

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46期

決算日 2020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2020年9月14日に第46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
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)



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>

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42期 (2018年9月14日)	円 12,655	円 0	% 7.2	円 23,094.67	% 6.0	% 84.3	% 15.4	百万円 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
第45期 (2020年3月16日)	9,566	0	△21.9	17,002.04	△22.7	86.9	12.7	19,561
第46期 (2020年9月14日)	13,352	0	39.6	23,559.30	38.6	84.8	14.9	24,770

*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) 2020年3月16日	円 9,566	% —	円 17,002.04	% —	% 86.9	% 12.7
3月末	10,741	12.3	18,917.01	11.3	85.4	14.4
4月末	11,448	19.7	20,193.69	18.8	87.2	12.7
5月末	12,395	29.6	21,877.89	28.7	88.3	11.6
6月末	12,641	32.1	22,288.14	31.1	90.1	9.1
7月末	12,315	28.7	21,710.00	27.7	82.8	16.6
8月末	13,119	37.1	23,139.76	36.1	84.9	14.5
(期末) 2020年9月14日	13,352	39.6	23,559.30	38.6	84.8	14.9

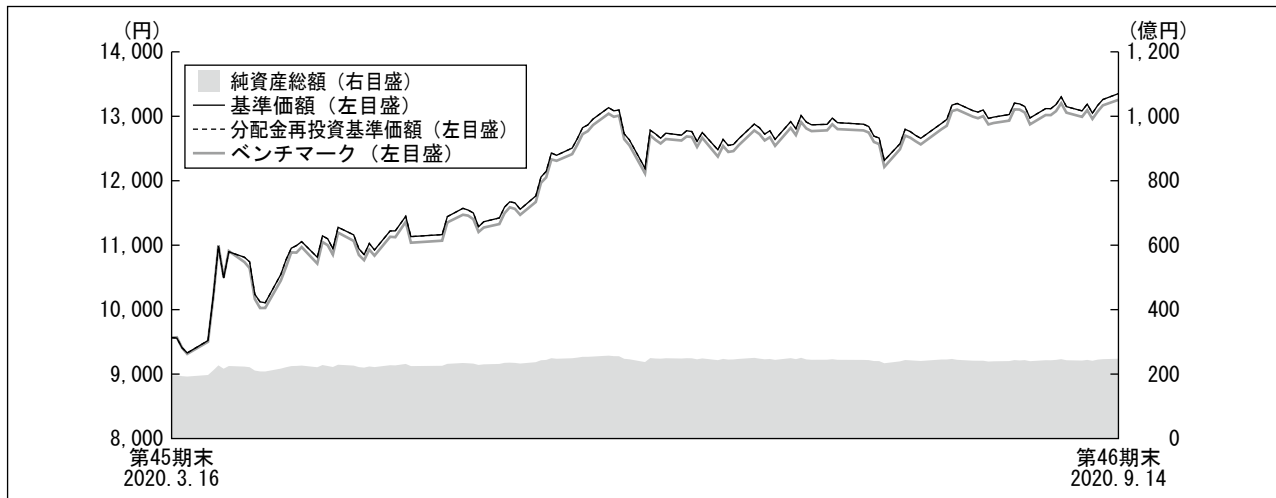
*騰落率は期首比です。

*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、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46期首： 9,566円

第46期末： 13,352円（既払分配金 0円）

騰落率： +39.6%（分配金再投資ベース）

【基準価額の主な変動要因】

（上昇要因）

エムスリー、Zホールディングス、ヤマトホールディングス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。

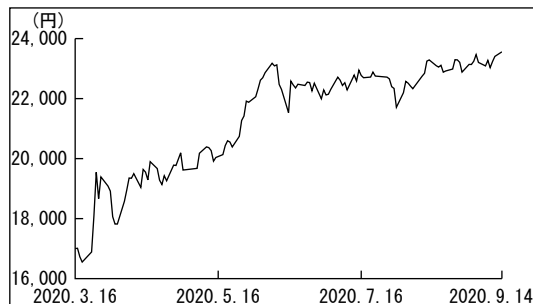
（下落要因）

ニコン、キヤノン、コニカミノルタ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、大きく上昇しました。新型コロナウイルスの感染拡大を受けて大幅下落となっていた国内株式市場は、3月下旬にかけて日本銀行によるETF（上場投資信託）購入額の大幅増やFRB（米連邦準備制度理事会）による無制限の量的緩和表明、米経済対策に対する期待感から反発しました。4月後半にかけては欧米で段階的な経済活動再開の動きも報道され、海外株式市場の上昇とともに、国内株式市場も戻り歩調となりました。5月以降も経済活動の再開への期待、新薬やワクチン開発の報道などで、株式市場は世界的に上昇の流れとなり、日本の追加景気対策や緊急事態宣言の解除などが好感され、国内株式市場も上昇しました。6月以降は一進一退の動きとなり、期末を迎えました。

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。

組入上位業種

（2020年9月14日現在）

	業種名	比率
1	電気機器	16.4%
2	小売業	11.0%
3	情報・通信業	9.6%
4	医薬品	7.7%
5	化学	6.8%
6	サービス業	5.7%
7	機械	4.3%
8	輸送用機器	3.5%
9	精密機器	3.5%
10	食料品	3.1%

*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】

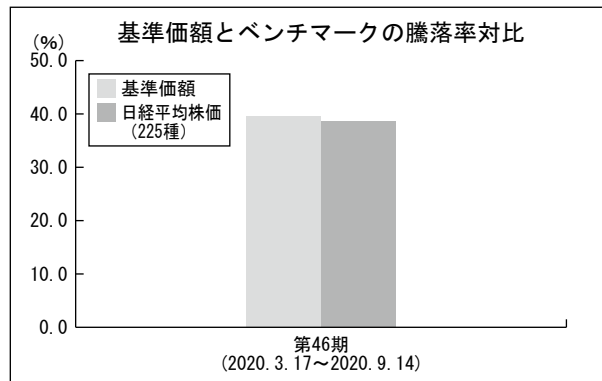
基準価額（分配金再投資ベース）の騰落率は+39.6%となり、ベンチマークである日経平均株価（225種）の騰落率+38.6%を1.0%上回りました。

（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

（1万口当り・税引前）

項目	第46期	
	2020年3月17日 ～2020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)	10,080	

※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

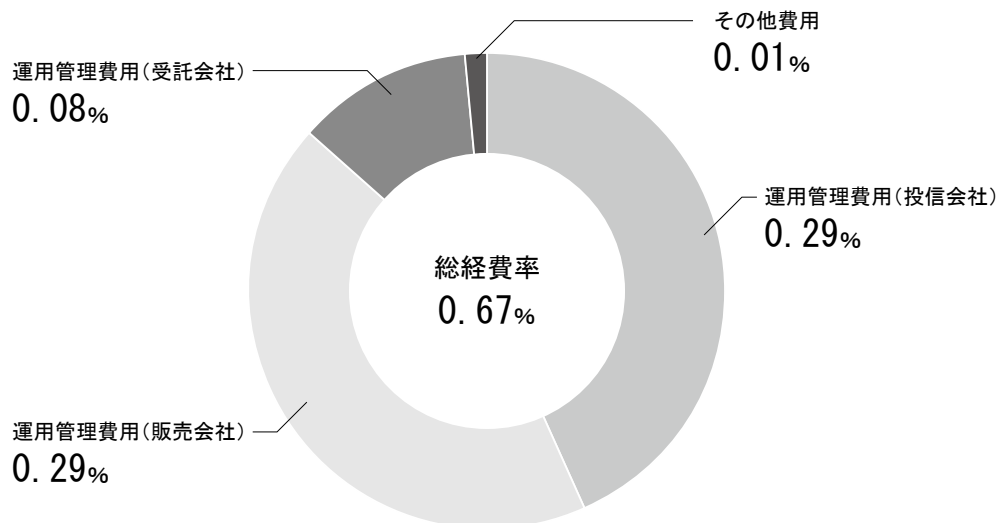
項目	当期		項目の概要
	2020年3月17日～2020年9月14日		
	金額	比率	
信託報酬	40円	0.329%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は12,110円です。
(投信会社)	(18)	(0.145)	ファンドの運用等の対価
(販売会社)	(18)	(0.145)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(5)	(0.038)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0.010	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
(株式)	(0)	(0.000)	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)	(0.010)	
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	42	0.343	

* 「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0.67%です。

売買及び取引の状況

（2020年3月17日から2020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	千円	株	千円
		32,000 (72,000)	88,032 (-)	732,600	2,528,627

*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	
	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 9,257	百万円 9,079	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 (2020年3月17日から2020年9月14日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	2,616,659千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	20,531,295千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.12

* (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

(2020年3月17日から2020年9月14日まで)

■株 式

当 付				期 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
日本取引所グループ	千株 32	千円 88,032	円 2,751	ファーストリテイリング	千株 4	千円 233,954	円 58,488
				ソフトバンクグループ	24	149,324	6,221
				東京エレクトロン	4	116,514	29,128
				ファナック	4	82,244	20,561
				KDDI	24	80,328	3,347
				ダイキン工業	4	78,403	19,600
				テルモ	16	65,491	4,093
				中外製薬	12	61,662	5,138
				アドバンテスト	8	53,055	6,631
				信越化学工業	4	51,515	12,878

*金額は受渡し代金

利害関係人との取引状況等

(2020年3月17日から2020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。

■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 1	百万円 9

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

2020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	36	32	15,328	
マルハニチロ	3.6	3.2	7,952	
鉱業 (0.0%)				
国際石油開発帝石	14.4	12.8	8,124	
建設業 (2.0%)				
コムシスホールディングス	36	32	97,600	
大成建設	7.2	6.4	24,256	
大林組	36	32	33,216	
清水建設	36	32	26,784	
長谷工コーポレーション	7.2	6.4	9,644	
鹿島建設	18	16	21,392	
大和ハウス工業	36	32	96,320	
積水ハウス	36	32	65,136	
日揮ホールディングス	36	32	36,544	
食料品 (3.7%)				
日清製粉グループ本社	36	32	54,112	
明治ホールディングス	7.2	6.4	51,968	
日本ハム	18	16	74,720	
サッポロホールディングス	7.2	6.4	12,627	
アサヒグループホールディングス	36	32	124,640	
キリンホールディングス	36	32	64,944	
宝ホールディングス	36	32	35,168	
キッコーマン	36	32	185,280	
味の素	36	32	64,048	
ニチレイ	18	16	44,288	
日本たばこ産業	36	32	63,808	
繊維製品 (0.2%)				
東洋紡	3.6	3.2	5,174	
ユニチカ	3.6	3.2	1,238	
帝人	7.2	6.4	11,014	
東レ	36	32	16,387	
パルプ・紙 (0.1%)				
王子ホールディングス	36	32	16,448	
日本製紙	3.6	3.2	4,358	
化学 (8.1%)				
クラレ	36	32	36,768	
旭化成	36	32	30,806	
昭和電工	3.6	3.2	6,614	
住友化学	36	32	12,288	
日産化学	36	32	176,960	
東ソー	18	16	28,816	
トクヤマ	7.2	6.4	17,804	
デンカ	7.2	6.4	20,736	
信越化学工業	36	32	454,400	
三井化学	7.2	6.4	17,638	
三菱ケミカルホールディングス	18	16	10,896	
宇部興産	3.6	3.2	6,281	

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
日本化薬	36	32	32,064	
花王	36	32	262,080	
D I C	3.6	3.2	8,934	
富士フイルムホールディングス	36	32	162,176	
資生堂	36	32	195,392	
日東電工	36	32	213,440	
医薬品 (9.1%)				
協和キリン	36	32	90,816	
武田薬品工業	36	32	125,504	
アステラス製薬	180	160	261,120	
大日本住友製薬	36	32	44,448	
塩野義製薬	36	32	185,312	
中外製薬	36	96	452,352	
エーザイ	36	32	296,576	
第一三共	36	32	314,432	
大塚ホールディングス	36	32	146,752	
石油・石炭製品 (0.2%)				
出光興産	14.4	12.8	30,924	
E N E O Sホールディングス	36	32	13,110	
ゴム製品 (0.7%)				
横浜ゴム	18	16	27,440	
ブリヂストン	36	32	114,080	
ガラス・土石製品 (1.1%)				
A G C	7.2	6.4	20,736	
日本板硝子	3.6	3.2	1,430	
日本電気硝子	10.8	9.6	20,601	
住友大阪セメント	3.6	3.2	11,536	
太平洋セメント	3.6	3.2	9,270	
東海カーボン	36	32	34,592	
T O T O	18	16	78,400	
日本碍子	36	32	51,168	
鉄鋼 (0.1%)				
日本製鉄	3.6	3.2	3,753	
神戸製鋼所	3.6	3.2	1,414	
ジェイ エフ イー ホールディングス	3.6	3.2	2,809	
大太平洋金属	3.6	3.2	5,856	
非鉄金属 (0.8%)				
日本軽金属ホールディングス	36	32	6,112	
三井金属鉱業	3.6	3.2	8,841	
東邦亜鉛	3.6	3.2	6,745	
三菱マテリアル	3.6	3.2	7,468	
住友金属鉱山	18	16	58,384	
D O W Aホールディングス	7.2	6.4	22,048	
古河電気工業	3.6	3.2	8,435	
住友電気工業	36	32	42,016	
フジクラ	36	32	10,336	
金属製品 (0.2%)				
S U M C O	3.6	3.2	4,633	

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	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
東洋製織グループホールディングス	36	32	38,080	
機械 (5.1%)				
日本製鋼所	7.2	6.4	10,425	
オークマ	7.2	6.4	34,944	
アマダ	36	32	33,760	
小松製作所	36	32	77,504	
住友重機械工業	7.2	6.4	16,659	
日立建機	36	32	120,160	
クボタ	36	32	60,352	
荏原製作所	7.2	6.4	18,560	
ダイキン工業	36	32	620,320	
日本精工	36	32	29,536	
N T N	36	32	7,488	
ジェイテクト	36	32	30,688	
日立造船	7.2	6.4	2,835	
三菱重工業	3.6	3.2	8,462	
I H I	3.6	3.2	5,251	
電気機器 (19.3%)				
日清紡ホールディングス	36	32	24,864	
コニカミノルタ	36	32	10,688	
ミネベアミツミ	36	32	67,552	
日立製作所	7.2	6.4	24,083	
三菱電機	36	32	48,208	
富士電機	7.2	6.4	22,560	
安川電機	36	32	127,360	
オムロン	36	32	261,760	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7.2	6.4	12,038	
日本電気	3.6	3.2	17,856	
富士通	3.6	3.2	43,088	
沖電気工業	3.6	3.2	3,440	
セイコーエプソン	72	64	86,720	
パナソニック	36	32	31,811	
ソニー	36	32	264,224	
T D K	36	32	377,920	
アルプスアルパイン	36	32	53,888	
横河電機	36	32	57,632	
アドバンテスト	72	64	323,840	
カシオ計算機	36	32	57,568	
ファナック	36	32	671,840	
京セラ	72	64	405,568	
太陽誘電	36	32	101,280	
S C R E E Nホールディングス	7.2	6.4	35,264	
キヤノン	54	48	87,840	
リコー	36	32	24,096	
東京エレクトロン	36	32	817,440	
輸送用機器 (4.2%)				
デンソー	36	32	146,080	
三井E&Sホールディングス	3.6	3.2	1,382	
川崎重工業	3.6	3.2	5,148	
日産自動車	36	32	13,129	
いすゞ自動車	18	16	16,816	
トヨタ自動車	36	32	225,504	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
日野自動車	36	32	23,776	
三菱自動車工業	3.6	3.2	851	
マツダ	7.2	6.4	4,422	
本田技研工業	72	64	172,256	
スズキ	36	32	141,696	
S U B A R U	36	32	71,920	
ヤマハ発動機	36	32	55,776	
精密機器 (4.2%)				
テルモ	144	128	562,432	
ニコン	36	32	24,992	
オリンパス	144	128	274,944	
シチズン時計	36	32	10,816	
その他製品 (2.1%)				
バンダイナムコホールディングス	36	32	224,000	
凸版印刷	18	16	25,056	
大日本印刷	18	16	35,248	
ヤマハ	36	32	166,720	
電気・ガス業 (0.2%)				
東京電力ホールディングス	3.6	3.2	1,008	
中部電力	3.6	3.2	4,352	
関西電力	3.6	3.2	3,457	
東京瓦斯	7.2	6.4	15,340	
大阪瓦斯	7.2	6.4	13,388	
陸運業 (1.8%)				
東武鉄道	7.2	6.4	22,176	
東急	18	16	24,048	
小田急電鉄	18	16	43,024	
京王電鉄	7.2	6.4	42,880	
京成電鉄	18	16	51,200	
東日本旅客鉄道	3.6	3.2	22,947	
西日本旅客鉄道	3.6	3.2	19,020	
東海旅客鉄道	3.6	3.2	54,816	
日本通運	3.6	3.2	20,384	
ヤマトホールディングス	36	32	82,848	
海運業 (0.1%)				
日本郵船	3.6	3.2	5,939	
商船三井	3.6	3.2	7,187	
川崎汽船	3.6	3.2	4,003	
空運業 (0.0%)				
A N Aホールディングス	3.6	3.2	9,150	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
三菱倉庫	18	16	50,320	
情報・通信業 (11.3%)				
Zホールディングス	14.4	12.8	8,448	
トレンドマイクロ	36	32	203,520	
スカパーJ S A Tホールディングス	3.6	3.2	1,459	
日本電信電話	14.4	12.8	29,574	
K D D I	216	192	543,744	
N T T ドコモ	3.6	3.2	8,833	
東宝	3.6	3.2	13,632	
エヌ・ティ・ティ・データ	180	160	199,520	
コナミホールディングス	36	32	143,200	

エス・ビー・日本株オープン225

銘柄	当 期 末		
	期首(前期末) 株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソフトバンクグループ	216	192	1,225,920
卸売業 (1.9%)			
双日	3.6	3.2	800
伊藤忠商事	36	32	88,256
丸紅	36	32	21,184
豊田通商	36	32	103,360
三井物産	36	32	61,760
住友商事	36	32	43,056
三菱商事	36	32	82,224
小売業 (13.0%)			
J. フロント リテイリング	18	16	12,416
三越伊勢丹ホールディングス	36	32	19,040
セブン&アイ・ホールディングス	36	32	110,208
ファミリーマート	144	128	301,824
高島屋	18	16	14,192
丸井グループ	36	32	64,256
イオン	36	32	87,328
ファーストリテイリング	36	32	2,114,880
銀行業 (0.6%)			
コンソルディア・フィナンシャルグループ	36	32	12,640
新生銀行	3.6	3.2	4,688
あおぞら銀行	3.6	3.2	6,019
三菱UFJフィナンシャル・グループ	36	32	14,294
りそなホールディングス	3.6	3.2	1,260
三井住友トラスト・ホールディングス	3.6	3.2	9,932
三井住友フィナンシャルグループ	3.6	3.2	9,961
千葉銀行	36	32	19,968
ふくおかフィナンシャルグループ	7.2	6.4	12,377
静岡銀行	36	32	24,928
みずほフィナンシャルグループ	36	32	4,524
証券、商品先物取引業 (0.3%)			
大和証券グループ本社	36	32	15,145
野村ホールディングス	36	32	17,100
松井証券	36	32	31,008
保険業 (0.7%)			
SOMPOホールディングス	9	8	31,528
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	10.8	9.6	29,328
ソニーフィナンシャルホールディングス	7.2	—	—

銘柄	当 期 末			
	期首(前期末) 株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
第一生命ホールディングス	3.6	3.2	5,096	
東京海上ホールディングス	18	16	81,856	
T&Dホールディングス	7.2	6.4	7,424	
その他金融業 (0.6%)				
クレディセゾン	36	32	39,488	
日本取引所グループ	—	32	93,600	
不動産業 (1.2%)				
東急不動産ホールディングス	36	32	15,552	
三井不動産	36	32	64,672	
三菱地所	36	32	52,848	
東京建物	18	16	21,616	
住友不動産	36	32	101,696	
サービス業 (6.7%)				
エムスリー	86.4	76.8	459,264	
ディー・エヌ・エー	10.8	9.6	17,500	
電通グループ	36	32	102,720	
サイバーエージェント	7.2	6.4	35,328	
楽天	36	32	37,792	
リクルートホールディングス	108	96	412,416	
日本郵政	36	32	24,636	
セコム	36	32	320,000	
合 計	株 数、金 額	千株	千株	千円
	銘柄 数 <比率>	225銘柄	225銘柄	<84.8%>

*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 3,700	百万円 —

投資信託財産の構成

2020年9月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円	%
株	21,002,830	84.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等、そ の 他	3,939,325	15.8
投 資 信 託 財 産 総 額	24,942,156	100.0

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年9月14日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	24,913,836,276円
コール・ローン等	3,693,828,007
株 式(評価額)	21,002,830,720
未 収 入 金	62,757,549
未 収 配 当 金	12,100,000
差 入 委 託 証 拠 金	142,320,000
(B) 負 債	143,347,781
未 払 解 約 金	64,863,792
未 払 信 託 報 酬	77,694,879
そ の 他 未 払 費 用	789,110
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	24,770,488,495
元 本	18,552,416,792
次 期 繰 越 損 益 金	6,218,071,703
(D) 受 益 権 総 口 数	18,552,416,792口
1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D)	13,352円

*元本状況

期首元本額	20,448,443,419円
期中追加設定元本額	2,750,998,301円
期中一部解約元本額	4,647,024,928円

損益の状況

自2020年3月17日
至2020年9月14日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	175,225,508円
受 取 配 当 金	176,074,543
取 利 息	44,531
そ の 他 収 益 金	8,764
支 払 利 息	△ 902,330
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	5,452,257,880
売 買 益	6,446,613,037
売 買 損	△ 994,355,157
(C) 先 物 取 引 等 損 益	889,780,485
取 引 益	949,529,299
取 引 損	△ 59,748,814
(D) 信 託 報 酬 等	△ 78,483,989
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	6,438,779,884
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 884,121,724
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	663,413,543
(配 当 等 相 当 額)	(13,146,240,139)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△12,482,826,596)
(H) 計 (E+F+G)	6,218,071,703
次 期 繰 越 損 益 金(H)	6,218,071,703
追 加 信 託 差 損 益 金	663,413,543
(配 当 等 相 当 額)	(13,146,240,139)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△12,482,826,596)
分 配 準 備 積 立 金	5,554,658,160

*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)	173,114,289円
(B) 有 価 証 券 売 買 等 損 益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)	1,339,360,017
(C) 収 益 調 整 金	13,146,240,139
(D) 分 配 準 備 積 立 金	4,042,183,854
分 配 可 能 額 (A+B+C+D)	18,700,898,299
(1 万 口 当 り 分 配 可 能 額)	(10,080.03)
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。