

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112期(決算日2020年3月13日) 第113期(決算日2020年4月13日) 第114期(決算日2020年5月13日)
第115期(決算日2020年6月15日) 第116期(決算日2020年7月13日) 第117期(決算日2020年8月13日)

作成対象期間(2020年2月14日～2020年8月13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があります。また、わが国の国債のみに投資を行う場合があります。なお、投資対象国は定期的に見直すものとします。外貨建て資産については、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	外貨建て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	基準価額 (分配落)	税金 分	配 金	騰 落	額 中 率	債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	純 資 産 額
88期(2018年3月13日)	9,228		20		△0.5		97.1		—	12,304
89期(2018年4月13日)	9,216		20		0.1		98.4		—	12,332
90期(2018年5月14日)	9,157		20		△0.4		98.3		—	12,003
91期(2018年6月13日)	9,148		20		0.1		98.2		—	12,045
92期(2018年7月13日)	9,178		20		0.5		99.9		—	11,974
93期(2018年8月13日)	9,151		20		△0.1		95.3		—	11,857
94期(2018年9月13日)	9,101		20		△0.3		98.3		—	11,810
95期(2018年10月15日)	9,020		20		△0.7		96.8		—	11,631
96期(2018年11月13日)	9,018		20		0.2		96.9		—	11,184
97期(2018年12月13日)	9,066		20		0.8		96.4		—	11,303
98期(2019年1月15日)	9,107		20		0.7		98.4		—	11,323
99期(2019年2月13日)	9,099		20		0.1		96.7		—	11,644
100期(2019年3月13日)	9,102		20		0.3		96.3		—	11,675
101期(2019年4月15日)	9,096		20		0.2		97.7		—	11,726
102期(2019年5月13日)	9,081		20		0.1		96.4		—	11,766
103期(2019年6月13日)	9,144		20		0.9		99.2		—	11,945
104期(2019年7月16日)	9,130		20		0.1		96.4		—	12,433
105期(2019年8月13日)	9,201		20		1.0		96.8		—	12,564
106期(2019年9月13日)	9,166		20		△0.2		100.7		—	12,494
107期(2019年10月15日)	9,118		20		△0.3		98.9		—	12,508
108期(2019年11月13日)	9,018		20		△0.9		96.7		—	12,698
109期(2019年12月13日)	9,000		20		0.0		98.2		—	13,013
110期(2020年1月14日)	8,952		20		△0.3		99.8		—	12,919
111期(2020年2月13日)	8,997		20		0.7		95.8		—	12,461
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

* 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

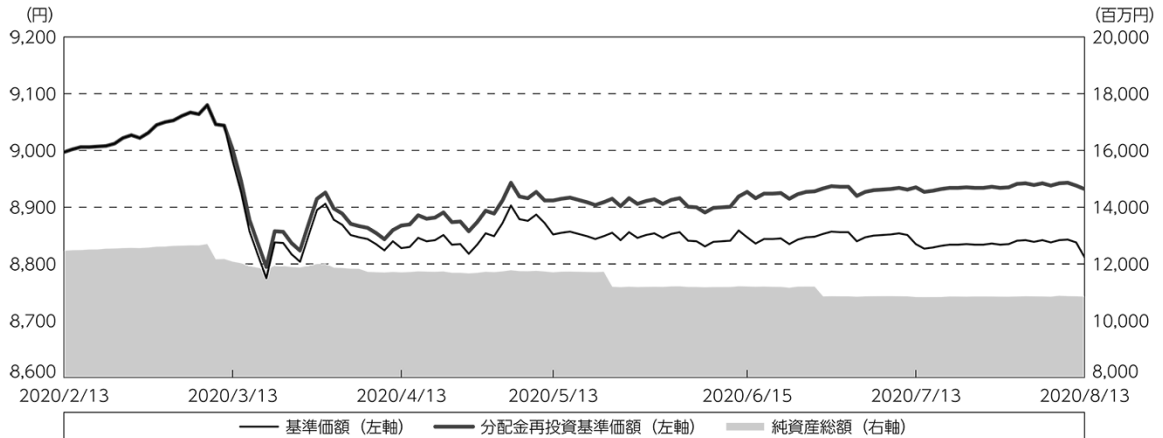
決 算 期	年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率
			騰 落 率	率				
第112期	(期 首) 2020年2月13日	円 8,997		% —	% 95.8		% —	
	2月末	9,031		0.4	95.9		—	
	(期 末) 2020年3月13日	9,002		0.1	94.8		—	
第113期	(期 首) 2020年3月13日	8,982		—	94.8		—	
	3月末	8,906		△0.8	95.9		—	
	(期 末) 2020年4月13日	8,848		△1.5	96.8		—	
第114期	(期 首) 2020年4月13日	8,828		—	96.8		—	
	4月末	8,872		0.5	96.2		—	
	(期 末) 2020年5月13日	8,872		0.5	98.3		—	
第115期	(期 首) 2020年5月13日	8,852		—	98.3		—	
	5月末	8,854		0.0	101.9		—	
	(期 末) 2020年6月15日	8,867		0.2	98.4		—	
第116期	(期 首) 2020年6月15日	8,847		—	98.4		—	
	6月末	8,856		0.1	98.8		—	
	(期 末) 2020年7月13日	8,855		0.1	97.5		—	
第117期	(期 首) 2020年7月13日	8,835		—	97.5		—	
	7月末	8,841		0.1	98.4		—	
	(期 末) 2020年8月13日	8,832		△0.0	99.5		—	

* 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112期首：8,997円

第117期末：8,812円 (既払分配金(税込み)：120円)

騰落率：△ 0.7% (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(2020年2月13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8,997円から当作成期末には8,812円(分配後)となりました。この間に、合計120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65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、新型コロナウイルス感染拡大に伴う景気の先行き懸念などを背景に、FRB（米連邦準備制度理事会）が大規模な金融緩和に踏み切ったことで、債券利回りは低下（価格は上昇）しました。

ユーロ圏では、新型コロナウイルス感染拡大による景気の急速な低迷などを背景に、ドイツの債券利回りは低下しました。ECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和余地の少なさが市場の一部で意識されたことなどから、米国と比較すると小幅な利回り低下となりました。なお、当作成期において投資対象国としていたフランス、ベルギー、オーストリアは、当作成期を通じては利回り低下となったものの、新型コロナウイルス感染拡大を受けて金融市場が大きく混乱し、安全資産とされる先進国国債にも売り圧力が強まる局面では、債券利回りが一時的に大きく上昇（価格は下落）しました。

日本では、日銀が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の枠組みのもと緩和的な金融政策を継続しました。

○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、当作成期にフランス、ベルギーを除外し、新たにオーストラリア、シンガポールを組み入れました。当作成期末における投資対象国は、オーストラリア、シンガポール、オーストリアとしました。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。

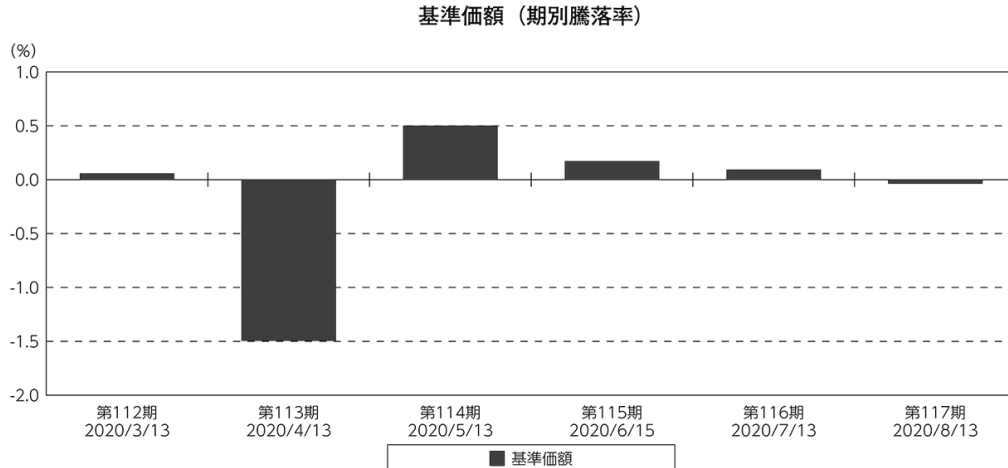
<為替>

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いません。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第112期	第113期	第114期	第115期	第116期	第117期
	2020年2月14日～ 2020年3月13日	2020年3月14日～ 2020年4月13日	2020年4月14日～ 2020年5月13日	2020年5月14日～ 2020年6月15日	2020年6月16日～ 2020年7月13日	2020年7月14日～ 2020年8月13日
当期分配金	20	20	20	20	20	20
(対基準価額比率)	0.222%	0.226%	0.225%	0.226%	0.226%	0.226%
当期の収益	10	10	13	18	14	14
当期の収益以外	9	9	6	1	5	5
翌期繰越分配対象額	955	945	939	938	933	927

(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四捨五入して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

(2020年2月14日～2020年8月13日)

項 目	第112期～第117期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 32	% 0.356	(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)	(0.164)	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)	(15)	(0.164)	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	0.008	(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)	(0.007)	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	33	0.364	
作成期間の平均基準価額は、8,893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。

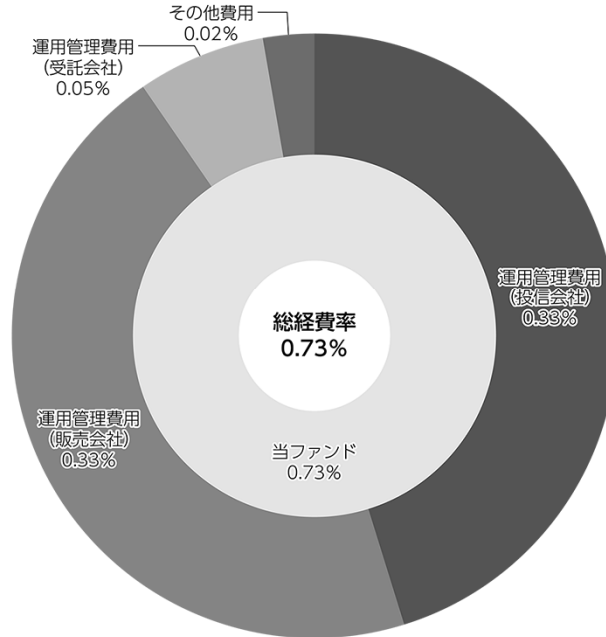
* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 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0.73%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

(2020年2月14日～2020年8月13日)

公社債

			第112期～第117期	
			買付額	売付額
外	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	フランス	国債証券	8,111	40,273
	ベルギー	国債証券	49,595	82,205
	オーストリア	国債証券	13,027	18,127
国	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 47,480	千シンガポールドル 1,587
	オーストラリア	国債証券	千豪ドル 79,462	千豪ドル 31,893

*金額は受け渡し代金。(経過利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

(2020年2月14日～2020年8月13日)

利害関係人との取引状況

区 分	第112期～第117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	%
為替先物取引	69,226	512	0.7	67,505	—	—
為替直物取引	7,720	—	—	9,389	512	5.5

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信託銀行です。

○組入資産の明細

(2020年8月13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117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
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千円	%	%	%	%	%
オーストリア	26,700	28,717	3,618,452	33.4	—	14.6	18.7	—
シンガポール	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
	42,500	45,790	3,563,890	32.8	—	3.5	29.3	—
オーストラリア	千豪ドル	千豪ドル						
	40,000	47,133	3,608,106	33.3	—	17.4	8.6	7.2
合 計	—	—	10,790,449	99.5	—	35.5	56.7	7.2

* 邦貨換算金額は、第117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117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	
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	400	437	55,080	2022/11/22
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	14,600	15,707	1,979,159	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	6,700	7,235	911,733	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	5,000	5,337	672,479	2027/4/20
小 計						3,618,452	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	12,000	12,702	988,596	2022/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	13,000	13,895	1,081,502	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	10,000	11,036	858,931	2024/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	3,000	3,266	254,258	2025/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	4,500	4,890	380,600	2026/6/1
小 計						3,563,890	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	9,300	10,270	786,174	2022/7/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	7,700	8,780	672,141	2023/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	3,000	3,397	260,086	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	12,000	14,520	1,111,546	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	8,000	10,165	778,157	2027/4/21
小 計						3,608,106	
合 計						10,790,449	

* 邦貨換算金額は、第117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

(2020年8月13日現在)

項 目	第117期末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 10,790,449	% 96.8
コール・ローン等、その他	355,516	3.2
投資信託財産総額	11,145,965	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*第117期末における外貨建て純資産(10,903,827千円)の投資信託財産総額(11,145,965千円)に対する比率は97.8%です。

*外貨建て資産は、第117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=106.71円、1ノルウェークローネ=11.97円、1ユーロ=126.00円、1シンガポールドル=77.83円、1豪ドル=76.55円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第112期末	第113期末	第114期末	第115期末	第116期末	第117期末
	2020年3月13日現在	2020年4月13日現在	2020年5月13日現在	2020年6月15日現在	2020年7月13日現在	2020年8月13日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	24,440,519,207	23,911,169,515	24,242,554,874	22,301,263,472	21,443,185,229	21,857,967,530
コール・ローン等	224,938,680	328,134,771	289,064,883	132,956,345	220,236,166	128,271,253
公社債(評価額)	11,459,609,339	11,330,919,388	11,506,406,335	11,024,817,193	10,565,858,631	10,790,449,746
未収入金	12,615,417,670	12,089,581,701	12,324,378,426	11,007,357,500	10,560,094,080	10,835,576,802
未収利息	70,921,102	82,338,741	35,706,589	63,391,186	40,410,775	59,396,056
前払費用	63,205,637	73,155,553	79,326,400	71,494,083	54,684,598	41,839,709
その他未収収益	6,426,779	7,039,361	7,672,241	1,247,165	1,900,979	2,433,964
(B) 負債	12,358,056,273	12,208,659,062	12,536,978,905	11,096,272,798	10,609,083,652	11,008,272,625
未払金	11,820,209,509	12,171,479,381	12,499,054,141	11,063,594,000	10,544,166,000	10,952,362,560
未払収益分配金	26,903,752	26,513,547	26,448,047	25,330,883	24,524,363	24,625,785
未払解約金	503,814,667	3,453,504	4,580,638	15,710	34,362,719	24,690,225
未払信託報酬	7,105,043	7,190,360	6,874,723	7,309,654	6,011,963	6,573,773
未払利息	1,451	157	212	73	119	62
その他未払費用	21,851	22,113	21,144	22,478	18,488	20,220
(C) 純資産総額(A-B)	12,082,462,934	11,702,510,453	11,705,575,969	11,204,990,674	10,834,101,577	10,849,694,905
元本	13,451,876,295	13,256,773,930	13,224,023,513	12,665,441,944	12,262,181,634	12,312,892,836
次期繰越損益金	△ 1,369,413,361	△ 1,554,263,477	△ 1,518,447,544	△ 1,460,451,270	△ 1,428,080,057	△ 1,463,197,931
(D) 受益権総口数	13,451,876,295口	13,256,773,930口	13,224,023,513口	12,665,441,944口	12,262,181,634口	12,312,892,836口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,982円	8,828円	8,852円	8,847円	8,835円	8,812円

(注) 第112期首元本額は13,850,567,929円、第112～117期中追加設定元本額は626,803,243円、第112～117期中一部解約元本額は2,164,478,336円、1口当たり純資産額は、第112期0.8982円、第113期0.8828円、第114期0.8852円、第115期0.8847円、第116期0.8835円、第117期0.8812円です。

○損益の状況

項 目	第112期	第113期	第114期	第115期	第116期	第117期
	2020年2月14日～ 2020年3月13日	2020年3月14日～ 2020年4月13日	2020年4月14日～ 2020年5月13日	2020年5月14日～ 2020年6月15日	2020年6月16日～ 2020年7月13日	2020年7月14日～ 2020年8月13日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	21,160,531	21,058,352	20,618,479	30,954,400	24,010,668	24,893,718
受取利息	21,114,110	20,632,956	20,020,693	30,651,701	23,622,570	24,431,099
その他収益金	48,975	433,577	614,472	316,002	401,971	466,569
支払利息	△ 2,554	△ 8,181	△ 16,686	△ 13,303	△ 13,873	△ 3,950
(B) 有価証券売買損益	△ 7,788,499	△ 190,763,722	44,764,373	△ 4,316,139	△ 7,456,912	△ 22,763,087
売買益	332,643,410	368,650,324	471,203,255	672,530,868	153,530,050	307,684,650
売買損	△ 340,431,909	△ 559,414,046	△ 426,438,882	△ 676,847,007	△ 160,986,962	△ 330,447,737
(C) 信託報酬等	△ 7,335,162	△ 7,362,390	△ 6,991,655	△ 7,449,971	△ 6,133,162	△ 6,730,897
(D) 当期損益金(A+B+C)	6,036,870	△ 177,067,760	58,391,197	19,188,290	10,420,594	△ 4,600,266
(E) 前期繰越損益金	△ 905,303,124	△ 906,503,758	△ 1,103,750,633	△ 1,022,232,803	△ 988,109,541	△ 994,833,376
(F) 追加信託差損益金	△ 443,243,355	△ 444,178,412	△ 446,640,061	△ 432,075,874	△ 425,866,747	△ 439,138,504
(配当等相当額)	(1,187,269,528)	(1,170,731,352)	(1,168,120,263)	(1,119,119,517)	(1,084,059,406)	(1,089,351,886)
(売買損益相当額)	(△1,630,512,883)	(△1,614,909,764)	(△1,614,760,324)	(△1,551,195,391)	(△1,509,926,153)	(△1,528,490,390)
(G) 計(D+E+F)	△ 1,342,509,609	△ 1,527,749,930	△ 1,491,999,497	△ 1,435,120,387	△ 1,403,555,694	△ 1,438,572,146
(H) 収益分配金	△ 26,903,752	△ 26,513,547	△ 26,448,047	△ 25,330,883	△ 24,524,363	△ 24,625,785
次期繰越損益金(G+H)	△ 1,369,413,361	△ 1,554,263,477	△ 1,518,447,544	△ 1,460,451,270	△ 1,428,080,057	△ 1,463,197,931
追加信託差損益金	△ 443,243,355	△ 444,178,412	△ 446,640,061	△ 432,075,874	△ 425,866,747	△ 439,138,504
(配当等相当額)	(1,187,269,528)	(1,170,731,352)	(1,168,120,263)	(1,119,119,517)	(1,084,059,406)	(1,089,351,886)
(売買損益相当額)	(△1,630,512,883)	(△1,614,909,764)	(△1,614,760,324)	(△1,551,195,391)	(△1,509,926,153)	(△1,528,490,390)
分配準備積立金	98,255,993	83,352,043	74,842,380	69,554,216	60,183,976	53,277,840
繰越損益金	△ 1,024,425,999	△ 1,193,437,108	△ 1,146,649,863	△ 1,097,929,612	△ 1,062,397,286	△ 1,077,337,267

* 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(2020年2月14日～2020年8月13日)は以下の通りです。

項 目	第112期	第113期	第114期	第115期	第116期	第117期
	2020年2月14日～ 2020年3月13日	2020年3月14日～ 2020年4月13日	2020年4月14日～ 2020年5月13日	2020年5月14日～ 2020年6月15日	2020年6月16日～ 2020年7月13日	2020年7月14日～ 2020年8月13日
a. 配当等収益(経費控除後)	13,825,369円	13,695,962円	18,414,010円	23,504,429円	17,877,506円	18,162,821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	1,187,269,528円	1,170,731,352円	1,168,120,263円	1,119,119,517円	1,084,059,406円	1,089,351,886円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	111,334,376円	96,169,628円	82,876,417円	71,380,670円	66,830,833円	59,740,804円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,312,429,273円	1,280,596,942円	1,269,410,690円	1,214,004,616円	1,168,767,745円	1,167,255,511円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	975円	965円	959円	958円	953円	947円
g. 分配金	26,903,752円	26,513,547円	26,448,047円	25,330,883円	24,524,363円	24,625,785円
h. 分配金(1万円当たり)	20円	20円	20円	20円	20円	20円

○分配金のお知らせ

	第112期	第113期	第114期	第115期	第116期	第117期
1万円当たり分配金(税込み)	20円	20円	20円	20円	20円	20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。