

## 運用報告書 (全体版)

第26期<決算日2020年12月15日>

# DIAMストラテジックJ-REITファンド

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／不動産投信
信託期間	2008年2月20日から2023年2月20日までです。
運用方針	主として国内金融商品取引所に上場している不動産投資信託証券（以下「J-REIT」といいます。）に投資し、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うことを基本とします。
主要投資対象	国内金融商品取引所に上場している不動産投資信託証券および短期金融資産を主要投資対象とします。
運用方法	J-REITの個別銘柄の組入れにあたっては、銘柄毎の割安度を勘案した上で、ボトムアップリサーチに基づく定性判断により銘柄を選定します。 ポートフォリオの構築にあたっては、ファンド全体のリスク調整を行い、流動性を勘案した上で組入銘柄数と個別銘柄の組入比率を決定します。 J-REITの組入比率は、高位を維持すること（フルインベストメント）を基本とします。ただし、相場全体がフェアバリューから著しく乖離している局面などフルインベストメントが適当でないと思われる場合には、純資産総額の100%～70%の範囲内で組入比率を引き下げる場合があります。
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。 株式への直接投資は行いません。
分配方針	年2回の決算時（原則として6月15日および12月15日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等のうち、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。

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、「DIAMストラテジックJ-REITファンド」は、2020年12月15日に第26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			東証REIT指数		投資証券 組入比率	純資産額
	(分配落)	税金 込み 分配	期 騰 落 率	(配当込み) (参考指数)	期 騰 落 率		
22期 (2018年12月17日)	円 14,377	円 280	% 7.3	ポイント 3,615.41	% 6.4	% 97.8	百万円 7,480
23期 (2019年6月17日)	15,279	280	8.2	3,934.65	8.8	98.2	11,467
24期 (2019年12月16日)	16,637	290	10.8	4,360.66	10.8	97.5	12,496
25期 (2020年6月15日)	12,927	290	△20.6	3,448.87	△20.9	98.4	9,269
26期 (2020年12月15日)	13,794	280	8.9	3,689.90	7.0	98.8	8,067

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 東証REIT指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は、(株東京証券取引所)が有しています。なお、本商品は、(株東京証券取引所)により提供、保証または販売されるものではなく、(株東京証券取引所)は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません(以下同じ)。

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

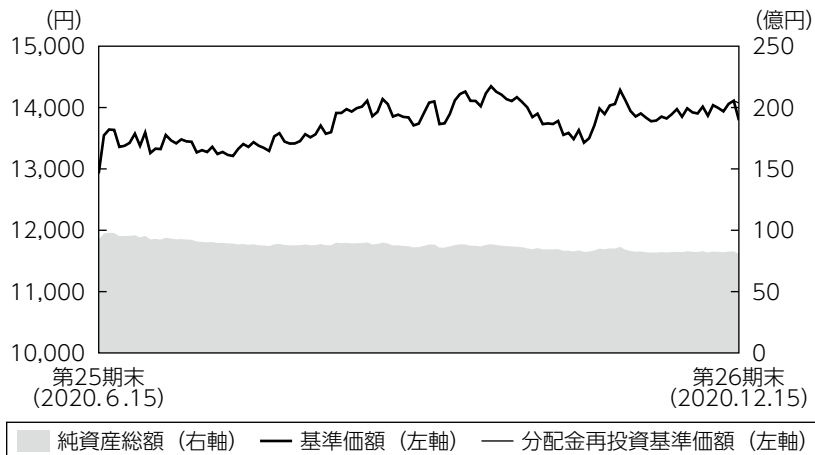
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		東証REIT指数		投資証券 組入比率
		騰落率	(配当込み) (参考指数)	騰落率	
(期首) 2020年6月15日	円 12,927	% -	ポイント 3,448.87	% -	% 98.4
6月末	13,330	3.1	3,525.99	2.2	96.2
7月末	13,343	3.2	3,535.10	2.5	97.0
8月末	14,111	9.2	3,735.15	8.3	97.3
9月末	14,109	9.1	3,698.94	7.3	97.4
10月末	13,428	3.9	3,512.43	1.8	97.3
11月末	13,851	7.1	3,635.82	5.4	96.7
(期末) 2020年12月15日	14,074	8.9	3,689.90	7.0	98.8

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

## ■当期の運用経過（2020年6月16日から2020年12月15日まで）

### 基準価額等の推移



第26期首：12,927円  
第26期末：13,794円  
(既払分配金280円)  
騰落率：8.9%  
(分配金再投資ベース)

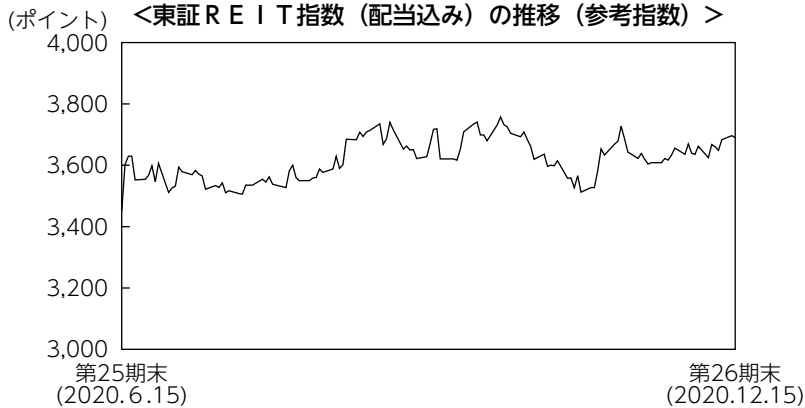
- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

### 基準価額の主な変動要因

世界的な金融緩和や景気対策により株式市場がリスクオンとなる中で、世界的な新型コロナウイルス感染拡大に伴う経済活動停滞からの回復やGo To政策効果を期待する動きから、J-R E I T市場も上昇したことが基準価額の上昇要因となりました。

## 投資環境

一部銘柄の大型増資による需給悪化やオフィス市況の悪化、新型コロナウイルス感染者数の再拡大などの悪材料による下落局面と、経済活動再開や政策サポートを好感した上昇局面が交錯する展開となる中で、J-R E I T市場は、期初から、東証R E I T指数で1,700ポイント前後の比較的狭いレンジ相場の展開が続きました。2020年11月以降、米国大統領選挙を経て不透明感が後退したことや新型コロナウイルスワクチン開発の進展報道からリスクオン相場となり、J-R E I T市場は上昇しました。

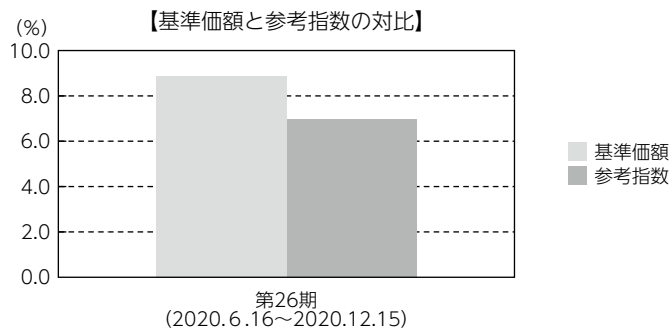


## ポートフォリオについて

コロナショックの影響の多寡から用途別の選好が激しく入れ替わる相場展開の中で、バリュエーション格差の縮小・拡大に合わせて、ウェイトを起動的に変動させました。特に、物流関連リートについては、原則強気で臨みましたが、バリュエーション格差が拡大しすぎた局面では、ウェイトの削減などを行いました。また、同一用途内で、相対的に割安だと考えられる銘柄のウェイトを引き上げた一方で、相対的に割高感が増した銘柄のウェイトを引き下げました。

## 参考指数との差異

当ファンドはベンチマークを定めておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数である東証REIT指数（配当込み）の騰落率の対比です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

## 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、以下の表の通り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
	2020年6月16日 ～2020年12月15日
当期分配金（税引前）	280円
対基準価額比率	1.99%
当期の収益	267円
当期の収益以外	12円
翌期繰越分配対象額	5,636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

J-REIT市場は、引き続き新型コロナウイルス感染者数の増減や経済活動の回復過程に加えて、各国の金融・財政政策などに左右される相場展開が続くと想定されます。個別銘柄は、キャッシュフローに基づく純資産価値から判断される相対的な割安感の有無に加えて、アフターコロナを見据え、環境変化に合わせた運営戦略を実行していけると考えられる銘柄を選好し、ウェイト格差をつけていく方針です。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第26期		項目の概要
	(2020年6月16日 ～2020年12月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	72円	0.524%	(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13,750円です。
(投信会社)	(34)	(0.248)	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)	(34)	(0.248)	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)	( 4)	(0.028)	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	3	0.022	(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
(投資証券)	( 3)	(0.022)	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
(c) その他費用	0	0.001	(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)	(0.001)	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
合計	75	0.546	

(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。

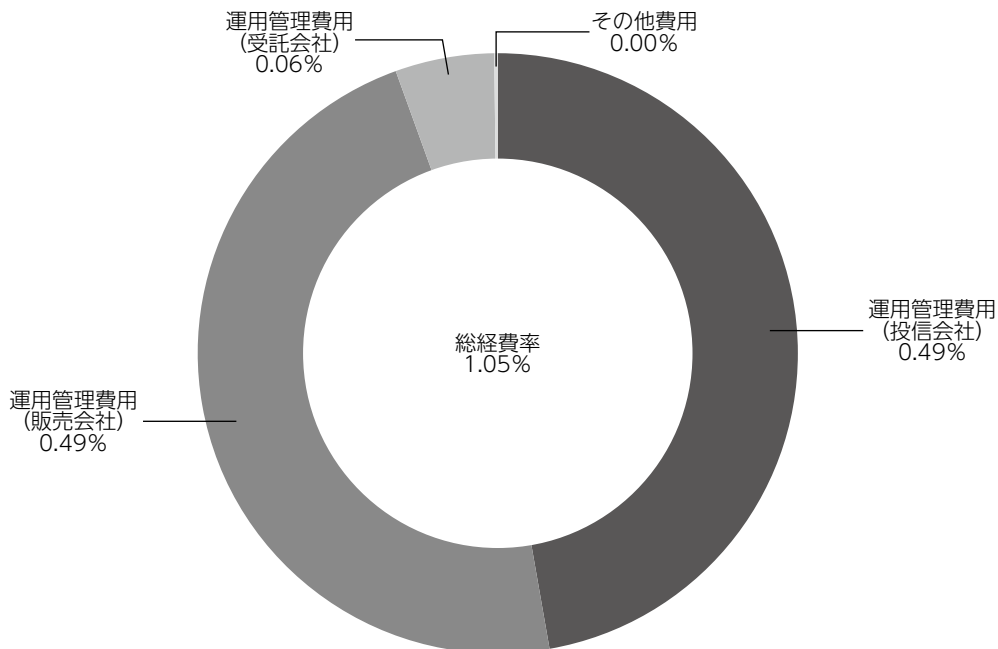
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.05%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 (2020年6月16日から2020年12月15日まで)  
投資証券

	買		付		売		付	
	口	数	金	額	口	数	金	額
国内		千口		千円		千口		千円
サンケイリアルエステート投資法人		-		-	0.028			2,771
		(-)		(-)	(-)			(-)
S O S I L A 物流リート投資法人	0.137		20,513		0.088			11,808
	(-)		(-)		(-)			(-)
MCUBS MidCity 投資法人		-		-	0.523			41,520
	(-)		(-)		(-)			(-)
森ヒルズリート投資法人	0.241		32,784		0.103			14,117
	(-)		(-)		(-)			(-)
アドバンス・レジデンス投資法人	0.035		10,522		0.181			58,216
	(-)		(-)		(-)			(-)
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	0.02		3,802		0.138			25,247
	(-)		(-)		(-)			(-)
アクティビア・プロパティーズ投資法人		-		-	0.327			127,400
	(-)		(-)		(-)			(-)
GLP 投資法人	0.546		88,669		0.877			142,913
	(-)		(-)		(-)			(-)
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		-		-	0.107			35,512
	(-)		(-)		(-)			(-)
日本プロロジスリート投資法人	0.012		4,276		0.34			117,080
	(-)		(-)		(-)			(-)
星野リゾート・リート投資法人	0.049		22,865		0.003			1,485
	(-)		(-)		(-)			(-)
イオンリート投資法人		-		-	0.902			106,321
	(-)		(-)		(-)			(-)
ヒューリックリート投資法人	0.102		14,872		0.178			23,593
	(-)		(-)		(-)			(-)
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人		-		-	2.107			29,427
	(-)		(-)		(-)			(-)
積水ハウス・リート投資法人		-		-	3.224			238,610
	(-)		(-)		(-)			(-)
ケネディクス商業リート投資法人	0.101		21,763		0.007			1,694
	(-)		(-)		(-)			(-)
ヘルスケア&メディカル投資法人		-		-	0.031			3,777
	(-)		(-)		(-)			(-)
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.017		1,830		0.082			8,446
	(-)		(-)		(-)			(-)
野村不動産マスターファンド投資法人	0.925		124,428		0.271			35,986
	(-)		(-)		(-)			(-)
ラサールロジポート投資法人		-		-	0.888			146,657
	(-)		(-)		(-)			(-)
スターアジア不動産投資法人		-		-	0.06258			5,591
	(0.43458)		(8,713)		(-)			(-)



	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.056	30,028	0.003	1,607
	(-)	(-)	(-)	(-)
さくら総合リート投資法人	-	-	0.047	3,730
	(△0.111)	(△8,713)	(-)	(-)
森トラスト・ホテルリート投資法人	-	-	0.101	11,228
	(-)	(-)	(-)	(-)
三菱地所物流リート投資法人	0.024	10,535	0.051	21,216
	(0.008)	(3,453)	(-)	(-)
三菱地所物流リート投資法人 新	0.008	3,453	-	-
	(△0.008)	(△3,453)	(-)	(-)
C R E ロジスティクスファンド投資法人	0.206	31,966	0.15	23,050
	(-)	(-)	(-)	(-)
ザイマックス・リート投資法人	-	-	0.147	13,264
	(-)	(-)	(-)	(-)
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.093	13,231	0.144	20,314
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本ビルファンド投資法人	-	-	0.3	181,819
	(-)	(-)	(-)	(-)
ジャパンリアルエステイト投資法人	0.13	68,871	0.104	57,626
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本リテールファンド投資法人	0.439	68,149	0.592	81,748
	(-)	(-)	(-)	(-)
オリックス不動産投資法人	0.413	62,549	1.206	186,764
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本プライムリアルティ投資法人	0.059	19,233	0.111	32,705
	(-)	(-)	(-)	(-)
プレミア投資法人	-	-	0.626	74,549
	(-)	(-)	(-)	(-)
東急リアル・エステート投資法人	0.563	82,654	0.172	25,519
	(-)	(-)	(-)	(-)
グローバル・ワン不動産投資法人	-	-	1.047	104,467
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユナイテッド・アーバン投資法人	-	-	1.159	136,439
	(-)	(-)	(-)	(-)
森トラスト総合リート投資法人	-	-	0.069	9,337
	(-)	(-)	(-)	(-)
インヴィンシブル投資法人	0.538	19,258	1.293	36,028
	(-)	(-)	(-)	(-)
フロンティア不動産投資法人	0.014	5,155	0.046	15,552
	(-)	(-)	(-)	(-)
平和不動産リート投資法人	0.039	4,337	0.238	26,619
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.09	27,239	0.14	41,895
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
福岡リート投資法人	0.013	1,730	0.148	19,683
	(-)	(-)	(-)	(-)
ケネディクス・オフィス投資法人	0.012	7,744	0.046	27,978
	(-)	(-)	(-)	(-)
いちごオフィスリート投資法人	-	-	0.28	20,596
	(-)	(-)	(-)	(-)
大和証券オフィス投資法人	0.05	28,556	0.023	14,482
	(-)	(-)	(-)	(-)
スターツプロシード投資法人	-	-	0.295	59,769
	(-)	(-)	(-)	(-)
大和ハウスリート投資法人	0.077	20,010	0.01	2,454
	(-)	(-)	(-)	(-)
ジャパン・ホテル・リート投資法人	0.097	4,452	1.738	80,912
	(-)	(-)	(-)	(-)
大和証券リビング投資法人	-	-	0.391	39,533
	(-)	(-)	(-)	(-)
ジャパンエクセレント投資法人	0.064	7,264	0.731	90,598
	(-)	(-)	(-)	(-)

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( ) 内は合併、分割等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## ■利害関係人との取引状況等（2020年6月16日から2020年12月15日まで）

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			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
投 資 証 券	百万円 862	百万円 32	% 3.8	百万円 2,639	百万円 238	% 9.0

### (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
投 資 証 券		百万円 16

### (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)	1,905千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	148千円
(B)/(A)	7.8%

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、みずほ証券です。

## ■組入資産の明細

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	期首(前期末)		当 期		末	
		□ 数	□ 数	□ 数	評 価 額	比	率
<b>不動産ファンド</b>		千□	千□	千円			%
サンケイリアルエステート投資法人		0.118	0.09	8,685			0.1
S O S I L A 物流リート投資法人		—	0.049	5,894			0.1
MCUB S M i d C i t y 投資法人		1.486	0.963	84,551			1.0
森ヒルズリート投資法人		0.695	0.833	114,704			1.4
アドバンス・レジデンス投資法人		1.318	1.172	351,014			4.4
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		0.638	0.52	92,612			1.1
アクティビア・プロパティーズ投資法人		1.104	0.777	319,347			4.0
G L P 投資法人		5.238	4.907	761,075			9.4
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		0.107	—	—			—
日本プロロジスリート投資法人		1.658	1.33	420,945			5.2
星野リゾート・リート投資法人		0.137	0.183	91,408			1.1
イオンリート投資法人		1.782	0.88	109,560			1.4
ヒューリックリート投資法人		0.178	0.102	14,790			0.2
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人		7.092	4.985	69,839			0.9
積水ハウス・リート投資法人		6.037	2.813	215,757			2.7
ケネディクス商業リート投資法人		—	0.094	22,804			0.3
ヘルスケア&メディカル投資法人		0.101	0.07	8,750			0.1
サムティ・レジデンシャル投資法人		0.103	0.038	3,944			0.0
野村不動産マスターファンド投資法人		2.048	2.702	375,307			4.7
ラサールロジポート投資法人		1.903	1.015	158,949			2.0
スターアジア不動産投資法人		0.299	0.671	32,577			0.4
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		—	0.053	26,553			0.3
さくら総合リート投資法人		0.158	—	—			—
森トラスト・ホテルリート投資法人		0.153	0.052	5,964			0.1
三菱地所物流リート投資法人		0.195	0.176	69,520			0.9
C R E ロジスティクスファンド投資法人		0.1	0.156	24,258			0.3
ザイマックス・リート投資法人		0.721	0.574	52,291			0.6
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人		0.253	0.202	26,138			0.3
日本ビルファンド投資法人		0.651	0.351	204,984			2.5
ジャパンリアルエステイト投資法人		1.064	1.09	615,850			7.6
日本リテールファンド投資法人		2.761	2.608	461,355			5.7
オリックス不動産投資法人		4.596	3.803	608,099			7.5
日本プライムリアルティ投資法人		0.109	0.057	18,838			0.2
プレミア投資法人		1.348	0.722	87,362			1.1
東急リアル・エステート投資法人		1.765	2.156	330,299			4.1
グローバル・ワン不動産投資法人		2.256	1.209	120,900			1.5
ユナイテッド・アーバン投資法人		3.033	1.874	235,749			2.9
森トラスト総合リート投資法人		0.069	—	—			—
インヴェンシブル投資法人		4.672	3.917	132,786			1.6
フロンティア不動産投資法人		0.114	0.082	31,898			0.4

銘 柄	期首(前期末)		当 期		末	
	□ 数	□ 数	□ 数	評 価 額	比 率	比 率
	千□	千□	千□	千円		%
平和不動産リート投資法人	1,246	1,047	1,047	124,488		1.5
日本ロジスティクスファンド投資法人	0,993	0,943	0,943	278,373		3.5
福岡リート投資法人	0,483	0,348	0,348	51,295		0.6
ケネディクス・オフィス投資法人	0,187	0,153	0,153	102,969		1.3
いちごオフィスリート投資法人	0,876	0,596	0,596	42,435		0.5
大和証券オフィス投資法人	0,663	0,69	0,69	425,730		5.3
スターツプロシード投資法人	0,96	0,665	0,665	128,278		1.6
大和ハウスリート投資法人	0,138	0,205	0,205	50,983		0.6
ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,518	2,877	2,877	153,344		1.9
大和証券リビング投資法人	2,432	2,041	2,041	186,343		2.3
ジャパンエクセレント投資法人	1,571	0,904	0,904	109,745		1.4
合 計	70,127	53,745	53,745	7,969,351		—
	□ 数 ・ 金 額 銘 柄 数 ・ 比 率	48銘柄<98.4%>	48銘柄<98.8%>	—		98.8

(注1) < >内は、期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

(注2) 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。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(注3) MCUBS MidCity投資法人、インヴィンシブル投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、ラサールロジポート投資法人、福岡リート投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、イオンリート投資法人、いちごオフィスリート投資法人、ジャパンエクセレント投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、積水ハウス・リート投資法人、平和不動産リート投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、CREロジスティクスファンド投資法人、ザイマックス・リート投資法人、伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人、サンケイリアルエステート投資法人、大和証券リビング投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人につきましては、委託会社の利害関係人（みずほ銀行、みずほ信託銀行、みずほ証券）が運用会社または一般事務受託会社となっています。（当該投資法人の直近の資産運用報告書より記載）

## ■投資信託財産の構成

2020年12月15日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	評 価 額	比 率	比 率
		千円		%
投 資 証 券	7,969,351			95.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	370,767			4.4
投 資 信 託 財 産 総 額	8,340,118			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

(2020年12月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	8,340,118,418円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	267,569,707
投 資 証 券(評価額)	7,969,351,000
未 収 入 金	48,614,471
未 収 配 当 金	54,583,240
(B) 負 債	272,257,640
未 払 金	1,715,361
未 払 収 益 分 配 金	163,764,450
未 払 解 約 金	60,936,802
未 払 信 託 報 酬	45,772,127
そ の 他 未 払 費 用	68,900
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	8,067,860,778
元 本	5,848,730,386
次 期 繰 越 損 益 金	2,219,130,392
(D) 受 益 権 総 口 数	5,848,730,386口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	13,794円

(注) 期首における元本額は7,171,035,424円、当期中における追加設定元本額は245,298,646円、同解約元本額は1,567,603,684円です。

## ■損益の状況

当期 自2020年6月16日 至2020年12月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	167,514,122円
受 取 配 当 金	167,562,540
受 取 利 息	87
支 払 利 息	△48,505
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	528,971,043
売 買 益	707,282,189
売 買 損	△178,311,146
(C) 信 託 報 酬 等	△45,841,027
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	650,644,138
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△1,083,012,310
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,815,263,014
(配 当 等 相 当 額)	(2,507,456,234)
(売 買 損 益 相 当 額)	(307,806,780)
(G) 合 計(D+E+F)	2,382,894,842
(H) 収 益 分 配 金	△163,764,450
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	2,219,130,392
追 加 信 託 差 損 益 金	2,815,263,014
(配 当 等 相 当 額)	(2,507,456,234)
(売 買 損 益 相 当 額)	(307,806,780)
分 配 準 備 積 立 金	789,403,645
繰 越 損 益 金	△1,385,536,267

(注1) (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2) (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3) (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	156,489,355円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	2,507,456,234
(d) 分 配 準 備 積 立 金	796,678,740
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	3,460,624,329
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	5,916.88
(g) 分 配 金	163,764,450
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	280

## ■分配金のお知らせ

**1万口当たり分配金 280円**

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

### 分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、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。
  - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
  - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎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、その後の受益者毎の個別元本となります。