

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38期

決算日 2016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2016年9月14日に第38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。

ホームページアドレス

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

お問い合わせ先

受付窓口:(電話番号)0120-286104

受付時間:午前9時から午後5時まで(土、日、祝日除く。)

※お客様のお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	期騰落	率			
第34期 (2014年9月16日)	円	円	円	%	円	%	%	百万円
	8,245	0		11.7	15,911.53	11.1	97.4	30,771
第35期 (2015年3月16日)	10,035	0		21.7	19,246.06	21.0	96.8	30,354
第36期 (2015年9月14日)	9,421	0	△ 6.1		17,965.70	△ 6.7	89.1	28,746
第37期 (2016年3月14日)	9,097	0	△ 3.4		17,233.75	△ 4.1	87.0	29,272
第38期 (2016年9月14日)	8,832	0	△ 2.9		16,614.24	△ 3.6	89.1	28,091

*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) 2016年3月14日	円	%	円	%	%	%
	9,097	—	17,233.75	—	87.0	13.0
3月末	8,910	△2.1	16,758.67	△2.8	86.3	13.7
4月末	8,845	△2.8	16,666.05	△3.3	86.9	13.1
5月末	9,153	0.6	17,234.98	0.0	86.5	13.5
6月末	8,282	△9.0	15,575.92	△9.6	85.8	14.2
7月末	8,811	△3.1	16,569.27	△3.9	86.2	13.7
8月末	8,980	△1.3	16,887.40	△2.0	88.4	11.6
(期末) 2016年9月14日	8,832	△2.9	16,614.24	△3.6	89.1	10.9

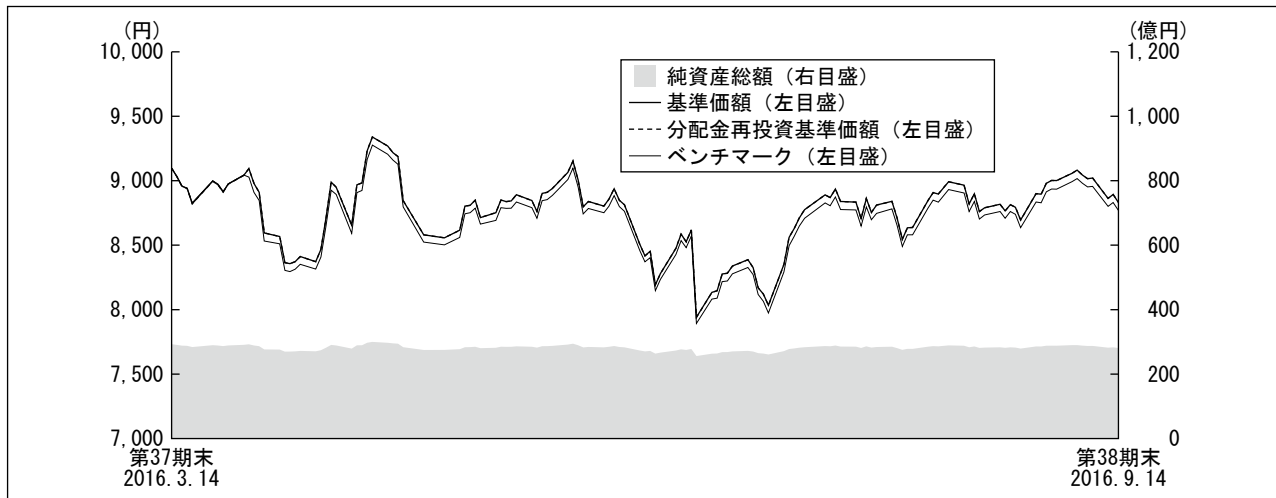
*騰落率は期首比です。

*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」を示す標準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38期首：9,097円

第38期末：8,832円（既払分配金 0円）

騰落率：△2.9%（分配金再投資ベース）

【基準価額の主な変動要因】

（上昇要因）

ソフトバンクグループ、東京エレクトロン、ダイキン工業などの値上がりが上昇要因となりました。

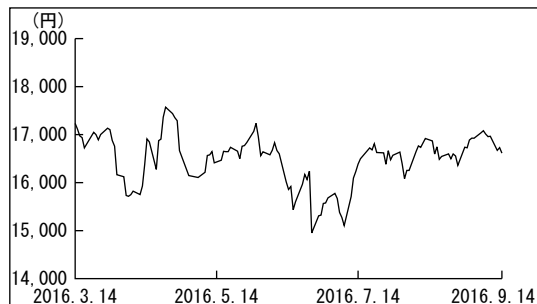
（下落要因）

オリンパス、カシオ計算機、武田薬品工業などの値下がり下落要因となりました。

【投資環境】

期初の国内株式市場は、円高の進行や熊本での大規模な地震の影響などを受けて下落しました。2016年4月には日本銀行の金融政策決定会合への期待から相場は上昇したものの、日本銀行が金融政策の現状維持を決定すると円高が進行し、下落しました。5月には、米国の利上げ期待により円高が一服したことや、日本での消費税増税の先送りを受けて相場は上昇しました。しかし、6月に米国の雇用統計が軟調だったことが発表されると、米連邦準備理事会（FRB）による利上げ観測が大幅に後退し、さらに英国の欧州連合（EU）離脱が予想外に決定されると、再び円高ドル安が進行して相場は下落しました。7月には、日本銀行が金融政策決定会合で上場投資信託（ETF）の買入れ増額を発表し、追加緩和の規模が予想を下回ったとの見方から円高が進行したものの、マイナス金利拡大の見送りにより銀行株が上昇したことを受けて相場は高値圏を維持しました。8月には、日本銀行の金融政策に手詰まり感が出てきたとの見方から、為替市場ではドル円が一時99円台まで円高が進行しました。しかし、日本銀行のETF買入れ期待に支えられて相場は下値を固める展開となり、その後は期末までレンジでの推移となりました。

日経平均株価（225種）の推移



【ポートフォリオ】

当ファンドは日経平均株価（225種）に連動した投資効果を目指し、日経平均株価採用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、東芝、三菱自動車の保有を見合わせており、日経平均株価（225種）採用銘柄のうち、非保有銘柄は2銘柄となっています。

組入上位業種

（2016年9月14日現在）

業種名	比率
1 電気機器	14.8%
2 情報・通信業	10.8%
3 小売業	10.6%
4 化学	7.3%
5 医薬品	6.8%
6 輸送用機器	6.1%
7 食料品	4.8%
8 機械	4.5%
9 サービス業	3.0%
10 精密機器	2.8%

*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】

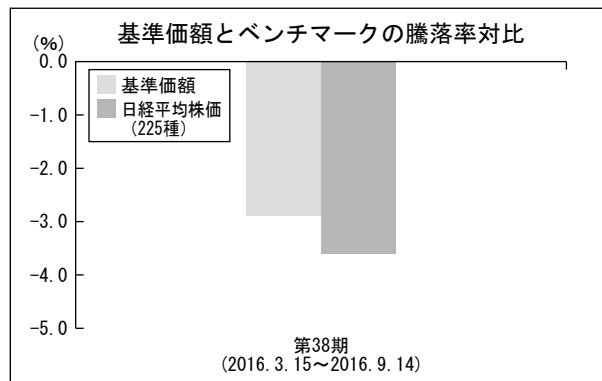
基準価額（分配金再投資ベース）の騰落率は、 $\Delta 2.9\%$ となり、ベンチマークである日経平均株価（225種）の騰落率 $\Delta 3.6\%$ を 0.7% 上回りました。

（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38期	
	2016年3月15日 ～2016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)		6,510

※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

F R Bによる年内の利上げ期待の高まりから足元では円高が一服しており、相場の下支えとなっています。また、9月に予定されている日本銀行の金融政策の総括的検証では、追加緩和があるとの見方から実質的な出口戦略が示されるとの見方まで予想が二分されています。今後も日米の金融政策に注目が集まる展開になると考えています。

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2016年3月15日～2016年9月14日		
	金額	比率	
信託報酬	29円	0.327%	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8,830円です。
(投信会社)	(13)	(0.144)	ファンドの運用等の対価
(販売会社)	(13)	(0.144)	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)	(3)	(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	0.007	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)	(0.007)	
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
(その他)	(0)	(0.000)	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	30	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

(2016年3月15日から2016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 179,800 (△127,600)	千円 585,534 ()	株 121,800	千円 96,388

*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 7,946	百万円 8,637	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 (2016年3月15日から2016年9月14日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	681,923千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	24,623,211千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.02

* (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

(2016年3月15日から2016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
ユニ・ファミリーマートホールディングス		58	449,144	7,743	ユニグループ・ホールディングス		58	62,886	1,084
ヤマハ発動機		58	101,964	1,758	横浜銀行		58	30,610	527
コンコルディア・フィナンシャルグループ		58	31,030	535	三菱自動車工業		5.8	2,891	498
東京電力ホールディングス		5.8	3,395	585					

*金額は受渡し代金

利害関係人との取引状況等

(2016年3月15日から2016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

2016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 (0.2%)				
日本水産	58	58	25,404	
マルハニチロ	5.8	5.8	14,587	
鉱業 (0.1%)				
国際石油開発帝石	23.2	23.2	19,258	
建設業 (2.9%)				
コムシスホールディングス	58	58	107,358	
大成建設	58	58	45,240	
大林組	58	58	57,652	
清水建設	58	58	53,360	
長谷工コーポレーション	11.6	11.6	11,286	
鹿島建設	58	58	40,716	
大和ハウス工業	58	58	159,413	
積水ハウス	58	58	99,963	
日揮	58	58	95,816	
千代田化工建設	58	58	46,806	
食料品 (5.3%)				
日清製粉グループ本社	58	58	88,102	
明治ホールディングス	11.6	11.6	109,852	
日本ハム	58	58	138,214	
サッポロホールディングス	58	11.6	31,760	
アサヒグループホールディングス	58	58	207,408	
キリンホールディングス	58	58	97,005	
宝ホールディングス	58	58	53,766	
キッコーマン	58	58	189,370	
味の素	58	58	130,616	
ニチレイ	58	58	61,364	
日本たばこ産業	58	58	230,260	
繊維製品 (0.4%)				
東洋紡	58	58	9,164	
ユニチカ	58	58	3,364	
帝人	58	58	22,794	
東レ	58	58	56,074	
パルプ・紙 (0.3%)				
王子ホールディングス	58	58	23,490	
日本製紙	5.8	5.8	10,706	
北越紀州製紙	58	58	36,946	
化学 (8.2%)				
クラレ	58	58	82,360	
旭化成	58	58	46,585	
昭和電工	58	5.8	7,406	
住友化学	58	58	26,622	
日産化学工業	58	58	176,320	
日本曹達	58	58	24,940	
東ソー	58	58	35,148	
トクヤマ	58	58	20,648	
デンカ	58	58	25,810	

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	58	58	405,942	
三井化学	58	58	26,390	
三菱ケミカルホールディングス	29	29	17,423	
宇部興産	58	58	11,078	
日本化薬	58	58	61,770	
花王	58	58	320,044	
富士フイルムホールディングス	58	58	224,402	
資生堂	58	58	155,991	
日東電工	58	58	382,046	
医薬品 (7.7%)				
協和発酵キリン	58	58	92,684	
武田薬品工業	58	58	269,120	
アステラス製薬	290	290	462,260	
大日本住友製薬	58	58	103,878	
塩野義製薬	58	58	292,436	
中外製薬	58	58	198,360	
エーザイ	58	58	365,574	
第一三共	58	58	137,228	
石油・石炭製品 (0.3%)				
昭和シェル石油	58	58	50,750	
J Xホールディングス	58	58	22,863	
ゴム製品 (1.0%)				
横浜ゴム	29	29	48,401	
ブリヂストン	58	58	207,060	
ガラス・土石製品 (1.5%)				
旭硝子	58	58	37,816	
日本板硝子	58	58	4,872	
日本電気硝子	87	87	43,935	
住友大阪セメント	58	58	26,912	
太平洋セメント	58	58	17,168	
東海カーボン	58	58	16,588	
TOTO	29	29	112,085	
日本碍子	58	58	125,164	
鉄鋼 (0.2%)				
新日鐵住金	5.8	5.8	11,742	
神戸製鋼所	58	58	5,394	
ジェイ エフ イー ホールディングス	5.8	5.8	8,566	
日新製鋼	5.8	5.8	7,667	
大太平洋金属	58	58	16,936	
非鉄金属 (1.3%)				
日本軽金属ホールディングス	58	58	12,644	
三井金属鉱業	58	58	12,238	
東邦亜鉛	58	58	18,618	
三菱マテリアル	58	58	16,588	
住友金属鉱山	58	58	73,080	
DOWAホールディングス	58	58	40,716	
古河機械金属	58	58	9,338	

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
古河電気工業	58	58	14,558
住友電気工業	58	58	85,318
フジクラ	58	58	31,668
金属製品 (0.4%)			
SUMCO	5.8	5.8	4,576
東洋製罐グループホールディングス	58	58	107,126
機械 (5.1%)			
日本製鋼所	58	58	26,796
オークマ	58	58	44,312
アマダホールディングス	58	58	60,088
小松製作所	58	58	129,630
住友重機械工業	58	58	29,696
日立建機	58	58	113,448
クボタ	58	58	85,956
荏原製作所	58	58	32,712
ダイキン工業	58	58	537,370
日本精工	58	58	60,784
NTN	58	58	21,228
ジェイテクト	58	58	86,362
日立造船	11.6	11.6	5,985
三菱重工業	58	58	25,630
IHI	58	58	16,588
電気機器 (16.6%)			
日清紡ホールディングス	58	58	62,814
コニカミノルタ	58	58	50,750
ミネベア	58	58	54,578
日立製作所	58	58	27,434
三菱電機	58	58	73,022
富士電機	58	58	26,738
安川電機	58	58	87,116
明電舎	58	58	19,256
ジーエス・ユアサ コーポレーション	58	58	24,186
日本電気	58	58	14,790
富士通	58	58	30,299
沖電気工業	58	58	8,004
パナソニック	58	58	59,218
ソニー	58	58	192,502
TDK	58	58	406,580
ミツミ電機	58	58	33,466
アルプス電気	58	58	128,818
パイオニア	58	58	12,992
横河電機	58	58	78,126
アドバンテスト	116	116	166,460
カシオ計算機	58	58	81,026
ファナック	58	58	980,780
京セラ	116	116	566,660
太陽誘電	58	58	58,696
SCREENホールディングス	58	58	73,254
キヤノン	87	87	252,561
リコー	58	58	54,230
東京エレクトロン	58	58	529,134

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
輸送用機器 (6.8%)			
デンソー	58	58	244,876
三井造船	58	58	8,236
川崎重工業	58	58	18,212
日産自動車	58	58	59,421
いすゞ自動車	29	29	36,830
トヨタ自動車	58	58	350,900
日野自動車	58	58	63,800
三菱自動車工業	5.8	—	—
マツダ	11.6	11.6	18,937
本田技研工業	116	116	356,236
スズキ	58	58	200,680
富士重工業	58	58	229,506
ヤマハ発動機	—	58	117,450
精密機器 (3.1%)			
テルモ	116	116	458,780
ニコン	58	58	87,406
オリンパス	58	58	199,810
シチズンホールディングス	58	58	30,798
その他製品 (1.2%)			
凸版印刷	58	58	53,998
大日本印刷	58	58	59,218
ヤマハ	58	58	185,310
電気・ガス業 (0.3%)			
東京電力ホールディングス	—	5.8	2,343
中部電力	5.8	5.8	8,421
関西電力	5.8	5.8	5,312
東京瓦斯	58	58	26,152
大阪瓦斯	58	58	23,710
陸運業 (2.5%)			
東武鉄道	58	58	29,464
東京急行電鉄	58	58	45,646
小田急電鉄	58	58	63,858
京王電鉄	58	58	50,518
京成電鉄	58	58	73,254
東日本旅客鉄道	5.8	5.8	52,234
西日本旅客鉄道	5.8	5.8	35,559
東海旅客鉄道	5.8	5.8	99,557
日本通運	58	58	29,174
ヤマトホールディングス	58	58	140,824
海運業 (0.2%)			
日本郵船	58	58	11,194
商船三井	58	58	13,630
川崎汽船	58	58	14,848
空運業 (0.1%)			
ANAホールディングス	58	58	16,402
倉庫・運輸関連業 (0.4%)			
三菱倉庫	58	58	90,712
情報・通信業 (12.1%)			
ヤフー	23.2	23.2	9,512
トレンドマイクロ	58	58	207,930

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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
スカパーJ SATホールディングス	5.8	5.8	2,708	
日本電信電話	11.6	11.6	52,733	
KDDI	348	348	1,061,400	
NTTドコモ	5.8	5.8	14,714	
東宝	5.8	5.8	18,212	
エヌ・ティ・ティ・データ	58	58	305,080	
コナミホールディングス	58	58	221,850	
ソフトバンクグループ	174	174	1,131,174	
卸売業 (2.0%)				
双日	5.8	5.8	1,455	
伊藤忠商事	58	58	71,485	
丸紅	58	58	29,667	
豊田通商	58	58	137,750	
三井物産	58	58	78,532	
住友商事	58	58	64,380	
三菱商事	58	58	121,713	
小売業 (11.9%)				
J. フロント リテイリング	29	29	37,845	
三越伊勢丹ホールディングス	58	58	61,306	
セブン&アイ・ホールディングス	58	58	253,228	
ユニ・ファミリーマートホールディングス	—	58	389,760	
高島屋	58	58	47,618	
丸井グループ	58	58	81,780	
イオン	58	58	84,970	
ユニグループ・ホールディングス	58	—	—	
ファーストリテイリング	58	58	2,034,640	
銀行業 (1.0%)				
コンソルディア・フィナンシャルグループ	—	58	27,724	
新生銀行	58	58	9,048	
あおぞら銀行	58	58	20,648	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	58	58	29,435	
りそなホールディングス	5.8	5.8	2,496	
三井住友トラスト・ホールディングス	58	58	19,505	
三井住友フィナンシャルグループ	5.8	5.8	19,772	
千葉銀行	58	58	33,176	
横浜銀行	58	—	—	
ふくおかフィナンシャルグループ	58	58	24,244	
静岡銀行	58	58	47,386	
みずほフィナンシャルグループ	58	58	10,051	
証券・商品先物取引業 (0.5%)				
大和証券グループ本社	58	58	33,930	

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
野村ホールディングス	58	58	27,347	
松井証券	58	58	53,186	
保険業 (1.0%)				
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	14.5	14.5	46,124	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	17.4	17.4	49,885	
ソニーフィナンシャルホールディングス	11.6	11.6	16,959	
第一生命保険	5.8	5.8	8,560	
東京海上ホールディングス	29	29	114,376	
T&Dホールディングス	11.6	11.6	14,453	
その他金融業 (0.4%)				
クレディセゾン	58	58	100,630	
不動産業 (1.9%)				
東急不動産ホールディングス	58	58	32,886	
三井不動産	58	58	131,022	
三菱地所	58	58	112,607	
東京建物	29	29	37,033	
住友不動産	58	58	163,067	
サービス業 (3.4%)				
ディー・エヌ・エー	17.4	17.4	59,943	
電通	58	58	314,940	
東京ドーム	58	29	28,014	
セコム	58	58	447,760	
合 計				
	株 数、金 額	千株	千株	千円
	銘柄数<比率>	12,090.1	12,020.5	25,040,924
		222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	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	日 経 平 均	百万円 3,048	百万円 —

投資信託財産の構成

2016年9月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 25,040,924	% 88.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,242,306	11.5
投 資 信 託 財 産 総 額	28,283,231	100.0

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2016年9月14日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	28,283,231,378円
コール・ローン等株 式(評価額)	3,039,434,238
未 収 配 当 金	25,040,924,640
差 入 委 託 証 拠 金	16,022,500
(B) 負 債	192,138,042
未 払 金	186,850,000
未 払 解 約 金	65,004,172
未 払 信 託 報 酬	34,338,344
そ の 他 未 払 費 用	91,958,553
836,973	
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	28,091,093,336
元 本	31,805,996,414
次 期 繰 越 損 益 金	△ 3,714,903,078
(D) 受 益 権 総 口 数	31,805,996,414口
1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D)	8,832円

* 元本状況
 期首元本額 32,178,774,586円
 期中追加設定元本額 2,152,931,497円
 期中一部解約元本額 2,525,709,669円
 * 元本の欠損 3,714,903,078円

損益の状況

自2016年3月15日
 至2016年9月14日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	233,969,819円
受 取 配 当 金	235,057,605
受 取 利 息	16,219
そ の 他 収 益	24,575
支 払 利 息	△ 1,128,580
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 841,242,877
売 買 益	862,642,538
売 買 損	△ 1,703,885,415
(C) 先 物 取 引 等 損 益	△ 52,173,070
取 引 益	103,763,546
取 引 損	△ 155,936,616
(D) 信 託 報 酬 等	△ 92,797,163
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△ 752,243,291
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	4,882,028,912
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 7,844,688,699
(配 当 等 相 当 額)	(12,866,679,703)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△20,711,368,402)
(H) 次 期 繰 越 損 益 金(H)	△ 3,714,903,078
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 7,844,688,699
(配 当 等 相 当 額)	(12,866,679,703)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△20,711,368,402)
分 配 準 備 積 立 金	7,840,896,192
繰 越 損 益 金	△ 3,711,110,571

* 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)	141,172,656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	12,866,679,703
(D) 分 配 準 備 積 立 金	7,699,723,536
分 配 可 能 額 (A+B+C+D)	20,707,575,895
(1 万 口 当 り 分 配 可 能 額)	(6,510.59)
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。



世界に通用する質の高い
資産運用会社を目指します