

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58期(決算日2015年9月14日) 第59期(決算日2015年10月13日) 第60期(決算日2015年11月13日)
第61期(決算日2015年12月14日) 第62期(決算日2016年1月13日) 第63期(決算日2016年2月15日)

作成対象期間(2015年8月14日～2016年2月15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 騰 落					
	円		円		%		%	百万円	
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	
58期(2015年9月14日)	10,007		20		△0.2	98.3	—	4,776	
59期(2015年10月13日)	10,045		20		0.6	96.3	—	4,870	
60期(2015年11月13日)	9,917		20		△1.1	97.9	—	4,853	
61期(2015年12月14日)	9,965		20		0.7	96.7	—	4,874	
62期(2016年1月13日)	9,929		20		△0.2	94.2	—	5,041	
63期(2016年2月15日)	10,058		20		1.5	91.8	—	5,178	

* 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

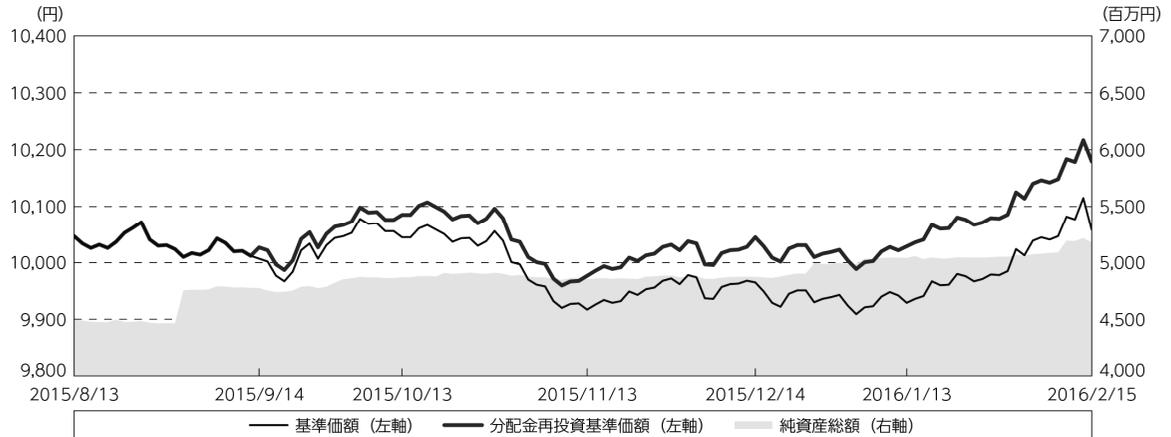
決 算 期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
			騰 落 率	騰 落 率			
第58期	(期 首) 2015年8月13日	円 10,047	% —		% 97.5		% —
	8月末	10,024	△0.2		94.5		—
	(期 末) 2015年9月14日	10,027	△0.2		98.3		—
第59期	(期 首) 2015年9月14日	10,007	—		98.3		—
	9月末	10,044	0.4		96.1		—
	(期 末) 2015年10月13日	10,065	0.6		96.3		—
第60期	(期 首) 2015年10月13日	10,045	—		96.3		—
	10月末	10,001	△0.4		98.6		—
	(期 末) 2015年11月13日	9,937	△1.1		97.9		—
第61期	(期 首) 2015年11月13日	9,917	—		97.9		—
	11月末	9,972	0.6		97.6		—
	(期 末) 2015年12月14日	9,985	0.7		96.7		—
第62期	(期 首) 2015年12月14日	9,965	—		96.7		—
	12月末	9,924	△0.4		94.8		—
	(期 末) 2016年1月13日	9,949	△0.2		94.2		—
第63期	(期 首) 2016年1月13日	9,929	—		94.2		—
	1月末	9,985	0.6		96.8		—
	(期 末) 2016年2月15日	10,078	1.5		91.8		—

* 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58期首：10,047円

第63期末：10,058円 (既払分配金(税込み)：120円)

騰落率：1.3% (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8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10,047円から当作成期末には10,058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上がり額は131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) 組入債券の価格が上昇したことによるキャピタルゲイン(値上がり益)。

(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、雇用市場の改善が続く中、12月のFOMC（米連邦公開市場委員会）で利上げが行なわれました。年明け以降は中国株の大幅下落を端緒に、金融市場でリスク回避的な動きが強まりました。

ユーロ圏では、ECB（欧州中央銀行）が国債買い入れを含む大規模な量的緩和策を続けたことが債券相場を下支えしました。12月のECB理事会では中銀預金金利の引き下げや資産買い入れ期間の延長を決定するなど、追加の金融緩和を発表しました。

日本では、日本銀行が国債の買い入れを続け、1月の金融政策決定会合でマイナス金利政策を導入しました。

- ・米国で利上げが行なわれた一方で、ユーロ圏や日本では緩和的な金融環境が継続したことや、年明け以降に金融市場でリスク回避的な姿勢が強まったことから先進国の国債利回りは低下（価格は上昇）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。

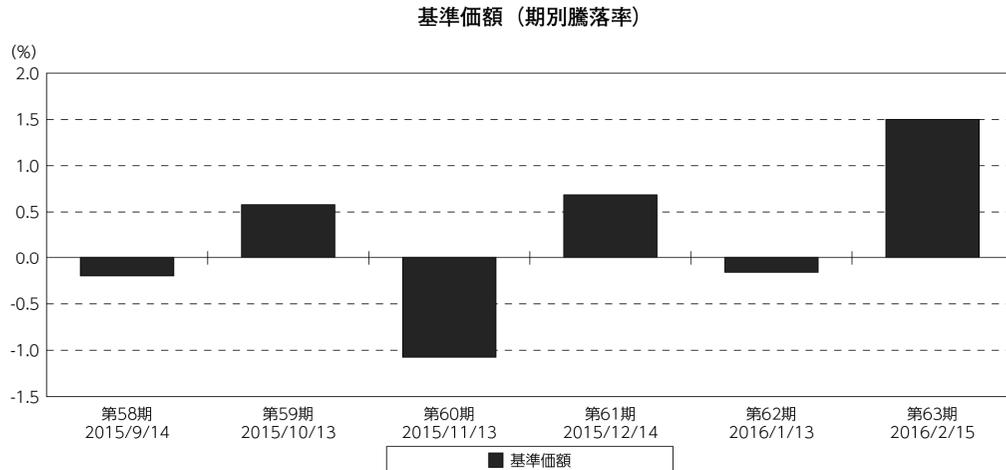
<為替>

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。



(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58期20円、第59期20円、第60期20円、第61期20円、第62期20円、第63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58期	第59期	第60期	第61期	第62期	第63期
	2015年8月14日～ 2015年9月14日	2015年9月15日～ 2015年10月13日	2015年10月14日～ 2015年11月13日	2015年11月14日～ 2015年12月14日	2015年12月15日～ 2016年1月13日	2016年1月14日～ 2016年2月15日
当期分配金	20	20	20	20	20	20
(対基準価額比率)	0.199%	0.199%	0.201%	0.200%	0.201%	0.198%
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	811	819	825	833	835	846

(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

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8月14日～2016年2月15日)

項 目	第58期～第63期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 36	% 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)	(16)	(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)	(16)	(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)	(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)	(0.011)	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	37	0.370	
作成期間の平均基準価額は、9,991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8月14日～2016年2月15日)

公社債

			第58期～第63期	
			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	国債証券	千米ドル 21,201	千米ドル 19,360
	イギリス	国債証券	千英ポンド 8,187	千英ポンド 6,452
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 8,175	千シンガポールドル 4,107

* 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8月14日～2016年2月15日)

利害関係人との取引状況

区 分	第58期～第63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	28,321	—	—	29,209	120	0.4
為替直物取引	876	103	11.8	66	—	—

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

(2016年2月15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63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	12,300	13,954	1,581,518	30.5	—	12.3	9.2	9.0
	千英ポンド	千英ポンド						
イギリス	8,150	9,476	1,558,904	30.1	—	11.8	9.7	8.6
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	18,800	19,877	1,613,078	31.1	—	9.9	15.3	5.9
合 計	—	—	4,753,501	91.8	—	34.0	34.2	23.6

* 邦貨換算金額は、第63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	柄	第63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 BOND	7.875	500	660	74,837	2021/2/15
		US TREASURY BOND	7.25	2,000	2,721	308,452	2022/8/15
		US TREASURY BOND	7.5	500	737	83,629	2024/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,000	2,049	232,308	2017/2/28
		US TREASURY N/B	4.0	1,400	1,513	171,491	2018/8/15
		US TREASURY N/B	3.125	2,500	2,674	303,069	2019/5/15
		US TREASURY N/B	2.0	1,200	1,240	140,638	2023/2/15
		US TREASURY N/B	4.5	200	276	31,364	2039/8/15
		US TREASURY NOTE	4.625	2,000	2,080	235,726	2017/2/15
小	計					1,581,518	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UK TREASURY	4.0	1,000	1,020	167,833	2016/9/7
		UK TREASURY	8.75	1,500	1,695	278,893	2017/8/25
		UK TREASURY	5.0	1,250	1,370	225,522	2018/3/7
		UK TREASURY	4.5	1,500	1,684	277,067	2019/3/7
		UK TREASURY	8.0	800	1,098	180,763	2021/6/7
		UK TREASURY	4.0	1,500	1,774	291,922	2022/3/7
		UK TREASURY	5.0	300	394	64,973	2025/3/7
		UK TREASURY	4.5	300	437	71,927	2042/12/7
小	計					1,558,904	
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	600	609	49,478	2016/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	3,100	3,153	255,891	2017/4/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	4.0	3,100	3,326	269,929	2018/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.5	3,000	3,121	253,309	2019/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.25	3,100	3,330	270,306	2020/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	4,000	4,306	349,431	2022/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	600	631	51,270	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	1,300	1,398	113,459	2024/9/1
小	計					1,613,078	
合	計					4,753,501	

*邦貨換算金額は、第63期末の時価をわが国の対顧客電信売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2月15日現在)

項 目	第63期末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 4,753,501	% 80.5
コール・ローン等、その他	1,150,495	19.5
投資信託財産総額	5,903,996	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*第63期末における外貨建て純資産(4,773,034千円)の投資信託財産総額(5,903,996千円)に対する比率は80.8%です。

*外貨建て資産は、第63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=113.33円、1英ポンド=164.51円、1シンガポールドル=81.15円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第58期末	第59期末	第60期末	第61期末	第62期末	第63期末
	2015年9月14日現在	2015年10月13日現在	2015年11月13日現在	2015年12月14日現在	2016年1月13日現在	2016年2月15日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	9,518,882,188	9,621,280,468	9,694,663,795	9,637,635,486	10,209,842,764	10,784,170,122
コール・ローン等	105,080,226	207,222,351	77,958,196	61,171,458	337,399,616	190,462,405
公社債(評価額)	4,696,114,251	4,690,197,151	4,751,918,145	4,713,935,366	4,748,074,364	4,753,501,087
未収入金	4,689,450,585	4,686,467,600	4,813,360,680	4,824,249,350	5,069,498,230	5,766,273,939
未収利息	17,813,216	27,658,698	34,109,928	30,486,414	41,244,057	52,194,852
前払費用	9,549,375	8,654,083	16,044,966	6,309,836	11,935,583	19,847,494
その他未収収益	874,535	1,080,585	1,271,880	1,483,062	1,690,914	1,890,345
(B) 負債	4,742,647,893	4,750,694,753	4,840,795,942	4,763,091,676	5,168,260,834	5,605,465,651
未払金	4,730,264,500	4,738,307,000	4,817,822,000	4,748,472,000	5,144,167,219	5,572,237,715
未払収益分配金	9,545,466	9,697,488	9,788,821	9,782,880	10,154,988	10,297,417
未払解約金	—	—	10,263,726	1,926,092	11,070,797	19,704,183
未払信託報酬	2,829,234	2,682,020	2,912,443	2,901,785	2,859,041	3,216,451
その他未払費用	8,693	8,245	8,952	8,919	8,789	9,885
(C) 純資産総額(A-B)	4,776,234,295	4,870,585,715	4,853,867,853	4,874,543,810	5,041,581,930	5,178,704,471
元本	4,772,733,252	4,848,744,071	4,894,410,715	4,891,440,327	5,077,494,389	5,148,708,666
次期繰越損益金	3,501,043	21,841,644	△ 40,542,862	△ 16,896,517	△ 35,912,459	29,995,805
(D) 受益権総口数	4,772,733,252口	4,848,744,071口	4,894,410,715口	4,891,440,327口	5,077,494,389口	5,148,708,666口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,007円	10,045円	9,917円	9,965円	9,929円	10,058円

(注) 第58期首元本額4,471百万円、第58～第63期中追加設定元本額965百万円、第58～第63期中一部解約元本額288百万円、第63期末計算口数当たり純資産額10,058円。

○損益の状況

項 目	第58期	第59期	第60期	第61期	第62期	第63期
	2015年8月14日～ 2015年9月14日	2015年9月15日～ 2015年10月13日	2015年10月14日～ 2015年11月13日	2015年11月14日～ 2015年12月14日	2015年12月15日～ 2016年1月13日	2016年1月14日～ 2016年2月15日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	14,574,354	14,511,447	15,557,635	14,829,930	14,265,785	15,998,094
受取利息	14,410,490	14,311,121	15,415,858	14,655,040	14,101,080	15,898,073
その他収益金	163,864	200,326	141,777	174,890	164,705	100,021
(B) 有価証券売買損益	△ 20,427,583	16,033,175	△ 65,131,642	21,500,226	△ 18,908,508	62,372,756
売買益	210,482,019	109,892,602	141,508,633	134,819,104	293,064,986	351,399,496
売買損	△ 230,909,602	△ 93,859,427	△ 206,640,275	△ 113,318,878	△ 311,973,494	△ 289,026,740
(C) 信託報酬等	△ 2,934,271	△ 2,759,398	△ 2,989,466	△ 3,025,652	△ 2,984,880	△ 3,314,285
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 8,787,500	27,785,224	△ 52,563,473	33,304,504	△ 7,627,603	75,056,565
(E) 前期繰越損益金	△ 29,993,179	△ 48,033,313	△ 29,740,378	△ 91,255,401	△ 67,307,327	△ 83,442,164
(F) 追加信託差損益金	51,827,188	51,787,221	51,549,810	50,837,260	49,177,459	48,678,821
(配当等相当額)	(304,198,974)	(310,998,077)	(315,420,556)	(316,017,314)	(332,298,971)	(340,313,995)
(売買損益相当額)	(△ 252,371,786)	(△ 259,210,856)	(△ 263,870,746)	(△ 265,180,054)	(△ 283,121,512)	(△ 291,635,174)
(G) 計(D+E+F)	13,046,509	31,539,132	△ 30,754,041	△ 7,113,637	△ 25,757,471	40,293,222
(H) 収益分配金	△ 9,545,466	△ 9,697,488	△ 9,788,821	△ 9,782,880	△ 10,154,988	△ 10,297,417
次期繰越損益金(G+H)	3,501,043	21,841,644	△ 40,542,862	△ 16,896,517	△ 35,912,459	29,995,805
追加信託差損益金	51,827,188	51,787,221	51,549,810	50,837,260	49,177,459	48,678,821
(配当等相当額)	(304,198,974)	(310,998,077)	(315,420,556)	(316,017,314)	(332,298,971)	(340,313,995)
(売買損益相当額)	(△ 252,371,786)	(△ 259,210,856)	(△ 263,870,746)	(△ 265,180,054)	(△ 283,121,512)	(△ 291,635,174)
分配準備積立金	83,304,792	86,302,977	88,490,953	91,498,404	92,048,245	95,289,969
繰越損益金	△ 131,630,937	△ 116,248,554	△ 180,583,625	△ 159,232,181	△ 177,138,163	△ 113,972,985

* 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8月14日～2016年2月15日)は以下の通りです。

項 目	第58期	第59期	第60期	第61期	第62期	第63期
	2015年8月14日～ 2015年9月14日	2015年9月15日～ 2015年10月13日	2015年10月14日～ 2015年11月13日	2015年11月14日～ 2015年12月14日	2015年12月15日～ 2016年1月13日	2016年1月14日～ 2016年2月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	11,640,083円	13,200,457円	12,568,169円	13,594,859円	11,280,905円	15,321,648円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金繰戻後)	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	304,198,974円	310,998,077円	315,420,556円	316,017,314円	332,298,971円	340,313,995円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	81,210,175円	82,800,008円	85,711,605円	87,686,425円	90,922,328円	90,265,738円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	397,049,232円	406,998,542円	413,700,330円	417,298,598円	434,502,204円	445,901,381円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	831円	839円	845円	853円	855円	866円
g. 分配金	9,545,466円	9,697,488円	9,788,821円	9,782,880円	10,154,988円	10,297,417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58期	第59期	第60期	第61期	第62期	第63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

該当事項はございません。