

ノムラ・ボンド・インカム・オープン

運用報告書(全体版)

第100期 (決算日2023年6月21日) 第101期 (決算日2023年9月21日)

作成対象期間 (2023年3月23日～2023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2026年3月23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せん。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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 (分配落)	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		税金	騰落率	騰落率	騰落率			
	円	円	%	FTSE世界国債 インデックス(1-3年) 為替100%ヘッジ	%	%	%	百万円
92期(2021年6月21日)	8,033	10	△0.3	116.26	△0.1	81.3	—	4,063
93期(2021年9月21日)	7,991	10	△0.4	116.35	0.1	89.6	—	3,938
94期(2021年12月21日)	7,937	10	△0.6	115.82	△0.5	75.6	—	3,837
95期(2022年3月22日)	7,868	10	△0.7	113.87	△1.7	77.8	—	3,763
96期(2022年6月21日)	7,749	10	△1.4	112.06	△1.6	79.8	—	3,661
97期(2022年9月21日)	7,706	10	△0.4	110.95	△1.0	90.7	—	3,605
98期(2022年12月21日)	7,699	10	0.0	110.33	△0.6	77.2	—	3,578
99期(2023年3月22日)	7,682	10	△0.1	110.20	△0.1	82.6	—	3,547
100期(2023年6月21日)	7,647	10	△0.3	108.98	△1.1	87.1	—	3,485
101期(2023年9月21日)	7,497	10	△1.8	108.06	△0.8	85.6	—	3,391

* 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。

* FTSE世界国債インデックス（1-3年）は、FTSE Fixed Income 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、FTSE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。

* FTSE世界国債インデックス（1-3年）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスパンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(出所) FTSE Fixed Income LLC

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

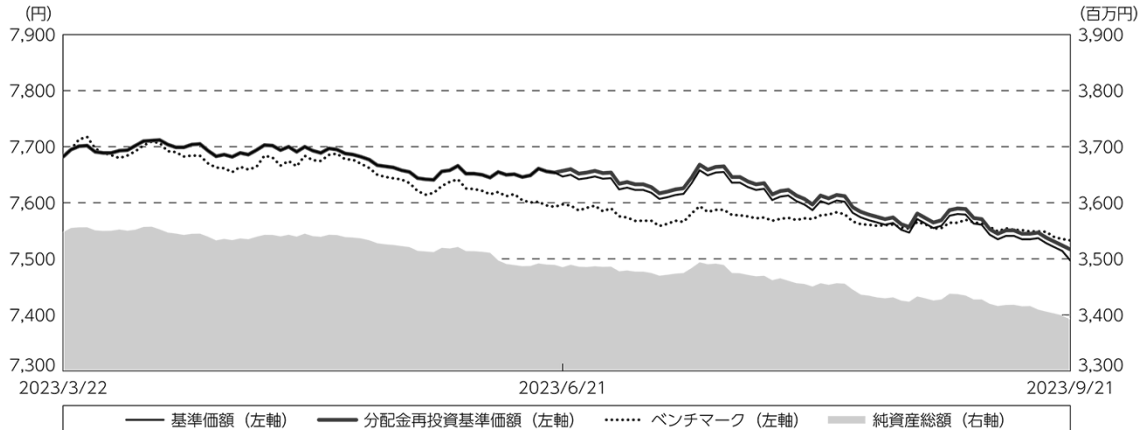
決算期	年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
第100期	(期首) 2023年3月22日	円	%	FTSE世界国債 インデックス(1-3年) 為替100%ヘッジ	%	%	%
	3月末	7,693	0.1	110.17	△0.0	85.0	—
	4月末	7,694	0.2	109.98	△0.2	85.5	—
	5月末	7,656	△0.3	109.45	△0.7	96.7	—
	(期末) 2023年6月21日	7,657	△0.3	108.98	△1.1	87.1	—
第101期	(期首) 2023年6月21日	7,647	—	108.98	—	87.1	—
	6月末	7,624	△0.3	108.68	△0.3	87.5	—
	7月末	7,611	△0.5	108.61	△0.3	89.7	—
	8月末	7,580	△0.9	108.51	△0.4	84.9	—
	(期末) 2023年9月21日	7,507	△1.8	108.06	△0.8	85.6	—

* 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100期首：7,682円

第101期末：7,497円 (既払分配金(税込み)：20円)

騰落率：△2.2% (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。作成期首(2023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、個々の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、FTSE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(2023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7,682円から当作成期末には7,497円(分配後)となりました。なお、第100期に10円、第101期に10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165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

債券市場<債券利回りは米・独・日で上昇>

米国では、債券利回りは上昇（価格は下落）しました。米国景気の底堅さが各種の経済指標から確認されたことやFRB（米連邦準備制度理事会）がインフレ沈静化に向けて利上げを継続したことなどが債券利回りの上昇要因となりました。

ユーロ圏では、債券利回りは上昇しました。インフレ率が高水準で推移する中で、ECB（欧州中央銀行）が継続的な利上げを行なったことなどを背景に、独債券利回りは上昇しました。

日本では、債券利回りは上昇しました。2023年7月の金融政策決定会合で日銀が10年金利の変動幅を拡大したことで、日銀の引き締め方向への金融政策調整の可能性が市場で意識され、債券利回りが上昇しました。

為替市場<円に対して米ドル・ユーロは上昇>

米国景気の底堅さが各種の経済指標から確認されたことやFRBがインフレ沈静化に向けて利上げを継続したことで米ドルが幅広い通貨に対して上昇する中、米ドルは円に対して上昇（円安）しました。またECBによる金融引き締め観測の高まりもユーロの上昇圧力として働き、ユーロは円に対して上昇しました。

○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、当作成期首から長期化しました。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長期化としました。

（※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）。

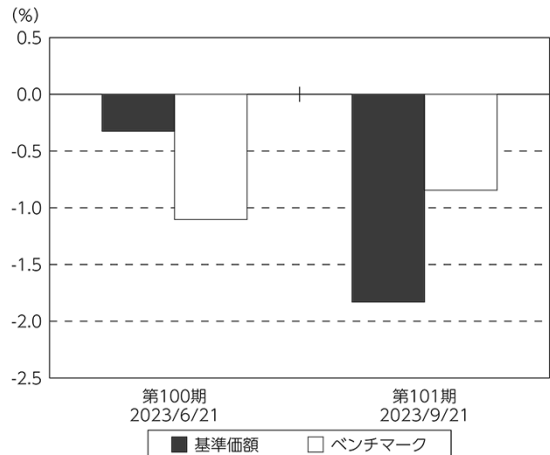
○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額（分配金再投資）の騰落率は-2.15%となり、ベンチマークの-1.94%を0.21ポイント下回りました。

（主なマイナス要因）

世界的に債券利回りが上昇する局面で、デュレーションをベンチマークに比べ長期化としていたこと。

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、FTSE世界国債インデックス（1-3年）を替100%ヘッジです。

○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100期10円、第101期10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100期	第101期
	2023年3月23日～ 2023年6月21日	2023年6月22日～ 2023年9月21日
当期分配金	10	10
（対基準価額比率）	0.131%	0.133%
当期の収益	8	10
当期の収益以外	1	—
翌期繰越分配対象額	2,158	2,164

（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ない、好収益が期待できる債券や為替市場への投資を行ないます。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、景気減速懸念の強まりやFRBの金融緩和への転換に対する市場の期待などから、債券利回りは低下（価格は上昇）しやすいと予想します。欧州では、ECBが利上げを停止し景気減速が市場で意識されることで、債券利回りは低下しやすいと予想します。日本では、日銀の緩和的な金融政策からの転換期待を背景に、長期債を中心として債券利回りは上昇しやすいと予想します。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長期化とする方針です。また、通貨配分については、ヘッジ比率の調整により米ドルをアンダーウェイト（ベンチマークに比べ低めの投資比率）、欧州通貨をオーバーウェイト（ベンチマークに比べ高めの投資比率）とします。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年3月23日～2023年9月21日)

項 目	第100期～第101期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 28	% 0.368	(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)	(13)	(0.176)	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)	(13)	(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)	(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	1	0.009	(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
合 計	29	0.377	
作成期間の平均基準価額は、7,643円です。			

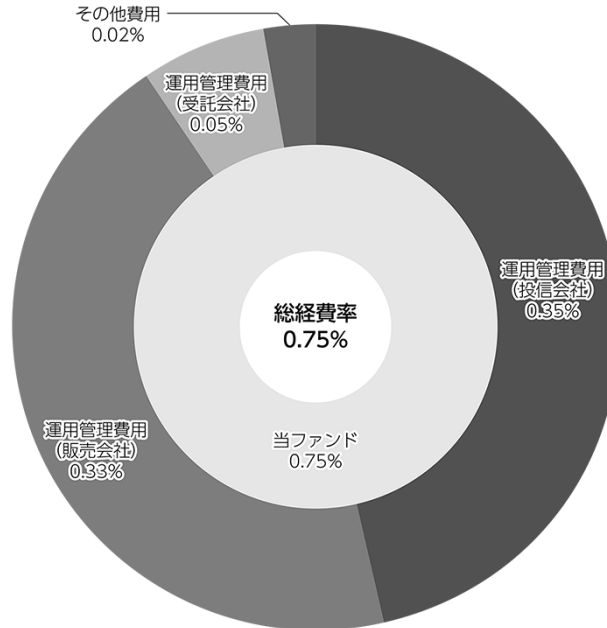
* 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 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。

(参考情報)**○総経費率**

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成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0.75%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口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) 当ファンドのその他費用には、外貨建資産の保管等に要する費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。

(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

(2023年3月23日～2023年9月21日)

公社債

			第100期～第101期		
			買付額	売付額	
国内	国債証券		千円	千円	
			1,200,872	2,201,887	
外国	アメリカ	国債証券	千米ドル 17,427	千米ドル 13,543	
	カナダ	国債証券	千カナダドル —	千カナダドル — (730)	
	イギリス	国債証券	千英ポンド 367	千英ポンド —	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ —	千スウェーデンクローナ 2,677	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 5,012	千ノルウェークローネ 2,680	
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ	
		ドイツ	国債証券	1,741	1,737
		フランス	国債証券	383	381
		スペイン	国債証券	1,701	528
		マレーシア	国債証券	千リンギ 532	千リンギ —
		中国	国債証券	千人民元 2,405	千人民元 —
		オーストラリア	国債証券	千豪ドル 464	千豪ドル 940
		ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランドドル 920	千ニュージーランドドル —
		メキシコ	国債証券	千メキシコペソ —	千メキシコペソ 3,648

*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。

○利害関係人との取引状況等

(2023年3月23日～2023年9月21日)

利害関係人との取引状況

区 分	第100期～第101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	%
為替直物取引	1,422	16	1.1	725	—	—

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

(2023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101期末							
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率			
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満	%
国債証券	400,000	400,529	11.8	—	—	—	—	11.8
合 計	400,000	400,529	11.8	—	—	—	—	11.8

*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	第101期末				
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千円	千円		
国債証券					
国庫債券 利付(2年)第430回	0.005	100,000	100,017	2023/11/1	
国庫債券 利付(10年)第332回	0.6	300,000	300,512	2023/12/20	
合 計		400,000	400,529		

*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101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 11,600	千米ドル 10,508	千円 1,559,826	% 46.0	% —	% 6.9	% 14.2	% 24.9
イギリス	千英ポンド 400	千英ポンド 374	68,391	2.0	—	—	—	2.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 2,500	千ノルウェークローネ 2,332	32,019	0.9	—	0.9	—	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
スペイン	2,940	2,729	430,577	12.7	—	2.3	6.8	3.6
マレーシア	千リンギ 530	千リンギ 529	16,725	0.5	—	—	0.5	—
中国	千人民元 8,400	千人民元 8,453	172,199	5.1	—	1.4	3.6	—
オーストラリア	千豪ドル 280	千豪ドル 277	26,473	0.8	—	—	—	0.8
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 1,000	千ニュージーランドドル 916	80,451	2.4	—	1.4	—	1.0
メキシコ	千メキシコペソ 15,000	千メキシコペソ 13,399	116,184	3.4	—	3.4	—	—
合 計	—	—	2,502,848	73.8	—	16.4	25.1	32.3

* 邦貨換算金額は、第101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101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		2.125	700	676	100,452	2024/9/30
	US TREASURY N/B		4.75	1,200	1,190	176,717	2025/7/31
	US TREASURY N/B		0.25	4,200	3,822	567,421	2025/8/31
	US TREASURY N/B		2.25	2,100	1,980	293,901	2025/11/15
	US TREASURY N/B		4.0	1,300	1,268	188,210	2028/6/30
	US TREASURY N/B		3.375	1,000	922	136,868	2033/5/15
	US TREASURY N/B		1.875	1,100	648	96,254	2051/11/15
小計						1,559,826	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
国債証券	UK TREASURY		0.625	400	374	68,391	2025/6/7
小計						68,391	
ノルウェー				千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ		
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT		3.0	2,500	2,332	32,019	2033/8/15
小計						32,019	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	100	97	15,372	2024/5/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO		—	700	666	105,201	2025/1/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO		2.15	1,500	1,460	230,476	2025/10/31
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO		0.7	640	504	79,526	2032/4/30
小計						430,577	
マレーシア				千リンギ	千リンギ		
国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT		3.733	530	529	16,725	2028/6/15
小計						16,725	
中国				千人民元	千人民元		
国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND		2.69	6,000	6,057	123,381	2026/8/12
	CHINA GOVERNMENT BOND		2.67	2,400	2,396	48,818	2033/5/25
小計						172,199	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.75	280	277	26,473	2024/4/21
小計						26,473	
ニュージーランド				千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル		
国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT		0.5	400	387	33,983	2024/5/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT		3.5	600	529	46,467	2033/4/14
小計						80,451	
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		7.75	15,000	13,399	116,184	2031/5/29
小計						116,184	
合計						2,502,848	

* 邦貨換算金額は、第101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

(2023年9月21日現在)

項 目	第101期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	2,903,377	83.9
コール・ローン等、その他	558,663	16.1
投資信託財産総額	3,462,040	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*第101期末における外貨建純資産(2,590,315千円)の投資信託財産総額(3,462,040千円)に対する比率は74.8%です。

*外貨建資産は、第101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=148.43円、1カナダドル=110.08円、1英ポンド=182.78円、1スウェーデンクローナ=13.28円、1ノルウェークローネ=13.73円、1デンマーククローネ=21.17円、1ユーロ=157.77円、1ズロチ=34.2133円、1シンガポールドル=108.55円、1リンギ=31.6147円、1人民元=20.3699円、1豪ドル=95.35円、1ニュージーランドドル=87.81円、1メキシコペソ=8.6706円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第100期末	第101期末
	2023年6月21日現在	2023年9月21日現在
	円	円
(A) 資産	5,478,708,330	6,031,514,235
コール・ローン等	462,212,248	536,908,377
公社債(評価額)	3,036,834,743	2,903,377,471
未収入金	1,971,603,474	2,570,962,934
未収利息	5,816,705	9,887,429
前払費用	2,241,160	10,049,467
その他未収収益	—	328,557
(B) 負債	1,993,587,157	2,639,548,598
未払金	1,981,269,665	2,627,704,780
未払収益分配金	4,557,708	4,524,350
未払解約金	1,250,553	885,672
未払信託報酬	6,489,129	6,413,908
未払利息	760	768
その他未払費用	19,342	19,120
(C) 純資産総額(A-B)	3,485,121,173	3,391,965,637
元本	4,557,708,236	4,524,350,666
次期繰越損益金	△1,072,587,063	△1,132,385,029
(D) 受益権総口数	4,557,708,236口	4,524,350,666口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,647円	7,497円

(注) 第100期首元本額は4,617,887,442円、第100～101期中追加設定元本額は65,764,301円、第100～101期中一部解約元本額は159,301,077円、1口当たり純資産額は、第100期0.7647円、第101期0.7497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523,952円。

○損益の状況

項 目	第100期	第101期
	2023年3月23日～ 2023年6月21日	2023年6月22日～ 2023年9月21日
	円	円
(A) 配当等収益	10,446,992	13,461,232
受取利息	10,234,646	13,206,523
その他収益金	241,109	308,758
支払利息	△ 28,763	△ 54,049
(B) 有価証券売買損益	△ 15,415,030	△ 69,929,861
売買益	146,150,169	142,788,846
売買損	△ 161,565,199	△ 212,718,707
(C) 信託報酬等	△ 6,662,181	△ 6,561,093
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 11,630,219	△ 63,029,722
(E) 前期繰越損益金	△ 481,714,055	△ 490,598,190
(F) 追加信託差損益金	△ 574,685,081	△ 574,232,767
(配当等相当額)	(792,857,452)	(788,460,220)
(売買損益相当額)	(△1,367,542,533)	(△1,362,692,987)
(G) 計(D+E+F)	△1,068,029,355	△1,127,860,679
(H) 収益分配金	△ 4,557,708	△ 4,524,350
次期繰越損益金(G+H)	△1,072,587,063	△1,132,385,029
追加信託差損益金	△ 574,685,081	△ 574,232,767
(配当等相当額)	(792,857,452)	(788,460,220)
(売買損益相当額)	(△1,367,542,533)	(△1,362,692,987)
分配準備積立金	191,011,267	190,647,873
繰越損益金	△ 688,913,249	△ 748,800,135

* 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(2023年3月23日～2023年9月21日)は以下の通りです。

項 目	第100期	第101期
	2023年3月23日～ 2023年6月21日	2023年6月22日～ 2023年9月21日
a. 配当等収益(経費控除後)	3,784,811円	6,900,139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	792,857,452円	788,460,220円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	191,784,164円	188,272,084円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	988,426,427円	983,632,443円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,168円	2,174円
g. 分配金	4,557,708円	4,524,350円
h. 分配金(1万口当たり)	10円	10円

○分配金のお知らせ

	第100期	第101期
1 万口当たり分配金 (税込み)	10円	10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。