

## 運用報告書 (全体版)

第9期<決算日2022年9月20日>

### D I AM新興企業日本株オープン 米ドル型

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/国内/株式
信託期間	2013年9月18日から2028年9月19日までです。
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。
主要投資対象	わが国の株式を主要投資対象とします。また、外国為替予約取引等を活用します。
運用方法	<p>主として今後値上がりが見込める国内の新興企業<sup>(*)</sup>への投資を通じて、中長期的な信託財産の成長を目的として、積極的な運用を行います。</p> <p>(*) 当ファンドにおいて新興企業とは、優れた経営者のもとで新しいビジネスモデルや経営戦略を果敢に実行し付加価値の高い新商品を積極的に市場に投入するなどして、企業価値を増大させている(または今後の増大が見込める)と委託会社が考える企業をさします。</p> <p>徹底した企業分析、銘柄調査によって新興企業を厳選し、投資します。</p> <p>トップダウンアプローチにより現在の相場局面(リスクオン・オフ等)を判断し、これに応じた最適と考えられる業種や銘柄とその投資比率を決定します。</p> <p>株式の組入比率は、原則として高位を維持しますが、相場急落時等には、一時的に実質組入比率を下げる場合があります。</p> <p>円建て資産に対して、原則として円売り米ドル買いの為替取引を行い、米ドルの対円で為替益を追及します。為替取引を行うにあたっては、外国為替予約取引等を活用します。</p> <p>純資産総額に対する円売り米ドル買いの為替取引の時価比率は、原則として高位を維持します。</p>
組入制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>
分配方針	<p>決算日(原則として9月17日。休業日の場合は翌営業日。)に、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を分配対象額とし、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。</p>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「D I AM新興企業日本株オープン 米ドル型」は、2022年9月20日に第9期の決算を行いました。ここに、運用経過等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。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	(分配落)	税金 込み	騰落 率			
5期 (2018年9月18日)	円 13,616	円 500	% 22.0	% 87.5	% 10.2	百万円 17,015
6期 (2019年9月17日)	11,849	0	△13.0	90.6	8.8	11,606
7期 (2020年9月17日)	13,602	700	20.7	95.4	1.1	9,907
8期 (2021年9月17日)	17,028	1,000	32.5	93.9	1.0	10,198
9期 (2022年9月20日)	15,823	0	△7.1	71.3	12.0	8,161

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指標を定めておりません。

(注4) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

## ■当期中の基準価額の推移

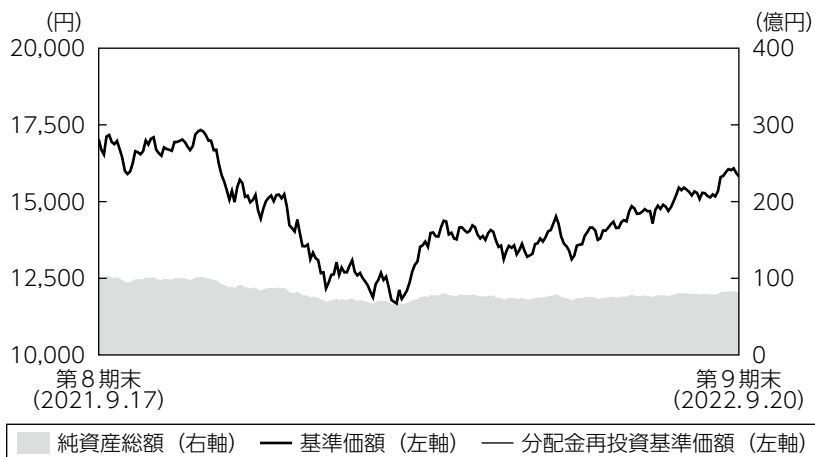
年月日	基準価額		株式組入率 比	株式先物率 比
		騰落率		
(期首) 2021年9月17日	円 17,028	% -	% 93.9	% 1.0
9月末	16,977	△0.3	92.8	0.2
10月末	16,656	△2.2	94.9	1.8
11月末	15,657	△8.1	97.8	1.9
12月末	15,108	△11.3	95.6	2.1
2022年1月末	12,607	△26.0	78.0	4.5
2月末	12,445	△26.9	73.9	7.3
3月末	13,870	△18.5	74.7	10.3
4月末	13,966	△18.0	72.0	7.2
5月末	13,640	△19.9	75.3	8.7
6月末	14,061	△17.4	71.4	8.5
7月末	14,688	△13.7	74.7	11.3
8月末	15,273	△10.3	72.5	12.6
(期末) 2022年9月20日	15,823	△7.1	71.3	12.0

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2021年9月18日から2022年9月20日まで）

### 基準価額等の推移

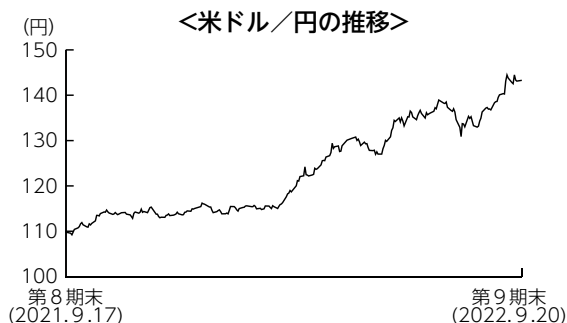


第9期首：17,028円  
第9期末：15,823円  
(既払分配金0円)  
騰落率：△7.1%  
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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はありません。
- (注2) 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、ファンドの購入価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。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

### 基準価額の主な変動要因

米国の金融引き締めへの警戒感の高まりやロシアのウクライナ侵攻などを背景に国内株式市場が下落したこと、エムスリーやペプチドリームなどの銘柄がマイナスに寄与したことなどから基準価額は下落しました。



### 投資環境

期初から2022年3月前半の局面では、インフレ進行を受けて米国において金融政策の引き締め転換が鮮明となったことに加え、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻が悪材料となり、リスク回避の動きが強まりました。その後は、急速な米国の金融引き締めに伴う景気後退リスクが懸念された一方で、為替市場で円安が進んだことによる企業業績の下支え期待などから、株価は概ね一進一退の動きとなりました。

為替市場は、F R B（米連邦準備理事会）が利上げを実施するなど金融引き締めを加速させた一方で、日銀が金融緩和姿勢を堅持したことで、日米の金融政策の方向性の違いが意識されて金利差

が拡大したことが米ドル高円安に繋がりました。ロシアのウクライナ侵攻やロシアへの経済制裁などから資源価格が高騰し、日本の貿易収支悪化の見通しが強まったことも円安進行の要因となりました。

## ポートフォリオについて

銘柄選択については、独力で成長を遂げると考える企業を中心に投資しました。「小売業」、「銀行業」などのウェイトを引き上げた一方で、バリュエーションとリスク管理の観点から「情報・通信業」、「電気機器」などのウェイトを引き下げました。

【運用状況】 (注1) 組入比率は純資産総額に対する割合です。  
(注2) 業種は東証33業種分類によるものです。

### ○組入上位10業種

期首 (前期末)

No.	業種	組入比率
1	情報・通信業	33.4%
2	サービス業	26.7
3	電気機器	10.0
4	精密機器	6.3
5	小売業	4.5
6	医薬品	4.4
7	不動産業	2.1
8	その他製品	1.4
9	空運業	1.1
10	金属製品	1.0



期末

No.	業種	組入比率
1	サービス業	21.4%
2	情報・通信業	18.6
3	電気機器	6.8
4	小売業	6.1
5	精密機器	4.0
6	医薬品	2.7
7	不動産業	2.7
8	銀行業	2.4
9	空運業	1.7
10	その他製品	1.3

### ○組入上位10銘柄

期首 (前期末)

No.	銘柄名	通貨	比率
1	エムスリー	日本・円	7.5%
2	リクルートホールディングス	日本・円	5.3
3	メドレー	日本・円	4.7
4	ソフトバンクグループ	日本・円	4.6
5	エイチ・アイ・エス	日本・円	4.6
6	ラクスル	日本・円	4.5
7	サイバーエージェント	日本・円	4.3
8	ペプチドリーム	日本・円	4.2
9	島津製作所	日本・円	3.8
10	パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	日本・円	3.8
組入銘柄数		99銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	日本・円	5.3%
2	エイチ・アイ・エス	日本・円	4.7
3	エムスリー	日本・円	4.5
4	メドレー	日本・円	4.4
5	島津製作所	日本・円	3.4
6	サイバーエージェント	日本・円	3.1
7	ペプチドリーム	日本・円	2.6
8	リゾートトラスト	日本・円	2.5
9	りそなホールディングス	日本・円	2.4
10	ビジョナル	日本・円	2.3
組入銘柄数		121銘柄	

## 分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益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す。

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2021年9月18日 ～2022年9月20日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－％
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	6,705円

(注1) 「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 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。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「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・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

### 今後の運用方針

株式市場において全般にバリュエーション調整がすすんだことから、株価の上値余地が拡大してきたものと考えます。投資妙味のある銘柄を見極めて、中長期にわたり高成長する銘柄のオーバーウェイトを継続することに加え、来期業績の大幅回復が見込め、かつ割安感の生じた銘柄の発掘を行うことにより運用パフォーマンスの向上を図ります。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第9期		項目の概要
	(2021年9月18日 ～2022年9月20日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	255円	1.752%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は14,543円です。
(投信会社)	(121)	(0.832)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(121)	(0.832)	販売会社分は、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等の対価
(受託会社)	( 13)	(0.089)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	7	0.047	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	( 7)	(0.045)	
(先物・オプション)	( 0)	(0.002)	
(c) その他費用	0	0.003	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(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かかる費用
(その他)	( 0)	(0.001)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	262	1.802	

(注1) 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・解約によって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。

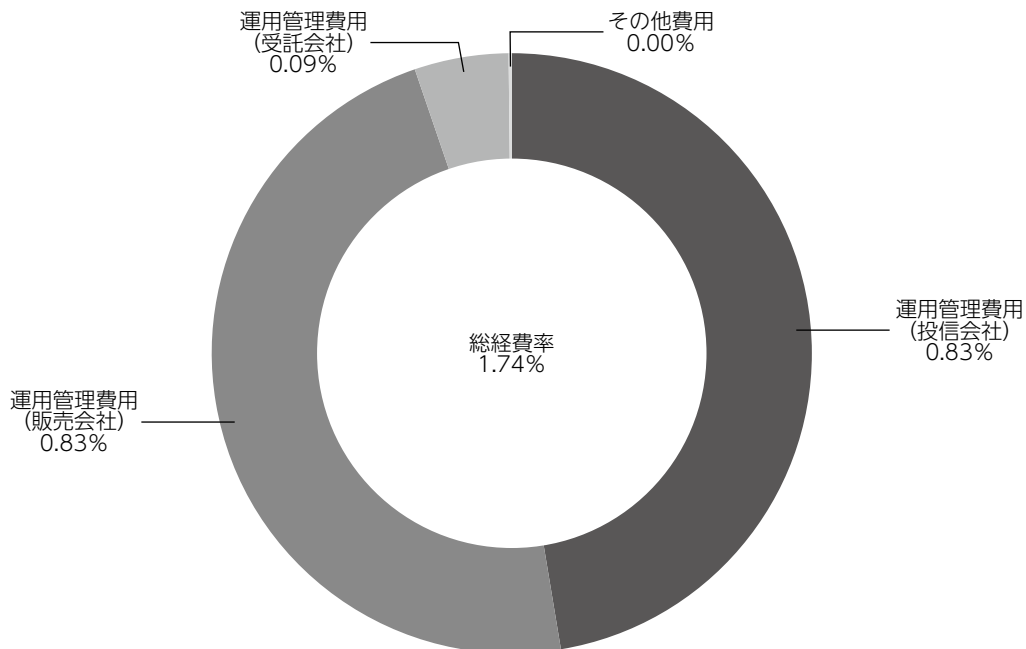
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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

当期中の運用・管理にかかった費用の総額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1.74%です。



(注1) 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異なります。

## ■売買及び取引の状況 (2021年9月18日から2022年9月20日まで)

### (1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場		千株 1,410.1 (156.53)	千円 3,003,410 (-)	千株 1,311.83	千円 3,860,156

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( ) 内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

### (2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円 4,075	百万円 3,209	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

## ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	6,863,567千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	6,711,026千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	1.02

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。



## ■利害関係人との取引状況等（2021年9月18日から2022年9月20日まで）

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 3,003	百万円 50	% 1.7	百万円 3,860	百万円 94	% 2.5
金 銭 信 託	0.199	0.199	100.0	0.199	0.199	100.0

### (2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 62

### (3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	3,790千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	57千円
(B) / (A)	1.5%

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、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほ信託銀行です。

## ■組入資産の明細

### (1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	
<b>建設業 (0.7%)</b>				
ライト工業	50	20	38,960	
<b>食料品 (0.2%)</b>				
ユーグレナ	16.6	10.8	9,622	
<b>医薬品 (3.8%)</b>				
モーせいグループ	—	6.6	12,579	
ペプチドリーム	111.1	127.7	208,278	
ヘリオス	9	9	2,718	
セルソース	—	0.1	419	
坪田ラボ	—	0.1	98	
<b>金属製品 (0.8%)</b>				
SUMCO	0.1	—	—	
リンナイ	7.7	4.4	46,596	
<b>機械 (0.6%)</b>				
日本製鋼所	—	11.9	36,235	
CKD	0.1	0.1	186	
THK	0.1	0.1	265	
<b>電気機器 (9.6%)</b>				
日本電産	0.1	0.1	918	
ソニーグループ	19.1	13.3	137,721	
TDK	2.2	—	—	
アルプスアルパイン	0.1	19.5	24,043	
アドバンテスト	—	0.1	741	
キーエンス	0.2	0.2	10,238	
シスメックス	19	15	123,165	
ローム	—	1	10,640	
浜松ホトニクス	39	14.2	90,028	
新光電気工業	—	5.5	20,102	
太陽誘電	—	0.1	414	
村田製作所	17.3	5.8	42,879	
SCREENホールディングス	—	0.1	901	
東京エレクトロン	—	2.3	94,392	
<b>輸送用機器 (0.0%)</b>				
SUBARU	0.1	0.1	254	
ヤマハ発動機	5.2	0.1	293	
<b>精密機器 (5.6%)</b>				
日機装	—	0.1	100	
島津製作所	71	71	274,415	
トプコン	81	6	10,836	
HOYA	5	3	43,455	
<b>その他製品 (1.9%)</b>				
イーディーピー	—	0.1	1,305	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	
ピジョン	51.1	51.1	108,229	
<b>海運業 (0.0%)</b>				
日本郵船	3.7	0.1	960	
<b>空運業 (2.4%)</b>				
ANAホールディングス	41.4	49.4	137,751	
<b>倉庫・運輸関連業 (0.0%)</b>				
三井倉庫ホールディングス	0.1	0.1	334	
<b>情報・通信業 (26.0%)</b>				
出前館	—	7.2	4,269	
グリー	—	32.6	28,036	
ポルトゥウィンホールディングス	7	—	—	
アイスタイル	24.2	27.7	14,404	
セレス	34.1	36.2	36,598	
GMOペイメントゲートウェイ	1	0.1	1,052	
インターネットイニシアティブ	5.1	5.1	24,352	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2.1	2.1	10,111	
クラウドワークス	24.9	23.9	38,550	
チェンジ	1.1	14.7	27,327	
ユーザベース	40.7	44.4	31,080	
PKSHA Technology	—	6.6	12,078	
マネーフォワード	6.6	5.5	18,535	
カラダノート	0.1	0.1	82	
SUN ASTERISK	0.1	—	—	
ニューラルポケット	0.1	0.1	104	
プラスアルファ・コンサルティング	1	0.1	238	
プレイド	9.9	15.7	8,870	
ヤプリー	6.6	9.2	12,052	
ENECHANGE	6.5	10.8	10,238	
アビリティ	0.1	—	—	
ココナラ	0.1	—	—	
APPIER GROUP	0.1	—	—	
スパイダープラス	2.7	2.9	2,253	
ビジョナル	30.4	21.3	190,422	
サインド	—	1.1	1,664	
セキュア	—	0.1	88	
シンプレクス・ホールディングス	13.8	—	—	
セーフィー	—	11.4	6,623	
くふうカンパニー	—	1.2	615	
CINC	—	0.9	1,282	
ラクスル	66.9	39.7	109,095	
メルカリ	0.1	18.2	39,166	
チームスピリット	7.1	7.1	3,152	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フレクト	—	0.1	210
Finatextホールディングス	—	33.3	14,585
スマレジ	25.2	15.2	19,440
カオナビ	9.6	9.9	25,938
Sansan	20	89.3	122,608
CHATWORK	1	3.5	1,288
HENNGE	23.6	30.5	28,029
BASE	138.2	46.3	14,214
マクアケ	0.4	2.8	4,365
メドレー	104.7	125.9	361,458
スペースマーケット	15	11.8	4,023
ロコガイド	0.3	—	—
フューチャー	7	14	22,638
大塚商会	21.1	21.1	94,211
サイボウズ	13.5	—	—
デジタルガレージ	31.4	17.9	66,230
ヌーラボ	—	2.5	1,497
UNERRY	—	0.3	538
EWELL	—	0.9	3,600
KADOKAWA	43.9	0.1	278
ソフトバンクグループ	70	17.5	96,547
<b>卸売業 (0.2%)</b>			
双日	—	3.8	8,926
<b>小売業 (8.6%)</b>			
ツルハホールディングス	3	3	24,390
クラシコム	—	19.1	20,303
HYUGA PRIMARY CARE	—	0.1	652
パシフィック・インターナショナルホールディングス	191	161	433,090
ユナイテッドアローズ	15.5	9.9	19,384
いづも	0.3	0.3	220
<b>銀行業 (3.4%)</b>			
新生銀行	0.1	—	—
三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.1	0.1	73
りそなホールディングス	0.1	354.4	196,160
三井住友フィナンシャルグループ	0.1	0.1	435
<b>証券・商品先物取引業 (1.5%)</b>			
GMOフィナンシャルホールディングス	9	9	6,669
SBIホールディングス	30.3	18.5	49,654
マネックスグループ	—	66.8	31,863
<b>保険業 (0.8%)</b>			
ライフネット生命保険	34.1	46	43,700
<b>その他金融業 (0.2%)</b>			
ネットプロテクションズホールディングス	—	24.4	11,224
<b>不動産業 (3.8%)</b>			
いちご	228.6	228.6	69,723

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ツクルバ	17.6	19.4	15,617
SREホールディングス	—	2.4	7,137
東急不動産ホールディングス	51.1	51.1	40,624
パーク24	26.2	26.2	54,207
東京建物	15.2	15.2	32,421
住友不動産	0.1	—	—
<b>サービス業 (30.1%)</b>			
パーソルホールディングス	68	62	172,546
ベネフィット・ワン	23.3	21.1	44,331
エムスリー	85.5	85.5	370,044
ラウンドワン	0.1	6.1	12,614
リゾートトラスト	86	86	206,916
サイバーエージェント	196	196	253,232
エン・ジャパン	0.1	0.1	238
アドベンチャー	—	10.1	120,291
リクルートホールディングス	77	39.6	174,358
ホープ	1.3	—	—
AIAIグループ	0.2	0.2	123
フォースタートアップス	0.4	0.4	1,246
グッドパッチ	0.5	0.5	417
RETTY	13.7	11.3	3,051
Enjin	0.1	—	—
AViC	—	0.3	370
エアークローゼット	—	6.2	4,309
エイチ・アイ・エス	198	172	385,108
共立メンテナンス	—	0.1	603
藤田観光	—	0.1	288
合 計	株 数 ・ 金 額	株 数	金 額
	2,740.2	2,995	5,820,697
	銘柄数<比率>	99銘柄	121銘柄 <71.3%>

(注1) 銘柄欄の( )内は、期末の国内株式評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

## (2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内	百万円	百万円
T O P I X	982	—

## ■投資信託財産の構成

2022年9月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	5,820,697千円	70.5%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,434,546	29.5
投 資 信 託 財 産 総 額	8,255,244	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年9月20日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	16,071,905,922円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,014,857,849
株 式(評価額)	5,820,697,780
未 収 入 金	8,197,419,293
未 収 配 当 金	2,466,000
差 入 委 託 証 拠 金	36,465,000
(B) 負 債	7,910,797,109
未 払 金	7,817,654,052
未 払 解 約 金	24,719,949
未 払 信 託 報 酬	68,361,764
そ の 他 未 払 費 用	61,344
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	8,161,108,813
元 本	5,157,642,133
次 期 繰 越 損 益 金	3,003,466,680
(D) 受 益 権 総 口 数	5,157,642,133口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	15,823円

(注) 期首における元本額は5,989,346,039円、当期中における追加設定元本額は8,826,262円、同解約元本額は840,530,168円です。

## ■損益の状況

当期 自2021年9月18日 至2022年9月20日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	50,756,581円
受 取 配 当 金	50,879,278
そ の 他 収 益	8,602
支 払 利 息	183,374
有 価 証 券 売 買 損 益	△314,673
(B) 有 価 証 券 買 入 損 益	△539,841,501
有 価 証 券 買 出 損 益	2,857,601,608
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△3,397,443,109
取 引 損 益	13,128,293
(D) 信 託 報 酬 等	87,267,814
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△74,139,521
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	△143,120,350
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	△619,076,977
(配 当 等 相 当 額)	3,292,251,348
(売 買 損 益 相 当 額)	330,292,309
(H) 合 計(E+F+G)	(166,183,873)
次 期 繰 越 損 益 金(H)	(164,108,436)
追 加 信 託 差 損 益 金	(164,108,436)
(配 当 等 相 当 額)	3,003,466,680
(売 買 損 益 相 当 額)	3,003,466,680
分 配 準 備 積 立 金	330,292,309
繰 越 損 益 金	(166,183,873)
	(164,108,436)
	3,292,251,348
	△619,076,977

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (D)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3) (G)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4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	166,183,873
(d) 分配準備積立金	3,292,251,348
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	3,458,435,221
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	6,705.46
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては、運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

## 《お知らせ》

### 約款変更のお知らせ

■信託期間を延長し、償還日を2028年9月19日とする変更を行いました。

(2022年6月18日)