

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8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（1万口当たり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 （8月設定） 公社債投信（8月号）



第60期（決算日：2021年8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（8月設定）」は、去る8月19日に第60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
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル **0120-151034**
（受付時間：営業日の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		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込配分	み金騰落率	騰落率	騰落率			
	円	円	銭	%		%	%	百万円
58期(2019年8月19日)	10,000	17.77		0.2	236.02	0.1	97.2	1,111
59期(2020年8月19日)	9,972	0.00		△0.3	234.98	△0.4	95.6	1,105
60期(2021年8月19日)	10,000	4.88		0.3	234.86	△0.1	97.2	598

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) NOMURA-BPI短期とは、野村証券株式会社が発表しているわが国の残存期間1年から3年の債券で構成されている債券パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI総合のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

(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。

○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		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) 2020年8月19日	円	銭	%		%	%
	9,972		—	234.98	—	95.6
8月末	9,971		△0.0	234.94	△0.0	98.6
9月末	9,975		0.0	235.02	0.0	97.4
10月末	9,977		0.1	234.97	△0.0	95.2
11月末	9,980		0.1	234.95	△0.0	99.1
12月末	9,982		0.1	234.92	△0.0	95.6
2021年1月末	9,983		0.1	234.89	△0.0	98.4
2月末	9,981		0.1	234.83	△0.1	98.4
3月末	9,990		0.2	234.91	△0.0	98.7
4月末	9,993		0.2	234.88	△0.0	97.3
5月末	9,996		0.2	234.86	△0.1	99.1
6月末	10,000		0.3	234.81	△0.1	97.8
7月末	10,003		0.3	234.85	△0.1	97.9
(期末) 2021年8月19日						
	10,004.88		0.3	234.86	△0.1	97.2

(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。

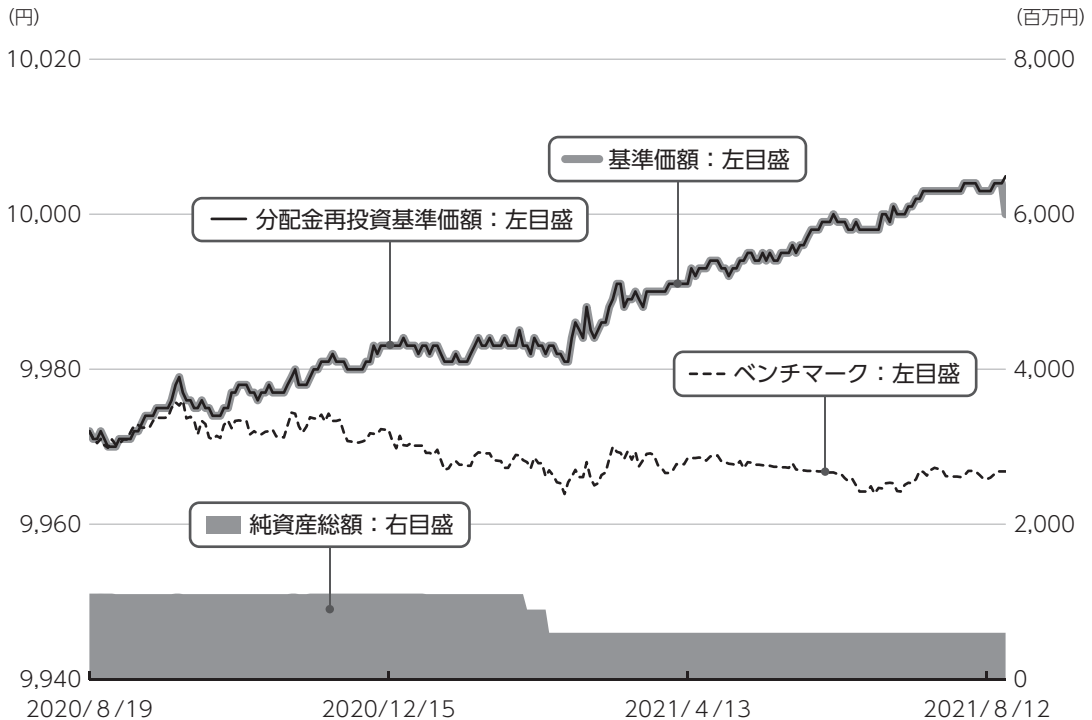
(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

運用経過

第60期：2020年8月20日～2021年8月19日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第60期首	9,972円
第60期末	10,000円
既払分配金	4.88円
騰落率	0.3%
	(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、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はありません。

※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、受益者のみな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、各個人の受益者のみな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。

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.3%（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（-0.1%）を0.4%上回りました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

利子等収益を獲得したことや、一般債の国債とのスプレッド（利回り格差）が縮小したことが基準価額の上昇要因となりました。

第60期：2020年8月20日～2021年8月19日

▶ 投資環境について

国内短期金利は小幅に低下、一般債の国債とのスプレッドは縮小しました。

国内短期金利は、日銀の強力な金融緩和政策を背景に、横ばい圏で推移しました。2021年2月下旬にかけては、日銀の政策点検への思惑を背景に一時上昇する局面も見られたものの、その後期末にかけてはもみ合いながら

も低下し、期首との比較では小幅に低下となりました。

一般債の国債とのスプレッドは、新型コロナウイルス感染拡大による世界景気への懸念が後退したことや、日銀の社債オペ拡充などを背景に、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（8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 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）

日銀の金融緩和政策継続から中短期金利は低位で推移と想定し、デュレーションをベンチマーク並みに調整しました。

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（8月設定）

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-0.1%）を0.4%上回りました。

マザーファンド保有以外の要因

マイナス要因

信託報酬等コストなどがマイナスに影響しました。

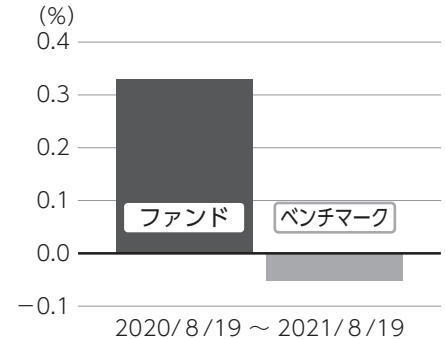
マザーファンド保有による要因

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（ベビーファンド）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、4円88銭（1万口当たり）とさせていただきます。

今後の運用方針 （作成対象期間末での見解です。）

▶ 追加型・公社債証券投資信託（8月設定）

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

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。

新型コロナウイルス感染症の影響などから本邦景気は引き続き厳しい状態にあります。海外経済の回復を受けて輸出・生産は着実な増加を続けており、企業収益や業況感も全体として改善しています。

しかし、サービス消費における下押し圧力の強さから個人消費が足踏み状態にあることや雇用・所得環境も弱い動きが続いているなど懸念材料も多く、景気の先行きの不確実性は依然として高いものと思われます。国内中短期金利は、引き続き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銀の社債買入オペなどを背景に横ばい圏での推移になるものと思われます。

こうしたなか、一般債は国債と異なりプラス利回りを維持できると予想していることから、債券種別構成は流動性や銘柄分散に留意しつつ、プラス利回りである一般債の組入比率をベンチマーク比高めに維持します。

2020年8月20日～2021年8月19日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	15	0.150	(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)	(0.036)	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)	(0.104)	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
（保管費用）	(0)	(0.000)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
（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、9,986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。

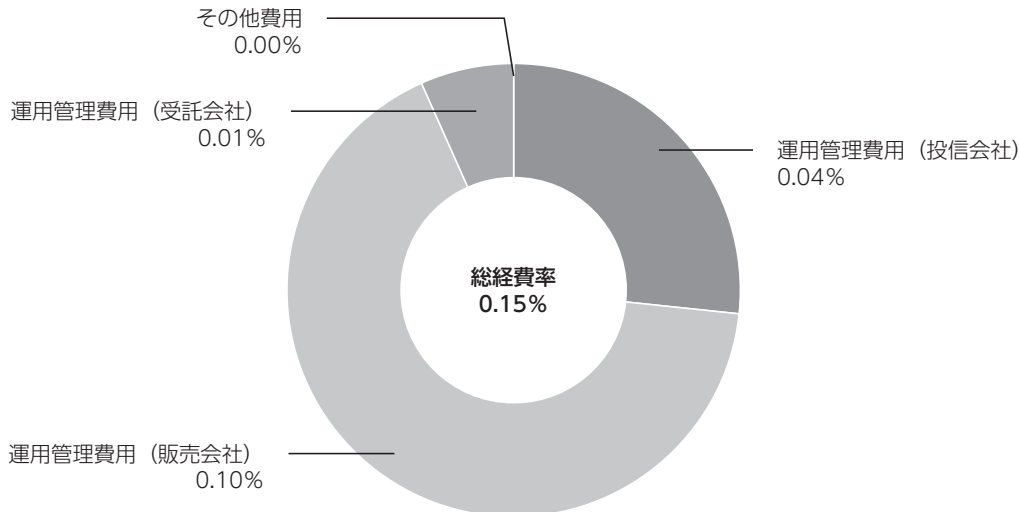
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

（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（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）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0.15%**です。



(注) 費用は、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) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前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は異なります。

○売買及び取引の状況

(2020年8月20日～2021年8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 246	千円 270	千口 462,935	千円 508,949

○利害関係人との取引状況等

(2020年8月20日～2021年8月19日)

利害関係人との取引状況

<追加型・公社債証券投資信託（8月設定）公社債投信（8月号）>

該当事項はございません。

<公社債投信マザーファンド>

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 1,701	百万円 —	% —	百万円 1,974	百万円 251	% 12.7

平均保有割合 11.8%

※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

<公社債投信マザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 —	百万円 300	百万円 702

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

<公社債投信マザーファンド>

種 類	買 付 額
公社債	百万円 100

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信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱HCキャピタル、アコムです。

○組入資産の明細

(2021年8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
公社債投信マザーファンド		千口 1,004,441	千口 541,752	千円 597,390

○投資信託財産の構成

(2021年8月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債投信マザーファンド	千円 597,390	% 99.5
コール・ローン等、その他	3,025	0.5
投資信託財産総額	600,415	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年8月19日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	600,415,703
コール・ローン等	3,022,884
公社債投信マザーファンド(評価額)	597,390,315
未収入金	2,504
(B) 負債	1,586,022
未払収益分配金	292,228
未払信託報酬	1,269,662
未払利息	5
その他未払費用	24,127
(C) 純資産総額(A-B)	598,829,681
元本	598,829,635
次期繰越損益金	46
(D) 受益権総口数	598,829,635口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,000円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,108,130,793円
 期中追加設定元本額 276,950円
 期中一部解約元本額 509,578,108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60期

計算期間末における純資産総額の元本超過額292,274円を分配対象収益とし、292,228円（1万口当たり4.88円）を分配金額としております。

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金（税込み）	4円88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、2021年8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（<https://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

○損益の状況（2020年8月20日～2021年8月19日）

項 目	当 期
	円
(A) 受取利息等収益	△ 1,700
支払利息	△ 1,700
(B) 有価証券売買損益	3,794,746
売買益	3,895,612
売買損	△ 100,866
(C) 信託報酬等	△1,293,789
(D) 当期利益(A+B+C)	2,499,257
(E) 前期繰越損益金	△3,101,958
(F) 追加信託差損益金	△ 2,660
(G) 解約差損益金	897,635
(H) 計(D+E+F+G)	292,274
(I) 収益分配金	△ 292,228
次期繰越損益金(H+I)	46

(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。

公社債投信マザーファンド

《第20期》決算日2021年4月19日

[計算期間：2020年4月21日～2021年4月19日]

「公社債投信マザーファンド」は、4月19日に第20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20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		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	円	騰 落 中 率		騰 落 中 率			
18期(2019年4月19日)	10,957	△0.0	235.68	△0.1	98.8	—	百万円 8,642
19期(2020年4月20日)	10,941	△0.1	235.07	△0.3	96.2	—	7,978
20期(2021年4月19日)	11,008	0.6	234.90	△0.1	97.4	—	6,325

(注) NOMURA-BPI 短期とは、野村証券株式会社が発表しているわが国の残存期間1年から3年の債券で構成されている債券パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI 総合のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

(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		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020年4月20日	円 10,941	% —	235.07	% —	% 96.2	% —
4月末	10,951	0.1	235.26	0.1	97.7	—
5月末	10,955	0.1	235.16	0.0	96.5	—
6月末	10,959	0.2	235.07	△0.0	97.4	—
7月末	10,976	0.3	235.09	0.0	95.8	—
8月末	10,973	0.3	234.94	△0.1	98.9	—
9月末	10,979	0.3	235.02	△0.0	97.7	—
10月末	10,983	0.4	234.97	△0.0	95.4	—
11月末	10,988	0.4	234.95	△0.1	99.4	—
12月末	10,991	0.5	234.92	△0.1	95.8	—
2021年1月末	10,994	0.5	234.89	△0.1	98.7	—
2月末	10,993	0.5	234.83	△0.1	98.6	—
3月末	11,004	0.6	234.91	△0.1	98.9	—
(期 末) 2021年4月19日	11,008	0.6	234.90	△0.1	97.4	—

(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

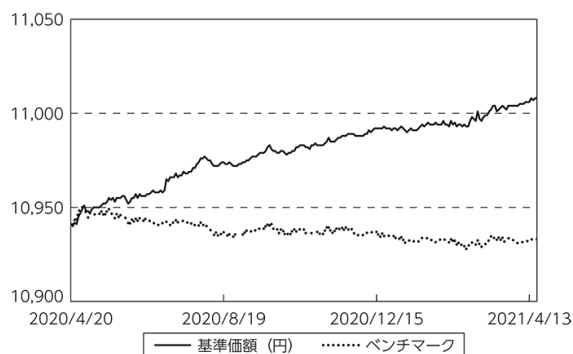
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.6%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(−0.1%)を0.7%上回りました。

基準価額等の推移



(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。

●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

利子等収益を獲得したことや、一般債の国債とのスプレッド（利回り格差）が縮小したことが基準価額の上昇要因となりました。

●投資環境について

国内短期金利はおおむね横ばい、一般債の国債とのスプレッド（利回り格差）は縮小しました。

- ・国内短期金利は、日銀の強力な金融緩和政策を背景に、横ばい圏で推移しました。2021年2月下旬にかけては、日銀の政策点検への思惑を背景に一時小幅に上昇する局面も見られましたが、期を通じてみるとおおむね横ばいとなりました。
- ・一般債の国債とのスプレッドは、新型コロナウイルス感染拡大による世界景気への懸念が後退したことや、日銀の社債オペ拡充などを背景に、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)

- ・日銀の金融緩和政策継続から中短期金利は低位で推移と想定し、デュレーションをベンチマーク並みに調整しました。

◎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、ベンチマークの騰落率（-0.1%）を0.7%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

- ・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。
- ・新型コロナウイルス感染症の影響などから本邦景気は引き続き厳しい状態にあります。海外景気を持ち直しを受けて輸出・生産は増加しており、企業収益や業況感も改善しています。しかし、個人消費の持ち直しが一服していることや雇用・所得環境に弱い動きがみられるなど懸念材料も多く、景気の先行きの不確実性は依然として高いものと思われます。こうしたなか、消費者物価の前年比は依然として2%に遠く、日銀は引き続き強力な金融緩和を粘り強く続けていくと思われ、国内中短期金利は、引き続き低位での推移を想定します。ファンド全体のデュレーションは、ベンチマーク並みを基本に調整する方針です。
- ・一般債のスプレッドについては、日銀の社債オペなどを背景に横ばい圏での推移になるとみています。こうしたなか、一般債は国債と異なりプラス利回りを維持できると予想していることから、債券種別構成は流動性や銘柄分散に留意しつつ、プラス利回りである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

(2020年4月21日～2021年4月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	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 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、10,979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

(2020年4月21日～2021年4月19日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国	国債証券	千円 385,639	千円 513,374
	特殊債券	100,098	200,040
内	社債券	2,206,526	1,401,880 (2,100,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は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。

(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

(2020年4月21日～2021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		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
		百万円	%		百万円	%
公社債	百万円 2,692	百万円 252	% 9.4	百万円 2,115	百万円 251	% 11.9

(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 —	百万円 300	百万円 702

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 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UFJ信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱HCキャピタル、アコムです。

○組入資産の明細

(2021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		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	150,000	151,948	2.4	—	—	1.3	1.1
特殊債券 (除く金融債)	200,000 (200,000)	200,028 (200,028)	3.2 (3.2)	— (—)	— (—)	— (—)	3.2 (3.2)
普通社債券	5,800,000 (5,700,000)	5,809,424 (5,709,044)	91.8 (90.2)	— (—)	1.6 (1.6)	44.3 (44.3)	45.9 (44.4)
合 計	6,150,000 (5,900,000)	6,161,401 (5,909,073)	97.4 (93.4)	— (—)	1.6 (1.6)	45.6 (44.3)	50.2 (47.5)

(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。

(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
国債証券	%	千円	千円	
第135回利付国債(5年)	0.1	70,000	70,315	2023/3/20
第329回利付国債(10年)	0.8	70,000	71,422	2023/6/20
第338回利付国債(10年)	0.4	10,000	10,210	2025/3/20
小計		150,000	151,948	
特殊債券(除く金融債)				
第48回韓国産業銀行(2018)	0.23	100,000	100,009	2021/9/3
第18回韓国輸出入銀行	0.27	100,000	100,019	2021/6/28
小計		200,000	200,028	
普通社債券				
第5回ヤフー	0.2	100,000	99,797	2022/12/7
第15回Zホールディングス	0.35	200,000	200,132	2023/6/9
第50回日本電気	0.29	200,000	200,360	2022/6/15
第34回ソニー	0.13	100,000	99,740	2024/10/10
第46回IHI	0.22	200,000	200,052	2023/9/1
第1回日本生命2017基金	0.304	100,000	100,034	2021/8/2
第1回明治安田生命2017基金	0.35	100,000	100,142	2022/8/4
第1回明治安田生命2018基金	0.315	200,000	200,320	2023/9/25
第1回明治安田生命2019基金	0.29	100,000	100,040	2024/8/2
第1回楽天カード	0.14	200,000	199,672	2022/12/12
第37回丸井グループ	0.12	100,000	99,847	2023/12/1
第22回あおぞら銀行	0.1	100,000	100,000	2021/12/10
第11回りそな銀行(劣後特約付)	1.78	200,000	202,638	2022/3/15
第11回三菱UFJ信託銀行(劣後特約付)	1.36	100,000	101,400	2022/6/27
第18回みずほフィナンシャルグループ期限前償還条項付	0.42	100,000	99,818	2029/6/13
第24回三井住友銀行劣後特約付	1.6	100,000	100,158	2021/6/1
第20回みずほ銀行(劣後特約付)	1.49	100,000	101,389	2022/6/3
第30回リコーリース	0.16	200,000	200,075	2022/1/21
第5回イオンフィナンシャルサービス	0.23	100,000	100,027	2022/5/27
第7回イオンフィナンシャルサービス	0.19	100,000	99,916	2023/3/20
第8回イオンフィナンシャルサービス	0.3	100,000	100,008	2024/9/20
第14回イオンフィナンシャルサービス	0.29	100,000	100,088	2024/2/2
第15回イオンフィナンシャルサービス	0.36	100,000	100,065	2026/2/2
第74回アコム	0.59	100,000	100,871	2024/2/28
第75回アコム	0.309	100,000	100,129	2023/2/28
第79回アコム	0.29	100,000	99,839	2025/2/28
第82回日立キャピタル	0.09	200,000	200,076	2023/2/20
第199回オリックス	0.19	200,000	200,600	2025/6/4
第75回三菱UFJリース	0.22	100,000	100,460	2025/1/23
第27回大和証券グループ本社	0.4	100,000	100,323	2023/4/25
第1回野村ホールディングス	0.3	200,000	200,076	2023/9/4
第47回野村ホールディングス	0.472	100,000	100,192	2021/12/24
第76回三井不動産	0.21	100,000	100,123	2023/4/28
第1回ソフトバンク	0.13	100,000	99,840	2023/3/17
第2回ソフトバンク	0.33	100,000	99,761	2025/3/18
第5回ソフトバンク	0.1	200,000	199,914	2023/7/28

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23回フランス相互信用連合銀行	0.217	100,000	99,892	2022/10/12
第32回フランス相互信用連合銀行	0.267	200,000	199,744	2025/10/15
第1回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.64	100,000	100,272	2022/1/27
第3回マラヤン・バンキング (2019)	0.27	200,000	200,022	2022/5/20
第6回マラヤン・バンキング	0.224	200,000	199,638	2023/2/13
第1回パークレイズ・ビーエルシー期限前償還条項付	1.232	100,000	100,996	2024/9/25
第3回ソシエテ ジェネラル円貨社債 (2018)	0.804	100,000	100,555	2023/10/12
NATWEST MARKETS	0.737	100,000	100,380	2022/7/4
小 計		5,800,000	5,809,424	
合 計		6,150,000	6,161,401	

○投資信託財産の構成

(2021年4月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 6,161,401	% 97.4
コール・ローン等、その他	164,582	2.6
投資信託財産総額	6,325,983	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年4月19日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,325,983,609
コール・ローン等	158,272,794
国債証券(評価額)	151,948,600
特殊債券(評価額)	200,028,363
社債券(評価額)	5,809,424,904
未収利息	6,265,250
前払費用	43,698
(B) 負債	25,358
未払解約金	25,077
未払利息	281
(C) 純資産総額(A-B)	6,325,958,251
元本	5,746,481,927
次期繰越損益金	579,476,324
(D) 受益権総口数	5,746,481,927口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,008円

<注記事項>

- ①期首元本額 7,292,894,560円
 期中追加設定元本額 10,931,260円
 期中一部解約元本額 1,557,343,893円
 また、1口当たり純資産額は、期末11,008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(2月設定)	778,011,375円
追加型・公社債証券投資信託(12月設定)	709,205,708円
追加型・公社債証券投資信託(4月設定)	629,383,513円
追加型・公社債証券投資信託(11月設定)	562,560,903円
追加型・公社債証券投資信託(8月設定)	544,273,073円
追加型・公社債証券投資信託(6月設定)	456,168,076円
追加型・公社債証券投資信託(1月設定)	436,690,178円
追加型・公社債証券投資信託(3月設定)	370,228,705円
追加型・公社債証券投資信託(7月設定)	364,770,108円
追加型・公社債証券投資信託(5月設定)	342,132,998円
追加型・公社債証券投資信託(10月設定)	279,850,155円
追加型・公社債証券投資信託(9月設定)	273,207,135円
合計	5,746,481,927円

○損益の状況 (2020年4月21日～2021年4月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 受取利息等収益	34,599,786
受取利息	34,744,380
支払利息	△ 144,594
(B) 有価証券売買損益	12,435,309
売買益	31,875,663
売買損	△ 19,440,354
(C) 保管費用等	△ 19,782
(D) 当期利益(A+B+C)	47,015,313
(E) 前期繰越損益金	685,901,565
(F) 追加信託差損益金	1,086,182
(G) 解約差損益金	△ 154,526,736
(H) 計(D+E+F+G)	579,476,324
次期繰越損益金(H)	579,476,324

- (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。