

運用報告書 (全体版)

DIAM新興資源国債券ファンド

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	2009年12月11日から無期限です。
運用方針	信託財産の成長をはかることを目標に運用を行います。
主要投資対象	新興国のうち資源国（以下、「新興資源国」といいます。）の現地通貨建てのソブリン債（国債・政府機関債のほか州政府債・国際機関債などを含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
運用方法	<p>①主に新興資源国の現地通貨建てのソブリン債に投資し、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。</p> <p>②投資対象国およびその配分比率については、委託会社が定義した「新興資源国」の中から、金利水準、経済ファンダメンタルズ、信用力、流動性等を総合的に勘案して決定します。</p> <p>③投資対象国は4カ国を原則とします。これら投資対象国とその数および配分比率は、前②の観点から信託期間中に見直される場合があります。</p> <p>④投資対象となる債券は、当初組入れ時においてBB-格以上*の格付けを取得しているものとします。保有する債券の格付けが格下げにより上記基準を満たさなくなった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。</p> <p>*格付け機関はムーディーズ社またはスタンダード&プアーズ社とし、両社が格付けを付与している場合には、どちらか高い方の格付けとします。</p> <p>⑤現地通貨建てのソブリン債の組入比率は、原則として高位を保ちます。</p> <p>⑥外貨建資産については、原則として対円でのヘッジは行いません。</p> <p>⑦運用指図に関する権限の一部をアセットマネジメントOne U.S.A.・インクに委託します。</p>
組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り、株式（株式投資信託証券を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
分配方針	外貨建資産への投資には、制限を設けません。 決算日（原則として毎月19日。休業日の場合は翌営業日。）に経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。原則として利子配当等収益を中心に安定分配を行います。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。また、毎年6月および12月の決算時には、基準価額水準を勘案し、安定分配に加えて委託会社が決定する額を付加して分配する場合があります。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

愛称：ラッキーローバー

第161期	<決算日	2023年5月19日>
第162期	<決算日	2023年6月19日>
第163期	<決算日	2023年7月19日>
第164期	<決算日	2023年8月21日>
第165期	<決算日	2023年9月19日>
第166期	<決算日	2023年10月19日>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAM新興資源国債券ファンド」は、2023年10月19日に第166期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<https://www.am-one.co.jp/>

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基 準 価 額 (分配落)	準 価 額			債券組入 率 比	債券先 物 率 比	純 資 産 総 額
			税 込 分 配	み 金 騰 落	期 騰 落 中 率			
第24作成期	137期(2021年5月19日)	円 4,951	円 30	% 2.6	% 94.4	% -	百万円 5,248	
	138期(2021年6月21日)	4,961	30	0.8	96.3	-	5,154	
	139期(2021年7月19日)	4,920	30	△0.2	97.6	-	5,025	
	140期(2021年8月19日)	4,836	30	△1.1	97.3	-	4,859	
	141期(2021年9月21日)	4,831	30	0.5	95.9	-	4,753	
	142期(2021年10月19日)	4,923	30	2.5	99.3	-	4,771	
第25作成期	143期(2021年11月19日)	4,851	30	△0.9	95.1	-	4,541	
	144期(2021年12月20日)	4,744	30	△1.6	94.6	-	4,320	
	145期(2022年1月19日)	4,823	30	2.3	95.4	-	4,294	
	146期(2022年2月21日)	4,915	30	2.5	95.0	-	4,345	
	147期(2022年3月22日)	5,053	30	3.4	95.5	-	4,443	
	148期(2022年4月19日)	5,406	30	7.6	96.3	-	4,592	
第26作成期	149期(2022年5月19日)	5,269	30	△2.0	95.9	-	4,340	
	150期(2022年6月20日)	5,471	30	4.4	96.5	-	4,417	
	151期(2022年7月19日)	5,439	30	△0.0	96.6	-	4,317	
	152期(2022年8月19日)	5,484	30	1.4	95.9	-	4,290	
	153期(2022年9月20日)	5,734	30	5.1	95.9	-	4,389	
	154期(2022年10月19日)	5,799	30	1.7	95.5	-	4,401	
第27作成期	155期(2022年11月21日)	5,445	30	△5.6	94.2	-	4,081	
	156期(2022年12月19日)	5,300	30	△2.1	95.2	-	3,947	
	157期(2023年1月19日)	5,176	30	△1.8	94.5	-	3,843	
	158期(2023年2月20日)	5,364	30	4.2	96.5	-	3,972	
	159期(2023年3月20日)	5,239	30	△1.8	97.0	-	3,856	
	160期(2023年4月19日)	5,468	30	4.9	97.2	-	4,010	
第28作成期	161期(2023年5月19日)	5,674	30	4.3	96.2	-	4,095	
	162期(2023年6月19日)	5,890	30	4.3	96.3	-	4,177	
	163期(2023年7月19日)	5,800	30	△1.0	96.6	-	4,047	
	164期(2023年8月21日)	5,937	30	2.9	96.7	-	4,138	
	165期(2023年9月19日)	6,039	30	2.2	96.3	-	4,189	
	166期(2023年10月19日)	5,950	30	△1.0	95.9	-	4,100	

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注3) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指標を定めておりません。

(注4) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■過去6ヶ月間の基準価額の推移

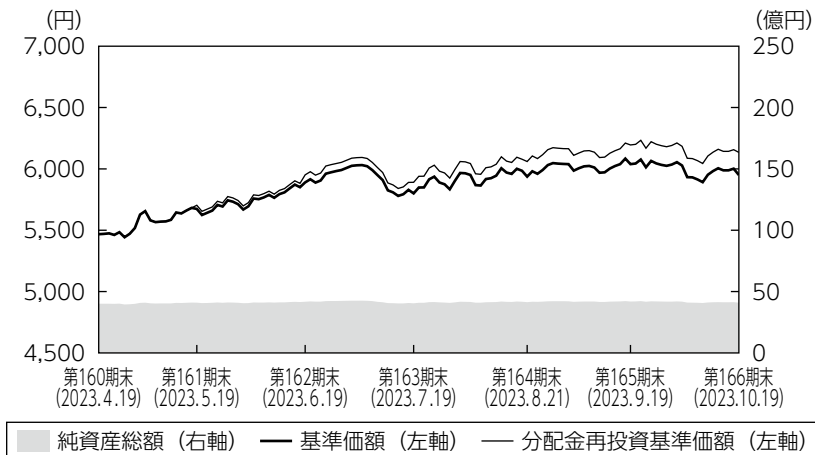
決算期	年 月 日	基 準 価 額		債 券 組 入 率	債 券 先 物 率
		騰 落 率	率		
第161期	(期首) 2023年4月19日	円 5,468	% -	% 97.2	% -
	4 月 末	5,518	0.9	96.5	-
	(期末) 2023年5月19日	5,704	4.3	96.2	-
第162期	(期首) 2023年5月19日	5,674	-	96.2	-
	5 月 末	5,712	0.7	96.1	-
	(期末) 2023年6月19日	5,920	4.3	96.3	-
第163期	(期首) 2023年6月19日	5,890	-	96.3	-
	6 月 末	6,025	2.3	96.6	-
	(期末) 2023年7月19日	5,830	△1.0	96.6	-
第164期	(期首) 2023年7月19日	5,800	-	96.6	-
	7 月 末	5,903	1.8	96.4	-
	(期末) 2023年8月21日	5,967	2.9	96.7	-
第165期	(期首) 2023年8月21日	5,937	-	96.7	-
	8 月 末	6,039	1.7	96.6	-
	(期末) 2023年9月19日	6,069	2.2	96.3	-
第166期	(期首) 2023年9月19日	6,039	-	96.3	-
	9 月 末	6,035	△0.1	96.1	-
	(期末) 2023年10月19日	5,980	△1.0	95.9	-

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■第161期～第166期の運用経過（2023年4月20日から2023年10月19日まで）

基準価額等の推移



第161期首： 5,468円
第166期末： 5,950円
(既払分配金180円)
騰落率： 12.2%
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客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により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

当作成期の基準価額は上昇しました。当ファンドが投資対象とする4カ国の通貨すべてに対して円安が進行したことや、インカム収益の積み上げが主な要因となりました。

投資環境

債券市場では、多くの主要新興国の国債利回りが上昇（価格は下落）しました。F R B（米連邦準備理事会）が高金利政策を長期化させるとの見通しから、米国の国債利回りが大きく上昇したことに連れた動きとなりました。ただ、ブラジルについては、一定のインフレ沈静化を受け、中央銀行が利下げサイクルに入ったことで、利回りが低下（価格は上昇）しました。

為替市場では、当ファンドが投資対象とする4カ国の通貨をはじめ、多くの主要新興国通貨が対円で上昇しました。海外の主要な中央銀行の既往の利上げにより、大幅な内外金利差が生じた状態にあるとともに、日銀の緩和的な政策姿勢の継続から全面的な円安に繋がりました。そうした円安の進行を受け、期の後半にかけては、日本の政策当局者から円安牽制発言がたびたび見られましたが、影響は限定的でした。

ポートフォリオについて

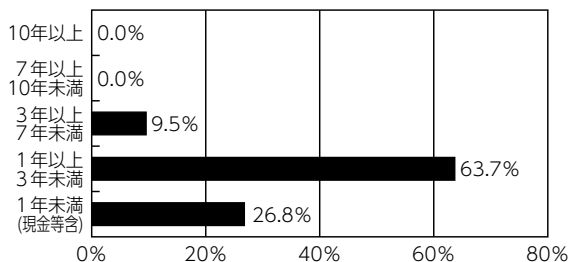
基本国別投資比率をインド30%、インドネシア30%、メキシコ20%、ブラジル20%としました。組入比率については、市場動向に応じて適宜調整を実施しました。

【運用状況】

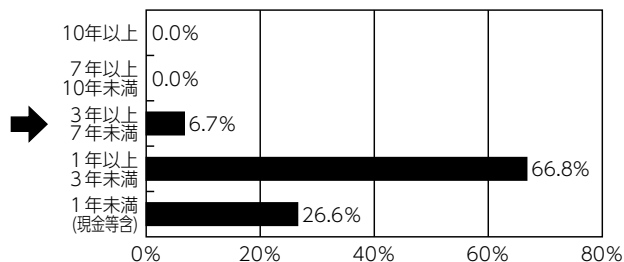
(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

前作成期末

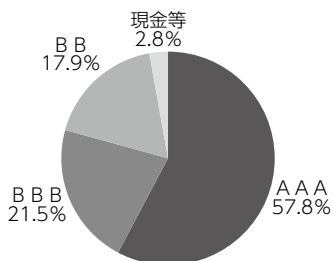


当作成期末

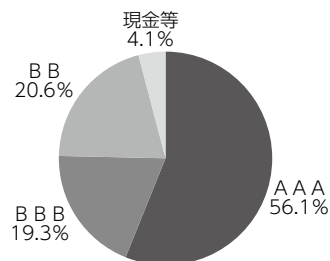


○格付別構成比

前作成期末



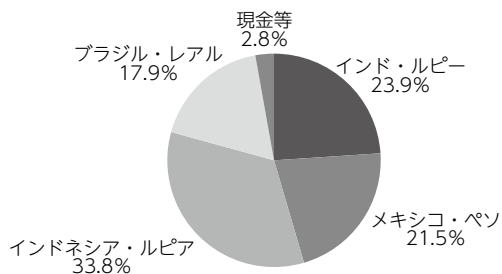
当作成期末



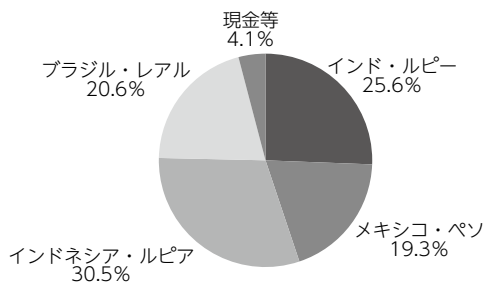
※格付については、格付機関（S & PおよびMoody's）による上位のものを採用しています。また、+・-等の符号は省略し、S & Pの表記方法にあわせて表示しています。

○通貨別構成比

前作成期末



当作成期末



【各国の為替・金利動向】

インド



メキシコ



インドネシア



ブラジル



※各国の債券利回りはJ PモルガンGB IーEMブロード・ディバーシファイドの構成国別の最終利回りです。

※J PモルガンGB IーEMブロード・ディバーシファイドに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

分配金

当作成期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第161期	第162期	第163期	第164期	第165期	第166期
	2023年4月20日 ～2023年5月19日	2023年5月20日 ～2023年6月19日	2023年6月20日 ～2023年7月19日	2023年7月20日 ～2023年8月21日	2023年8月22日 ～2023年9月19日	2023年9月20日 ～2023年10月19日
当期分配金（税引前）	30円	30円	30円	30円	30円	30円
対基準価額比率	0.53%	0.51%	0.51%	0.50%	0.49%	0.50%
当期の収益	30円	30円	25円	30円	30円	27円
当期の収益以外	-円	-円	4円	-円	-円	2円
翌期繰越分配対象額	333円	340円	336円	343円	347円	344円

（注1）「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

（注2）当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

（注3）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

新興国の債券・為替市場は、主要国の経済・金融政策や内外の政治情勢の影響を受け、ボラティリティが高まる場面も想定しています。投資国、基本投資比率に対しては現状を維持する方針ですが、組入対象国を中心とした新興国の政治・経済情勢の変化に留意しつつ、相対的にそうした情勢の良好な国の比率を高めるなど機動的な運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第161期～第166期 (2023年4月20日 ～2023年10月19日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	48円	
(投信会社)	(24)	(0.411)	
(販売会社)	(22)	(0.384)	
(受託会社)	(2)	(0.027)	
(b) その他費用	1	0.019	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(1)	(0.018)	
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	49	0.840	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって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。

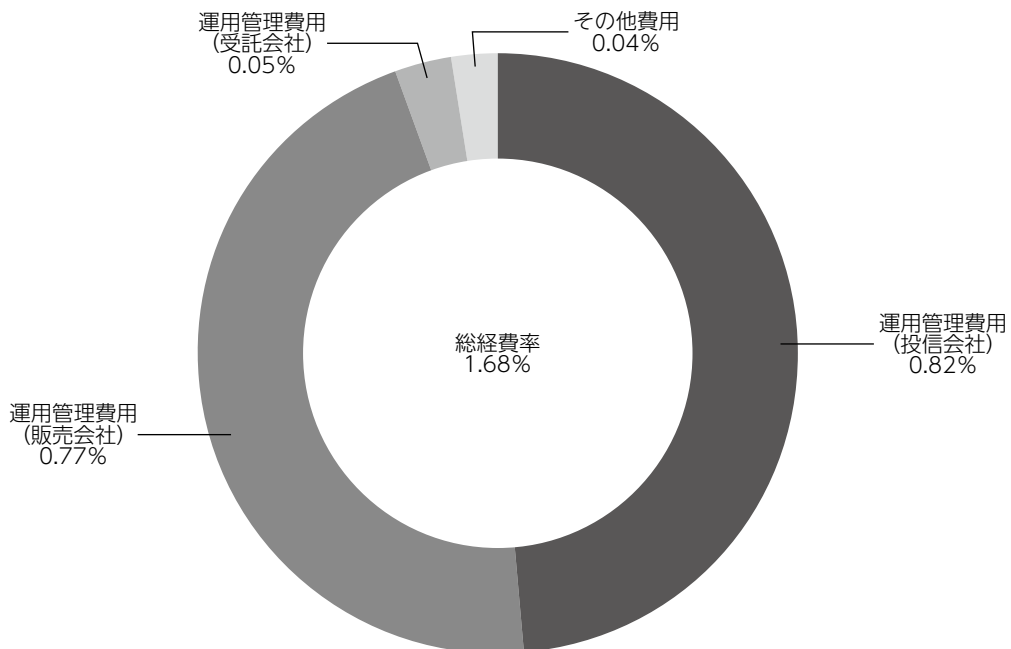
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 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。

(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）は1.68%です。



(注1) 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2) 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3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 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異なります。

■売買及び取引の状況 (2023年4月20日から2023年10月19日まで)

公社債

			第 161 期 ~ 第 166 期	
			買 付 額	売 付 額
外 国	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 5,360	千メキシコ・ペソ 25,165 (-)
	イ ン ド	特 殊 債 券	千インド・ルピー -	千インド・ルピー 9,850 (-)
	イ ン ド ネ シ ア	特 殊 債 券	千インドネシア・ルピア -	千インドネシア・ルピア 18,513,600 (-)
	ブ ラ ジ ル	国 債 証 券	千ブラジル・リアル 3,480	千ブラジル・リアル 2,246 (-)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等 (2023年4月20日から2023年10月19日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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

公社債

(A) 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

作 成 期		第 28 作 成 期 末						
区 分	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
メ キ シ コ	千メキシコ・ペソ 97,550	千メキシコ・ペソ 96,135	千円 789,492	% 19.3	% -	% -	% -	% 19.3
イ ン ド	千インド・ルピー 589,500	千インド・ルピー 580,116	千円 1,050,011	25.6	-	-	5.5	20.1
イ ン ド ネ シ ア	千インドネシア・ルピア 133,000,000	千インドネシア・ルピア 130,282,908	千円 1,250,715	30.5	-	-	13.2	17.3
ブ ラ ジ ル	千ブラジル・リアル 28,830	千ブラジル・リアル 28,470	千円 843,115	20.6	20.6	-	-	20.6
合 計	-	-	千円 3,933,335	95.9	20.6	-	18.8	77.1

(注1) 邦貨換算金額は、作成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。

(注2) 組入比率は、作成期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

作 成 期 銘 柄	第 28 作 成 期 末	種 類	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	
(メキシコ) MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24		国 債 証 券	% 10.0000	千メキシコ・ペソ 97,550	千メキシコ・ペソ 96,135	千円 789,492	2024/12/05
小 計		—	—	97,550	96,135	789,492	—
(インド) IBRD 4.8 01/23/25 EBRD 5.0 01/15/26 IADB 5.0 02/12/24 ASIAN DEV BANK 6.2 10/06/26 IFC 6.3 11/25/24		特 殊 債 券 特 殊 債 券 特 殊 債 券 特 殊 債 券 特 殊 債 券	% 4.8000 5.0000 5.0000 6.2000 6.3000	千インド・ルピー 9,000 114,500 390,000 16,000 60,000	千インド・ルピー 8,735 109,515 386,945 15,511 59,409	千円 15,811 198,223 700,371 28,075 107,530	2025/01/23 2026/01/15 2024/02/12 2026/10/06 2024/11/25
小 計		—	—	589,500	580,116	1,050,011	—
(インドネシア) EIB 5.75 01/24/25 EBRD 5.6 01/30/25 IBRD 4.75 01/21/27 IBRD 4.6 02/09/26 IBRD 7.25 03/15/24 IBRD 5.5 03/04/25 EBRD 5.0 10/06/26 EBRD 4.6 12/09/25		特 殊 債 券 特 殊 債 券 特 殊 債 券 特 殊 債 券 特 殊 債 券 特 殊 債 券 特 殊 債 券 特 殊 債 券	% 5.7500 5.6000 4.7500 4.6000 7.2500 5.5000 5.0000 4.6000	千インドネシア・ルピア 26,000,000 22,000,000 30,000,000 3,800,000 23,000,000 3,000,000 11,200,000 14,000,000	千インドネシア・ルピア 25,877,263 21,799,227 28,557,210 3,666,244 23,050,802 2,970,013 10,794,560 13,567,585	千円 248,421 209,272 274,149 35,195 221,287 28,512 103,627 130,248	2025/01/24 2025/01/30 2027/01/21 2026/02/09 2024/03/15 2025/03/04 2026/10/06 2025/12/09
小 計		—	—	133,000,000	130,282,908	1,250,715	—
(ブラジル) BRAZIL NTN 01/01/25		国 債 証 券	% 10.0000	千ブラジル・レアル 28,830	千ブラジル・レアル 28,470	千円 843,115	2025/01/01
小 計		—	—	28,830	28,470	843,115	—
合 計		—	—	—	—	3,933,335	—

■投資信託財産の構成

2023年10月19日現在

項 目	第 28 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 3,933,335	% 95.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	200,566	4.9
投 資 信 託 財 産 総 額	4,133,902	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、4,082,217千円、98.7%です。

(注3) 外貨建資産は、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。なお、2023年10月19日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.88円、1メキシコ・ペソ=8.212円、1インド・ルピー=1.81円、100インドネシア・ルピア=0.96円、1ブラジル・レアル=29.613円、1ユーロ=157.91円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年5月19日)、(2023年6月19日)、(2023年7月19日)、(2023年8月21日)、(2023年9月19日)、(2023年10月19日)現在

項 目	第 161 期 末	第 162 期 末	第 163 期 末	第 164 期 末	第 165 期 末	第 166 期 末
(A) 資 産	4,236,408,493円	4,361,739,555円	4,206,082,945円	4,172,565,176円	4,359,803,423円	4,133,902,376円
コール・ローン等	41,313,066	57,763,568	53,568,087	70,198,744	31,676,579	61,911,472
公社債(評価額)	3,940,605,025	4,024,472,933	3,911,619,009	4,004,344,771	4,033,131,272	3,933,335,873
未 収 入 金	141,811,580	193,523,681	171,110,037	-	170,695,260	-
未 収 利 息	104,062,207	82,931,311	66,377,093	94,073,701	119,786,839	133,666,480
前 払 費 用	2,080,921	2,099,514	1,957,891	2,001,554	2,026,857	2,022,629
その他未収収益	6,535,694	948,548	1,450,828	1,946,406	2,486,616	2,965,922
(B) 負 債	141,186,447	184,438,631	158,832,225	33,657,298	170,542,781	33,019,754
未 払 金	107,138,305	146,031,115	129,322,550	-	128,159,074	-
未 払 収 益 分 配 金	21,653,542	21,277,331	20,934,624	20,915,140	20,810,663	20,677,735
未 払 解 約 金	6,915,946	11,382,614	2,921,788	6,586,122	16,084,368	6,715,131
未 払 信 託 報 酬	5,466,678	5,735,013	5,640,904	6,142,578	5,476,676	5,614,586
その他未払費用	11,976	12,558	12,359	13,458	12,000	12,302
(C) 純資産総額(A-B)	4,095,222,046	4,177,300,924	4,047,250,720	4,138,907,878	4,189,260,642	4,100,882,622
元 本	7,217,847,600	7,092,443,703	6,978,208,222	6,971,713,622	6,936,887,826	6,892,578,383
次 期 繰 越 損 益 金	△3,122,625,554	△2,915,142,779	△2,930,957,502	△2,832,805,744	△2,747,627,184	△2,791,695,761
(D) 受 益 権 総 口 数	7,217,847,600口	7,092,443,703口	6,978,208,222口	6,971,713,622口	6,936,887,826口	6,892,578,383口
1万口当たり基準価額(C/D)	5,674円	5,890円	5,800円	5,937円	6,039円	5,950円

(注) 第160期末における元本額は7,335,197,976円、当作成期間(第161期~第166期)中における追加設定元本額は299,080,064円、同解約元本額は741,699,657円です。

■損益の状況

〔自 2023年4月20日 至 2023年5月19日〕〔自 2023年5月20日 至 2023年6月19日〕〔自 2023年6月20日 至 2023年7月19日〕〔自 2023年7月20日 至 2023年8月19日〕〔自 2023年8月22日 至 2023年9月19日〕〔自 2023年9月20日 至 2023年10月19日〕

項 目	第 161 期	第 162 期	第 163 期	第 164 期	第 165 期	第 166 期
(A) 配 当 等 収 益	24,639,304円	26,600,544円	23,844,102円	27,520,796円	24,735,493円	24,610,546円
受 取 利 息	24,180,228	26,134,981	23,355,407	27,033,347	24,202,735	24,137,218
そ の 他 収 益 金	461,607	467,604	491,251	491,820	534,437	474,482
支 払 利 息	△2,531	△2,041	△2,556	△4,371	△1,679	△1,154
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	150,608,967	153,444,414	△60,109,146	94,565,344	72,485,565	△59,669,611
売 買 益	154,118,347	157,069,540	9,908,336	101,698,877	77,884,339	16,269,001
売 買 損	△3,509,380	△3,625,126	△70,017,482	△7,133,533	△5,398,774	△75,938,612
(C) 信 託 報 酬 等	△5,478,654	△5,875,329	△5,793,678	△6,291,572	△5,650,933	△5,778,581
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	169,769,617	174,169,629	△42,058,722	115,794,568	91,570,125	△40,837,646
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△978,373,540	△810,053,652	△641,333,442	△697,999,785	△596,232,428	△518,766,341
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△2,292,368,089	△2,257,981,425	△2,226,630,714	△2,229,685,387	△2,222,154,218	△2,211,414,039
(配 当 等 相 当 額)	(236,782,610)	(232,774,020)	(229,157,546)	(229,055,868)	(228,034,684)	(226,701,964)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,529,150,699)	(△2,490,755,445)	(△2,455,788,260)	(△2,458,741,255)	(△2,450,188,902)	(△2,438,116,003)
(G) 合 計 (D+E+F)	△3,100,972,012	△2,893,865,448	△2,910,022,878	△2,811,890,604	△2,726,816,521	△2,771,018,026
(H) 収 益 分 配 金	△21,653,542	△21,277,331	△20,934,624	△20,915,140	△20,810,663	△20,677,735
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△3,122,625,554	△2,915,142,779	△2,930,957,502	△2,832,805,744	△2,747,627,184	△2,791,695,761
追 加 信 託 差 損 益 金	△2,292,368,089	△2,257,981,425	△2,226,630,714	△2,229,685,387	△2,222,154,218	△2,211,414,039
(配 当 等 相 当 額)	(236,782,610)	(232,774,020)	(229,157,546)	(229,055,868)	(228,034,684)	(226,701,964)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,529,150,699)	(△2,490,755,445)	(△2,455,788,260)	(△2,458,741,255)	(△2,450,188,902)	(△2,438,116,003)
分 配 準 備 積 立 金	4,153,366	8,507,724	5,418,611	10,557,471	12,924,133	10,913,410
繰 越 損 益 金	△834,410,831	△665,669,078	△709,745,399	△613,677,828	△538,397,099	△591,195,132

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (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。

(注3) (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4) 信託財産の運用の指図に関わる権限を委託するために要する費用は、2,891,684円で、委託者報酬から支弁しております。

(注5) 分配金の計算過程

項 目	第 161 期	第 162 期	第 163 期	第 164 期	第 165 期	第 166 期
(a) 経費控除後の配当等収益	23,869,005円	25,732,758円	18,050,424円	26,102,676円	23,297,896円	18,831,965円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	236,782,610	232,774,020	229,157,546	229,055,868	228,034,684	226,701,964
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,937,903	4,052,297	8,302,811	5,369,935	10,436,900	12,759,180
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	262,589,518	262,559,075	255,510,781	260,528,479	261,769,480	258,293,109
(f) 1万口当たり当期分配対象額	363.81	370.20	366.16	373.69	377.36	374.74
(g) 分 配 金	21,653,542	21,277,331	20,934,624	20,915,140	20,810,663	20,677,735
(h) 1万口当たり分配金	30	30	30	30	30	30

■分配金のお知らせ

決算期	第 161 期	第 162 期	第 163 期	第 164 期	第 165 期	第 166 期
1 万口当たり分配金	30円	30円	30円	30円	30円	30円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■運用指図に関する権限の一部の委託先である、アセットマネジメントOne U.S.A.・インクの所在地を変更しました。

(2023年10月6日)