

クロッキー日本株プラス(3か月決算型) 愛称 ダブルインカム

追加型投信/国内/株式/インデックス型

2016年7月

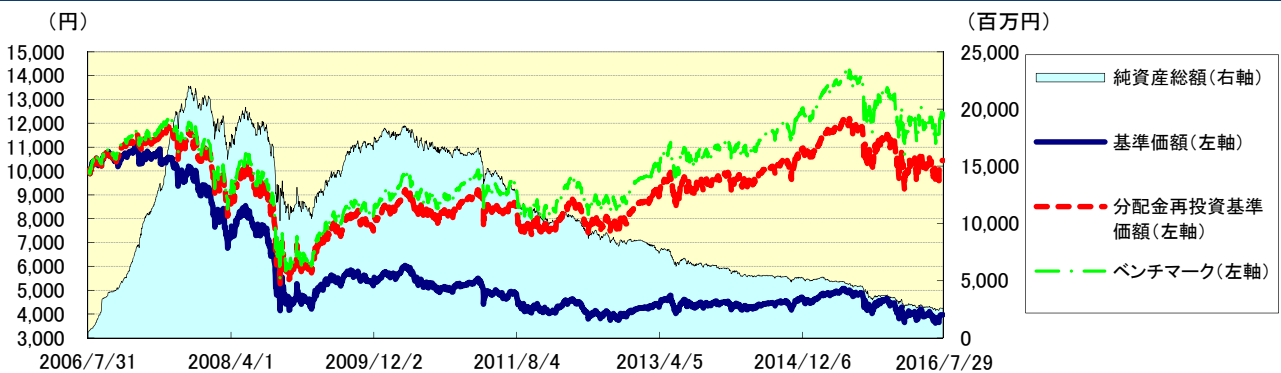


設定・運用は
BNPパリバ インベストメント・パートナーズ株式会社

運用実績

当該実績は過去のものであり、将来の運用成果等を示唆または保証するものではありません。

設定来の基準価額(左軸)と純資産総額(右軸)の推移



基準価額は、信託報酬控除後です。また、1万口当たりを表示しています。分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものと算出。ベンチマークである「クロッキー日本株プラス指数」は、基準価額との比較を考慮し、クロッキー日本株プラス戦略のクーポン相当額と諸費用を調整した値を使用しています。また、基準価額への反映を考慮し前営業日の指数を使用しています。戦略スポンサーであるドイツ銀行グループのデータを用いて、算出開始日(2006年8月6日)の値を10,000として当社が指数化しました。

| 基準価額 ^{*1} | 設定来高値 | 設定来安値 | 純資産総額 | 信託財産の構成 | 対純資産比率 |
|--------------------|------------------------|-----------------------|--------|--------------------------------------|------------------|
| 3,978円 | 11,104円 (2007/2/26) | 3,623円 (2016/6/27) | 26.0億円 | 債券(ユーロ円債 ^{*2}) コール・ローン等 | 0.00% 100.00% |

*1 分配金控除後
*2 ドイツ銀行ロンドン支店発行

| 期間別騰落率 ^{*3} | 1ヶ月 | 3ヶ月 | 6ヶ月 | 1年 | 3年 | 設定来 ^{*4} |
|----------------------|--------|--------|--------|---------|---------|-------------------|
| ファンド | +6.59% | -2.28% | +1.62% | -11.29% | +12.90% | +4.44% |
| ベンチマーク | +7.12% | -1.80% | +2.54% | -10.46% | +18.30% | - |

*3 ファンドの騰落率は、分配金再投資基準価額を使用して算出。
*4 設定日(2006年7月31日)以降。

分配金実績(1万口当たり、税引前)

設定来累計 5,630円

| 決算期(直近10期) | 金額 |
|------------|-----|
| 2014年3月 | 80円 |
| 2014年6月 | 80円 |
| 2014年9月 | 80円 |
| 2014年12月 | 80円 |
| 2015年3月 | 80円 |
| 2015年6月 | 80円 |
| 2015年9月 | 80円 |
| 2015年12月 | 80円 |
| 2016年3月 | 80円 |
| 2016年6月 | 80円 |

| 概要 | 項目が動く原因 | 項目 | 第35期 (15年6月5日) | 第36期 (15年9月7日) | 第37期 (15年12月7日) | 第38期 (16年3月7日) | 第39期 (16年6月6日) |
|------------------------|---------|-----------------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-------------------|-------------------|
| 分配できる 収益の内訳 | インカム | 配当等収益 | 128円 | 130円 | 132円 | 123円 | 117円 |
| | | 配当等収益(経費控除後)(A) | 121円 | 113円 | 127円 | 109円 | 103円 |
| | キャピタル | 有価証券売却益 | 183円 | ▲833円 | 280円 | ▲471円 | ▲186円 |
| | | 有価証券売却益(経費控除後・繰越欠損金補てん後)(B) | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 |
| 繰越部分 | | 収益調整金と分配準備積立金(C) | 386円 | 428円 | 463円 | 513円 | 543円 |
| 決算前 分配可能原資(D)=(A+B+C)* | | | 507円 | 541円 | 591円 | 622円 | 646円 |
| 分配実績 | | 収益分配金(1万口当たり・税引前)(E) | 80円 | 80円 | 80円 | 80円 | 80円 |
| 次回決算への繰越分 | | 決算後 繰越分配可能原資(F)=(D-E) | 427円 | 461円 | 511円 | 542円 | 566円 |
| 分配落ち後基準価額 | | | 4,997円 | 4,196円 | 4,516円 | 4,075円 | 3,913円 |

運用状況によっては、分配金額が変わる場合、または分配金が支払われない場合があります。

(B)の値がマイナスの場合は、分配金計算対象外とします。

巻末の「当資料のお取扱いにおけるご注意」をご確認ください。

クロッキー日本株プラス(3ヵ月決算型) 愛称 ダブルインカム

追加型投信/国内/株式/インデックス型

2016年7月

設定・運用は
BNPパリバ インベストメント・パートナーズ株式会社

クロッキー日本株プラス戦略の構成銘柄(30銘柄)



2016年7月末
(浮動株ベース)
出所 東京証券取引所
<http://www.jpix.co.jp/markets/indices/related/value/index.html>

| 証券コード | 銘柄 | 投資戦略 基準株価 | 目標株価 | 目標株価÷ 投資戦略 基準株価 | 7月19日終値 |
|--------|-------------------|--------------|--------|-----------------------|---------|
| 1928.T | 積水ハウス | 1,926 | 2,290 | 118.92% | 1,823 |
| 2502.T | アサヒグループホールディングス | 3,577 | 3,934 | 109.99% | 3,473 |
| 3382.T | セブン&アイホールディングス *1 | 4,763 | 5,205 | 109.29% | 4,543 |
| 4063.T | 信越化学工業 *1 | 6,215 | 6,842 | 110.08% | 6,326 |
| 4188.T | 三菱ケミカルホールディングス | 572 | 646 | 112.98% | 524 |
| 4503.T | アステラス製薬 | 1,479 | 1,616 | 109.29% | 1,661 |
| 4568.T | 第一三共 | 2,739 | 3,009 | 109.87% | 2,637 |
| 4911.T | 資生堂 | 2,446 | 2,822 | 115.38% | 2,925 |
| 5108.T | プリヂストン | 4,138 | 4,826 | 116.62% | 3,540 |
| 5713.T | 住友金属鉱山 | 1,137 | 1,314 | 115.59% | 1,213 |
| 5802.T | 住友電気工業 | 1,306 | 1,476 | 113.06% | 1,422 |
| 6273.T | SMC | 27,045 | 30,925 | 114.35% | 26,075 |
| 6367.T | ダイキン工業 | 8,822 | 9,905 | 112.27% | 9,278 |
| 6503.T | 三菱電機 | 1,239 | 1,384 | 111.73% | 1,278 |
| 6752.T | パナソニック | 952 | 1,098 | 115.26% | 996 |
| 6902.T | デンソー | 4,122 | 4,713 | 114.35% | 3,920 |
| 6954.T | ファナック | 16,200 | 18,511 | 114.26% | 17,290 |
| 6981.T | 村田製作所 | 12,880 | 15,407 | 119.62% | 12,950 |
| 6988.T | 日東電工 | 6,840 | 7,982 | 116.70% | 6,992 |
| 7201.T | 日産自動車 | 1,004 | 1,128 | 112.35% | 1,043 |
| 7202.T | いすゞ自動車 | 1,162 | 1,319 | 113.54% | 1,328 |
| 7203.T | トヨタ自動車 | 5,677 | 6,287 | 110.75% | 5,784 |
| 7269.T | スズキ | 2,929 | 3,366 | 114.92% | 3,134 |
| 7741.T | HOYA *1 | 4,041 | 4,491 | 111.12% | 3,815 |
| 8001.T | 伊藤忠商事 *1 | 1,382 | 1,561 | 112.98% | 1,319 |
| 8035.T | 東京エレクトロン | 7,150 | 8,089 | 113.14% | 9,184 |
| 9021.T | 西日本旅客鉄道 *1 | 6,668 | 7,390 | 110.82% | 6,716 |
| 9022.T | 東海旅客鉄道 | 19,450 | 21,483 | 110.45% | 19,325 |
| 9531.T | 東京瓦斯 | 441 | 486 | 110.08% | 451 |
| 9532.T | 大阪瓦斯 | 409 | 440 | 107.75% | 421 |
| | | | | 112.92% | |

上記の株価の円未満は四捨五入しています。

*1 戦略再構築時に組み入れた銘柄です。

戦略スポンサーのドイツ銀行グループによるコメント

7月上旬は、英国の欧州連合(EU)離脱の影響で円高が進行したことなどが懸念材料となり、国内株式市場は下落する局面が見られました。しかし、その後は、米国の雇用統計が堅調だったことや国内の参議院選挙で与党が圧勝したことなどが好感され、国内株式市場は反発しました。政府の経済対策や日銀の金融政策への期待も上昇要因となり、国内株式市場は前月より上昇した水準で当該期間*を終えました。当該期間の東証株価指数(TOPIX)の騰落率は6.71%でした。

7月19日時点の組み入れ銘柄数が多い業種は、電気機器(5銘柄)、輸送用機器(5銘柄)、化学(4銘柄)となっています。当該期間のクロッキー日本株プラス戦略に対する寄与度が高かった銘柄は、住友金属鉱山、スズキ、三菱ケミカルホールディングスでした。一方、寄与度が低かった銘柄は、積水ハウス、アステラス製薬、東京エレクトロンでした。

*当該期間とは、6月29日から7月19日を指します。(月中にユーロ円債を売却したため、7月19日までの状況について述べています。)

(戦略スポンサーのドイツ銀行グループから提供されたコメントを基に、当社が加筆・編集しました。)

上記の銘柄は説明のための表示であり、当社が特定の有価証券等の取得勧誘を行うものではありません。また将来のポートフォリオへの組入れを示唆または保証するものではありません。

巻末の「当資料のお取扱いにおけるご注意」をご確認ください。

クロッキー日本株プラス(3ヵ月決算型) 愛称 ダブルインカム

追加型投信/国内/株式/インデックス型

設定・運用は

BNPパリバ インベストメント・パートナーズ株式会社

ファンドの特色

- ①主として、ドイツ銀行ロンドン支店が発行するユーロ円債を投資対象とし、可能な限り高位に組入れることで、ドイツ銀行グループが独自に開発した投資手法に基づき計算されるクロッキー日本株プラス戦略のパフォーマンスに連動する投資成果をめざします。
- ②当該ユーロ円債は償還されるまで保有することを前提とし、ユーロ円債の銘柄入替えは行わないことを原則とします。ただし、投資するユーロ円債の発行体の信用状況が著しく悪化した場合、または債務不履行となった場合等には、委託会社の判断で当該ユーロ円債(以下、株価連動債ともいいます。)をすべて途中売却することがあり、その場合には信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ③なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

投資リスク

基準価額の変動要因

当ファンドは、主として特定の株価連動債に投資しますので、組入れた有価証券の価格の変動や、発行体の信用状況の悪化等の影響による基準価額の下落により、損失を被ることがあります。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割込むことがあります。また、ファンドの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。なお、投資信託は預貯金と異なります。

●主な変動要因

①一般的経済状況

市場及び投資資産は、金利、政府による政策や貿易、外国為替レートといったマクロ経済的な要因に影響を受ける可能性があります。かかる要因により予期せぬ変動が起こり、投資資産の価格自体だけでなくボラティリティにも影響が及ぶ可能性があります。

②市場リスク

上場、非上場にかかわらず、有価証券等への投資にはリスクが伴います。有価証券等の価格は経済状況や金利、証券の市場感応度の変化等により変動します。したがって、当ファンドの基準価額は、現在の当ファンドが置かれている投資環境により変動します。

③信用リスク

当ファンドが主要投資対象とする株価連動債は、その発行体や保証を与える金融機関の倒産や財務状況の悪化等によって当該債券の利息や償還金が支払われなくなる(債務不履行)リスクがあります。また株価連動債は「クロッキー日本株プラス戦略」で選定される株式について倒産や価格変動リスクがあります。発行者の経営・財務状況の変化及びそれらに対する外部評価の変化等により、当ファンドの基準価額も影響を受け、投資元本を下回る可能性があります。

④流動性リスク

- ・ 一般に、市場規模や取引量が小さい組入銘柄を売却する際に市場実勢から期待される価格で売買できない場合、不測の損失を被るリスクがあります。
- ・ 当ファンドが主要投資対象とする株価連動債は、当該債券の残存期間中における一部売却に関して、少なくとも当該債券の値付業者が当該債券を買取る形式が取られており、流動性の確保が図られております。ただし、当該債券の残存期間中における一部売却に当該債券の値付業者が対応できなくなることがあります。

⑤特定の債券への銘柄集中によるリスク

当ファンドは、原則として株価連動債を高位に組入れます。また、原則として設定時に一度組入れた銘柄は満期償還まで保有することから、複数銘柄に分散投資された投資信託に比べ、当該債券が及ぼす基準価額への影響が強くなります。信用リスクが顕在化した場合など、流動性が低くなるため当該債券の一部売却ができなくなり、そのために当ファンドの価額が下落する可能性があります。

⑥価格変動リスク

当ファンドが主要投資対象とする株価連動債は、株価の下落及び信用状況により価格が下落するリスクがあります。当該債券が値下がりがりした場合、当ファンドの基準価額が下落し、当初元本を下回る可能性があります。

※基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。

収益分配金に関する留意事項

○分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

○分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

○投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり量が小さかった場合も同様です。

巻末の「当資料のお取扱いにおけるご注意」をご確認ください。

クロッキー日本株プラス(3ヵ月決算型) 愛称 ダブルインカム

追加型投信/国内/株式/インデックス型

設定・運用は
BNPパリバ インベストメント・パートナーズ株式会社

お申込みメモ

商品分類 追加型投信/国内/株式/インデックス型

ご購入について

購入申込受付 原則として、販売会社の営業日の午後3時までに販売会社が受け付けた分を当日のお申込みとします。当該時刻を過ぎての申込みは、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。

購入単位 購入単位の詳細は、お取扱いの販売会社にお問い合わせください。

購入価額 購入申込受付日の翌営業日の基準価額

信託期間について

信託期間 設定日(2006年7月31日)から2016年8月1日まで

決算日 年4回(原則として毎年3月、6月、9月、12月の5日)。休業日場合は、翌営業日を決算日とします。

収益分配 毎決算時に、信託約款に定める収益分配方針に基づき分配します。ただし、委託会社の判断により、分配を行わないこともあります。

ご換金について

換金申込受付 原則として、販売会社の営業日の午後3時までに販売会社が受け付けた分を当日のお申込みとします。当該時刻を過ぎての申込みは、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。

換金価額 換金申込受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した額

換金単位 換金単位の詳細は、お取扱いの販売会社にお問い合わせ下さい。

換金代金 原則として、換金申込受付日から起算して5営業日目から、お申込みの販売会社においてお支払いします。
※受益権の買取りによる換金については、販売会社にお問い合わせください。

課税関係

原則として、収益分配時の普通分配金ならびに換金時および償還時の差益(譲渡益)に対して課税されます。課税上は株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、NISA(少額投資非課税制度)及びジュニアNISA(未成年者少額投資非課税制度)の適用対象です。配当控除、益金不算入制度の適用はありません。
※詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。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。

繰上償還

受益権の口数が10億円を下回るようになった場合、やむを得ない事情が発生した場合等は、繰上償還となる場合があります。

ファンドの費用

お申込み時や保有期間中には以下の諸費用を投資者の皆さまにご負担いただきます。

①投資者の皆様にご負担いただく費用

ご購入時:

購入時手数料 購入申込受付日の翌営業日の基準価額に**3.24%(税抜3.0%)**を上限として販売会社が定めた料率を乗じて得た額(1口当たり)
※お取扱いは販売会社によって異なります。販売会社にお問い合わせください。

ご換金時:

信託財産留保額 換金申込受付日の翌営業日の基準価額に**0.5%**を乗じて得た額

②保有期間中に間接的にご負担いただく費用

**運用管理費用
(信託報酬)**

ファンドの純資産総額に年率**1.242%(税抜1.15%)**を乗じて得た額
投資対象である株価連動債(ドイツ銀行ロンドン支店が発行するユーロ円債)は、時価に対して年間1%(クロッキー日本株プラス戦略のメンテナンスや維持管理コストとして)の費用がかかります。信託報酬及びこの費用の合計は年率**2.242%**になりますが、株価連動債の組み入れ状況により合計数値は変動します。

**その他の費用・
手数料**

信託事務の諸費用: ファンドの財務諸表の監査に要する費用、法定書類の作成・印刷費用等
上記以外の費用・手数料: ファンドの組入る有価証券等の売買に係る売買手数料等

※その他の費用・手数料については、運用資産の状況等により異なるものであるため、事前に料率、上限等を表示することができません。

※当ファンドの手数料等の合計額については、ファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することができません。
ご購入の際は、投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

巻末の「当資料のお取扱いにおけるご注意」をご確認ください。

クロッキー日本株プラス(3ヵ月決算型) 愛称 ダブルインカム

追加型投信/国内/株式/インデックス型

設定・運用は
BNPパリバ インベストメント・パートナーズ株式会社

販売会社情報

| 販売会社 | 登録番号 | 加入協会 | | | |
|------------------------------|----------|------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| | | 日本証券業協会 | 一般社団法人日本投資顧問業協会 | 一般社団法人金融先物取引業協会 | 一般社団法人第二種金融商品取引業協会 |
| 安藤証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 東海財務局長(金商)第1号 | ○ | | |
| 株式会社池田泉州銀行 | 登録金融機関 | 近畿財務局長(登金)第6号 | ○ | ○ | |
| 池田泉州TT証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 近畿財務局長(金商)第370号 | ○ | | |
| 今村証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 北陸財務局長(金商)第3号 | ○ | | |
| エース証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 近畿財務局長(金商)第6号 | ○ | | |
| SMBC日興証券株式会社 (ダイレクトコース専用) | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第2251号 | ○ | ○ | ○ |
| 株式会社SBI証券 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第44号 | ○ | ○ | ○ |
| 株式会社愛媛銀行 | 登録金融機関 | 四国財務局長(登金)第6号 | ○ | | |
| 株式会社大垣共立銀行 | 登録金融機関 | 東海財務局長(登金)第3号 | ○ | ○ | |
| 香川証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 四国財務局長(金商)第3号 | ○ | | |
| 木村証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 東海財務局長(金商)第6号 | ○ | | |
| 株式会社荘内銀行 | 登録金融機関 | 東北財務局長(登金)第6号 | ○ | | |
| スルガ銀行株式会社 | 登録金融機関 | 東海財務局長(登金)第8号 | ○ | | |
| ドイツ証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第117号 | ○ | ○ | ○ |
| 第四証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第128号 | ○ | | |
| 西村証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 近畿財務局長(金商)第26号 | ○ | | |
| ニューズ証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第138号 | ○ | | |
| 八十二証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第21号 | ○ | ○ | |
| ばんせい証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第148号 | ○ | | |
| 三田証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第175号 | ○ | | |
| 株式会社福岡銀行 | 登録金融機関 | 福岡財務支局長(登金)第7号 | ○ | ○ | |
| 楽天証券株式会社 | 金融商品取引業者 | 関東財務局長(金商)第195号 | ○ | ○ | ○ |

委託会社、その他の関係法人

委託会社: BNPパリバ インベストメント・パートナーズ株式会社
(信託財産の運用の指図、投資信託説明書(目論見書)および運用報告書の作成などを行います。)
金融商品取引業者、関東財務局長(金商)第378号
加入協会/一般社団法人投資信託協会、一般社団法人日本投資顧問業協会、
一般社団法人第二種金融商品取引業協会

受託会社: 三井住友信託銀行株式会社(信託財産の保管、管理業務を行います。)

販売会社: 上記の販売会社情報をご参照ください。また、BNPパリバ インベストメント・パートナーズ株式会社のホームページ(<http://www.bnpparibas-ip.jp/>)にて販売会社をご覧になれます。(募集の取扱い、一部解約の請求の受付、償還金および一部解約金の支払、投資信託説明書(交付目論見書)の提供などを行います。)

当資料のお取扱いにおけるご注意

〈投資信託の商品性に関する注意事項〉

投資信託は、その商品性から次の特徴をご理解のうえお申込みくださいますようお願い申し上げます。投資信託は預金ではありません。投資信託は預金保険機構または保険契約者保護機構の保護の対象とはなりません。投資信託は元本および利息を保証する商品ではありません。投資信託の設定・運用は投資信託委託会社が行います(販売会社は販売の窓口となります)。投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託をご購入のお客様が負うこととなります。銀行等の登録金融機関でご購入いただいた投資信託は、日本投資者保護基金の補償対象とはなりません。

本資料はBNPパリバ インベストメント・パートナーズ株式会社が2016年8月に作成したものです。投資信託及び投資法人に関する法律に基づく運用報告書ではありません。本資料における統計等は、当社が信頼できるとされる外部情報等に基づいて作成しておりますが、その正確性や完全性を保証するものではありません。本資料中の情報は作成時点のものであり、予告なく変更する場合があります。本資料中の過去の実績に関する数値、図表、見解や予測などを含むいかなる内容も将来の運用成績を保証するものではありません。本資料で使用している指数等に係る著作権等の知的財産権、その他一切の権利は、当該指数等の開発元または公表元に帰属します。

当ページの「当資料のお取扱いにおけるご注意」をご確認ください。