

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、分配金額は経費控除後の利子・配当収益および売買益(評価損益も含みます。)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44期

決算日 2019年9月17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2019年9月17日に第44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。

- 口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
- 運用報告書についてのお問い合わせ
フリーダイヤル 0120-88-2976
受付時間:午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)



三井住友DSアセットマネジメント

(旧:大和住銀投信投資顧問)
〒105-6228 東京都港区愛宕2-5-1
<https://www.smd-am.co.jp>

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)	税金	期騰落率	(ベンチマーク)	期騰落率			
第40期 (2017年9月14日)	円 10,678	円 0	% 1.7	円 19,807.44	% 1.0	% 83.0	% 16.5	百万円 25,367
第41期 (2018年3月14日)	11,809	0	10.6	21,777.29	9.9	82.5	16.8	25,595
第42期 (2018年9月14日)	12,655	0	7.2	23,094.67	6.0	84.3	15.4	26,569
第43期 (2019年3月14日)	11,751	0	△ 7.1	21,287.02	△ 7.8	81.1	18.6	25,497
第44期 (2019年9月17日)	12,250	0	4.2	22,001.32	3.4	84.3	15.3	25,833

*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	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首) 2019年3月14日	円 11,751	% —	円 21,287.02	% —	% 81.1	% 18.6
3月末	11,798	0.4	21,205.81	△ 0.4	80.9	18.7
4月末	12,377	5.3	22,258.73	4.6	84.1	15.5
5月末	11,451	△ 2.6	20,601.19	△ 3.2	82.4	16.9
6月末	11,850	0.8	21,275.92	△ 0.1	82.0	17.3
7月末	11,985	2.0	21,521.53	1.1	83.8	15.8
8月末	11,533	△ 1.9	20,704.37	△ 2.7	82.6	16.9
(期末) 2019年9月17日	12,250	4.2	22,001.32	3.4	84.3	15.3

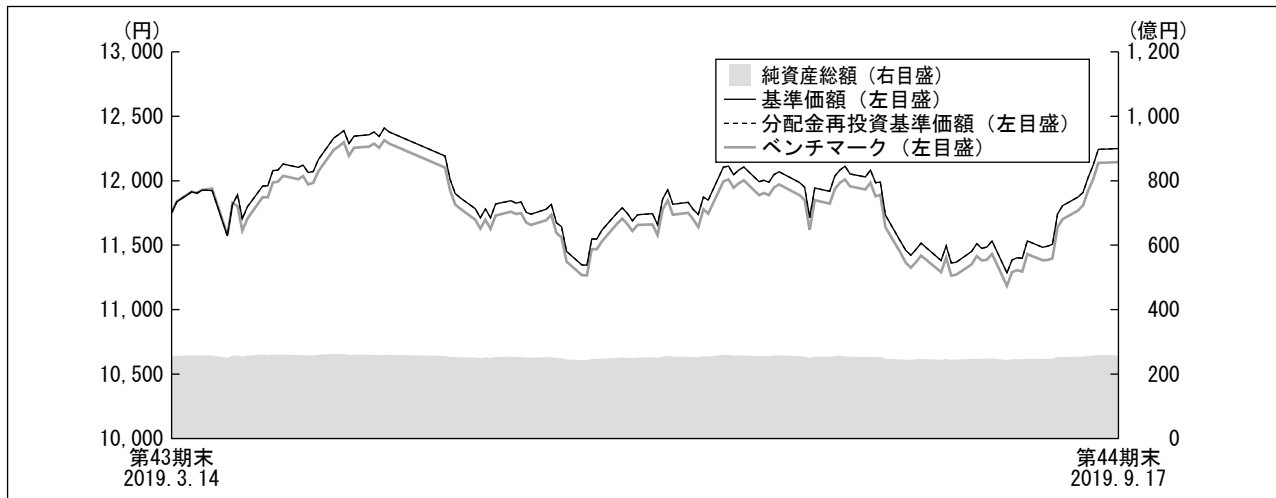
*騰落率は期首比です。

*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、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はありません。

*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。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

第44期首：11,751円

第44期末：12,250円（既払分配金 0円）

騰落率：+4.2%（分配金再投資ベース）

【基準価額の主な変動要因】

（上昇要因）

アドバンテスト、第一三共、東京エレクトロンなどの株価が値上がりしたことが上昇要因となりました。

（下落要因）

エーザイ、東邦亜鉛、ヤマトホールディングスなどの株価が値下がりしたことが下落要因となりました。

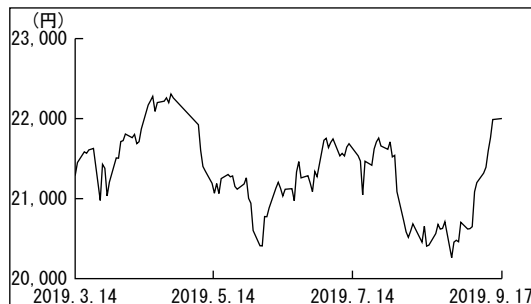
【投資環境】

当期の国内株式市場は小幅に上昇しました。3月から4月にかけては米中貿易交渉の進展期待から上昇しましたが、5月には米国が対中関税の引き上げを発表したことから下落しました。6月に入るとFOMC（米連邦公開市場委員会）で今後の利下げが示唆されたことや、米中貿易交渉再開への期待などで、国内株式市場は戻り歩調となると、その後も6月末の米中首脳会談で中国通信機器大手への制裁の一部解除が発表されたため、一段高となりました。8月には再び米国が新たな対中関税を発表したことから、再び下落しました。9月に入ってから、米中通商協議の再開が発表されたことや、英国の合意なきEU（欧州連合）離脱のリスクが低下したことを受けて、国内株式市場も上昇しました。

【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て運用を行いました。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。

日経平均株価（225種）の推移



組入上位業種

(2019年9月17日現在)

	業種名	比率
1	電気機器	16.4%
2	小売業	12.0%
3	情報・通信業	9.0%
4	化学	7.1%
5	医薬品	6.4%
6	輸送用機器	4.2%
7	機械	4.0%
8	サービス業	3.8%
9	食料品	3.6%
10	精密機器	2.9%

*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】

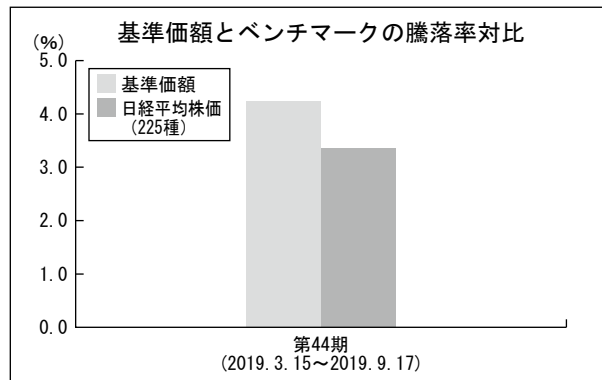
基準価額（分配金再投資ベース）の騰落率は+4.2%となり、ベンチマークである日経平均株価（225種）の騰落率+3.4%を0.8%上回りました。

（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、分配金につきましては見送りとさせていただきます。

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

（1万口当たり・税引前）

項目	第44期	
	2019年3月15日 ～2019年9月17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)	9,178	

※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

今後も日経平均株価（225種）に連動する投資成果を目指して運用を行う方針です。

1万口当りの費用明細

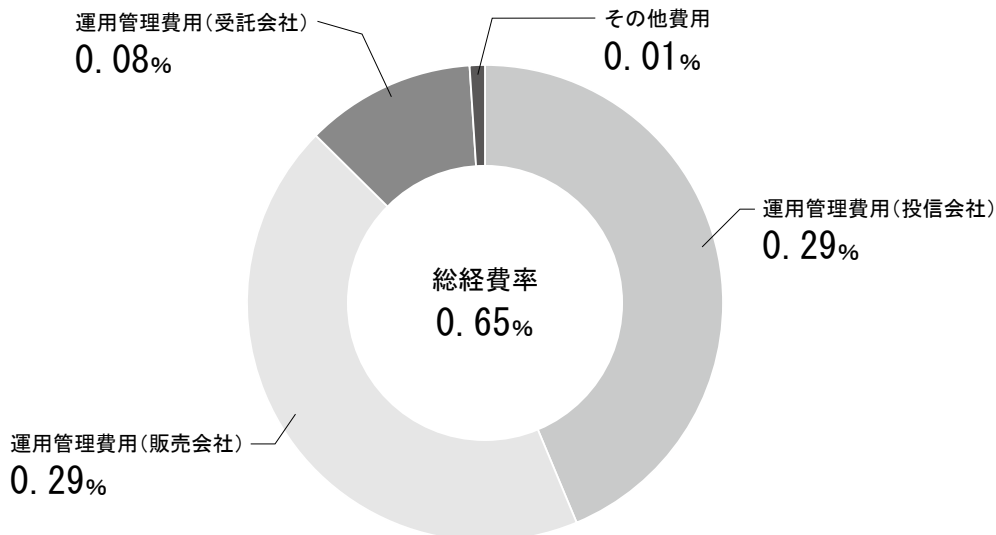
項目	当期		項目の概要
	2019年3月15日～2019年9月17日		
	金額	比率	
信託報酬	39円	0.331%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,832円です。
(投信会社)	(17)	(0.146)	ファンドの運用等の対価
(販売会社)	(17)	(0.146)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(5)	(0.039)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0.009	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
(株式)	(0)	(0.000)	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)	(0.009)	
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	41	0.344	

* 「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。

参考情報 総経費率（年率換算）



*各費用は、前掲「1万口当りの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、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。

*各比率は、年率換算した値（小数点以下第2位未満を四捨五入）です。

*上記の前提条件で算出しているため、「1万口当りの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、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。

当期中の運用・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口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率換算）は0.65%です。

売買及び取引の状況

（2019年3月15日から2019年9月17日まで）

■株 式

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内 上 場	株 86,400 (288,000)	千円 455,021 ()	株 72,000	千円 73,248

*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 9,719		百万円 10,748		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 (2019年3月15日から2019年9月17日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	528,269千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	20,877,877千円
(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

(2019年3月15日から2019年9月17日まで)

■株 式

当 期				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
バンダイナムコホールディングス	36	212,463	5,901	昭和シェル石油	36	60,552	1,682
オムロン	36	185,317	5,147	千代田化工建設	36	12,696	352
出光興産	14.4	57,240	3,975				

*金額は受渡し代金

利害関係人との取引状況等

(2019年3月15日から2019年9月17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。

■利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
株 式	百万円 -	百万円 -	百万円 13

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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、株式会社三井住友フィナンシャルグループです。

組入資産の明細

2019年9月17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	36	36	23,004	
マルハニチロ	3.6	3.6	10,134	
鉱業 (0.1%)				
国際石油開発帝石	14.4	14.4	15,868	
建設業 (2.3%)				
コムシスホールディングス	36	36	106,344	
大成建設	7.2	7.2	30,024	
大林組	36	36	39,456	
清水建設	36	36	35,604	
長谷工コーポレーション	7.2	7.2	9,086	
鹿島建設	18	18	25,794	
大和ハウス工業	36	36	127,260	
積水ハウス	36	36	73,602	
日揮	36	36	54,612	
千代田化工建設	36	—	—	
食料品 (4.2%)				
日清製粉グループ本社	36	36	73,044	
明治ホールディングス	7.2	7.2	56,376	
日本ハム	18	18	79,020	
サッポロホールディングス	7.2	7.2	19,137	
アサヒグループホールディングス	36	36	189,864	
キリンホールディングス	36	36	80,280	
宝ホールディングス	36	36	40,068	
キッコーマン	36	36	184,680	
味の素	36	36	71,766	
ニチレイ	18	18	43,956	
日本たばこ産業	36	36	83,970	
繊維製品 (0.2%)				
東洋紡	3.6	3.6	5,137	
ユニチカ	3.6	3.6	1,202	
帝人	7.2	7.2	14,896	
東レ	36	36	29,134	
パルプ・紙 (0.1%)				
王子ホールディングス	36	36	18,792	
日本製紙	3.6	3.6	6,728	
化学 (8.4%)				
クラレ	36	36	48,312	
旭化成	36	36	39,438	
昭和電工	3.6	3.6	11,016	
住友化学	36	36	18,000	
日産化学	36	36	161,820	
東ソー	18	18	26,730	
トクヤマ	7.2	7.2	17,402	
デンカ	7.2	7.2	21,542	
信越化学工業	36	36	419,760	
三井化学	7.2	7.2	17,841	
三菱ケミカルホールディングス	18	18	14,580	

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
宇部興産	3.6	3.6	7,999	
日本化薬	36	36	46,692	
花王	36	36	280,548	
D I C	3.6	3.6	10,854	
富士フィルムホールディングス	36	36	172,656	
資生堂	36	36	313,668	
日東電工	36	36	194,184	
医薬品 (7.6%)				
協和キリン	36	36	75,600	
武田薬品工業	36	36	136,368	
アステラス製薬	180	180	275,220	
大日本住友製薬	36	36	68,616	
塩野義製薬	36	36	212,076	
中外製薬	36	36	275,040	
エーザイ	36	36	193,968	
第一三共	36	36	251,712	
大塚ホールディングス	36	36	169,452	
石油・石炭製品 (0.3%)				
昭和シェル石油	36	—	—	
出光興産	—	14.4	47,592	
J X T Gホールディングス	36	36	18,432	
ゴム製品 (0.9%)				
横浜ゴム	18	18	39,456	
ブリヂストン	36	36	153,612	
ガラス・土石製品 (1.2%)				
A G C	7.2	7.2	24,048	
日本板硝子	3.6	3.6	2,426	
日本電気硝子	10.8	10.8	26,341	
住友大阪セメント	3.6	3.6	16,956	
太平洋セメント	3.6	3.6	10,562	
東海カーボン	36	36	41,400	
T O T O	18	18	75,690	
日本碍子	36	36	57,240	
鉄鋼 (0.1%)				
日本製鉄	3.6	3.6	5,693	
神戸製鋼所	3.6	3.6	2,203	
ジェイ エフ イー ホールディングス	3.6	3.6	4,978	
大太平洋金属	3.6	3.6	8,258	
非鉄金属 (0.9%)				
日本軽金属ホールディングス	36	36	7,308	
三井金属鉱業	3.6	3.6	9,406	
東邦亜鉛	3.6	3.6	7,401	
三菱マテリアル	3.6	3.6	10,569	
住友金属鉱山	18	18	63,306	
D O W Aホールディングス	7.2	7.2	26,460	
古河電気工業	3.6	3.6	9,280	
住友電気工業	36	36	50,850	
フジクラ	36	36	14,832	

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
金属製品 (0.3%)			
SUMCO	3.6	3.6	5,421
東洋製織グループホールディングス	36	36	62,712
機械 (4.7%)			
日本製鋼所	7.2	7.2	15,429
オークマ	7.2	7.2	42,336
アマダホールディングス	36	36	42,624
小松製作所	36	36	90,558
住友重機械工業	7.2	7.2	24,480
日立建機	36	36	95,472
クボタ	36	36	60,948
荏原製作所	7.2	7.2	20,613
ダイキン工業	36	36	516,060
日本精工	36	36	35,388
NTN	36	36	11,808
ジェイテクト	36	36	46,908
日立造船	7.2	7.2	2,527
三菱重工業	3.6	3.6	15,854
IHI	3.6	3.6	8,830
電気機器 (19.4%)			
日清紡ホールディングス	36	36	31,824
コニカミノルタ	36	36	28,800
ミネベアミツミ	36	36	68,688
日立製作所	7.2	7.2	29,707
三菱電機	36	36	52,992
富士電機	7.2	7.2	24,876
安川電機	36	36	142,020
オムロン	—	36	211,320
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7.2	7.2	13,809
日本電気	3.6	3.6	16,452
富士通	3.6	3.6	30,448
沖電気工業	3.6	3.6	5,270
セイコーエプソン	72	72	111,312
パナソニック	36	36	32,454
ソニー	36	36	235,512
TDK	36	36	343,440
アルプスアルパイン	36	36	74,412
横河電機	36	36	72,828
アドバンテスト	72	72	338,400
カシオ計算機	36	36	58,536
ファナック	36	36	725,400
京セラ	72	72	493,200
太陽誘電	36	36	89,100
SCREENホールディングス	7.2	7.2	47,376
キヤノン	54	54	159,030
リコー	36	36	37,620
東京エレクトロン	36	36	752,940
輸送用機器 (5.0%)			
デンソー	36	36	173,916
三井E&Sホールディングス	3.6	3.6	3,391
川崎重工業	3.6	3.6	8,809
日産自動車	36	36	25,801

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
いすゞ自動車	18	18	22,500
トヨタ自動車	36	36	268,020
日野自動車	36	36	33,876
三菱自動車工業	3.6	3.6	1,807
マツダ	7.2	7.2	7,254
本田技研工業	72	72	210,816
スズキ	36	36	155,304
SUBARU	36	36	111,276
ヤマハ発動機	36	36	70,668
精密機器 (3.4%)			
テルモ	72	144	472,176
ニコン	36	36	50,796
オリンパス	36	144	203,184
シチズン時計	36	36	19,836
その他製品 (2.2%)			
バンダイナムコホールディングス	—	36	230,400
凸版印刷	18	18	34,848
大日本印刷	18	18	50,796
ヤマハ	36	36	170,460
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	3.6	3.6	1,980
中部電力	3.6	3.6	5,724
関西電力	3.6	3.6	4,818
東京瓦斯	7.2	7.2	19,814
大阪瓦斯	7.2	7.2	14,680
陸運業 (2.2%)			
東武鉄道	7.2	7.2	25,524
東急	18	18	36,954
小田急電鉄	18	18	45,882
京王電鉄	7.2	7.2	48,456
京成電鉄	18	18	77,040
東日本旅客鉄道	3.6	3.6	37,548
西日本旅客鉄道	3.6	3.6	33,789
東海旅客鉄道	3.6	3.6	79,956
日本通運	3.6	3.6	20,556
ヤマトホールディングス	36	36	67,968
海運業 (0.1%)			
日本郵船	3.6	3.6	6,663
商船三井	3.6	3.6	10,364
川崎汽船	3.6	3.6	4,608
空運業 (0.1%)			
ANAホールディングス	3.6	3.6	13,438
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	18	18	49,248
情報・通信業 (10.7%)			
ヤフー	14.4	14.4	4,579
トレンドマイクロ	36	36	183,960
スカパーJ SATホールディングス	3.6	3.6	1,598
日本電信電話	7.2	7.2	38,505
KDDI	216	216	631,800
NTTドコモ	3.6	3.6	10,236
東宝	3.6	3.6	16,632

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
	千株	千株	千円
エヌ・ティ・ティ・データ	180	180	256,140
コナミホールディングス	36	36	178,920
ソフトバンクグループ	108	216	1,013,040
卸売業 (2.2%)			
双日	3.6	3.6	1,267
伊藤忠商事	36	36	81,504
丸紅	36	36	27,601
豊田通商	36	36	135,000
三井物産	36	36	68,580
住友商事	36	36	63,990
三菱商事	36	36	101,304
小売業 (14.2%)			
J. フロント リテイリング	18	18	23,616
三越伊勢丹ホールディングス	36	36	31,644
セブン&アイ・ホールディングス	36	36	149,220
ファミリーマート	144	144	383,760
高島屋	18	18	23,580
丸井グループ	36	36	81,792
イオン	36	36	72,396
ファーストリテイリング	36	36	2,334,240
銀行業 (0.7%)			
コンソルディア・フィナンシャルグループ	36	36	15,372
新生銀行	3.6	3.6	5,684
あおぞら銀行	3.6	3.6	9,864
三菱UFJフィナンシャル・グループ	36	36	20,581
りそなホールディングス	3.6	3.6	1,729
三井住友トラスト・ホールディングス	3.6	3.6	14,475
三井住友フィナンシャルグループ	3.6	3.6	13,701
千葉銀行	36	36	20,844
ふくおかフィナンシャルグループ	7.2	7.2	15,242
静岡銀行	36	36	29,736
みずほフィナンシャルグループ	36	36	6,080
証券、商品先物取引業 (0.3%)			
大和証券グループ本社	36	36	18,414
野村ホールディングス	36	36	17,161
松井証券	36	36	33,228
保険業 (1.0%)			
SOMP Oホールディングス	9	9	42,642
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	10.8	10.8	38,826

銘柄	期首(前期末) 当 期 末		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ソニーフィナンシャルホールディングス	7.2	7.2	17,064
第一生命ホールディングス	3.6	3.6	5,977
東京海上ホールディングス	18	18	106,542
T&Dホールディングス	7.2	7.2	8,503
その他金融業 (0.2%)			
クレディセゾン	36	36	50,112
不動産業 (1.7%)			
東急不動産ホールディングス	36	36	24,516
三井不動産	36	36	97,218
三菱地所	36	36	74,808
東京建物	18	18	26,442
住友不動産	36	36	147,564
サービス業 (4.5%)			
ディー・エヌ・エー	10.8	10.8	20,930
電通	36	36	141,480
サイバーエージェント	7.2	7.2	29,880
楽天	36	36	38,160
リクルートホールディングス	108	108	351,000
日本郵政	36	36	37,044
東京ドーム	18	18	18,576
セコム	36	36	343,692
合 計	株数、金額	千株	千円
	6,085.8	6,388.2	21,778,929
	銘柄数<比率>	224銘柄	225銘柄 <84.3%>

*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 3,947	百万円 -

投資信託財産の構成

2019年9月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 21,778,929	% 83.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,440,944	16.9
投 資 信 託 財 産 総 額	26,219,873	100.0

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2019年9月17日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	26,101,181,259円
コール・ローン等	4,179,749,060
株 式(評価額)	21,778,929,000
未 収 入 金	119,598,199
未 収 配 当 金	16,857,000
差 入 委 託 証 拠 金	6,048,000
(B) 負 債	268,178,666
未 払 解 約 金	183,351,554
未 払 信 託 報 酬	84,010,618
そ の 他 未 払 費 用	816,494
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	25,833,002,593
元 本	21,088,733,022
次 期 繰 越 損 益 金	4,744,269,571
(D) 受 益 権 総 口 数	21,088,733,022口
1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D)	12,250円

*元本状況

期首元本額	21,698,841,899円
期中追加設定元本額	2,288,661,804円
期中一部解約元本額	2,898,770,681円

損益の状況

自2019年3月15日
至2019年9月17日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	213,952,742円
受 取 配 当 金	215,713,891
受 取 利 息	17,671
そ の 他 収 益 金	18,542
支 払 利 息	△ 1,797,362
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	676,828,515
売 買 益 損	1,869,402,423
売 買 損 益	△ 1,192,573,908
(C) 先 物 取 引 等 損 益	232,643,882
取 引 益 損	252,246,904
取 引 損 益	△ 19,603,022
(D) 信 託 報 酬 等	△ 84,886,120
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	1,038,539,019
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	4,724,610,493
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 1,018,879,941
(配 当 等 相 当 額)	(12,833,067,604)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△13,851,947,545)
(H) 計 (E+F+G)	4,744,269,571
次 期 繰 越 損 益 金(H)	4,744,269,571
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 1,018,879,941
(配 当 等 相 当 額)	(12,833,067,604)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△13,851,947,545)
分 配 準 備 積 立 金	6,522,364,606
繰 越 損 益 金	△ 759,215,094

*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)	197,790,425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	12,833,067,604
(D) 分 配 準 備 積 立 金	6,324,574,181
分 配 可 能 額 (A+B+C+D)	19,355,432,210
(1 万 口 当 り 分 配 可 能 額)	(9,178.09)
収 益 分 配 金	0
(1 万 口 当 り 収 益 分 配 金)	(0)

お知らせ

大和住銀投信投資顧問株式会社は、2019年4月1日に三井住友アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友DSアセットマネジメント株式会社となりました。

委託会社の合併に伴い、ファンドの委託者の商号ならびに公告の方法を変更することに伴う所要の約款変更を行いました。(2019年4月1日付)

※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。