

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	
信託期間	無期限（1961年4月24日設定）	
運用方針	わが国の公社債および公社債投信マザーファンド受益証券へ投資し、NOMURA-BPI短期インデックスをベンチマークとして、利子等収益の確保および売買益の獲得をめざします。	
主要運用対象	ベビーフンド	わが国の公社債および公社債投信マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	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	毎決算時に、運用収益（純資産総額が当該元本の額（1万円当たり1万円）を超過する額）の全額を分配します。	

※当ファンドは、課税上、公社債投資信託として取り扱われます。

## 運用報告書（全体版）

# 追加型・公社債証券投資信託 （4月設定） 公社債投信（4月号）



第56期（決算日：2017年4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御礼申し上げます。  
さて、お手持ちの「追加型・公社債証券投資信託（4月設定）」は、去る4月19日に第56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。



### 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/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客様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)  
お客様の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。

## ○最近3期の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI 短期インデックス		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配	み 金 騰 落	期 騰 落	中 騰 落 率			
54期(2015年4月20日)	円 10,000	円 20.26	銭 0.2	235.78	% 0.3	% 98.4	% —	百万円 1,061
55期(2016年4月19日)	10,000	19.64	0.2	236.77	0.4	98.6	—	939
56期(2017年4月19日)	10,000	12.08	0.1	236.35	△0.2	99.3	—	872

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) NOMURA-BPI短期インデックスとは、NOMURA-BPI総合インデックスのサブインデックスで、残存期間1年から3年の債券で構成されています。NOMURA-BPI総合インデックスは、野村証券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、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-BPI総合インデックスおよびNOMURA-BPI短期インデックス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合わせるので、「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。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額		NOMURA-BPI 短期インデックス		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2016年4月19日	円 10,000	銭 —	236.77	% —	% 98.6	% —
4月末	9,994	△0.1	236.72	△0.0	99.0	—
5月末	9,999	△0.0	236.69	△0.0	98.2	—
6月末	10,010	0.1	236.88	0.0	98.9	—
7月末	10,000	0.0	236.69	△0.0	97.5	—
8月末	9,998	△0.0	236.43	△0.1	98.9	—
9月末	10,014	0.1	236.78	0.0	99.0	—
10月末	10,005	0.1	236.57	△0.1	99.3	—
11月末	9,989	△0.1	236.27	△0.2	98.7	—
12月末	9,998	△0.0	236.32	△0.2	98.9	—
2017年1月末	10,001	0.0	236.33	△0.2	98.7	—
2月末	10,009	0.1	236.48	△0.1	98.3	—
3月末	10,006	0.1	236.33	△0.2	99.0	—
(期末) 2017年4月19日	10,012.08	0.1	236.35	△0.2	99.3	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み合わせるので、「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。

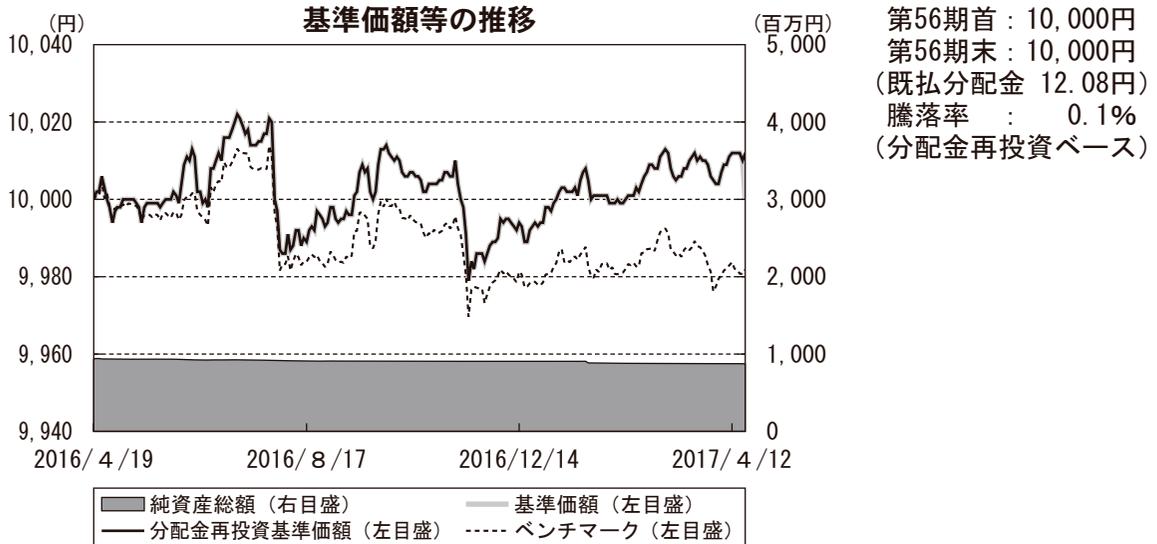
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## 運用経過

### 当期中の基準価額等の推移について

（第56期：2016/4/20～2017/4/19）

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ0.1%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。
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0.3%上回りました。



- ・分配金再投資基準価額は、収益分配金（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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- ・実際のファンドにおいては、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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なるため、お客さまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

### 基準価額の主な変動要因

上昇要因	債券利子収入を享受した他、中短期ゾーンの国内金利がマイナスで推移するなか、プラス利回りの事業債を多く保有したことなどが基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	国内金利が上昇したこと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56期：2016/4/20～2017/4/19）

- ・国内金利は、期初は横ばいで推移していましたが、2016年6月に英国の欧州連合離脱を巡る国民投票で離脱派が勝利したことによる景気の先行き不透明感や、日本銀行による追加緩和期待などから低下しました。その後、7月末の日銀金融政策決定会合にて、金融緩和の強化が決定されたものの、マイナス金利の深掘りがされなかったことや、11月に米国金利が上昇したことなどから国内金利は上昇し、前期末比金利は上昇して期末を迎えました。こうしたなか、事業債の国債とのスプレッド（利回り格差）は、前記の金利低下局面では拡大していましたが、7月末の日銀金融政策決定会合以降の金利上昇局面では縮小し、前期末と比べてスプレッドは縮小しました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

### <追加型・公社債証券投資信託（4月設定）>

- ・主要投資対象である公社債投信マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の安全性の高い公社債を高位に組み入れた運用を行いました。

### <公社債投信マザーファンド>

基準価額は期首に比べ0.3%の上昇となりました。

#### ◎組入比率

- ・期を通じて高位組み入れを維持しました。

#### ◎債券種別構成

- ・国内金利の低位安定推移を見込み、利回り向上の観点から一般債をオーバーウェイトとしました。

#### ◎デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

- ・短期金利は横ばい圏で推移すると判断し中立としていましたが、2016年9月に日本銀行の緩和的スタンスの継続からデュレーションをベンチマーク対比長めとしました。

#### ◎残存期間構成

- ・利回り向上の観点から中期ゾーンをオーバーウェイトとしました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

＜追加型・公社債証券投資信託（４月設定）＞

- ・当期の基準価額騰落率はベンチマークであるNOMURA-BPI短期インデックスを0.3%上回りました。

＜公社債投信マザーファンド＞

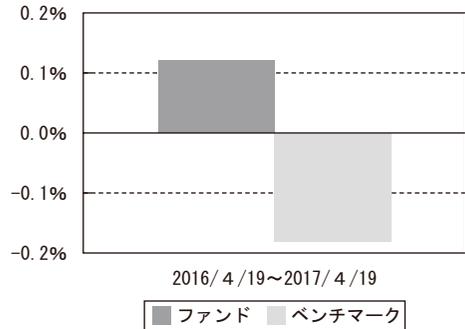
- ・ファンドの騰落率は、ベンチマークであるNOMURA-BPI短期インデックスを0.5%上回りました。

- ・この主な要因は、次の通りです。  
（プラス要因）

◎債券種別構成

- ・国内金利の中短期ゾーンがマイナスで推移するなか、プラス利回りの一般債をベンチマーク対比でオーバーウェイトとしていたこと。

基準価額（ペビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



・ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

## 分配金について

当期の収益分配金（元本超過額）は当ファンドの分配方針に基づきまして、12円08銭（1万口当たり）とさせていただきます。

## 今後の運用方針

<追加型・公社債証券投資信託（4月設定）>

### ◎今後の運用方針

- ・公社債投信マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保ち、マザーファンドのポートフォリオの構成に近づけた状態を維持する方針です。

<公社債投信マザーファンド>

### ◎運用環境の見通し

- ・雇用環境は着実な改善を続けており、企業の設備投資も緩やかな増加基調にあります。また、輸出・生産も持ち直してきていますが、個人消費が盛り上がり欠けることから、本邦景気の回復は緩やかなものになると思われます。
- ・「物価安定の目標」の実現に向けて、日本銀行は引き続き金融緩和姿勢をもって臨むものと思われ、中短期金利は低位での推移を想定します。
- ・国内事業債のスプレッドについては、日本銀行の社債買入オペや投資家の資金余剰感などによる良好な需給環境を背景に概ね横ばい圏で推移し、事業債は国債と異なりプラス利回りを維持できると予想します。

### ◎今後の運用方針

- ・安定した利子収益確保をめざし、債券組入比率は引き続き高位に維持する方針です。
- ・ファンド全体のデュレーションは、中短期ゾーンの金利が低位安定すると判断し、ベンチマーク対比長めを基本に調整する方針です。
- ・債券種別構成は、流動性や銘柄分散に留意しつつ、一般債の組入比率をベンチマーク比高めに維持します。

## ○1万口当たりの費用明細

(2016年4月20日～2017年4月19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=1万口当たり元本×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
( 投 信 会 社 )	( 4 )	(0.038)	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 )	(10)	(0.101)	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 )	( 1 )	(0.011)	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
合 計	15	0.153	
期中の平均基準価額は、10,001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4月20日～2017年4月19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
公社債投信マザーファンド	千口 2,456	千円 2,676	千口 63,945	千円 69,724

## ○利害関係人との取引状況等

(2016年4月20日～2017年4月19日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;追加型・公社債証券投資信託（4月設定）公社債投信（4月号）&gt;

該当事項はございません。

## &lt;公社債投信マザーファンド&gt;

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 5,759	百万円 705	% 12.2	百万円 6,362	百万円 1,500	% 23.6

平均保有割合 9.0%

※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みません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt;公社債投信マザーファンド&gt;

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 201	百万円 100	百万円 1,033

## 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

## &lt;公社債投信マザーファンド&gt;

種 類	買 付 額
公社債	百万円 1,300

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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJリース、アコムです。

## ○組入資産の明細

(2017年4月19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
		千口	千口	千円
公社債投信マザーファンド		860,500	799,011	872,600

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4月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債投信マザーファンド	872,600	99.5
コール・ローン等、その他	4,703	0.5
投資信託財産総額	877,303	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年4月19日現在）

項目	当期末
	円
(A) 資産	877,303,057
コール・ローン等	4,691,969
公社債投信マザーファンド(評価額)	872,600,111
未収入金	10,977
(B) 負債	4,451,344
未払収益分配金	1,054,404
未払解約金	2,010,951
未払信託報酬	1,360,629
未払利息	8
その他未払費用	25,352
(C) 純資産総額(A-B)	872,851,713
元本	872,851,500
次期繰越損益金	213
(D) 受益権総口数	872,851,500口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,000円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 939,181,578円  
 期中追加設定元本額 2,957,045円  
 期中一部解約元本額 69,287,123円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0000円です。

## ②分配金の計算過程

決算期末における運用収益（純資産総額の元本超過額）の全額を分配金額としております。ただし、分配金額は1万口当たりの分配金単価を銭未満で切捨てて算出しているため、若干の繰越金を生じます。

第56期

計算期間末における純資産総額の元本超過額1,054,617円を分配対象収益とし、1,054,404円（1万口当たり12.08円）を分配金額としております。

## ○損益の状況（2016年4月20日～2017年4月19日）

項目	当期
	円
(A) 受取利息等収益	△ 1,777
支払利息	△ 1,777
(B) 有価証券売買損益	2,477,813
売買益	2,481,823
売買損	△ 4,010
(C) 信託報酬等	△1,385,981
(D) 当期利益(A+B+C)	1,090,055
(E) 前期繰越損益金	2,473
(F) 追加信託差損益金	△ 2,059
(G) 解約差損益金	△ 35,852
(H) 計(D+E+F+G)	1,054,617
(I) 収益分配金	△1,054,404
次期繰越損益金(H+I)	213

(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。

## ○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金（税込み）	12円08銭
----------------	--------

◆分配金は決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、2017年4月19日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

・個人受益者が支払いを受ける収益分配金については利子所得として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収されます。法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

\*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7月15日）
- ②個人受益者は、収益分配金ならびに解約時および償還時の差益（譲渡益）に対し、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で課税されます。法人受益者は15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。

## 公社債投信マザーファンド

### 《第16期》決算日2017年4月19日

[計算期間：2016年4月20日～2017年4月19日]

「公社債投信マザーファンド」は、4月19日に第16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16期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	信託財産の安定的な成長をめざします。わが国の公社債へ投資し、NOMURA-BPI 短期インデックスをベンチマークとして、利子等収益の確保および売買益の獲得をめざします。公社債組入比率の調整のためおよび価格変動リスクを回避するために債券先物取引、債券先物オプション取引等を利用する場合があります。
主 要 運 用 対 象	わが国の公社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。

### ○最近3期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		NOMURA-BPI 短期インデックス		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
14期(2015年4月20日)	10,853	0.4	235.78	0.3	98.6	—	12,252
15期(2016年4月19日)	10,891	0.4	236.77	0.4	98.8	—	10,330
16期(2017年4月19日)	10,921	0.3	236.35	△0.2	99.4	—	9,611

(注) NOMURA-BPI 短期インデックスとは、NOMURA-BPI 総合インデックスのサブインデックスで、残存期間1年から3年の債券で構成されています。NOMURA-BPI 総合インデックスは、野村証券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、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-BPI 総合インデックスおよび NOMURA-BPI 短期インデックス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) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 短 期 イ ン デ ッ ク ス		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 4月19日	円	%		%	%	%
	10,891	—	236.77	—	98.8	—
4 月 末	10,885	△0.1	236.72	△0.0	99.0	—
5 月 末	10,892	0.0	236.69	△0.0	98.4	—
6 月 末	10,905	0.1	236.88	0.0	99.1	—
7 月 末	10,896	0.0	236.69	△0.0	97.7	—
8 月 末	10,895	0.0	236.43	△0.1	99.1	—
9 月 末	10,914	0.2	236.78	0.0	99.2	—
10 月 末	10,905	0.1	236.57	△0.1	99.6	—
11 月 末	10,889	△0.0	236.27	△0.2	99.0	—
12 月 末	10,901	0.1	236.32	△0.2	99.2	—
2017年 1 月 末	10,905	0.1	236.33	△0.2	99.0	—
2 月 末	10,915	0.2	236.48	△0.1	98.5	—
3 月 末	10,914	0.2	236.33	△0.2	99.3	—
(期 末) 2017年 4月19日	10,921	0.3	236.35	△0.2	99.4	—

(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

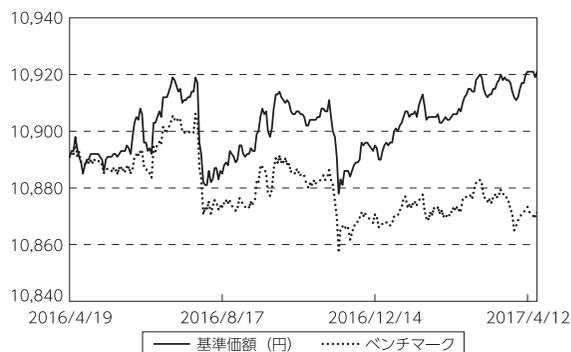
#### ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.3%の上昇となりました。

#### ◎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0.5%上回りました。

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

・国内金利は、期初は横ばいで推移していましたが、2016年6月に英国の欧州連合離脱を巡る国民投票で離脱派が勝利したことによる景気の先行き不透明感や、日本銀行による追加緩和期待などから低下しました。その後、7月末の日銀金融政策決定会合にて、金融緩和の強化が決定されたものの、マイナス金利の深掘りがされなかったことや、11月に米国金利が上昇したことなどから国内金利は上昇し、前期末比金利は上昇して期末を迎えました。こうしたなか、事業債の国債とのスプレッド（利回り格差）は、前記の金利低下局面では拡大していましたが、7月末の日銀金融政策決定会合以降の金利上昇局面では縮小し、前期末と比べてスプレッドは縮小しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

◎組入比率

・期を通じて高位組み入れを維持しました。

◎債券種別構成

・国内金利の低位安定推移を見込み、利回り向上の観点から一般債をオーバーウェイトとしました。

◎デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

・短期金利は横ばい圏で推移すると判断し中立としていましたが、2016年9月に日本銀行の緩和的スタンスの継続からデュレーションをベンチマーク対比長めとしました。

◎残存期間構成

・利回り向上の観点から中期ゾーンをオーバーウェイトとしました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

・ファンドの騰落率は、ベンチマークであるNOMURA-BPI短期インデックスを0.5%上回りました。

・この主な要因は、次の通りです。

（プラス要因）

◎債券種別構成

・国内金利の中短期ゾーンがマイナスで推移するなか、プラス利回りの一般債をベンチマーク対比でオーバーウェイトとしていたこと。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

・雇用環境は着実な改善を続けており、企業の設備投資も緩やかな増加基調にあります。また、輸出・生産も持ち直してきていますが、個人消費が盛り上がり欠けることから、本邦景気の回復は緩やかなものになると思われます。

・「物価安定の目標」の実現に向けて、日本銀行は引き続き金融緩和姿勢をもって臨むものと思われる、中短期金利は低位での推移を想定します。

・国内事業債のスプレッドについては、日本銀行の社債買入オペや投資家の資金余剰感などによる良好な需給環境を背景に概ね横ばい圏で推移し、事業債は国債と異なりプラス利回りを維持できると予想します。

◎今後の運用方針

・安定した利子収益確保をめざし、債券組入比率は引き続き高位に維持する方針です。

・ファンド全体のデュレーションは、中短期ゾーンの金利が低位安定すると判断し、ベンチマーク対比長めを基本に調整する方針です。

・債券種別構成は、流動性や銘柄分散に留意しつつ、一般債の組入比率をベンチマーク比高めに維持します。

○1万口当たりの費用明細

(2016年4月20日～2017年4月19日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2016年4月20日～2017年4月19日)

公社債

		買付額	売付額
国内		千円	千円
	特殊債券	602,406	1,005,009
	社債券	5,157,100	5,357,703

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) 社債券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4月20日～2017年4月19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	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
公社債	百万円 5,759	百万円 705	% 12.2	百万円 6,362	百万円 1,500	% 23.6

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種類	買付額	売付額	当期末保有額
公社債	百万円 201	百万円 100	百万円 1,033

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	買付額
公社債	百万円 1,300

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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJリース、アコムです。

○組入資産の明細

(2017年4月19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		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
特殊債券 (除く金融債)	300,000 ( 300,000)	300,073 ( 300,073)	3.1 ( 3.1)	— (—)	— (—)	2.1 ( 2.1)	1.0 ( 1.0)
金融債券	500,000 ( 500,000)	501,318 ( 501,318)	5.2 ( 5.2)	— (—)	— (—)	— ( —)	5.2 ( 5.2)
普通社債券	8,607,000 (8,607,000)	8,748,537 (8,748,537)	91.0 (91.0)	— (—)	— (—)	57.5 (57.5)	33.5 (33.5)
合 計	9,407,000 (9,407,000)	9,549,929 (9,549,929)	99.4 (99.4)	— (—)	— (—)	59.6 (59.6)	39.8 (39.8)

(注) ( )内は非上場債で内書きです。

(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) 残存期間が1年以内の公社債は、原則として償却原価法により評価しています。

(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
<b>特殊債券(除金融債)</b>	%	千円	千円	
第41回東日本高速道路	0.005	200,000	200,000	2019/6/20
第15回韓国輸出入銀行	0.31	100,000	100,073	2017/9/25
小 計		300,000	300,073	
<b>金融債券</b>				
い第763号農林債券	0.3	100,000	100,499	2018/12/27
第285回信金中金債	0.35	100,000	100,461	2018/8/27
第181号商工債券(3年)	0.15	300,000	300,358	2018/2/27
小 計		500,000	501,318	
<b>普通社債券</b>				
第365回中国電力	1.405	100,000	103,508	2019/12/25
第374回中国電力	0.814	300,000	306,009	2020/2/25
第408回九州電力	1.672	100,000	103,352	2019/6/25
第316回北海道電力	1.164	400,000	412,984	2020/6/25
第10回大和ハウス工業	0.001	100,000	100,110	2020/2/28
第4回富士フィルムホールディングス	0.005	200,000	199,814	2020/3/3
第12回横浜ゴム	0.001	100,000	99,942	2019/12/9
第30回豊田自動織機	0.001	100,000	99,900	2020/3/19
第15回パナソニック	0.19	200,000	200,214	2021/9/17
第29回ソニー	0.86	400,000	403,216	2018/6/19
第31回ソニー	0.23	200,000	200,356	2021/9/17
第29回丸井	0.05	100,000	99,795	2019/8/16
第7回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	2.5	200,000	209,952	2019/6/3
第9回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	2.01	200,000	212,058	2020/7/22
第28回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	1.56	200,000	210,458	2021/1/20
第6回りそな銀行(劣後特約付)	2.084	400,000	421,444	2020/3/4
第6回三菱UFJ信託銀行(劣後特約付)	1.9	200,000	209,832	2020/3/2
第23回三井住友銀行(劣後特約付)	1.61	400,000	421,024	2020/12/17
第14回みずほ銀行(劣後特約付)	2.14	300,000	314,457	2019/9/27
第27回日産フィナンシャルサービス	0.146	100,000	100,022	2017/6/20
第32回日産フィナンシャルサービス	0.12	100,000	100,114	2018/3/20
第38回日産フィナンシャルサービス	0.001	100,000	99,723	2019/6/20
第64回アコム	0.88	100,000	100,860	2018/9/5
第70回アコム	0.36	200,000	200,242	2018/5/29
第165回オリックス	0.777	107,000	107,301	2017/9/12
第172回オリックス	0.566	300,000	301,288	2018/4/17
第47回三菱UFJリース	0.001	100,000	99,816	2020/1/24
第43回野村ホールディングス	0.454	300,000	302,109	2019/2/25
第46回野村ホールディングス	0.346	100,000	100,651	2019/12/25
第48回野村ホールディングス	0.245	100,000	100,147	2018/6/8
第54回三井不動産	0.001	100,000	99,937	2020/4/7
第80回東海旅客鉄道	0.001	300,000	299,874	2020/4/13
第1回ファーストリテイリング	0.11	100,000	100,084	2018/12/18
第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.64	200,000	200,590	2022/1/27
第7回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.55	200,000	201,082	2019/7/10
第1回エイチエスピーシー・ホールディングス	0.45	300,000	299,868	2021/9/24

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券		%	千円	千円	
第1回ロイズ・バンキング・グループ・ビーエルシー		0.615	200,000	200,554	2021/12/15
第9回モルガン・スタンレー		0.557	400,000	401,664	2018/5/22
第17回ルノー		0.75	400,000	403,488	2018/11/26
第11回現代キャピタル・サービス・インク		0.52	400,000	400,179	2017/10/30
第21回ラボバンク・ネダーランド		0.708	100,000	100,472	2018/5/24
第5回ソシエテ ジェネラル円貨社債 (2014)		0.369	100,000	100,044	2017/6/13
小 計			8,607,000	8,748,537	
合 計			9,407,000	9,549,929	

○投資信託財産の構成

(2017年4月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 9,549,929	% 97.3
コール・ローン等、その他	262,001	2.7
投資信託財産総額	9,811,930	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年4月19日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,811,930,547
コール・ローン等	44,152,072
特殊債券(評価額)	801,392,638
社債券(評価額)	8,748,537,326
未収入金	200,302,000
未収利息	17,546,511
(B) 負債	200,120,778
未払金	200,000,000
未払解約金	120,700
未払利息	78
(C) 純資産総額(A-B)	9,611,809,769
元本	8,801,427,183
次期繰越損益金	810,382,586
(D) 受益権総口数	8,801,427,183口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,921円

<注記事項>

- ①期首元本額 9,485,173,120円  
 期中追加設定元本額 38,762,367円  
 期中一部解約元本額 722,508,304円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0921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)

追加型・公社債証券投資信託(1月設定)	699,739,645円
追加型・公社債証券投資信託(2月設定)	1,398,438,765円
追加型・公社債証券投資信託(3月設定)	441,447,055円
追加型・公社債証券投資信託(4月設定)	799,011,182円
追加型・公社債証券投資信託(5月設定)	384,548,885円
追加型・公社債証券投資信託(6月設定)	528,806,695円
追加型・公社債証券投資信託(7月設定)	436,470,164円
追加型・公社債証券投資信託(8月設定)	1,046,483,970円
追加型・公社債証券投資信託(9月設定)	701,975,545円
追加型・公社債証券投資信託(10月設定)	393,405,217円
追加型・公社債証券投資信託(11月設定)	958,053,003円
追加型・公社債証券投資信託(12月設定)	1,013,047,057円
合計	8,801,427,183円

[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4月20日～2017年4月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 受取利息等収益	85,161,481
受取利息	85,240,038
支払利息	△ 78,557
(B) 有価証券売買損益	△ 58,386,922
売買益	10,415,106
売買損	△ 68,802,028
(C) 当期利益(A+B)	26,774,559
(D) 前期繰越損益金	845,438,200
(E) 追加信託差損益金	3,494,746
(F) 解約差損益金	△ 65,324,919
(G) 計(C+D+E+F)	810,382,586
次期繰越損益金(G)	810,382,586

- (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) (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) (F) 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。