

第12回 公社債投資信託

運用報告書(全体版)

第59期（決算日2020年12月21日）

作成対象期間（2019年12月20日～2020年12月21日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●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／債券
信託期間	無期限とします。
運用方針	公社債への投資により、安定した収益の確保を目指して安定運用を行います。また、各前期末までに金利水準、想定されるポートフォリオのインカム収入等を基に、各期の目標分配額を定め、その目標分配額の実現を目指して運用を行うことを基本とします。
主な投資対象	円建ての公社債（国債、政府保証債、地方債、金融債、事業債等）を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	年1回決算を行い、決算日の分配前の基準価額が元本（1万口当たり1万円）を超過する分を原則として全額分配します。決算日の分配前の基準価額が元本を下回っている場合、分配を行いません。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104
〈受付時間〉営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近3期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価 額			新株予約権付社債 (転換社債) 組 入 比 率	債 組 入 比 率	純 資 産 額	
		税 分	込 配	み 金				期 騰 落 中 率
	円		円 銭		%	%	百万円	
57期(2018年12月19日)	9,998		0.00		0.0	—	56.2	58,980
58期(2019年12月19日)	9,997		0.00		△0.0	—	78.6	54,642
59期(2020年12月21日)	9,996		0.00		△0.0	—	77.0	51,279

*当ファンドは、決算時の元本の安定性に最大限配慮しつつ、目標分配額の実現を目指して運用を行なうことを基本としており、ベンチマーク等はありません。

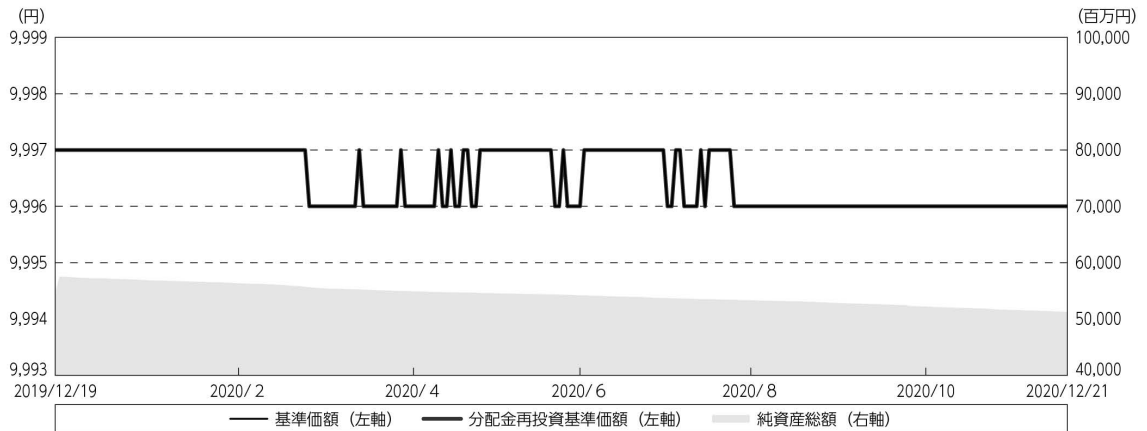
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		新株予約権付社債 (転換社債) 組 入 比 率	債 組 入 比 率	券 率
		騰 落	率			
(期 首) 2019年12月19日	円		%			%
	9,997		—		—	78.6
12月末	9,997		0.0		—	78.6
2020年1月末	9,997		0.0		—	79.9
2月末	9,997		0.0		—	83.5
3月末	9,996		△0.0		—	86.1
4月末	9,996		△0.0		—	86.7
5月末	9,997		0.0		—	83.4
6月末	9,996		△0.0		—	86.4
7月末	9,996		△0.0		—	86.3
8月末	9,996		△0.0		—	85.8
9月末	9,996		△0.0		—	81.6
10月末	9,996		△0.0		—	79.7
11月末	9,996		△0.0		—	78.6
(期 末) 2020年12月21日	9,996		△0.0		—	77.0

*騰落率は期首比です。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：9,997円

期 末：9,996円（既払分配金（税込み）：0円00銭）

騰落率：△0.0%（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。作成期首（2019年12月19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）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。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

（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

投資している短期有価証券やコール・ローンなどのマイナス金利環境を要因とする支払利息等。

○投資環境

国内経済は、2020年2月以降、新型コロナウイルスの感染拡大により、個人消費を始め、輸出入や生産が減少するとともに、企業収益が急速に悪化しましたが、その後は徐々に消費や生産に持ち直しの動きも出始めました。このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、3月および4月には資産買入の拡大などの金融緩和策を決定しました。

1年国債金利は、2020年2月以降、世界的な景気減速懸念の広がりから一時的に-0.3%程度まで低下する局面もありましたが、概ね-0.1%台で推移しました。

○当ファンドのポートフォリオ

決算時の元本の安定性に最大限配慮し、運用致しました。

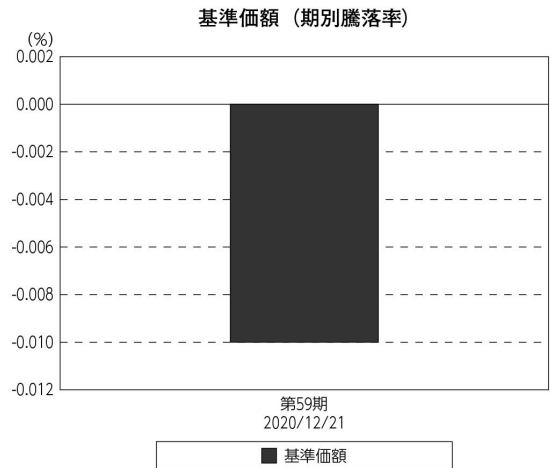
ポートフォリオに関しては、A格以上の信用力の高い発行体が発行する債券やコマーシャル・ペーパー（CP）を中心に組み入れるとともに、コール・ローン等で流動性を確保しました。

期末時点における組入比率は債券77.0%、CP19.5%となり、ポートフォリオの平均残存期間は0.44年となりました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、決算時の元本の安定性に最大限配慮しつつ、目標分配額の実現を目指して運用を行なうことを基本としており、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

◎分配金

決算時の純資産総額が元本の額を下回ったことから、分配を行ないませんでした。

◎今後の運用方針

当ファンドは安定した収益の確保を目指し、安定運用を行なうという方針のもと、残存1年以内の公社債を中心にポートフォリオを構築することを基本とします。

日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、残存期間1年以内の公社債を中心に短期金融資産も含めマイナス幅の小さい投資対象を選定し、運用することを目指します。

マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

また、第60期の目標分配額は1万口当たり0円程度と致しました。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

※マイナス利回りの資産への投資等を通じてファンド全体の損益がマイナスとなった場合は、ファンドの基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年12月20日～2020年12月21日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 0	% 0.001	(a) 信託報酬 = 1 万口当たり元本 × 信託報酬率
(投 信 会 社)	(0)	(0.000)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
(販 売 会 社)	(0)	(0.001)	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および事務手続き等
(受 託 会 社)	(0)	(0.000)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.001	(b) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(0)	(0.001)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.000)	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)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	0	0.002	
期中の平均基準価額は、9,996円です。			

* 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。

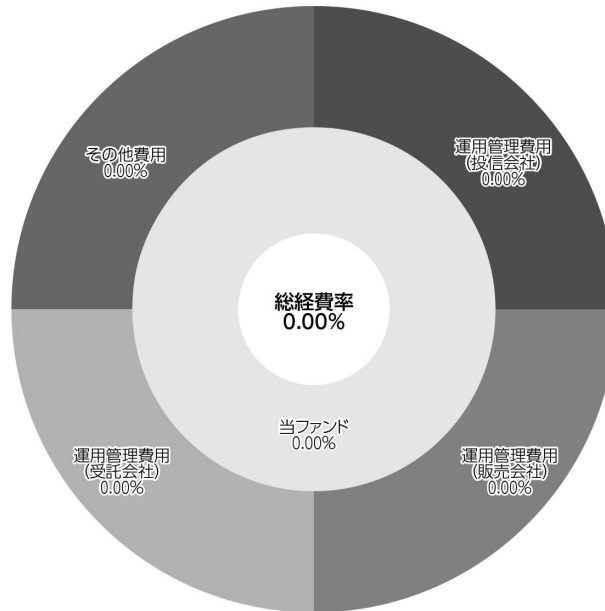
* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 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。

(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口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.00%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、売買委託手数料及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12月20日～2020年12月21日)

公社債

		買付額	売付額
国内	地方債証券	千円 16,244,522	千円 — (9,450,000)
	特殊債券	17,173,067	— (24,050,000)
	社債券(投資法人債券を含む)	13,435,135	— (16,650,000)

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

*()内は償還等による増減分です。

*社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

その他有価証券

		買付額	売付額
国内	コマーシャル・ペーパー	千円 44,999,673	千円 — (46,000,000)

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

*()内は償還等による増減分です。

○利害関係人との取引状況等

(2019年12月20日～2020年12月21日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
公社債	百万円 1,603	% 3.4	百万円 —	百万円 —	% —	—

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野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

国内公社債

(A) 国内（邦貨建）公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	11,669,120 (11,669,120)	11,709,169 (11,709,169)	22.8 (22.8)	— (—)	— (—)	— (—)	22.8 (22.8)
特殊債券 (除く金融債)	8,100,000 (8,100,000)	8,113,295 (8,113,295)	15.8 (15.8)	— (—)	— (—)	— (—)	15.8 (15.8)
金融債券	8,640,000 (8,640,000)	8,642,036 (8,642,036)	16.9 (16.9)	— (—)	— (—)	— (—)	16.9 (16.9)
普通社債券 (含む投資法人債券)	11,000,000 (11,000,000)	11,005,991 (11,005,991)	21.5 (21.5)	— (—)	— (—)	— (—)	21.5 (21.5)
合 計	39,409,120 (39,409,120)	39,470,492 (39,470,492)	77.0 (77.0)	— (—)	— (—)	— (—)	77.0 (77.0)

* ()内は非上場債で内書きです。

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B) 国内(邦貨建) 公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
東京都	公募第694回	1.35	100,000	100,329	2021/3/19
東京都	公募第698回	1.05	200,000	201,020	2021/6/18
東京都	公募(7年)第6回	0.316	200,000	200,429	2021/9/17
北海道	公募(5年)平成28年度第5回	0.001	300,000	300,046	2021/7/29
北海道	公募(5年)平成28年度第7回	0.001	100,000	99,978	2021/9/24
神奈川県	公募第183回	1.2	100,000	100,593	2021/6/18
神奈川県	公募(5年)第69回	0.001	100,000	99,986	2021/9/17
大阪府	公募第353回	1.06	200,000	201,645	2021/9/29
大阪府	公募第355回	1.04	250,000	252,358	2021/11/29
大阪府	公募第356回	1.06	100,000	101,046	2021/12/27
大阪府	公募(5年)第125回	0.101	1,250,000	1,250,016	2020/12/25
大阪府	公募(5年)第131回	0.001	500,000	500,034	2021/6/29
大阪府	公募(5年)第132回	0.001	600,000	600,061	2021/7/28
京都府	公募平成23年度第4回	1.09	116,120	117,035	2021/9/16
京都府	公募平成28年度第6回	0.001	100,000	99,986	2021/9/16
兵庫県	公募(5年)平成27年度第17回	0.02	100,000	100,007	2021/3/22
兵庫県	公募(7年)第3回	0.31	100,000	100,185	2021/7/15
静岡県	公募平成22年度第13回	1.316	100,000	100,328	2021/3/24
静岡県	公募平成23年度第1回	1.385	100,000	100,450	2021/4/21
静岡県	公募(5年)平成28年度第6回	0.001	200,000	199,973	2021/9/17
愛知県	公募平成23年度第1回	1.38	100,000	100,475	2021/4/28
愛知県	公募(5年)平成28年度第10回	0.001	200,000	199,969	2021/10/14
広島県	公募平成23年度第3回	1.1	200,000	201,648	2021/9/27
福岡県	公募平成23年度第5回	1.02	100,000	100,844	2021/10/25
千葉県	公募平成22年度第14回	1.33	360,000	361,192	2021/3/25
千葉県	公募平成23年度第4回	1.1	100,000	100,821	2021/9/24
茨城県	公募平成28年度第1回	0.001	100,000	99,984	2021/8/25
岐阜県	公募平成23年度第1回	1.01	250,000	251,997	2021/9/30
共同発行市場地方債	公募第95回	1.28	100,000	100,229	2021/2/25
共同発行市場地方債	公募第96回	1.29	200,000	200,660	2021/3/25
共同発行市場地方債	公募第97回	1.38	259,000	260,188	2021/4/23
共同発行市場地方債	公募第102回	1.03	100,000	100,791	2021/9/24
共同発行市場地方債	公募第103回	1.0	200,000	201,655	2021/10/25
熊本県	公募平成23年度第2回	1.0	100,000	100,835	2021/10/28
奈良県	公募平成28年度第1回	0.001	100,000	100,024	2021/11/30
浜松市	公募平成23年度第1回	1.045	200,000	201,904	2021/11/25
大阪市	公募(5年)平成27年度第7回	0.101	1,400,000	1,400,264	2021/1/26
大阪市	公募(5年)平成28年度第3回	0.001	100,000	99,981	2021/9/28
名古屋市	公募(5年)第24回	0.001	200,000	199,977	2021/10/13
京都市	公募平成28年度第3回	0.001	100,000	99,984	2021/9/29
横浜市	公募(5年)第44回	0.01	300,000	299,988	2021/5/24
札幌市	公募平成23年度第6回	1.01	100,000	100,754	2021/9/17
川崎市	公募(15年)第4回	2.11	400,000	408,356	2021/12/20
川崎市	公募(5年)第48回	0.001	184,000	183,975	2021/9/17
北九州市	公募(5年)平成28年度第3回	0.001	100,000	99,974	2021/9/28
福岡市	公募平成23年度第6回	1.0	500,000	504,205	2021/10/28

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
仙台市 公募平成27年度第1回	0.101	400,000	400,055	2021/1/27
さいたま市 公募第9回	1.06	100,000	101,047	2021/12/22
鹿児島県 公募(5年)平成28年度第1回	0.001	100,000	99,982	2021/10/29
徳島県 公募平成23年度第1回	1.02	200,000	201,884	2021/11/30
小 計		11,669,120	11,709,169	
特殊債券(除く金融債)				
日本政策投資銀行社債 財投機関債第90回	0.001	300,000	300,024	2021/6/18
日本政策投資銀行社債 財投機関債第94回	0.001	200,000	199,985	2021/9/17
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第73回	1.14	300,000	301,680	2021/6/18
地方公共団体金融機構債券 第20回	1.28	500,000	500,688	2021/1/28
地方公共団体金融機構債券 第24回	1.208	100,000	100,528	2021/5/28
地方公共団体金融機構債券 第25回	1.178	300,000	301,823	2021/6/28
地方公共団体金融機構債券 第28回	1.048	100,000	100,795	2021/9/28
首都高速道路 第17回	0.03	200,000	200,053	2021/6/18
首都高速道路 第18回	0.03	400,000	400,154	2021/9/17
阪神高速道路 第19回	0.02	100,000	100,004	2021/12/20
日本政策金融公庫社債 第71回財投機関債	0.001	100,000	99,986	2021/8/9
日本政策金融公庫社債 第79回財投機関債	0.001	600,000	599,921	2021/8/9
日本政策金融公庫社債 第81回財投機関債	0.001	400,000	399,968	2021/11/8
都市再生債券 財投機関債第52回	1.218	200,000	201,196	2021/6/18
福祉医療機構債券 第55回財投機関債	0.001	100,000	99,985	2021/12/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第67回	1.478	300,000	301,456	2021/4/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第86回	1.046	100,000	100,767	2021/9/17
日本学生支援債券 財投機関債第54回	0.001	100,000	100,007	2021/2/19
日本学生支援債券 財投機関債第55回	0.001	800,000	800,032	2021/6/18
日本学生支援債券 財投機関債第57回	0.001	100,000	99,986	2021/11/19
東日本高速道路 第36回	0.06	1,000,000	1,000,378	2021/6/18
東日本高速道路 第37回	0.03	200,000	200,027	2021/6/18
東日本高速道路 第38回	0.03	200,000	200,032	2021/9/17
中日本高速道路社債 第33回	1.084	300,000	302,383	2021/9/17
中日本高速道路社債 第39回	1.057	100,000	101,039	2021/12/20
中日本高速道路社債 第59回	0.309	100,000	100,292	2021/12/20
中日本高速道路 第64回	0.06	100,000	100,026	2021/5/31
中日本高速道路 第65回	0.03	500,000	500,065	2021/7/14
中日本高速道路 第66回	0.03	100,000	100,004	2021/9/28
中日本高速道路 第67回	0.03	100,000	100,016	2021/9/17
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第94回	0.001	100,000	99,985	2021/12/20
小 計		8,100,000	8,113,295	
金融債券				
商工債券 利付第787回い号	0.22	400,000	400,025	2020/12/25
商工債券 利付第789回い号	0.05	110,000	110,010	2021/2/26
商工債券 利付第792回い号	0.04	100,000	100,017	2021/5/27
商工債券 利付第795回い号	0.03	100,000	100,010	2021/8/27
商工債券 利付第797回い号	0.03	100,000	100,007	2021/10/27
農林債券 利付第794回い号	0.01	610,000	609,982	2021/7/27
農林債券 利付第797回い号	0.03	100,000	100,015	2021/10/27
農林債券 利付第798回い号	0.03	200,000	200,026	2021/11/26
農林債券 利付第799回い号	0.04	400,000	400,056	2021/12/27

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
金融債券	%	千円	千円	
しんきん中金債券 利付第313回	0.225	800,000	800,066	2020/12/25
しんきん中金債券 利付第316回	0.07	100,000	99,993	2021/3/26
しんきん中金債券 利付第317回	0.06	400,000	399,980	2021/4/27
しんきん中金債券 利付第318回	0.04	300,000	300,040	2021/5/27
しんきん中金債券 利付第319回	0.03	320,000	320,041	2021/6/25
しんきん中金債券 利付第320回	0.01	500,000	500,000	2021/7/27
しんきん中金債券 利付第321回	0.03	300,000	300,061	2021/8/27
しんきん中金債券 利付第323回	0.03	1,000,000	1,000,358	2021/10/27
しんきん中金債券 利付第325回	0.04	200,000	200,028	2021/12/27
しんきん中金債券 利付第326回	0.05	200,000	200,064	2022/1/27
商工債券 利付(3年)第216回	0.12	400,000	400,060	2021/1/27
商工債券 利付(3年)第217回	0.12	200,000	200,040	2021/2/26
商工債券 利付(3年)第218回	0.12	100,000	100,006	2021/3/26
商工債券 利付(3年)第220回	0.11	400,000	400,153	2021/5/27
商工債券 利付(3年)第223回	0.11	900,000	900,701	2021/8/27
商工債券 利付(3年)第224回	0.11	300,000	300,213	2021/9/27
商工債券 利付(3年)第225回	0.11	100,000	100,074	2021/10/27
小計		8,640,000	8,642,036	
普通社債券(含む投資法人債券)				
中国電力 第330回	2.1	100,000	100,537	2021/3/25
中国電力 第379回	0.619	600,000	600,359	2021/1/25
東北電力 第473回	0.597	100,000	100,200	2021/4/23
豊田通商 第16回社債間限定同順位特約付	1.35	100,000	101,195	2021/12/8
三菱東京UFJ銀行 第130回特定社債間限定同順位特約付	1.12	100,000	100,839	2021/10/20
東京センチュリーリース 第16回社債間限定同順位特約付	0.2	200,000	199,966	2021/4/14
トヨタファイナンス 第70回社債間限定同順位特約付	0.04	500,000	500,096	2021/4/26
三井住友ファイナンス&リース 第9回社債間限定同順位特約付	0.518	200,000	200,097	2021/1/29
三菱UFJリース 第27回社債間限定同順位特約付	0.508	200,000	200,171	2021/2/24
三菱地所 第115回担保提供制限等財務上特約無	0.54	200,000	200,233	2021/3/15
東日本旅客鉄道 第111回社債間限定同順位特約付	0.16	400,000	400,065	2021/1/28
日本電信電話 第61回	1.21	500,000	501,474	2021/3/19
日本電信電話 第62回	1.02	100,000	100,754	2021/9/17
mitsubishi UFJ LEASE & FINANCE	0.02	500,000	500,000	2021/1/6
mitsubishi UFJ LEASE & FINANCE	0.02	400,000	400,000	2021/1/22
mitsubishi UFJ LEASE & FINANCE	0.02	100,000	100,000	2021/2/26
TOKYO CENTURY CORPORATION	0.02	100,000	100,000	2021/3/23
SUMITOMO MITSUI FINANCE AND LE	0.02	300,000	300,000	2021/3/23
SUMITOMO MITSUI FINANCE AND LE	0.03	900,000	900,000	2021/6/8
mitsubishi UFJ LEASE & FINANCE	0.02	700,000	700,000	2021/6/8
mitsubishi UFJ LEASE & FINANCE	0.02	500,000	500,000	2021/6/25
SUMITOMO MITSUI FINANCE AND LE	0.025	400,000	400,000	2021/6/25
SUMITOMO MITSUI FINANCE AND LE	0.02	100,000	100,000	2021/7/27
SUMITOMO MITSUI FINANCE AND LE	0.01	700,000	700,000	2021/10/19
mitsubishi UFJ LEASE & FINANCE	0.01	700,000	700,000	2021/11/5
mitsubishi UFJ LEASE & FINANCE	0.01	200,000	200,000	2021/11/18
mitsubishi UFJ LEASE & FINANCE	0.01	600,000	600,000	2021/11/19
SUMITOMO MITSUI FINANCE AND LE	0.01	1,100,000	1,100,000	2021/11/24

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
SUMITOMO MITSUI FINANCE AND LE	0.01	400,000	400,000	2021/12/14
小 計		11,000,000	11,005,991	
合 計		39,409,120	39,470,492	

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

国内その他有価証券

区 分	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 9,999,970	% 19.5

*比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2020年12月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 39,470,492	% 73.3
その他有価証券	9,999,970	18.6
コール・ローン等、その他	4,363,552	8.1
投資信託財産総額	53,834,014	100.0

*金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12月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	53,834,014,350
コール・ローン等	4,334,731,912
地方債証券(評価額)	11,709,169,356
特殊債証券(評価額)	16,755,332,189
社債証券(評価額)	11,005,991,069
その他有価証券	9,999,970,586
未収利息	25,686,996
前払費用	3,132,242
(B) 負債	2,554,440,620
未払金	2,500,054,863
未払解約金	53,775,458
未払信託報酬	601,549
未払利息	2,876
その他未払費用	5,874
(C) 純資産総額(A-B)	51,279,573,730
元本	51,300,150,076
次期繰越損益金	△ 20,576,346
(D) 受益権総口数	51,300,150,076口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,996円

(注) 期首元本額は54,658,610,881円、期中追加設定元本額は2,920,773,570円、期中一部解約元本額は6,279,234,375円、1口当たり純資産額は0.9996円です。

○損益の状況 (2019年12月20日～2020年12月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 受取利息等収益	164,841,133
受取利息	166,374,319
その他収益金	208,845
支払利息	△ 1,742,031
(B) 有価証券売買損益	△169,209,737
売買益	918,912
売買損	△170,128,649
(C) 信託報酬等	△ 1,391,403
(D) 当期利益(A+B+C)	△ 5,760,007
(E) 前期繰越損益金	△ 15,202,311
(F) 追加信託差損益金	△ 1,510,488
(G) 解約差損益金	1,896,460
(H) 計(D+E+F+G)	△ 20,576,346
(I) 収益分配金	0
次期繰越損益金(H+I)	△ 20,576,346

*損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金 (税込み)	0円00銭0厘
-----------------	---------

○お知らせ

該当事項はございません。