

# 北欧高利回り社債ファンド (為替ヘッジあり) 2015-09

## 愛称：オーロラギフト (為替ヘッジあり)

### 償還運用報告書(全体版)

第12期(決算日2018年9月7日) 第13期(償還日2018年11月20日)

作成対象期間(2018年6月8日～2018年11月20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。  
このたび、約款の規定にもとづき償還決算を行い、償還価額が決定いたしました。  
ここに設定日から償還までの運用経過をご報告いたしますとともに、ご愛顧に対し厚く御礼申し上げます。

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |   |   |
|--------|---|---|
| 商品分類   | 単位型投信/海外/債券   |   |
| 信託期間   | 2018年11月20日をもちまして繰上償還いたします。(設定日2015年9月30日)  |   |
| 運用方針   | 円建ての外国投資信託であるSuMi TRUST インベストメント・ファンズ・ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネーインベストメント マザーファンド受益証券への投資を通じて、北欧市場で発行される、もしくは流通している、または北欧において主要な事業活動に従事している企業が発行するハイ・イールド債等の社債を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保と中長期的な信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。各受益証券への投資比率は、通常の場合においては、SuMi TRUST インベストメント・ファンズ・ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定します。2018年10月1日以降に、支払済みの分配金累計額を加算した基準価額(1万口当たり)が一定水準(11,000円)以上となった場合には、一定期間内でSuMi TRUST インベストメント・ファンズ・ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス受益証券の組入比率を引き下げ、国内の短期有価証券、短期金融商品等(野村マネーインベストメント マザーファンド受益証券を含みます。)の安定資産による安定運用に切り替えることを基本とします。 |   |
| 主な投資対象 | 北欧高利回り社債ファンド<br>(為替ヘッジあり) 2015-09   | SuMi TRUST インベストメント・ファンズ・ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス受益証券および野村マネーインベストメント マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コモンサル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。 |
|        | SuMi TRUST インベストメント・ファンズ・ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス<br>野村マネーインベストメント<br>マザーファンド  | 北欧(ノルウェー、スウェーデン、デンマーク、フィンランド、アイスランド)市場で発行される、もしくは流通している、または北欧において主要な事業活動に従事している企業が発行するハイ・イールド債等の社債を主要投資対象とします。<br>本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。           |
| 主な投資制限 | 北欧高利回り社債ファンド<br>(為替ヘッジあり) 2015-09   | 株式への直接投資は行いません。外貨建て資産への直接投資は行いません。  |
|        | 野村マネーインベストメント<br>マザーファンド  | 株式への投資は行いません。外貨建て資産への投資は行いません。  |
| 分配方針   | 毎決算時に、原則として経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)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います。  |   |

### 野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



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/>

## ○設定以来の運用実績

| 決算期                 | 基準価額<br>(分配落) | 標準価額     |          |          | 受利益者<br>回率 | 債券組入<br>比率 | 債券先物<br>比率 | 投資信託<br>組入比率 | 元残存<br>本率  |
|---------------------|---------------|----------|----------|----------|------------|------------|------------|--------------|------------|
|                     |               | 税金<br>分配 | み<br>金   | 期中<br>騰落 |            |            |            |              |            |
| (設定日)<br>2015年9月30日 | 円 銭<br>10,000 | 円<br>-   | 円 銭<br>- | 円 銭<br>- | %<br>-     | %<br>-     | %<br>-     | %<br>-       | %<br>100.0 |
| 1期(2015年12月7日)      | 10,086        | 0        | 86       | 0.9      | 4.6        | 0.2        | -          | 98.3         | 99.9       |
| 2期(2016年3月7日)       | 9,168         | 50       | △868     | △8.6     | △17.9      | 0.0        | -          | 98.8         | 99.7       |
| 3期(2016年6月7日)       | 9,722         | 50       | 604      | 6.6      | △2.6       | 0.2        | -          | 98.7         | 98.6       |
| 4期(2016年9月7日)       | 9,992         | 50       | 320      | 3.3      | 1.5        | 0.1        | -          | 98.7         | 96.6       |
| 5期(2016年12月7日)      | 10,147        | 50       | 205      | 2.1      | 2.9        | 0.1        | -          | 99.2         | 94.2       |
| 6期(2017年3月7日)       | 10,625        | 50       | 528      | 5.2      | 6.1        | 0.1        | -          | 98.6         | 78.7       |
| 7期(2017年6月7日)       | 10,815        | 50       | 240      | 2.3      | 6.6        | 0.3        | -          | 99.0         | 65.7       |
| 8期(2017年9月7日)       | 10,929        | 50       | 164      | 1.5      | 6.6        | 0.1        | -          | 99.0         | 59.0       |
| 9期(2017年12月7日)      | 10,974        | 50       | 95       | 0.9      | 6.3        | 0.1        | -          | 99.0         | 55.1       |
| 10期(2018年3月7日)      | 11,038        | 50       | 114      | 1.0      | 6.1        | 0.1        | -          | 99.0         | 50.4       |
| 11期(2018年6月7日)      | 11,034        | 50       | 46       | 0.4      | 5.7        | -          | -          | 98.9         | 46.7       |
| 12期(2018年9月7日)      | 11,091        | 50       | 107      | 1.0      | 5.6        | 0.3        | -          | 98.9         | 44.0       |
| (償還時)               | (償還価額)        |          |          |          |            |            |            |              |            |
| 13期(2018年11月20日)    | 11,138.96     | -        | 47.96    | 0.4      | 5.4        | -          | -          | -            | 43.2       |

\* 基準価額の騰落額および騰落率は分配金込み。

\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

\* 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、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、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<br>円 銭         | 騰 落 率 | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|------|----------------------|---------------------|-------|-------------|-------------|---------------------|
|      |                      |                     | %     | %           | %           | %                   |
| 第12期 | (期 首)<br>2018年6月7日   | 11,034              | —     | —           | —           | 98.9                |
|      | 6月末                  | 11,023              | △0.1  | —           | —           | 98.3                |
|      | 7月末                  | 11,096              | 0.6   | —           | —           | 98.6                |
|      | 8月末                  | 11,135              | 0.9   | 0.3         | —           | 98.4                |
|      | (期 末)<br>2018年9月7日   | 11,141              | 1.0   | 0.3         | —           | 98.9                |
| 第13期 | (期 首)<br>2018年9月7日   | 11,091              | —     | 0.3         | —           | 98.9                |
|      | 9月末                  | 11,145              | 0.5   | 0.3         | —           | 98.4                |
|      | 10月末                 | 11,146              | 0.5   | 0.1         | —           | —                   |
|      | (償還時)<br>2018年11月20日 | (償還価額)<br>11,138.96 | 0.4   | —           | —           | —                   |

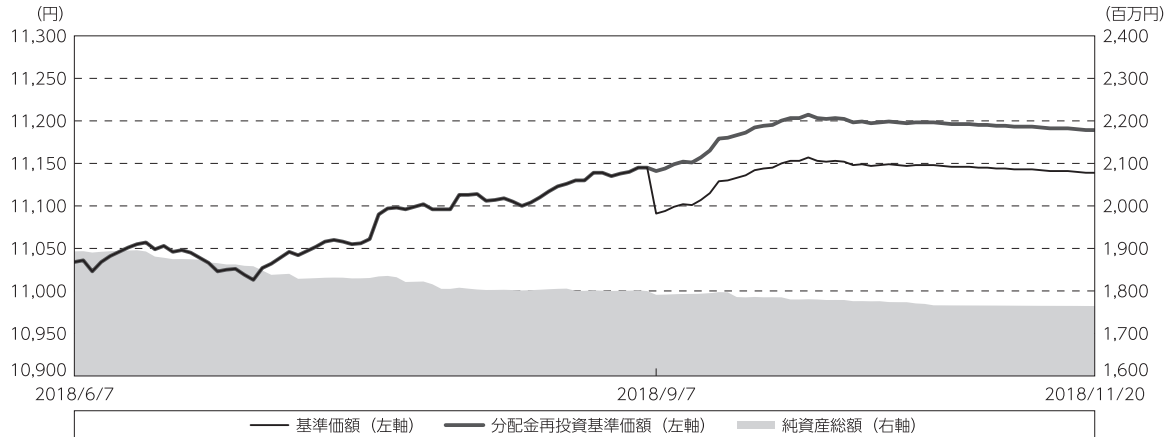
\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

\* 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 12 期 首： 11,034円

第13期末（償還日）：11,138円96銭（既払分配金（税込み）：50円）

騰 落 率： 1.4%（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（2018年6月7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。なお、当ファンドは単位型投信であり、実際には分配金は再投資されませんのでご注意ください。

（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11,034円から償還時には11,138.96円となりました。

- ・ 北欧各国が新発債券の発行を活発に行なったことや、原油価格の上昇を背景に、北欧社債の価格が上昇したこと
- ・ 原油価格が下落したことや、米中貿易摩擦懸念などを背景に、北欧社債の価格が下落したこと
- ・ 北欧社債からの利息収入

### ○投資環境

北欧社債市場の大半を占めるノルウェーのハイ・イールド債券市場は、当作成期間では上昇しました（トータルリターン・現地通貨ベース）。

ノルウェーなど北欧各国の中央銀行の金融政策動向や経済指標の発表の他、原油価格の動向に左右されました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [北欧高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり）2015-09]

当作成期首から2018年9月までは、[SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス] 受益証券および [野村マネーインベストメント マザーファンド] 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする [SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス] 受益証券を高位に組み入れました。

10月以降は、償還対応で [SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス] 受益証券の売却を徐々に進めました。また、[野村マネーインベストメント マザーファンド] 受益証券も11月中旬に全売却しました。

### [SuMi TRUST インベストメント・ファンズーノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス]

主要投資対象である北欧<sup>(※1)</sup>市場で発行される、もしくは流通している、または北欧において主要な事業活動に従事している企業が発行する社債（投資適格債券およびハイ・イールド債券）を高位に組み入れました。

(※1) 北欧とはノルウェー、スウェーデン、デンマーク、フィンランド、アイスランドの5か国を指します。

信用格付け別組入比率については、BBB格以上、BB格、B格、CCC格以下及び無格付けの組入比率は、2018年10月末時点で4.8%、18.0%、74.4%、1.5%としました。

組入資産について、原則として実質的に対円で為替ヘッジを行ないました。

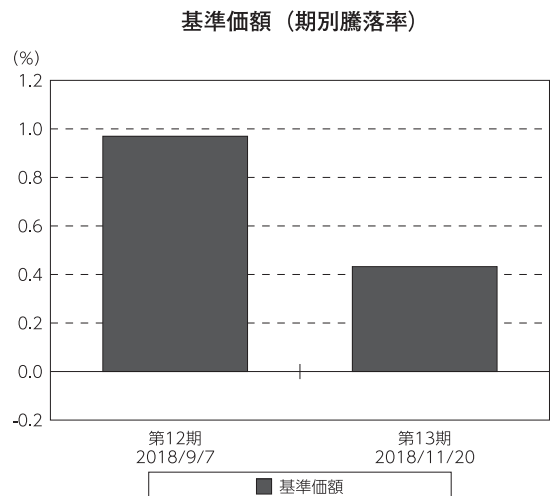
### [野村マネーインベストメント マザーファンド]

残存1年以内の公社債やコマーシャルペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、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。

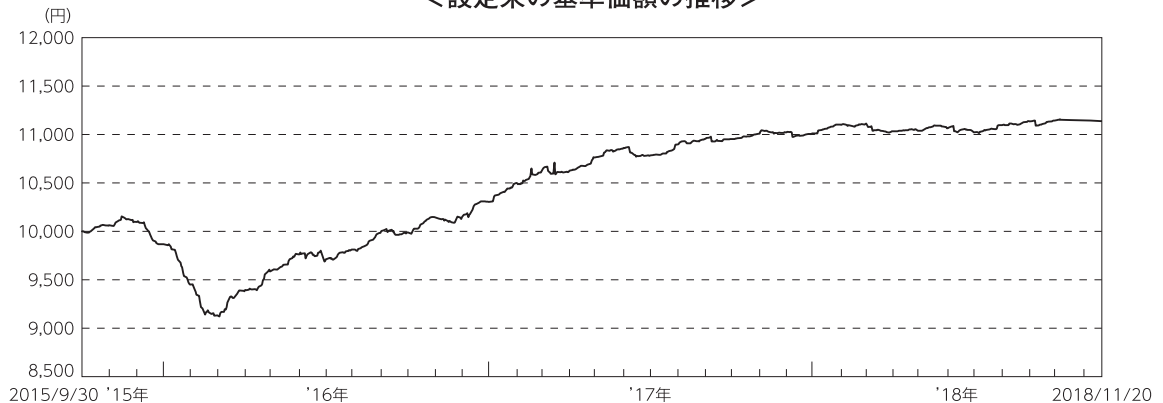
## ◎分配金

第12期の収益分配については、利子・配当等収入、信託報酬などの諸経費を勘案し、1万口当たり50円といたしました。第13期は償還のため分配金をお支払しておりません。

|                | 第12期 |
|----------------|------|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 50円  |

## ◎設定来の運用経過

＜設定来の基準価額の推移＞



### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、設定時の10,000円が償還時11,138.96円となりました。設定来お支払した分配金は1万口当たり550円となりました。

#### 第1期（2015年9月30日～2015年12月7日）

- ・ 北欧社債からの利息収入
- ・ ノルウェーの一部の経済指標が悪化したことなどから、ノルウェー中央銀行が政策金利の引き下げを行なうとの観測が強まったことを背景に、北欧社債の価格が上昇したこと
- ・ 原油価格が下落基調で推移したことなどを背景に、北欧社債の価格が下落したこと

#### 第2期-第3期（2015年12月8日～2016年6月7日）

- ・ 原油価格が下落したことなどを背景に、北欧社債の価格が下落したこと
- ・ 原油価格が反発したことなどを背景に、北欧社債の価格が上昇したこと
- ・ 北欧社債からの利息収入

**第4期-第5期（2016年6月8日～2016年12月7日）**

- ・原油価格が下落したことなどを背景に、北欧社債の価格が下落したこと
- ・原油価格が反発したことなどを背景に、北欧社債の価格が上昇したこと
- ・北欧社債からの利息収入

**第6期-第7期（2016年12月8日～2017年6月7日）**

- ・原油価格が反発したことなどを背景に、北欧社債の価格が上昇したこと
- ・北欧各国が市場予想を上回る良好な経済指標を発表したことなどを背景に、北欧社債の価格が上昇したこと
- ・北欧社債からの利息収入

**第8期-第9期（2017年6月8日～2017年12月7日）**

- ・北欧各国が良好な経済指標を発表したことなどを背景に、北欧社債の価格が上昇したこと
- ・原油価格が反発したことなどを背景に、北欧社債の価格が上昇したこと
- ・北欧社債からの利息収入

**第10期-第11期（2017年12月8日～2018年6月7日）**

- ・北欧各国が良好な経済指標を発表したことなどを背景に、北欧社債の価格が上昇したこと
- ・原油価格が反発したことなどを背景に、北欧社債の価格が上昇したこと
- ・北欧社債からの利息収入

**第12期-第13期（2018年6月8日～2018年11月20日）**

- ・北欧各国が新発債券の発行を活発に行なったことや、原油価格の上昇を背景に、北欧社債の価格が上昇したこと
- ・原油価格が下落したことや、米中貿易摩擦懸念などを背景に、北欧社債の価格が下落したこと
- ・北欧社債からの利息収入

※店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行われており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響をうけ、当該金融取引を行うための担保として現金等を提供する必要がある場合があります。その場合、追加的に現金等を保有するため、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。

## ○1万口当たりの費用明細

（2018年6月8日～2018年11月20日）

| 項 目                     | 第12期～第13期 |            | 項 目 の 概 要                                    |
|-------------------------|-----------|------------|--|
|                         | 金 額       | 比 率        |  |
| (a) 信 託 報 酬             | 円<br>52   | %<br>0.467 | (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 ）             | (15)      | (0.133)    | 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 ）             | (35)      | (0.319)    | 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 )     | (0.015)    | 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＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数             |
| （ 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                     | 52        | 0.468      |  |
| 作成期間の平均基準価額は、11,109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、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。
- \*その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
- \*各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
- \*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。

## ○売買及び取引の状況

（2018年6月8日～2018年11月20日）

## 投資信託証券

| 銘 柄 |   | 第12期～第13期  |              |              |                 |
|-----|---|------------|--------------|--------------|-----------------|
|     |   | 買 付        |              | 売 付          |                 |
|     |   | 口 数        | 金 額          | 口 数          | 金 額             |
| 国内  | Sulfi TRUST インベストメント・ファンズー<br>ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス | 口<br>4,324 | 千円<br>38,200 | 口<br>214,814 | 千円<br>1,893,248 |

- \*金額は受け渡し代金。
- \*金額の単位未満は切り捨て。



## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘             | 柄       | 第12期～第13期 |     |       |       |
|---------------|---------|-----------|-----|-------|-------|
|               |         | 設 定       |     | 解 約   |       |
|               |         | 口 数       | 金 額 | 口 数   | 金 額   |
|               |         | 千口        | 千円  | 千口    | 千円    |
| 野村マネーインベストメント | マザーファンド | —         | —   | 9,949 | 9,988 |

\* 単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2018年6月8日～2018年11月20日)

## 利害関係人との取引状況

<北欧高利回り社債ファンド（為替ヘッジあり）2015-09>  
該当事項はございません。

## &lt;野村マネーインベストメント マザーファンド&gt;

| 区 分 | 第12期～第13期 |                    |               |           |                    |               |
|-----|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|     | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円<br>40 | 百万円<br>30          | %<br>75.0     | 百万円<br>—  | 百万円<br>—           | %<br>—        |

平均保有割合 14.5%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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証券株式会社です。

## ○組入資産の明細

(2018年11月20日現在)

2018年11月20日現在、有価証券等の組入れはございません。

## ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| 銘          | 柄   | 第11期末 |              |
|------------|---|-------|--------------|
|            |   | 口     | 数            |
| SuMi TRUST | インベストメント・ファンズ—ノルディック・ハイ・インカム・ボンド・ファンド A JPY クラス |       | 口<br>210,490 |
| 合          | 計   |       | 210,490      |

## 親投資信託残高

| 銘                     | 柄 | 第11期末 |             |
|-----------------------|---|-------|-------------|
|                       |   | 口     | 数           |
| 野村マネーインベストメント マザーファンド |   |       | 千口<br>9,949 |

\*単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2018年11月20日現在)

| 項 目          | 償 還 時           |            |
|--------------|-----------------|------------|
|              | 評 価 額           | 比 率        |
| コール・ローン等、その他 | 千円<br>1,768,231 | %<br>100.0 |
| 投資信託財産総額     | 1,768,231       | 100.0      |

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び償還(基準)価額の状況

| 項 目                        | 第12期末          | 償 還 時          |
|----------------------------|----------------|----------------|
|                            | 2018年9月7日現在    | 2018年11月20日現在  |
|                            | 円              | 円              |
| (A) 資産                     | 1,805,422,389  | 1,768,231,146  |
| コール・ローン等                   | 22,790,521     | 1,768,231,146  |
| 投資信託受益証券(評価額)              | 1,771,042,812  | —              |
| 野村マネーインベストメント マザーファンド(評価額) | 9,989,056      | —              |
| 未収入金                       | 1,600,000      | —              |
| (B) 負債                     | 14,447,108     | 3,682,875      |
| 未払収益分配金                    | 8,074,212      | —              |
| 未払解約金                      | 1,728,216      | —              |
| 未払信託報酬                     | 4,634,677      | 3,671,287      |
| 未払利息                       | 37             | 3,828          |
| その他未払費用                    | 9,966          | 7,760          |
| (C) 純資産総額(A-B)             | 1,790,975,281  | 1,764,548,271  |
| 元本                         | 1,614,842,505  | 1,584,122,440  |
| 次期繰越損益金                    | 176,132,776    | —              |
| 償還差益金                      | —              | 180,425,831    |
| (D) 受益権総口数                 | 1,614,842,505口 | 1,584,122,440口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)            | 11,091円        | —              |
| 1万口当たり償還価額(C/D)            | —              | 11,138円96銭     |

(注) 設定年月日2015年9月30日、設定元本額は3,666,122,013円、第12期首元本額は1,715,737,871円、当作成期末における元本残存率は43.2%、1口当たり純資産額は、第12期1.1091円、第13期1.113896円です。

## ○損益の状況

| 項 目                | 第12期                    | 第13期                      |
|--------------------|-------------------------|---------------------------|
|                    | 2018年6月8日～<br>2018年9月7日 | 2018年9月8日～<br>2018年11月20日 |
|                    | 円                       | 円                         |
| (A) 配当等収益          | 36,687,109              | 14,598,525                |
| 受取配当金              | 36,691,140              | 14,728,740                |
| 支払利息               | △ 4,031                 | △ 130,215                 |
| (B) 有価証券売買損益       | △ 4,176,528             | △ 3,094,879               |
| 売買益                | -                       | 71,322,205                |
| 売買損                | △ 4,176,528             | △ 74,417,084              |
| (C) 有価証券評価差損益      | △ 10,201,689            | -                         |
| (D) 信託報酬等          | △ 4,759,771             | △ 3,704,262               |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 17,549,121              | 7,799,384                 |
| (F) 前期繰越損益金        | 177,393,252             | 176,132,776               |
| (G) 解約差損益金         | △ 10,735,385            | △ 3,506,329               |
| (H) 計(E+F+G)       | 184,206,988             | -                         |
| (I) 収益分配金          | △ 8,074,212             | -                         |
| 次期繰越損益金(H+I)       | 176,132,776             | -                         |
| 償還差益金(E+F+G)       | -                       | 180,425,831               |

\* 損益の状況の中で(D)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(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。

## ○投資信託財産運用総括表

| 信託期間                    | 投資信託契約締結日      | 2015年9月30日     |                 |           | 投資信託契約終了時の状況   |                |
|-------------------------|----------------|----------------|-----------------|-----------|----------------|----------------|
|                         | 投資信託契約終了日      | 2018年11月20日    |                 |           | 資産総額           | 1,768,231,146円 |
| 区分                      | 投資信託契約締結当初     | 投資信託契約終了時      | 差引増減または追加信託     | 負債総額      | 3,682,875円     |                |
| 受益権口数                   | 3,666,122,013口 | 1,584,122,440口 | △2,081,999,573口 | 純資産総額     | 1,764,548,271円 |                |
| 元本額                     | 3,666,122,013円 | 1,584,122,440円 | △2,081,999,573円 | 受益権口数     | 1,584,122,440口 |                |
|                         |                |                |                 | 1万円当たり償還金 | 11,138円96銭     |                |
| 毎計算期末の状況                |                |                |                 |           |                |                |
| 計算期                     | 元本額            | 純資産総額          | 基準価額            | 1万円当たり分配金 |                |                |
|                         |                |                |                 | 金額        | 分配率            |                |
| 第1期                     | 3,663,122,013円 | 3,694,768,467円 | 10,086円         | 0円        | 0.0%           |                |
| 第2期                     | 3,657,327,479  | 3,353,213,798  | 9,168           | 50        | 0.5            |                |
| 第3期                     | 3,616,121,064  | 3,515,413,762  | 9,722           | 50        | 0.5            |                |
| 第4期                     | 3,541,619,810  | 3,538,702,759  | 9,992           | 50        | 0.5            |                |
| 第5期                     | 3,453,964,154  | 3,504,770,757  | 10,147          | 50        | 0.5            |                |
| 第6期                     | 2,885,824,526  | 3,066,112,154  | 10,625          | 50        | 0.5            |                |
| 第7期                     | 2,411,950,335  | 2,608,528,830  | 10,815          | 50        | 0.5            |                |
| 第8期                     | 2,164,227,429  | 2,365,260,988  | 10,929          | 50        | 0.5            |                |
| 第9期                     | 2,021,658,988  | 2,218,544,271  | 10,974          | 50        | 0.5            |                |
| 第10期                    | 1,849,908,795  | 2,041,973,379  | 11,038          | 50        | 0.5            |                |
| 第11期                    | 1,715,737,871  | 1,893,131,123  | 11,034          | 50        | 0.5            |                |
| 第12期                    | 1,614,842,505  | 1,790,975,281  | 11,091          | 50        | 0.5            |                |
| 信託期間中1万円当たり総収益金及び年平均収益率 |                |                |                 | 1,688円96銭 | 5.3746%        |                |

## ○分配金のお知らせ

|                | 第12期 |
|----------------|------|
| 1万円当たり分配金（税込み） | 50円  |

## ○償還金のお知らせ

|                | 償還時        |
|----------------|------------|
| 1万円当たり償還金（税込み） | 11,138円96銭 |

## ○お知らせ

該当事項はございません。