

野村先進国ヘッジ付き債券ファンド (愛称:エンタメくん)

運用報告書(全体版)

第136期(決算日2022年3月14日) 第137期(決算日2022年4月13日) 第138期(決算日2022年5月13日)
第139期(決算日2022年6月13日) 第140期(決算日2022年7月13日) 第141期(決算日2022年8月15日)
作成対象期間(2022年2月15日～2022年8月15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	2010年11月10日以降、無期限とします。
運用方針	日本を含む世界主要国の国債への投資により、安定した収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行なうことを基本とします。 投資する債券は、主として、世界主要国のうち信用力が高い国(A格相当以上の長期債格付を有している国(格付のない場合には委託会社が当該格付と同等の信用度を有すると判断した国を含みます。))の国債、およびわが国の国債とします。 運用にあたっては、信用力、為替ヘッジ後の利回り水準に加え、経済ファンダメンタルズ、流動性等も加味して、投資対象国を原則として3カ国選定した上で、国別の投資比率が概ね均等となるように投資を行なうことを基本とします。 ただし、投資環境、資金動向、市況動向等によっては、投資対象国が3カ国とならない場合、国別の投資比率が概ね均等とならない場合があります。また、わが国の国債のみに投資を行なう場合があります。なお、投資対象国は定期的に見直すものとします。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。
主な投資対象	日本を含む世界主要国の国債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行ないません。株式への投資は、転換社債を転換したもの等に限る、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等から利子・配当等収益等の水準及び基準価額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ないます。

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30期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		税 分	込 配	期 騰 落 中 率			
	円		円	%	%	%	百万円
112期(2020年3月13日)	8,982		20	0.1	94.8	—	12,082
113期(2020年4月13日)	8,828		20	△1.5	96.8	—	11,702
114期(2020年5月13日)	8,852		20	0.5	98.3	—	11,705
115期(2020年6月15日)	8,847		20	0.2	98.4	—	11,204
116期(2020年7月13日)	8,835		20	0.1	97.5	—	10,834
117期(2020年8月13日)	8,812		20	△0.0	99.5	—	10,849
118期(2020年9月14日)	8,799		20	0.1	96.4	—	10,530
119期(2020年10月13日)	8,795		10	0.1	98.3	—	10,424
120期(2020年11月13日)	8,761		10	△0.3	99.5	—	10,327
121期(2020年12月14日)	8,732		10	△0.2	99.1	—	10,150
122期(2021年1月13日)	8,696		10	△0.3	99.6	—	10,029
123期(2021年2月15日)	8,667		10	△0.2	99.6	—	9,596
124期(2021年3月15日)	8,515		10	△1.6	99.6	—	8,943
125期(2021年4月13日)	8,516		10	0.1	97.7	—	9,374
126期(2021年5月13日)	8,507		10	0.0	99.0	—	9,302
127期(2021年6月14日)	8,508		10	0.1	98.6	—	9,072
128期(2021年7月13日)	8,490		10	△0.1	96.8	—	9,020
129期(2021年8月13日)	8,483		10	0.0	98.9	—	8,975
130期(2021年9月13日)	8,469		10	△0.0	99.2	—	8,908
131期(2021年10月13日)	8,374		10	△1.0	101.6	—	8,779
132期(2021年11月15日)	8,301		10	△0.8	96.6	—	8,311
133期(2021年12月13日)	8,304		10	0.2	99.1	—	8,284
134期(2022年1月13日)	8,260		10	△0.4	97.8	—	8,153
135期(2022年2月14日)	8,182		10	△0.8	99.3	—	7,999
136期(2022年3月14日)	8,146		10	△0.3	100.6	—	7,960
137期(2022年4月13日)	7,994		10	△1.7	100.7	—	7,773
138期(2022年5月13日)	7,930		10	△0.7	96.2	—	7,702
139期(2022年6月13日)	7,820		10	△1.3	101.1	—	7,343
140期(2022年7月13日)	7,903		10	1.2	96.5	—	7,427
141期(2022年8月15日)	7,878		10	△0.2	101.4	—	7,301

* 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。

* 当ファンドは、原則として為替ヘッジ後の利回り水準等を勘案して1ヵ月毎に投資対象国を見直します。当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

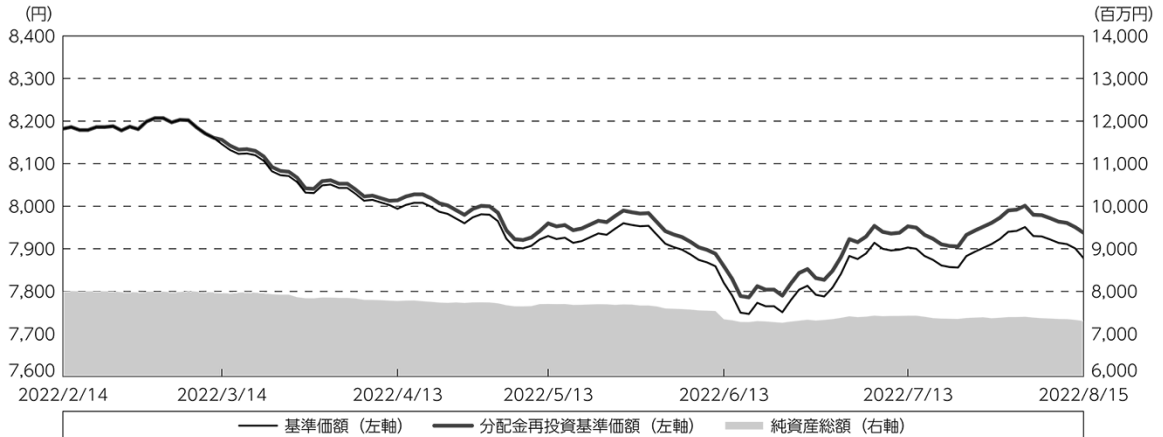
決 算 期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 券	債 券
				組 入 比 率	先 物 比 率
第136期	(期 首) 2022年 2 月14日	円 8,182	% —	% 99.3	% —
	2 月末	8,181	△0.0	99.7	—
	(期 末) 2022年 3 月14日	8,156	△0.3	100.6	—
第137期	(期 首) 2022年 3 月14日	8,146	—	100.6	—
	3 月末	8,049	△1.2	106.4	—
	(期 末) 2022年 4 月13日	8,004	△1.7	100.7	—
第138期	(期 首) 2022年 4 月13日	7,994	—	100.7	—
	4 月末	7,980	△0.2	101.0	—
	(期 末) 2022年 5 月13日	7,940	△0.7	96.2	—
第139期	(期 首) 2022年 5 月13日	7,930	—	96.2	—
	5 月末	7,954	0.3	98.3	—
	(期 末) 2022年 6 月13日	7,830	△1.3	101.1	—
第140期	(期 首) 2022年 6 月13日	7,820	—	101.1	—
	6 月末	7,809	△0.1	101.0	—
	(期 末) 2022年 7 月13日	7,913	1.2	96.5	—
第141期	(期 首) 2022年 7 月13日	7,903	—	96.5	—
	7 月末	7,923	0.3	97.9	—
	(期 末) 2022年 8 月15日	7,888	△0.2	101.4	—

* 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136期首：8,182円

第141期末：7,878円 (既払分配金(税込み):60円)

騰落率：△ 3.0% (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(2022年2月14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

基準価額は、当作成期首8,182円から当作成期末には7,878円(分配後)となりました。この間に、合計60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244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)。

○投資環境

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2022年3月のFOMC（米連邦公開市場委員会）にて、高インフレが持続するリスクに鑑みて、2018年以来となる0.25%の利上げに踏み切りました。続く5月、6月、7月のFOMCにおいてもそれぞれ0.50%、0.75%、0.75%の利上げを実施し、今後も金融引き締めの手を緩めない姿勢を示したことで、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。2022年2月に開催されたECB（欧州中央銀行）の会合を受けて金融緩和の早期縮小が市場で強く意識された結果、債券利回りが上昇しました。その後、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は7月の会合にて0.50%の利上げを実施し、引き締め姿勢を明確にしました。

当作成期末に投資対象国としていたオーストラリア、ノルウェー、フランスについても、世界的に金融引き締めへと急ぐ流れの中で、債券利回りは上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

<組入債券・投資対象国>

組入債券は、世界主要国のうち信用力が高い国の国債としました。投資対象国は、当作成期にシンガポールと米国を除外し、新たにノルウェーとフランスを組み入れました。当作成期末における投資対象国は、オーストラリア、ノルウェー、フランスとしました。投資対象国の選定にあたっては、信用力、為替ヘッジ後の利回り水準に加え、経済ファンダメンタルズ、流動性等も加味して決定しました。投資配分については当作成期を通じて、投資対象国で概ね均等としました。

<デュレーション※>

ポートフォリオのデュレーションは、当作成期末で約2.4年程度としました。

※デュレーションとは、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変化に対する価格変化が大きくなります。ポートフォリオのデュレーションとは、債券デュレーション×債券組入比率で表されます。

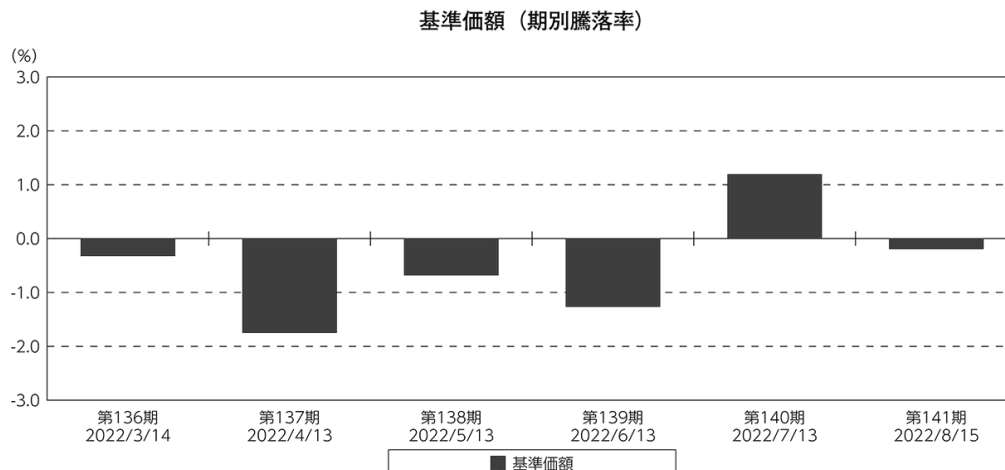
<為替>

当作成期を通じて、対円でほぼフルヘッジとしました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、原則として為替ヘッジ後の利回り水準等を勘案して1ヵ月毎に投資対象国を見直します。当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、作成期間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

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・配当等収益等から次の通り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136期	第137期	第138期	第139期	第140期	第141期
	2022年2月15日～ 2022年3月14日	2022年3月15日～ 2022年4月13日	2022年4月14日～ 2022年5月13日	2022年5月14日～ 2022年6月13日	2022年6月14日～ 2022年7月13日	2022年7月14日～ 2022年8月15日
当期分配金	10	10	10	10	10	10
(対基準価額比率)	0.123%	0.125%	0.126%	0.128%	0.126%	0.127%
当期の収益	9	10	9	10	10	9
当期の収益以外	0	—	0	—	—	0
翌期繰越分配対象額	958	958	958	959	962	961

(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

今後の運用につきましては、引き続き信用力、為替ヘッジ後の利回り水準に加え、経済ファンダメンタルズ、流動性等も加味して、投資対象国を原則として3ヵ国選定した上で、国別の投資比率が概ね均等となるように投資を行ないます。投資する債券は、主として、世界主要国※のうち信用力が高い国の国債、およびわが国の国債とします。また、ポートフォリオのデュレーションは、原則として、5年を中心として、その±3年程度の範囲内に維持します。外貨建資産については、原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ります。

※世界主要国とは、当面、FTSE世界国債インデックスに採用されている国とします。

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。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年2月15日～2022年8月15日)

項 目	第136期～第141期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 28	% 0.357	(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)	(13)	(0.165)	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)	(0.027)	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	0.017	(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)	(0.016)	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
(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	29	0.374	
作成期間の平均基準価額は、7,982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。

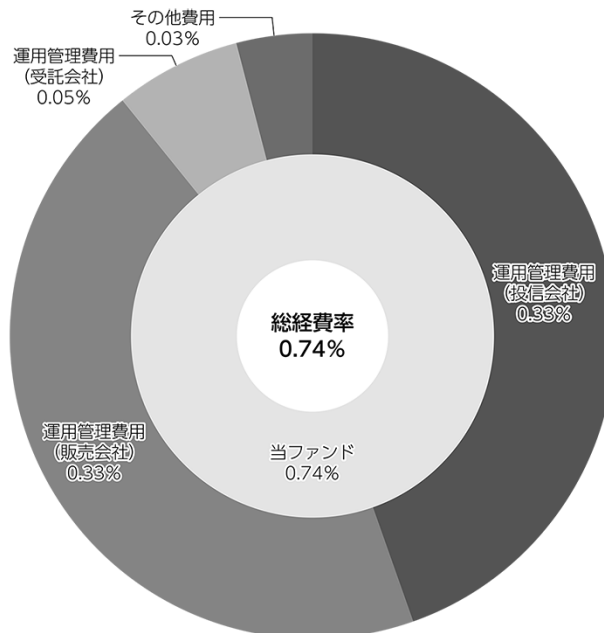
* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 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0.74%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2月15日～2022年8月15日)

公社債

			第136期～第141期	
			買付額	売付額
外国	アメリカ	国債証券	千米ドル 18,336	千米ドル 40,286
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 281,035	千ノルウェークローネ 100,443
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	フランス	国債証券	32,368	14,105
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 17,621	千シンガポールドル 47,585
	オーストラリア	国債証券	千豪ドル 19,106	千豪ドル 25,230

*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。

○利害関係人との取引状況等

(2022年2月15日～2022年8月15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

(2022年8月15日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	第141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
ノルウェー	千ノルウェークローネ 183,000	千ノルウェークローネ 179,142	千円 2,491,867	% 34.1	% —	% 2.4	% 11.6	% 20.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
フランス	18,600	18,409	2,512,743	34.4	—	7.2	11.0	16.2
オーストラリア	千豪ドル 25,000	千豪ドル 25,332	2,399,968	32.9	—	0.6	21.9	10.4
合 計	—	—	7,404,579	101.4	—	10.2	44.5	46.7

*邦貨換算金額は、第141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141期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ノルウェー			%	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ	千円	
	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	62,000	61,680	857,979	2023/5/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	44,000	44,004	612,103	2024/3/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	34,000	32,399	450,677	2026/2/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	30,000	28,602	397,853	2027/2/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	13,000	12,455	173,253	2028/4/26
小計						2,491,867	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	1,500	1,497	204,325	2023/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	7,100	7,175	979,341	2023/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	6,000	5,877	802,168	2025/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	3,000	2,943	401,748	2028/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,000	916	125,159	2029/11/25
小計						2,512,743	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	8,000	7,999	757,863	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.25	3,800	3,571	338,375	2024/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,000	1,003	95,113	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	6,700	6,950	658,513	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	5,000	5,332	505,241	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	500	473	44,861	2028/5/21
小計						2,399,968	
合 計						7,404,579	

* 邦貨換算金額は、第141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8月15日現在)

項 目	第141期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	7,404,579	88.4
コール・ローン等、その他	971,922	11.6
投資信託財産総額	8,376,501	100.0

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 第141期末における外貨建純資産（7,472,267千円）の投資信託財産総額（8,376,501千円）に対する比率は89.2%です。

* 外貨建資産は、第141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＝132.97円、1ノルウェークローネ＝13.91円、1ユーロ＝136.49円、1豪ドル＝94.74円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第136期末	第137期末	第138期末	第139期末	第140期末	第141期末
	2022年3月14日現在	2022年4月13日現在	2022年5月13日現在	2022年6月13日現在	2022年7月13日現在	2022年8月15日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	16,026,099,809	15,662,482,404	15,109,480,630	15,097,135,602	14,598,679,792	15,643,404,440
コール・ローン等	90,011,741	50,297,129	76,042,141	113,187,390	△ 1,075,512,887	73,618,569
公社債(評価額)	8,010,955,633	7,830,337,767	7,406,842,252	7,423,879,909	7,168,702,486	7,404,579,657
未収入金	7,870,724,120	7,717,957,738	7,581,136,260	7,531,848,551	8,470,608,502	8,117,562,327
未収利息	36,361,930	39,358,813	24,030,170	13,614,403	18,298,116	24,031,977
前払費用	12,865,214	18,951,361	15,428,964	13,787,169	15,343,362	21,992,989
その他未収収益	5,181,171	5,579,596	6,000,843	818,180	1,240,213	1,618,921
(B) 負債	8,065,357,538	7,889,368,266	7,406,556,924	7,753,671,355	7,171,234,251	8,342,336,492
未払金	8,049,011,540	7,870,691,300	7,386,564,615	7,582,443,472	7,156,226,840	8,311,892,974
未払収益分配金	9,772,081	9,723,652	9,713,565	9,391,176	9,397,706	9,267,119
未払解約金	2,177,731	4,305,322	5,723,649	157,180,011	1,279,969	16,395,249
未払信託報酬	4,382,700	4,633,738	4,541,124	4,642,380	4,316,465	4,766,485
未払利息	11	5	7	43	3	9
その他未払費用	13,475	14,249	13,964	14,273	13,268	14,656
(C) 純資産総額(A－B)	7,960,742,271	7,773,114,138	7,702,923,706	7,343,464,247	7,427,445,541	7,301,067,948
元本	9,772,081,250	9,723,652,496	9,713,565,595	9,391,176,223	9,397,706,794	9,267,119,603
次期繰越損益金	△ 1,811,338,979	△ 1,950,538,358	△ 2,010,641,889	△ 2,047,711,976	△ 1,970,261,253	△ 1,966,051,655
(D) 受益権総口数	9,772,081,250口	9,723,652,496口	9,713,565,595口	9,391,176,223口	9,397,706,794口	9,267,119,603口
1万口当たり基準価額(C／D)	8.146円	7.994円	7.930円	7.820円	7.903円	7.878円

(注) 第136期首元本額は9,777,028,821円、第136～141期中追加設定元本額は269,514,357円、第136～141期中一部解約元本額は779,423,575円、1口当たり純資産額は、第136期0.8146円、第137期0.7994円、第138期0.7930円、第139期0.7820円、第140期0.7903円、第141期0.7878円です。

○損益の状況

項 目	第136期	第137期	第138期	第139期	第140期	第141期
	2022年 2月15日～ 2022年 3月14日	2022年 3月15日～ 2022年 4月13日	2022年 4月14日～ 2022年 5月13日	2022年 5月14日～ 2022年 6月13日	2022年 6月14日～ 2022年 7月13日	2022年 7月14日～ 2022年 8月15日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	13,681,960	15,301,162	14,278,459	14,763,214	12,954,357	13,759,359
受取利息	13,244,692	14,960,683	13,888,254	14,438,443	12,559,409	13,434,010
その他収益金	437,502	340,709	390,608	325,360	395,795	325,613
支払利息	△ 234	△ 230	△ 403	△ 589	△ 847	△ 264
(B) 有価証券売買損益	△ 34,221,357	△ 148,707,168	△ 61,536,767	△ 104,279,250	79,851,288	△ 22,717,592
売買益	236,907,201	786,346,325	428,654,284	373,753,010	462,476,906	399,958,854
売買損	△ 271,128,558	△ 935,053,493	△ 490,191,051	△ 478,032,260	△ 382,625,618	△ 422,676,446
(C) 信託報酬等	△ 4,625,402	△ 4,821,832	△ 4,731,411	△ 4,896,703	△ 4,545,871	△ 4,953,540
(D) 当期損益金 (A+B+C)	△ 25,164,799	△ 138,227,838	△ 51,989,719	△ 94,412,739	88,259,774	△ 13,911,773
(E) 前期繰越損益金	△1,307,389,193	△1,326,313,476	△1,460,639,234	△1,471,136,838	△1,566,173,937	△1,465,193,555
(F) 追加信託差損益金	△ 469,012,906	△ 476,273,392	△ 488,299,371	△ 472,771,223	△ 482,949,384	△ 477,679,208
(配当等相当額)	(871,991,168)	(868,129,449)	(867,807,932)	(839,033,392)	(840,037,598)	(828,430,358)
(売買損益相当額)	(△1,341,004,074)	(△1,344,402,841)	(△1,356,107,303)	(△1,311,804,615)	(△1,322,986,982)	(△1,306,109,566)
(G) 計 (D+E+F)	△1,801,566,898	△1,940,814,706	△2,000,928,324	△2,038,320,800	△1,960,863,547	△1,956,784,536
(H) 収益分配金	△ 9,772,081	△ 9,723,652	△ 9,713,565	△ 9,391,176	△ 9,397,706	△ 9,267,119
次期繰越損益金 (G+H)	△1,811,338,979	△1,950,538,358	△2,010,641,889	△2,047,711,976	△1,970,261,253	△1,966,051,655
追加信託差損益金	△ 469,012,906	△ 476,273,392	△ 488,299,371	△ 472,771,223	△ 482,949,384	△ 477,679,208
(配当等相当額)	(871,991,168)	(868,129,449)	(867,807,932)	(839,033,392)	(840,037,598)	(828,430,358)
(売買損益相当額)	(△1,341,004,074)	(△1,344,402,841)	(△1,356,107,303)	(△1,311,804,615)	(△1,322,986,982)	(△1,306,109,566)
分配準備積立金	64,262,464	64,251,555	63,491,198	61,830,935	64,408,804	62,989,657
繰越損益金	△1,406,588,537	△1,538,516,521	△1,585,833,716	△1,636,771,688	△1,551,720,673	△1,551,362,104

* 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 2月15日～2022年 8月15日) は以下の通りです。

項 目	第136期	第137期	第138期	第139期	第140期	第141期
	2022年 2月15日～ 2022年 3月14日	2022年 3月15日～ 2022年 4月13日	2022年 4月14日～ 2022年 5月13日	2022年 5月14日～ 2022年 6月13日	2022年 6月14日～ 2022年 7月13日	2022年 7月14日～ 2022年 8月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	9,056,558円	10,479,330円	9,547,048円	9,866,511円	12,319,753円	8,805,819円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越大損金補填後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	871,991,168円	868,129,449円	867,807,932円	839,033,392円	840,037,598円	828,430,358円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	64,977,987円	63,495,877円	63,657,715円	61,355,600円	61,486,757円	63,450,957円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	946,025,713円	942,104,656円	941,012,695円	910,255,503円	913,844,108円	900,687,134円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	968円	968円	968円	969円	972円	971円
g. 分配金	9,772,081円	9,723,652円	9,713,565円	9,391,176円	9,397,706円	9,267,119円
h. 分配金(1万円当たり)	10円	10円	10円	10円	10円	10円

○分配金のお知らせ

	第136期	第137期	第138期	第139期	第140期	第141期
1 万口当たり分配金（税込み）	10円	10円	10円	10円	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。