

損保ジャパン 欧州国債オープン （毎月分配型）

〈愛称〉 ヨーロッパ便り

■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／海外／債券 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 運用方針 | <p>①ユーロ参加国を中心に欧州各国の信用度の高い国債を主要投資対象として、アクティブに運用します。</p> <p>インカムゲインを重視するとともに、割安と考えられる国債の投資比率を上げることで、中長期的なトータルリターンの向上を目指します。運用にあたっては、F T S E 欧州世界国債インデックスの国別配分を参考とします。</p> <p>②原則として、取得時においてBBB-（スタンダード・アンド・プアーズ社）またはBaa3（ムーディーズ・インベスターズ・サービス社）以上の格付を得ている信用度の高い銘柄を投資対象とします。国債への投資割合は原則として高位とします。</p> <p>③外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>④毎月決算を行い、組入れ債券の利子収入等を中心に、安定的な分配を行います。</p> |
| 主要投資対象 | 欧州各国の国債 |
| 主な組入制限 | 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 |
| 分配方針 | <p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>①分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子、配当収入と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>②収益分配金額は、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。原則として、利子、配当収入等を中心に安定分配を行います。ただし、基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないことがあります。</p> |

第211期（決算日 2022年7月1日）
 第212期（決算日 2022年8月1日）
 第213期（決算日 2022年9月1日）
 第214期（決算日 2022年10月3日）
 第215期（決算日 2022年11月1日）
 第216期（決算日 2022年12月1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。さて、「損保ジャパン欧州国債オープン（毎月分配型）」は、このたび第216期の決算を行いましたので、第211期～第216期中の運用状況をご報告申し上げます。今後とも引き続きお引立て賜りますようお願い申し上げます。



SOMPOアセットマネジメント

東京都中央区日本橋二丁目2番16号 共立日本橋ビル



<https://www.sompo-am.co.jp/>

お問い合わせ先



リテール営業部 0120-69-5432
 （受付時間 営業日の午前9時～午後5時）

○最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準 (分配落) | 準 価 額 | | | 債 組 | 入 比 | 券 率 | 純 資 産 総 額 | |
|------------------|-------------|-------|-----|------------|--------|-----|--------|--------------|-----|
| | | 税 分 | 込 配 | み 期 金 騰 | | | | | 落 率 |
| | 円 | | | 円 | | | % | 百万円 | |
| 187期(2020年7月1日) | 5,496 | | | 20 | | | 2.1 | 93.3 | 613 |
| 188期(2020年8月3日) | 5,664 | | | 20 | | | 3.4 | 94.1 | 627 |
| 189期(2020年9月1日) | 5,706 | | | 20 | | | 1.1 | 95.9 | 621 |
| 190期(2020年10月1日) | 5,599 | | | 20 | | | △1.5 | 93.4 | 599 |
| 191期(2020年11月2日) | 5,527 | | | 20 | | | △0.9 | 95.3 | 580 |
| 192期(2020年12月1日) | 5,656 | | | 20 | | | 2.7 | 94.6 | 583 |
| 193期(2021年1月4日) | 5,713 | | | 20 | | | 1.4 | 95.8 | 582 |
| 194期(2021年2月1日) | 5,705 | | | 20 | | | 0.2 | 95.8 | 582 |
| 195期(2021年3月1日) | 5,714 | | | 20 | | | 0.5 | 97.1 | 575 |
| 196期(2021年4月1日) | 5,758 | | | 20 | | | 1.1 | 94.1 | 576 |
| 197期(2021年5月6日) | 5,756 | | | 20 | | | 0.3 | 95.3 | 568 |
| 198期(2021年6月1日) | 5,846 | | | 20 | | | 1.9 | 95.6 | 576 |
| 199期(2021年7月1日) | 5,745 | | | 20 | | | △1.4 | 96.3 | 562 |
| 200期(2021年8月2日) | 5,708 | | | 20 | | | △0.3 | 97.4 | 552 |
| 201期(2021年9月1日) | 5,664 | | | 20 | | | △0.4 | 95.6 | 544 |
| 202期(2021年10月1日) | 5,551 | | | 20 | | | △1.6 | 94.2 | 523 |
| 203期(2021年11月1日) | 5,575 | | | 20 | | | 0.8 | 94.9 | 522 |
| 204期(2021年12月1日) | 5,471 | | | 20 | | | △1.5 | 97.2 | 501 |
| 205期(2022年1月4日) | 5,483 | | | 20 | | | 0.6 | 92.3 | 500 |
| 206期(2022年2月1日) | 5,370 | | | 20 | | | △1.7 | 93.6 | 483 |
| 207期(2022年3月1日) | 5,262 | | | 20 | | | △1.6 | 94.3 | 470 |
| 208期(2022年4月1日) | 5,379 | | | 20 | | | 2.6 | 94.9 | 478 |
| 209期(2022年5月2日) | 5,277 | | | 20 | | | △1.5 | 93.5 | 458 |
| 210期(2022年6月1日) | 5,241 | | | 20 | | | △0.3 | 94.7 | 449 |
| 211期(2022年7月1日) | 5,310 | | | 20 | | | 1.7 | 95.7 | 450 |
| 212期(2022年8月1日) | 5,173 | | | 20 | | | △2.2 | 95.5 | 440 |
| 213期(2022年9月1日) | 5,092 | | | 20 | | | △1.2 | 96.1 | 431 |
| 214期(2022年10月3日) | 4,977 | | | 20 | | | △1.9 | 91.4 | 418 |
| 215期(2022年11月1日) | 5,165 | | | 20 | | | 4.2 | 95.3 | 417 |
| 216期(2022年12月1日) | 5,069 | | | 20 | | | △1.5 | 91.6 | 404 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 基準価額及び分配金は1万円当たり（以下同じ）。

(注3) 当ファンドは、ユーロ参加国を中心に欧州各国の信用度の高い国債を主要投資対象として、アクティブに運用するファンドです。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数は記載しておりません。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

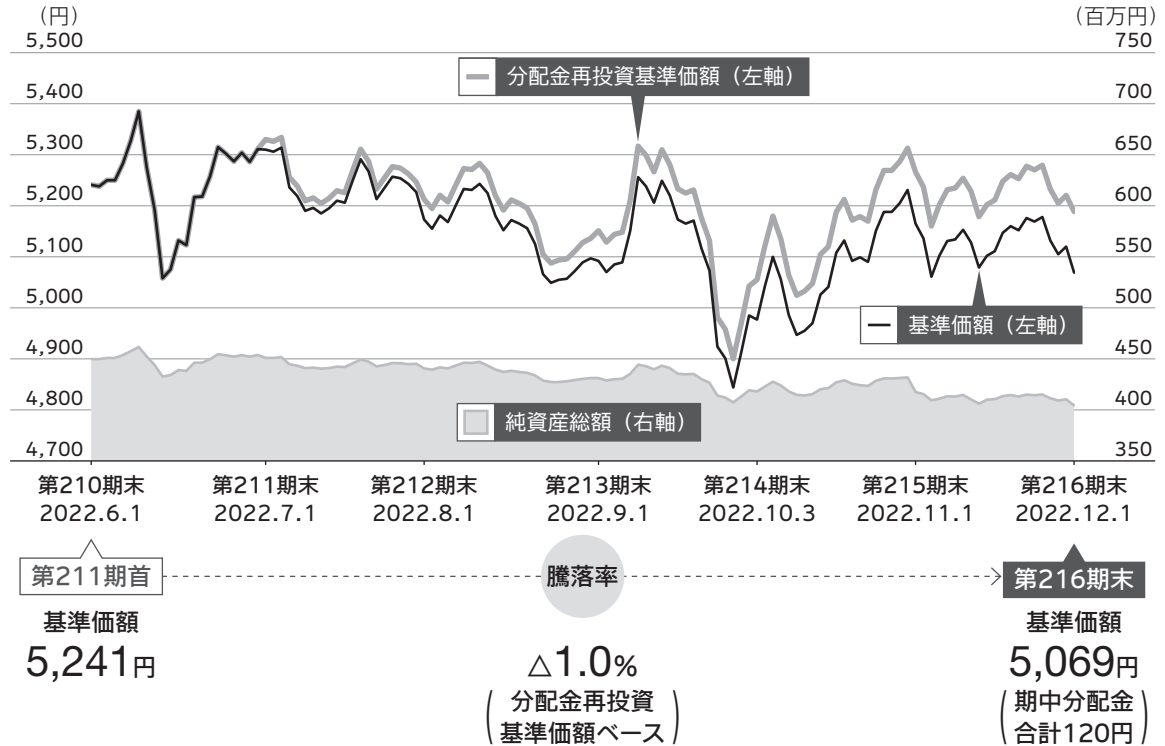
| 決算期 | 年 月 日 | 基 準 | 価 額 | | 債 組 入 比 | 券 率 |
|-------|------------|-------|-----|------|---------|------|
| | | | 騰 落 | 率 | | |
| 第211期 | (期 首) | 円 | | % | | % |
| | 2022年6月1日 | 5,241 | | — | | 94.7 |
| | 6月末 | 5,311 | | 1.3 | | 94.8 |
| 第212期 | (期 末) | | | | | |
| | 2022年7月1日 | 5,330 | | 1.7 | | 95.7 |
| | (期 首) | | | | | |
| 第212期 | 2022年7月1日 | 5,310 | | — | | 95.7 |
| | 7月末 | 5,227 | | △1.6 | | 95.2 |
| | (期 末) | | | | | |
| 第213期 | 2022年8月1日 | 5,193 | | △2.2 | | 95.5 |
| | (期 首) | | | | | |
| | 2022年8月1日 | 5,173 | | — | | 95.5 |
| 第214期 | 8月末 | 5,097 | | △1.5 | | 95.8 |
| | (期 末) | | | | | |
| | 2022年9月1日 | 5,112 | | △1.2 | | 96.1 |
| 第214期 | (期 首) | | | | | |
| | 2022年9月1日 | 5,092 | | — | | 96.1 |
| | 9月末 | 4,985 | | △2.1 | | 90.9 |
| 第215期 | (期 末) | | | | | |
| | 2022年10月3日 | 4,997 | | △1.9 | | 91.4 |
| | (期 首) | | | | | |
| 第215期 | 2022年10月3日 | 4,977 | | — | | 91.4 |
| | 10月末 | 5,231 | | 5.1 | | 93.0 |
| | (期 末) | | | | | |
| 第216期 | 2022年11月1日 | 5,185 | | 4.2 | | 95.3 |
| | (期 首) | | | | | |
| | 2022年11月1日 | 5,165 | | — | | 95.3 |
| 第216期 | 11月末 | 5,120 | | △0.9 | | 90.9 |
| | (期 末) | | | | | |
| | 2022年12月1日 | 5,089 | | △1.5 | | 91.6 |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注2) 当ファンドは、ユーロ参加国を中心に欧州各国の信用度の高い国債を主要投資対象として、アクティブに運用するファンドです。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数は記載しておりません。

運用経過

● 基準価額の推移



- 分配金再投資基準価額の推移は、2022年6月1日の基準価額をもとに委託会社にて指数化したものを使用しております。
- 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税引前）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。
- 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- 当ファンドは、ユーロ参加国を中心に欧州各国の信用度の高い国債を主要投資対象として、アクティブに運用するファンドです。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数は記載しておりません。

● 基準価額の主な変動要因

ユーロやポンドが円に対して上昇したため、為替要因はプラスとなりましたが、欧州債券の利回りが上昇（価格は下落）したことによる債券要因のマイナスが大きかったことから、分配金再投資基準価額は下落しました。

● 投資環境

【債券市場】

○欧州債券市場

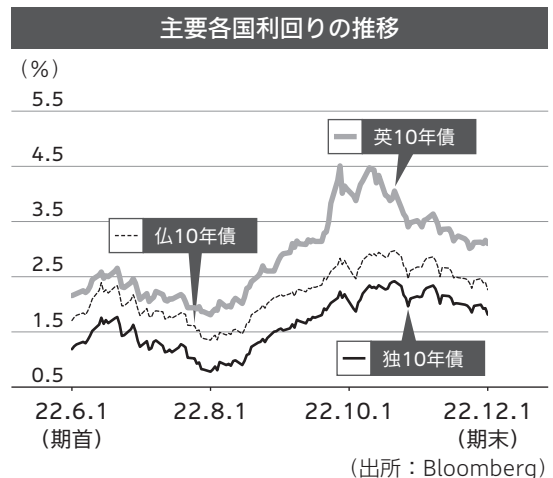
ドイツ債券利回りは上昇

インフレ高進によりECB（欧州中央銀行）が大幅な利上げを進めたことなどから、ドイツ債券利回りは上昇しました。

○英国債券市場

英国債券利回りは上昇

インフレ高進によりBOE（イングランド銀行）が大幅な利上げを進めたことなどから、利回りは上昇しました。



【為替市場】

○ユーロ円市場

円安ユーロ高

ECBが大幅な利上げを進めた一方、日銀は金融緩和を継続したことなどから、円安ユーロ高となりました。

○ポンド円市場

円安ポンド高

BOEが大幅な利上げを進めた一方、日銀は金融緩和を継続したことなどから、円安ポンド高となりました。

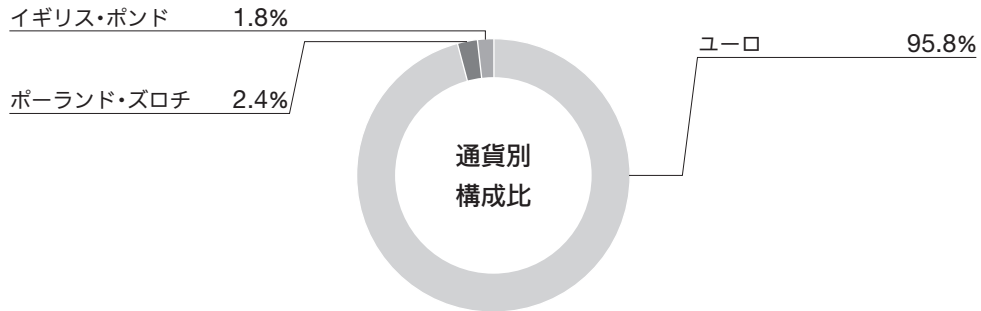


(出所：Bloomberg)

注．為替レートは対顧客電信売買相場の仲値を使用しております。

● 当該投資信託のポートフォリオ

FTSE欧州世界国債インデックスの国別配分を参考として、安定したインカムゲインの確保を目指し運用を行いました。



注1．比率は、第216期末における組入債券評価額に対する割合。

注2．端数処理の関係上、構成比合計が100%とならないことがあります。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異

当ファンドは、ユーロ参加国を中心に欧州各国の信用度の高い国債を主要投資対象として、アクティブに運用するファンドです。そのため、当ファンドのコンセプトに適った指数等が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数は記載していません。

● 分配金

収益分配金については、基準価額水準、市場動向等を勘案し、次表の通りと致しました。なお、収益分配に充てなかった収益は、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて引き続き元本と同一の運用を行います。

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税引前）

| 項目 | 第211期 | 第212期 | 第213期 | 第214期 | 第215期 | 第216期 |
|-----------|----------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|------------------------|------------------------|
| | 2022.6.2 2022.7.1 | 2022.7.2 2022.8.1 | 2022.8.2 2022.9.1 | 2022.9.2 2022.10.3 | 2022.10.4 2022.11.1 | 2022.11.2 2022.12.1 |
| 当期分配金 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 |
| （対基準価額比率） | 0.375% | 0.385% | 0.391% | 0.400% | 0.386% | 0.393% |
| 当期の収益 | 20 | 16 | 15 | 17 | 20 | 10 |
| 当期の収益以外 | — | 3 | 5 | 2 | — | 10 |
| 翌期繰越分配対象額 | 39 | 36 | 32 | 30 | 31 | 26 |

注1. 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

注2. 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税引前）に合致しない場合があります。

注3. 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

決算期毎にインカム収入[※]を中心に分配を行うことを目指すファンドです。

※ インカム収入とは、債券の利子収入等をいいます。

- ・ ファンドに蓄積された過去の運用成果（分配原資）を加味する場合があります。
- ・ 投資対象資産や為替の値動き等により基準価額が下落した場合でも、原則として、インカム収入相当については、分配を行います。

● 今後の運用方針

今後もインカムゲインを重視しつつ、投資妙味が高いと考えられる銘柄の組入れにより、中長期的なトータルリターンの向上を目指します。

● 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第211期～第216期 2022.6.2～2022.12.1 | | 項目の概要 |
|-----------|-----------------------------------|--------------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 30円 | 0.579% | (a) 信託報酬 = 各期中の平均基準価額 × 信託報酬率（年率） × $\frac{\text{各期の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は5,161円です。 |
| （投信会社） | (14) | (0.276) | ファンドの運用の対価 |
| （販売会社） | (14) | (0.276) | 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等の対価 |
| （受託会社） | (1) | (0.028) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価 |
| (b) その他費用 | 5 | 0.095 | (b) その他費用 = $\frac{\text{各期中のその他費用}}{\text{各期中の平均受益権口数}}$ |
| （保管費用） | (5) | (0.088) | 有価証券等の保管等のために、海外の銀行等に支払う費用 |
| （監査費用） | (0) | (0.005) | 監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用 |
| （その他） | (0) | (0.002) | 信託事務の処理にかかるその他の費用等 |
| 合計 | 35 | 0.674 | |

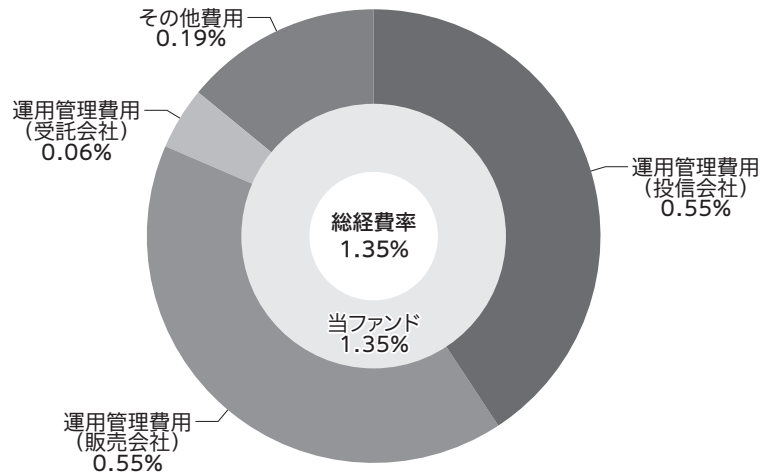
注1. 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

注2. 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

注3. 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

（参考情報）**○総経費率**

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1.35%**です。



注1. 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2. 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3. 各比率は、年率換算した値です。

注4. 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6月2日～2022年12月1日）

公社債

| | | | 第211期～第216期 | |
|----|------|------|-------------|------|
| | | | 買付額 | 売付額 |
| 外国 | ユーロ | | 千ユーロ | 千ユーロ |
| | イタリア | 国債証券 | — | 159 |
| | スペイン | 国債証券 | — | 141 |

（注1）金額は受渡代金（経過利子分は含まれておりません）。

（注2）単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

（2022年6月2日～2022年12月1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

（2022年12月1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216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 |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | % | % | % | % | % |
| イタリア | 1,060 | 1,226 | 175,354 | 43.4 | — | 8.2 | 35.2 | — |
| フランス | 100 | 119 | 17,039 | 4.2 | — | 4.2 | — | — |
| スペイン | 950 | 1,137 | 162,619 | 40.2 | — | 40.2 | — | — |
| イギリス | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | | | | | | |
| | 35 | 39 | 6,628 | 1.6 | — | 1.6 | — | — |
| ポーランド | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | | | | | | |
| | 300 | 285 | 8,752 | 2.2 | — | 2.2 | — | — |
| 合計 | — | — | 370,394 | 91.6 | — | 56.4 | 35.2 | — |

（注1）邦貨換算金額は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2）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

（注3）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(B) 外国(外貨建) 公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | | | 第216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 | | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| イタリア | 国債証券 | ITALY 5.75 330201 | 5.75 | 200 | 231 | 33,059 | 2033/2/1 |
| | | ITALY 7.25 261101 | 7.25 | 860 | 995 | 142,295 | 2026/11/1 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE 5.5 290425 | 5.5 | 100 | 119 | 17,039 | 2029/4/25 |
| スペイン | 国債証券 | SPAIN 5.75 320730 | 5.75 | 60 | 74 | 10,715 | 2032/7/30 |
| | | SPAIN 6.0 290131 | 6.0 | 890 | 1,062 | 151,903 | 2029/1/31 |
| 小計 | | | | | | 355,013 | |
| イギリス | | | | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | | |
| | 国債証券 | UK GILT 6.0 281207 | 6.0 | 35 | 39 | 6,628 | 2028/12/7 |
| 小計 | | | | | | 6,628 | |
| ポーランド | | | | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | | |
| | 国債証券 | POLAND 5.75 290425 | 5.75 | 300 | 285 | 8,752 | 2029/4/25 |
| 小計 | | | | | | 8,752 | |
| 合計 | | | | | | 370,394 | |

(注1) 邦貨換算金額は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2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

*当ファンドは、第216期末において、直接投資をする株式及び新株予約権証券の組入れはありません。

○投資信託財産の構成

(2022年12月1日現在)

| 項目 | 第216期末 | |
|--------------|---------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| 公社債 | 千円 370,394 | % 90.7 |
| コール・ローン等、その他 | 38,008 | 9.3 |
| 投資信託財産総額 | 408,402 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 第216期末における外貨建資産（380,130千円）の投資信託財産総額（408,402千円）に対する比率は、93.1%です。

(注3) 外貨建資産は、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、第216期末における邦貨換算レートは、1ユーロ=142.94円、1イギリス・ポンド=165.74円、1ポーランド・ズロチ=30.6249円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第211期末 | 第212期末 | 第213期末 | 第214期末 | 第215期末 | 第216期末 |
|-----------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | 2022年7月1日現在 | 2022年8月1日現在 | 2022年9月1日現在 | 2022年10月3日現在 | 2022年11月1日現在 | 2022年12月1日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 456,631,007 | 443,039,387 | 433,282,889 | 420,678,916 | 430,057,603 | 408,402,288 |
| コール・ローン等 | 18,155,622 | 13,675,669 | 9,931,660 | 27,960,434 | 19,545,186 | 29,005,502 |
| 公社債(評価額) | 431,697,165 | 421,019,544 | 414,126,393 | 382,039,401 | 397,709,904 | 370,394,875 |
| 未収利息 | 6,629,833 | 8,160,212 | 9,033,780 | 10,450,554 | 12,537,819 | 8,703,559 |
| 前払費用 | 32,297 | 30,793 | — | — | — | — |
| その他未収収益 | 116,090 | 153,169 | 191,056 | 228,527 | 264,694 | 298,352 |
| (B) 負債 | 5,678,366 | 2,404,398 | 2,126,394 | 2,576,050 | 12,522,822 | 3,963,715 |
| 未払収益分配金 | 1,698,594 | 1,703,688 | 1,693,410 | 1,680,147 | 1,616,783 | 1,595,733 |
| 未払解約金 | 3,549,846 | 260,524 | 28 | 456,591 | 10,513,245 | 1,972,399 |
| 未払信託報酬 | 426,107 | 436,223 | 429,151 | 435,442 | 388,731 | 391,632 |
| 未払利息 | — | — | 24 | — | 53 | 84 |
| その他未払費用 | 3,819 | 3,963 | 3,781 | 3,870 | 4,010 | 3,867 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 450,952,641 | 440,634,989 | 431,156,495 | 418,102,866 | 417,534,781 | 404,438,573 |
| 元本 | 849,297,448 | 851,844,281 | 846,705,064 | 840,073,513 | 808,391,830 | 797,866,808 |
| 次期繰越損益金 | △398,344,807 | △411,209,292 | △415,548,569 | △421,970,647 | △390,857,049 | △393,428,235 |
| (D) 受益権総口数 | 849,297,448口 | 851,844,281口 | 846,705,064口 | 840,073,513口 | 808,391,830口 | 797,866,808口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 5,310円 | 5,173円 | 5,092円 | 4,977円 | 5,165円 | 5,069円 |

(注1) 当作成期間（第211期～216期）における期首元本額858,196,208円、期中追加設定元本額15,246,332円、期中一部解約元本額75,575,732円

(注2) 期末における1口当たりの純資産総額

第211期0.5310円、第212期0.5173円、第213期0.5092円、第214期0.4977円、第215期0.5165円、第216期0.5069円

(注3) 期末における元本の欠損金額

第211期398,344,807円、第212期411,209,292円、第213期415,548,569円、第214期421,970,647円、第215期390,857,049円、第216期393,428,235円

○損益の状況

| 項 目 | 第211期 | 第212期 | 第213期 | 第214期 | 第215期 | 第216期 |
|-------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2022年6月2日～ 2022年7月1日 | 2022年7月2日～ 2022年8月1日 | 2022年8月2日～ 2022年9月1日 | 2022年9月2日～ 2022年10月3日 | 2022年10月4日～ 2022年11月1日 | 2022年11月2日～ 2022年12月1日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 1,880,434 | 1,874,017 | 1,918,747 | 1,987,777 | 1,691,775 | 1,732,502 |
| 受取利息 | 1,860,177 | 1,839,206 | 1,885,674 | 1,956,370 | 1,706,094 | 1,703,713 |
| その他収益金 | 20,770 | 35,199 | 33,680 | 32,003 | △ 14,893 | 29,937 |
| 支払利息 | △ 513 | △ 388 | △ 607 | △ 596 | 574 | △ 1,148 |
| (B) 有価証券売買損益 | 6,162,785 | △ 11,302,813 | △ 6,551,326 | △ 9,488,818 | 15,584,533 | △ 7,285,654 |
| 売買益 | 12,544,075 | 9,323,314 | 12,680,411 | 5,884,985 | 16,137,659 | 3,691,280 |
| 売買損 | △ 6,381,290 | △ 20,626,127 | △ 19,231,737 | △ 15,373,803 | △ 553,126 | △ 10,976,934 |
| (C) 信託報酬等 | △ 486,684 | △ 508,076 | △ 488,754 | △ 498,174 | △ 461,262 | △ 476,337 |
| (D) 当期損益金 (A+B+C) | 7,556,535 | △ 9,936,872 | △ 5,121,333 | △ 7,999,215 | 16,815,046 | △ 6,029,489 |
| (E) 前期繰越損益金 | △334,650,921 | △327,789,591 | △336,730,967 | △339,990,829 | △336,065,892 | △314,766,045 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 69,551,827 | △ 71,779,141 | △ 72,002,859 | △ 72,300,456 | △ 69,989,420 | △ 71,036,968 |
| (配当等相当額) | (3,010,424) | (3,027,999) | (3,011,496) | (2,568,584) | (2,471,992) | (2,443,531) |
| (売買損益相当額) | (△ 72,562,251) | (△ 74,807,140) | (△ 75,014,355) | (△ 74,869,040) | (△ 72,461,412) | (△ 73,480,499) |
| (G) 計 (D+E+F) | △396,646,213 | △409,505,604 | △413,855,159 | △420,290,500 | △389,240,266 | △391,832,502 |
| (H) 収益分配金 | △ 1,698,594 | △ 1,703,688 | △ 1,693,410 | △ 1,680,147 | △ 1,616,783 | △ 1,595,733 |
| 次期繰越損益金 (G+H) | △398,344,807 | △411,209,292 | △415,548,569 | △421,970,647 | △390,857,049 | △393,428,235 |
| 追加信託差損益金 | △ 69,551,827 | △ 71,779,141 | △ 72,426,212 | △ 72,300,456 | △ 69,989,420 | △ 71,834,835 |
| (配当等相当額) | (3,010,424) | (3,027,999) | (2,588,143) | (2,568,584) | (2,471,992) | (1,645,664) |
| (売買損益相当額) | (△ 72,562,251) | (△ 74,807,140) | (△ 75,014,355) | (△ 74,869,040) | (△ 72,461,412) | (△ 73,480,499) |
| 分配準備積立金 | 385,279 | 46,571 | 206,183 | 14,667 | 45,035 | 503,007 |
| 繰越損益金 | △329,178,259 | △339,476,722 | △343,328,540 | △349,684,858 | △320,912,664 | △322,096,407 |

(注1) 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2) 信託報酬等には、消費税相当額を含めて表示しております。

(注3) 追加信託差損益金とは、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4) 分配金の計算過程 (2022年6月2日～2022年12月1日) は以下の通りです。

| 項 目 | 2022年6月2日～ 2022年7月1日 | 2022年7月2日～ 2022年8月1日 | 2022年8月2日～ 2022年9月1日 | 2022年9月2日～ 2022年10月3日 | 2022年10月4日～ 2022年11月1日 | 2022年11月2日～ 2022年12月1日 |
|---------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|---------------------------|---------------------------|
| a. 配当等収益 (費用控除後) | 1,766,647円 | 1,365,941円 | 1,429,993円 | 1,489,603円 | 1,646,617円 | 1,256,165円 |
| b. 有価証券等損益額 (費用控除後) | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 |
| c. 信託約款に規定する収益調整金 | 3,010,424円 | 3,027,999円 | 3,011,496円 | 2,568,584円 | 2,471,992円 | 2,443,531円 |
| d. 信託約款に規定する分配準備積立金 | 317,226円 | 384,318円 | 46,247円 | 205,211円 | 15,201円 | 44,708円 |
| e. 分配対象収益 (a+b+c+d) | 5,094,297円 | 4,778,258円 | 4,487,736円 | 4,263,398円 | 4,133,810円 | 3,744,404円 |
| f. 分配対象収益 (1万口当たり) | 59円 | 56円 | 52円 | 50円 | 51円 | 46円 |
| g. 分配金 | 1,698,594円 | 1,703,688円 | 1,693,410円 | 1,680,147円 | 1,616,783円 | 1,595,733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211期 | 第212期 | 第213期 | 第214期 | 第215期 | 第216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 |

<分配金をお支払いする場合>

・分配金は、原則として各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しています。

<分配金を再投資する場合>

・お手持り分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資しています。

<課税上の取扱いについて>

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配金落ち後の基準価額が個別元本と同額の場合または個別元本を上回っている場合は、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配金落ち後の基準価額が個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、収益分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人の受益者に対する課税
 税率は普通分配金について、20.315%（所得税及び復興特別所得税15.315%、並びに地方税5%）です。

※上記は源泉徴収時の税率であり、税率は課税方法等により異なる場合があります。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が5年間非課税となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※法人の受益者に対する課税は、税率が異なります。

※上記内容は、税法が改正された場合等には変更になることがあります。

※課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家または税務署等にご確認ください。