

ノムラ・ボンド・インカム・オープン

運用報告書(全体版)

第72期(決算日2016年6月21日) 第73期(決算日2016年9月21日)

作成対象期間(2016年3月23日～2016年9月21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	1998年7月30日から2018年3月21日までです。
運用方針	公社債への投資にあたっては、ソブリン債および国際機関の発行した債券を中心とした優良クレジットの債券に分散投資することを基本とします。ポートフォリオのデュレーションは、原則として概ね1～3年程度で4年を超えない範囲内に維持することを基本とします。 カントリーアロケーション、デュレーションおよび為替ヘッジ比率をアクティブに変更することで収益の獲得を目指します。先物取引等も適宜活用します。
主な投資対象	日本を含む世界先進主要国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	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および新株予約権を行使したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の10%未満とします。
分配方針	年4回の毎決算時に、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益等から基準価額の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/>

○最近10期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税金配	み騰落	シティ世界国債インデックス(1-3年)為替100%ヘッジ	騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
64期(2014年6月23日)	8,503	35	0.3	116.12	0.2	87.3	—	7,103
65期(2014年9月22日)	8,514	35	0.5	116.26	0.1	83.7	—	7,005
66期(2014年12月22日)	8,562	35	1.0	116.37	0.1	89.8	—	6,843
67期(2015年3月23日)	8,592	35	0.8	116.74	0.3	77.1	—	6,745
68期(2015年6月22日)	8,487	35	△0.8	116.65	△0.1	79.2	—	6,491
69期(2015年9月24日)	8,484	35	0.4	116.77	0.1	85.2	—	6,367
70期(2015年12月21日)	8,448	35	△0.0	116.59	△0.2	80.4	—	6,147
71期(2016年3月22日)	8,423	35	0.1	116.90	0.3	79.8	—	6,107
72期(2016年6月21日)	8,392	15	△0.2	117.04	0.1	86.1	—	6,057
73期(2016年9月21日)	8,382	15	0.1	116.90	△0.1	85.1	—	5,956

* 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。

* シティ世界国債インデックス(1-3年)は、Citigroup Index LLCが開発した世界先進主要国短期国債(1-3年)市場全体のパフォーマンスを表す代表的な指数の一つです。ファンドは、当インデックスの対円での為替100%ヘッジベースをベンチマークとします。

* 当ベンチマークは、シティ世界国債インデックス(1-3年)の各国別指数(現地通貨ベース)を用い、当社において円ヘッジベースに換算した指数です。なお、設定時を100として指数化しています。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

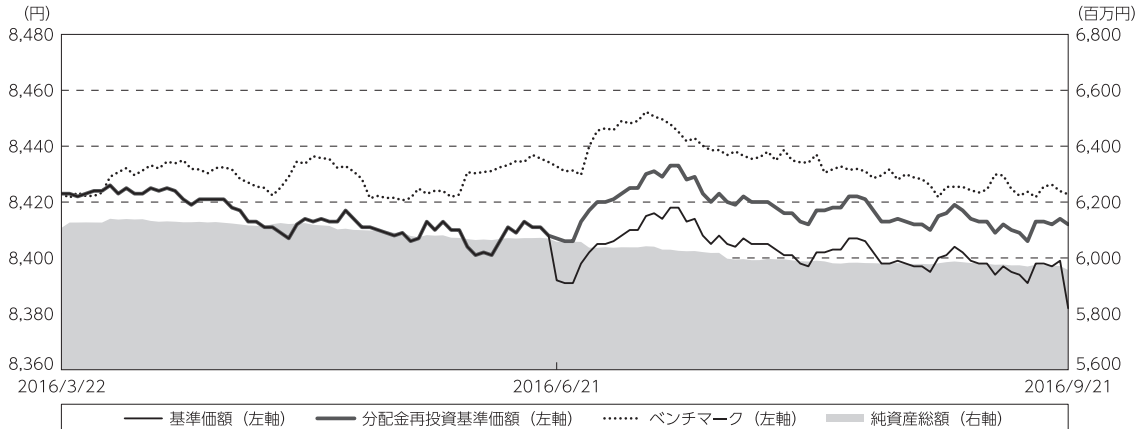
決算期	年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
		騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
第72期	(期首) 2016年3月22日	円	%		%	%	%
		8,423	—	116.90	—	79.8	—
	3月末	8,423	0.0	117.01	0.1	79.9	—
	4月末	8,409	△0.2	116.93	0.0	88.9	—
	5月末	8,410	△0.2	116.92	0.0	84.2	—
(期末) 2016年6月21日	8,407	△0.2	117.04	0.1	86.1	—	
第73期	(期首) 2016年6月21日	8,392	—	117.04	—	86.1	—
	6月末	8,406	0.2	117.22	0.2	92.6	—
	7月末	8,403	0.1	117.07	0.0	82.9	—
	8月末	8,404	0.1	116.94	△0.1	81.2	—
	(期末) 2016年9月21日	8,397	0.1	116.90	△0.1	85.1	—

* 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



- (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（2016年3月22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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、シティ世界国債インデックス（1－3年）為替100%ヘッジです。ベンチマークは、作成期首（2016年3月22日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (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、当作成期首の8,423円から当作成期末には8,382円（分配後）となりました。なお、第72期に15円、第73期に15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11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）。
- (上昇) 米国や欧州の中長期債利回りが低下（価格は上昇）する局面において、これらの債券を保有していたこと。
- (下落) 円が幅広い通貨に対して上昇する局面で、外貨エクスポージャーを取得していたこと。

○投資環境

債券市場<国債利回りは米国・ドイツで低下、日本で横ばい>

米国では、FRB（米連邦準備制度理事会）が、利上げを進める姿勢を軟化させたことから、長期債の利回りは低下しました。6月23日に実施された英国の国民投票でEU（欧州連合）からの離脱が多数となったことを受け、景気悪化を抑えるために先進国で金融緩和スタンスが強まるとの観測が浮上したことも、利回りの低下に拍車をかけました。

ユーロ圏では、ECB（欧州中央銀行）が国債や社債の大規模な買い入れプログラムを継続したことや、英国国民投票の結果を受けて追加金融緩和観測が強まったことを背景に、債券利回りは低下しました。

日本では、海外債券の利回り低下につれて利回りが低下する局面があったものの、日銀が超長期債を中心とした過度な利回り低下の副作用を懸念したことから利回りは上昇（価格は下落）し、期を通じて見ると横ばいとなりました。

為替市場<円は米ドル・ユーロに対して上昇>

世界的にリスク回避的な動きが強まった局面で、円は米ドル・ユーロに対して上昇しました（円高）。

○当ファンドのポートフォリオ

・組入債券について

債券組入比率：当作成期を通じて、概ね高めを維持しました。

債券の種類：組入債券の信用力に留意し、国債を中心に高格付け債券に投資しました。

・ファンド全体のデュレーション（※1）

<ファンドのデュレーション>

ファンド全体のデュレーションは当作成期首から当作成期末にかけ、大幅な変更はありませんでした。当作成期末において、ファンド全体のデュレーションはベンチマークに対して短期化としました。

（※1）デュレーションは、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低下時の価格上昇率が大きくなり、利回り上昇時には価格下落率が大きくなります。

・為替のエクスポージャー（※2）

当作成期を通じて対円での全体の為替エクスポージャーは抑えめとしました。

（※2）為替エクスポージャーとは、外国債券を中心とした外貨建て資産のうち、為替ヘッジを行っていない部分の純資産額に対する比率のことです。比率が高いほど円安時には為替差益が、円高時には為替差損が発生しやすくなります。当ファンドの為替エクスポージャーは最大限で20%までです。（純資産の100%を外貨建てで保有した場合）

○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額（分配金再投資）の騰落率は-0.13%となり、ベンチマークの-0.00%を下回りました。

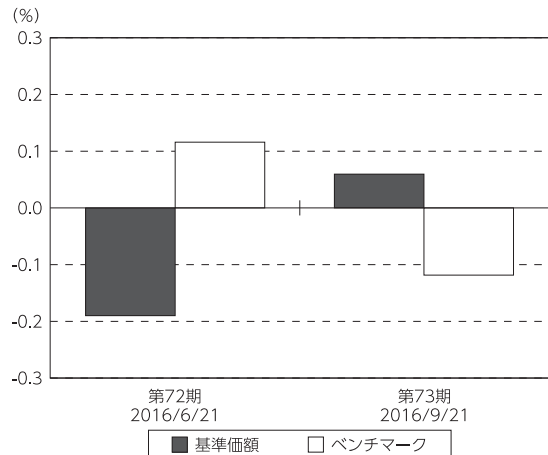
(主なプラス要因)

米ドルがドル圏周辺通貨に対して上昇する局面で、米ドル買い、ドル圏周辺通貨売りのポジションとしていたこと。

(主なマイナス要因)

米国の債券利回りが低下する局面で、ベンチマーク比での米国債のデュレーションを短期化していたこと。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、シティ世界国債インデックス（1－3年）為替100%ヘッジです。

◎分配金

当期の収益分配金は、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1万口当たり、第72期15円、第73期15円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72期	第73期
	2016年3月23日～ 2016年6月21日	2016年6月22日～ 2016年9月21日
当期分配金	15	15
(対基準価額比率)	0.178%	0.179%
当期の収益	10	10
当期の収益以外	4	4
翌期繰越分配対象額	2,163	2,159

(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切捨てで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

当ファンドは、国内外の金融市場について精緻な投資環境リサーチ及び分析を行い、好収益が期待できる債券や為替市場への投資を行います。金利リスク・国別投資配分リスクに加えて、為替変動リスクもコントロールすることで、より分散されたポートフォリオ構築に努めて参ります。

米国では、個人消費など内需を中心に景気回復が継続しており、FRBによる継続的な金融引き締めを見込んでいることから、債券利回りは上昇圧力がかかりやすいと予想します。欧州では、景気は緩やかながらも回復が見込まれ、ECBによる金融緩和姿勢が後退していくことで、債券利回りは上昇圧力がかかると予想します。日本では、以前と比べ日銀の追加金融緩和政策の余地が少なくなっているものの、引き続き日銀の金融政策が債券相場を下支えすると見込んでおり、債券利回りは低水準で推移すると予想します。ファンド全体のデュレーションはベンチマークに対して短期化とする方針です。また、通貨配分については、ベンチマークに比べ米ドルを多め、欧州通貨とドル圏周辺通貨を少なめとします。

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

(2016年3月23日～2016年9月21日)

項 目	第72期～第73期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 31	% 0.363	(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)	(0.173)	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)	(14)	(0.162)	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	0.006	(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)	(0)	(0.005)	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
合 計	31	0.369	
作成期間の平均基準価額は、8,409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。

○売買及び取引の状況

(2016年3月23日～2016年9月21日)

公社債

			第72期～第73期	
			買付額	売付額
国内	国債証券		千円 2,216,252	千円 1,853,244
	特殊債券		200,524	— (509,000)
外	アメリカ	国債証券	千米ドル 3,045	千米ドル 4,573
		地方債証券	1,000	—
		特殊債券	4,491	—
		社債券 (投資法人債券を含む)	400	—
外	イギリス	国債証券	千英ポンド 406	千英ポンド 406
		スウェーデン	千スウェーデンクローナ 7,237	千スウェーデンクローナ 7,297
国	ユーロ	フランス	千ユーロ 2,670	千ユーロ 3,549
		ベルギー	—	119
	ポーランド	千ズロチ 4,914	千ズロチ 5,014	
	オーストラリア	特殊債券 千豪ドル 3,138	千豪ドル —	
	メキシコ	国債証券 千メキシコペソ 10,943	千メキシコペソ 50,906	

*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。

*() 内は償還等による増減分です。

*社債券 (投資法人債券を含む) には新株予約権付社債 (転換社債) は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2016年3月23日～2016年9月21日)

利害関係人との取引状況

区 分	第72期～第73期					
	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		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	%
公社債	4,289	408	9.5	3,361	900	26.8
為替先物取引	15,770	51	0.3	16,213	—	—
為替直物取引	1,398	—	—	900	51	5.7
預金	13,293	13,293	100.0	14,035	14,035	100.0

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證券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年9月21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73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		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	2,850,000	2,871,170	48.2	—	—	—	48.2
特殊債券 (除く金融債)	200,000 (200,000)	200,401 (200,401)	3.4 (3.4)	— (—)	— (—)	— (—)	3.4 (3.4)
合 計	3,050,000 (200,000)	3,071,571 (200,401)	51.6 (3.4)	— (—)	— (—)	— (—)	51.6 (3.4)

* () 内は非上場債で内書きです。

* 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73期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付(2年)第350回	0.1	300,000	300,357	2017/3/15
国庫債券	利付(2年)第354回	0.1	400,000	401,432	2017/7/15
国庫債券	利付(2年)第357回	0.1	300,000	301,137	2017/10/15
国庫債券	利付(2年)第358回	0.1	400,000	401,640	2017/11/15
国庫債券	利付(2年)第360回	0.1	200,000	200,942	2018/1/15
国庫債券	利付(5年)第106回	0.2	150,000	150,743	2017/9/20
国庫債券	利付(5年)第108回	0.1	500,000	502,195	2017/12/20
国庫債券	利付(10年)第286回	1.8	400,000	406,176	2017/6/20
国庫債券	利付(20年)第36回	3.0	200,000	206,546	2017/9/20
小	計		2,850,000	2,871,170	
特殊債券(除く金融債)					
中日本高速道路社債	第53回	0.222	200,000	200,401	2017/6/20
小	計		200,000	200,401	
合	計		3,050,000	3,071,571	

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

外国公社債

(A) 外国(外貨建) 公社債 種類別開示

区 分	第73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
アメリカ	千米ドル 10,303	千米ドル 10,343	千円 1,053,138	% 17.7	% —	% —	% 7.9	% 9.8
カナダ	千カナダドル 200	千カナダドル 202	15,636	0.3	—	—	—	0.3
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 500	千スウェーデンクローナ 520	6,163	0.1	—	—	—	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 3,500	千ノルウェークローネ 3,586	44,008	0.7	—	—	—	0.7
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
フランス	1,500	1,683	191,231	3.2	—	—	3.2	—
日本	1,000	1,031	117,114	2.0	—	2.0	—	—
国際機関	1,000	1,075	122,098	2.0	—	—	2.0	—
ポーランド	千ズロチ 1,300	千ズロチ 1,302	34,384	0.6	—	—	0.4	0.1
オーストラリア	千豪ドル 4,000	千豪ドル 4,175	320,971	5.4	—	—	5.4	—
メキシコ	千メキシコペソ 17,000	千メキシコペソ 18,364	94,393	1.6	—	—	1.6	—
合 計	—	—	1,999,142	33.6	—	2.0	20.6	11.0

* 邦貨換算金額は、第73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、価格情報会社等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73期末				償還年月日		
		利 率	額面金額	評 価 額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円			
	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	700	718	73,164	2018/5/31	
	地方債証券	LAND NORDRHEIN-WESTFALEN	1.625	1,000	1,007	102,544	2020/1/22	
	特殊債券 (除く金融債)	JAPAN BANK FOR INTL COOP	1.125	2,000	1,999	203,599	2017/7/19	
		JAPAN BANK FOR INTL COOP	1.75	1,000	1,007	102,617	2018/7/31	
		JAPAN BANK FOR INTL COOP	1.75	1,000	1,004	102,278	2020/5/28	
		JAPAN FIN ORG MUNICIPAL	1.375	2,000	1,997	203,335	2018/2/5	
		JAPAN FIN ORG MUNICIPAL	2.125	200	202	20,604	2019/3/6	
		KOMMUNEKREDIT	1.125	1,500	1,495	152,271	2019/8/23	
	普通社債券 (含む投資法人債券)	CENTRAL NIPPON EXPRESSWY	2.17	503	508	51,762	2019/8/5	
		CENTRAL NIPPON EXPRESSWY	2.293	400	402	40,960	2021/4/23	
小	計					1,053,138		
カナダ				千カナダドル	千カナダドル			
	特殊債券 (除く金融債)	JAPAN BANK FOR INTL COOP	2.3	200	202	15,636	2018/3/19	
小	計					15,636		
スウェーデン				千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ			
	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	3.75	500	520	6,163	2017/8/12	
小	計					6,163		
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ			
	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	4.25	3,500	3,586	44,008	2017/5/19	
小	計					44,008		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ			
	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.5	1,500	1,683	191,231	2020/10/25
	日本	特殊債券 (除く金融債)	JAPAN FIN ORG MUNICIPAL	0.875	1,000	1,031	117,114	2021/9/22
	国際機関	特殊債券 (除く金融債)	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1.5	1,000	1,075	122,098	2020/7/15
小	計					430,444		
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ			
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3.75	300	309	8,174	2018/4/25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.0	1,000	992	26,210	2021/4/25	
小	計					34,384		
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル			
	特殊債券 (除く金融債)	KFW	4.0	4,000	4,175	320,971	2019/1/16	
小	計					320,971		
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ			
	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	17,000	18,364	94,393	2020/6/11	
小	計					94,393		
合	計					1,999,142		

* 邦貨換算金額は、第73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

(2016年9月21日現在)

項 目	第73期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	5,070,713	84.6
コール・ローン等、その他	920,001	15.4
投資信託財産総額	5,990,714	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*第73期末における外貨建て純資産(2,312,756千円)の投資信託財産総額(5,990,714千円)に対する比率は38.6%です。

*外貨建て資産は、第73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=101.82円、1カナダドル=77.25円、1英ポンド=132.39円、1スウェーデンクローナ=11.85円、1ノルウェークローネ=12.27円、1デンマーククローネ=15.23円、1ユーロ=113.58円、1ズロチ=26.40円、1シンガポールドル=74.77円、1豪ドル=76.87円、1メキシコペソ=5.14円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第72期末	第73期末
	2016年6月21日現在	2016年9月21日現在
	円	円
(A) 資産	8,897,761,503	8,203,861,130
コール・ローン等	917,178,834	887,120,772
公社債(評価額)	5,216,509,967	5,070,713,888
未収入金	2,744,725,335	2,229,302,958
未収利息	16,419,665	13,215,156
前払費用	2,927,702	3,346,011
その他未収収益	—	162,345
(B) 負債	2,839,835,577	2,247,078,979
未払金	2,816,106,632	2,216,014,000
未払収益分配金	10,828,157	10,659,412
未払解約金	1,880,927	9,458,300
未払信託報酬	10,986,229	10,913,768
未払利息	871	952
その他未払費用	32,761	32,547
(C) 純資産総額(A-B)	6,057,925,926	5,956,782,151
元本	7,218,771,558	7,106,274,873
次期繰越損益金	△1,160,845,632	△1,149,492,722
(D) 受益権総口数	7,218,771,558口	7,106,274,873口
1万円当たり基準価額(C/D)	8,392円	8,382円

(注) 第72期首元本額は7,251,250,885円、第72～73期中追加設定元本額は188,659,309円、第72～73期中一部解約元本額は333,635,321円、1口当たり純資産額は、第72期0.8392円、第73期0.8382円です。

(注) 投資信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用、支払金額909,296円。

○損益の状況

項 目	第72期	第73期
	2016年3月23日～ 2016年6月21日	2016年6月22日～ 2016年9月21日
	円	円
(A) 配当等収益	18,531,572	18,830,348
受取利息	18,477,627	18,803,979
その他収益金	171,526	155,778
支払利息	△ 117,581	△ 129,409
(B) 有価証券売買損益	△ 18,893,622	△ 3,968,364
売買益	197,715,962	166,012,648
売買損	△ 216,609,584	△ 169,981,012
(C) 信託報酬等	△ 11,090,960	△ 11,165,634
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 11,453,010	3,696,350
(E) 前期繰越損益金	△ 374,625,961	△ 386,348,082
(F) 追加信託差損益金	△ 763,938,504	△ 756,181,578
(配当等相当額)	(1,153,636,695)	(1,140,057,498)
(売買損益相当額)	(△1,917,575,199)	(△1,896,239,076)
(G) 計(D+E+F)	△1,150,017,475	△1,138,833,310
(H) 収益分配金	△ 10,828,157	△ 10,659,412
次期繰越損益金(G+H)	△1,160,845,632	△1,149,492,722
追加信託差損益金	△ 763,938,504	△ 756,181,578
(配当等相当額)	(1,153,636,695)	(1,140,057,498)
(売買損益相当額)	(△1,917,575,199)	(△1,896,239,076)
分配準備積立金	408,160,856	394,606,003
繰越損益金	△ 805,067,984	△ 787,917,147

* 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(2016年3月23日～2016年9月21日)は以下の通りです。

項 目	第72期	第73期
	2016年3月23日～ 2016年6月21日	2016年6月22日～ 2016年9月21日
a. 配当等収益(経費控除後)	7,440,612円	7,664,714円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	1,153,636,695円	1,140,057,498円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	411,548,401円	397,600,701円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,572,625,708円	1,545,322,913円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	2,178円	2,174円
g. 分配金	10,828,157円	10,659,412円
h. 分配金(1万円当たり)	15円	15円

○分配金のお知らせ

	第72期	第73期
1 万口当たり分配金 (税込み)	15円	15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。