

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64期(決算日2016年3月14日) 第65期(決算日2016年4月13日) 第66期(決算日2016年5月13日)
第67期(決算日2016年6月13日) 第68期(決算日2016年7月13日) 第69期(決算日2016年8月15日)

作成対象期間(2016年2月16日～2016年8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りに、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					
	円		円		%		%	百万円
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
64期(2016年3月14日)	9,989		20		△0.5	96.6	—	5,470
65期(2016年4月13日)	10,036		20		0.7	95.0	—	5,586
66期(2016年5月13日)	10,011		20		△0.0	96.7	—	5,826
67期(2016年6月13日)	10,014		20		0.2	94.9	—	6,749
68期(2016年7月13日)	10,087		20		0.9	98.4	—	10,323
69期(2016年8月15日)	10,092		20		0.2	96.0	—	11,946

* 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

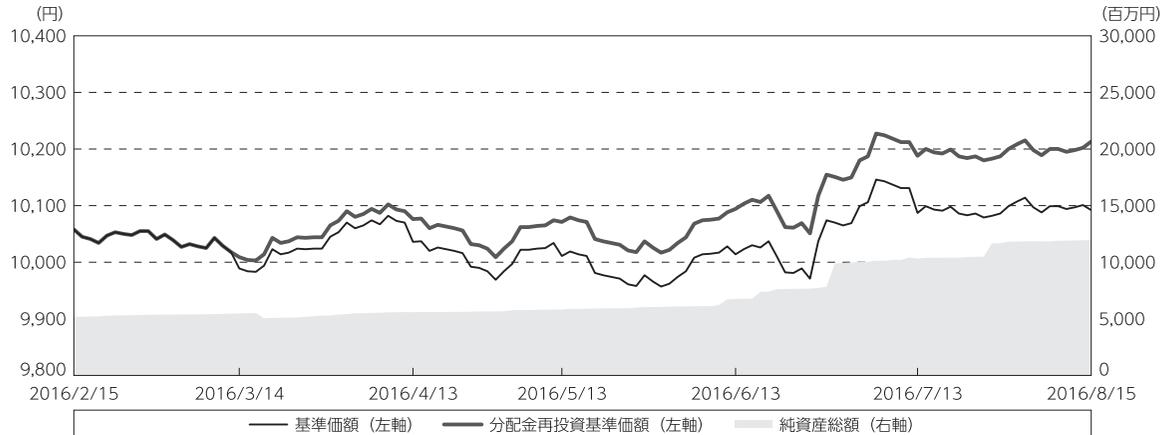
決 算 期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
			騰	落			
第64期	(期 首) 2016年2月15日	円 10,058		% —	% 91.8		% —
	2月末	10,041		△0.2	90.4		—
	(期 末) 2016年3月14日	10,009		△0.5	96.6		—
第65期	(期 首) 2016年3月14日	9,989		—	96.6		—
	3月末	10,053		0.6	97.7		—
	(期 末) 2016年4月13日	10,056		0.7	95.0		—
第66期	(期 首) 2016年4月13日	10,036		—	95.0		—
	4月末	9,984		△0.5	97.1		—
	(期 末) 2016年5月13日	10,031		△0.0	96.7		—
第67期	(期 首) 2016年5月13日	10,011		—	96.7		—
	5月末	9,957		△0.5	98.0		—
	(期 末) 2016年6月13日	10,034		0.2	94.9		—
第68期	(期 首) 2016年6月13日	10,014		—	94.9		—
	6月末	10,065		0.5	91.8		—
	(期 末) 2016年7月13日	10,107		0.9	98.4		—
第69期	(期 首) 2016年7月13日	10,087		—	98.4		—
	7月末	10,099		0.1	96.4		—
	(期 末) 2016年8月15日	10,112		0.2	96.0		—

* 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64期首：10,058円

第69期末：10,092円 (既払分配金 (税込み) : 120円)

騰落率： 1.5% (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 (2016年2月15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10,058円から当作成期末には10,092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154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、6月のFOMC（米連邦公開市場委員会）でメンバーの政策金利の見通しが引き下げられるなど、利上げを進める姿勢が軟化しました。6月23日に実施された英国の国民投票でEU（欧州連合）からの離脱を支持する票が多数となったことを受け、金融市場でリスク回避的な動きが強まる場面もありました。

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。3月の理事会では、資産買い入れ規模の拡大や利下げ、資産購入の対象に銀行以外の投資適格級の社債を加えることなど大規模な追加金融緩和策が決定されました。

日本では、日本銀行が国債の買い入れやマイナス金利政策を続けました。

- ・米国で利上げ観測が後退したことや、ユーロ圏で緩和的な金融環境が継続したこと、英国の国民投票の結果を受けて欧州を中心に金融緩和強化への期待が高まったことを背景に、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、当作成期にイギリスを除外し、新たにスウェーデンを組み入れました。当作成期末における投資対象国は、米国、シンガポール、スウェーデンとしました。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4.5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。

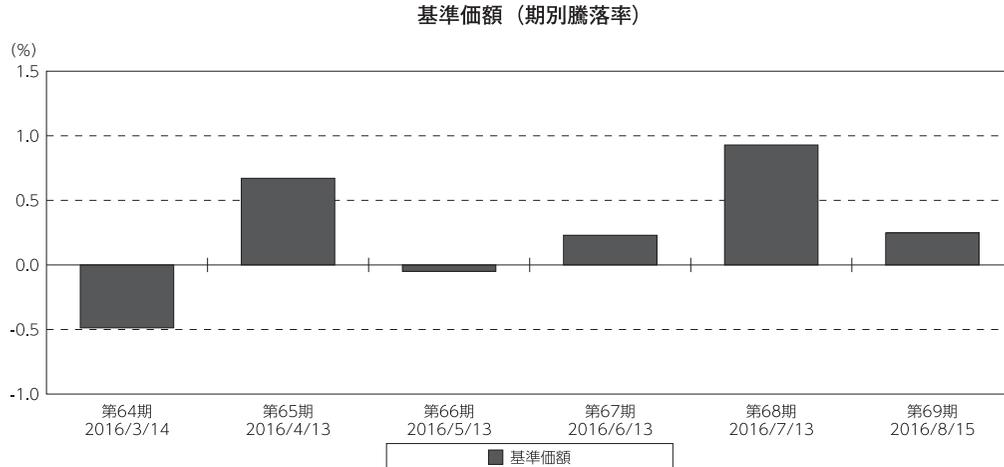
<為替>

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64期20円、第65期20円、第66期20円、第67期20円、第68期20円、第69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64期	第65期	第66期	第67期	第68期	第69期
	2016年2月16日～ 2016年3月14日	2016年3月15日～ 2016年4月13日	2016年4月14日～ 2016年5月13日	2016年5月14日～ 2016年6月13日	2016年6月14日～ 2016年7月13日	2016年7月14日～ 2016年8月15日
当期分配金 (対基準価額比率)	20 0.200%	20 0.199%	20 0.199%	20 0.199%	20 0.198%	20 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	848	856	860	866	869	871

(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

(2016年2月16日～2016年8月15日)

項 目	第64期～第69期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 35	% 0.349	(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)	(0.161)	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)	(0.161)	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	0.010	(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)	(0.008)	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	0.359	
作成期間の平均基準価額は、10,033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2月16日～2016年8月15日)

公社債

			第64期～第69期	
			買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券	千米ドル 42,264	千米ドル 19,230
	イギリス	国債証券	千英ポンド 19,123	千英ポンド 28,731
国	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 402,152	千スウェーデンクローナ 68,250
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 52,085	千シンガポールドル 23,498

*金額は受け渡し代金。(経過利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

(2016年2月16日～2016年8月15日)

利害関係人との取引状況

区 分	第64期～第69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	42,164	—	—	49,726	2,503	5.0
為替直物取引	10,908	2,444	22.4	3,445	—	—

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8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69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	31,200	36,966	3,751,027	31.4	—	11.3	12.4	7.7
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 280,000	千スウェーデンクローナ 336,251	4,028,297	33.7	—	24.4	9.3	—
シンガポール	千シンガポールドル 45,900	千シンガポールドル 48,938	3,686,066	30.9	—	12.2	14.5	4.2
合 計	—	—	11,465,390	96.0	—	47.9	36.2	11.9

* 邦貨換算金額は、第69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69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	3,200	4,160	422,165	2021/2/15
		US TREASURY BOND	7.25	5,500	7,429	753,850	2022/8/15
		US TREASURY BOND	7.5	2,000	2,954	299,780	2024/11/15
		US TREASURY BOND	6.75	1,000	1,489	151,174	2026/8/15
		US TREASURY N/B	2.5	3,800	3,862	391,957	2017/6/30
		US TREASURY N/B	3.875	4,900	5,174	525,034	2018/5/15
		US TREASURY N/B	4.0	6,800	7,254	736,112	2018/8/15
		US TREASURY N/B	3.125	3,000	3,190	323,732	2019/5/15
		US TREASURY N/B	4.5	1,000	1,450	147,218	2039/8/15
小	計					3,751,027	
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	5.0	75,000	92,977	1,113,870	2020/12/1
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	70,000	85,970	1,029,926	2022/6/1
		SWEDISH GOVERNMENT	1.5	70,000	79,268	949,630	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT	2.5	50,000	61,575	737,668	2025/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	1.0	15,000	16,460	197,200	2026/11/12
小	計					4,028,297	
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	601	45,288	2016/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.375	6,000	6,040	455,002	2017/10/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	4.0	8,600	9,149	689,143	2018/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.5	7,000	7,291	549,225	2019/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.25	6,000	6,498	489,429	2020/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	7,000	7,696	579,700	2022/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	5,100	5,497	414,094	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	5,600	6,162	464,182	2024/9/1
小	計					3,686,066	
合	計					11,465,390	

* 邦貨換算金額は、第69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8月15日現在)

項 目	第69期末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 11,465,390	% 95.6
コール・ローン等、その他	533,124	4.4
投資信託財産総額	11,998,514	100.0

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 第69期末における外貨建て純資産（11,637,282千円）の投資信託財産総額（11,998,514千円）に対する比率は97.0%です。

* 外貨建て資産は、第69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=101.47円、1スウェーデンクローナ=11.98円、1シンガポールドル=75.32円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第64期末	第65期末	第66期末	第67期末	第68期末	第69期末
	2016年3月14日現在	2016年4月13日現在	2016年5月13日現在	2016年6月13日現在	2016年7月13日現在	2016年8月15日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	10,825,630,337	11,127,228,453	11,912,922,297	14,791,495,116	23,468,254,503	23,527,938,171
コール・ローン等	262,351,667	229,331,850	424,713,218	869,095,323	1,258,257,763	298,668,585
公社債(評価額)	5,287,061,186	5,305,947,521	5,631,938,082	6,404,201,738	10,163,274,869	11,465,390,965
未収入金	5,252,318,592	5,551,819,799	5,798,641,450	7,459,976,091	11,962,880,118	11,606,608,530
未収利息	19,595,288	29,189,213	43,682,273	43,827,472	38,436,581	55,250,266
前払費用	2,194,590	8,625,666	11,416,897	13,944,403	44,701,656	100,952,279
その他未収収益	2,109,014	2,314,404	2,530,377	450,089	703,516	1,067,546
(B) 負債	5,354,753,552	5,540,500,917	6,086,562,408	8,042,349,720	13,144,679,721	11,580,996,285
未払金	5,333,052,000	5,525,286,897	6,069,662,836	8,025,252,704	13,050,069,358	11,550,184,000
未払収益分配金	10,953,399	11,133,063	11,640,048	13,478,815	20,468,856	23,675,319
未払解約金	7,870,135	1,001,424	1,978,975	—	69,133,039	—
未払信託報酬	2,869,198	3,070,097	3,269,800	3,605,907	4,992,314	7,114,707
未払利息	—	—	698	1,210	803	379
その他未払費用	8,820	9,436	10,051	11,084	15,351	21,880
(C) 純資産総額(A-B)	5,470,876,785	5,586,727,536	5,826,359,889	6,749,145,396	10,323,574,782	11,946,941,886
元本	5,476,699,847	5,566,531,701	5,820,024,140	6,739,407,657	10,234,428,378	11,837,659,861
次期繰越損益金	△ 5,823,062	20,195,835	6,335,749	9,737,739	89,146,404	109,282,025
(D) 受益権総口数	5,476,699,847口	5,566,531,701口	5,820,024,140口	6,739,407,657口	10,234,428,378口	11,837,659,861口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,989円	10,036円	10,011円	10,014円	10,087円	10,092円

(注) 第64期首元本額は5,148,708,666円、第64～69期中追加設定元本額は7,516,244,366円、第64～69期中一部解約元本額は827,293,171円、1口当たり純資産額は、第64期0.9989円、第65期1.0036円、第66期1.0011円、第67期1.0014円、第68期1.0087円、第69期1.0092円です。

○損益の状況

項 目	第64期	第65期	第66期	第67期	第68期	第69期
	2016年2月16日～ 2016年3月14日	2016年3月15日～ 2016年4月13日	2016年4月14日～ 2016年5月13日	2016年5月14日～ 2016年6月13日	2016年6月14日～ 2016年7月13日	2016年7月14日～ 2016年8月15日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	14,954,023	16,144,094	17,311,987	18,866,847	22,103,485	29,815,647
受取利息	14,757,657	16,063,262	17,127,165	18,714,159	21,928,436	29,516,727
その他収益金	196,366	80,832	194,299	166,213	202,418	320,797
支払利息	-	-	△ 9,477	△ 13,525	△ 27,369	△ 21,942
(B) 有価証券売買損益	△ 38,115,157	21,289,716	△ 16,198,755	1,368,717	59,308,135	8,028,767
売買益	353,300,038	281,588,459	233,036,750	243,003,645	664,283,280	368,998,960
売買損	△391,415,195	△260,298,743	△249,235,505	△241,634,928	△604,975,145	△360,970,193
(C) 信託報酬等	△ 2,969,368	△ 3,187,870	△ 3,372,374	△ 3,723,360	△ 5,107,008	△ 7,271,131
(D) 当期繰越損益金 (A+B+C)	△ 26,130,502	34,245,940	△ 2,259,142	16,512,204	76,304,612	30,573,283
(E) 前期繰越損益金	△ 18,622,450	△ 50,295,685	△ 27,045,578	△ 40,571,968	△ 37,017,150	18,707,506
(F) 追加信託差損益金	49,883,289	47,378,643	47,280,517	47,276,318	70,327,798	83,676,555
(配当等相当額)	(368,701,361)	(386,403,198)	(408,897,215)	(490,594,427)	(798,058,877)	(939,491,613)
(売買損益相当額)	(△318,818,072)	(△339,024,555)	(△361,616,698)	(△443,318,109)	(△727,731,079)	(△855,815,058)
(G) 計 (D+E+F)	5,130,337	31,328,898	17,975,797	23,216,554	109,615,260	132,957,344
(H) 収益分配金	△ 10,953,399	△ 11,133,063	△ 11,640,048	△ 13,478,815	△ 20,468,856	△ 23,675,319
次期繰越損益金 (G+H)	△ 5,823,062	20,195,835	6,335,749	9,737,739	89,146,404	109,282,025
追加信託差損益金	49,883,289	47,378,643	47,280,517	47,276,318	70,327,798	83,676,555
(配当等相当額)	(368,701,361)	(386,403,198)	(408,897,215)	(490,594,427)	(798,058,877)	(939,491,613)
(売買損益相当額)	(△318,818,072)	(△339,024,555)	(△361,616,698)	(△443,318,109)	(△727,731,079)	(△855,815,058)
分配準備積立金	96,012,311	90,322,893	92,166,465	93,243,661	92,196,531	92,064,350
繰越損益金	△151,718,662	△117,505,701	△133,111,233	△130,782,240	△ 73,377,925	△ 66,458,880

* 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2月16日～2016年8月15日) は以下の通りです。

項 目	第64期	第65期	第66期	第67期	第68期	第69期
	2016年2月16日～ 2016年3月14日	2016年3月15日～ 2016年4月13日	2016年4月14日～ 2016年5月13日	2016年5月14日～ 2016年6月13日	2016年6月14日～ 2016年7月13日	2016年7月14日～ 2016年8月15日
a. 配当等収益 (経費控除後)	11,984,655円	14,769,166円	13,939,613円	15,395,186円	20,716,932円	24,087,450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	368,701,361円	386,403,198円	408,897,215円	490,594,427円	798,058,877円	939,491,613円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	94,981,055円	86,686,790円	89,866,900円	91,327,290円	91,948,455円	91,652,219円
e. 分配対象収益 (a+b+c+d)	475,667,071円	487,859,154円	512,703,728円	597,316,903円	910,724,264円	1,055,231,282円
f. 分配対象収益 (1万円当たり)	868円	876円	880円	886円	889円	891円
g. 分配金	10,953,399円	11,133,063円	11,640,048円	13,478,815円	20,468,856円	23,675,319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64期	第65期	第66期	第67期	第68期	第69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。