

○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 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 主要投資対象 | 我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。 |
| 運用方針 | <p>① 主として予想配当利回りが市場平均を上回ると判断できる株式に投資し、安定した配当収益の獲得と投資信託財産の成長を目標とします。</p> <p>② 銘柄の選定にあたっては、企業業績、財務健全性、時価総額などを総合的に勘案して決定します。</p> <p>③ 株式等の組入れは、原則として高位を保ちます。</p> <p>④ 株式以外の資産の組入比率は通常の場合50%以下とします。</p> <p>⑤ 投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引(以下「先物取引等」といいます。)を行うことができます。</p> <p>⑥ 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。</p> |
| 投資制限 | <p>① 株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>④ 同一銘柄の株式への投資は、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。</p> <p>⑤ 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、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>⑥ 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。</p> <p>⑦ 外貨建資産への投資は行いません。</p> |
| 収益配分方針 | <p>① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)の全額とします。</p> <p>② 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は、分配を行わないこともあります。</p> <p>③ 収益分配に充てず投資信託財産に留保した収益等については、運用の基本方針に基づき運用を行います。</p> |

■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 好配当利回り株ファンド

決算日

(第18期:2020年8月6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「しんきん好配当利回り株ファンド」は2020年8月6日に第18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

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

目 次

| ◇しんきん好配当利回り株ファンド | 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18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 | 7 |
| 株式売買比率 | 7 |
| 利害関係人との取引状況等 | 7 |
| 第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己取引状況 | 7 |
| 自社による当ファンドの設定・解約状況 | 7 |
| 組入資産の明細 | 8 |
| 投資信託財産の構成 | 9 |
| 資産、負債、元本及び基準価額の状況 | 10 |
| 損益の状況 | 10 |
| 分配金のお知らせ | 11 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | T O P I X ※ | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産総額 |
|----------------|--------|------|-------|-------------|-------|--------|--------|------------|-------|
| | (分配落) | 税金込み | 期中騰落率 | (参考指数) | 期中騰落率 | | | | |
| | 円 | 円 | % | ポイント | % | % | % | % | 百万円 |
| 14期(2016年8月8日) | 15,957 | 600 | △16.8 | 1,305.53 | △22.0 | 98.0 | — | 1.1 | 8,529 |
| 15期(2017年8月7日) | 20,094 | 800 | 30.9 | 1,639.27 | 25.6 | 97.4 | — | 1.0 | 7,813 |
| 16期(2018年8月6日) | 20,146 | 800 | 4.2 | 1,732.90 | 5.7 | 97.8 | — | 1.0 | 8,708 |
| 17期(2019年8月6日) | 16,582 | 600 | △14.7 | 1,499.23 | △13.5 | 97.7 | — | — | 8,835 |
| 18期(2020年8月6日) | 15,075 | 500 | △6.1 | 1,549.88 | 3.4 | 98.5 | — | — | 7,930 |

(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

(注3) 投資信託証券組入比率はJリート(国内不動産投資信託)の組入比率です。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | T O P I X ※ | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 |
|-------------------|--------|--------|-------------|--------|--------|--------|------------|
| | 騰落率 | (参考指数) | 騰落率 | (参考指数) | | | |
| (期首) 2019年8月6日 | 円 | % | ポイント | % | % | % | % |
| 8月末 | 16,582 | — | 1,499.23 | — | 97.7 | — | — |
| 9月末 | 16,719 | 0.8 | 1,511.86 | 0.8 | 97.3 | — | — |
| 10月末 | 17,910 | 8.0 | 1,587.80 | 5.9 | 97.9 | — | — |
| 11月末 | 18,916 | 14.1 | 1,667.01 | 11.2 | 98.8 | — | — |
| 12月末 | 19,213 | 15.9 | 1,699.36 | 13.3 | 98.6 | — | — |
| 2020年1月末 | 19,367 | 16.8 | 1,721.36 | 14.8 | 99.6 | — | — |
| 2月末 | 18,814 | 13.5 | 1,684.44 | 12.4 | 98.6 | — | — |
| 3月末 | 16,795 | 1.3 | 1,510.87 | 0.8 | 98.7 | — | — |
| 4月末 | 15,250 | △8.0 | 1,403.04 | △6.4 | 97.0 | — | — |
| 5月末 | 15,597 | △5.9 | 1,464.03 | △2.3 | 96.8 | — | — |
| 6月末 | 16,452 | △0.8 | 1,563.67 | 4.3 | 97.2 | — | — |
| 7月末 | 16,049 | △3.2 | 1,558.77 | 4.0 | 97.8 | — | — |
| 8月末 | 14,946 | △9.9 | 1,496.06 | △0.2 | 97.5 | — | — |
| (期末) 2020年8月6日 | 円 | % | ポイント | % | % | % | % |
| | 15,575 | △6.1 | 1,549.88 | 3.4 | 98.5 | — | — |

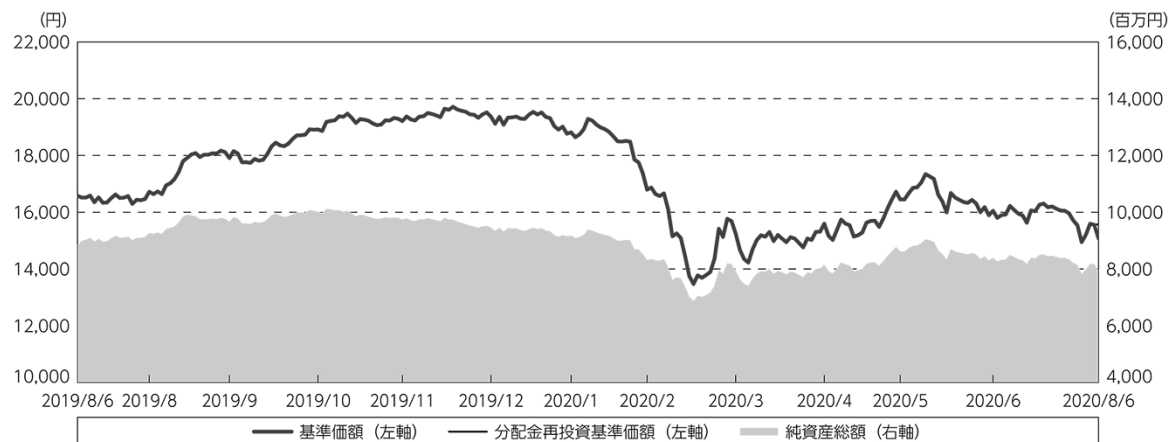
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注2) 株式先物比率=買建比率-売建比率

※東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(㈱東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、㈱東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、㈱東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

○第18期の運用経過等（2019年8月7日～2020年8月6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は、期首(2019年8月6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。

<基準価額の主な変動要因>

当ファンドは、主として予想配当利回りが市場平均を上回ると判断できる株式に投資し、安定した配当収益の獲得と投資信託財産の成長を目標として運用を行っています。

当期の基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

<上昇要因>

- ・英国の合意なき欧州連合(EU)離脱懸念が後退したこと。
- ・各国で新型コロナウイルス感染拡大による景気への影響軽減のため、金融政策および経済対策がとられたこと。

<下落要因>

- ・トランプ政権による関税措置に伴い、米中間の貿易摩擦が激化したこと。
- ・新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、投資家のリスク回避姿勢が広がったこと。

<投資環境>

(2019年8月～9月)

当期のTOPIXは、1,499.23ポイント(2019年8月6日現在)の水準から始まりました。8月の株式市場は、トランプ政権が中国を経済制裁の対象となる「為替操作国」へ指定したことなどから、投資家心理が悪化し下落しました。9月は、香港政府が逃亡犯条例改正案の撤回を表明、英国議会下院がEU離脱の再延期を求める法案を可決、また、米中が10月に閣僚級貿易協議を開くことで合意したことを受けて国内株は堅調な動きになりました。

(2019年10月～12月)

10月の株式市場は、米サプライマネジメント協会(I S M)が発表した製造業景況感指数が、低い水準に落ち込んだことなどから、上旬はやや軟調な動きになりましたが、米国の利下げ観測や米中貿易協議の進展期待から上昇に転じ、11月にかけて年初来高値の更新が続きました。12月の株式市場は、米中が第1段階の貿易合意に至ったことや、英国の総選挙で与党・保守党が過半数の議席を獲得し、合意なきEU離脱への懸念が後退したことから、12月17日には、TOPIXは期中高値となる1,747.20ポイントまで上昇しました。

(2020年1月～3月)

1月には、米軍によるイラン革命防衛隊司令官殺害を受け、両国の対立が激化すると懸念が広がったことや、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて、投資家のリスク回避姿勢が広がり、3月にかけて大きく値を下げました。3月16日には、TOPIXは終値で期中安値となる1,236.34ポイントまで下落しました。ただし、月末にかけては、米連邦準備制度理事会(F R B)が資金繰り支援のための緊急措置を発動すると発表したことや、トランプ政権が大規模な経済対策を取りまとめたこと、日銀が上場投資信託(E T F)の買入額を増額したことなどを好感し、下げ幅が縮小する展開となりました。

(2020年4月～8月)

4月から6月にかけては、欧米での都市封鎖の段階的解除や経済活動再開への期待などから、国内外の株価は堅調な動きになりました。その後は、東京都での新型コロナウイルス感染拡大もあり、TOPIXは1,500ポイント台後半での一進一退となりました。7月末にかけて、東京都が酒類を提供する飲食店などに営業時間の短縮を要請するなど感染拡大への警戒が強まる中、軟調な動きになり、期末のTOPIXは1,549.88ポイントで終了しました。

<当ファンドのポートフォリオ>

期中の売買については、設定・解約に伴い現物株式を売買したほか、ファンドの運用方針に従い、①予想配当利回り、②企業業績、③時価総額、④財務の健全性の4項目により投資対象銘柄を絞り込み、個別銘柄の入替えなどを必要に応じて実施しました。

株式の組入比率は、90%以上の高位を保ち、期末には98.5%となっています。

業種構成は、情報・通信業、化学および非鉄金属が増加し、空運業、卸売業および銀行業などが減少しました。なお、期末時点で、TOPIX対比でオーバーウエートとしている主な業種は、卸売業、機械、金属製品、非鉄金属および石油・石炭製品で、アンダーウエートとしている主な業種は、電気機器、情報・通信業、医薬品、精密機器および食料品です。

東証株価指数(TOPIX)の推移
(2019年8月7日～2020年8月6日)



期末時点の組入銘柄数は88銘柄となっています。期末時点の組入上位10銘柄は、太陽ホールディングス、住友金属鉱山、伊藤忠商事、ヤマハ発動機、TKC、トレンドマイクロ、IDEC、日東電工、ホクトおよび野村ホールディングスとなっています。なお、期末時点の保有銘柄の予想配当利回りは、3.71%（時価加重ベース。日経予想・会社予想等より、しんきんアセットマネジメント投信算出。）となっています。

<当ファンドのベンチマークとの差異>

当期末の基準価額の騰落率（分配金込み）は△6.1%となり、同期間のTOPIX（参考指数）の騰落率である+3.4%を、9.5%下回りました。

株式組入比率は90%以上の高位を保ちました。その結果、組入比率による影響は軽微でした。業種構成では、相対的に堅調に推移した機械、証券、商品先物取引業の組入比率が高かったことや、相対的に上昇率が小さかった陸運業、食料品や電気・ガス業の組入比率が低かったことがプラス要因となりました。一方、相対的に堅調に推移した電気機器、情報・通信業や医薬品の組入比率が低かったことや、相対的に上昇率が小さかった石油・石炭製品や繊維製品の組入比率が高かったことがマイナス要因となりました。個別銘柄では、期を通して保有していた太陽ホールディングス、東京エレクトロン、トレンドマイクロ、野村ホールディングスおよびTKCなどがプラスに寄与しました。一方、期中に売却した青山商事のほか、期を通して保有していたコニカミノルタ、三菱重工業、JFE（ジェイエフイー）ホールディングスおよび大東建託などがマイナスに寄与しました。

<分配金>

当期の収益分配金については、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500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いては、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18期 |
|-----------|-------------------------|
| | 2019年8月7日～ 2020年8月6日 |
| 当期分配金 | 500 |
| （対基準価額比率） | 3.210% |
| 当期の収益 | 376 |
| 当期の収益以外 | 123 |
| 翌期繰越分配対象額 | 8,472 |

（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、主として予想配当利回りが市場平均を上回ると判断できる株式に投資し、安定した配当収益の獲得と投資信託財産の成長を目標として運用します。

株式組入比率は高位に保ち、配当利回りの向上を狙い、個別銘柄の予想配当利回りの推移などを参考に、銘柄の入替えなどを実施します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年8月7日～2020年8月6日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|----------|------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 189 | % 1.100 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (85) | (0.495) | 委託した資金の運用の対価 |
| （ 販 売 会 社 ） | (85) | (0.495) | 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 ） | (19) | (0.110) | 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 | 4 | 0.021 | (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 ） | (4) | (0.021) | |
| (c) そ の 他 費 用 | 1 | 0.004 | (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) | (0.004) | 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) | 信託事務の処理等に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 194 | 1.125 | |
| 期中の平均基準価額は、17,169円です。 | | | |

(注1) 期中の費用（消費税等の掛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。

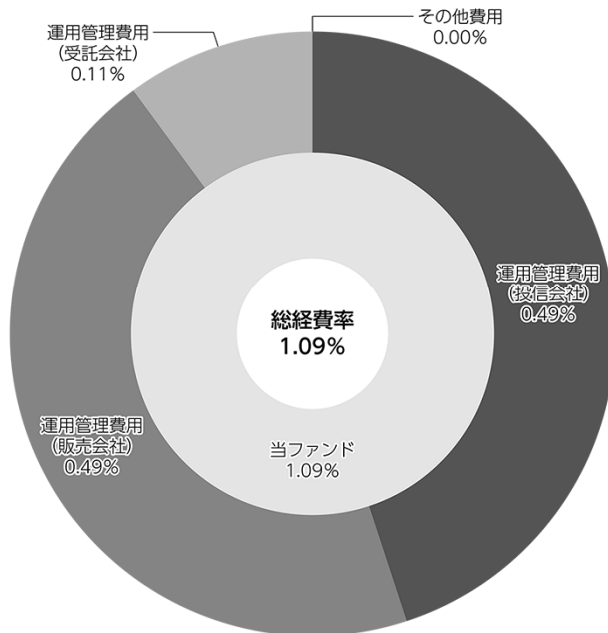
(注2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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。

(参考情報)

○総経費率

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）は1.09%です。



(注) 当ファンドの費用は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す。

(注) 各費用は、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。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、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。

○売買及び取引の状況

(2019年8月7日～2020年8月6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 | | 1,497 | 1,848,336 | 1,350 | 2,100,793 |
| | | (40) | (-) | | |

(注1) 金額は受渡し代金。

(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おりません。

○株式売買比率

(2019年8月7日～2020年8月6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 | 3,949,129千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 8,705,615千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.45 |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年8月7日～2020年8月6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。

○第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己取引状況

(2019年8月7日～2020年8月6日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2019年8月7日～2020年8月6日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2020年8月6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 (1.3%) | | | |
| ホクト | 54.4 | 46.8 | 99,964 |
| 建設業 (3.2%) | | | |
| 大林組 | 98.1 | 90 | 90,450 |
| 大東建託 | 7.2 | 8.3 | 67,728 |
| 積水ハウス | 55.8 | 47.3 | 94,741 |
| 食料品 (2.2%) | | | |
| キリンホールディングス | 42.8 | 42.8 | 87,012 |
| 日本たばこ産業 | 42.1 | 42.7 | 83,521 |
| 繊維製品 (2.2%) | | | |
| 帝人 | 53.5 | 51.9 | 84,337 |
| 東レ | — | 170.2 | 84,129 |
| オンワードホールディングス | 169.1 | — | — |
| 化学 (7.0%) | | | |
| クラレ | 78.9 | 80.8 | 90,657 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 133.1 | 136.8 | 83,598 |
| 三洋化成工業 | 19.1 | 20.7 | 98,739 |
| 太陽ホールディングス | 30.8 | 19.7 | 109,926 |
| マンダム | 38.4 | 40.6 | 67,517 |
| 日東電工 | 18.9 | 16.3 | 100,082 |
| 医薬品 (3.7%) | | | |
| 武田薬品工業 | 26.2 | 25.3 | 97,582 |
| アステラス製薬 | 65.2 | 55.6 | 92,323 |
| 大塚ホールディングス | 26.4 | 21.9 | 98,747 |
| 石油・石炭製品 (2.2%) | | | |
| 出光興産 | 31.5 | 37.5 | 83,887 |
| E N E O Sホールディングス | 188.5 | 229 | 88,371 |
| ゴム製品 (2.1%) | | | |
| 横浜ゴム | 51.6 | 60.3 | 87,555 |
| ブリヂストン | 24.6 | 25.2 | 79,884 |
| ガラス・土石製品 (1.2%) | | | |
| A G C | 27.6 | 31.4 | 94,357 |
| 鉄鋼 (1.1%) | | | |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 63.3 | — | — |
| 丸一鋼管 | — | 32 | 83,744 |
| 非鉄金属 (2.5%) | | | |
| 住友金属鉱山 | 32.5 | 30.9 | 107,562 |
| 住友電気工業 | 70.8 | 73.4 | 90,538 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 金属製品 (2.5%) | | | |
| 三和ホールディングス | 85.9 | 101.9 | 97,314 |
| L I X I Lグループ | 53.3 | 64.3 | 95,292 |
| 機械 (7.7%) | | | |
| アマダ | 89.2 | 93.8 | 72,695 |
| 小松製作所 | 39.4 | 46 | 95,956 |
| SANKYO | 25.6 | 31.6 | 85,193 |
| マックス | 58.6 | 53.8 | 85,972 |
| 日本精工 | 104.9 | 119.8 | 85,417 |
| 三菱重工業 | 23.3 | 31.2 | 74,677 |
| スター精密 | 73.9 | 77.8 | 99,428 |
| 電気機器 (9.8%) | | | |
| 日清紡ホールディングス | — | 113.4 | 76,885 |
| コニカミノルタ | 95.7 | 212.7 | 67,000 |
| 三菱電機 | 73 | 69.6 | 96,465 |
| マブチモーター | — | 25.4 | 83,947 |
| I D E C | 52.4 | 57.4 | 100,105 |
| パナソニック | 111.6 | 99.2 | 89,974 |
| マクセルホールディングス | 68 | — | — |
| アズビル | 39.7 | — | — |
| カシオ計算機 | — | 55.6 | 84,345 |
| ファナック | 5.4 | — | — |
| キヤノン | 31.9 | 39.5 | 69,934 |
| 東京エレクトロン | 5.5 | 3.4 | 97,121 |
| 輸送用機器 (6.9%) | | | |
| デンソー | 22 | 23 | 93,472 |
| 東海理化電機製作所 | 56.3 | 60.9 | 84,042 |
| トヨタ自動車 | 14.7 | 13.9 | 94,520 |
| 本田技研工業 | 35.9 | 34.4 | 91,108 |
| S U B A R U | 38.9 | 37.4 | 75,398 |
| ヤマハ発動機 | 53.7 | 60.8 | 101,840 |
| 精密機器 (0.9%) | | | |
| ニコン | — | 89.3 | 70,814 |
| ニプロ | 83.8 | — | — |
| その他製品 (2.3%) | | | |
| トッパン・フォームズ | 111.9 | 96.3 | 95,529 |
| 大日本印刷 | 43.6 | 36.6 | 81,874 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 電気・ガス業 (1.2%) | | | |
| 中国電力 | 73.7 | 74.2 | 96,385 |
| 陸運業 (2.0%) | | | |
| 西日本旅客鉄道 | 11.5 | — | — |
| 日本通運 | 17.4 | 17.4 | 92,394 |
| 九州旅客鉄道 | — | 29.4 | 62,357 |
| 空運業 (—%) | | | |
| 日本航空 | 29.1 | — | — |
| 倉庫・運輸関連業 (1.2%) | | | |
| 住友倉庫 | 75 | 72.8 | 91,218 |
| 情報・通信業 (6.2%) | | | |
| トレンドマイクロ | 20.8 | 15.3 | 100,521 |
| 日本テレビホールディングス | 62.7 | 72.4 | 86,880 |
| 日本電信電話 | 20.6 | 37.8 | 94,859 |
| NTTドコモ | 39 | 32.5 | 97,597 |
| TKC | 22.4 | 16.6 | 100,762 |
| 卸売業 (7.0%) | | | |
| 伊藤忠商事 | 48.3 | 41.6 | 102,419 |
| 三井物産 | 57.4 | 54.5 | 91,778 |
| 住友商事 | 63.8 | 68.7 | 87,832 |
| サンゲツ | 50.5 | 56.6 | 85,522 |
| リョーサン | 39.2 | 39.6 | 80,071 |
| 東陽テクニカ | 83 | — | — |
| 因幡電機産業 | 21.5 | 38.7 | 98,839 |
| 小売業 (4.6%) | | | |
| ローソン | 19.3 | 16.6 | 87,648 |
| 島忠 | — | 31.3 | 92,084 |
| 青山商事 | 47.4 | — | — |
| ヤマダ電機 | 210 | 185.7 | 88,950 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------------|----------------|-------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ブレナス | 57 | 54.8 | 92,009 |
| 銀行業 (6.4%) | | | |
| あおぞら銀行 | 38.7 | 44.7 | 81,175 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 194 | 199.6 | 82,394 |
| りそなホールディングス | 223.3 | 245.5 | 86,882 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 25.6 | 27.9 | 79,361 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 26.3 | 28.4 | 82,345 |
| みずほフィナンシャルグループ | 641.8 | 687.8 | 90,720 |
| 証券・商品先物取引業 (2.5%) | | | |
| 大和証券グループ本社 | 212.2 | 202.1 | 93,410 |
| 野村ホールディングス | 266.7 | 193.7 | 99,774 |
| 保険業 (3.3%) | | | |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 28.8 | 29.2 | 81,438 |
| 東京海上ホールディングス | 17.8 | 18.5 | 86,802 |
| T&Dホールディングス | 85.6 | 99.8 | 92,015 |
| 不動産業 (2.1%) | | | |
| 野村不動産ホールディングス | 46.4 | 46.5 | 87,001 |
| パーク24 | 42.6 | 51.1 | 75,832 |
| サービス業 (4.7%) | | | |
| H. U. グループホールディングス | 40.8 | 39.7 | 97,820 |
| ユー・エス・エス | 48 | 54.8 | 90,858 |
| 日本郵政 | 82.1 | 112.9 | 84,539 |
| メイテック | 18 | 19.4 | 97,582 |
| 合 計 | 株数・金額 6,056 | 6,244 | 7,813,374 |
| | 銘柄数<比率> | 90 | 88 <98.5%> |

(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。

○投資信託財産の構成

(2020年8月6日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 7,813,374 | 94.8 |
| コール・ローン等、その他 | 426,648 | 5.2 |
| 投資信託財産総額 | 8,240,022 | 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 (2020年8月6日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 8,240,022,831 |
| コール・ローン等 | 243,184,131 |
| 株式(評価額) | 7,813,374,650 |
| 未収入金 | 156,855,800 |
| 未収配当金 | 26,608,250 |
| (B) 負債 | 309,514,301 |
| 未払収益分配金 | 263,028,856 |
| 未払解約金 | 1,259,914 |
| 未払信託報酬 | 45,058,692 |
| 未払利息 | 627 |
| その他未払費用 | 166,212 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 7,930,508,530 |
| 元本 | 5,260,577,130 |
| 次期繰越損益金 | 2,669,931,400 |
| (D) 受益権総口数 | 5,260,577,130口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 15,075円 |

(注1) 当ファンドの期首元本額は5,328,737,370円、期中追加設定元本額は1,336,099,336円、期中一部解約元本額は1,404,259,576円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1,5075円です。

○損益の状況 (2019年8月7日～2020年8月6日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 295,978,244 |
| 受取配当金 | 295,870,876 |
| 受取利息 | △ 4 |
| その他収益金 | 195,932 |
| 支払利息 | △ 88,560 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 747,681,147 |
| 売買益 | 634,399,591 |
| 売買損 | △1,382,080,738 |
| (C) 信託報酬等 | △ 98,130,757 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 549,833,660 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 821,088,672 |
| (F) 追加信託差損益金 | 4,303,882,588 |
| (配当等相当額) | (4,135,020,476) |
| (売買損益相当額) | (168,862,112) |
| (G) 計(D+E+F) | 2,932,960,256 |
| (H) 収益分配金 | △ 263,028,856 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 2,669,931,400 |
| 追加信託差損益金 | 4,303,882,588 |
| (配当等相当額) | (4,135,020,476) |
| (売買損益相当額) | (168,862,112) |
| 分配準備積立金 | 321,759,622 |
| 繰越損益金 | △1,955,710,810 |

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買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(C)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(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4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(197,847,487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(4,135,020,476円)および分配準備積立金(386,940,991円)より分配対象収益は4,719,808,954円(10,000口当たり8,972円)であり、うち263,028,856円(10,000口当たり500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) | 500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「N I S A (ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアN I S A (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。