



アライアンス・バーンスタイン・ グローバルESG・社債ファンド2021-09 (限定追加型)

追加型投信／内外／債券
第2期(決算日2023年9月25日)

●当ファンドの仕組み

当ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	追加型投信／内外／債券
信託期間	2026年9月25日まで(信託設定日:2021年9月3日)
運用方針	<p>信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・主として、新興国を含む世界の社債等のうち、信託期間内に満期償還を迎える債券に投資します。 ・ポートフォリオの構築にあたっては、計量分析とファンダメンタル分析による徹底したリサーチを行い、ESG評価が一定基準を満たす銘柄群の中から、将来の信用力分析やリスク特性などを考慮して魅力的と判断される銘柄を選定して投資します。 ・外貨建資産について、原則として対円での為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図ります。 ・信託期間は約5年の限定追加型投資信託です。 ・運用は、アライアンス・バーンスタインのグループ会社に委託します。
主運用対象	主として世界各国の社債等に投資します。
組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・外貨建資産への投資割合は、制限を設けません。 ・株式への投資は、優先証券のうち株券または新株引受権証券の性質を有するものならびに転換社債の転換および新株予約権を行使したものに限り、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
分配方針	<p>原則として毎決算時に、以下の方針に基づき分配を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・分配対象額の範囲は、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。)等の全額とします。 ・分配金額は、委託会社が基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、分配可能額が少額の場合等には、収益分配を行わないこともあります。 ・留保益の運用については、特に制限を設けず、「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用を行います。

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「アライアンス・バーンスタイン・グローバルESG・社債ファンド2021-09 (限定追加型)」は、このたび第2期の決算を行いました。

ここに、当期の運用状況をご報告申し上げます。今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

アライアンス・バーンスタイン株式会社

〒100-0011

東京都千代田区内幸町二丁目1番6号 日比谷パークフロント

お問合せ先 お客様窓口

電話番号 03-5962-9687

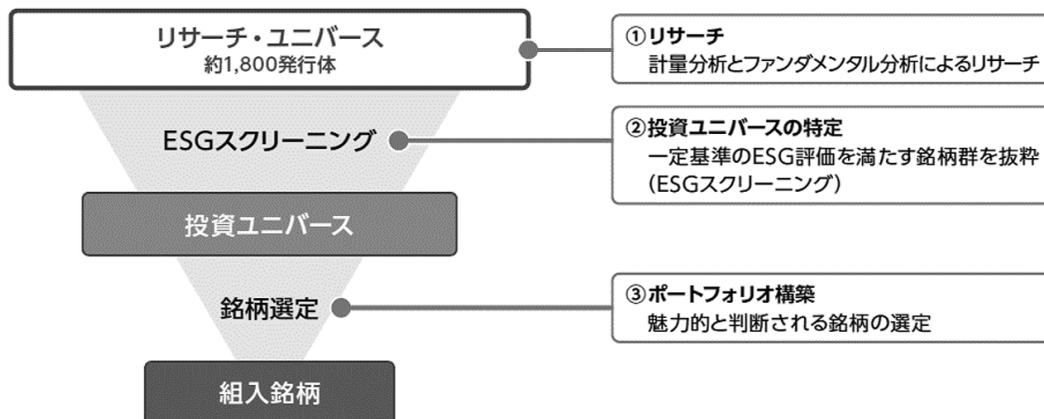
(受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで)

ホームページアドレス <https://www.alliancebernstein.co.jp>

アライアンス・バーンスタイン・グローバルESG・社債ファンド2021-09（限定追加型）の運用プロセス

アライアンス・バーンスタイン・グローバルESG・社債ファンド2021-09（限定追加型）は、主として新興国を含む世界の社債等のうち、信託期間内に満期償還を迎える債券に投資しますが、ポートフォリオの構築に当たっては、計量分析とファンダメンタル分析による徹底したリサーチを行い、ESG評価が一定基準を満たす銘柄群の中から、将来の信用力分析やリスク特性などを考慮して魅力的と判断される銘柄を選定して投資します。下図のようなプロセスでポートフォリオを構築します。

運用プロセス



※上記の内容は、2021年5月末現在のものであり、今後変更する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基 準 (分配落)	価 額			債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 分 込 配	み 金 騰 落	中 率			
(設定日) 2021年9月3日	円 10,000	円 —	—	% —	% —	% —	百万円 10,559
1期(2022年9月26日)	8,591	0	△14.1	100.5	—	—	11,427
2期(2023年9月25日)	8,698	0	1.2	99.5	—	—	9,498

(注) 設定日の基準価額は、当初設定時の価額です。また設定日の純資産総額は、当初設定元本総額を表示しております。

(注) 債券組入比率には、新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落	率		
(期首) 2022年9月26日	円 8,591	—	% —	% 100.5	% —
9月末	8,458	△1.5	101.4	—	
10月末	8,316	△3.2	102.0	—	
11月末	8,629	0.4	94.5	—	
12月末	8,661	0.8	92.2	—	
2023年1月末	8,774	2.1	91.8	—	
2月末	8,731	1.6	98.7	—	
3月末	8,696	1.2	98.9	—	
4月末	8,754	1.9	100.3	—	
5月末	8,747	1.8	102.9	—	
6月末	8,697	1.2	105.5	—	
7月末	8,742	1.8	99.3	—	
8月末	8,710	1.4	102.9	—	
(期末) 2023年9月25日	8,698	1.2	99.5	—	

(注) 各騰落率は期首比です。

(注) 債券組入比率には、新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

(注) 月末は、各月の最終営業日です。

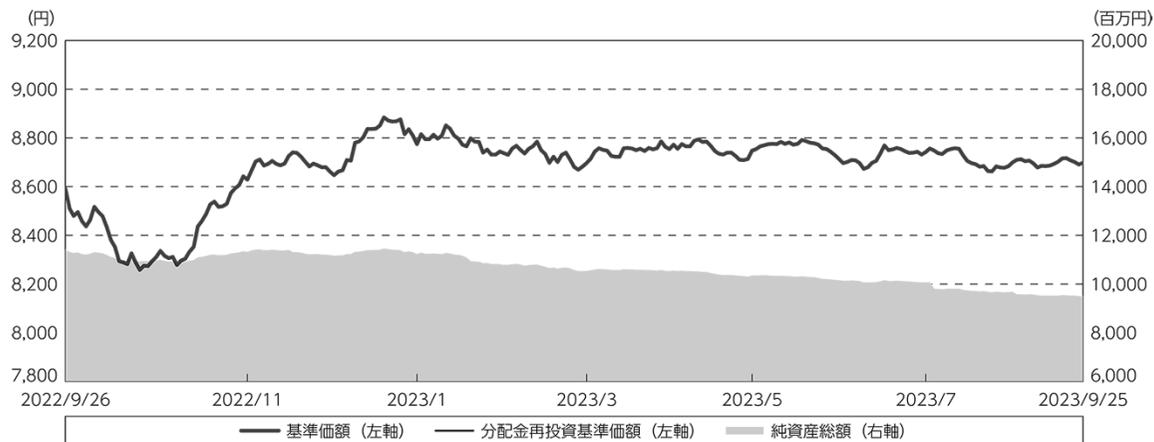
※ベンチマークおよび参考指数について
当ファンドの運用方針と類似した適切な指標が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

運用経過

アライアンス・バーンスタイン・グローバルESG・社債ファンド2021-09（限定追加型）（以下「当ファンド」ということがあります。）の運用状況をご報告いたします。

期中の基準価額等の推移

（2022年9月27日～2023年9月25日）



期首：8,591円

期末：8,698円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率：1.2%（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。

（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。したがって、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、小数第2位を四捨五入して表示しております。

（注）分配金再投資基準価額は、期首（2022年9月26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。

○基準価額の推移

基準価額（分配金（税込み）再投資）は前期末比で上昇しました。

○基準価額の変動要因

上昇要因

- ・保有している債券の価格上昇

下落要因

- ・為替のヘッジコスト

投資環境

(2022年9月27日～2023年9月25日)

【債券市場】

当期のグローバル社債市場は、下落しました。

期初から2022年10月にかけては、イギリス国債市場の混乱や米連邦準備理事会 (FRB) による積極的な金融引締め観測を背景に、下落基調で推移しました。11月以降2023年3月初旬にかけては、欧米当局の金融引締め政策に対する見方に左右される変動の高い展開となりました。その後欧米の金融不安を背景とする債券買いから反発したものの、4月以降期末にかけては、米中の対立激化や、米国の債務上限問題、主要先進国の金利が長期にわたり高止まりするとの懸念から、下落基調で推移しました。

運用概況

(2022年9月27日～2023年9月25日)

当ファンドは、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。主として、新興国を含む世界の社債等のうち、信託期間内に満期償還を迎える債券に投資し、投資した債券は原則として各債券の満期償還日まで保有いたします。外貨建資産について、原則として対円で為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図ります。

運用にあたっては、計量分析とファンダメンタル分析による徹底したリサーチを行い、ESG*評価が一定基準を満たす銘柄群の中から、将来の信用力分析やリスク特性等を考慮して魅力的と判断される銘柄を選定して投資しました。

その結果、セクター配分については、銀行セクターや循環消費財セクターの組入比率が上昇した一方、資本財セクターの組入比率は低下しました。

*ESGとは、Environment (環境)、Social (社会)、Governance (ガバナンス)の頭文字をとったものです。ESG評価の高い企業は、事業環境等への対応能力やリスク管理に優れ、長期的に事業を継続できることが期待できると考えられます。

< 公社債のセクター別組入比率 >

前期末 (2022年9月26日現在)

セクター	比率
銀行	37.7%
循環消費財	14.2%
資本財	13.5%
運輸	7.1%
天然ガス	6.0%
その他	20.9%
現金等	0.5%



当期末 (2023年9月25日現在)

セクター	比率
銀行	39.0%
循環消費財	15.0%
資本財	10.0%
天然ガス	7.8%
電力	6.9%
その他	20.9%
現金等	0.5%

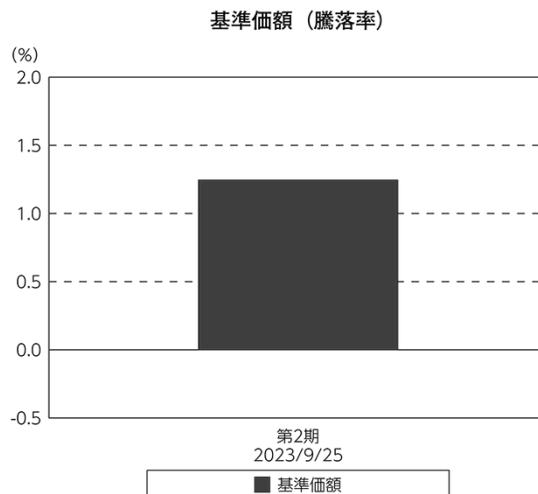
(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 小数第2位を四捨五入。

当ファンドのベンチマークとの差異

（2022年9月27日～2023年9月25日）

当ファンドは、特定の指数を上回ることを目指す運用を行っていないため、ベンチマークおよび参考指数を設けておりません。



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金

（2022年9月27日～2023年9月25日）

当期の収益分配については、信託財産の成長を目指す観点から見送ることとしました。なお、収益分配に充てなかった利益については、信託財産内に留保し「運用の基本方針」に基づいて運用を行います。

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項 目	第2期
	2022年9月27日～ 2023年9月25日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	687

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の当期末基準価額（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」は小数以下切り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。

（注）上記表は、経費控除後の数値です。分配金の計算過程については、「損益の状況」の注記をご覧ください。

今後の運用方針

グローバル社債市場は、経済の減速に伴い今後緩やかに信用力の悪化が進むとみられるものの、発行体全般のファンダメンタルズは健全な状態が保たれていることから、信用力の顕著な悪化には至らないとみています。為替ヘッジコストについては高止まりする可能性があります。当ファンドでは、今後も各企業の財務面のみならず、ESGへの取り組みが一層重要視され、持続可能な成長にコミットすることが求められると考えており、こうした取り組みに積極的な企業を選別し、発行体の信用リスクに十分に配慮しながら魅力的な銘柄に投資することで、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行う方針です。

※将来の市場環境の変動等により、当該運用方針が変更される場合があります。

<ご参考> 代表的な組入銘柄解説・ESGの取組みについて

アライアンス・バーンスタイン・グローバルESG・社債ファンド2021-09（限定追加型）において投資している代表的な組入銘柄について、アライアンス・バーンスタイン*が、ESGが企業の信用力向上に資すると判断した根拠をご説明いたします。なお、以下は入手可能な直近のデータを掲載しております。
*アライアンス・バーンスタイン（AB）には、アライアンス・バーンスタイン・エル・ピーとその傘下の関連会社を含みます。

基準日：2023年8月31日

ホスト・ホテル・アンド・リゾート

【ESGが企業の信用力向上に資すると判断した根拠】

米国のホテル・リート。再生可能エネルギーやスマートビルディングに投資し、同業他社を上回る比率のグリーン認証を受ける。炭素排出削減や水資源配慮など物件リスク低減に積極的。

BNPパリバ

【ESGが企業の信用力向上に資すると判断した根拠】

フランスに本社を置く大手銀行。取締役会メンバーにおける独立社外取締役および女性比率が同業他社よりも高く、透明性の高いガバナンス構造による経営の安定性向上に努めている。

トラベル・アンド・レジャー

【ESGが企業の信用力向上に資すると判断した根拠】

米国の旅行関連会社。炭素排出量や水資源利用への野心的な削減目標を掲げていることや、顧客情報保護にも積極的に取り組み事業リスクの低減を図っている。

エンゲージメントについて

アライアンス・バーンスタインの債券運用プラットフォームのポートフォリオ・マネジャーとアナリストは、炭素排出量、サステナブル・ファイナンス、ダイバーシティ・エクイティ・インクルージョン（DEI）など、環境・社会・ガバナンス（ESG）に関する幅広いトピックについて、債券発行体の経営陣や取締役会メンバーに対しエンゲージメントを行いました。

過去のエンゲージメントについて、当社ホームページ（以下のURLの「月報・各種資料」）に『ESGエンゲージメント・レポート／アライアンス・バーンスタイン 債券部門におけるエンゲージメント活動』を掲載していますので、ご参照ください。

<https://www.alliancebernstein.co.jp/retail/5242.html>

また、右の2次元コードをスマートフォン等のカメラで読み込むことで、直接ご覧いただけます。



○ 1万口当たりの費用明細

(2022年9月27日～2023年9月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	84	0.965	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(43)	(0.494)	委託した資金の運用、基準価額の算出等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(38)	(0.439)	購入後の情報提供、交付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の対価
（ 受 託 会 社 ）	(3)	(0.033)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	2	0.021	(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 ）	(1)	(0.006)	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および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ そ の 他 ）	(2)	(0.016)	その他は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受益権の管理事務に係る費用、計理業務関係費用、印刷業者等に支払う法定書類の作成・印刷・交付および届出に係る費用等
合 計	86	0.986	
期中の平均基準価額は、8,659円です。			

(注) 期中の費用(消費税等の課されるものは消費税等相当額を含めて表示)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。

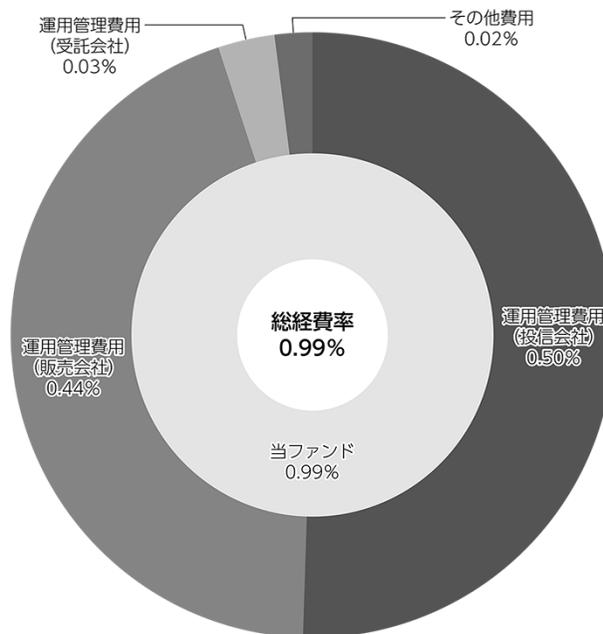
(注) 各金額は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。ただし、平均基準価額は円未満切り捨て。

(注) 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)を期中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。

（参考情報）

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（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除く。）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0.99%です。



(注) 当ファンドの費用は1万円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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 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は異なります。

○売買及び取引の状況

(2022年9月27日～2023年9月25日)

公社債

			買付額	売付額
外国	アメリカ	社債券	千米ドル —	千米ドル 16,340 (2,878)

(注) 金額は受け渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 単位未満は切り捨て。

(注) —印は該当なし。

○利害関係人との取引状況等

(2022年9月27日～2023年9月25日)

該当事項はございません。

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

(2023年9月25日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区分	当			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 56,229	千米ドル 51,754	千円 7,685,604	% 80.9	% 23.7	% —	% 74.3	% 6.6	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ							
ドイツ	2,700	2,096	331,681	3.5	3.5	—	3.5	—	
その他	4,960	4,581	724,994	7.6	7.6	—	7.6	—	
イギリス	千英ポンド 4,430	千英ポンド 3,892	707,899	7.5	4.8	—	6.6	0.8	
合計	—	—	9,450,180	99.5	39.6	—	92.1	7.4	

(注) 邦貨換算金額は、当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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(注) —印は該当なし。

(注) 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。

(注) 格付はムーディーズとS&Pのうちいずれか高い方を採用して集計したものです。

アライアンス・バーンスタイン・グローバルESG・社債ファンド2021-09（限定追加型）

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘	柄	当 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		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	普通社債券						
	ABN AMRO BANK NV	4.8	3,200	3,069	455,864	2026/4/18	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	4.375	3,425	3,208	476,508	2024/9/8	
	ADANI TRANSMISSION LTD	4.0	2,520	2,193	325,668	2026/8/3	
	AIR CANADA	3.875	1,405	1,287	191,212	2026/8/15	
	AIRCASTLE LTD	4.25	1,620	1,534	227,822	2026/6/15	
	ANZ BANKING GROUP	4.4	425	405	60,163	2026/5/19	
	BANCO SANTANDER SA	5.179	400	389	57,895	2025/11/19	
	BARCLAYS PLC	5.2	3,325	3,211	476,875	2026/5/12	
	BNP PARIBAS	4.375	3,250	3,105	461,215	2026/5/12	
	BOEING CO	2.25	682	621	92,278	2026/6/15	
	BPCE SA	4.875	3,365	3,228	479,434	2026/4/1	
	CHINA OIL & GAS GROUP	4.7	3,210	2,625	389,813	2026/6/30	
	DISCOVER BANK	3.45	440	399	59,344	2026/7/27	
	GLP PTE LTD	3.875	1,466	1,000	148,504	2025/6/4	
	HAWAIIAN BRAND INTELLECT	5.75	2,361	2,166	321,753	2026/1/20	
	HCA INC	5.25	415	406	60,401	2026/6/15	
	HOST HOTELS & RESORTS LP	4.5	3,317	3,180	472,241	2026/2/1	
	HSBC HOLDINGS PLC	3.9	430	406	60,425	2026/5/25	
	INDIA CLEANTECH ENERGY	4.7	2,554	2,206	327,706	2026/8/10	
	INTESA SANPAOLO SPA	5.71	273	260	38,739	2026/1/15	
	KEYSPAN GAS EAST CORP	2.742	2,566	2,339	347,449	2026/8/15	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	4.65	425	407	60,480	2026/3/24	
	MIZUHO FINANCIAL GROUP	4.353	430	411	61,134	2025/10/20	
	NATIONWIDE BLDG SOCIETY	4.0	1,627	1,512	224,592	2026/9/14	
	NISSAN MOTOR ACCEPTANCE	1.85	1,560	1,354	201,196	2026/9/16	
	OMEGA HLTHCARE INVESTORS	5.25	420	409	60,827	2026/1/15	
	PRIME SECSRVC BRW/FINANC	5.75	695	673	99,997	2026/4/15	
	SOCIETE GENERALE	4.25	3,335	3,118	463,061	2026/8/19	
	SYNCHRONY FINANCIAL	3.7	440	398	59,228	2026/8/4	
	UNICREDIT SPA	2.569	3,388	3,100	460,473	2026/9/22	
	VORNADO REALTY LP	2.15	470	400	59,431	2026/6/1	
	WYNDHAM DESTINATIONS INC	6.625	2,790	2,719	403,857	2026/7/31	
小	計				7,685,604		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	普通社債券	ADLER REAL ESTATE AG	3.0	2,700	2,096	331,681	2026/4/27
その他	普通社債券	ADLER GROUP SA	4.625	500	214	33,889	2026/1/14
		CARNIVAL CORP	7.625	2,520	2,504	396,239	2026/3/1
		JAGUAR LAND ROVER AUTOMO	4.5	1,940	1,863	294,865	2026/1/15
小	計				1,056,676		
イギリス			千英ポンド	千英ポンド			
	普通社債券	COMMERZBANK AG	1.75	300	282	51,342	2025/1/22
		CPUK FINANCE LTD	3.588	165	156	28,392	2025/8/28
		ROLLS-ROYCE PLC	3.375	2,300	2,098	381,628	2026/6/18

アライアンス・バーンスタイン・グローバルESG・社債ファンド2021-09（限定追加型）

銘	柄	当 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	
イギリス		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
	普通社債券					
	THAMES WATER KEMBLE FINA	4.625	670	420	76,467	2026/5/19
	VIRGIN MONEY UK PLC	3.375	995	935	170,069	2026/4/24
	小 計				707,899	
	合 計				9,450,180	

(注) 邦貨換算金額は、当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) 単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年9月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 9,450,180	% 95.2
コール・ローン等、その他	477,724	4.8
投資信託財産総額	9,927,904	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注) 当期末における外貨建純資産(9,616,851千円)の投資信託財産総額(9,927,904千円)に対する比率は96.9%です。

(注) 外貨建資産は、当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、邦貨換算に使用した為替レートは、1米ドル=148.50円、1ユーロ=158.23円、1英ポンド=181.84円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年9月25日現在）

項目	当期末	円
(A) 資産	21,529,636,331	
コール・ローン等	319,616,491	
公社債(評価額)	9,450,180,401	
未収入金	11,653,163,271	
未収利息	106,676,168	
(B) 負債	12,030,761,802	
未払金	11,964,691,495	
未払解約金	16,293,277	
未払信託報酬	48,980,006	
未払利息	739	
その他未払費用	796,285	
(C) 純資産総額(A-B)	9,498,874,529	
元本	10,920,935,890	
次期繰越損益金	△ 1,422,061,361	
(D) 受益権総口数	10,920,935,890口	
1万口当たり基準価額(C/D)	8,698円	

- (注) 期首元本額13,301,846,099円、期中追加設定元本額0円、期中一部解約元本額2,380,910,209円。当期末現在における1口当たり純資産額0.8698円。
- (注) 当期末現在において純資産総額が元本を下回っており、その差額は△1,422,061,361円です。

○損益の状況（2022年9月27日～2023年9月25日）

項目	当期	円
(A) 配当等収益	461,926,938	
受取利息	451,165,177	
その他収益金	10,855,669	
支払利息	△ 93,908	
(B) 有価証券売買損益	△ 242,774,208	
売買益	1,685,698,887	
売買損	△1,928,473,095	
(C) 信託報酬等	△ 105,000,050	
(D) 当期損益金(A+B+C)	114,152,680	
(E) 前期繰越損益金	△1,527,509,241	
(F) 追加信託差損益金	△ 8,704,800	
(配当等相当額)	(772,286)	
(売買損益相当額)	(△ 9,477,086)	
(G) 計(D+E+F)	△1,422,061,361	
(H) 収益分配金	0	
次期繰越損益金(G+H)	△1,422,061,361	
追加信託差損益金	△ 8,704,800	
(配当等相当額)	(772,286)	
(売買損益相当額)	(△ 9,477,086)	
分配準備積立金	750,554,470	
繰越損益金	△2,163,911,031	

- (注) 損益の状況の中で(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) 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およびその他費用等を含めて表示しています。
- (注) 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) 第2期計算期間末における費用控除後の配当等収益額(356,926,888円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額(0円)、収益調整金額(772,286円)および分配準備積立金額(393,627,582円)より分配対象収益額は751,326,756円(10,000口当たり687円)ですが、当期に分配した金額はありません。

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----