

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52期(決算日2015年3月13日) 第53期(決算日2015年4月13日) 第54期(決算日2015年5月13日)
第55期(決算日2015年6月15日) 第56期(決算日2015年7月13日) 第57期(決算日2015年8月13日)

作成対象期間(2015年2月14日～2015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、国別の投資比率が概ね均等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30期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額			債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金					
	円		円		%		%	百万円	
28期(2013年3月13日)	10,205		20		0.9	100.6	—	2,590	
29期(2013年4月15日)	10,294		20		1.1	101.5	—	2,383	
30期(2013年5月13日)	10,293		20		0.2	100.3	—	2,555	
31期(2013年6月13日)	10,125		20		△1.4	95.0	—	2,231	
32期(2013年7月16日)	10,103		20		△0.0	97.8	—	2,339	
33期(2013年8月13日)	10,055		20		△0.3	95.9	—	2,294	
34期(2013年9月13日)	9,869		20		△1.7	99.2	—	2,372	
35期(2013年10月15日)	9,944		20		1.0	99.0	—	2,320	
36期(2013年11月13日)	9,959		20		0.4	99.0	—	2,272	
37期(2013年12月13日)	9,933		20		△0.1	99.9	—	2,687	
38期(2014年1月14日)	9,939		20		0.3	97.2	—	2,636	
39期(2014年2月13日)	9,949		20		0.3	100.1	—	2,652	
40期(2014年3月13日)	9,964		20		0.4	97.2	—	2,889	
41期(2014年4月14日)	10,012		20		0.7	95.4	—	2,548	
42期(2014年5月13日)	9,992		20		0.0	96.1	—	2,865	
43期(2014年6月13日)	9,997		20		0.3	95.1	—	3,010	
44期(2014年7月14日)	10,033		20		0.6	97.9	—	3,017	
45期(2014年8月13日)	10,051		20		0.4	95.9	—	3,196	
46期(2014年9月16日)	9,972		20		△0.6	98.8	—	3,319	
47期(2014年10月14日)	10,148		20		2.0	94.9	—	3,423	
48期(2014年11月13日)	10,103		20		△0.2	97.1	—	2,935	
49期(2014年12月15日)	10,237		20		1.5	95.2	—	3,346	
50期(2015年1月13日)	10,315		20		1.0	95.1	—	3,644	
51期(2015年2月13日)	10,259		20		△0.3	97.6	—	3,788	
52期(2015年3月13日)	10,156		20		△0.8	97.8	—	3,825	
53期(2015年4月13日)	10,220		20		0.8	96.4	—	3,860	
54期(2015年5月13日)	10,082		20		△1.2	97.6	—	3,893	
55期(2015年6月15日)	10,043		20		△0.2	96.8	—	4,096	
56期(2015年7月13日)	10,032		20		0.1	97.2	—	4,474	
57期(2015年8月13日)	10,047		20		0.3	97.5	—	4,493	

* 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

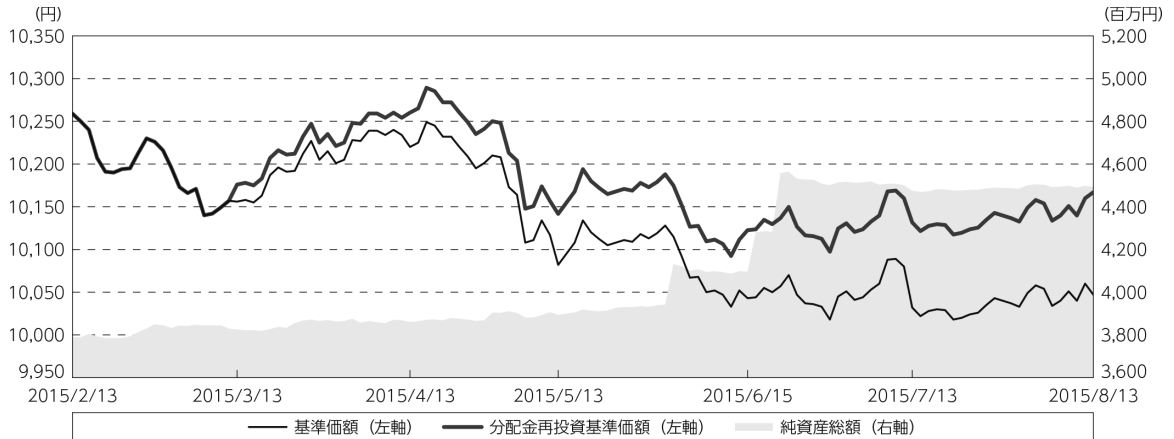
決算期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
			騰	落			
第52期	(期 首) 2015年 2月13日	円 10,259		% —	% 97.6		% —
	2月末	10,226		△0.3	97.5		—
	(期 末) 2015年 3月13日	10,176		△0.8	97.8		—
第53期	(期 首) 2015年 3月13日	10,156		—	97.8		—
	3月末	10,201		0.4	96.1		—
	(期 末) 2015年 4月13日	10,240		0.8	96.4		—
第54期	(期 首) 2015年 4月13日	10,220		—	96.4		—
	4月末	10,173		△0.5	98.8		—
	(期 末) 2015年 5月13日	10,102		△1.2	97.6		—
第55期	(期 首) 2015年 5月13日	10,082		—	97.6		—
	5月末	10,119		0.4	98.7		—
	(期 末) 2015年 6月15日	10,063		△0.2	96.8		—
第56期	(期 首) 2015年 6月15日	10,043		—	96.8		—
	6月末	10,045		0.0	96.9		—
	(期 末) 2015年 7月13日	10,052		0.1	97.2		—
第57期	(期 首) 2015年 7月13日	10,032		—	97.2		—
	7月末	10,033		0.0	97.7		—
	(期 末) 2015年 8月13日	10,067		0.3	97.5		—

* 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52期首：10,259円

第57期末：10,047円 (既払分配金(税込み):120円)

騰落率：△0.9% (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(2015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) 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10,259円から当作成期末には10,047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92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)。

(下落) 対円で為替ヘッジを行なったことによるコスト(金利差相当分の費用)。

○投資環境

- ・米国では、好調な自動車販売や小売売上を通じて個人消費の底堅さが確認されたことで、米国の景気回復への不安が和らぎました。また、金融政策においてはFRB（米連邦準備制度理事會）のイエレン議長が年内の利上げを示唆しました。
ユーロ圏では、ECB（欧州中央銀行）による国債買い入れを含む大規模な量的緩和策が始まりました。
日本では、日本銀行による大規模な国債買い入れが継続しました。
- ・米国では雇用市場の改善などを背景に利上げが意識された他、ユーロ圏では経済指標が改善したことから、先進国の国債利回りは上昇（価格は下落）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、当作成期首から当作成期末にかけて変更はありませんでした。当作成期末における投資対象国は、米国、イギリス、シンガポールとしました。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※>

ファンドのデュレーションは、当作成期末で約3.5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。ファンド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>

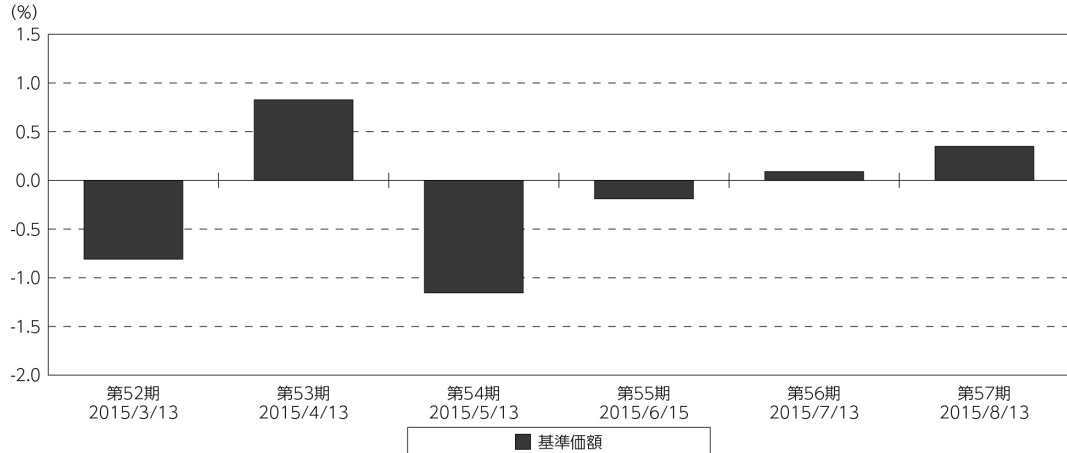
当作成期を通じて、対円でほぼフルヘッジとしました。

○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。

基準価額（期別騰落率）



(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1万口当たり第52期20円、第53期20円、第54期20円、第55期20円、第56期20円、第57期20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ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第52期	第53期	第54期	第55期	第56期	第57期
	2015年2月14日～ 2015年3月13日	2015年3月14日～ 2015年4月13日	2015年4月14日～ 2015年5月13日	2015年5月14日～ 2015年6月15日	2015年6月16日～ 2015年7月13日	2015年7月14日～ 2015年8月13日
当期分配金	20	20	20	20	20	20
(対基準価額比率)	0.197%	0.195%	0.198%	0.199%	0.199%	0.199%
当期の収益	20	20	20	20	20	20
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	776	784	789	796	799	806

(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いません。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。

※投資する債券は、原則として、シティ世界国債インデックスに採用されている国のうち取得時において最上位（AAA格相当）の長期価格付を有している国の国債、およびわが国の国債とします。ただし、AAA格相当の長期価格付を有している国が極端に減少する等、投資環境が大きく変化した場合には、AA格相当以上の長期価格付を有している国の国債に投資する場合があります。

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

(2015年2月14日～2015年8月13日)

項 目	第52期～第57期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 35	% 0.348	(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)	(16)	(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)	(16)	(0.158)	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)	(3)	(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	0.013	(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)	(0.012)	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	36	0.361	
作成期間の平均基準価額は、10,132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

(2015年2月14日～2015年8月13日)

公社債

			第52期～第57期	
			買付額	売付額
外国	アメリカ	国債証券	千米ドル 6,529	千米ドル 4,614
	イギリス	国債証券	千英ポンド 2,077	千英ポンド 1,036
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 5,362	千シンガポールドル 3,325

*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

(2015年2月14日～2015年8月13日)

利害関係人との取引状況

区分	第52期～第57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 1,667	百万円 199	% 11.9	百万円 1,051	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證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2015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57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
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	11,050	12,007	1,492,375	33.2	—	6.2	14.3	12.6
イギリス	千英ポンド 6,600	千英ポンド 7,713	1,498,049	33.3	—	9.8	18.8	4.7
シンガポール	千シンガポールドル 15,000	千シンガポールドル 15,649	1,390,801	31.0	—	7.7	12.7	10.6
合 計	—	—	4,381,226	97.5	—	23.7	45.9	27.9

* 邦貨換算金額は、第57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。

* ー印は組み入れなし。

* 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57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	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY BOND	7.5	700	1,023	127,167	2024/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	2,150	2,231	277,390	2017/1/31
		US TREASURY N/B	3.875	900	972	120,862	2018/5/15
		US TREASURY N/B	4.0	1,900	2,071	257,459	2018/8/15
		US TREASURY N/B	3.125	2,000	2,137	265,679	2019/5/15
		US TREASURY N/B	2.0	1,100	1,104	137,231	2023/2/15
		US TREASURY N/B	4.5	100	131	16,355	2039/8/15
		US TREASURY NOTE	4.625	2,200	2,335	290,228	2017/2/15
小		計				1,492,375	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UK TREASURY	4.0	1,050	1,089	211,495	2016/9/7
		UK TREASURY	8.75	1,100	1,283	249,187	2017/8/25
		UK TREASURY	5.0	1,250	1,386	269,258	2018/3/7
		UK TREASURY	4.5	1,500	1,683	326,984	2019/3/7
		UK TREASURY	8.0	600	820	159,282	2021/6/7
		UK TREASURY	5.0	800	1,025	199,187	2025/3/7
		UK TREASURY	4.5	300	425	82,653	2042/12/7
小		計				1,498,049	
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	3.75	2,600	2,676	237,878	2016/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	2,600	2,657	236,140	2017/4/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	4.0	3,100	3,344	297,261	2018/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.5	3,000	3,090	274,608	2019/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.25	600	634	56,388	2020/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	2,200	2,316	205,876	2022/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	600	616	54,815	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	300	313	27,834	2024/9/1
小		計				1,390,801	
合		計				4,381,226	

* 邦貨換算金額は、第57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

(2015年8月13日現在)

項 目	第57期末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 4,381,226	% 96.9
コール・ローン等、その他	138,812	3.1
投資信託財産総額	4,520,038	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*第57期末における外貨建て純資産(4,457,930千円)の投資信託財産総額(4,520,038千円)に対する比率は98.6%です。

*外貨建て資産は、第57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=124.29円、1英ポンド=194.20円、1シンガポールドル=88.87円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第52期末	第53期末	第54期末	第55期末	第56期末	第57期末
	2015年3月13日現在	2015年4月13日現在	2015年5月13日現在	2015年6月15日現在	2015年7月13日現在	2015年8月13日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	7,899,124,900	7,611,440,975	7,832,724,720	8,346,242,639	8,869,960,062	8,940,897,946
コール・ローン等	96,717,785	128,196,975	106,235,115	104,335,807	51,222,791	59,906,950
公社債(評価額)	3,739,959,535	3,721,802,974	3,800,445,518	3,963,808,248	4,349,582,852	4,381,226,768
未収入金	4,042,285,308	3,735,265,640	3,886,847,710	4,239,798,712	4,416,661,850	4,436,659,340
未収利息	16,457,438	23,168,752	34,929,722	34,010,846	43,266,770	54,109,981
前払費用	2,274,983	1,427,845	2,523,870	3,963,003	8,718,112	8,313,552
その他未収収益	1,429,851	1,578,789	1,742,785	326,023	507,687	681,355
(B) 負債	4,073,928,926	3,751,126,742	3,938,911,103	4,250,182,060	4,395,146,278	4,447,873,199
未払金	4,037,728,119	3,738,246,000	3,926,908,320	4,233,738,577	4,375,792,000	4,432,280,000
未払収益分配金	7,533,242	7,554,673	7,724,271	8,156,771	8,920,640	8,943,603
未払解約金	26,604,687	3,022,594	2,030,437	5,744,570	8,014,140	3,966,816
未払信託報酬	2,056,560	2,296,419	2,241,187	2,534,356	2,412,085	2,674,562
その他未払費用	6,318	7,056	6,888	7,786	7,413	8,218
(C) 純資産総額(A-B)	3,825,195,974	3,860,314,233	3,893,813,617	4,096,060,579	4,474,813,784	4,493,024,747
元本	3,766,621,303	3,777,336,825	3,862,135,854	4,078,385,980	4,460,320,032	4,471,801,979
次期繰越損益金	58,574,671	82,977,408	31,677,763	17,674,599	14,493,752	21,222,768
(D) 受益権総口数	3,766,621,303口	3,777,336,825口	3,862,135,854口	4,078,385,980口	4,460,320,032口	4,471,801,979口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,156円	10,220円	10,082円	10,043円	10,032円	10,047円

(注) 第52期首元本額3,692百万円、第52～第57期中追加設定元本額1,101百万円、第52～第57期中一部解約元本額322百万円、第57期末計算口数当たり純資産額10,047円。

○損益の状況

項 目	第52期	第53期	第54期	第55期	第56期	第57期
	2015年2月14日～ 2015年3月13日	2015年3月14日～ 2015年4月13日	2015年4月14日～ 2015年5月13日	2015年5月14日～ 2015年6月15日	2015年6月16日～ 2015年7月13日	2015年7月14日～ 2015年8月13日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	10,866,464	11,543,135	11,699,824	13,345,292	12,456,757	14,295,632
受取利息	10,780,500	11,480,983	11,562,072	13,264,568	12,368,437	14,140,768
その他収益金	85,964	62,152	137,752	80,724	88,320	154,864
(B) 有価証券売買損益	△ 39,716,470	22,257,628	△ 54,498,461	△ 19,312,815	△ 6,073,819	4,131,205
売買益	132,640,736	106,136,981	123,641,665	156,390,601	92,042,776	109,880,624
売買損	△172,357,206	△ 83,879,353	△178,140,126	△175,703,416	△ 98,116,595	△105,749,419
(C) 信託報酬等	△ 2,142,316	△ 2,412,846	△ 2,316,314	△ 2,623,159	△ 2,485,177	△ 2,787,856
(D) 当期繰越益金(A+B+C)	△ 30,992,322	31,387,917	△ 45,114,951	△ 8,590,682	3,897,761	15,638,981
(E) 前期繰越損益金	51,573,326	12,805,211	36,390,748	△ 16,235,892	△ 32,111,434	△ 37,023,758
(F) 追加信託差損益金	45,526,909	46,338,953	48,126,237	50,657,944	51,628,065	51,551,148
(配当等相当額)	(216,557,930)	(218,894,290)	(226,206,798)	(244,704,764)	(277,343,341)	(278,518,156)
(売買損益相当額)	(△171,031,021)	(△172,555,337)	(△178,080,561)	(△194,046,820)	(△225,715,276)	(△226,967,008)
(G) 計(D+E+F)	66,107,913	90,532,081	39,402,034	25,831,370	23,414,392	30,166,371
(H) 収益分配金	△ 7,533,242	△ 7,554,673	△ 7,724,271	△ 8,156,771	△ 8,920,640	△ 8,943,603
(次期繰越損益金(G+H))	58,574,671	82,977,408	31,677,763	17,674,599	14,493,752	21,222,768
追加信託差損益金	45,526,909	46,338,953	48,126,237	50,657,944	51,628,065	51,551,148
(配当等相当額)	(216,557,930)	(218,894,290)	(226,206,798)	(244,704,764)	(277,343,341)	(278,518,156)
(売買損益相当額)	(△171,031,021)	(△172,555,337)	(△178,080,561)	(△194,046,820)	(△225,715,276)	(△226,967,008)
分配準備積立金	75,795,468	77,550,939	78,685,868	80,234,295	79,164,249	82,117,770
繰越損益金	△ 62,747,706	△ 40,912,484	△ 95,134,342	△113,217,640	△116,298,562	△112,446,150

* 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(2015年2月14日～2015年8月13日)は以下の通りです。

項 目	第52期	第53期	第54期	第55期	第56期	第57期
	2015年2月14日～ 2015年3月13日	2015年3月14日～ 2015年4月13日	2015年4月14日～ 2015年5月13日	2015年5月14日～ 2015年6月15日	2015年6月16日～ 2015年7月13日	2015年7月14日～ 2015年8月13日
a. 配当等収益(経費控除後)	8,724,148円	10,719,148円	9,383,510円	10,722,133円	9,971,580円	12,132,813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	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	216,557,930円	218,894,290円	226,206,798円	244,704,764円	277,343,341円	278,518,156円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	74,604,562円	74,386,464円	77,026,629円	77,668,933円	78,113,309円	78,928,560円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	299,886,640円	303,999,902円	312,616,937円	333,095,830円	365,428,230円	369,579,529円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	796円	804円	809円	816円	819円	826円
g. 分配金	7,533,242円	7,554,673円	7,724,271円	8,156,771円	8,920,640円	8,943,603円
h. 分配金(1万口当たり)	20円	20円	20円	20円	20円	20円

○分配金のお知らせ

	第52期	第53期	第54期	第55期	第56期	第57期
1 万口当たり分配金 (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

有価証券の指図範囲に新投資口予約権証券を加える所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2015年8月3日＞