

三井住友・ ヨーロッパ国債ファンド

【運用報告書(全体版)】

第37作成期 (2021年2月23日から2021年8月20日まで)

第 216 期 / 第 217 期 / 第 218 期
決算日2021年3月22日 決算日2021年4月20日 決算日2021年5月20日

第 219 期 / 第 220 期 / 第 221 期
決算日2021年6月21日 決算日2021年7月20日 決算日2021年8月20日

■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／海外／債券
信託期間	無期限 (設定日：2003年2月27日)
運用方針	EU (欧州連合) 加盟国の高格付けの国債を主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要投資対象	EU (欧州連合) 加盟国の高格付けの国債
当ファンドの運用方法	<ul style="list-style-type: none">■ EU (欧州連合) 加盟国の高格付けの国債を主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定的な利息収入の確保を目指します。■ FTSE 欧州世界国債インデックス (円ベース) をベンチマークとして運用します。■ 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
組入制限	<ul style="list-style-type: none">■ 株式への投資割合は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使による取得に限り、信託財産の純資産総額の5%以下とします。■ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	<ul style="list-style-type: none">■ 毎月20日 (休業日の場合は翌営業日) に決算を行い、分配を行います。■ 分配対象額は、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益 (評価益を含みません) 等の全額とします。■ 分配金額は、委託会社が基準価額水準・市況動向を勘案して決定します。 <p>※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。</p>

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドはEU (欧州連合) 加盟国の高格付けの国債を主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。当作成期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

 **三井住友DSアセットマネジメント**
〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1
<https://www.smd-am.co.jp>

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976
受付時間：午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)

三井住友・ヨーロッパ国債ファンド

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

■ 最近30期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			(ベンチマーク) F T S E 欧州世界 国債インデックス		債券組入率	純 資 産 額
	(分配落)	税 分 配 金	期 騰 落 率	(円ベース)	期 騰 落 率		
192期 (2019年3月20日)	円 6,356	円 15	% 1.4	191.70	% 1.7	% 97.3	百万円 6,764
193期 (2019年4月22日)	6,315	15	△0.4	191.10	△0.3	97.0	6,663
194期 (2019年5月20日)	6,197	15	△1.6	187.74	△1.8	98.7	6,501
195期 (2019年6月20日)	6,197	15	0.2	189.38	0.9	98.2	6,474
196期 (2019年7月22日)	6,214	15	0.5	191.15	0.9	98.4	6,468
197期 (2019年8月20日)	6,198	15	△0.0	190.67	△0.2	97.7	6,418
198期 (2019年9月20日)	6,199	15	0.3	193.29	1.4	97.8	6,375
199期 (2019年10月21日)	6,231	15	0.8	195.43	1.1	97.4	6,368
200期 (2019年11月20日)	6,152	15	△1.0	192.64	△1.4	97.4	6,247
201期 (2019年12月20日)	6,163	15	0.4	193.98	0.7	95.3	6,216
202期 (2020年1月20日)	6,191	15	0.7	195.40	0.7	95.7	6,219
203期 (2020年2月20日)	6,191	15	0.2	196.64	0.6	97.2	6,157
204期 (2020年3月23日)	5,972	15	△3.3	187.83	△4.5	96.6	5,884
205期 (2020年4月20日)	5,919	15	△0.6	188.03	0.1	97.2	5,790
206期 (2020年5月20日)	5,950	15	0.8	189.65	0.9	98.2	5,800
207期 (2020年6月22日)	6,049	15	1.9	193.15	1.8	98.5	5,880
208期 (2020年7月20日)	6,232	15	3.3	199.78	3.4	98.3	6,040
209期 (2020年8月20日)	6,389	15	2.8	205.78	3.0	97.8	6,160
210期 (2020年9月23日)	6,253	15	△1.9	201.68	△2.0	97.9	5,983
211期 (2020年10月20日)	6,367	15	2.1	206.31	2.3	97.3	6,069
212期 (2020年11月20日)	6,292	15	△0.9	204.68	△0.8	97.7	5,957
213期 (2020年12月21日)	6,418	15	2.2	209.86	2.5	95.9	6,022
214期 (2021年1月20日)	6,370	15	△0.5	209.59	△0.1	96.4	5,949
215期 (2021年2月22日)	6,294	15	△1.0	208.47	△0.5	97.5	5,764
216期 (2021年3月22日)	6,335	15	0.9	210.10	0.8	97.2	5,776
217期 (2021年4月20日)	6,329	15	0.1	210.90	0.4	96.9	5,733
218期 (2021年5月20日)	6,350	15	0.6	212.11	0.6	97.7	5,703
219期 (2021年6月21日)	6,301	15	△0.5	211.75	△0.2	98.3	5,629
220期 (2021年7月20日)	6,304	15	0.3	212.26	0.2	98.5	5,613
221期 (2021年8月20日)	6,292	15	0.0	212.85	0.3	97.6	5,581

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※ベンチマークは、当報告書作成時に知れた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、基準価額の反映を考慮して、前営業日の値を使用しています。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

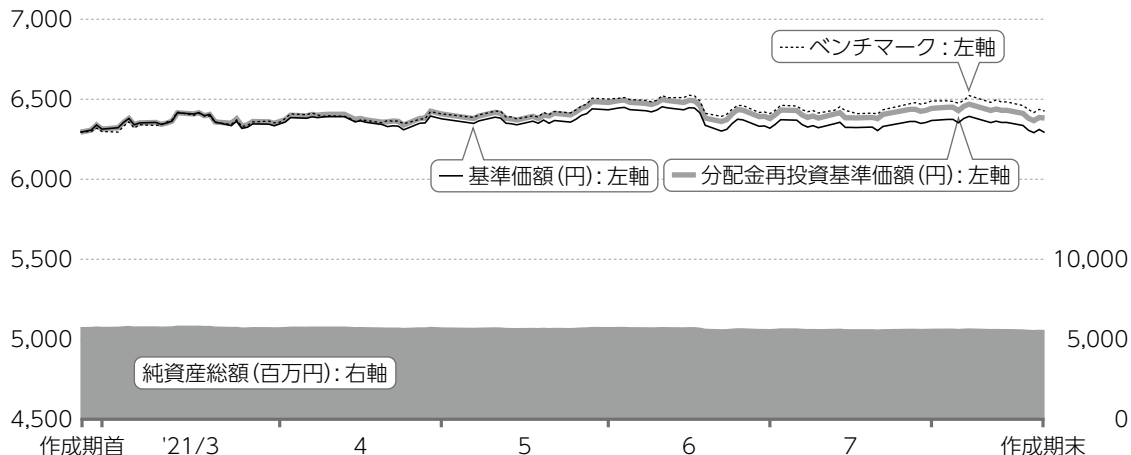
決算期	年 月 日	基 準 価 額		(ベ ン チ マ ー ク) F T S E N 国 債 イ ン 欧 州 世 界 (円ベース)		債 券 組 入 率 比
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	
第216期	(期 首) 2021年2月22日	円 6,294	% —	208.47	% —	% 97.5
	2月末	6,313	0.3	208.61	0.1	97.5
	(期 末) 2021年3月22日	6,350	0.9	210.10	0.8	97.2
第217期	(期 首) 2021年3月22日	6,335	—	210.10	—	97.2
	3月末	6,346	0.2	210.55	0.2	95.9
	(期 末) 2021年4月20日	6,344	0.1	210.90	0.4	96.9
第218期	(期 首) 2021年4月20日	6,329	—	210.90	—	96.9
	4月末	6,378	0.8	212.27	0.7	97.3
	(期 末) 2021年5月20日	6,365	0.6	212.11	0.6	97.7
第219期	(期 首) 2021年5月20日	6,350	—	212.11	—	97.7
	5月末	6,434	1.3	215.33	1.5	97.8
	(期 末) 2021年6月21日	6,316	△0.5	211.75	△0.2	98.3
第220期	(期 首) 2021年6月21日	6,301	—	211.75	—	98.3
	6月末	6,319	0.3	212.32	0.3	98.2
	(期 末) 2021年7月20日	6,319	0.3	212.26	0.2	98.5
第221期	(期 首) 2021年7月20日	6,304	—	212.26	—	98.5
	7月末	6,367	1.0	214.94	1.3	98.0
	(期 末) 2021年8月20日	6,307	0.0	212.85	0.3	97.6

※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

1 運用経過

基準価額等の推移について(2021年2月23日から2021年8月20日まで)

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額およびベンチマークは、作成期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

作成期首	6,294円
作成期末	6,382円 (当作成期分配金90円(税引前)込み)
騰落率	+1.4% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さま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などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドのベンチマークは、FTSE欧州世界国債インデックス(円ベース)です。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

基準価額の主な変動要因(2021年2月23日から2021年8月20日まで)

当ファンドは、EU(欧州連合)加盟国の高格付けの国債を主要投資対象として運用しました。
なお、外貨建資産については、為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因

- 投資国の国債利回りが概ね低下(債券価格は上昇)したこと
- ユーロが対円で上昇したこと

投資環境について(2021年2月23日から2021年8月20日まで)

ドイツやフランスなどの欧州金利は低下しました。為替市場では、ユーロは円に対して小幅に上昇しました。

債券市場

新型コロナウイルスワクチン接種の進展や行動制限措置の緩和による経済回復への期待とともに、ECB(欧州中央銀行)による資産購入ペースの減額が意識され、期初から5月にかけて、ドイツやフランスなどの欧州金利は上昇しました。しかしその後は、ECB高官から資産購入ペースの減額は時期尚早など、ハト派(景気を重視する立場)的な姿勢が示されたことや、7月に入ると新型コロナウイルス(デルタ型)の感染が拡大し、景気の先行き期待が後退したこと

から、期末にかけてドイツやフランスなどの欧州金利は大きく低下しました。結局、期を通じてみるとドイツやフランスなどの欧州金利は低下しました。

為替市場

期間中のユーロは円に対して小幅に上昇しました。欧米株価の上昇などリスク選好の動きやユーロ圏内のワクチン接種進展に伴う景気の回復期待がユーロ高要因となりました。

ポートフォリオについて(2021年2月23日から2021年8月20日まで)

デュレーション(投資資金の平均回収期間)

期間を通じて、デュレーションはベンチマークに対して概ね中立の範囲内で、金融市場の動向に応じて調整を行いました。

国別配分

ユーロ圏内では、引き続きフランス、ベ

ルギー、ドイツを中心に組入れを行いました。経済・市場動向や格付け水準等を勘案し、イタリアを引き続き非保有としました。スペインについても、イタリアの財政悪化観測が高まる局面では高格付けのフランスやベルギーなどが選好されやすいと判断し、非保有を継続しました。また、EU非加盟国である英国、ノルウェーについては投資を行いませんでした。

通貨別配分

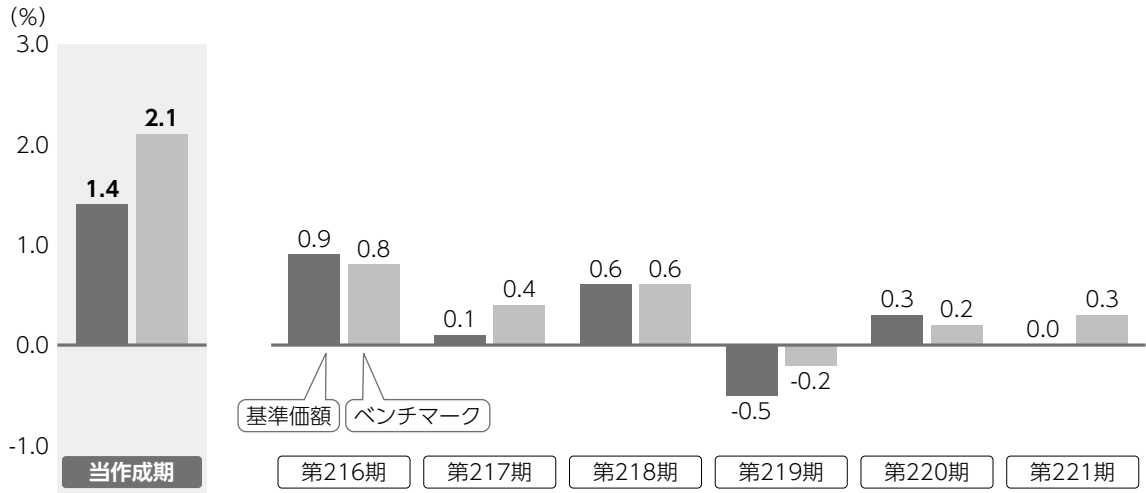
E U非加盟国である英国やノルウェーには投資を行わないことから、大部分をユー

ロで保有し、他にポーランドズロチ、デンマーククローネ、スウェーデンクローナを保有しました。

ベンチマークとの差異について(2021年2月23日から2021年8月20日まで)

当ファンドはF T S E 欧州世界国債インデックス(円ベース)をベンチマークとしています。以下のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

基準価額とベンチマークの騰落率対比



ベンチマークとの差異の状況および要因

当期における基準価額の騰落率は+1.4%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率+2.1%を0.7%下回りました。

マイナス要因

- E U非加盟国である英国(国債)の非保有

分配金について(2021年2月23日から2021年8月20日まで)

当作成期の1万口当たりの分配金(税引前)は、基準価額水準等を勘案し、以下の通りといたしました。

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

(単位：円、1万口当たり、税引前)

項目	第216期	第217期	第218期	第219期	第220期	第221期
当期分配金	15	15	15	15	15	15
(対基準価額比率)	(0.236%)	(0.236%)	(0.236%)	(0.237%)	(0.237%)	(0.238%)
当期の収益	15	12	15	13	13	13
当期の収益以外	-	2	-	1	1	2
翌期繰越分配対象額	170	168	169	167	166	164

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。
 ※「対基準価額比率」は、「当期分配金」(税引前)の期末基準価額(分配金(税引前)込み)に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

2 今後の運用方針

欧州では、中期的に景気の回復が金利上昇要因となっていく見通しですが、足元では新型コロナウイルス(デルタ型)の収束時期について不透明感が高く、当面はECBの大規模な金融緩和が継続される中で、ドイツやフランスなどのユーロ諸国の金利上昇は抑制される見通しです。

デュレーションや残存構成は、景気情勢や金融政策、需給環境を踏まえて機動的に調整を行います。ユーロ圏内での国別配分では、格付け水準等を勘案し、イタリアを非保有とする一方で、フランス、ベルギー、ドイツの組入れを厚めとします。非保有の

スペインについては、今後の経済状況や格付動向等を勘案しながら、組入れも検討します。

為替市場では、欧州復興基金による投資拡大への期待などから、ユーロなどの欧州通貨は円に対して緩やかに水準を切り上げる見通しです。

通貨配分は、大部分をユーロとしたポジションを維持する方針です。EU非加盟国である英国、ノルウェーについては投資を行いません。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

三井住友・ヨーロッパ国債ファンド

1万口当たりの費用明細(2021年2月23日から2021年8月20日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	29円	0.459%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数／年日数) 期中の平均基準価額は6,359円です。
(投信会社)	(14)	(0.216)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
(販売会社)	(14)	(0.216)	販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(2)	(0.027)	受託会社:ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	－	－	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(先物・オプション)	(－)	(－)	
(c) 有価証券取引税	－	－	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(－)	(－)	
(公社債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(d) その他費用	1	0.022	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)	(1)	(0.018)	保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.003)	監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用
(その他)	(0)	(0.001)	その他:信託事務の処理等に要するその他費用
合計	30	0.481	

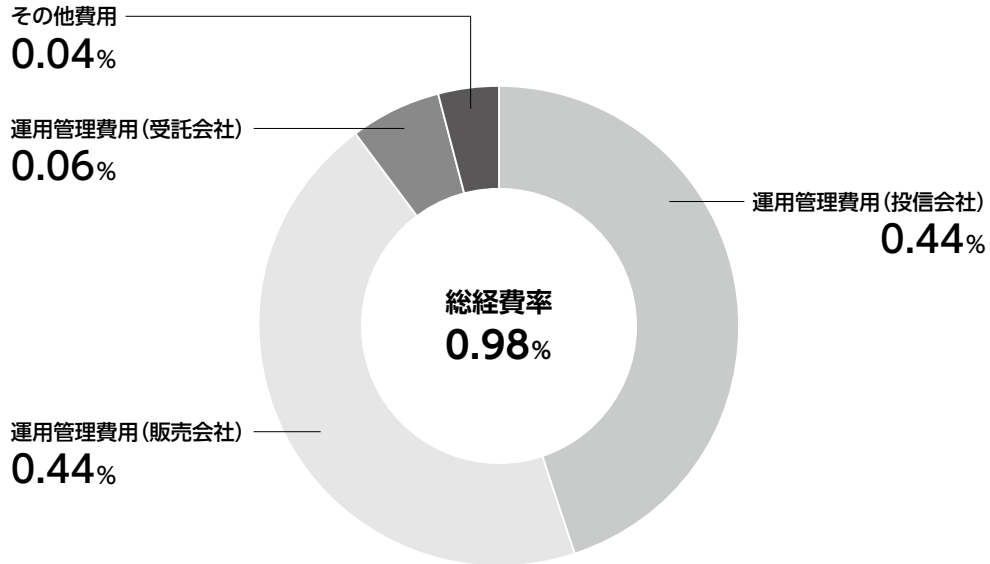
※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。



参考情報 総経費率(年率換算)



※各費用は、前掲「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、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

※各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。

※上記の前提条件で算出しているため、「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、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。

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、売買委託手数料およ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(年率換算)は0.98%です。

■ 当作成期中の売買及び取引の状況 (2021年2月23日から2021年8月20日まで)

公社債

			当 作 成 期	
			買 付 額	売 付 額
外国	ユ	ロ	千ユーロ	
	ド	イツ	158	259
	フ	ランス	377	1,638
	オ	ランダ	—	304
	ベル	ギー	229	—

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年2月23日から2021年8月20日まで)

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

※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。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年2月23日から2021年8月20日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細 (2021年8月20日現在)

公社債

A 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	作 成 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	
ユ	千ユーロ	千ユーロ	千円	%	%	%	%	%	
ド	イツ	5,030	7,499	962,779	17.2	—	17.2	—	—
フ	ランス	15,390	21,583	2,770,937	49.6	—	40.9	—	8.7
オ	ランダ	380	504	64,792	1.2	—	1.2	—	—
ベ	ルギー	7,970	11,395	1,462,929	26.2	—	26.2	—	—
ス	ウェーデン	千スウェーデンクローナ 2,880	千スウェーデンクローナ 3,571	44,569	0.8	—	0.7	0.1	—
デ	ンマーク	千デンマーククローネ 2,200	千デンマーククローネ 3,631	62,681	1.1	—	1.1	—	—
ポ	ーランド	千ポーランドズロチ 2,350	千ポーランドズロチ 2,808	78,685	1.4	—	0.8	0.6	—
合	計	—	—	5,447,374	97.6	—	88.2	0.7	8.7

※邦貨換算金額は、作成期末の時価を日本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。

三井住友・ヨーロッパ国債ファンド

B 個別銘柄開示 外国（外貨建）公社債

種 類	銘 柄	作 成 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		
(ユ ー ロ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
(ド イ ツ)	国債証券	DEUTSCHLAND REP 0	—	860	873	112,118	2050/8/15
		DEUTSCHLAND REP 5.5	5.5	4,070	6,482	832,191	2031/1/4
		DEUTSCHLAND REP 6.5	6.5	100	143	18,470	2027/7/4
(フ ラ ンス)	国債証券	FRANCE O. A. T. 2	2.0	1,550	2,127	273,082	2048/5/25
		FRANCE O. A. T. 2.75	2.75	2,120	2,557	328,384	2027/10/25
		FRANCE O. A. T. 4	4.0	4,150	6,835	877,547	2038/10/25
		FRANCE O. A. T. 5.5	5.5	4,290	6,272	805,306	2029/4/25
		FRANCE O. A. T. 8.5	8.5	3,280	3,790	486,615	2023/4/25
(オ ラ ン ダ)	国債証券	NETHERLANDS GOVT 2.5	2.5	380	504	64,792	2033/1/15
(ベ ル ギ ー)	国債証券	BELGIAN 0326 4	4.0	3,860	5,598	718,790	2032/3/28
		BELGIAN 0291 5.5	5.5	4,110	5,796	744,138	2028/3/28
小 計		—	—	—	—	5,261,438	—
(ス ウ ェー デ ン)	国債証券	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	0.75	1,460	1,540	19,228	2028/5/12
		SWEDISH GOVRNMNT 2.5	2.5	320	353	4,405	2025/5/12
		SWEDISH GOVRNMNT 3.5	3.5	1,100	1,677	20,935	2039/3/30
小 計		—	—	—	—	44,569	—
(デ ン マー ク)	国債証券	DENMARK - BULLET 0.5	0.5	500	530	9,149	2027/11/15
		DENMARK - BULLET 4.5	4.5	1,700	3,101	53,531	2039/11/15
小 計		—	—	—	—	62,681	—
(ポ ー ラ ン ド)	国債証券	POLAND GOVT BOND 2.5	2.5	1,100	1,157	32,438	2024/4/25
		POLAND GOVT BOND 5.75	5.75	1,250	1,650	46,246	2029/4/25
小 計		—	—	—	—	78,685	—
合 計		—	—	—	—	5,447,374	—

※邦貨換算金額は、作成期末の時価を日本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。

■ 投資信託財産の構成

(2021年8月20日現在)

項 目	作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	5,447,374千円	97.3%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	152,664	2.7
投 資 信 託 財 産 総 額	5,600,038	100.0

※作成期末における外貨建資産（5,537,640千円）の投資信託財産総額（5,600,038千円）に対する比率は98.9%です。

※外貨建資産は、作成期末の時価を日本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。なお、作成期末における邦貨換算レートは、1ユーロ=128.38円、1スウェーデンクローナ=12.48円、1デンマーククローネ=17.26円、1ポーランドズロチ=28.0177円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年3月22日) (2021年4月20日) (2021年5月20日) (2021年6月21日) (2021年7月20日) (2021年8月20日)

項 目	第 216 期 末	第 217 期 末	第 218 期 末	第 219 期 末	第 220 期 末	第 221 期 末
(A) 資 産	5,840,306,707円	5,795,535,979円	5,722,721,493円	5,648,960,511円	5,663,768,749円	5,600,038,931円
コール・ローン等	35,906,593	130,569,040	97,005,990	56,635,614	32,272,633	65,188,215
公社債(評価額)	5,612,889,883	5,554,419,411	5,573,165,939	5,531,802,082	5,528,287,955	5,447,374,071
未 収 入 金	44,349,304	—	—	—	29,752,426	—
未 収 利 息	139,927,786	103,663,227	47,039,432	59,548,462	71,886,383	85,075,576
前 払 費 用	2,677,535	1,960,566	208,554	205,169	379,635	835,174
その他未収収益	4,555,606	4,923,735	5,301,578	769,184	1,189,717	1,565,895
(B) 負 債	63,545,052	62,468,672	19,661,521	19,440,484	50,198,296	18,403,295
未 払 金	44,353,254	42,449,367	—	—	29,809,777	—
未払収益分配金	13,679,007	13,586,567	13,471,488	13,400,589	13,358,052	13,307,378
未 払 解 約 金	1,320,390	2,115,783	1,758,267	1,304,000	2,803,834	584,162
未 払 信 託 報 酬	4,167,810	4,290,164	4,405,222	4,707,809	4,201,847	4,484,818
未 払 利 息	85	188	242	121	50	158
その他未払費用	24,506	26,603	26,302	27,965	24,736	26,779
(C) 純資産総額(A-B)	5,776,761,655	5,733,067,307	5,703,059,972	5,629,520,027	5,613,570,453	5,581,635,636
元 本	9,119,338,329	9,057,711,431	8,980,992,122	8,933,726,628	8,905,368,176	8,871,585,907
次期繰越損益金	△3,342,576,674	△3,324,644,124	△3,277,932,150	△3,304,206,601	△3,291,797,723	△3,289,950,271
(D) 受益権総口数	9,119,338,329口	9,057,711,431口	8,980,992,122口	8,933,726,628口	8,905,368,176口	8,871,585,907口
1万口当たり基準価額(C/D)	6,335円	6,329円	6,350円	6,301円	6,304円	6,292円

※当作成期における作成期首元本額9,159,968,708円、作成期中追加設定元本額36,552,392円、作成期中一部解約元本額324,935,193円です。
 ※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 損益の状況

〔自2021年2月23日
至2021年3月22日〕 〔自2021年3月23日
至2021年4月20日〕 〔自2021年4月21日
至2021年5月20日〕 〔自2021年5月21日
至2021年6月21日〕 〔自2021年6月22日
至2021年7月20日〕 〔自2021年7月21日
至2021年8月20日〕

項 目	第 216 期	第 217 期	第 218 期	第 219 期	第 220 期	第 221 期
(A) 配 当 等 収 益	15,402,611円	15,628,779円	16,195,351円	17,291,359円	15,506,015円	16,051,867円
受 取 利 息	14,997,280	15,288,787	15,867,774	16,939,543	15,105,229	15,702,928
そ の 他 収 益 金	406,987	344,145	331,066	356,249	402,603	350,305
支 払 利 息	△ 1,656	△ 4,153	△ 3,489	△ 4,433	△ 1,817	△ 1,366
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	39,755,136	△ 2,293,454	20,374,553	△ 42,553,411	4,335,179	△ 8,933,352
売 買 益	67,746,518	37,540,811	121,224,439	53,678,791	79,617,536	32,269,580
売 買 損	△ 27,991,382	△ 39,834,265	△ 100,849,886	△ 96,232,202	△ 75,282,357	△ 41,202,932
(C) 信 託 報 酬 等	△ 4,192,316	△ 4,543,616	△ 4,662,811	△ 4,957,100	△ 4,619,875	△ 4,516,140
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	50,965,431	8,791,709	31,907,093	△ 30,219,152	15,221,319	2,602,375
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 2,108,916,841	△ 2,055,241,154	△ 2,041,448,637	△ 2,011,129,080	△ 2,047,129,693	△ 2,036,528,264
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 1,270,946,257	△ 1,264,608,112	△ 1,254,919,118	△ 1,249,457,780	△ 1,246,531,297	△ 1,242,717,004
(配当等相当額)	(5,565,656)	(5,697,474)	(5,724,858)	(5,781,761)	(5,839,099)	(5,883,219)
(売買損益相当額)	(△1,276,511,913)	(△1,270,305,586)	(△1,260,643,976)	(△1,255,239,541)	(△1,252,370,396)	(△1,248,600,223)
(G) 計 (D + E + F)	△ 3,328,897,667	△ 3,311,057,557	△ 3,264,460,662	△ 3,290,806,012	△ 3,278,439,671	△ 3,276,642,893
(H) 収 益 分 配 金	△ 13,679,007	△ 13,586,567	△ 13,471,488	△ 13,400,589	△ 13,358,052	△ 13,307,378
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△ 3,342,576,674	△ 3,324,644,124	△ 3,277,932,150	△ 3,304,206,601	△ 3,291,797,723	△ 3,289,950,271
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 1,270,946,257	△ 1,264,608,112	△ 1,254,919,118	△ 1,249,457,780	△ 1,246,531,297	△ 1,242,717,004
(配当等相当額)	(5,565,656)	(5,697,474)	(5,724,858)	(5,781,761)	(5,839,099)	(5,883,219)
(売買損益相当額)	(△1,276,511,913)	(△1,270,305,586)	(△1,260,643,976)	(△1,255,239,541)	(△1,252,370,396)	(△1,248,600,223)
分 配 準 備 積 立 金	150,262,783	146,701,584	146,154,101	144,304,614	142,355,286	140,032,977
繰 越 損 益 金	△ 2,221,893,200	△ 2,206,737,596	△ 2,169,167,133	△ 2,199,053,435	△ 2,187,621,712	△ 2,187,266,244

※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。

※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。

※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。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

	第 216 期	第 217 期	第 218 期	第 219 期	第 220 期	第 221 期
(a) 費用控除後の配当等収益	14,232,116円	11,085,163円	14,130,192円	12,334,259円	11,895,583円	11,535,727円
(b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	—	—	—	—	—	—
(c) 収益調整金	5,565,656	5,697,474	5,724,858	5,781,761	5,839,099	5,883,219
(d) 分配準備積立金	149,709,674	149,202,988	145,495,397	145,370,944	143,817,755	141,804,628
(e) 分配可能額(a+b+c+d)	169,507,446	165,985,625	165,350,447	163,486,964	161,552,437	159,223,574
1万口当たり分配可能額	185	183	184	182	181	179
(f) 分配金額	13,679,007	13,586,567	13,471,488	13,400,589	13,358,052	13,307,378
1万口当たり分配金額(税引前)	15	15	15	15	15	15

■ 分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税引前)	第216期	第217期	第218期	第219期	第220期	第221期
	15円	15円	15円	15円	15円	15円

※分配金は、分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額「普通分配金」となり課税されます。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は下回る部分が「元本払戻金(特別分配金)」となり非課税、残りの部分が「普通分配金」となります。

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。