

グローバル・ハイブリッド・プレミア (為替ヘッジなし)

償還 運用報告書(全体版)

第113期(決算日 2024年3月18日) 第115期(決算日 2024年5月17日) 第117期(決算日 2024年7月17日)
第114期(決算日 2024年4月17日) 第116期(決算日 2024年6月17日) 第118期(償還)(償還日 2024年8月19日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
「グローバル・ハイブリッド・プレミア(為替ヘッジなし)」は、信託約款の規定に基づき、2024年8月19日に信託期間が終了し、償還いたしました。
ここに、設定以来の運用状況と償還内容をご報告いたしますとともに、受益者のみなさまのご愛顧に対しまして、重ねてお礼申し上げます。

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/その他資産(ハイブリッド証券)
信託期間	2014年11月5日から2024年8月19日までです。
運用方針	主として、世界の金融機関が発行するハイブリッド証券を主要投資対象とする投資信託証券(投資信託または外国投資信託の受益証券(振替投資信託受益権を含みます。))および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。)の一部、またはすべてに投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	「グローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド アンヘッジド・クラス」受益証券 「マネー・アカウント・マザーファンド」受益証券 上記の投資信託証券を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。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	第1計算期は収益分配を行ないません。第2計算期以降、毎決算時、原則として分配対象額のなかから、基準価額水準、市況動向などを勘案して分配を行なう方針です。 ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

<642495>

日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号
www.nikkoam.com/

当運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター 電話番号: 0120-25-1404
午前9時~午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			債券組入比率	投資信託 組入比率	純資産総額	
		税分	込配	み騰				期騰落
	円 銭		円		%	%	百万円	
89期(2022年3月17日)	9,376		40		△1.0	—	95.1	20
90期(2022年4月18日)	9,813		40		5.1	—	95.2	21
91期(2022年5月17日)	9,504		40		△2.7	—	94.9	21
92期(2022年6月17日)	9,393		40		△0.7	—	94.9	21
93期(2022年7月19日)	9,505		40		1.6	—	95.0	21
94期(2022年8月17日)	9,685		40		2.3	—	95.2	22
95期(2022年9月20日)	9,647		40		0.0	—	94.9	22
96期(2022年10月17日)	9,345		40		△2.7	—	95.0	22
97期(2022年11月17日)	9,571		40		2.8	—	95.2	23
98期(2022年12月19日)	9,647		40		1.2	—	95.0	23
99期(2023年1月17日)	9,235		40		△3.9	—	95.0	21
100期(2023年2月17日)	9,636		40		4.8	—	95.2	21
101期(2023年3月17日)	8,865		40		△7.6	—	94.2	22
102期(2023年4月17日)	9,216		40		4.4	—	95.1	25
103期(2023年5月17日)	9,303		40		1.4	—	95.0	26
104期(2023年6月19日)	9,907		40		6.9	—	95.1	26
105期(2023年7月18日)	9,918		40		0.5	—	95.3	26
106期(2023年8月17日)	10,272		40		4.0	—	95.0	25
107期(2023年9月19日)	10,270		40		0.4	—	95.0	25
108期(2023年10月17日)	10,131		40		△1.0	—	95.0	23
109期(2023年11月17日)	10,672		40		5.7	—	95.0	24
110期(2023年12月18日)	10,570		40		△0.6	—	95.0	63
111期(2024年1月17日)	10,854		40		3.1	—	94.7	63
112期(2024年2月19日)	11,065		40		2.3	—	94.9	63
113期(2024年3月18日)	11,239		40		1.9	—	95.1	61
114期(2024年4月17日)	11,268		40		0.6	—	95.0	62
115期(2024年5月17日)	11,813		40		5.2	0.1	94.6	64
116期(2024年6月17日)	11,728		40		△0.4	0.1	95.0	65
117期(2024年7月17日)	12,152		40		4.0	0.1	95.0	64
(償還時)	(償還価額)							
118期(2024年8月19日)	11,295.78		—		△7.0	—	—	57

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) ファンドの商品性格に適合する適切なベンチマークおよび参考指数はございません。

○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 券 組 入 比	投 資 信 託 組 入 比	信 託 券 率
			騰 落	率			
第113期	(期 首) 2024年 2月19日	円 銭 11,065		% —			% 94.9
	2月末	11,215		1.4			94.7
	(期 末) 2024年 3月18日	11,279		1.9			95.1
第114期	(期 首) 2024年 3月18日	11,239		—			95.1
	3月末	11,412		1.5			95.0
	(期 末) 2024年 4月17日	11,308		0.6			95.0
第115期	(期 首) 2024年 4月17日	11,268		—			95.0
	4月末	11,622		3.1	0.1		95.1
	(期 末) 2024年 5月17日	11,853		5.2	0.1		94.6
第116期	(期 首) 2024年 5月17日	11,813		—	0.1		94.6
	5月末	11,863		0.4	0.1		93.9
	(期 末) 2024年 6月17日	11,768		△0.4	0.1		95.0
第117期	(期 首) 2024年 6月17日	11,728		—	0.1		95.0
	6月末	12,039		2.7	0.1		94.7
	(期 末) 2024年 7月17日	12,192		4.0	0.1		95.0
第118期	(期 首) 2024年 7月17日	12,152		—	0.1		95.0
	7月末	11,848		△2.5	0.1		95.0
	(償還時) 2024年 8月19日	(償還価額) 11,295.78		△7.0			—

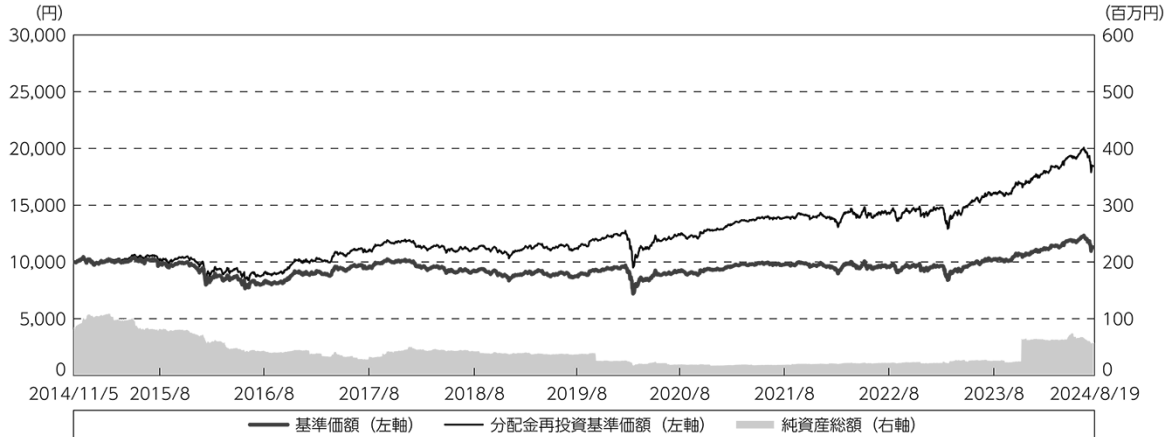
(注) 期末の基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

○運用経過

(2014年11月5日～2024年8月19日)

設定以来の基準価額等の推移



設定日：10,000円

第118期末(償還日)：11,295円78銭(既払分配金(税込み)：4,640円)

騰落率：84.5% (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。
- (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、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主として、世界の金融機関が発行するハイブリッド証券を主要投資対象とする投資信託証券に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行なっております。ハイブリッド証券の中でもCOC債を中心に投資を行いました。信託期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

<値上がり要因>

- ・保有銘柄からインカム収益を得たこと。
- ・米ドル、ユーロ、イギリスポンドが対円で上昇したこと。

<値下がり要因>

- ・保有銘柄の債券価格が下落したこと。

投資環境

（ＣＯＣＯ債市況）

2016年第1四半期には、ドイツ銀行の業績悪化やＣＯＣＯ債の利払いの継続性に対する懸念の高まりからスプレッド（上乗せ金利）は拡大し、ＣＯＣＯ債市場は調整しました。その後は2017年にかけて、世界的な景況感の改善と低金利環境下での高金利を求めた資金流入を背景にＣＯＣＯ債のスプレッドは縮小し、ＣＯＣＯ債市場は上昇基調を辿りました。ＣＯＣＯ債の主発行体である欧州の大手銀行が株主還元よりも自己資本の拡充を優先し、発行銀行の信用力が改善傾向を辿ったこともＣＯＣＯ債市場の堅調を後押ししました。2018年にはマクロ景況感の悪化懸念からＣＯＣＯ債市場は弱含みましたが、2019年は世界同時景気回復～拡大の様相となり、リスク性資産全般が堅調に推移する中でＣＯＣＯ債市場も上昇しました。

2020年3月には新型コロナウイルスの世界的な感染拡大（パンデミック）への不安感からリスク性資産は急落し、ＣＯＣＯ債市場もスプレッド拡大を主因に大幅に調整しましたが、欧米の中央銀行が大幅な金融緩和に踏み切り金利が大きく低下したことに加えて、各国政府が大掛かりな財政出動を打ち出したこと、加えてワクチンの開発・普及が進んだことから、リスク性資産は2021年にかけて下げを取り戻す展開となり、ＣＯＣＯ債市場も回復・上昇しました。

2022年は物価上昇への対処として欧米の中央銀行が連続利上げを開始したことから世界的に金利が上昇し、債券全体が下落する中でＣＯＣＯ債市場も下落しました。2023年3月にはクレディスイスのＡＴ１債が無価値化され、ＣＯＣＯ債市場はスプレッドの拡大により調整しました。2023年後半になると景気が緩やかに鈍化する中でインフレ上昇圧力が弱まったことから欧米の中央銀行の連続利上げが終了し、先行きの利下げサイクルへの転換が意識されて金利は低下に転じ、リスク性資産全体が騰勢を強める中で期間末にかけてＣＯＣＯ債市場は堅調に推移しました。

（国内短期金利市況）

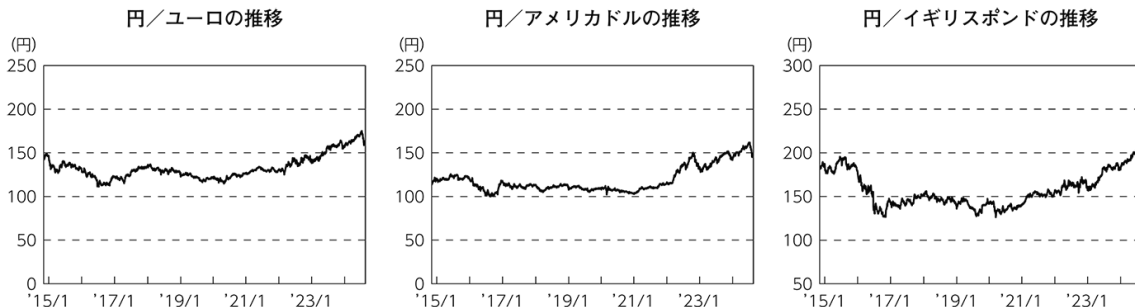
設定時から2016年2月前半にかけては、日銀が2013年4月に「量的・質的金融緩和」を導入したことなどから、無担保コール翌日物金利は、概ね0.1%を下回る水準で推移しました。その間、国庫短期証券（ＴＢ）3ヵ月物金利は概ね0.0%を挟んだ水準で推移しました。

2016年2月後半から2024年3月中旬にかけては、日銀によるマイナス金利政策の導入を受けて、無担保コール翌日物金利とＴＢ3ヵ月物金利はともにマイナス圏での推移となりました。

2024年3月下旬以降は、日銀が金融政策決定会合においてマイナス金利政策を解除したことや追加利上げを行なったことなどから、無担保コール翌日物金利は0.23%近辺まで上昇し、ＴＢ3ヵ月物金利はプラス圏に浮上して0.11%近辺で償還時を迎えました。

（為替市況）

信託期間中における主要通貨（対円）は、下記の推移となりました。



当ファンドのポートフォリオ

（当ファンド）

収益性を追求するため「グローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド アンヘッジド・クラス」円建受益証券を高位に組み入れ、「マネー・アカウント・マザーファンド」受益証券への投資を抑制しました。

当ファンドは2014年11月5日の設定以来、約9年9ヵ月にわたり運用してまいりました。このたび、約款の規定に基づき、信託終了日を2024年8月19日として償還いたしました。

これまでのみなさまのご愛顧に対しまして、心より厚くお礼申し上げますとともに、今後とも弊社投資信託をご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

（グローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド アンヘッジド・クラス）

G-S I F I s（グローバルなシステム上重要な金融機関）に含まれる銀行が発行するC o C o債、ハイブリッド証券を主たる投資対象とし、米国の大手銀行が発行する優先証券にも投資しました。ポートフォリオのデュレーション（金利感応度）は3～6年程度、平均格付けはBBB-～BB+としました。欧州の大手銀行のC o C o債に重点を置いたポートフォリオ構成としました。

（マネー・アカウント・マザーファンド）

運用の基本方針に従い、国庫短期証券の購入や現先取引、コールローンや金銭信託などを通じて、元本の安全性を重視した運用を行ないました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定していません。

分配金

信託期間中における分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案して決定し、1万口当たりの累計は4,640円（税込み）となりました。また、第113期～第117期における分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案し、以下のとおりとしました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたしました。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項 目	第113期	第114期	第115期	第116期	第117期
	2024年2月20日～ 2024年3月18日	2024年3月19日～ 2024年4月17日	2024年4月18日～ 2024年5月17日	2024年5月18日～ 2024年6月17日	2024年6月18日～ 2024年7月17日
当期分配金	40	40	40	40	40
（対基準価額比率）	0.355%	0.354%	0.337%	0.340%	0.328%
当期の収益	40	40	40	40	40
当期の収益以外	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	2,698	2,724	3,261	3,267	3,588

（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して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。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2024年 2月20日～2024年 8月19日）

項 目	第113期～第118期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	61	0.520	(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 ）	(20)	(0.175)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(38)	(0.328)	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
（ 受 託 会 社 ）	(2)	(0.016)	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	6	0.049	(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
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.002)	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
（ 印 刷 費 用 等 ）	(5)	(0.047)	印刷費用等は、法定開示資料の印刷に係る費用など
合 計	67	0.569	
作成期間の平均基準価額は、11,666円です。			

(注) 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。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

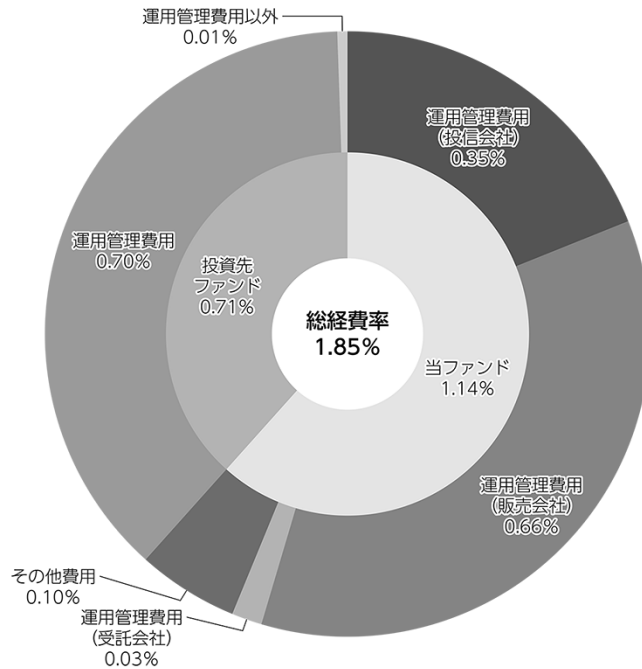
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(注) この他にファンドが投資対象とする投資先においても信託報酬等が発生する場合があります。

（参考情報）

○総経費率

作成期間の運用・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。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.85%です。



(単位:%)

総経費率(①+②+③)	1.85
①当ファンドの費用の比率	1.14
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.70
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.01

(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) 「その他費用」には保管費用が含まれる場合があります。なお、「その他費用」の内訳は「1万口当たりの費用明細」にてご確認いただけますが、期中の費用の総額と年率換算した値は一致しないことがあります。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(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

（2024年2月20日～2024年8月19日）

投資信託証券

銘 柄		第113期～第118期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国内	グローバル・ハイブリッド・セキユリティーズ・ファンドアンヘッド・クラス	千口 11,427	千円 13,307	千口 67,157	千円 75,255

（注）金額は受け渡し代金。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄		第113期～第118期			
		設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	マネー・アカウント・マザーファンド	千口 16	千円 16	千口 78	千円 79

○利害関係人との取引状況等

（2024年2月20日～2024年8月19日）

利害関係人との取引状況

<グローバル・ハイブリッド・プレミア（為替ヘッジなし）>

区 分	第113期～第118期					
	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 13	百万円 13	% 100.0	百万円 75	百万円 75	% 100.0

<マネー・アカウント・マザーファンド>

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三井住友信託銀行株式会社です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2024年2月20日～2024年8月19日）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2024年2月20日～2024年8月19日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2024年8月19日現在）

2024年8月19日現在、有価証券等の組入れはございません。

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	第112期末	
		口	数
グローバル・ハイブリッド・セキュリティーズ・ファンド アンヘッジド・クラス			千口 55,729
合	計		55,729

親投資信託残高

銘	柄	第112期末	
		口	数
マネー・アカウント・マザーファンド			千口 62

○投資信託財産の構成

（2024年8月19日現在）

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 57,241	% 100.0
投資信託財産総額	57,241	100.0

（注）比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び償還（基準）価額の状況

項 目	第113期末	第114期末	第115期末	第116期末	第117期末	償 還 時
	2024年3月18日現在	2024年4月17日現在	2024年5月17日現在	2024年6月17日現在	2024年7月17日現在	2024年8月19日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	62,196,540	62,452,077	64,865,320	67,915,070	65,399,196	57,241,072
コール・ローン等	3,096,215	3,375,742	4,192,095	3,496,727	3,997,859	57,240,698
投資信託受益証券(評価額)	58,842,784	59,013,173	60,610,239	61,822,783	60,884,788	—
マネー・アカウント・マザーファンド(評価額)	61,315	62,873	62,977	65,276	64,852	—
未収入金	196,226	282	—	2,530,276	451,688	—
未収利息	—	7	9	8	9	374
(B) 負債	295,157	303,846	774,811	2,830,860	1,281,434	106,593
未払金	—	—	460,961	—	—	—
未払収益分配金	220,316	220,625	217,012	221,976	211,046	—
未払解約金	409	—	8,369	2,506,984	968,320	189
未払信託報酬	50,007	53,864	54,162	61,906	56,898	56,116
その他未払費用	24,425	29,357	34,307	39,994	45,170	50,288
(C) 純資産総額(A-B)	61,901,383	62,148,231	64,090,509	65,084,210	64,117,762	57,134,479
元本	55,079,229	55,156,463	54,253,121	55,494,102	52,761,717	50,580,397
次期繰越損益金	6,822,154	6,991,768	9,837,388	9,590,108	11,356,045	—
償還差益金	—	—	—	—	—	6,554,082
(D) 受益権総口数	55,079,229口	55,156,463口	54,253,121口	55,494,102口	52,761,717口	50,580,397口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,239円	11,268円	11,813円	11,728円	12,152円	—
1万口当たり償還価額(C/D)	—	—	—	—	—	11,295円78銭

（注）当ファンドの第113期首元本額は57,644,082円、第113～118期中追加設定元本額は13,200,606円、第113～118期中一部解約元本額は20,264,291円です。

（注）1口当たり純資産額は、第113期1.1239円、第114期1.1268円、第115期1.1813円、第116期1.1728円、第117期1.2152円、第118期1.129578円です。

○損益の状況

項 目	第113期	第114期	第115期	第116期	第117期	第118期
	2024年2月20日～ 2024年3月18日	2024年3月19日～ 2024年4月17日	2024年4月18日～ 2024年5月17日	2024年5月18日～ 2024年6月17日	2024年6月18日～ 2024年7月17日	2024年7月18日～ 2024年8月19日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	320,288	320,107	310,380	323,619	305,321	2,267
受取配当金	320,288	319,906	310,143	323,278	305,028	—
受取利息	—	201	237	341	293	2,267
(B) 有価証券売買損益	908,077	105,696	2,872,628	△ 550,494	2,161,714	△ 4,273,231
売買益	922,129	115,926	2,938,580	41,802	2,339,721	83,848
売買損	△ 14,052	△ 10,230	△ 65,952	△ 592,296	△ 178,007	△ 4,357,079
(C) 信託報酬等	△ 54,774	△ 58,997	△ 59,326	△ 67,810	△ 62,324	△ 61,463
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,173,591	366,806	3,123,682	△ 294,685	2,404,711	△ 4,332,427
(E) 前期繰越損益金	4,432,170	5,316,242	5,262,779	7,235,047	6,119,820	7,950,170
(F) 追加信託差損益金	1,436,709	1,529,345	1,667,939	2,871,722	3,042,560	2,936,339
(配当等相当額)	(9,475,594)	(9,565,681)	(9,523,973)	(10,863,523)	(10,618,367)	(10,198,986)
(売買損益相当額)	(△8,038,885)	(△8,036,336)	(△ 7,856,034)	(△ 7,991,801)	(△ 7,575,807)	(△ 7,262,647)
(G) 計(D+E+F)	7,042,470	7,212,393	10,054,400	9,812,084	11,567,091	—
(H) 収益分配金	△ 220,316	△ 220,625	△ 217,012	△ 221,976	△ 211,046	—
次期繰越損益金(G+H)	6,822,154	6,991,768	9,837,388	9,590,108	11,356,045	—
償還差益金(D+E+F+H)	—	—	—	—	—	6,554,082
追加信託差損益金	1,436,709	1,529,345	1,667,939	2,871,722	3,042,560	—
(配当等相当額)	(9,475,594)	(9,565,681)	(9,523,973)	(10,863,523)	(10,618,367)	(—)
(売買損益相当額)	(△8,038,885)	(△8,036,336)	(△ 7,856,034)	(△ 7,991,801)	(△ 7,575,807)	(—)
分配準備積立金	5,385,445	5,462,423	8,169,449	7,268,880	8,313,485	—
繰越損益金	—	—	—	△ 550,494	—	—

(注) 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。

(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をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2024年2月20日～2024年7月17日)は以下の通りです。

項 目	2024年2月20日～ 2024年3月18日	2024年3月19日～ 2024年4月17日	2024年4月18日～ 2024年5月17日	2024年5月18日～ 2024年6月17日	2024年6月18日～ 2024年7月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	306,008円	275,754円	304,596円	255,809円	297,605円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	867,583円	91,052円	2,819,086円	0円	1,605,657円
c. 信託約款に定める収益調整金	9,475,594円	9,565,681円	9,523,973円	10,863,523円	10,618,367円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	4,432,170円	5,316,242円	5,262,779円	7,235,047円	6,621,269円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	15,081,355円	15,248,729円	17,910,434円	18,354,379円	19,142,898円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	2,738円	2,764円	3,301円	3,307円	3,628円
g. 分配金	220,316円	220,625円	217,012円	221,976円	211,046円
h. 分配金(1万円当たり)	40円	40円	40円	40円	40円

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2014年11月5日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024年8月19日		資産総額	57,241,072円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	106,593円
				純資産総額	57,134,479円
受益権口数	81,049,621口	50,580,397口	△30,469,224口	受益権口数	50,580,397口
元本額	81,049,621円	50,580,397円	△30,469,224円	1万円当たり償還金	11,295円78銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万円当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	87,576,637円	88,336,343円	10,087円	-円	-%
第2期	99,956,106	99,210,185	9,925	40	0.4
第3期	105,009,441	102,344,055	9,746	40	0.4
第4期	105,802,751	105,346,840	9,957	40	0.4
第5期	102,954,974	103,902,237	10,092	40	0.4
第6期	97,598,433	97,255,940	9,965	40	0.4
第7期	97,388,026	97,647,895	10,027	40	0.4
第8期	83,035,831	83,784,922	10,090	40	0.4
第9期	81,428,378	83,273,181	10,227	40	0.4
第10期	79,299,762	80,565,112	10,160	40	0.4
第11期	82,837,107	81,438,859	9,831	40	0.4
第12期	81,551,980	78,886,952	9,673	40	0.4
第13期	80,970,614	80,104,442	9,893	40	0.4
第14期	76,893,946	75,132,914	9,771	40	0.4
第15期	75,735,250	70,156,790	9,263	40	0.4
第16期	69,366,947	58,305,980	8,405	40	0.4
第17期	69,418,971	61,215,420	8,818	40	0.4
第18期	63,574,598	53,827,033	8,467	40	0.4
第19期	55,126,171	47,005,947	8,527	40	0.4
第20期	54,885,699	43,925,355	8,003	40	0.4
第21期	53,681,324	44,319,469	8,256	40	0.4
第22期	53,453,960	42,788,716	8,005	40	0.4
第23期	49,474,927	40,099,635	8,105	40	0.4
第24期	49,537,810	40,319,022	8,139	40	0.4
第25期	49,487,199	41,653,268	8,417	40	0.4
第26期	48,990,400	44,834,933	9,152	40	0.4
第27期	49,122,226	44,070,499	8,972	40	0.4
第28期	42,325,020	38,054,945	8,991	40	0.4
第29期	42,380,016	38,309,641	9,040	40	0.4
第30期	37,638,535	33,048,600	8,781	40	0.4

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第31期	39,399,662円	37,502,792円	9,519円	40円	0.4%
第32期	35,400,013	33,014,717	9,326	40	0.4
第33期	32,496,443	31,368,053	9,653	40	0.4
第34期	29,716,081	28,603,584	9,626	40	0.4
第35期	32,679,545	32,005,722	9,794	40	0.4
第36期	34,012,093	33,598,022	9,878	40	0.4
第37期	41,815,996	41,823,780	10,002	40	0.4
第38期	43,270,167	43,299,572	10,007	40	0.4
第39期	45,479,646	45,827,369	10,076	40	0.4
第40期	47,216,793	45,326,523	9,600	40	0.4
第41期	46,258,636	43,788,887	9,466	40	0.4
第42期	48,035,701	46,068,600	9,590	40	0.4
第43期	47,351,054	44,953,778	9,494	40	0.4
第44期	47,371,737	44,046,246	9,298	40	0.4
第45期	47,738,632	44,709,553	9,365	40	0.4
第46期	47,069,841	42,651,575	9,061	40	0.4
第47期	45,215,677	42,128,032	9,317	40	0.4
第48期	42,609,829	38,877,310	9,124	40	0.4
第49期	44,331,396	39,784,568	8,974	40	0.4
第50期	44,254,613	39,043,029	8,822	40	0.4
第51期	44,665,587	38,802,668	8,687	40	0.4
第52期	44,246,481	39,172,998	8,853	40	0.4
第53期	43,061,371	39,348,426	9,138	40	0.4
第54期	41,714,142	38,502,224	9,230	40	0.4
第55期	41,900,588	37,534,941	8,958	40	0.4
第56期	42,040,439	37,139,882	8,834	40	0.4
第57期	42,234,519	37,963,853	8,989	40	0.4
第58期	42,378,332	36,595,286	8,635	40	0.4
第59期	42,422,006	38,164,362	8,996	40	0.4
第60期	42,501,390	38,977,817	9,171	40	0.4
第61期	27,988,669	25,715,646	9,188	40	0.4
第62期	27,276,317	25,879,901	9,488	40	0.4
第63期	26,973,445	25,661,973	9,514	40	0.4
第64期	27,162,941	25,932,610	9,547	40	0.4
第65期	27,000,736	20,875,182	7,731	40	0.4
第66期	24,080,146	20,468,775	8,500	40	0.4
第67期	25,814,052	21,587,736	8,363	40	0.4
第68期	24,294,632	21,764,122	8,958	40	0.4
第69期	21,925,783	19,650,113	8,962	40	0.4

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第70期	21,051,770円	19,250,507円	9,144円	40円	0.4%
第71期	21,170,349	19,143,696	9,043	40	0.4
第72期	21,196,327	19,035,426	8,981	40	0.4
第73期	21,382,178	19,661,418	9,195	40	0.4
第74期	18,641,491	17,364,348	9,315	40	0.4
第75期	18,742,921	17,451,065	9,311	40	0.4
第76期	18,992,090	18,229,212	9,598	40	0.4
第77期	19,315,827	18,802,465	9,734	40	0.4
第78期	19,731,199	19,278,061	9,770	40	0.4
第79期	18,428,004	18,058,024	9,799	40	0.4
第80期	18,684,567	18,463,157	9,882	40	0.4
第81期	18,872,951	18,505,281	9,805	40	0.4
第82期	19,091,897	18,566,345	9,725	40	0.4
第83期	19,398,175	18,931,439	9,759	40	0.4
第84期	20,497,428	20,429,792	9,967	40	0.4
第85期	20,774,863	20,421,687	9,830	40	0.4
第86期	20,852,707	20,224,188	9,699	40	0.4
第87期	21,036,000	20,348,224	9,673	40	0.4
第88期	22,186,357	21,099,833	9,510	40	0.4
第89期	22,331,910	20,937,592	9,376	40	0.4
第90期	22,367,721	21,950,375	9,813	40	0.4
第91期	22,409,885	21,298,782	9,504	40	0.4
第92期	22,488,523	21,123,100	9,393	40	0.4
第93期	22,617,560	21,498,620	9,505	40	0.4
第94期	23,002,014	22,278,129	9,685	40	0.4
第95期	23,095,478	22,280,790	9,647	40	0.4
第96期	23,857,995	22,296,276	9,345	40	0.4
第97期	24,059,813	23,027,849	9,571	40	0.4
第98期	24,270,007	23,412,102	9,647	40	0.4
第99期	22,903,678	21,150,848	9,235	40	0.4
第100期	22,829,145	21,998,853	9,636	40	0.4
第101期	25,368,363	22,489,590	8,865	40	0.4
第102期	27,898,854	25,710,391	9,216	40	0.4
第103期	28,646,479	26,649,857	9,303	40	0.4
第104期	26,882,007	26,630,690	9,907	40	0.4
第105期	26,873,655	26,652,712	9,918	40	0.4
第106期	25,195,113	25,881,207	10,272	40	0.4
第107期	25,236,912	25,919,363	10,270	40	0.4
第108期	22,783,391	23,082,460	10,131	40	0.4

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1 万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第109期	22,969,541円	24,513,246円	10,672円	40円	0.4%
第110期	60,322,886	63,761,447	10,570	40	0.4
第111期	58,466,764	63,457,739	10,854	40	0.4
第112期	57,644,082	63,782,942	11,065	40	0.4
第113期	55,079,229	61,901,383	11,239	40	0.4
第114期	55,156,463	62,148,231	11,268	40	0.4
第115期	54,253,121	64,090,509	11,813	40	0.4
第116期	55,494,102	65,084,210	11,728	40	0.4
第117期	52,761,717	64,117,762	12,152	40	0.4

○分配金のお知らせ

	第113期	第114期	第115期	第116期	第117期
1 万口当たり分配金（税込み）	40円	40円	40円	40円	40円

○償還金のお知らせ

1 万口当たり償還金（税込み）	11,295円78銭
-----------------	------------

○お知らせ

約款変更について

2024年2月20日から2024年8月19日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。