

ノムラ・ボンド・インカム・オープン

運用報告書(全体版)

第96期（決算日2022年6月21日） 第97期（決算日2022年9月21日）

作成対象期間（2022年3月23日～2022年9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／内外／債券
信託期間	1998年7月30日から2026年3月23日までです。
運用方針	公社債への投資にあたっては、ソブリン債および国際機関の発行した債券を中心とした優良クレジットの債券に分散投資することを基本とします。ポートフォリオのデュレーションは、原則として概ね1～3年程度で4年を超えない範囲内に維持することを基本とします。 カントリーアロケーション、デュレーションおよび為替ヘッジ比率をアクティブに変更することで収益の獲得を目指します。先物取引等も適宜活用します。
主な投資対象	日本を含む世界先進主要国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への直接投資は行いません。株式への投資は転換社債を転換および新株予約権を行使したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の10%未満とします。
分配方針	年4回の毎決算時に、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益等から基準価額の水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行いません。

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10期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	基準価額			ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	純資産額
		税込 分配 金	期騰 落	中 率	FTSE世界国債 インデックス(1-3年) 為替100%ヘッジ	期騰 落			
	円	円	%		%	%	%	百万円	
88期(2020年6月22日)	8,079	10	0.4	116.55	0.2	91.0	—	4,242	
89期(2020年9月23日)	8,104	10	0.4	116.66	0.1	72.7	—	4,184	
90期(2020年12月21日)	8,131	10	0.5	116.60	△0.0	75.6	—	4,156	
91期(2021年3月22日)	8,068	10	△0.7	116.43	△0.2	80.4	—	4,128	
92期(2021年6月21日)	8,033	10	△0.3	116.26	△0.1	81.3	—	4,063	
93期(2021年9月21日)	7,991	10	△0.4	116.35	0.1	89.6	—	3,938	
94期(2021年12月21日)	7,937	10	△0.6	115.82	△0.5	75.6	—	3,837	
95期(2022年3月22日)	7,868	10	△0.7	113.87	△1.7	77.8	—	3,763	
96期(2022年6月21日)	7,749	10	△1.4	112.06	△1.6	79.8	—	3,661	
97期(2022年9月21日)	7,706	10	△0.4	110.95	△1.0	90.7	—	3,605	

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

* FTSE世界国債インデックス（1-3年）は、FTSE Fixed Income LLCが開発した世界先進主要国短期国債（1-3年）市場全体のパフォーマンスを表す代表的な指数の一つです。ファンドは、当インデックスの対円で為替100%ヘッジベースをベンチマークとします。

* 当ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（1-3年）の各国別指数（現地通貨ベース）を用い、当社において円ヘッジベースに換算した指数です。なお、設定時を100として指数化しています。

* FTSE世界国債インデックス（1-3年）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスパンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(出所) FTSE Fixed Income LLC

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

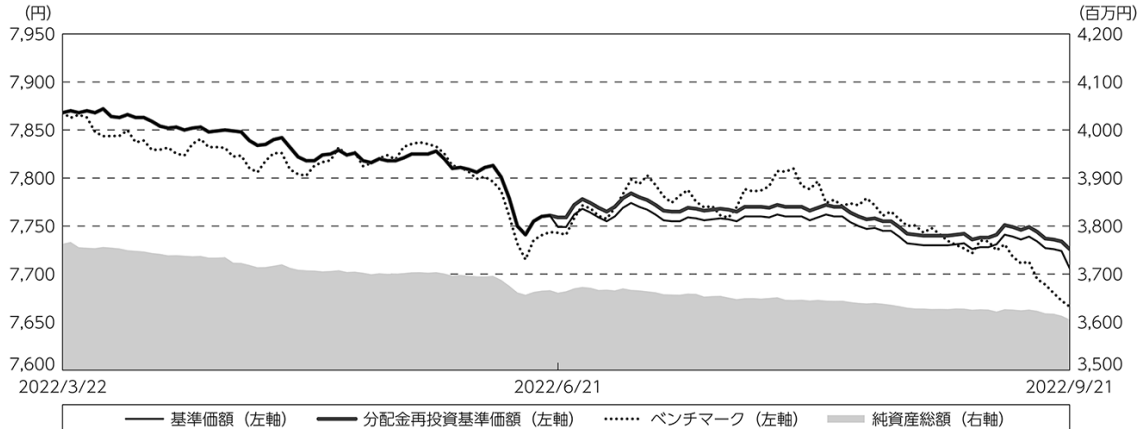
決算期	年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
		騰落率	FTSE世界国債 インデックス(1-3年) 為替100%ヘッジ	騰落率			
第96期	(期首) 2022年3月22日	円	%		%	%	%
		7,868	—	113.87	—	77.8	—
	3月末	7,863	△0.1	113.52	△0.3	79.4	—
	4月末	7,842	△0.3	113.26	△0.5	90.9	—
	5月末	7,828	△0.5	113.36	△0.4	86.6	—
	(期末) 2022年6月21日	7,759	△1.4	112.06	△1.6	79.8	—
第97期	(期首) 2022年6月21日	7,749	—	112.06	—	79.8	—
	6月末	7,760	0.1	112.43	0.3	84.2	—
	7月末	7,762	0.2	112.99	0.8	85.1	—
	8月末	7,731	△0.2	111.87	△0.2	89.3	—
	(期末) 2022年9月21日	7,716	△0.4	110.95	△1.0	90.7	—

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第96期首：7,868円

第97期末：7,706円 (既払分配金(税込み)：20円)

騰落率：△1.8% (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(2022年3月22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) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(1-3年)為替100%ヘッジです。ベンチマークは、作成期首(2022年3月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (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

基準価額は、当作成期首の7,868円から当作成期末には7,706円(分配後)となりました。なお、第96期に10円、第97期に10円の分配金をお支払いしましたので、分配金を考慮した値下がり額は142円となりました。

- (上昇) 債券を保有していたことによる、インカムゲイン(利息収入)。
- (下落) 組入れ債券の価格が下落したことによるキャピタルロス(値下がり損)。
- (下落) 対円で為替ヘッジを行なったことによるコスト(金利差相当分の費用)。

○投資環境

債券市場<債券利回りは米国、ドイツ、日本で上昇>

米国では、債券利回りは上昇（価格は下落）しました。FRB（米連邦準備制度理事会）はインフレ沈静化に向けて足元で大幅な利上げを継続しており、今後も金融引き締めの手を緩めない姿勢を見せたことで、債券利回りは上昇基調で推移しました。

ユーロ圏では、債券利回りは上昇しました。ロシアによるウクライナへの軍事侵攻によるエネルギー価格の高騰などからさらなるインフレ高進が想定される中、ECB（欧州中央銀行）は7月の会合にて0.50%の利上げを実施し、金融引き締めへの姿勢を明確にしたことなどを背景に、債券利回りには上昇圧力がかかりました。

日本では、債券利回りは上昇しました。世界的な債券利回り上昇の流れに連れて債券利回りが上昇しましたが、日銀による強力な金融緩和策の継続により、海外と比較すると利回り上昇幅は抑制されました。

為替市場<円に対して米ドル、ユーロは上昇>

金融緩和縮小・金融引き締めの動きが海外で加速する中においても日銀は強力な金融緩和を継続する姿勢を堅持しており、海外と日本の金融政策格差が浮き彫りとなった結果、米ドルやユーロは円に対して上昇（円安）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・組入債券について

債券組入比率：当作成期を通じて、概ね高めを維持しました。

債券の種類：組入債券の信用力に留意し、国債を中心に高格付け債券に投資しました。

・ファンド全体のデュレーション（※1）

<ファンドのデュレーション>

ファンド全体のデュレーションは、当作成期首から短期化しました。当作成期末において、ファンド全体のデュレーションはベンチマークに対して短期化としました。

（※1）デュレーションは、債券の利回り変化に対する価格変化の感応度を表し、数値が大きいほど利回り低下時の価格上昇率が大きくなり、利回り上昇時には価格下落率が大きくなります。

・為替のエクスポージャー（※2）

当作成期を通じて対円での全体の為替エクスポージャーは抑えめとしました。

（※2）為替エクスポージャーとは、外国債券を中心とした外貨建資産のうち、為替ヘッジを行っていない部分の純資産額に対する比率のことです。比率が高いほど円安時には為替差益が、円高時には為替差損が発生しやすくなります。当ファンドの為替エクスポージャーは最大限で20%までです（純資産の100%を外貨建てで保有した場合）。

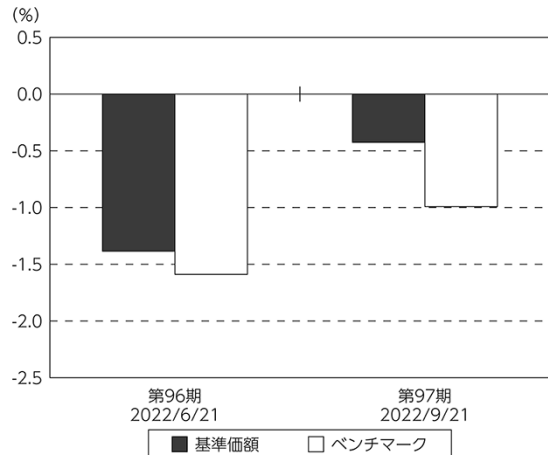
○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額（分配金再投資）の騰落率は-1.81%となり、ベンチマークの-2.57%を0.76ポイント上回りました。

(主なプラス要因)

世界的に債券利回りが上昇する局面で、デュレーションをベンチマークに比べ短期化していたこと。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（1-3年）を替100%ヘッジです。

○分配金

当作成期の収益分配金は、基準価額水準等を勘案し、経費控除後の利子・配当等収益等から1万口当たり、第96期10円、第97期10円とさせていただきます。なお、留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第96期	第97期
	2022年3月23日～ 2022年6月21日	2022年6月22日～ 2022年9月21日
当期分配金	10	10
(対基準価額比率)	0.129%	0.130%
当期の収益	10	1
当期の収益以外	—	8
翌期繰越分配対象額	2,184	2,176

(注) 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) 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

当ファンドは、国内外の金融市場について精緻な投資環境リサーチ及び分析を行ない、好収益が期待できる債券や為替市場への投資を行ないます。金利リスク・国別投資配分リスクに加えて、為替変動リスクもコントロールすることで、より分散されたポートフォリオ構築に努めて参ります。

米国では、高インフレを抑制すべくFRBが継続的な金融引き締めを行なうことで、債券利回りは上昇しやすいと予想します。欧州では、景気減速の動きが見られるものの、ECBによる金融引き締めに伴う債券利回り上昇圧力から、債券利回りは横ばい圏で推移すると予想します。日本では、今後も緩和的な日銀の金融政策が債券相場を下支えすると見込んでおり、債券利回りは低水準で推移しやすいと予想します。ファンド全体のデュレーションはベンチマークに対して短期化とする方針です。また、通貨配分については、ヘッジ比率の調整により円と米ドルをアンダーウェイト（ベンチマークに比べ低めの投資比率）、欧州通貨をオーバーウェイト（ベンチマークに比べ高めの投資比率）とします。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年3月23日～2022年9月21日)

項 目	第96期～第97期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 29	% 0.370	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(14)	(0.176)	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)	(13)	(0.165)	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)	(2)	(0.028)	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	1	0.009	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.008)	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)	(0.001)	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	30	0.379	
作成期間の平均基準価額は、7,797円です。			

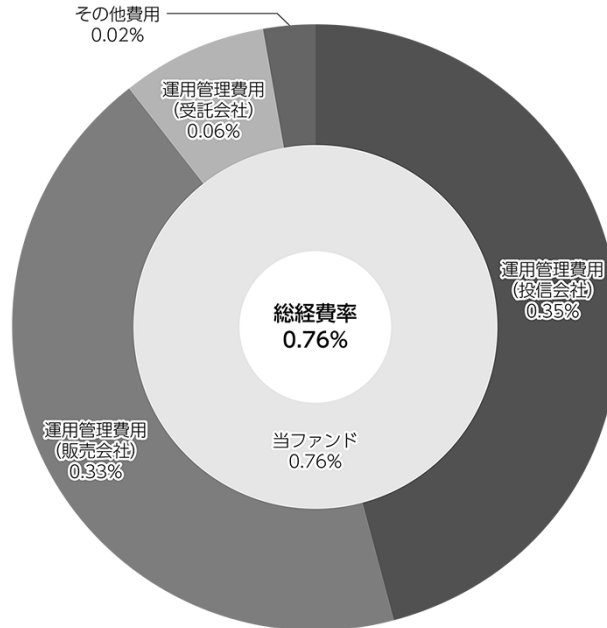
* 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 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）を作成期間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**

当作成期中の運用・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。）を作成期中の平均受益権口数に作成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0.76%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

(2022年3月23日～2022年9月21日)

公社債

			第96期～第97期		
			買付額	売付額	
国内	国債証券		千円 1,840,883	千円 101,084 (1,540,000)	
	アメリカ	国債証券	千米ドル 22,817	千米ドル 17,082	
外国	カナダ	国債証券	千カナダドル 708	千カナダドル —	
		地方債証券	—	(500)	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 2,184	千スウェーデンクローナ —	
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ	
		ドイツ	国債証券	—	704
		フランス	国債証券	954	397
		スペイン	国債証券	1,443	4,334
		ポーランド	国債証券	千ズロチ —	千ズロチ 2,745
		マレーシア	国債証券	千リンギ 1,487	千リンギ 2,862
		オーストラリア	国債証券	千豪ドル 751	千豪ドル —
特殊債券	—		(1,000)		
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ —	千メキシコペソ — (40,000)	

*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、上段の数字には含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2022年3月23日～2022年9月21日)

利害関係人との取引状況

区 分	第96期～第97期					
	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	%
公社債	5,430	600	11.0	3,318	—	—
為替直物取引	1,348	—	—	1,602	44	2.7

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、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2022年9月21日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	第97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	%	%	%	%	%
国債証券	1,400,000 (600,000)	1,403,742 (600,095)	38.9 (16.6)	— (—)	— (—)	— (—)	38.9 (16.6)
合 計	1,400,000 (600,000)	1,403,742 (600,095)	38.9 (16.6)	— (—)	— (—)	— (—)	38.9 (16.6)

* () 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。

* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

* 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	第97期末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫短期証券 第1099回		—	600,000	600,095	2022/11/7
国庫債券 利付(2年) 第433回		0.005	300,000	300,429	2024/2/1
国庫債券 利付(5年) 第139回		0.1	200,000	200,566	2024/3/20
国庫債券 利付(10年) 第332回		0.6	300,000	302,652	2023/12/20
合 計			1,400,000	1,403,742	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	第97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		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千米ドル 6,470	千米ドル 6,389	千円 918,390	% 25.5	% —	% 0.7	% —	% 24.7
カナダ	千カナダドル 3,230	千カナダドル 3,207	344,887	9.6	—	—	—	9.6
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 2,200	千スウェーデンクローナ 2,178	28,735	0.8	—	—	—	0.8
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
フランス	870	833	119,375	3.3	—	0.9	—	2.4
スペイン	1,720	1,518	217,462	6.0	—	1.5	2.6	1.9
マレーシア	千リンギ 1,300	千リンギ 1,284	40,423	1.1	—	0.3	—	0.8
中国	千人民元 6,000	千人民元 6,062	124,161	3.4	—	—	3.4	—
オーストラリア	千豪ドル 750	千豪ドル 745	71,658	2.0	—	—	—	2.0
合 計	—	—	1,865,094	51.7	—	3.5	6.1	42.2

*邦貨換算金額は、第97期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

*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。

*評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄			第97期末				償還年月日	
			利率	額面金額	評価額			
					外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円		
	国債証券	US TREASURY N/B	1.5	3,140	3,120	448,544	2023/1/15	
		US TREASURY N/B	0.5	3,130	3,082	443,056	2023/3/15	
		US TREASURY N/B	2.75	200	186	26,789	2032/8/15	
小	計					918,390		
カナダ				千カナダドル	千カナダドル			
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	0.25	730	707	76,074	2023/8/1	
	地方債証券	PROVINCE OF QUEBEC	3.5	2,500	2,499	268,812	2022/12/1	
小	計					344,887		
スウェーデン				千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ			
	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	1.5	2,200	2,178	28,735	2023/11/13	
小	計					28,735		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ			
	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	600	597	85,508	2023/2/25
			FRANCE (GOVT OF)	1.75	270	236	33,867	2039/6/25
	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	500	483	69,311	2024/5/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	700	666	95,490	2025/1/31
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.85	320	226	32,472	2037/7/30
			BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2	200	140	20,189	2040/10/31
小	計					336,838		
マレーシア				千リンギ	千リンギ			
	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	900	903	28,438	2023/3/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.582	400	380	11,985	2032/7/15	
小	計					40,423		
中国				千人民元	千人民元			
	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.69	6,000	6,062	124,161	2026/8/12	
小	計					124,161		
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル			
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	750	745	71,658	2024/4/21	
小	計					71,658		
合	計					1,865,094		

*邦貨換算金額は、第97期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年9月21日現在)

項 目	第97期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	3,268,837	86.4
コール・ローン等、その他	516,286	13.6
投資信託財産総額	3,785,123	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*第97期末における外貨建純資産（1,973,022千円）の投資信託財産総額（3,785,123千円）に対する比率は52.1%です。

*外貨建資産は、第97期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=143.73円、1カナダドル=107.53円、1英ポンド=163.54円、1スウェーデンクローナ=13.19円、1ノルウェークローネ=13.90円、1デンマーククローネ=19.26円、1ユーロ=143.21円、1ズロチ=30.2604円、1シンガポールドル=101.91円、1リンギ=31.4791円、1人民元=20.4786円、1豪ドル=96.16円、1メキシコペソ=7.1922円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第96期末	第97期末
	2022年6月21日現在	2022年9月21日現在
	円	円
(A) 資産	5,918,255,791	5,606,632,467
コール・ローン等	744,341,274	469,243,206
公社債(評価額)	2,921,113,037	3,268,837,007
未収入金	2,242,781,198	1,861,561,519
未収利息	3,979,600	5,722,878
前払費用	6,040,682	1,016,751
その他未収収益	—	251,106
(B) 負債	2,257,098,048	2,001,235,198
未払金	2,245,384,494	1,986,055,448
未払収益分配金	4,724,510	4,678,937
未払解約金	141,411	3,710,512
未払信託報酬	6,826,899	6,769,687
未払利息	384	439
その他未払費用	20,350	20,175
(C) 純資産総額(A-B)	3,661,157,743	3,605,397,269
元本	4,724,510,125	4,678,937,500
次期繰越損益金	△1,063,352,382	△1,073,540,231
(D) 受益権総口数	4,724,510,125口	4,678,937,500口
1万円当たり基準価額(C/D)	7,749円	7,706円

(注) 第96期首元本額は4,782,748,653円、第96～97期中追加設定元本額は68,717,488円、第96～97期中一部解約元本額は172,528,641円、1口当たり純資産額は、第96期0.7749円、第97期0.7706円です。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額552,852円。

○損益の状況

項 目	第96期	第97期
	2022年3月23日～ 2022年6月21日	2022年6月22日～ 2022年9月21日
	円	円
(A) 配当等収益	12,732,100	7,737,627
受取利息	12,567,800	7,533,739
その他収益金	268,141	245,463
支払利息	△ 103,841	△ 41,575
(B) 有価証券売買損益	△ 57,171,101	△ 16,586,962
売買益	287,255,019	145,855,615
売買損	△ 344,426,120	△ 162,442,577
(C) 信託報酬等	△ 6,968,741	△ 6,971,319
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 51,407,742	△ 15,820,654
(E) 前期繰越損益金	△ 426,245,273	△ 474,148,643
(F) 追加信託差損益金	△ 580,974,857	△ 578,891,997
(配当等相当額)	(815,682,102)	(809,397,586)
(売買損益相当額)	(△1,396,656,959)	(△1,388,289,583)
(G) 計(D+E+F)	△1,058,627,872	△1,068,861,294
(H) 収益分配金	△ 4,724,510	△ 4,678,937
次期繰越損益金(G+H)	△1,063,352,382	△1,073,540,231
追加信託差損益金	△ 580,974,857	△ 578,891,997
(配当等相当額)	(815,682,102)	(809,397,586)
(売買損益相当額)	(△1,396,656,959)	(△1,388,289,583)
分配準備積立金	216,446,439	208,919,553
繰越損益金	△ 698,823,964	△ 703,567,787

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

* 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。

* 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) 分配金の計算過程(2022年3月23日～2022年9月21日)は以下の通りです。

項 目	第96期	第97期
	2022年3月23日～ 2022年6月21日	2022年6月22日～ 2022年9月21日
a. 配当等収益(経費控除後)	5,763,359円	766,308円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	815,682,102円	809,397,586円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	215,407,590円	212,832,182円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,036,853,051円	1,022,996,076円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,194円	2,186円
g. 分配金	4,724,510円	4,678,937円
h. 分配金(1万口当たり)	10円	10円

○分配金のお知らせ

	第96期	第97期
1 万口当たり分配金 (税込み)	10円	10円

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。