

第15期

運用報告書(全体版)

日本新生ファンド 愛称：ライジングパワー

【2016年9月20日決算】

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。
皆様の「日本新生ファンド（愛称：ライジングパワー）」は、2016年9月20日に第15期決算を迎えましたので、期中の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。
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。

岡三アセットマネジメント

〒104-0028 東京都中央区八重洲2-8-1

お問い合わせは弊社カスタマーサービス部へ
フリーダイヤル ☎ 0120-048-214（営業日の9:00～17:00）

【ホームページ】

<http://www.okasan-am.jp>

※アクセスにかかる通信料はお客様のご負担となります。
※機種により本サービスをご利用いただけない場合があります。



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 |
| 信託期間 | 2001年9月20日から2021年9月17日までです。 |
| 運用方針 | 主として、わが国の金融商品取引所上場株式に投資し、信託財産の成長を図ることを目標に積極的な運用を行います。 投資にあたっては、構造改革を通じた経済の活性化により90年代の「停滞の10年」を抜け出し「躍動の10年」が展望される日本経済の方向性に焦点をあて、経済社会の構造改革が進展することにより新たなビジネスチャンスが生じ収益の向上が期待できる企業、構造改革が進展する中でも競争上の優位を保てると判断できる企業およびより競争力が高まると判断できる企業等の株式に投資します。 |
| 主要投資対象 | わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。 |
| 分配方針 | 毎年9月19日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、原則として、以下の方針に基づき、分配を行います。 分配対象収益の範囲は、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額は、委託会社が、基準価額水準、配当等収益等を勘案のうえ分配金額を決定します。 分配可能額が少額の場合や基準価額水準によっては、収益分配を行わないことがあります。 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 東証株価指数 (TOPIX) | | 日経平均株価 (225種) | | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|--------|----------------|---------------|----------------|---------------|---------------|---------------|------------|------------|-----------|
| | (分配落) | 税金 込み 分配 | 期中 騰落 率 | (参考指数) | 期中 騰落 率 | (参考指数) | 期中 騰落 率 | | | |
| | 円 | 円 | % | ポイント | % | 円 | % | % | % | 百万円 |
| 11期(2012年9月19日) | 5,993 | 0 | 6.3 | 764.80 | 1.3 | 9,232.21 | 5.9 | 93.8 | — | 102 |
| 12期(2013年9月19日) | 12,073 | 200 | 104.8 | 1,215.48 | 58.9 | 14,766.18 | 59.9 | 87.7 | — | 634 |
| 13期(2014年9月19日) | 13,884 | 500 | 19.1 | 1,331.91 | 9.6 | 16,321.17 | 10.5 | 86.2 | — | 248 |
| 14期(2015年9月24日) | 13,548 | 400 | 0.5 | 1,426.97 | 7.1 | 17,571.83 | 7.7 | 94.1 | — | 204 |
| 15期(2016年9月20日) | 12,511 | 200 | △ 6.2 | 1,316.97 | △ 7.7 | 16,492.15 | △ 6.1 | 91.4 | — | 176 |

(注) 基準価額および分配金(税引前)は1万口当たり、基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

(注) 東証株価指数(TOPIX)、日経平均株価(225種)は当ファンドの参考指数であり、ベンチマークではありません。

(注) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

○当期中の基準価額と市況等の推移

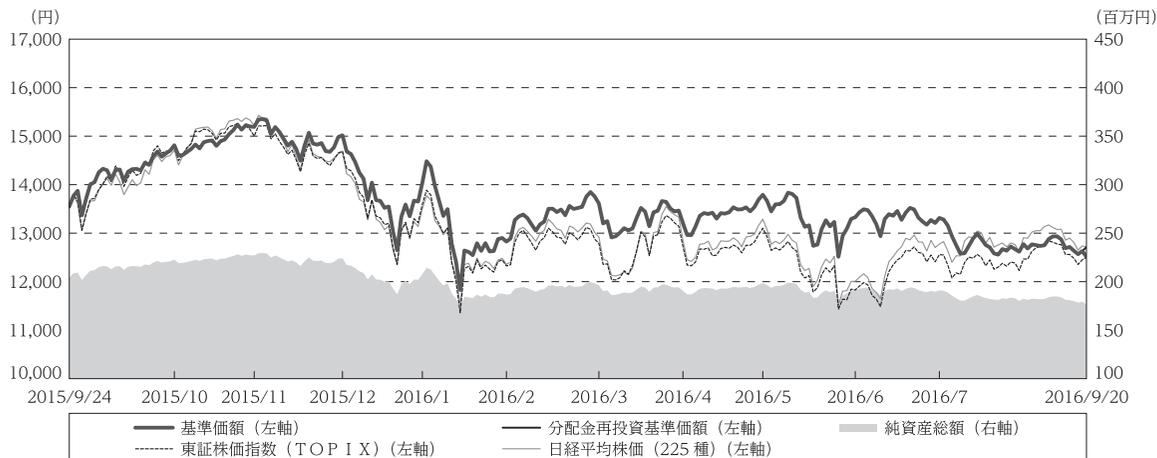
| 年月日 | 基準価額 | | 東証株価指数 (TOPIX) | | 日経平均株価 (225種) | | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 |
|------------|--------|--------|----------------|--------|---------------|--------|------------|------------|
| | 騰落率 | (参考指数) | 騰落率 | (参考指数) | 騰落率 | (参考指数) | | |
| (期首) | 円 | % | ポイント | % | 円 | % | % | % |
| 2015年9月24日 | 13,548 | — | 1,426.97 | — | 17,571.83 | — | 94.1 | — |
| 9月末 | 13,709 | 1.2 | 1,411.16 | △ 1.1 | 17,388.15 | △ 1.0 | 93.7 | — |
| 10月末 | 14,813 | 9.3 | 1,558.20 | 9.2 | 19,083.10 | 8.6 | 95.2 | — |
| 11月末 | 15,191 | 12.1 | 1,580.25 | 10.7 | 19,747.47 | 12.4 | 95.3 | — |
| 12月末 | 15,018 | 10.9 | 1,547.30 | 8.4 | 19,033.71 | 8.3 | 95.2 | — |
| 2016年1月末 | 14,038 | 3.6 | 1,432.07 | 0.4 | 17,518.30 | △ 0.3 | 95.9 | — |
| 2月末 | 12,826 | △ 5.3 | 1,297.85 | △ 9.0 | 16,026.76 | △ 8.8 | 94.0 | — |
| 3月末 | 13,612 | 0.5 | 1,347.20 | △ 5.6 | 16,758.67 | △ 4.6 | 94.4 | — |
| 4月末 | 13,205 | △ 2.5 | 1,340.55 | △ 6.1 | 16,666.05 | △ 5.2 | 92.4 | — |
| 5月末 | 13,792 | 1.8 | 1,379.80 | △ 3.3 | 17,234.98 | △ 1.9 | 94.1 | — |
| 6月末 | 13,329 | △ 1.6 | 1,245.82 | △ 12.7 | 15,575.92 | △ 11.4 | 90.4 | — |
| 7月末 | 13,314 | △ 1.7 | 1,322.74 | △ 7.3 | 16,569.27 | △ 5.7 | 94.3 | — |
| 8月末 | 12,769 | △ 5.7 | 1,329.54 | △ 6.8 | 16,887.40 | △ 3.9 | 92.3 | — |
| (期末) | | | | | | | | |
| 2016年9月20日 | 12,711 | △ 6.2 | 1,316.97 | △ 7.7 | 16,492.15 | △ 6.1 | 91.4 | — |

(注) 期末基準価額は1万口当たり分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

運用経過

期中の基準価額等の推移

（2015年9月25日～2016年9月20日）



期 首：13,548円

期 末：12,511円（既払分配金（税引前）：200円）

騰落率：△ 6.2%（分配金再投資ベース）

（注）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。

（注）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。

（注）参考指数は、東証株価指数（TOPIX）および日経平均株価（225種）です。

（注）分配金再投資基準価額および参考指数は、期首（2015年9月24日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

（注）上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドにおける主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

- ・業種配分では、食品、機械、医薬品などが基準価額にプラスに寄与しました。
- ・個別銘柄では、東京エレクトロン、ペプチドリーム、アリアケジャパンなどが基準価額にプラスに寄与しました。

（主なマイナス要因）

- ・業種配分では、輸送用機器、電気機器、小売業などが基準価額にマイナスに寄与しました。
- ・個別銘柄では、りそなホールディングス、山一電機、新明和工業などが基準価額にマイナスに寄与しました。

投資環境

（2015年9月25日～2016年9月20日）

国内株式市場は、中国経済の減速懸念が後退したことなどから、2015年11月後半にかけて上昇しました。しかし、12月の米国での利上げ決定を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり、原油価格が急落したことや為替市場において円高ドル安が進行したことなどから国内株式市場は2016年2月中旬にかけて大幅に下落しました。その後は、米国の景気回復に対する期待や英国の国民投票で欧州連合（EU）離脱賛成票が多数を占めたことによる先行き不透明感の高まり、日銀による上場投資信託（ETF）の買入れ額拡大による株式需給の改善期待など、強弱材料が交錯し一進一退の動きとなりました。

当ファンドのポートフォリオ

（2015年9月25日～2016年9月20日）

当ファンドは、経済社会の構造改革の進展において、新たなビジネスチャンスが生じ収益の向上が期待できる企業や競争上の優位性を保てると判断できる企業、およびより競争力が高まると判断できる企業等の株式に投資を行っております。

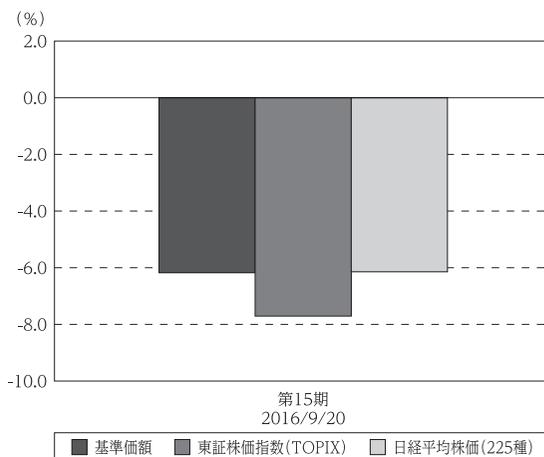
当期の運用につきましては、先端半導体の需要増加などにより半導体製造装置の受注拡大が予想される東京エレクトロン、経済成長が続くインドにおいて自動車販売の増加が見込まれるスズキ、航空機向け炭素繊維の成長が期待される東レなどの買付けを行いました。一方、マイナス金利導入により資金利益の悪化が懸念されたりそのなホールディングス、好業績が株価に織り込まれたと判断した大和ハウス工業などを全売却しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

（2015年9月25日～2016年9月20日）

当ファンドは特定のベンチマークを設けておりませんが、分配金も考慮した当ファンドの基準価額の騰落率は、参考指数としている東証株価指数（TOPIX）の騰落率を上回りましたが、日経平均株価（225種）の騰落率を下回りました。詳細につきましては前掲の「基準価額の主な変動要因」をご参照ください。

基準価額と参考指数の対比（騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

(注) 参考指数は、東証株価指数（TOPIX）、日経平均株価（225種）です。

分配金

（2015年9月25日～2016年9月20日）

当ファンドは毎年9月19日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象収益として、分配可能額、基準価額水準、配当等収益等を勘案のうえ分配金額を決定します。当期の分配につきましては、1万口当たり200円（税引前）とさせていただきます。なお、収益分配に充てなかった留保益につきましては、運用の基本方針と同一の運用を行ってまいります。

（単位：円、1万口当たり・税引前）

| 項 目 | 第15期 |
|-----------|---------------------------|
| | 2015年9月25日～ 2016年9月20日 |
| 当期分配金 | 200 |
| （対基準価額比率） | 1.573% |
| 当期の収益 | — |
| 当期の収益以外 | 200 |
| 翌期繰越分配対象額 | 5,190 |

（注）対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

国内株式市場は、緩やかに上昇すると考えております。短期的には米国の利上げに対する警戒感や為替相場の先行きに対する懸念などが残りますが、世界的な景気持ち直しや企業業績の改善期待などを背景に、国内株式市場は底堅く推移すると思われまます。また、経済成長を促す政策や日銀によるETFの買入れ額拡大なども国内株式市場を押し上げる要因になると考えます。当ファンドの運用につきましては、経済社会の構造改革が進展することにより、新たな事業機会の創出が期待される企業や製品力や営業力などを背景に、競争優位性が高まると考えられる企業などへ選別投資を行う方針です。当面は、世界的な景気持ち直しなどを背景に業績回復が期待される輸出関連銘柄として、テクノロジー関連製品の需要拡大の恩恵が見込まれる半導体関連株や新興国の景気回復の恩恵が予想される素材関連株などへ投資を行う考えです。

※文中の投資行動は、個別銘柄の売買等いかなる投資行動も推奨するものではありません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年9月25日～2016年9月20日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|----------|------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 251 | % 1.816 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (118) | (0.855) | 委託した資金の運用の対価 |
| （ 販 売 会 社 ） | (118) | (0.855) | 交付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、購入後の 情報提供等の対価 |
| （ 受 託 会 社 ） | (15) | (0.107) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 86 | 0.623 | (b) 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 ） | (86) | (0.623) | 売買委託手数料は、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 | 1 | 0.006 | (c) 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 ） | (1) | (0.005) | 監査費用は、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) | その他は、金銭信託支払手数料 |
| 合 計 | 338 | 2.445 | |
| 期中の平均基準価額は、13,801円です。 | | | |

(注) 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。

(注) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2015年9月25日～2016年9月20日）

○売買及び取引の状況とは、ファンドが購入・売却した有価証券の数量および金額です。

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---|----|-------|---------|-----|---------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国 | 上場 | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| 内 | | 243 | 379,206 | 247 | 398,985 |
| | | (0.6) | (-) | | |

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 単位未満は切捨てです。ただし、単位未満の場合は小数で記載しています。

(注) () 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。

○株式売買比率

（2015年9月25日～2016年9月20日）

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|-----------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 778,192千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 189,939千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 4.09 |

(注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

（2015年9月25日～2016年9月20日）

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 | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 株式 | 379 | 151 | 39.8 | 398 | 151 | 37.9 |

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 |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 1,258千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 491千円 |
| (B) / (A) | 39.0% |

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、当ファンドに係る利害関係人とは岡三証券です。

○組入資産の明細

(2016年9月20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 (1.6%) | | | | |
| サカタのタネ | — | 1 | — | 2,575 |
| 建設業 (2.9%) | | | | |
| 清水建設 | 4 | — | — | — |
| 前田建設工業 | — | 3 | — | 2,502 |
| 五洋建設 | — | 4 | — | 2,176 |
| 大和ハウス工業 | 2.3 | — | — | — |
| 食料品 (2.6%) | | | | |
| 米久 | 1.3 | — | — | — |
| 味の素 | 2 | — | — | — |
| アリアケジャパン | 1.2 | — | — | — |
| ニチレイ | — | 4 | — | 4,244 |
| 繊維製品 (4.8%) | | | | |
| 東レ | — | 8 | — | 7,701 |
| 化学 (14.2%) | | | | |
| クラレ | — | 2 | — | 2,846 |
| 東ソー | 13 | — | — | — |
| 信越化学工業 | — | 0.5 | — | 3,515 |
| 大陽日酸 | — | 4 | — | 4,152 |
| 三井化学 | — | 15 | — | 6,990 |
| サカタインクス | — | 2.5 | — | 2,902 |
| 小林製薬 | 0.5 | — | — | — |
| ユニ・チャーム | — | 1 | — | 2,494 |
| 医薬品 (—%) | | | | |
| 参天製薬 | 2.4 | — | — | — |
| JCRファーマ | 1.5 | — | — | — |
| ベプチドリーム | 0.8 | — | — | — |
| 非鉄金属 (2.5%) | | | | |
| DOWAホールディングス | 2 | — | — | — |
| 古河電気工業 | — | 16 | — | 4,128 |
| 機械 (4.8%) | | | | |
| SMC | — | 0.2 | — | 5,718 |
| 日立建機 | — | 1 | — | 1,979 |
| ハーモニック・ドライブ・システムズ | 1.5 | — | — | — |

| 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 |
| アマノ | 2.1 | — | — | — |
| ホシザキ | 0.6 | — | — | — |
| 電気機器 (17.1%) | | | | |
| 安川電機 | — | 3 | — | 4,479 |
| 日本電産 | 0.9 | 0.4 | — | 3,578 |
| テクノメディカ | 2.5 | — | — | — |
| セイコーエプソン | — | 2 | — | 3,800 |
| 日本信号 | 3.6 | — | — | — |
| パナソニック | 3.5 | — | — | — |
| ソニー | — | 1.2 | — | 3,984 |
| 山一電機 | 6 | — | — | — |
| 村田製作所 | 0.2 | — | — | — |
| S C R E E Nホールディングス | — | 2 | — | 2,508 |
| 東京エレクトロン | — | 1 | — | 9,174 |
| 輸送用機器 (10.7%) | | | | |
| トヨタ紡織 | — | 2 | — | 4,528 |
| 日産自動車 | 7.5 | 5 | — | 5,045 |
| 新明和工業 | 4 | — | — | — |
| マツダ | 1.1 | — | — | — |
| スズキ | — | 2.3 | — | 7,716 |
| 精密機器 (—%) | | | | |
| 島津製作所 | 2 | — | — | — |
| その他製品 (3.4%) | | | | |
| バンダイナムコホールディングス | 2 | — | — | — |
| 任天堂 | — | 0.2 | — | 5,463 |
| コクヨ | 4 | — | — | — |
| 情報・通信業 (15.3%) | | | | |
| システナ | — | 2.7 | — | 4,784 |
| ネクソン | 2.4 | — | — | — |
| ハーツユナイテッドグループ | — | 0.9 | — | 3,789 |
| デジタルガレージ | 2 | 1.8 | — | 3,312 |
| NTTドコモ | — | 1.6 | — | 4,094 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 0.8 | — | — | — |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | — | 1.1 | — | 3,531 |

日本新生ファンド（愛称：ライジングパワー）

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 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 | — | 0.8 | 5,181 |
| 卸売業 (4.9%) | | | |
| 横浜冷凍 | — | 1.9 | 1,900 |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 1.7 | — | — |
| 阪和興業 | — | 10 | 5,940 |
| 小売業 (5.3%) | | | |
| スタートトゥデイ | — | 0.6 | 2,985 |
| すかいらく | 2.5 | — | — |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 3.1 | — | — |
| トリドール | — | 1 | 2,269 |
| ドンキホーテホールディングス | 1.2 | — | — |
| スギホールディングス | 0.9 | — | — |
| ファーストリテイリング | — | 0.1 | 3,251 |
| 銀行業 (4.3%) | | | |
| りそなホールディングス | 13.1 | — | — |
| スルガ銀行 | 2.5 | 2.8 | 6,896 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 不動産業 (—%) | | | |
| ユニゾホールディングス | 0.7 | — | — |
| 三井不動産 | 2 | — | — |
| サービス業 (5.6%) | | | |
| 日本M&Aセンター | — | 0.4 | 2,400 |
| エス・エム・エス | 2.5 | — | — |
| 総合警備保障 | 1 | — | — |
| ディー・エヌ・エー | — | 0.6 | 2,292 |
| ダスキン | 2.2 | — | — |
| サイバーエージェント | — | 0.8 | 4,432 |
| 共立メンテナンス | 0.7 | — | — |
| 合 計 | 株 数・金 額 | 111 | 108 |
| | 銘柄数<比率> | 42 | 39 <91.4%> |

(注) 業種・銘柄欄の()内は、当期末の国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注) 評価額の単位未満は切捨てです。

(注) 一印は組み入れがありません。

○投資信託財産の構成

(2016年9月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 161,257 | 88.5 |
| コール・ローン等、その他 | 20,911 | 11.5 |
| 投資信託財産総額 | 182,168 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨てです。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2016年9月20日現在）

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 182,168,164 |
| コール・ローン等 | 16,403,500 |
| 株式(評価額) | 161,257,200 |
| 未収入金 | 4,337,964 |
| 未収配当金 | 169,500 |
| (B) 負債 | 5,726,524 |
| 未払収益分配金 | 2,820,567 |
| 未払解約金 | 1,192,956 |
| 未払信託報酬 | 1,707,897 |
| 未払利息 | 27 |
| その他未払費用 | 5,077 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 176,441,640 |
| 元本 | 141,028,360 |
| 次期繰越損益金 | 35,413,280 |
| (D) 受益権総口数 | 141,028,360口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,511円 |

(注) 計算期間末における1口当たり純資産額は1.2511円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は150,700,170円、期中追加設定元本額は3,194,722円、期中一部解約元本額は12,866,532円です。

○損益の状況（2015年9月25日～2016年9月20日）

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 2,866,957 |
| 受取配当金 | 2,869,322 |
| 受取利息 | 659 |
| その他収益金 | 59 |
| 支払利息 | △ 3,083 |
| (B) 有価証券売買損益 | △10,969,170 |
| 売買益 | 27,593,930 |
| 売買損 | △38,563,100 |
| (C) 信託報酬等 | △ 3,630,079 |
| (D) 当期繰越損益金(A+B+C) | △11,732,292 |
| (E) 前期繰越損益金 | 31,827,752 |
| (F) 追加信託差損益金 | 18,138,387 |
| (配当等相当額) | (44,188,535) |
| (売買損益相当額) | (△26,050,148) |
| (G) 計(D+E+F) | 38,233,847 |
| (H) 収益分配金 | △ 2,820,567 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 35,413,280 |
| 追加信託差損益金 | 18,138,387 |
| (配当等相当額) | (44,188,535) |
| (売買損益相当額) | (△26,050,148) |
| 分配準備積立金 | 29,007,185 |
| 繰越損益金 | △11,732,292 |

(注) 損益の状況の中で、(B)有価証券売買損益は期末の評価替えによるものを含みます。(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額、監査費用を含めて表示しています。(F)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。

(注) 収益分配金

| 決算期 | 第15期 |
|------------------------------|-------------|
| (a) 配当等収益(費用控除後) | 0円 |
| (b) 有価証券等損益額(費用控除後、繰越欠損金補填後) | 0円 |
| (c) 信託約款に規定する収益調整金 | 44,188,535円 |
| (d) 信託約款に規定する分配準備積立金 | 31,827,752円 |
| 分配対象収益(a+b+c+d) | 76,016,287円 |
| 分配対象収益(1万口当たり) | 5,390円 |
| 分配金額 | 2,820,567円 |
| 分配金額(1万口当たり) | 200円 |

用語解説

○資産、負債、元本及び基準価額の状況は、期末における資産、負債、元本及び基準価額の計算過程を表しています。主な項目の説明は次の通りです。

| 項目 | 説明 |
|---------------------|---|
| 資産 | ファンドが保有する財産の合計です。 |
| コール・ローン等 | 金融機関向けの安全性の高い短期貸付運用などの残高です。 |
| 各種有価証券等(評価額) | 組入れた株式・債券・ファンドなどの評価金額です。 |
| 未収入金 | 入金が予定されている有価証券の売却代金などです。 |
| 未収配当金 | 入金が予定されている株式の配当金等です。 |
| 未収利息 | 入金が予定されているコール・ローン等の利息や債券の利息の合計です。 |
| 負債 | 支払いが予定されている金額の合計です。 |
| 未払収益分配金 | 期末時点で支払いが予定されている収益分配金です。 |
| 未払解約金 | 支払いが予定されている解約金です。 |
| 未払信託報酬 | 支払いが予定されている信託報酬の額です。 |
| その他未払費用 | 支払いが予定されている監査費用、その他の費用です。 |
| 純資産総額(資産－負債) | ファンドが保有する財産の合計から支払いが予定されている金額の合計を差し引いたものです。 |
| 元本 | ファンド全体の元本残高です。 |
| 次期繰越損益金 | 純資産総額と元本の差額(翌期に繰り越す損益金の合計額)です。 |
| 受益権総口数 | 受益者が保有する受益権口数の合計です。 |
| 1(万)口当たり基準価額 | 1(万)口当たりのファンドの時価です。 |

用語解説

○損益の状況は、期中にファンドがどのような収益や損失を計上したかを表しています。主な項目の説明は次の通りです。

| 項目 | 説明 |
|-----------------|---|
| 配当等収益 | ファンドが受取った配当金・利息等の合計です。 |
| 受取配当金 | 保有する株式等の配当金等です。 |
| 受取利息 | 債券、コール・ローン等の利息等です。 |
| 有価証券売買損益 | 有価証券の売買損益と期末の評価損益の合計額です。 |
| 売買益 | 売買益と期末評価益の合計です。 |
| 売買損 | 売買損と期末評価損の合計です。 |
| 信託報酬等 | 信託報酬のほか保管費用、監査費用、その他の費用と、それに掛かる消費税等相当額です。 |
| 当期損益金 | 当期における収支合計です。 |
| 前期繰越損益金 | 前期分の分配準備積立金と繰越損益金の合計額から当期中の解約に対する持分を控除した金額です。 |
| 追加信託差損益金 | 受益者がファンドに払い込んだ金額と元本との差額です。 |
| (配当等相当額) | 配当等に相当する額です。 |
| (売買損益相当額) | 売買損益に相当する額です。 |
| 計 | 収益分配前の期中の収支の総合計です。 |
| 収益分配金 | 期中の分配可能額から受益者に支払われる分配金です。 |
| 次期繰越損益金 | 翌期に繰り越す損益金の合計です。 |
| 追加信託差損益金 | 翌期に繰り越す追加信託差損益金です。 |
| (配当等相当額) | 配当等に相当する額です。 |
| (売買損益相当額) | 売買損益に相当する額です。 |
| 分配準備積立金 | 翌期に繰り越す分配準備積立金の額です。 |
| 繰越損益金 | 翌期に繰り越す損益金の額です。 |

○分配金のお知らせ

| | |
|-----------------|------------------------------|
| 1 万口当たり分配金（税引前） | 200円 |
| 支払開始日 | 2016年9月27日（火）までの間に支払いを開始します。 |
| お支払場所 | 取得申込みを取扱った販売会社の本支店 |

〈お知らせ〉

金融商品取引業等に関する内閣府令等の改正に伴い信用リスクを適正に管理するために、投資信託約款に所要の整備を行うべく、約款の変更を行いました。（実施日：2015年12月22日）