は、参考指数としている東証株価指数(TOPIX)の騰落率を8.9%上回りました。詳細につきましては前掲の「基準価額の主な変動要因」をご参照ください。

今後の運用方針

世界の経済・社会は、新型コロナウイルスの感染拡大を警戒しつつも、活動制限に対応した「新しい生活様式」への移行による新たな需要が創出されており、今後はワクチンの開発と接種が進むことで先送りされた需要も回復する局面に向かうと見ております。当面は緩和的な金融環境が続くと思われ、株式市場は短期的調整を挟みながらも、経済や企業業績の回復を織り込む堅調な展開が続くと考えております。

当ファンドの運用につきましては、連続増配期間の長さ、時価総額、信用リスク、流動性等を考慮してユニバースを構築し、その中から、成長性や連続増配の持続可能性等を勘案しポートフォリオを構築します。個別銘柄につきましては、「新しい生活様式」が追い風となり来期以降も高い成長が期待できる銘柄の組入比率を高めとしていく方針です。ただし、決算などで配当金の据え置きや減額を発表した銘柄につきましては速やかに売却する方針です。

※文中の投資行動は、個別銘柄の売買等いかなる投資行動も推奨するものではありません。

○1万口当たりの費用明細

(2019年12月17日～2020年12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)	円 26 (26)	% 0.193 (0.193)	(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
(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 その他は、金銭信託支払手数料
合 計	26	0.193	
期中の平均基準価額は、13,268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) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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

(2019年12月17日～2020年12月15日)

株式

国	上場	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
内		千株	千円	千株	千円
		1,670	5,559,111	5,387	15,837,562
		(228)	(-)		

(注) 金額は受渡代金。

(注) 単位未満は切捨て。

(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おりません。

○株式売買比率

(2019年12月17日～2020年12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	21,396,674千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	15,222,517千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.40

(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

(2019年12月17日～2020年12月15日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	5,559	1,282	23.1	15,837	4,671	29.5

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	31,382千円
うち利害関係人への支払額 (B)	9,300千円
(B) / (A)	29.6%

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは岡三証券です。

○組入資産の明細

(2020年12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
建設業 (5.7%)			
ショーボンドホールディングス	110.2	83.3	428,995
東鉄工業	35.7	—	—
大和ハウス工業	62.6	—	—
積水ハウス	148.6	94.3	187,091
食料品 (1.4%)			
ヤクルト本社	21.3	13	67,080
アサヒグループホールディングス	63.4	20.2	86,698
キュービー	172.3	—	—
日本たばこ産業	42.1	—	—
繊維製品 (1.2%)			
ゴールドウイン	26.2	17.5	125,475
化学 (16.1%)			
日産化学	23.3	23.3	142,829
積水化学工業	130.8	125	242,000
日油	69.6	—	—

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
花王	70.7	35.8	277,879
ミルボン	19.1	24.2	152,460
小林製薬	35	17.2	219,988
タカラバイオ	191.1	95.7	277,721
ユニ・チャーム	87.5	91.4	441,005
医薬品 (6.3%)			
アステラス製薬	216.7	195.1	297,820
ロート製薬	146.3	121.8	383,061
ゴム製品 (—%)			
ブリヂストン	23.3	—	—
ガラス・土石製品 (1.7%)			
ニチアス	77	75.6	186,807
金属製品 (2.9%)			
リンナイ	27	26.4	316,272
機械 (2.7%)			
三浦工業	66	—	—

日本連続増配成長株マザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タクマ	—	38.8	70,810
栗田工業	69.5	54.9	218,776
竹内製作所	119.2	—	—
電気機器 (4.7%)			
富士電機	95.3	—	—
富士通ゼネラル	113.8	74.5	210,388
シスメックス	30.2	26.3	304,554
スタンレー電気	33.2	—	—
輸送用機器 (0.7%)			
テイ・エス テック	—	22.8	74,328
精密機器 (3.0%)			
テルモ	131	82	327,180
その他製品 (1.0%)			
ビジョン	41.9	24.8	113,212
陸運業 (—%)			
小田急電鉄	25.7	—	—
西日本旅客鉄道	52.2	—	—
東海旅客鉄道	15	—	—
ハマキョウレックス	54.5	—	—
日立物流	19.8	—	—
倉庫・運輸関連業 (—%)			
上組	29.5	—	—
情報・通信業 (14.7%)			
NECネットエスアイ	73	66.9	118,814
GMOペイメントゲートウェイ	15.3	19.4	269,466
日本オラクル	22.4	—	—
伊藤忠テクノソリューションズ	148.9	55.5	210,067
大塚商会	53.4	22.7	115,770
日本ユニシス	27	27	104,625
日本電信電話	77.9	104.4	276,660
KDDI	190.7	38.8	114,867
光通信	8.7	12.8	320,896
S C S K	18	12.9	74,304
卸売業 (7.1%)			
アルフレッサ ホールディングス	92.7	75.1	155,006
第一興商	46.4	33.5	123,782

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
アズワン	55.2	—	—	
長瀬産業	144.6	138.3	205,652	
豊田通商	111.2	74.8	291,346	
小売業 (9.0%)				
サンエー	24.4	18.7	78,820	
セリア	—	24.8	95,728	
MonotaRO	86.3	50.4	271,152	
J. フロント リテイリング	82.4	—	—	
コスモス薬品	5.6	9.1	155,155	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	355.1	88.6	211,399	
イズミ	14.3	—	—	
ニトリホールディングス	23.5	8.1	173,583	
銀行業 (0.8%)				
セブン銀行	724.6	—	—	
山梨フィナンシャルグループ	133.5	141.1	88,046	
その他金融業 (4.1%)				
芙蓉総合リース	15.4	15.4	100,870	
みずほリース	35.5	34.8	103,216	
東京センチュリー	21.6	21.5	157,165	
オリックス	191.7	—	—	
三菱UFJリース	189	185.6	88,716	
不動産業 (—%)				
野村不動産ホールディングス	45	—	—	
スターツコーポレーション	91.9	—	—	
サービス業 (16.9%)				
日本M&Aセンター	166.2	53.8	363,150	
カカコム	179	82.4	237,641	
ベネフィット・ワン	97.6	105	320,250	
エムスリー	161.3	43.6	400,204	
ユー・エス・エス	56.3	28.5	59,622	
リログループ	89.5	110.5	295,035	
セコム	22.3	17.5	170,835	
合 計	株 数・金 額	6,594	3,105	10,904,280
	銘柄数<比率>	75	54	<97.1%>

(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。

(注) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2020年12月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 10,904,280	% 96.9
コール・ローン等、その他	346,870	3.1
投資信託財産総額	11,251,150	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年12月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	11,251,150,159
コール・ローン等	346,172,459
株式(評価額)	10,904,280,250
未収配当金	697,450
(B) 負債	17,114,295
未払解約金	17,112,606
未払利息	292
その他未払費用	1,397
(C) 純資産総額(A-B)	11,234,035,864
元本	7,577,212,268
次期繰越損益金	3,656,823,596
(D) 受益権総口数	7,577,212,268口
1口当たり基準価額(C/D)	14,826円

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1.4826円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は15,562,922,012円、期中追加設定元本額は3,073,399,124円、期中一部解約元本額は11,059,108,868円です。

(注) 当親ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、以下の通りです。

日本連続増配成長株オープン	3,909,395,334円
日本連続増配成長株ファンド18-07(繰上償還条項付)	1,326,100,230円
日本連続増配成長株ファンド(ベータヘッジ型)19-04(適格機関投資家専用)	774,597,801円
日本連続増配成長株オープン(ベータヘッジ型)(適格機関投資家専用)	652,813,253円
日本連続増配成長株ファンド(ベータヘッジ型)19-07(適格機関投資家専用)	586,016,192円
リスク抑制型・4資産バランスファンド(愛称 にいがた創業応援団)	315,771,096円
D C 日本連続増配成長株オープン	12,518,362円

○損益の状況 (2019年12月17日～2020年12月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	268,383,910
受取配当金	268,629,840
受取利息	5,952
その他収益金	3,204
支払利息	△ 255,086
(B) 有価証券売買損益	1,227,821,563
売買益	3,070,278,700
売買損	△1,842,457,137
(C) その他費用等	△ 54,396
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,496,151,077
(E) 前期繰越損益金	5,132,096,581
(F) 追加信託差損益金	831,708,766
(G) 解約差損益金	△3,803,132,828
(H) 計(D+E+F+G)	3,656,823,596
次期繰越損益金(H)	3,656,823,596

(注) 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) 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、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で(G)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。

＜お知らせ＞

該当事項はございません。