

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／インデックス型
設定日	1996年3月22日
信託期間	無期限
運用方針	わが国の株式市場の動きをとらえることと、信託財産の長期的な成長を目標に、日経平均株価(225種)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	日経平均株価(225種)採用銘柄
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。
分配方針	毎年3月、9月の14日(休業日の場合は、翌営業日)の決算日に、収益分配金額は経費控除後の利子・配当収益および売買益(評価損益も含まれます。)等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には分配を行わないことがあります。 ※分配金自動再投資型の場合、分配金は税金を差し引いた後自動的に無手数料で再投資されます。

運用報告書 (全体版)

第36期

決算日 2015年9月14日

エス・ビー・ 日本株オープン225

受益者の皆様へ

毎々、格別のお引き立てにあずかり厚くお礼申し上げます。

さて「エス・ビー・日本株オープン225」は、去る2015年9月14日に第36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。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

ファンドの内容、運用状況に関する情報などをホームページでご覧いただけます。

<http://www.daiwasbi.co.jp/>

また、お電話でも承っております。

ディスクロージャー部 ☎ 0120-286104

受付時間は、毎営業日の午前9時から午後5時までです。

※お客様の取引内容につきましては、ご購入された販売会社にお問い合わせください。



大和住銀投信投資顧問

Daiwa SB Investments

東京都千代田区霞が関三丁目2番1号

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			日経平均株価 (225種)		株式組入比率	株式先物組入比率	純資産額
	(分配落)	税金配	込金騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
第32期 (2013年9月17日)	円	円	%	円	%	%	%	百万円
第33期 (2014年3月14日)	7,332	0	16.3	14,311.67	15.6	96.8	3.1	35,388
第34期 (2014年9月16日)	7,380	0	0.7	14,327.66	0.1	94.4	5.5	28,590
第35期 (2015年3月16日)	8,245	0	11.7	15,911.53	11.1	97.4	2.5	30,771
第36期 (2015年9月14日)	10,035	0	21.7	19,246.06	21.0	96.8	3.1	30,354
第36期 (2015年9月14日)	9,421	0	△6.1	17,965.70	△6.7	89.1	10.8	28,746

*先物組入比率は、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		日経平均株価 (225種)		株式組入比率	株式先物組入比率
	騰落率	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首) 2015年3月16日	円	%	円	%	%	%
3月末	10,035	—	19,246.06	—	96.8	3.1
4月末	10,070	0.3	19,206.99	△0.2	97.2	2.7
5月末	10,229	1.9	19,520.01	1.4	97.3	2.6
6月末	10,774	7.4	20,563.15	6.8	95.3	4.7
7月末	10,620	5.8	20,235.73	5.1	95.6	4.4
8月末	10,799	7.6	20,585.24	7.0	93.3	6.7
9月末	9,909	△1.3	18,890.48	△1.8	89.8	10.4
(期末) 2015年9月14日	9,421	△6.1	17,965.70	△6.7	89.1	10.8

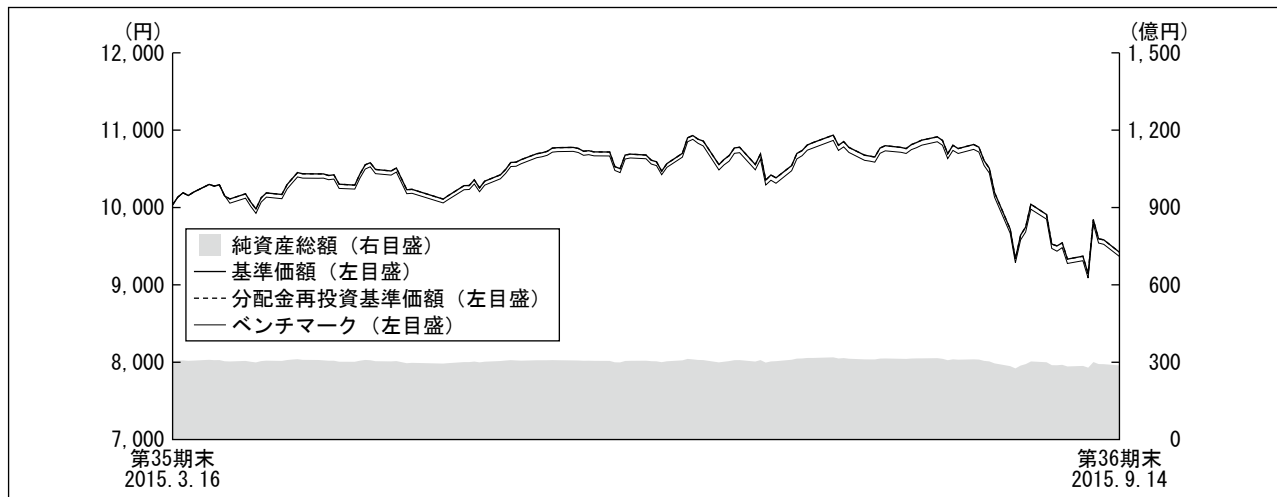
*騰落率は期首比です。

*先物組入比率は、買建比率－売建比率

- ①「日経平均株価」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、「日経平均株価」自体および「日経平均株価」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。
- ②「日経」および「日経平均株価」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ています。
- ③当ファンドは、投資信託委託会社など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、その運用および当ファンドの受益権の取引に関して、一切責任を負いません。
- ④株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」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。
- ⑤株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均株価」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。

運用経過

【基準価額等の推移】



*当ファンドのベンチマークは、日経平均株価（225種）です。

*日経平均株価（225種）は、期首の基準価額を基準に指数化しております。

*分配金再投資基準価額は、期首の基準価額を基準に算出しております。

*分配金再投資基準価額は、収益分配金（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。

*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。

第36期首：10,035円

第36期末：9,421円（既払分配金 0円）

騰落率：△6.1%（分配金再投資ベース）

【基準価額の主な変動要因】

（上昇要因）

2015年3月は中国での利下げや欧州中央銀行（ECB）の量的緩和策、米国の早期利上げ観測の後退、4月はゆうちょ銀行の国内株式組入比率の引き上げ報道、5月は中国の追加利下げや円安の進行などが上昇要因となりました。また、7月中旬から8月上旬にかけては、中国当局による株式市場の下支え策が奏功して中国株が反発したことやユーロ圏首脳会議においてギリシャへの金融支援再開が大筋合意に至ったことを好感されたことも上昇要因となりました。

（下落要因）

緊縮財政反対派が勝利した7月5日のギリシャ国民投票後に中国株式市場が急落したこと、8月下旬に中国人民銀行が人民元の実質的な切り下げを行い、これをきっかけに中国経済の減速への懸念や通貨安を通じた新興諸国の景気悪化への懸念が台頭し、世界同時株安へとつながったことが下落要因となりました。

【投資環境】

当期の国内株式市場は、中国の利下げやECBの量的緩和策、米国での早期利上げ観測の後退などにより市場でのリスク選好の姿勢がより強まり、さらに良好な需給などを背景に強気相場の中で始まりました。4月には日経平均株価が15年ぶりに20,000円台に乗せました。その後、6月から8月中旬にかけては、中国株式市場の急落やギリシャ債務問題の不透明感などを嫌気して利益確定の売りが出る局面もありましたが、好業績銘柄や株主還元強化策を発表した銘柄を中心に、押し目では積極的な買いが入り、高値圏での推移が続きました。

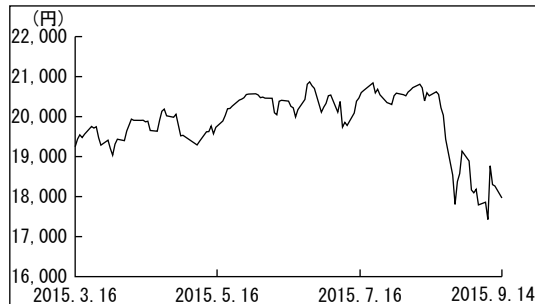
しかし、8月11日に中国人民銀行が人民元を実質的に切り下げたことをきっかけに、中国経済の減速や通貨安を通じた新興国の景気悪化への懸念が台頭し、市場でのリスク回避姿勢が強まり、円高の進行も嫌気され株式市場は急落しました。9月に入ってからも17日～18日に開催される米連邦公開市場委員会（FOMC）などの重要イベントを控えて上値は重く、日経平均株価は前期末比△6.7%の17,965.70円で当期の取引を終えました。

【ポートフォリオ】

当ファンドは日経平均株価に連動した投資効果を目指し、日経平均採用銘柄225銘柄のうち、223銘柄を対象に運用を行いました。また、余剰現金部分は日経225先物を買建てることにより、実質的な株式組入比率（株式現物と株価指数先物の買建の合計）をほぼ100%に保ちました。

個別銘柄では引き続き、シャープ、東京電力の保有を見合わせており、日経平均採用銘柄のうち、非保有銘柄は2銘柄となっています。

日経平均株価（225種）の推移



組入上位業種

(2015年9月14日現在)

	業種名	比率
1	電気機器	14.7%
2	小売業	11.5%
3	情報・通信業	9.6%
4	医薬品	7.1%
5	化学	7.0%
6	輸送用機器	6.2%
7	食料品	4.4%
8	機械	4.0%
9	サービス業	2.8%
10	精密機器	2.5%

*純資産総額に対する評価額の割合

【ベンチマークとの差異】

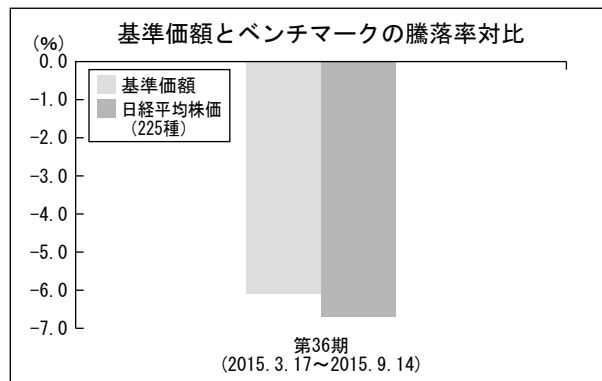
基準価額（分配金再投資ベース）の騰落率は△6.1%となり、ベンチマークである日経平均株価（225種）の騰落率△6.7%を0.6%上回りました。

（主なプラス要因）

株式配当金の受け取りがプラスに寄与しました。

（主なマイナス要因）

売買手数料などの諸経費がマイナスに作用しました。



【分配金】

当期は、基準価額の水準及び株価指数との連動性等を勘案し、収益分配金につきましては見送りとさせて頂きました。

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用を行います。

■分配原資の内訳

（1万口当り・税引前）

項目	第36期	
	2015年3月17日 ～2015年9月14日	
当期分配金 (円)		0
(対基準価額比率) (%)		0.00
当期の収益 (円)		—
当期の収益以外 (円)		—
翌期繰越分配対象額 (円)		6,409

※当期分配金の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、ファンドの収益率とは異なります。

今後の運用方針

国内株式市場は、世界経済の減速や米国の利上げへの警戒感を背景に乱高下する展開となっています。今後は、日本銀行の追加緩和や公的年金による買い支え期待などを背景に下値では押し目買いが入ることが予想される一方、円安の一服や国内外金利の上昇、世界経済の減速懸念などが上値を重くする可能性があると考えています。

今後の運用については、株式現物と日経225先物の合計組入比率を高位に保つことにより、日経平均株価との高い連動性を維持した運用を継続する方針です。

現状は日経平均採用銘柄のうち223銘柄に投資していますが、個別銘柄のファンダメンタルズに十分注意を払いつつ、必要ならば保有銘柄から除外する方針です。

今後ともわが国の代表的な株価指数である日経平均株価への高い連動性を目指す運用に努力してまいりますので、引き続き当ファンドをご愛顧賜りますようお願い申し上げます。

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2015年3月17日～2015年9月14日		
	金額	比率	
信託報酬	34円	0.322%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,400円です。
(投信会社)	(15)	(0.142)	ファンドの運用等の対価
(販売会社)	(15)	(0.142)	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)	(4)	(0.038)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0.012	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)	(0)	(0.000)	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)	(1)	(0.012)	
その他費用	0	0.003	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)	(0.003)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合計	35	0.337	

* 「比率」欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

* 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。

* 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

売買及び取引の状況

(2015年3月17日から2015年9月14日まで)

■株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	株 — (189,600)	千円 — (—)	株 849,400	千円 2,060,641

*金額は受渡し代金

* () 内は増資割当、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 10,285	百万円 7,947	百万円 —	百万円 —

*金額は受渡し代金

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合 (2015年3月17日から2015年9月14日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	2,060,641千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	28,769,429千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.07

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均

主要な売買銘柄

(2015年3月17日から2015年9月14日まで)

■株 式

当				期					
買		付		売		付			
銘	柄	株 数	金 額	平均単価	銘	柄	株 数	金 額	平均単価
—	—	千株	千円	円			千株	千円	円
		—	—	—	ファーストリテイリング		4	202,621	50,655
					ファナック		4	108,147	27,036
					ソフトバンクグループ		12	89,056	7,421
					KDDI		24	68,246	2,843
					京セラ		8	55,153	6,894
					アステラス製薬		20	37,476	1,873
					TDK		4	37,442	9,360
					日東電工		4	35,285	8,821
					ダイキン工業		4	35,221	8,805
					セコム		4	33,909	8,477

*金額は受渡し代金

利害関係人との取引状況等

(2015年3月17日から2015年9月14日まで)

■利害関係人との取引状況

当期における利害関係人との取引はありません。

組入資産の明細

2015年9月14日現在

■国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				
日本水産	60	56	20,272	
マルハニチロ	6	5.6	9,576	
鉱業 (0.1%)				
国際石油開発帝石	24	22.4	24,292	
建設業 (2.7%)				
コムシスホールディングス	60	56	81,424	
大成建設	60	56	44,184	
大林組	60	56	57,288	
清水建設	60	56	62,272	
鹿島建設	60	56	36,680	
大和ハウス工業	60	56	169,792	
積水ハウス	60	56	102,340	
日揮	60	56	95,928	
千代田化工建設	60	56	48,496	
食料品 (4.9%)				
日清製粉グループ本社	60	56	87,080	
明治ホールディングス	6	5.6	93,576	
日本ハム	60	56	143,472	
サッポロホールディングス	60	56	24,584	
アサヒグループホールディングス	60	56	199,640	
キリンホールディングス	60	56	90,076	
宝ホールディングス	60	56	41,328	
キッコーマン	60	56	183,400	
味の素	60	56	136,220	
ニチレイ	60	56	37,408	
日本たばこ産業	60	56	225,456	
繊維製品 (0.7%)				
東洋紡	60	56	9,296	
ユニチカ	60	56	3,472	
日清紡ホールディングス	60	56	80,584	
帝人	60	56	21,112	
東レ	60	56	57,652	
パルプ・紙 (0.3%)				
王子ホールディングス	60	56	32,256	
日本製紙	6	5.6	11,816	
北越紀州製紙	60	56	39,704	
化学 (7.9%)				
クラレ	60	56	79,968	
旭化成	60	56	51,464	
昭和電工	60	56	7,672	
住友化学	60	56	34,048	
日産化学工業	60	56	150,808	
日本曹達	60	56	39,536	
東ソー	60	56	32,256	
トクヤマ	60	56	10,752	
電気化学工業	60	56	27,272	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
信越化学工業	60	56	354,424	
三井化学	60	56	21,952	
三菱ケミカルホールディングス	30	28	18,323	
宇部興産	60	56	12,040	
日本化薬	60	56	73,360	
花王	60	56	290,360	
富士フイルムホールディングス	60	56	261,856	
資生堂	60	56	137,200	
日東電工	60	56	413,672	
医薬品 (7.9%)				
協和発酵キリン	60	56	104,664	
武田薬品工業	60	56	320,880	
アステラス製薬	300	280	466,480	
大日本住友製薬	60	56	74,984	
塩野義製薬	60	56	267,120	
中外製薬	60	56	232,680	
エーザイ	60	56	444,752	
第一三共	60	56	123,200	
石油・石炭製品 (0.3%)				
昭和シェル石油	60	56	54,432	
J Xホールディングス	60	56	24,981	
ゴム製品 (1.1%)				
横浜ゴム	60	28	58,632	
ブリヂストン	60	56	227,584	
ガラス・土石製品 (1.7%)				
日東紡績	60	56	22,568	
旭硝子	60	56	41,944	
日本板硝子	60	56	6,104	
日本電気硝子	90	84	52,920	
住友大阪セメント	60	56	26,824	
太平洋セメント	60	56	21,952	
東海カーボン	60	56	16,240	
TOTO	60	56	95,928	
日本碍子	60	56	141,512	
鉄鋼 (0.2%)				
新日鐵住金	60	56	13,714	
神戸製鋼所	60	56	8,736	
ジェイ エフ イー ホールディングス	6	5.6	10,063	
日新製鋼	6	5.6	6,372	
大太平洋金属	60	56	16,968	
非鉄金属 (1.4%)				
日本軽金属ホールディングス	60	56	10,192	
三井金属鉱業	60	56	13,440	
東邦亜鉛	60	56	16,800	
三菱マテリアル	60	56	22,176	
住友金属鉱山	60	56	84,532	
DOWAホールディングス	60	56	56,000	

エス・ビー・日本株オープン225

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
古河機械金属	60	56	14,840
古河電気工業	60	56	11,144
住友電気工業	60	56	90,748
フジクラ	60	56	31,752
金属製品 (0.4%)			
SUMCO	6	5.6	6,468
東洋製罐グループホールディングス	60	56	108,584
機械 (4.4%)			
日本製鋼所	60	56	21,896
オークマ	60	56	48,160
アマダホールディングス	60	56	57,120
小松製作所	60	56	110,320
住友重機械工業	60	56	29,512
日立建機	60	56	99,904
クボタ	60	56	98,896
荏原製作所	60	56	26,600
ダイキン工業	60	56	387,296
日本精工	60	56	73,584
NTN	60	56	31,416
ジェイテクト	60	56	92,848
日立造船	12	11.2	7,224
三菱重工業	60	56	31,264
IHI	60	56	19,488
電気機器 (16.5%)			
コニカミノルタ	60	56	71,848
ミネベア	60	56	75,936
日立製作所	60	56	34,753
東芝	60	56	17,628
三菱電機	60	56	64,316
富士電機	60	56	25,984
安川電機	60	56	72,240
明電舎	60	56	21,448
ジーエス・ユアサ コーポレーション	60	56	25,088
日本電気	60	56	21,616
富士通	60	56	32,457
沖電気工業	60	56	10,976
パナソニック	60	56	71,204
ソニー	60	56	174,524
TDK	60	56	406,000
ミツミ電機	60	56	37,016
アルプス電気	60	56	199,920
パイオニア	60	56	14,952
横河電機	60	56	74,536
アドバンテスト	120	112	102,928
カシオ計算機	60	56	124,152
ファナック	60	56	1,066,520
京セラ	120	112	645,792
太陽誘電	60	56	81,480
SCREENホールディングス	60	56	34,048
キヤノン	90	84	304,920
リコー	60	56	70,364

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京エレクトロン	60	56	347,368
輸送用機器 (7.0%)			
デンソー	60	56	302,344
三井造船	60	56	10,640
川崎重工業	60	56	24,864
日産自動車	60	56	62,020
いすゞ自動車	30	28	35,728
トヨタ自動車	60	56	392,392
日野自動車	60	56	73,248
三菱自動車工業	6	5.6	5,269
マツダ	12	11.2	20,938
本田技研工業	120	112	409,360
スズキ	60	56	209,524
富士重工業	60	56	237,076
精密機器 (2.8%)			
テルモ	120	112	360,080
ニコン	60	56	82,992
オリンパス	60	56	230,720
シチズンホールディングス	60	56	46,592
その他製品 (1.1%)			
凸版印刷	60	56	55,832
大日本印刷	60	56	67,844
ヤマハ	60	56	149,800
電気・ガス業 (0.3%)			
中部電力	6	5.6	10,343
関西電力	6	5.6	8,072
東京瓦斯	60	56	34,871
大阪瓦斯	60	56	26,504
陸運業 (2.5%)			
東武鉄道	60	56	29,624
東京急行電鉄	60	56	48,944
小田急電鉄	60	56	61,544
京王電鉄	60	56	48,496
京成電鉄	60	56	71,680
東日本旅客鉄道	6	5.6	57,484
西日本旅客鉄道	6	5.6	43,131
東海旅客鉄道	6	5.6	107,296
日本通運	60	56	33,712
ヤマトホールディングス	60	56	133,616
海運業 (0.2%)			
日本郵船	60	56	17,416
商船三井	60	56	18,592
川崎汽船	60	56	15,736
空運業 (0.1%)			
ANAホールディングス	60	56	19,129
倉庫・運輸関連業 (0.3%)			
三菱倉庫	60	56	84,672
情報・通信業 (10.8%)			
ヤフー	24	22.4	10,976
トレンドマイクロ	60	56	240,240
スカパーJ SATホールディングス	6	5.6	3,029

エス・ビー・日本株オープン225

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円			
日本電信電話	6	11.2	47,762			
KDDI	120	336	927,528			
NTTドコモ	6	5.6	12,334			
東宝	6	5.6	15,372			
エヌ・ティ・ティ・データ	60	56	325,360			
コナミ	60	56	149,856			
ソフトバンク	180	168	1,033,872			
卸売業 (2.1%)						
双日	6	5.6	1,338			
伊藤忠商事	60	56	77,616			
丸紅	60	56	36,556			
豊田通商	60	56	152,824			
三井物産	60	56	86,156			
住友商事	60	56	71,456			
三菱商事	60	56	119,868			
小売業 (12.9%)						
J.フロントリテイリング	30	28	50,960			
三越伊勢丹ホールディングス	60	56	101,080			
セブン&アイ・ホールディングス	60	56	278,572			
高島屋	60	56	53,032			
丸井グループ	60	56	78,792			
イオン	60	56	99,568			
ユニグループ・ホールディングス	60	56	41,384			
ファーストリテイリング	60	56	2,596,440			
銀行業 (1.4%)						
新生銀行	60	56	14,224			
あおぞら銀行	60	56	24,024			
三菱UFJフィナンシャル・グループ	60	56	42,190			
りそなホールディングス	6	5.6	3,340			
三井住友トラスト・ホールディングス	60	56	26,516			
三井住友フィナンシャルグループ	6	5.6	26,446			
千葉銀行	60	56	49,336			
横浜銀行	60	56	41,820			
ふくおかフィナンシャルグループ	60	56	32,816			
静岡銀行	60	56	72,464			
みずほフィナンシャルグループ	60	56	13,199			
証券・商品先物取引業 (0.6%)						
大和証券グループ本社	60	56	45,466			

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円			
野村ホールディングス	60	56	41,647			
松井証券	60	56	59,696			
保険業 (1.1%)						
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	15	14	51,912			
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	18	16.8	57,556			
ソニーフィナンシャルホールディングス	12	11.2	23,441			
第一生命保険	6	5.6	11,104			
東京海上ホールディングス	30	28	127,638			
T&Dホールディングス	12	11.2	16,805			
その他金融業 (0.5%)						
クレディセゾン	60	56	126,728			
不動産業 (2.5%)						
東急不動産ホールディングス	60	56	46,200			
三井不動産	60	56	183,624			
三菱地所	60	56	140,028			
平和不動産	12	11.2	14,358			
東京建物	60	28	40,460			
住友不動産	60	56	219,436			
サービス業 (3.1%)						
電通	60	56	346,640			
東京ドーム	60	56	29,232			
セコム	60	56	423,472			
合 計	株 数、金額	12,501	11,841.2	25,614,022		
	銘柄数<比率>	223銘柄	223銘柄	<89.1%>		

*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

*合計欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率

*各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づき表示しています。

■先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	柄 別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	日 経 平 均	百万円 3,100	百万円 -

投資信託財産の構成

2015年9月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 25,614,022	% 88.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,312,874	11.5
投 資 信 託 財 産 総 額	28,926,896	100.0

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2015年9月14日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	28,915,418,527円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,119,644,527
株 式(評価額)	25,614,022,000
未 収 配 当 金	15,750,000
差 入 委 託 証 拠 金	166,002,000
(B) 負 債	168,870,148
未 払 金	49,678,352
未 払 解 約 金	20,203,991
未 払 信 託 報 酬	98,133,741
そ の 他 未 払 費 用	854,064
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	28,746,548,379
元 本	30,514,632,326
次 期 繰 越 損 益 金	△ 1,768,083,947
(D) 受 益 権 総 口 数	30,514,632,326口
1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D)	9,421円

*元本状況
 期首元本額 30,248,796,134円
 期中追加設定元本額 6,219,298,613円
 期中一部解約元本額 5,953,462,421円
 *元本の欠損 1,768,083,947円

損益の状況

自2015年3月17日
 至2015年9月14日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	228,220,019円
受 取 配 当 金	227,776,720
受 取 利 息	422,997
そ の 他 収 益 金	20,302
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 1,945,808,581
売 買 益	818,628,052
売 買 損	△ 2,764,436,633
(C) 先 物 取 引 等 損 益	△ 188,072,548
取 引 益	84,248,513
取 引 損	△ 272,321,061
(D) 信 託 報 酬 等	△ 98,987,805
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△ 2,004,648,915
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	8,989,457,266
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 8,752,892,298
(配 当 等 相 当 額)	(10,440,367,035)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△19,193,259,333)
(H) 計 (E+F+G)	△ 1,768,083,947
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△ 1,768,083,947
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 8,752,892,298
(配 当 等 相 当 額)	(10,440,367,035)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△19,193,259,333)
分 配 準 備 積 立 金	9,118,689,480
繰 越 損 益 金	△ 2,133,881,129

*有価証券売買損益及び先物取引等損益には、期末の評価換えによるものを含みます。
 *信託報酬等には、消費税等相当額を含めて表示しております。
 *追加信託差損益金とは、追加信託金と元本の差額をいい、元本を下回る額は損失として、上回る額は利益として処理されます。

<分配金の計算過程>
 信託約款に基づき計算した収益分配可能額及び収益分配金の計算過程は以下のとおりです。

(A) 配 当 等 収 益 (費用控除後)	129,232,214円
(B) 有 価 証 券 売 買 等 損 益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)	0
(C) 収 益 調 整 金	10,440,367,035
(D) 分 配 準 備 積 立 金	8,989,457,266
分 配 可 能 額 (A+B+C+D)	19,559,056,515
(1 万 口 当 り 分 配 可 能 額)	(6,409.73)
収 益 分 配 金	0
(1 万 口 当 り 収 益 分 配 金)	(0)

お知らせ

該当事項はございません。

※各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しております。