

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／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2014年11月6日設定）	
運用方針	国内物価連動国債インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の物価連動国債に実質的な投資を行い、NOMURA 物価連動国債インデックス（フロアあり）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し債券の実質投資比率が100%を超える場合があります。	
主要運用対象	ベビード ファンド	国内物価連動国債インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、わが国の国債に直接投資することがあります。
	マザー ファンド	わが国の物価連動国債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビード ファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	マザー ファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	経費等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、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

eMAXIS
イーマックス

eMAXIS 国内物価連動国債インデックス

第3期（決算日：2017年1月26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、お手持ちの「eMAXIS 国内物価連動国債インデックス」は、去る1月26日に第3期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG

三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 URL:<http://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト URL:<http://emaxis.muam.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル **TEL. 0120-151034**

(9:00~17:00、土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)

お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

- ・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。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA 物価連動国債インデックス(フロアあり)		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配	み期騰落率	期騰落	中率			
(設定日)	円	円	%		%	%	%	百万円
2014年11月6日	10,000	—	—	107.50	—	—	—	350
1期(2015年1月26日)	9,721	0	△2.8	104.32	△3.0	98.2	—	882
2期(2016年1月26日)	9,529	0	△2.0	102.78	△1.5	99.6	—	984
3期(2017年1月26日)	9,489	0	△0.4	103.00	0.2	99.7	—	1,069

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) NOMURA 物価連動国債インデックス(フロアあり)とは、野村証券株式会社が発表している日本国が発行したフロアありの物価連動国債のパフォーマンスインデックスで、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA 物価連動国債インデックス(フロアあり)は野村証券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し、野村証券株式会社は一切関係ありません。

(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」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA 物価連動国債 インデックス(フロアあり)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2016年 1月26日	9,529	—	102.78	—	99.6	—
1 月 末	9,590	0.6	103.38	0.6	99.5	—
2 月 末	9,427	△1.1	101.72	△1.0	98.9	—
3 月 末	9,525	△0.0	102.68	△0.1	99.6	—
4 月 末	9,515	△0.1	102.75	△0.0	99.3	—
5 月 末	9,501	△0.3	102.68	△0.1	99.7	—
6 月 末	9,624	1.0	104.12	1.3	100.0	—
7 月 末	9,610	0.9	104.06	1.2	99.6	—
8 月 末	9,472	△0.6	102.53	△0.2	99.0	—
9 月 末	9,500	△0.3	102.82	0.0	99.1	—
10 月 末	9,499	△0.3	102.92	0.1	99.5	—
11 月 末	9,517	△0.1	103.14	0.4	99.2	—
12 月 末	9,571	0.4	103.86	1.1	99.3	—
(期 末) 2017年 1月26日	9,489	△0.4	103.00	0.2	99.7	—

(注) 騰落率は期首比。

(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」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第3期：2016/1/27～2017/1/26)

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ0.4%の下落となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(0.2%)を0.6%下回りました。



基準価額の主な変動要因

下落要因	信託報酬等の費用などが基準価額の下落要因となりました。
------	-----------------------------

投資環境について

(第3期：2016/1/27～2017/1/26)

◎物価連動国債市況

- ・2016年2月にかけて、原油価格の下落などを受けて期待インフレ率が低下し、物価連動国債市況も下落する局面があったものの、その後原油価格が反発したことなどから、期待インフレ率は上昇し、物価連動国債市況も上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

<eMAXIS 国内物価連動国債インデックス>

- ・当ファンドは、主として、国内物価連動国債インデックスマザーファンド受益証券に投資しており、これを通じてベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額は債券市況とほぼ同様の推移となりました。

<国内物価連動国債インデックスマザーファンド>

基準価額は期首に比べほぼ横ばいとなりました。

- ・資産のほぼ全額を債券に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・ベンチマーク採用全銘柄に投資することで、指数を模倣しました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

＜eMAXIS 国内物価連動国債インデックス＞
ベンチマークとのカイ離は、 $\Delta 0.6\%$ 程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

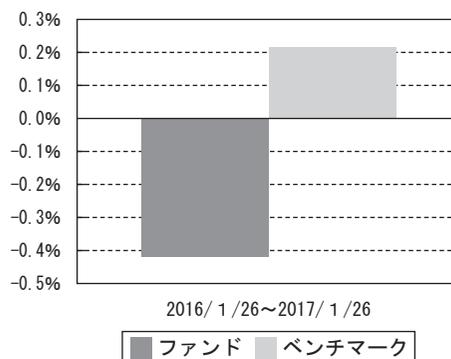
	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	$\Delta 0.4\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度	$\Delta 0.6\%$ 程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎マザーファンド保有以外の要因
ファンドの管理コスト等は $\Delta 0.4\%$ 程度でした。

◎マザーファンド保有による要因
マザーファンド保有による要因は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。

基準価額（ベビーファンド）と
ベンチマークの対比（騰落率）



＜国内物価連動国債インデックスマザーファンド＞
ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.2\%$ 程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	ポートフォリオ 要 因	取 引 要 因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	$\Delta 0.1\%$ 程度	$\Delta 0.1\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎ポートフォリオ要因
ポートフォリオによる影響は0.0%程度でした。
・公社債の組入比率については、期を通じて高位に保ち、ベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。
・ベンチマーク採用全銘柄に投資することでベンチマークとの連動性を維持するよう努めました。

◎取引要因
取引による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

◎評価時価差異に基づく要因
評価時価差異による影響は、 $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。
・保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる要因です。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

【分配原資の内訳】 (単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第3期
	2016年1月27日～2017年1月26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	1

(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

< eMAXIS 国内物価連動国債インデックス >

- ・ベンチマークであるNOMURA 物価連動国債インデックス（フロアあり）に連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を国内物価連動国債インデックスマザーファンド受益証券に投資し、高い実質公社債組入比率を維持します。

< 国内物価連動国債インデックスマザーファンド >

- ・ベンチマークであるNOMURA 物価連動国債インデックス（フロアあり）に連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を公社債に投資し、高い公社債組入比率を維持します。
- ・原則としてベンチマークの採用全銘柄へ投資し、指数を模倣します。

○1万口当たりの費用明細

(2016年1月27日～2017年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
(投 信 会 社)	(18)	(0.190)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(18)	(0.190)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(5)	(0.054)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	0	0.003	(b) 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)	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	41	0.438	
期中の平均基準価額は、9,529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) 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1月27日～2017年1月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内物価連動国債インデックスマザーファンド	千口 503, 018	千円 484, 252	千口 414, 615	千円 399, 789

○利害関係人との取引状況等

(2016年1月27日～2017年1月26日)

利害関係人との取引状況

< eMAXIS 国内物価連動国債インデックス >

該当事項はございません。

< 国内物価連動国債インデックスマザーファンド >

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	%	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	%
公社債	百万円 588	百万円 67	11.4	百万円 501	百万円 21	4.2

平均保有割合 100.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

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菱UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 340	百万円 -	百万円 -	百万円 340	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2017年1月26日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
国内物価連動国債インデックスマザーファンド	千口 1,028,035	千口 1,116,439	千円 1,069,660

マザーファンドの組入資産の明細につきましては、マザーファンド頁をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内物価連動国債インデックスマザーファンド	千円 1,069,660	% 99.5
コール・ローン等、その他	5,412	0.5
投資信託財産総額	1,075,072	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,075,072,328
コール・ローン等	2,957,711
国内物価連動国債インデックスマザーファンド(評価額)	1,069,660,617
未収入金	2,454,000
(B) 負債	5,250,304
未払解約金	3,017,990
未払信託報酬	2,217,950
未払利息	4
その他未払費用	14,360
(C) 純資産総額(A-B)	1,069,822,024
元本	1,127,389,969
次期繰越損益金	△ 57,567,945
(D) 受益権総口数	1,127,389,969口
1万口当たり基準価額(C/D)	9.489円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,033,637,089円
 期中追加設定元本額 803,219,220円
 期中一部解約元本額 709,466,340円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9489円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は57,567,945円です。

③分配金の計算過程

項 目	2016年1月27日～ 2017年1月26日
費用控除後の配当等収益額	—円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	—円
収益調整金額	212,678円
分配準備積立金額	—円
当ファンドの分配対象収益額	212,678円
1万口当たり収益分配対象額	1円
1万口当たり分配金額	—円
収益分配金金額	—円

○損益の状況 (2016年1月27日～2017年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	13,373
受取利息	44
その他収益金	14,414
支払利息	△ 1,085
(B) 有価証券売買損益	△ 1,695,489
売買益	3,527,087
売買損	△ 5,222,576
(C) 信託報酬等	△ 4,456,689
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 6,138,805
(E) 前期繰越損益金	△12,732,159
(F) 追加信託差損益金	△38,696,981
(配当等相当額)	(154,370)
(売買損益相当額)	(△38,851,351)
(G) 計(D+E+F)	△57,567,945
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△57,567,945
追加信託差損益金	△38,696,981
(配当等相当額)	(212,678)
(売買損益相当額)	(△38,909,659)
繰越損益金	△18,870,964

- (注) (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) (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) (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。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<http://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お 知 ら せ】

- ①信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める（分散型に分類）ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2016年10月18日)
- ②純資産残高増大に応じた信託報酬率の引き下げを行うため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2016年10月18日)
- ③2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。

国内物価連動国債インデックスマザーファンド

《第3期》決算日2017年1月26日

〔計算期間：2016年1月27日～2017年1月26日〕

「国内物価連動国債インデックスマザーファンド」は、1月26日に第3期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第3期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	主としてわが国の物価連動国債に投資を行い、NOMURA 物価連動国債インデックス（フロアあり）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 物価連動国債の組入比率は原則として高位を保ちます。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し債券の実質投資比率が100%を超える場合があります。
主 要 運 用 対 象	わが国の物価連動国債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	外貨建資産への投資は行いません。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		NOMURA 物価連動国債 インデックス(フロアあり)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
(設定日)	円	%		%	%	%	百万円
2014年11月6日	10,000	—	107.50	—	—	—	349
1期(2015年1月26日)	9,730	△2.7	104.32	△3.0	98.2	—	882
2期(2016年1月26日)	9,579	△1.6	102.78	△1.5	99.6	—	984
3期(2017年1月26日)	9,581	0.0	103.00	0.2	99.8	—	1,069

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) NOMURA 物価連動国債インデックス（フロアあり）とは、野村證券株式会社が発表している日本国が発行したフロアありの物価連動国債のパフォーマンスインデックスで、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA 物価連動国債インデックス（フロアあり）は野村證券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA 物価連動国債 インデックス(フロアあり)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2016年1月26日	円	%		%	%	%
	9,579	—	102.78	—	99.6	—
1月末	9,641	0.6	103.38	0.6	99.5	—
2月末	9,481	△1.0	101.72	△1.0	98.9	—
3月末	9,583	0.0	102.68	△0.1	99.6	—
4月末	9,576	△0.0	102.75	△0.0	99.3	—
5月末	9,566	△0.1	102.68	△0.1	99.7	—
6月末	9,693	1.2	104.12	1.3	100.0	—
7月末	9,682	1.1	104.06	1.2	99.6	—
8月末	9,547	△0.3	102.53	△0.2	99.0	—
9月末	9,578	△0.0	102.82	0.0	99.1	—
10月末	9,581	0.0	102.92	0.1	99.5	—
11月末	9,603	0.3	103.14	0.4	99.2	—
12月末	9,660	0.8	103.86	1.1	99.4	—
(期 末) 2017年1月26日	9,581	0.0	103.00	0.2	99.8	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べほぼ横ばいとなりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(0.2%)を0.2%下回りました。

基準価額の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

◎物価連動国債市況

- ・2016年2月にかけて、原油価格の下落などを受けて期待インフレ率が低下し、物価連動国債市況も下落する局面があったものの、その後原油価格が反発したことなどから、期待インフレ率は上昇し、物価連動国債市況も上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を債券に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・ベンチマーク採用全銘柄に投資することで、指数を模倣しました。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.2\%$ 程度と低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

	ポートフォリオ要因	取引要因	評価時価差異に基づく要因	合計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	$\Delta 0.1\%$ 程度	$\Delta 0.1\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎ポートフォリオ要因

- ・ポートフォリオによる影響は0.0%程度でした。
- ・公社債の組入比率については、期を通じて高位に保ち、ベンチマークとの連動性を高めるよう努めました。
- ・ベンチマーク採用全銘柄に投資することでベンチマークとの連動性を維持するよう努めました。

◎取引要因

取引による影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

◎評価時価差異に基づく要因

- ・評価時価差異による影響は、 $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。
- ・保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる要因です。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークであるNOMURA 物価連動国債インデックス（フロアあり）に連動する投資成果をめざすべく、ファンドの資産のほぼ全額を公社債に投資し、高い公社債組入比率を維持します。
- ・原則としてベンチマークの採用全銘柄へ投資し、指数を模倣します。

○1万口当たりの費用明細

(2016年1月27日～2017年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、9,599円です。			

(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) 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1月27日～2017年1月26日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国内	国債証券	千円 588,756	千円 501,589

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2016年1月27日～2017年1月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 588	百万円 67	% 11.4	百万円 501	百万円 21	% 4.2

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

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菱UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2017年1月26日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)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		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	1,010,000 (1,010,000)	1,067,065 (1,067,065)	99.8 (99.8)	— (—)	99.8 (99.8)	— (—)	— (—)
合 計	1,010,000 (1,010,000)	1,067,065 (1,067,065)	99.8 (99.8)	— (—)	99.8 (99.8)	— (—)	— (—)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(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。

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期			末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千円	千円		
国債証券					
第17回利付国債(物価連動・10年)	0.1	108,000	115,967	2023/9/10	
第18回利付国債(物価連動・10年)	0.1	137,000	146,460	2024/3/10	
第19回利付国債(物価連動・10年)	0.1	184,000	192,702	2024/9/10	
第20回利付国債(物価連動・10年)	0.1	359,000	377,629	2025/3/10	
第21回利付国債(物価連動・10年)	0.1	222,000	234,305	2026/3/10	
合 計		1,010,000	1,067,065		

○投資信託財産の構成

(2017年1月26日現在)

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
	千円	%	千円	%
公社債	1,067,065	99.5		
コール・ローン等、その他	5,007	0.5		
投資信託財産総額	1,072,072	100.0		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,072,072,233
コール・ローン等	4,624,625
公社債(評価額)	1,067,065,227
未収利息	329,279
前払費用	53,102
(B) 負債	2,454,006
未払解約金	2,454,000
未払利息	6
(C) 純資産総額(A-B)	1,069,618,227
元本	1,116,439,430
次期繰越損益金	△ 46,821,203
(D) 受益権総口数	1,116,439,430口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,581円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,028,035,835円
 期中追加設定元本額 503,018,934円
 期中一部解約元本額 414,615,339円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9581円です。

- ②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)
 eMAXIS 国内物価連動国債インデックス 1,116,439,430円
 ③純資産総額が元本額を下回っており、その差額は46,821,203円です。

【お 知 ら せ】

信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める(分散型に分類)ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2016年7月1日)

○損益の状況 (2016年1月27日～2017年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	961,922
受取利息	966,123
支払利息	△ 4,201
(B) 有価証券売買損益	△ 601,607
売買益	2,465,419
売買損	△ 3,067,026
(C) 保管費用等	△ 12
(D) 当期損益金(A+B+C)	360,303
(E) 前期繰越損益金	△43,240,911
(F) 追加信託差損益金	△18,766,934
(G) 解約差損益金	14,826,339
(H) 計(D+E+F+G)	△46,821,203
次期繰越損益金(H)	△46,821,203

- (注) (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) (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) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。