

■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／特殊型
信託期間	無期限（設定日：1999年7月28日）
運用方針	日本の取引所上場株式を中心に投資しつつ、日本において行われる株券オプション取引、株価指数先物取引および株価指数オプション取引等を活用して、信託財産の中・長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本の取引所上場株式
当ファンドの運用方法	<p>■日本の取引所上場株式のなかから、日本の株式市場の動きをアウトパフォームしていくとみられる銘柄に投資します。</p> <p>■組入候補銘柄の選定にあたっては以下の観点を重視します。</p> <ul style="list-style-type: none"><li>・収益力、成長力、財務内容などからみて投資価値が高い。</li><li>・リストラ効果等により収益の回復が期待できる。</li><li>・株価水準等から割安と判断される。</li></ul> <p>■現物株式の運用は中・長期的にTOPIX（東証株価指数）を上回る運用成果を目指します。</p> <p>■日本において行われる株券オプション取引、株価指数先物取引および株価指数オプション取引等を積極的に活用し、収益の獲得につとめます。</p> <p>■実質組入比率は、現物株式の組入れのほか株券オプション取引、株価指数先物取引および株価指数オプション取引等を活用することにより、上限を信託財産の純資産総額の200%までとして局面に応じて機動的に変更します。</p>
組入制限	<p>■株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>■外貨建資産への投資は行いません。</p>
分配方針	<p>■年2回（原則として毎年1月および7月の27日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配を行います。</p> <p>■分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>■分配金額は、委託会社が基準価額水準・市況動向などを勘案して決定します。</p> <p>※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。</p>

# 三井住友・スーパー アクティブ・オープン

【愛称：元気!】

【運用報告書(全体版)】

(2020年1月28日から2020年7月27日まで)

第 **42** 期

決算日 2020年7月27日

## 受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドは日本の取引所上場株式を中心に投資しつつ、日本において行われる株券オプション取引、株価指数先物取引および株価指数オプション取引等を活用して、信託財産の中・長期的な成長を目指して運用を行います。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

## 三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

<https://www.smd-am.co.jp>

■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。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976  
受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(参考指数) TOPIX (東証株価指数)		株式組入率	株式先物率 (買建-売建)	純資産額
	(分配落)	込 税 分 配 金	中 期 騰 落 率	中 期 騰 落 率	騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
38期 (2018年7月27日)	6,077	0	△12.2	1,775.76	△5.6	85.2	88.5	1,282
39期 (2019年1月28日)	4,846	0	△20.3	1,555.51	△12.4	86.7	85.8	1,106
40期 (2019年7月29日)	5,229	0	7.9	1,568.57	0.8	84.5	88.1	1,137
41期 (2020年1月27日)	5,861	0	12.1	1,702.57	8.5	86.4	95.3	1,001
42期 (2020年7月27日)	5,174	0	△11.7	1,576.69	△7.4	85.0	87.8	863

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※TOPIX（東証株価指数）の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額		(参考指数) TOPIX (東証株価指数)		株式組入率	株式先物率 (買建-売建)
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2020年1月27日	円	%		%	%	%
1月末	5,861	—	1,702.57	—	86.4	95.3
2月末	5,645	△3.7	1,684.44	△1.1	84.8	96.6
3月末	4,500	△23.2	1,510.87	△11.3	88.6	96.9
4月末	3,920	△33.1	1,403.04	△17.6	78.4	95.1
5月末	4,370	△25.4	1,464.03	△14.0	80.9	81.3
6月末	4,865	△17.0	1,563.67	△8.2	82.0	82.1
7月末	5,010	△14.5	1,558.77	△8.4	86.2	87.8
(期末) 2020年7月27日	5,174	△11.7	1,576.69	△7.4	85.0	87.8

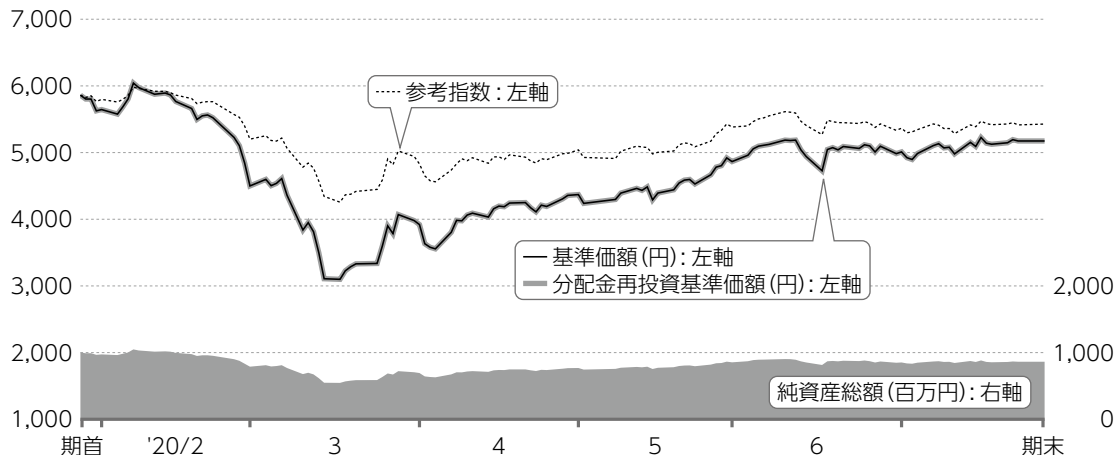
※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

# 1 運用経過

基準価額等の推移について(2020年1月28日から2020年7月27日まで)

## 基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額および参考指数は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	5,861円
期末	5,174円 (分配金0円(税引前)込み)
騰落率	-11.7% (分配金再投資ベース)

## 分配金再投資基準価額について

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と仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さま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などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドの参考指数は、TOPIX(東証株価指数)です。

※TOPIX(東証株価指数)の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

**基準価額の主な変動要因(2020年1月28日から2020年7月27日まで)**

当ファンドは、日本の取引所上場株式のなかから、株式市場の動きをアウトパフォームしていくとみられる銘柄に投資しつつ、株価指数先物取引を活用して、収益の獲得につとめました。

**上昇要因**

- メディアドゥ、神戸物産、GMOペイメントゲートウェイなどの株価が上昇したこと

**下落要因**

- 新型コロナウイルスの感染拡大を受け、国内株式市場が下落したこと
- TOPIX先物を買建て、実質株式組入比率を100%超で推移させたこと
- ディップ、インソース、ヒビノなどの株価が下落したこと

投資環境について(2020年1月28日から2020年7月27日まで)

国内株式市場は下落しました。

### 国内株式市場

期初より、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて世界景気および企業業績の先行きを警戒する見方が強まったことなどから、3月中旬にかけて株式市場は大幅に下落しました。3月下旬は、日銀の金融緩和強化発表を受けたETF(上場投資信託)買入れ観測による需給改善期待や、米

国の大規模な経済対策への期待などから、反発しました。その後は、各国の金融経済対策や経済活動再開への期待感からじり高となったものの、感染拡大が上値を抑える展開となり、6月中旬から期末にかけてはレンジ内での値動きとなりました。

当期の市場の動きをTOPIXで見ると、期首に比べて7.4%下落しました。

ポートフォリオについて(2020年1月28日から2020年7月27日まで)

### 株式組入比率

株価指数先物取引を含めた実質組入比率を概ね160-190%程度で推移させました。

### 業種配分

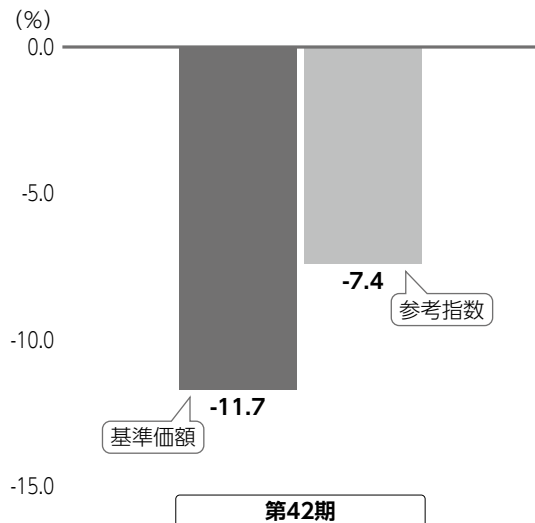
サービス業の比率を引き下げるとともに、情報・通信業、電気機器、機械などの比率を引き上げました。

### 個別銘柄

ディップ、ヒビノ、信和などを売却する一方で、前田工織、日本ケミコン、マキタなどを新規で組み入れました。

ベンチマークとの差異について(2020年1月28日から2020年7月27日まで)

基準価額と参考指数の対比(騰落率)



当ファンドは運用の指標となるベンチマークはありませんが、参考指数としてTOPIX(東証株価指数)を設けています。

左のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

※基準価額は分配金再投資ベース

分配金について(2020年1月28日から2020年7月27日まで)

(単位：円、1万円当たり、税引前)

項目	第42期
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	2,696

当期の分配は、基準価額水準等を勘案し、見送りいたしました。

なお、収益分配に充てなかった留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

※「対基準価額比率」は、「当期分配金」(税引前)の期末基準価額(分配金(税引前)込み)に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

## 2 今後の運用方針

国内株式市場は方向感の出にくい展開が続くことが想定されます。米中対立が再び激化しつつあるほか、新型コロナウイルスの感染拡大状況やワクチン開発を巡る報道などによって値動きが荒くなる可能性には留意が必要です。個別銘柄では4－6月期の決算発表を踏まえ、業績の行方を見極める動きが強まると思われます。

このような状況下、当ファンドではデリバティブ(先物などの派生商品)を活用し、実質株式組入比率の機動的な変更を行うことで株式市場の変動に対応しつつ、積極的な運用で、より高いパフォーマンスを目指します。

(2020年7月28日現在)

## 3 お知らせ

### 約款変更について

該当事項はございません。

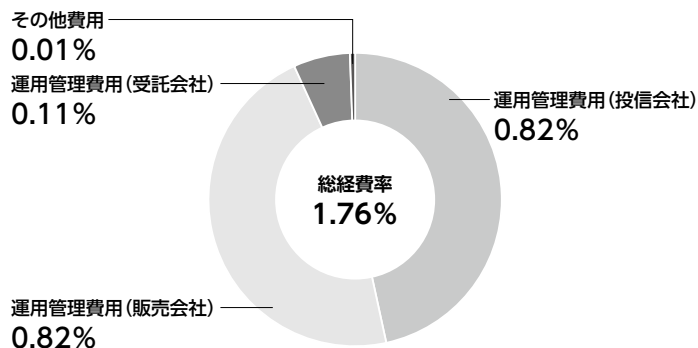
■ 1万口当たりの費用明細 (2020年1月28日から2020年7月27日まで)

項 目	金 額	比 率	項 目 の 概 要
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	41円 (19) (19) ( 3)	0.875% (0.410) (0.410) (0.055)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数) 投信会社：ファンド運用の指図等の対価 販売会社：交付運用報告書等各種資料の送付、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：ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	7 ( 5) ( 1)	0.144 (0.115) (0.029)	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：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 (監 査 費 用) (そ の 他)	0 ( 0) ( 0)	0.006 (0.003) (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：監査法人に支払うファンドの監査費用 そ の 他：信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	48	1.025	

期中の平均基準価額は4,718円です。

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。  
※比率欄は1万口当た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。  
※各項目毎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、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。  
※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、「1万口当たりの費用明細」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（年率換算）は1.76%です。



## ■ 当期中の売買及び取引の状況 (2020年1月28日から2020年7月27日まで)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 249 ( 1 )	千円 581,559 ( - )	千株 371	千円 676,576

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※( ) 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。

## ■ 派生商品の取引状況等 (2020年1月28日から2020年7月27日まで)

先物取引の銘柄別取引・残高状況

銘 柄 別			買 建		売 建		当 期 末 評 価 額		
			新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額	買 建 額	売 建 額	評価損益
国 内	株式先物取引	T O P I X	百万円 1,563	百万円 1,678	百万円 -	百万円 -	百万円 757	百万円 -	百万円 △21

※金額は受渡し代金。

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

## ■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2020年1月28日から2020年7月27日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	1,258,136千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	687,475千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	1.83

※単位未満は切捨て。

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

※外貨建資産については、(a)は各月末（ただし、決算日の属する月については決算日）の日本の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計、(b)は各月末の同仲値で換算した邦貨金額合計の平均です。

## ■ 利害関係人との取引状況等 (2020年1月28日から2020年7月27日まで)

(1) 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	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
株 式	百万円 581	百万円 80	% 13.8	百万円 676	百万円 121	% 17.9

(2) 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
(a) 売 買 委 託 手 数 料 総 額	1,184千円
(b) う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額	156千円
(c) (b) / (a)	13.2%

利害関係人とは、投資信託およ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、SMB C日興証券株式会社です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況  
(2020年1月28日から2020年7月27日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細 (2020年7月27日現在)

(1) 国内株式

銘 柄	期首(前期末)		期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
鉱業 ( - % )				
国際石油開発帝石	20.4	—	—	—
建設業 (0.7%)				
コムシスホールディングス	—	1.7	5,499	—
不動テトラ	2.4	—	—	—
関電工	36.6	—	—	—
食料品 (2.1%)				
森永乳業	—	1.2	5,802	—
東洋水産	—	1.5	9,495	—
パルプ・紙 (1.6%)				
王子ホールディングス	18.7	—	—	—
レンゴー	—	13.7	11,412	—
化学 (3.7%)				
信越化学工業	2	2	27,050	—
富士フイルムホールディングス	3.3	—	—	—
石油・石炭製品 ( - % )				
出光興産	3.1	—	—	—
ガラス・土石製品 ( - % )				
日本特殊陶業	8.9	—	—	—
鉄鋼 (1.4%)				
日本製鉄	—	10.7	10,544	—
金属製品 (0.5%)				
SUMCO	—	2	3,338	—
信和	36.2	—	—	—
機械 (13.9%)				
オーエスジー	—	4.1	6,642	—
ディスコ	0.2	0.4	10,724	—
フリュー	—	4.5	4,387	—
オカダアイオン	11.4	—	—	—
ダイキン工業	0.5	1.6	30,984	—

銘 柄	期首(前期末)		期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
ダイフク	3.4	2.5	24,900	—
マックス	5	0.9	1,395	—
マキタ	—	5.5	22,660	—
電気機器 (15.7%)				
日立製作所	1.4	0.3	1,002	—
日本電産	1.4	0.6	5,037	—
日本電気	—	2.2	13,046	—
富士通	—	0.7	9,807	—
エレコム	1.5	2.3	12,512	—
アンリツ	9.4	9	22,131	—
ローム	0.3	—	—	—
村田製作所	4.8	4.2	28,190	—
日本ケミコン	—	12.2	23,070	—
東京エレクトロン	0.4	—	—	—
輸送用機器 (1.0%)				
トヨタ自動車	1.5	1.1	7,410	—
精密機器 ( - % )				
タムロン	4.2	—	—	—
その他製品 (6.5%)				
ブシロード	—	3.1	8,735	—
前田工織	—	9.8	24,980	—
任天堂	0.5	0.3	14,250	—
電気・ガス業 (0.1%)				
メタウォーター	2.4	0.2	936	—
陸運業 (1.0%)				
ヤマトホールディングス	—	2.6	7,111	—
海運業 (2.3%)				
商船三井	—	9	16,839	—
情報・通信業 (16.8%)				
グリー	4.3	1.8	815	—
エムアップホールディングス	—	1.1	2,565	—

## 三井住友・スーパーアクティブ・オープン【愛称：元気！】

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
メディアドゥ	1.6	4.9	26,460	
GMOペイメントゲートウェイ	1.1	0.1	1,119	
テラスカイ	—	1	4,860	
UUUM	0.3	—	—	
野村総合研究所	5.2	3.2	8,972	
メルカリ	—	4.2	18,375	
Amazilia	0.1	0.8	3,164	
ギフトイ	—	1.7	3,461	
オービック	0.6	0.3	5,718	
日本ユニシス	2.5	2.7	9,058	
ビジョン	9.8	—	—	
USEN-NEXT HOLDINGS	—	15	19,695	
光通信	—	0.8	18,608	
ファイバーゲート	18.8	—	—	
福井コンピュータホールディングス	0.3	—	—	
<b>卸売業 (12.0%)</b>				
神戸物産	1.6	5.4	35,964	
第一興商	3.2	—	—	
伊藤忠商事	6.2	4.6	10,906	
三井物産	10	10	16,455	
三菱商事	5	5	11,265	
岩谷産業	6.7	3.6	13,698	
<b>小売業 (4.2%)</b>				
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	9.6	6.7	15,959	
ワークマン	3	1.5	14,925	
<b>銀行業 (2.3%)</b>				
三菱UFJフィナンシャル・グループ	20	20	8,316	
みずほフィナンシャルグループ	61.5	61.5	8,585	
<b>保険業 (0.3%)</b>				
第一生命ホールディングス	5.7	1.7	2,226	
<b>その他金融業 (0.8%)</b>				
オリックス	10.2	—	—	
イー・ギャランティ	—	2.3	6,067	

銘柄	期首(前期末)		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
<b>不動産業 (0.2%)</b>				
三井不動産	2.2	0.7	1,269	
カチタス	1.2	—	—	
<b>サービス業 (12.9%)</b>				
日本M&Aセンター	8.4	3.6	17,568	
タケエイ	12.7	24.2	25,966	
総合警備保障	0.4	—	—	
ディップ	9	—	—	
ヒビノ	8.2	—	—	
サイバーエージェント	1.7	1.8	10,368	
インソース	5.7	0.9	2,261	
ユービーアール	9	5.6	21,924	
乃村工藝社	7.4	—	—	
日本管財	2.9	8.3	16,707	
<b>合計</b>	<b>株数・金額</b>	<b>株数・金額</b>	<b>株数・金額</b>	<b>株数・金額</b>
	436	314	733,198	733,198
	<b>銘柄数&lt;比率&gt;</b>	<b>銘柄数&lt;比率&gt;</b>	<b>銘柄数&lt;比率&gt;</b>	<b>銘柄数&lt;比率&gt;</b>
	60	60	<85.0%>	<85.0%>

※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。

※< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※評価額の単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※—印は組入れなし。

### (2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
株式先物取引	757	—
TOPIX		

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

※—印は組入れなし。

## ■ 投資信託財産の構成

(2020年7月27日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
株式	千円	%
株	733,198	80.9
コール・ローン等、その他	173,473	19.1
投資信託財産総額	906,671	100.0

※単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

## ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年7月27日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	973,831,723円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	134,213,183
株 式 (評 価 額)	733,198,850
未 収 入 金	14,221,840
未 収 配 当 金	265,850
差 入 委 託 証 拠 金	91,932,000
(B) 負 債	110,797,478
未 払 金	35,856,099
未 払 解 約 金	631,506
未 払 信 託 報 酬	7,123,707
未 払 利 息	353
差入委託証拠金代用有価証券	67,160,000
そ の 他 未 払 費 用	25,813
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	863,034,245
元 本	1,668,079,969
次 期 繰 越 損 益 金	△ 805,045,724
(D) 受 益 権 総 口 数	1,668,079,969口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	5,174円

※当期における期首元本額1,708,497,034円、期中追加設定元本額148,358,616円、期中一部解約元本額188,775,681円です。

※代用として、担保に供している資産は、株式65,878,000円です。(受渡ベース)

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

## ■ 分配金のお知らせ

1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	当 期
	- 円

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

## ■ 損益の状況

(自2020年1月28日 至2020年7月27日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	7,528,153円
受 取 配 当 金	7,568,431
受 取 利 息	△ 4
そ の 他 収 益 金	209
支 払 利 息	△ 40,483
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 28,691,819
売 買 益	127,193,853
売 買 損	△ 155,885,672
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△ 73,146,192
取 引 益	109,877,123
取 引 損	△ 183,023,315
(D) 信 託 報 酬 等	△ 7,171,760
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	△ 101,481,618
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	94,731,336
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 798,295,442
(配 当 等 相 当 額)	( 271,305,362)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,069,600,804)
(H) 計 (E + F + G)	△ 805,045,724
(I) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (H + I)	△ 805,045,724
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 798,295,442
(配 当 等 相 当 額)	( 271,305,362)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,069,600,804)
分 配 準 備 積 立 金	178,438,668
繰 越 損 益 金	△ 185,188,950

※有価証券売買損益および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。

※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。

※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。

※期末における、費用控除後の配当等収益(356,393円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(271,305,362円)および分配準備積立金(178,082,275円)より分配可能額は449,744,030円(1万口当たり2,696円)ですが、分配は行っておりません。