

○当ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型
信託期間	無期限
主投資対象	我が国の金融商品取引所上場株式のうち、日経平均株価に採用された225銘柄を主要投資対象とします。
運用方針	投資成果を日経平均株価の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。 ①原則として日経平均株価採用銘柄のうち、200銘柄以上に等株数投資を行います。 ②株式の組入比率は高位を保ちます。 ③株式以外の資産への投資割合は、原則として、投資信託財産の総額の50%以下とします。 ④資金動向および市況動向等に急激な変化が生じたときおよびやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができないことがあります。
主投資制限	①株式への投資には制限を設けません。 ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④外貨建資産への投資は行いません。 ⑤同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
収益分配方針	①分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益の範囲内とします。 ②分配金額は、原則として配当等収益を中心として委託者が決定します。ただし、収益が少額の場合は分配を行わないこともあります。

■運用報告書に関しては、下記にお問い合わせください。

しんきんアセットマネジメント投信株式会社
 <コールセンター> ☎ 0120-781812
 (土日、休日を除く) 携帯電話・PHSからは03-5524-8181
 9:00~17:00

本資料は投資信託の運用状況を開示するためのものであり、ファンドの勧誘を目的とするものではありません。

運用報告書(全体版)

しんきん インデックスファンド225

決算日

(第17期：2016年1月13日)


受益者のみなさまへ

平素は格別のお引立てに預かり厚く御礼申し上げます。

さて、ご購入いただいております「しんきんインデックスファンド225」は2016年1月13日に第17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。

 しんきんアセットマネジメント投信株式会社

〒104-0031 東京都中央区京橋3丁目8番1号

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

目 次

◇しんきんインデックスファンド225	頁
最近5期の運用実績	1
当期中の基準価額と市況等の推移	1
第17期の運用経過等	2
1万口当たりの費用明細	5
売買及び取引の状況	6
株式売買比率	6
利害関係人との取引状況等	6
組入資産の明細	7
投資信託財産の構成	10
資産、負債、元本及び基準価額の状況	11
損益の状況	11
分配金のお知らせ	12

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	騰落率		日経平均株価(日経225)		株組入比率	株先物比率	純資産額
		税金込み	期中騰落	期中騰落	期中騰落			
13期(2012年1月13日)	円 5,933	円 0	% △18.9	円 8,500.02	% △19.7	% 93.6	% 6.4	百万円 49,889
14期(2013年1月15日)	7,573	120	29.7	10,879.08	28.0	98.9	2.6	55,502
15期(2014年1月14日)	10,736	90	43.0	15,422.40	41.8	92.6	7.3	50,057
16期(2015年1月13日)	11,879	100	11.6	17,087.71	10.8	92.8	8.0	47,827
17期(2016年1月13日)	12,391	20	4.5	17,715.63	3.7	93.1	7.0	51,402

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 株式先物比率=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(日経225)		株組入比率	株先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2015年1月13日	円 11,879	% -	円 17,087.71	% -	% 92.8	% 8.0
1月末	12,277	3.4	17,674.39	3.4	98.5	1.3
2月末	13,051	9.9	18,797.94	10.0	96.0	4.0
3月末	13,402	12.8	19,206.99	12.4	92.2	7.8
4月末	13,612	14.6	19,520.01	14.2	97.1	2.9
5月末	14,329	20.6	20,563.15	20.3	95.5	3.6
6月末	14,116	18.8	20,235.73	18.4	93.4	6.6
7月末	14,353	20.8	20,585.24	20.5	94.3	4.7
8月末	13,175	10.9	18,890.48	10.6	92.7	7.3
9月末	12,198	2.7	17,388.15	1.8	93.4	6.6
10月末	13,377	12.6	19,083.10	11.7	96.8	3.1
11月末	13,829	16.4	19,747.47	15.6	97.2	2.8
12月末	13,338	12.3	19,033.71	11.4	92.2	7.4
(期末) 2016年1月13日	円 12,411	% 4.5	円 17,715.63	% 3.7	% 93.1	% 7.0

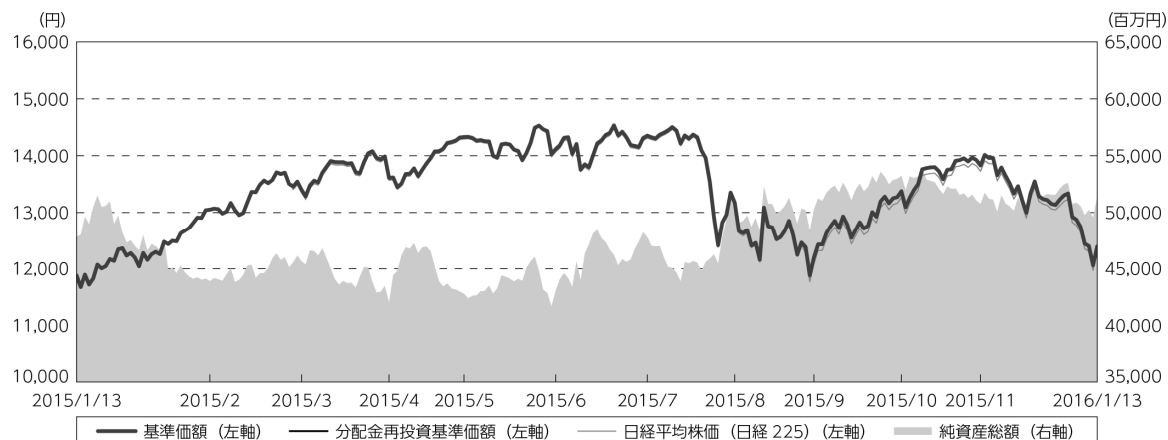
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率=買建比率-売建比率。

※「日経平均株価(日経平均)」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、日経平均自体および日経平均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。「日経」および「日経平均」を示す標章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。「しんきんインデックスファンド225」は、委託会社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、その運用および受益権の取引等に関し一切の責任を負いません。株式会社日本経済新聞社は、日経平均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。株式会社日本経済新聞社は、日経平均の構成銘柄、計算方法、その他日経平均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。

○第17期の運用経過等（2015年1月14日～2016年1月13日）

<当期中の基準価額等の推移>



- (注1) 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す。
- (注2) 分配金再投資基準価額および日経平均株価(日経225)は、期首(2015年1月13日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。
- (注3) ベンチマークは、日経平均株価(日経225)です。

(期首と期末の比較)

当期の基準価額は、11,879円(2015年1月13日現在)から始まり、翌日に11,674円の期中安値をつけた後、期の前半では、日経平均株価が堅調に推移したことや保有銘柄の配当収入によって、期中高値の14,534円(2015年7月21日現在)まで上昇しました。

しかし、期の後半では、日経平均株価の下落とともに基準価額も値下がりし、12,411円(税込み分配金20円を含む。)で期末を迎えました。なお、決算日時点の基準価額の期中騰落率は4.48%となる一方、日経平均株価の騰落率は3.67%となりました。

＜投資環境について＞

（株式市況）

当期の日経平均株価は、17,087.71円（2015年1月13日現在）から始まり、翌日に16,795.96円の期中安値をつけた後、20,868.03円（2015年6月24日現在）の期中高値をつけましたが、期末は17,715.63円（2016年1月13日現在）となり、期を通じて3.67%の上昇となりました。

2015年1月の株式市場は、欧州中央銀行の金融緩和政策や、ギリシャ不安の後退などを受け、日経平均株価は3.43%上昇しました。

2015年2月の株式市場は、為替が円安ドル高に進んだことから、輸出企業の業績改善や国内景気の回復期待などを背景に、日経平均株価は6.36%上昇しました。

2015年3月の株式市場は、企業業績回復期待という前月からの流れを引き継ぎ、日経平均株価は2.18%上昇しました。

2015年4月の株式市場は、中国の追加金融緩和期待などを好感した底堅い動きとなり、日経平均株価は1.63%上昇しました。

2015年5月の株式市場は、企業決算発表の良好な内容に反応し、日経平均株価は5.34%上昇しました。

2015年6月の株式市場は、黒田日銀総裁の円安けん制発言や、ギリシャ不安の再燃などが悪材料となり、日経平均株価は1.59%下落しました。

2015年7月の株式市場は、国内景気の堅調が確認され、日経平均株価は1.73%上昇しました。

2015年8月の株式市場は、中国発の世界景気先行き懸念と中国株の急落によって、世界的な株安連鎖となり、日経平均株価は8.23%下落しました。

2015年9月の株式市場は、為替市場の円高が警戒されたことに加え、ドイツの大手自動車メーカーの不正問題などを受け、日経平均株価は7.95%下落しました。

2015年10月の株式市場は、中国の経済対策や海外株式の上昇などを背景に、日経平均株価は9.75%上昇しました。

2015年11月の株式市場は、郵政3社上場が順調な滑り出しとなったことや、米国景気の堅調のもと、日経平均株価は3.48%上昇しました。

2015年12月の株式市場は、中国など新興国景気の先行き不透明感がくすぶる中、米国の利上げが実施され、日経平均株価は3.61%下落しました。

当ファンドの決算日（2016年1月13日）までの2016年1月の株式市場は、原油価格が急落する中、地政学的リスクなどへの懸念から、投資家の不安心理が高まり、日経平均株価は6.92%下落しました。結局、当期末となる1月13日の日経平均株価は17,715.63円で終わりました。

＜運用概況＞

（基本方針）

当ファンドは、日経平均株価に連動する投資成果を目指して運用を行いました。

（組入銘柄）

現物株式については、日経平均株価採用銘柄の中から財務内容や信用リスクを考慮して、一部の銘柄を除く場合があります。当期末現在は、財務内容や信用リスクに著しい問題が生じている企業はないと判断し、225銘柄全てに等株数投資をしています。

（運用経過）

期中の売買につきましては、設定・解約に応じた株式売買のほか、指数構成銘柄変更に伴う入れ替えなどを、必要に応じて実施しました。また、株式組入比率は日経225先物等を利用しながら、高位の水準を保つように努めました。

＜当ファンドのベンチマークとの差異＞

当期における基準価額の騰落率は、ベンチマークである日経平均株価の騰落率に対して0.8%上回ることとなりました。ベンチマークとの差異の主な要因としては、保有している組入銘柄の配当金計上などのプラス要因が、信託報酬や株式売買手数料などのマイナス要因を上回ったことが挙げられます。

＜収益分配方針＞

当期の収益分配金につきましては、期末の基準価額が、期首の水準を上回っていたことから、経費控除後の配当等収益や期末の基準価額水準等を勘案して1万円当たり20円（税込み）としました。なお、収益分配に充てなかった部分につきましては、信託財産中に留保し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

（単位：円、1万円当たり、税込み）

項 目	第17期
	2015年1月14日～ 2016年1月13日
当期分配金	20
（対基準価額比率）	0.161%
当期の収益	20
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	7,385

（注1）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）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（注2）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＞

引き続き運用の基本方針に従い、日経平均株価採用銘柄のうち、200銘柄以上に等株数投資を行うとともに、株式組入比率を高位に保ち、日経平均株価に連動する投資成果を目標として運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年 1月14日～2016年 1月13日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 116	% 0.864	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(36)	(0.270)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(65)	(0.486)	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 ）	(14)	(0.108)	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	5	0.038	(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 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
（ 株 式 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(5)	(0.038)	
(c) そ の 他 費 用	1	0.007	(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)	(0.007)	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
合 計	122	0.909	
期中の平均基準価額は、13,421円です。			

(注1) 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2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 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、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入しています。

○売買及び取引の状況

(2015年1月14日～2016年1月13日)

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		12,356	27,927,147	11,543	26,831,166
		(141)	(-)		

(注1) 金額は受け渡し代金。

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) ()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	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
内		82,543	82,725	-	-

(注1) 金額は受け渡し代金。

(注2) 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2015年1月14日～2016年1月13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	54,758,313千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	45,127,539千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.21

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2015年1月14日～2016年1月13日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2016年1月13日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.2%)			
日本水産	102	106	68,370
マルハニチロ	10.2	10.6	21,412
鉱業 (0.1%)			
国際石油開発帝石	40.8	42.4	44,180
建設業 (2.9%)			
コムシスホールディングス	102	106	170,872
大成建設	102	106	78,758
大林組	102	106	111,724
清水建設	102	106	101,018
長谷工コーポレーション	—	21.2	26,902
鹿島建設	102	106	73,140
大和ハウス工業	102	106	345,560
積水ハウス	102	106	198,909
日揮	102	106	185,712
千代田化工建設	102	106	92,114
食料品 (5.4%)			
日清製粉グループ本社	102	106	200,764
明治ホールディングス	10.2	21.2	204,156
日本ハム	102	106	240,302
サッポロホールディングス	102	106	54,166
アサヒグループホールディングス	102	106	391,352
キリンホールディングス	102	106	170,925
宝ホールディングス	102	106	92,326
キッコーマン	102	106	413,400
味の素	102	106	285,670
ニチレイ	102	106	90,524
日本たばこ産業	102	106	445,942
繊維製品 (0.4%)			
東洋紡	102	106	17,066
ユニチカ	102	106	5,618
日清紡ホールディングス	102	—	—
帝人	102	106	43,566
東レ	102	106	110,558

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
パルプ・紙 (0.3%)			
王子ホールディングス	102	106	49,396
日本製紙	10.2	10.6	19,832
北越紀州製紙	102	106	72,928
化学 (8.1%)			
クラレ	102	106	149,248
旭化成	102	106	84,248
昭和電工	102	106	14,098
住友化学	102	106	62,646
日産化学工業	102	106	281,112
日本曹達	102	106	72,080
東ソー	102	106	60,526
トクヤマ	102	106	25,758
デンカ	102	106	53,636
信越化学工業	102	106	667,058
三井化学	102	106	53,212
三菱ケミカルホールディングス	51	53	37,264
宇部興産	102	106	25,440
日本化薬	102	106	128,366
花王	102	106	613,104
富士フイルムホールディングス	102	106	499,366
資生堂	102	106	247,775
日東電工	102	106	789,064
医薬品 (8.0%)			
協和発酵キリン	102	106	195,570
武田薬品工業	102	106	601,762
アステラス製薬	510	530	873,970
大日本住友製薬	102	106	141,934
塩野義製薬	102	106	561,482
中外製薬	102	106	413,400
エーザイ	102	106	811,430
第一三共	102	106	248,358
石油・石炭製品 (0.3%)			
昭和シェル石油	102	106	96,990
JXホールディングス	102	106	47,392

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ゴム製品 (1.1%)			
横浜ゴム	102	53	92,326
ブリヂストン	102	106	433,222
ガラス・土石製品 (1.6%)			
日東紡績	102	—	—
旭硝子	102	106	69,748
日本板硝子	102	106	9,752
日本電気硝子	153	159	89,676
住友大阪セメント	102	106	48,442
太平洋セメント	102	106	37,206
東海カーボン	102	106	34,450
TOTO	102	53	202,195
日本碍子	102	106	264,470
鉄鋼 (0.2%)			
新日鐵住金	102	10.6	23,251
神戸製鋼所	102	106	12,932
ジェイ エフ イー ホールディングス	10.2	10.6	18,512
日新製鋼	10.2	10.6	12,455
大太平洋金属	102	106	32,012
非鉄金属 (1.2%)			
日本軽金属ホールディングス	102	106	20,776
三井金属鉱業	102	106	21,412
東邦亜鉛	102	106	26,712
三菱マテリアル	102	106	37,842
住友金属鉱山	102	106	131,758
DOWAホールディングス	102	106	82,468
古河機械金属	102	106	23,850
古河電気工業	102	106	27,560
住友電気工業	102	106	166,791
フジクラ	102	106	65,720
金属製品 (0.5%)			
SUMCO	10.2	10.6	8,660
東洋製鐵グループホールディングス	102	106	233,412
機械 (4.7%)			
日本製鋼所	102	106	41,764
オークマ	102	106	99,216
アマダホールディングス	102	106	117,024
小松製作所	102	106	192,920
住友重機械工業	102	106	53,530
日立建機	102	106	188,044

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
クボタ	102	106	184,281
荏原製作所	102	106	57,134
ダイキン工業	102	106	859,236
日本精工	102	106	130,698
NTN	102	106	48,654
ジェイテクト	102	106	196,948
日立造船	20.4	21.2	12,953
三菱重工業	102	106	52,512
I H I	102	106	31,482
電気機器 (16.8%)			
日清紡ホールディングス	—	106	129,426
コニカミノルタ	102	106	116,812
ミネベア	102	106	104,410
日立製作所	102	106	66,907
東芝	102	106	24,464
三菱電機	102	106	122,695
富士電機	102	106	50,456
安川電機	102	106	157,940
明電舎	102	106	48,866
ジーエス・ユアサ コーポレーション	102	106	44,626
日本電気	102	106	39,114
富士通	102	106	61,798
沖電気工業	102	106	14,416
パナソニック	102	106	120,840
シャープ	102	106	12,084
ソニー	102	106	291,500
TDK	102	106	750,480
ミツミ電機	102	106	66,568
アルプス電気	102	106	309,626
パイオニア	102	106	31,058
横河電機	102	106	141,934
アドバンテスト	204	212	209,880
カシオ計算機	102	106	276,024
ファナック	102	106	2,056,400
京セラ	204	212	1,117,876
太陽誘電	102	106	163,558
S C R E E Nホールディングス	102	106	88,192
キヤノン	153	159	534,399
リコー	102	106	120,734
東京エレクトロン	102	106	758,642

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
輸送用機器 (7.0%)			
デンソー	102	106	558,620
三井造船	102	106	18,656
川崎重工業	102	106	43,354
日産自動車	102	106	122,483
いすゞ自動車	51	53	64,289
トヨタ自動車	102	106	737,018
日野自動車	102	106	138,436
三菱自動車工業	10.2	10.6	10,218
マツダ	20.4	21.2	46,629
本田技研工業	204	212	764,472
スズキ	102	106	372,696
富士重工業	102	106	489,084
精密機器 (3.2%)			
テルモ	204	212	783,340
ニコン	102	106	170,872
オリンパス	102	106	481,770
シチズンホールディングス	102	106	87,238
その他製品 (1.1%)			
凸版印刷	102	106	109,392
大日本印刷	102	106	116,918
ヤマハ	102	106	288,638
電気・ガス業 (0.3%)			
東京電力	10.2	10.6	7,080
中部電力	10.2	10.6	16,514
関西電力	10.2	10.6	14,537
東京瓦斯	102	106	57,165
大阪瓦斯	102	106	45,113
陸運業 (2.7%)			
東武鉄道	102	106	60,208
東京急行電鉄	102	106	96,248
小田急電鉄	102	106	130,380
京王電鉄	102	106	106,530
京成電鉄	102	106	162,816
東日本旅客鉄道	10.2	10.6	112,943
西日本旅客鉄道	10.2	10.6	83,347
東海旅客鉄道	10.2	10.6	221,275
日本通運	102	106	55,014
ヤマトホールディングス	102	106	249,948

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
海運業 (0.2%)			
日本郵船	102	106	28,302
商船三井	102	106	28,408
川崎汽船	102	106	23,850
空運業 (0.1%)			
A N Aホールディングス	102	106	35,319
倉庫・運輸関連業 (0.3%)			
三菱倉庫	102	106	159,954
情報・通信業 (11.1%)			
ヤフー	40.8	42.4	20,182
トレンドマイクロ	102	106	515,160
スカパーJ S A Tホールディングス	10.2	10.6	6,837
日本電信電話	10.2	21.2	100,742
K D D I	204	636	1,880,016
N T T ドコモ	10.2	10.6	25,917
東宝	10.2	10.6	33,549
エヌ・ティ・ティ・データ	102	106	609,500
コナミホールディングス	102	106	301,358
ソフトバンクグループ	306	318	1,810,056
卸売業 (2.0%)			
双日	10.2	10.6	2,597
伊藤忠商事	102	106	142,252
丸紅	102	106	61,533
豊田通商	102	106	279,840
三井物産	102	106	144,054
住友商事	102	106	126,352
三菱商事	102	106	202,407
小売業 (11.4%)			
J・フロント リテイリング	51	53	87,185
三越伊勢丹ホールディングス	102	106	165,148
セブン&アイ・ホールディングス	102	106	541,342
高島屋	102	106	107,696
丸井グループ	102	106	196,736
イオン	102	106	168,805
ユニーグループ・ホールディングス	102	106	79,924
ファーストリテイリング	102	106	4,101,140
銀行業 (1.2%)			
新生銀行	102	106	22,472
あおぞら銀行	102	106	43,036
三菱U F J フィナンシャル・グループ	102	106	74,200

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
りそなホールディングス	10.2	10.6	5,942
三井住友トラスト・ホールディングス	102	106	44,795
三井住友フィナンシャルグループ	10.2	10.6	45,590
千葉銀行	102	106	84,800
横浜銀行	102	106	74,200
ふくおかフィナンシャルグループ	102	106	59,572
静岡銀行	102	106	116,494
みずほフィナンシャルグループ	102	106	24,210
証券・商品先物取引業 (0.5%)			
大和証券グループ本社	102	106	74,889
野村ホールディングス	102	106	67,045
松井証券	102	106	110,770
保険業 (1.1%)			
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	25.5	26.5	95,188
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	30.6	31.8	100,456
ソニーフィナンシャルホールディングス	20.4	21.2	41,806
第一生命保険	10.2	10.6	19,355
東京海上ホールディングス	51	53	224,402
T&Dホールディングス	20.4	21.2	30,824

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
その他金融業 (0.5%)				
クレディセゾン	102	106	232,776	
不動産業 (2.1%)				
東急不動産ホールディングス	102	106	77,062	
三井不動産	102	106	305,280	
三菱地所	102	106	249,259	
平和不動産	20.4	—	—	
東京建物	102	53	65,773	
住友不動産	102	106	337,716	
サービス業 (3.4%)				
ディー・エヌ・エー	—	31.8	54,155	
電通	102	106	683,700	
東京ドーム	102	106	64,554	
セコム	102	106	821,394	
合 計	株 数 ・ 金 額	21,363	22,318	47,870,316
	銘柄数 < 比率 >	225	225	< 93.1% >

(注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。
(注2) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切り捨て。
(注4) —印は組み入れなし。

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	株式先物取引	百万円 3,610	百万円 —
	日経225		

(注1) 単位未満は切り捨て。
(注2) —印は組み入れなし。

○投資信託財産の構成

(2016年1月13日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	47,870,316	89.3
コール・ローン等、その他	5,760,554	10.7
投資信託財産総額	53,630,870	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年1月13日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	53,614,741,636
コール・ローン等	5,370,028,605
株式(評価額)	47,870,316,560
未収配当金	67,300,000
未収利息	1,471
差入委託証拠金	307,095,000
(B) 負債	2,211,882,537
未払金	1,844,739,349
未払収益分配金	82,970,581
未払解約金	64,023,829
未払信託報酬	218,420,778
その他未払費用	1,728,000
(C) 純資産総額(A-B)	51,402,859,099
元本	41,485,290,588
次期繰越損益金	9,917,568,511
(D) 受益権総口数	41,485,290,588口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,391円

(注1) 当ファンドの期首元本額は40,262,095,871円、期中追加設定元本額は55,937,008,033円、期中一部解約元本額は54,713,813,316円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1,2391円です。

○損益の状況 (2015年1月14日～2016年1月13日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	507,947,412
受取配当金	507,621,813
受取利息	209,412
その他収益金	116,187
(B) 有価証券売買損益	△ 2,632,241,737
売買益	4,426,982,780
売買損	△ 7,059,224,517
(C) 先物取引等取引損益	△ 356,114,464
取引益	906,930,387
取引損	△ 1,263,044,851
(D) 信託報酬等	△ 415,672,689
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 2,896,081,478
(F) 前期繰越損益金	1,207,069,009
(G) 追加信託差損益金	11,689,551,561
(配当等相当額)	(29,424,691,771)
(売買損益相当額)	(△17,735,140,210)
(H) 計(E+F+G)	10,000,539,092
(I) 収益分配金	△ 82,970,581
次期繰越損益金(H+I)	9,917,568,511
追加信託差損益金	11,689,551,561
(配当等相当額)	(29,424,691,771)
(売買損益相当額)	(△17,735,140,210)
分配準備積立金	1,216,373,151
繰越損益金	△ 2,988,356,201

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)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。

(注2) 損益の状況の中で(D)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。

(注3) 損益の状況の中で(G)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4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(92,274,723円)、費用控除後の有価証券等損益額(0.0円)、信託約款に規定する収益調整金(29,424,691,771円)および分配準備積立金(1,207,069,009円)より分配対象収益は30,724,035,503円(10,000口当たり7,405円)であり、うち82,970,581円(10,000口当たり20円)を分配金額としています。

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金 (税込み)	20円
------------------	-----

◇分配金を再投資される場合のお手取分配金は、自動けいぞく投資約款の規定に基づき、決算日の翌営業日に再投資いたしました。

◇分配金をお受け取りになる場合の分配金は、決算日から起算して5営業日目までにお支払いを開始しています。

◇分配金のお取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

- (注1) 分配金は、分配後の基準価額と各受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)があります。分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額が「普通分配金」となります。分配後の基準価額を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が「元本払戻金(特別分配金)」、残りの部分が「普通分配金」となります。
- (注2) 個人の受益者の場合、収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%) の税率が適用されます。
- (注3) 法人の受益者の場合、収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、15.315% (所得税15%および復興特別所得税0.315%) が源泉徴収されます。
- (注4) 当ファンドは少額投資非課税制度「NISA (ニーサ)」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。
- (注5) 税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。