

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154期 (決算日2023年9月13日) 第155期 (決算日2023年10月13日) 第156期 (決算日2023年11月13日)
第157期 (決算日2023年12月13日) 第158期 (決算日2024年1月15日) 第159期 (決算日2024年2月13日)

作成対象期間 (2023年8月15日～2024年2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カ国とまらない場合、国別の投資比率が概ね均等とま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に限り、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 |
|-------------------|---------------|---------|--------|--------|-------------|------------------|--------|------------------|--------|------------------|
| | | | | | | | | | | |
| 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 |
| 142期(2022年9月13日) | 7,799 | | 10 | | △0.9 | | 102.2 | | — | 7,180 |
| 143期(2022年10月13日) | 7,707 | | 10 | | △1.1 | | 98.6 | | — | 7,094 |
| 144期(2022年11月14日) | 7,805 | | 10 | | 1.4 | | 96.9 | | — | 7,148 |
| 145期(2022年12月13日) | 7,846 | | 10 | | 0.7 | | 100.5 | | — | 7,224 |
| 146期(2023年1月13日) | 7,756 | | 10 | | △1.0 | | 99.0 | | — | 7,121 |
| 147期(2023年2月13日) | 7,687 | | 10 | | △0.8 | | 97.8 | | — | 7,101 |
| 148期(2023年3月13日) | 7,617 | | 10 | | △0.8 | | 97.3 | | — | 7,023 |
| 149期(2023年4月13日) | 7,640 | | 10 | | 0.4 | | 98.9 | | — | 6,508 |
| 150期(2023年5月15日) | 7,631 | | 10 | | 0.0 | | 98.8 | | — | 6,430 |
| 151期(2023年6月13日) | 7,624 | | 10 | | 0.0 | | 99.2 | | — | 6,341 |
| 152期(2023年7月13日) | 7,592 | | 10 | | △0.3 | | 98.7 | | — | 6,206 |
| 153期(2023年8月14日) | 7,535 | | 10 | | △0.6 | | 99.1 | | — | 6,041 |
| 154期(2023年9月13日) | 7,508 | | 10 | | △0.2 | | 99.7 | | — | 5,937 |
| 155期(2023年10月13日) | 7,489 | | 10 | | △0.1 | | 99.4 | | — | 5,879 |
| 156期(2023年11月13日) | 7,444 | | 10 | | △0.5 | | 99.5 | | — | 5,561 |
| 157期(2023年12月13日) | 7,482 | | 10 | | 0.6 | | 98.9 | | — | 5,462 |
| 158期(2024年1月15日) | 7,502 | | 10 | | 0.4 | | 99.6 | | — | 5,425 |
| 159期(2024年2月13日) | 7,445 | | 10 | | △0.6 | | 99.5 | | — | 5,318 |

* 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

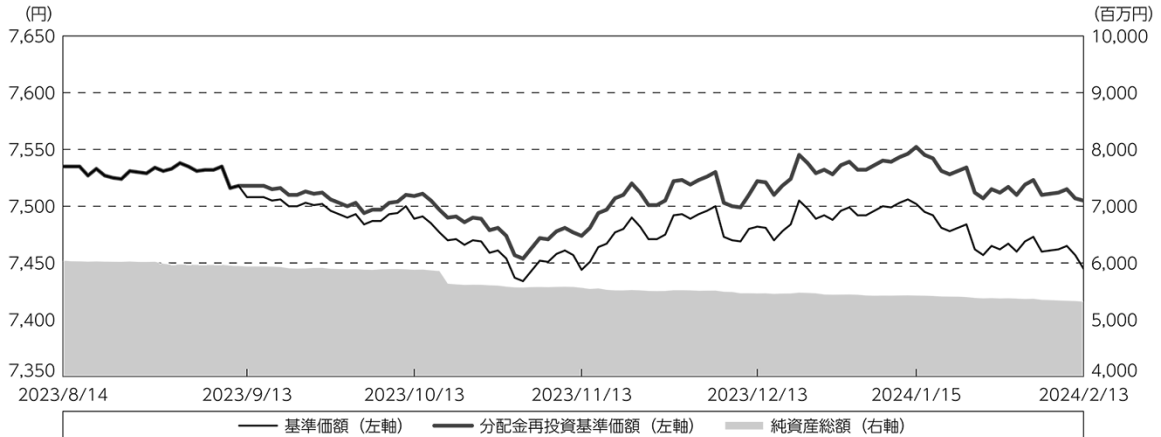
| 決 算 期 | 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 券 率 |
|-------|----------------------|------------|--------|-------|-----------|-----------|--------|
| | | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | |
| 第154期 | (期 首) 2023年 8月14日 | 円 7,535 | % — | | % 99.1 | | % — |
| | 8月末 | 7,533 | △0.0 | | 99.5 | | — |
| | (期 末) 2023年 9月13日 | 7,518 | △0.2 | | 99.7 | | — |
| 第155期 | (期 首) 2023年 9月13日 | 7,508 | — | | 99.7 | | — |
| | 9月末 | 7,493 | △0.2 | | 99.4 | | — |
| | (期 末) 2023年10月13日 | 7,499 | △0.1 | | 99.4 | | — |
| 第156期 | (期 首) 2023年10月13日 | 7,489 | — | | 99.4 | | — |
| | 10月末 | 7,437 | △0.7 | | 100.0 | | — |
| | (期 末) 2023年11月13日 | 7,454 | △0.5 | | 99.5 | | — |
| 第157期 | (期 首) 2023年11月13日 | 7,444 | — | | 99.5 | | — |
| | 11月末 | 7,493 | 0.7 | | 99.4 | | — |
| | (期 末) 2023年12月13日 | 7,492 | 0.6 | | 98.9 | | — |
| 第158期 | (期 首) 2023年12月13日 | 7,482 | — | | 98.9 | | — |
| | 12月末 | 7,492 | 0.1 | | 99.4 | | — |
| | (期 末) 2024年 1月15日 | 7,512 | 0.4 | | 99.6 | | — |
| 第159期 | (期 首) 2024年 1月15日 | 7,502 | — | | 99.6 | | — |
| | 1月末 | 7,460 | △0.6 | | 99.3 | | — |
| | (期 末) 2024年 2月13日 | 7,455 | △0.6 | | 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154期首：7,535円

第159期末：7,445円 (既払分配金(税込み)：60円)

騰落率：△ 0.4% (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(2023年8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7,535円から当作成期末には7,445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30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、債券利回りは低下（価格は上昇）しました。当作成期首は、各種経済指標から米国景気の底堅さが確認される中で、FRB（米連邦準備制度理事会）の金融引き締め姿勢の継続が意識され、債券利回りは上昇（価格は下落）基調で推移しました。その後、雇用市場に減速の兆しが見えたことなどを背景に、債券利回りが急速に低下する局面もあり、当作成期を通じては債券利回り低下となりました。
- ・ユーロ圏では、債券利回りは低下しました。当作成期首は、ECB（欧州中央銀行）がインフレ率の高止まりに警戒感を示していたことなどから、ドイツの債券利回りは上昇しましたが、域内景気の悪化などから市場の一部でECBの金融引き締め姿勢の転換に対する期待が高まると、債券利回りは低下に転じ、当作成期を通じてみると、債券利回りは低下しました。
- ・当作成期に投資対象国としていた日本では、日銀がイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）政策の基本的な枠組みを維持しつつも、10年国債利回りの上振れを実質的に許容し、同政策の運営を柔軟化したことなどから、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、当作成期を通じて日本のみとしました。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。

<デュレーション※>

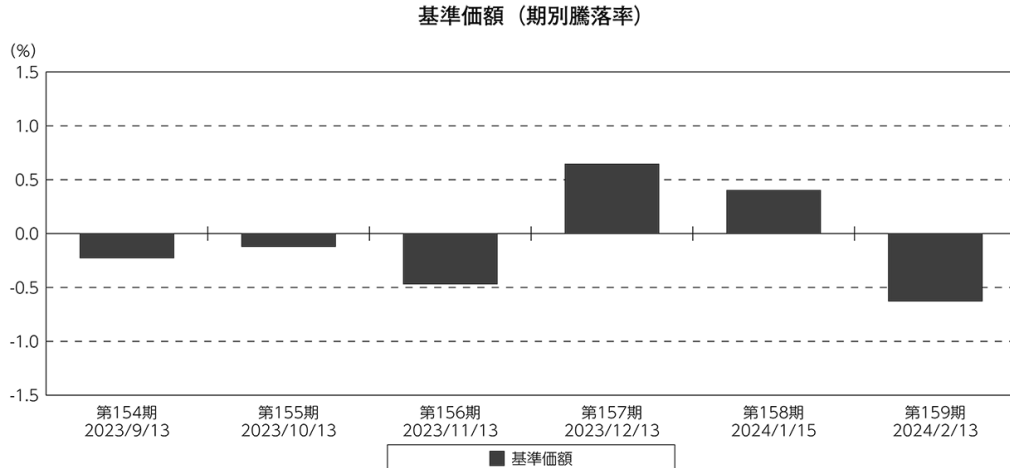
ポートフォリオのデュレーションは、当作成期末で約4.4年程度としました。

※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。

○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154期 | 第155期 | 第156期 | 第157期 | 第158期 | 第159期 |
|-----------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|
| | 2023年8月15日～ 2023年9月13日 | 2023年9月14日～ 2023年10月13日 | 2023年10月14日～ 2023年11月13日 | 2023年11月14日～ 2023年12月13日 | 2023年12月14日～ 2024年1月15日 | 2024年1月16日～ 2024年2月13日 |
| 当期分配金 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |
| (対基準価額比率) | 0.133% | 0.133% | 0.134% | 0.133% | 0.133% | 0.134% |
| 当期の収益 | — | — | — | — | — | — |
| 当期の収益以外 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |
| 翌期繰越分配対象額 | 867 | 857 | 847 | 838 | 829 | 819 |

(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。日本国債の利回りが外国債券のヘッジ後利回りを上回った場合には、投資対象国が3カ国未満となることがあります。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

(2023年8月15日～2024年2月13日)

| 項 目 | 第154期～第159期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------------|-------------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 27 | % 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) | (12) | (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) | (12) | (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 | 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 | 27 | 0.358 | |
| 作成期間の平均基準価額は、7,484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。

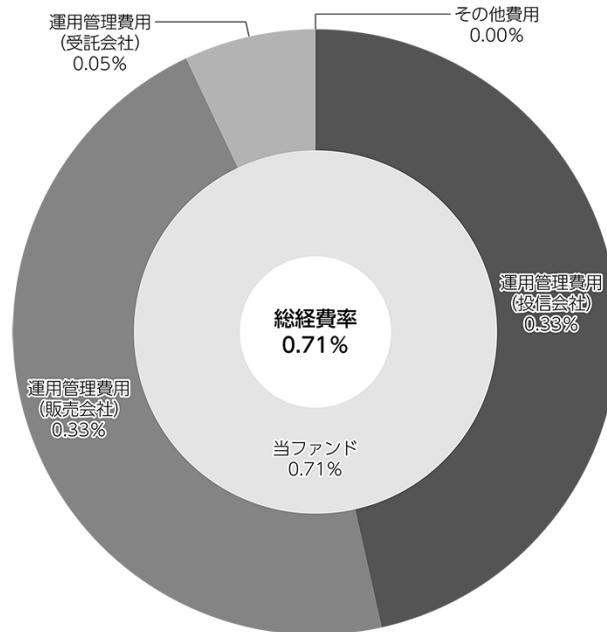
* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 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0.71%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、売買委託手数料およ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) 当ファンドのその他費用には、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。

(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

(2023年8月15日～2024年2月13日)

公社債

| | | 第154期～第159期 | |
|----|------|-----------------|------------------|
| | | 買付額 | 売付額 |
| 国内 | 国債証券 | 千円 9,989,593 | 千円 10,679,400 |

*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

(2023年8月15日～2024年2月13日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 第154期～第159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 | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円 9,989 | 百万円 750 | % 7.5 | 百万円 10,679 | 百万円 - | % - |

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

(2024年2月13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159期末 | | | | | | | |
|------|-----------|-----------|---------|---------------------|-----------|------|------|---|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちB B格以下 組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 | | | |
| | 千円 | 千円 | % | % | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 | % |
| 国債証券 | 5,335,000 | 5,289,498 | 99.5 | - | 25.3 | 50.7 | 23.5 | % |
| 合 計 | 5,335,000 | 5,289,498 | 99.5 | - | 25.3 | 50.7 | 23.5 | % |

*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 | 柄 | 第159期末 | | |
|------|--------------|--------|-----------|-----------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 |
| 国債証券 | | % | 千円 | 千円 |
| 国庫債券 | 利付(2年)第451回 | 0.005 | 1,070,000 | 1,069,293 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第144回 | 0.1 | 150,000 | 150,141 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第147回 | 0.005 | 565,000 | 563,819 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第148回 | 0.005 | 1,000,000 | 997,540 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第161回 | 0.3 | 210,000 | 210,268 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第162回 | 0.3 | 180,000 | 180,000 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第339回 | 0.4 | 30,000 | 30,149 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第352回 | 0.1 | 300,000 | 297,279 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第353回 | 0.1 | 450,000 | 445,275 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第354回 | 0.1 | 410,000 | 405,272 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第371回 | 0.4 | 440,000 | 429,360 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第80回 | 1.8 | 30,000 | 30,321 |
| 国庫債券 | 利付(20年)第148回 | 1.5 | 200,000 | 214,678 |
| 国庫債券 | 利付(20年)第157回 | 0.2 | 100,000 | 91,409 |
| 国庫債券 | 利付(20年)第176回 | 0.5 | 200,000 | 174,690 |
| 合 計 | | | 5,335,000 | 5,289,498 |

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年2月13日現在)

| 項 目 | 第159期末 | |
|--------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 5,289,498 | % 99.1 |
| コール・ローン等、その他 | 46,966 | 0.9 |
| 投資信託財産総額 | 5,336,464 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*第159期末における外貨建純資産(17千円)の投資信託財産総額(5,336,464千円)に対する比率は0.0%です。

*外貨建資産は、第159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=149.39円、1英ポンド=188.62円、1ノルウェークローネ=14.22円、1ユーロ=160.92円、1豪ドル=97.51円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第154期末 | 第155期末 | 第156期末 | 第157期末 | 第158期末 | 第159期末 |
|-----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | 2023年9月13日現在 | 2023年10月13日現在 | 2023年11月13日現在 | 2023年12月13日現在 | 2024年1月15日現在 | 2024年2月13日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 5,957,411,009 | 5,900,859,886 | 5,578,590,484 | 6,422,304,741 | 5,437,087,174 | 5,336,464,034 |
| コール・ローン等 | 38,377,225 | 54,942,945 | 43,643,649 | 69,143,707 | 32,149,528 | 44,008,199 |
| 公社債(評価額) | 5,917,176,900 | 5,844,156,700 | 5,532,610,200 | 5,402,190,200 | 5,403,915,800 | 5,289,498,250 |
| 未収入金 | — | — | — | 948,071,500 | — | — |
| 未収利息 | 229,604 | 592,804 | 1,081,007 | 1,479,103 | 392,406 | 725,184 |
| 前払費用 | 1,504,379 | 1,044,536 | 1,132,727 | 1,297,330 | 506,539 | 2,109,500 |
| その他未収収益 | 122,901 | 122,901 | 122,901 | 122,901 | 122,901 | 122,901 |
| (B) 負債 | 19,538,180 | 21,346,973 | 16,979,479 | 959,682,403 | 11,529,804 | 18,339,168 |
| 未払金 | — | — | — | 914,675,600 | — | — |
| 未払収益分配金 | 7,909,245 | 7,850,879 | 7,471,382 | 7,301,329 | 7,232,136 | 7,143,673 |
| 未払解約金 | 8,093,505 | 10,014,828 | 6,068,332 | 34,456,559 | 777,340 | 8,141,041 |
| 未払信託報酬 | 3,524,570 | 3,470,551 | 3,429,202 | 3,238,942 | 3,509,527 | 3,045,090 |
| 未払利息 | 29 | 47 | 22 | 16 | 9 | 3 |
| その他未払費用 | 10,831 | 10,668 | 10,541 | 9,957 | 10,792 | 9,361 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 5,937,872,829 | 5,879,512,913 | 5,561,611,005 | 5,462,622,338 | 5,425,557,370 | 5,318,124,866 |
| 元本 | 7,909,245,904 | 7,850,879,039 | 7,471,382,600 | 7,301,329,402 | 7,232,136,602 | 7,143,673,322 |
| 次期繰越損益金 | △1,971,373,075 | △1,971,366,126 | △1,909,771,595 | △1,838,707,064 | △1,806,579,232 | △1,825,548,456 |
| (D) 受益権総口数 | 7,909,245,904口 | 7,850,879,039口 | 7,471,382,600口 | 7,301,329,402口 | 7,232,136,602口 | 7,143,673,322口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 7,508円 | 7,489円 | 7,444円 | 7,482円 | 7,502円 | 7,445円 |

(注) 第154期首元本額は8,017,058,526円、第154～159期中追加設定元本額は66,854,854円、第154～159期中一部解約元本額は940,240,058円、1口当たり純資産額は、第154期0.7508円、第155期0.7489円、第156期0.7444円、第157期0.7482円、第158期0.7502円、第159期0.7445円です。

○損益の状況

| 項 目 | 第154期 | 第155期 | 第156期 | 第157期 | 第158期 | 第159期 |
|------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|
| | 2023年8月15日～ 2023年9月13日 | 2023年9月14日～ 2023年10月13日 | 2023年10月14日～ 2023年11月13日 | 2023年11月14日～ 2023年12月13日 | 2023年12月14日～ 2024年1月15日 | 2024年1月16日～ 2024年2月13日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 431,767 | 488,714 | 591,309 | 581,678 | 604,759 | 594,823 |
| 受取利息 | 433,939 | 490,315 | 592,195 | 582,370 | 605,475 | 595,067 |
| 支払利息 | △ 2,172 | △ 1,601 | △ 886 | △ 692 | △ 716 | △ 244 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 10,901,271 | △ 3,658,968 | △ 23,375,198 | 37,556,282 | 24,849,831 | △ 31,461,721 |
| 売買益 | 371,145 | 1,289,866 | 491,365 | 38,691,842 | 25,559,052 | 466,190 |
| 売買損 | △ 11,272,416 | △ 4,948,834 | △ 23,866,563 | △ 1,135,560 | △ 709,221 | △ 31,927,911 |
| (C) 信託報酬等 | △ 3,535,401 | △ 3,481,219 | △ 3,439,743 | △ 3,248,899 | △ 3,520,319 | △ 3,054,451 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 14,004,905 | △ 6,651,473 | △ 26,223,632 | 34,889,061 | 21,934,271 | △ 33,921,349 |
| (E) 前期繰越損益金 | △1,448,808,798 | △1,444,172,309 | △1,379,990,785 | △1,373,023,845 | △1,324,659,028 | △1,285,849,456 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 500,650,127 | △ 512,691,465 | △ 496,085,796 | △ 493,270,951 | △ 496,622,339 | △ 498,633,978 |
| (配当等相当額) | (693,504,715) | (680,540,104) | (640,173,693) | (618,301,865) | (605,211,128) | (590,665,702) |
| (売買損益相当額) | (△1,194,154,842) | (△1,193,231,569) | (△1,136,259,489) | (△1,111,572,816) | (△1,101,833,467) | (△1,089,299,680) |
| (G) 計(D+E+F) | △1,963,463,830 | △1,963,515,247 | △1,902,300,213 | △1,831,405,735 | △1,799,347,096 | △1,818,404,783 |
| (H) 収益分配金 | △ 7,909,245 | △ 7,850,879 | △ 7,471,382 | △ 7,301,329 | △ 7,232,136 | △ 7,143,673 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △1,971,373,075 | △1,971,366,126 | △1,909,771,595 | △1,838,707,064 | △1,806,579,232 | △1,825,548,456 |
| 追加信託差損益金 | △ 508,559,372 | △ 520,542,344 | △ 503,557,178 | △ 500,572,280 | △ 503,854,475 | △ 505,777,651 |
| (配当等相当額) | (685,595,470) | (672,689,225) | (632,702,311) | (611,000,536) | (597,978,992) | (583,522,029) |
| (売買損益相当額) | (△1,194,154,842) | (△1,193,231,569) | (△1,136,259,489) | (△1,111,572,816) | (△1,101,833,467) | (△1,089,299,680) |
| 分配準備積立金 | 731,632 | 722,309 | 687,043 | 1,202,795 | 1,711,660 | 1,689,489 |
| 繰越損益金 | △1,463,545,335 | △1,451,546,091 | △1,406,901,460 | △1,339,337,579 | △1,304,436,417 | △1,321,460,294 |

* 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(2023年8月15日～2024年2月13日)は以下の通りです。

| 項 目 | 第154期 | 第155期 | 第156期 | 第157期 | 第158期 | 第159期 |
|------------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|---------------------------|
| | 2023年8月15日～ 2023年9月13日 | 2023年9月14日～ 2023年10月13日 | 2023年10月14日～ 2023年11月13日 | 2023年11月14日～ 2023年12月13日 | 2023年12月14日～ 2024年1月15日 | 2024年1月16日～ 2024年2月13日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 0円 | 0円 | 0円 | 531,970円 | 520,975円 | 0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 | 693,504,715円 | 680,540,104円 | 640,173,693円 | 618,301,865円 | 605,211,128円 | 590,665,702円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 731,632円 | 722,309円 | 687,043円 | 670,825円 | 1,190,685円 | 1,689,489円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 694,236,347円 | 681,262,413円 | 640,860,736円 | 619,504,660円 | 606,922,788円 | 592,355,191円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 877円 | 867円 | 857円 | 848円 | 839円 | 829円 |
| g. 分配金 | 7,909,245円 | 7,850,879円 | 7,471,382円 | 7,301,329円 | 7,232,136円 | 7,143,673円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 |

○分配金のお知らせ

| | 第154期 | 第155期 | 第156期 | 第157期 | 第158期 | 第159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。