



BNY MELLON

BNYメロン・グローバル 好利回りCBファンド2016-11 (円ヘッジ) (限定追加型)

追加型投信／海外／その他資産（転換社債）

運用報告書（全体版）

第1期（決算日：2017年11月27日）

●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／その他資産（転換社債） |
| 信託期間 | 平成33年11月26日まで |
| 運用方針 | 海外の転換社債を主要投資対象とし、信託期間を勘案しつつ、安定した収益の確保および信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 |
| 主要運用対象 | 海外の転換社債を主要投資対象とします。 |
| 組入制限 | 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。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 | 毎決算時（原則として11月27日。休業日の場合は翌営業日）に、基準価額水準等を勘案して委託会社が決定します。ただし、委託者の判断で分配を行わないことがあります。 |

●お知らせ

- 当ファンドの運用委託先について
当ファンドの運用委託先である「メロン・キャピタル・マネジメント・コーポレーション」は、2018年1月31日の営業終了後、同じBNYメロン・グループの「ザ・ボストン・カンパニー・アセット・マネジメント・エル・エル・シー」ならびに「スタンディッシュ・メロン・アセット・マネジメント・カンパニー・エル・エル・シー」と統合し、2018年2月1日からは、マルチ・アセット運用会社であるBNYメロン・アセット・マネジメント・ノースアメリカ・コーポレーションとして業務を行う予定です。本統合により、各社の主たる運用チーム、運用哲学、運用プロセスを変更することはございません。

受益者のみなさまへ

平素は、格別のお引立てにあずかり厚く御礼申し上げます。

さて、「BNYメロン・グローバル好利回りCBファンド2016-11（円ヘッジ）（限定追加型）」は、2017年11月27日に第1期決算を行いました。ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

BNYメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社

東京都千代田区丸の内1丁目8番3号

丸の内トラストタワー本館

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

ドキュメンテーション部

電話番号：03-6756-4600（代表）

受付時間：営業日の9：00～17：00

ホームページ <http://www.bnymellonam.jp/>

■設定以来の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 | | | 新株予約権付社債 (転 換 社 債) 組 入 比 率 | 債 券 組入比率 | 純資産 総 額 |
|-----------------|---------|------------|------------|------------------------------------|-------------|------------|
| | (分配落) | 税込み 分配金 | 期 中 騰落率 | | | |
| (設 定 日) | 円 | 円 | % | % | % | 百万円 |
| 2016年11月28日 | 10,000 | — | — | — | — | 3,632 |
| 1期(2017年11月27日) | 10,336 | 0 | 3.4 | 92.8 | 7.0 | 4,009 |

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

(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ないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

■当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 新株予約権付社債 (転 換 社 債) 組 入 比 率 | 債 券 組入比率 |
|-------------|---------|------|------------------------------------|-------------|
| | | 騰落率 | | |
| (設定日) | 円 | % | % | % |
| 2016年11月28日 | 10,000 | — | — | — |
| 11月末 | 9,961 | △0.4 | 56.9 | — |
| 12月末 | 9,979 | △0.2 | 93.2 | — |
| 2017年1月末 | 9,992 | △0.1 | 92.6 | — |
| 2月末 | 10,075 | 0.8 | 90.9 | 2.8 |
| 3月末 | 10,080 | 0.8 | 92.0 | 5.7 |
| 4月末 | 10,163 | 1.6 | 93.0 | 5.7 |
| 5月末 | 10,137 | 1.4 | 91.4 | 5.9 |
| 6月末 | 10,241 | 2.4 | 93.5 | 6.2 |
| 7月末 | 10,257 | 2.6 | 91.8 | 6.3 |
| 8月末 | 10,186 | 1.9 | 91.2 | 6.5 |
| 9月末 | 10,305 | 3.1 | 93.8 | 6.8 |
| 10月末 | 10,322 | 3.2 | 94.3 | 7.0 |
| (期 末) | | | | |
| 2017年11月27日 | 10,336 | 3.4 | 92.8 | 7.0 |

(注) 騰落率は設定日比です。

(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ないためベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

◆基準価額の推移

基準価額は、期末には10,336円となりました。その結果、基準価額は336円上昇し、期中騰落率は3.36%となりました。



◆基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

- ・ トランプ米大統領の経済政策や米国の景気拡大に対する期待が高まり、CB市場が期初から堅調に推移したこと。
- ・ 2017年4月以降、米国や中国など世界経済の改善基調が強まったこと、欧州の政治リスクが後退したことなどから、投資家のリスク選好度が回復したこと。

(下落要因)

- ・ 2017年8月、北朝鮮情勢の緊迫化などを受けて投資家のリスク回避姿勢が高まったこと。

◆市場概況

当期のグローバルCB市場は、欧米の金融政策正常化への警戒感や北朝鮮情勢の悪化による地政学リスクの高まりなどを背景に短期的に下落する場面もありましたが、ドナルド・トランプ米大統領の経済政策や米国の景気拡大に対する期待の高まり、中国の景気減速懸念の後退、及び、ユーロ圏の景気改善を示唆する経済指標の発表が相次いだことなどを受けて、期を通じて買い優勢の展開が続きました。また、代表的な株価指数であるS&P500種指数やナスダック総合指数が過去最高値を更新するなど株式市場が堅調に推移したことや、フランス大統領選挙の結果などを受けて欧州の政治リスクが後退したなども相場の上昇要因となりました。

◆運用概況

当ファンドにおいては、実質的な運用について、BNYメロン・グループ傘下の運用会社であるメロン・キャピタル・マネジメント・コーポレーションに委託を行っています。

当ファンドでは、魅力的な利回りを有するCBからの収益を追求する投資アプローチを採用し、期を通じて魅力的な利回りを有するCBの組入れを高位に保ちました。また、為替については、期を通じて、外貨建資産に対し対円での為替ヘッジを行ったため、為替変動による影響は限定的でした。

国別配分

国別の投資配分は期を通じて米国が最大となりました。

業種別配分

業種別配分は、期を通じて金融、通信、消費（非景気循環型）などのセクターが概ね上位を占めました。期末時点における配分の上位3業種は、金融38.1%、通信13.2%、消費（非景気循環型）12.5%でした。

◆収益分配

当期の収益分配については、基準価額水準等を勘案して、見送りとさせていただきます。分配に充てなかった収益につきましては、信託財産に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

| 項 目 | 第1期 |
|-----------|-----------------------------|
| | 2016年11月28日～ 2017年11月27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 | 342 |

(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、上記の運用方針を堅持しながら、安定的な利子収入の確保とともに中長期的な信託財産の成長を目的とした投資を継続して参る所存です。

■ 1 万口当たりの費用明細

(2016年11月28日～2017年11月27日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|------|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信託報酬 | 102 | 1.010 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| (投信会社) | (66) | (0.648) | 委託した資金の運用の対価 |
| (販売会社) | (33) | (0.324) | 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、購入後の情報提供等の対価 |
| (受託会社) | (4) | (0.038) | 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 | 0.054 | (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) | (0.014) | 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・資産の移転等に係る費用 |
| (監査費用) | (2) | (0.016) | 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| (印刷) | (2) | (0.019) | 目論見書・運用報告書等の印刷・交付等に係る費用 |
| (その他) | (0) | (0.005) | 金融商品取引に要する諸費用 |
| 合 計 | 108 | 1.064 | |
| 期中の平均基準価額は、10,141円です。 | | | |

(注) 期中の費用（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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(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) 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、項目ごとに小数点以下第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11月28日～2017年11月27日)

新株予約権付社債(転換社債)

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|----|---------|--------|--------|-----------------|-----------------|
| | | 額 面 | 金 額 | 額 面 | 金 額 |
| 外国 | ア メ リ カ | 千ドル | 千ドル | 千ドル | 千ドル |
| | | 49,976 | 48,482 | 15,605 (350) | 15,998 (350) |

(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) 単位未満は切り捨て。

(注) ()内は予約権行使・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。

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|----|------|----------------|-------|-------|
| 外国 | アメリカ | 社債券(投資法人債券を含む) | 千ドル | 千ドル |
| | | | 2,525 | — |

(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) 単位未満は切り捨て。

(注) 社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等

(2016年11月28日～2017年11月27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

(2017年11月27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 |
| | 千ドル | 千ドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| ア メ リ カ | 36,421 | 35,835 | 4,001,372 | 99.8 | 44.4 | 7.1 | 49.6 | 43.1 |
| 合 計 | 36,421 | 35,835 | 4,001,372 | 99.8 | 44.4 | 7.1 | 49.6 | 43.1 |

(注) 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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 単位未満は切り捨て。

(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。

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 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 | |
| | | % | 千ドル | 千ドル | 千円 | |
| アメリカ | | | | | | |
| | 新株予約権付社債 (転換社債) | 0% RH 7/20 | 150 | 153 | 17,178 | 2020/7/15 |
| | | 0.25% CALATLANTIC 06/19 | 250 | 254 | 28,420 | 2019/6/1 |
| | | 0.25% SHUTTERFLY 05/18 | 200 | 197 | 22,038 | 2018/5/15 |
| | | 0.25% TEVA PHARM CO 2/26 | 300 | 255 | 28,515 | 2026/2/1 |
| | | 0.25% TWITTER, INC. 09/19 | 800 | 764 | 85,308 | 2019/9/15 |
| | | 0.75% ELECTRONICS 09/19 | 275 | 266 | 29,727 | 2019/9/1 |
| | | 0.75% INPHI CORPOR 09/21 | 250 | 263 | 29,380 | 2021/9/1 |
| | | 0.75% SUNPOWER CORP 6/18 | 400 | 393 | 43,938 | 2018/6/1 |
| | | 0.75% SYNCHRONOSS 8/19 | 300 | 278 | 31,111 | 2019/8/15 |
| | | 1% CARDTRONICS INC 12/20 | 500 | 444 | 49,584 | 2020/12/1 |
| | | 1% FIREEYE, INC 06/35 | 800 | 752 | 84,024 | 2035/6/1 |
| | | 1% WEB. COM GROUP 08/18 | 650 | 645 | 72,034 | 2018/8/15 |
| | | 1.125% YANDEX NV 12/18 | 700 | 700 | 78,162 | 2018/12/15 |
| | | 1.25% HURON CONSUL 10/19 | 600 | 567 | 63,311 | 2019/10/1 |
| | | 1.25% WHITING PETRO 4/20 | 450 | 404 | 45,128 | 2020/4/1 |
| | | 1.5% NEXTERA ENERGY 9/20 | 300 | 291 | 32,513 | 2020/9/15 |
| | | 1.5% SM ENERGY CO 07/21 | 350 | 330 | 36,882 | 2021/7/1 |
| | | 1.5% VERINT SYSTEM 06/21 | 500 | 492 | 54,992 | 2021/6/1 |
| | | 1.75% PANDORA MEDIA12/20 | 250 | 222 | 24,861 | 2020/12/1 |
| | | 1.875% JAZZ INVES 08/21 | 250 | 254 | 28,386 | 2021/8/15 |
| | | 2% ACETO CORPORATI 11/20 | 775 | 693 | 77,396 | 2020/11/1 |
| | | 2% AVID TECHNOLOGY 06/20 | 250 | 211 | 23,623 | 2020/6/15 |
| | | 2% CHART INDUSTRIES 8/18 | 800 | 802 | 89,607 | 2018/8/1 |
| | | 2% HERBALIFE LTD 08/19 | 300 | 301 | 33,665 | 2019/8/15 |
| | | 2.125% EZCORP, INC. 6/19 | 600 | 601 | 67,163 | 2019/6/15 |
| | | 2.25% VITAMIN SHOP 12/20 | 100 | 62 | 6,943 | 2020/12/1 |
| | | 2.375% SCORPIO TAN 7/19 | 500 | 439 | 49,025 | 2019/7/1 |
| | | 2.5% DEPOMED INC 09/21 | 350 | 268 | 29,994 | 2021/9/1 |
| | | 2.5% ECHO GLOBAL L 05/20 | 1,000 | 998 | 111,520 | 2020/5/1 |
| | | 2.5% KEYW HOLDING 07/19 | 500 | 447 | 50,002 | 2019/7/15 |
| | | 2.75% BROOKDALE SE 06/18 | 750 | 746 | 83,326 | 2018/6/15 |
| | | 2.75% SOLARCITY CORP11/18 | 275 | 271 | 30,341 | 2018/11/1 |
| | | 2.875% ENCORE CAPI 03/21 | 650 | 655 | 73,214 | 2021/3/15 |
| | | 2.875% SILVER STAND 2/33 | 400 | 386 | 43,184 | 2033/2/1 |
| | | 3% COWEN GROUP, INC 03/19 | 650 | 650 | 72,669 | 2019/3/15 |
| | | 3% PRA GROUP INC 8/20 | 650 | 619 | 69,131 | 2020/8/1 |
| | | 3% SEACOR HOLDINGS 11/28 | 600 | 555 | 61,971 | 2028/11/15 |
| | | 3.25% ENDOLOGIX 11/20 | 400 | 349 | 39,025 | 2020/11/1 |
| | | 3.25% NRG YIELD INC 6/20 | 700 | 700 | 78,162 | 2020/6/1 |
| | | 3.72% CEMEX SAB DE 3/20 | 275 | 288 | 32,203 | 2020/3/15 |
| | | 3.75% FORESTAR GROU 3/20 | 750 | 757 | 84,530 | 2020/3/1 |
| | | 3.75% TELIGENT, INC 12/19 | 550 | 483 | 54,005 | 2019/12/15 |
| | | 3.75% TITAN MACHINE 5/19 | 360 | 352 | 39,393 | 2019/5/1 |
| | | 3.75% VEREIT, INC. 12/20 | 800 | 828 | 92,454 | 2020/12/15 |

| 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 | | |
| % | 千ドル | 千ドル | 千円 | | | |
| アメリカ | | | | | | |
| 新株予約権付社債 (転換社債) | 3.75% SPIRIT REALTY 5/21 | 3.75 | 800 | 820 | 91,617 | 2021/5/15 |
| | 3.875% HCI GROUP 03/19 | 3.875 | 500 | 491 | 54,852 | 2019/3/15 |
| | 3.875% COLONY CAPITAL 1/21 | 3.875 | 900 | 903 | 100,933 | 2021/1/15 |
| | 4% PATTERN ENERGY G 7/20 | 4.0 | 300 | 304 | 34,042 | 2020/7/15 |
| | 4% PDL BIOPHARMA 02/18 | 4.0 | 786 | 786 | 87,764 | 2018/2/1 |
| | 4.25% HOSPITALITY P 2/21 | 4.25 | 400 | 415 | 46,356 | 2021/2/15 |
| | 4.25% CANADIAN SOLAR 2/19 | 4.25 | 300 | 291 | 32,576 | 2019/2/15 |
| | 4.375% ARES CAPITAL 1/19 | 4.375 | 800 | 817 | 91,226 | 2019/1/15 |
| | 4.5% DHT HOLDINGS 10/19 | 4.5 | 300 | 294 | 32,828 | 2019/10/1 |
| | 4.5% TPG SPECIALTY 12/19 | 4.5 | 550 | 567 | 63,370 | 2019/12/15 |
| | 4.75% PROSPECT CAPI 4/20 | 4.75 | 500 | 496 | 55,446 | 2020/4/15 |
| | 5% IAS OPER PARTNER 3/18 | 5.0 | 950 | 959 | 107,137 | 2018/3/15 |
| | 5% NEW MOUNTAIN FIN 6/19 | 5.0 | 600 | 617 | 68,964 | 2019/6/15 |
| | 5.25% TCPC 12/19 | 5.25 | 800 | 839 | 93,682 | 2019/12/15 |
| | 5.375% PENNYMAC CORP 5/20 | 5.375 | 875 | 861 | 96,175 | 2020/5/1 |
| | 5.5% BLACKROCK CAP 02/18 | 5.5 | 750 | 754 | 84,268 | 2018/2/15 |
| | 5.625% RWT HOLDINGS 11/19 | 5.625 | 750 | 765 | 85,524 | 2019/11/15 |
| | 5.75% PROSPECT CAPI 3/18 | 5.75 | 200 | 202 | 22,555 | 2018/3/15 |
| | 5.875% WEATHERFORD 07/21 | 5.875 | 300 | 304 | 33,958 | 2021/7/1 |
| | 6% RESOURCE CAPITAL 12/18 | 6.0 | 600 | 607 | 67,875 | 2018/12/1 |
| | 6.5% ARBOR REALTY 10/19 | 6.5 | 200 | 218 | 24,425 | 2019/10/1 |
| | 8.25% CLEARWIRE COMM 12/40 | 8.25 | 600 | 601 | 67,136 | 2040/12/1 |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 3.125% JD.COM 04/21 | 3.125 | 400 | 400 | 44,737 | 2021/4/29 |
| | 4.2% SYMANTEC CORP 09/20 | 4.2 | 400 | 413 | 46,128 | 2020/9/15 |
| | 4.625% INTL LEASE 04/21 | 4.625 | 400 | 423 | 47,252 | 2021/4/15 |
| | 5.4% ARCONIC INC 04/21 | 5.4 | 400 | 424 | 47,343 | 2021/4/15 |
| | 5.625% MDC HOLDING 02/20 | 5.625 | 400 | 422 | 47,120 | 2020/2/1 |
| | 5.7% CHOICE HOTELS 8/20 | 5.7 | 400 | 430 | 48,013 | 2020/8/28 |
| 合計 | | | | | 4,001,372 | |

(注) 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) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

■ 投資信託財産の構成

(2017年11月27日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 新株予約権付社債(転換社債) | 3,720,775 | 90.9 |
| 公 社 債 | 280,596 | 6.9 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 92,539 | 2.2 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 4,093,910 | 100.0 |

(注) 金額の単位未満は切り捨て。

(注) 当期末における外貨建て純資産(4,039,155千円)の投資信託財産総額(4,093,910千円)に対する比率は98.7%です。

(注) 外貨建て資産は、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。1ドル=111.66円。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年11月27日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 9,358,325,738円 |
| コール・ローン等 | 50,373,006 |
| 公社債(評価額) | 4,001,372,168 |
| 未 収 入 金 | 5,269,153,223 |
| 未 収 利 息 | 36,400,279 |
| 前 払 費 用 | 1,027,062 |
| (B) 負 債 | 5,348,826,482 |
| 未 払 金 | 5,309,117,659 |
| 未 払 解 約 金 | 16,785,509 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 22,228,647 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 694,667 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 4,009,499,256 |
| 元 本 | 3,879,328,089 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 130,171,167 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 3,879,328,089口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,336円 |

(注) 当ファンドの期首元本額は3,632,124,707円、期中追加設定元本額は1,246,616,929円、期中一部解約元本額は999,413,547円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は1.0336円です。

■損益の状況 (2016年11月28日～2017年11月27日)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|---------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 133,221,142円 |
| 受 取 利 息 | 133,100,838 |
| そ の 他 収 益 金 | 120,304 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 48,627,531 |
| 売 買 益 | 274,633,631 |
| 売 買 損 | △ 226,006,100 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 49,102,305 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 132,746,368 |
| (E) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 2,575,201 |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 2,575,201) |
| (F) 計 (D + E) | 130,171,167 |
| (G) 収 益 分 配 金 | 0 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (F + G) | 130,171,167 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 2,575,201 |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 2,575,201) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 132,746,368 |

(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を含めて表示しています。

(注) 損益の状況の中で(E)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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(97,248,793円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(35,497,575円)より分配対象収益は132,746,368円(10,000口当たり342円)ですが、当期に分配した金額はありません。

(注) 運用の指図に係る権限を委託するために要する費用として委託者報酬から支弁している額：信託財産の純資産総額に年0.37%を乗じて得た額

■分配金のお知らせ

当期の分配金はございません。