

## 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9月22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 （9月設定） 公社債投信（9月号）



第61期（決算日：2022年9月20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（9月設定）」は、去る9月20日に第61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 (分配落)	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
		税 分 配	み 金	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
	円	円	銭	%		%	%	%	百万円
59期(2020年9月23日)	9,975	0.00		△0.3	235.07	△0.4	94.9	—	702
60期(2021年9月21日)	10,000	0.43		0.3	234.79	△0.1	97.4	—	295
61期(2022年9月20日)	9,973	0.00		△0.3	234.50	△0.1	96.2	—	285

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) NOMURA-BPI短期とは、野村證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		
	円	%		%	%	%
(期首) 2021年9月21日	10,000	—	234.79	—	97.4	—
9月末	9,998	△0.0	234.74	△0.0	97.7	—
10月末	9,997	△0.0	234.68	△0.0	97.8	—
11月末	10,002	0.0	234.75	△0.0	98.2	—
12月末	9,998	△0.0	234.61	△0.1	98.6	—
2022年1月末	9,993	△0.1	234.46	△0.1	95.5	—
2月末	9,985	△0.2	234.37	△0.2	95.5	—
3月末	9,984	△0.2	234.39	△0.2	97.3	—
4月末	9,990	△0.1	234.48	△0.1	97.4	—
5月末	9,987	△0.1	234.50	△0.1	96.1	—
6月末	9,983	△0.2	234.50	△0.1	96.3	—
7月末	9,987	△0.1	234.63	△0.1	96.0	—
8月末	9,980	△0.2	234.58	△0.1	96.0	—
(期末) 2022年9月20日	9,973	△0.3	234.50	△0.1	96.2	—

(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。

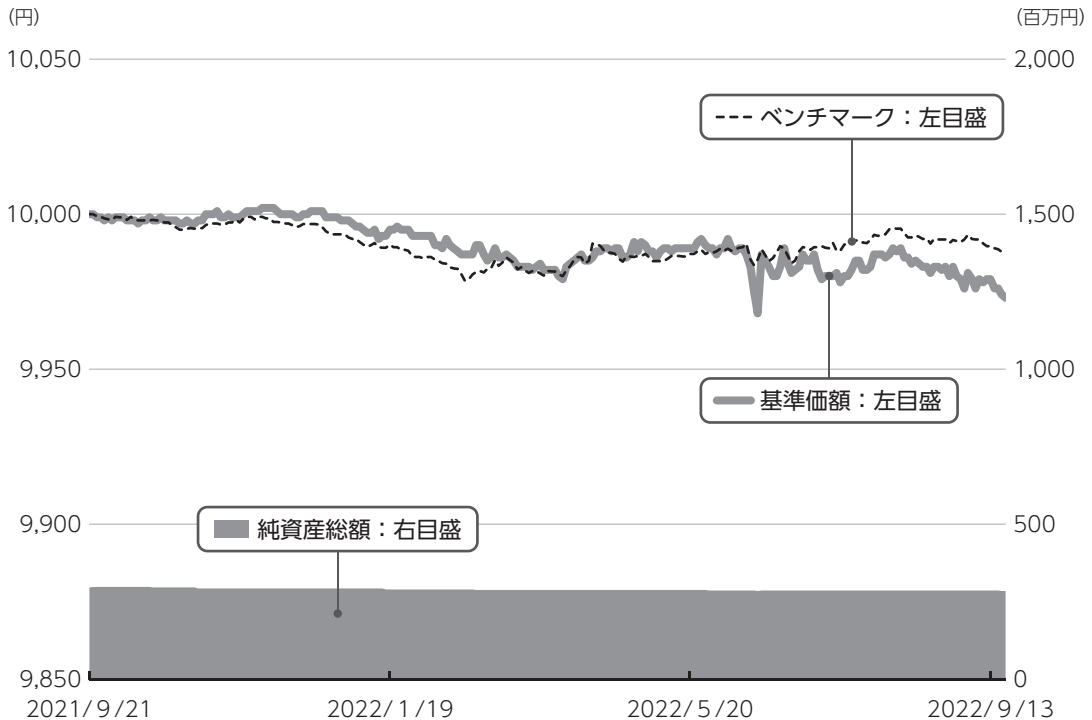
(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

# 運用経過

第61期：2021年9月22日～2022年9月20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61期首	10,000円
第61期末	9,973円
既払分配金	0円
騰落率	-0.3%

※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、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%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（-0.1%）を0.2%下回りました。

## 基準価額の主な変動要因

### 下落要因

国内金利が上昇したことや、一般債の国債とのスプレッド（利回り格差）が拡大したことなどが基準価額の下落要因となりました。

第61期：2021年9月22日～2022年9月20日

## ▶ 投資環境について

### 国内短期金利は上昇、一般債の国債とのスプレッドは拡大しました。

国内短期金利は、日銀の強力な金融緩和政策を背景に、期首から2021年12月中旬にかけて横ばい圏で推移しました。その後期末にかけては海外金利の上昇や、日銀の政策変更に対する思惑などから上昇しました。

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、日銀の社債オペなどを背景に、期首から2022年2月下旬にかけては横ばい圏で推移しましたが、その後期末にかけてはウクライナ情勢などを背景に拡大し、期首との比較では拡大して終えました。

## ▶ 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（9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（9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0.2%下回りました。

#### 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

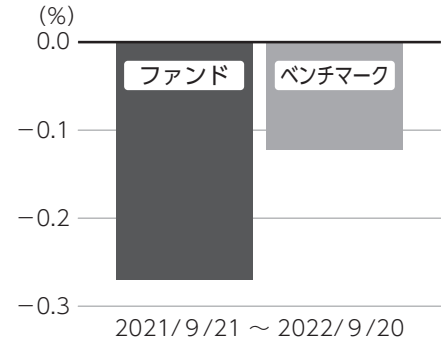
相対的に利回りの高い一般債をベンチマーク対比でオーバーウェイトとしていたこと。

##### マイナス要因

##### 債券種別構成

2022年3月以降、対国債とのスプレッドが拡大した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）



## ▶ 分配金について

当期の収益分配金につきましては、当ファンドの分配方針に基づきまして見送らせていただきました。

## 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（9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。

国内景気は新型コロナウイルス感染症や資源価格の上昇の影響などから一部に弱めの動きもみられますが、基調としては持ち直しています。輸出は、基調として増加を続けており、個人消費も、足元の

感染症拡大の影響からサービス消費に下押しがみられるものの緩やかに増加しています。しかしながら、生産が供給制約の影響から下押し圧力が強い状態にあるなど懸念材料も多く、地政学リスクや資源価格の問題もあり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ます。国内債券相場は、海外金利や為替動向を睨んで神経質な展開を予想します。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ます。こうしたなか、債券種別構成は流動性や銘柄分散に留意しつつ、国債対比で利回りの高い一般債の組入比率をベンチマーク比高めに維持します。

2021年9月22日～2022年9月20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)	(0.103)	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、9,989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。

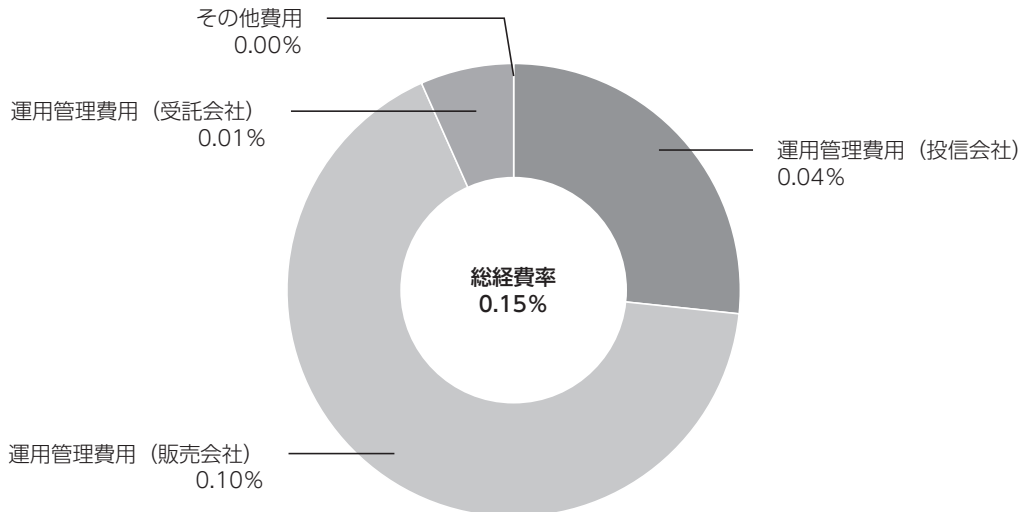
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。



## （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

(2021年9月22日～2022年9月20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 1,730	千円 1,908	千口 10,683	千円 11,777

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年9月22日～2022年9月20日)

## 利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

## 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 —	百万円 —	百万円 600

## 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 400

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、三菱HCキャピタル、アコムです。

## ○組入資産の明細

(2022年9月20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 267,322	千口 258,369	千円 284,542

## ○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
	千円	%
公社債投信マザーファンド	284,542	99.6
コール・ローン等、その他	1,148	0.4
投資信託財産総額	285,690	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年9月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	285,690,508
コール・ローン等	1,147,121
公社債投信マザーファンド(評価額)	284,542,191
未収入金	1,196
(B) 負債	440,980
未払信託報酬	432,857
未払利息	2
その他未払費用	8,121
(C) 純資産総額(A-B)	285,249,528
元本	286,021,014
次期繰越損益金	△ 771,486
(D) 受益権総口数	286,021,014口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,973円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 295,498,574円  
 期中追加設定元本額 1,901,052円  
 期中一部解約元本額 11,378,612円  
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9973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771,486円です。

③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61期

計算期間末における純資産総額の元本超過額はなかったため当期に分配した金額はありません。

\*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 (2021年9月22日～2022年9月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 受取利息等収益	△ 427
支払利息	△ 427
(B) 有価証券売買損益	△337,399
売買益	240
売買損	△337,639
(C) 信託報酬等	△440,978
(D) 当期利益(A+B+C)	△778,804
(E) 前期繰越損益金	1,760
(F) 追加信託差損益金	△ 1,467
(G) 解約差損益金	7,025
(H) 計(D+E+F+G)	△771,486
(I) 収益分配金	0
次期繰越損益金(H+I)	△771,486

(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21期》決算日2022年4月19日

[計算期間：2021年4月20日～2022年4月19日]

「公社債投信マザーファンド」は、4月19日に第21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21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 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
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
21期(2022年4月19日)	11,023	0.1	234.45	△0.2	97.7	—	6,089

(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	率	騰 落 率	率		
(期 首) 2021年4月19日	円	%		%	%	%
	11,008	—	234.90	—	97.4	—
4月末	11,009	0.0	234.88	△0.0	97.5	—
5月末	11,014	0.1	234.86	△0.0	99.3	—
6月末	11,019	0.1	234.81	△0.0	98.0	—
7月末	11,024	0.1	234.85	△0.0	98.1	—
8月末	11,026	0.2	234.82	△0.0	97.5	—
9月末	11,024	0.1	234.74	△0.1	97.9	—
10月末	11,024	0.1	234.68	△0.1	98.1	—
11月末	11,031	0.2	234.75	△0.1	98.5	—
12月末	11,028	0.2	234.61	△0.1	98.8	—
2022年1月末	11,024	0.1	234.46	△0.2	95.7	—
2月末	11,017	0.1	234.37	△0.2	95.8	—
3月末	11,017	0.1	234.39	△0.2	97.6	—
(期 末) 2022年4月19日						
	11,023	0.1	234.45	△0.2	97.7	—

(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

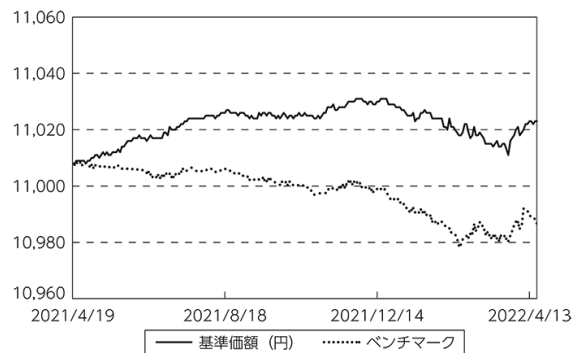
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.1%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。

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、事業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。

(下落要因)

国内金利が上昇したことや、円建外債の国債とのスプレッドが拡大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

国内短期金利は上昇、事業債の国債とのスプレッドは縮小となりました。

- ・国内短期金利は、日銀の強力な金融緩和政策を背景に、期首から2021年12月中旬にかけて概ね横ばい圏で推移しました。その後期末にかけては海外金利の上昇や、日銀の政策変更に対する思惑などから上昇しました。
- ・事業債・円建外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、期首から2022年2月下旬にかけては縮小して推移しました。期首との対比では、事業債はスプレッドが縮小した一方、円建外債はウクライナ情勢を背景に期末にかけてスプレッドが拡大して終わりました。

●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（-0.2%）を0.3%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

- ・相対的に利回りの高い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。
- ・国内景気は新型コロナウイルスの影響が徐々に和らぐもとで持ち直しています。輸出・生産は供給制約の影響を残しつつも基調として増加を続けています。しかしながら、個人消費が感染症の再拡大によるサービス消費を中心とした下押し圧力の強まりから持ち直しが一服していること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る。国内金利は、為替相場や海外金利動向を睨みながら神経質な展開を予想します。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、債券種別構成は流動性や銘柄分散に留意しつつ、国債対比で利回りの高い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

(2021年4月20日～2022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、11,021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

(2021年4月20日～2022年4月19日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国	国債証券	千円 70,790	千円 70,198
	特殊債券	—	—
内	社債券	1,100,094	(200,000) 499,903 (600,000)

(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

(2021年4月20日～2022年4月19日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

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 —	百万円 701

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 200

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

(2022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	151,081	2.5	—	1.2	0.2	1.2
普通社債券	5,800,000 (5,700,000)	5,795,864 (5,695,783)	95.2 (93.5)	— (—)	6.5 (6.5)	32.8 (32.8)	55.8 (54.2)
合 計	5,950,000 (5,700,000)	5,946,945 (5,695,783)	97.7 (93.5)	— (—)	7.7 (6.5)	33.0 (32.8)	57.0 (54.2)

(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
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第329回利付国債 (10年)	0.8	70,000	70,719	2023/6/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	10,000	10,126	2025/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	70,000	70,234	2027/6/20
小 計		150,000	151,081	
<b>普通社債券</b>				
第1回関西電力利払繰延・期限前償還条項・劣後特約付	0.896	200,000	200,136	2082/3/20
第5回ヤフー	0.2	100,000	100,004	2022/12/7
第15回Zホールディングス	0.35	200,000	200,192	2023/6/9
第15回楽天グループ	0.5	100,000	99,694	2024/12/2
第67回神戸製鋼所	0.2	100,000	99,556	2026/6/10
第50回日本電気	0.29	200,000	200,045	2022/6/15
第17回パナソニック	0.47	100,000	100,880	2026/9/18
第34回ソニー	0.13	100,000	99,864	2024/10/10
第46回IHI	0.22	200,000	199,888	2023/9/1
第1回明治安田生命2017基金	0.35	100,000	100,032	2022/8/4
第1回明治安田生命2018基金	0.315	200,000	199,984	2023/9/25
第1回明治安田生命2019基金	0.29	100,000	99,876	2024/8/2
第1回楽天カード	0.14	200,000	199,830	2022/12/12
第1回日本生命2021基金劣後特約付	0.28	100,000	99,711	2026/8/3
第37回丸井グループ	0.12	100,000	99,846	2023/12/1
第11回三菱UFJ信託銀行(劣後特約付)	1.36	100,000	100,221	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	99,790	2029/6/13
第20回みずほ銀行(劣後特約付)	1.49	100,000	100,152	2022/6/3
第28回芙蓉総合リース	0.14	100,000	99,333	2026/4/21
第5回イオンフィナンシャルサービス	0.23	100,000	100,002	2022/5/27
第8回イオンフィナンシャルサービス	0.3	100,000	99,894	2024/9/20
第14回イオンフィナンシャルサービス	0.29	100,000	99,964	2024/2/2
第15回イオンフィナンシャルサービス	0.36	100,000	99,745	2026/2/2
第74回アコム	0.59	100,000	100,677	2024/2/28
第75回アコム	0.309	100,000	100,113	2023/2/28
第79回アコム	0.29	100,000	100,034	2025/2/28
第82回日立キャピタル	0.09	200,000	199,976	2023/2/20
第199回オリックス	0.19	200,000	199,888	2025/6/4
第27回三井住友ファイナンス&リース	0.22	100,000	99,609	2026/10/16
第75回三菱UFJリース	0.22	100,000	100,087	2025/1/23
第27回大和証券グループ本社	0.4	100,000	100,187	2023/4/25
第36回大和証券グループ本社	0.23	100,000	99,640	2026/6/2
第1回野村ホールディングス	0.3	200,000	200,094	2023/9/4
第3回野村ホールディングス	0.28	100,000	99,576	2026/9/4
第76回三井不動産	0.21	100,000	100,076	2023/4/28
第2回ソフトバンク	0.33	100,000	100,020	2025/3/18
第5回ソフトバンク	0.1	200,000	199,744	2023/7/28
第23回フランス相互信用連合銀行	0.217	100,000	99,984	2022/10/12
第32回フランス相互信用連合銀行	0.267	200,000	198,790	2025/10/15
第9回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付	1.1	100,000	98,353	2031/12/16

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3回マラヤン・バンキング (2019)		0.27	200,000	200,001	2022/5/20
第6回マラヤン・バンキング		0.224	200,000	199,749	2023/2/13
第1回パークレイズ・ピーエルシー期限前償還条項付		1.232	100,000	100,862	2024/9/25
第3回ソニエテ ジェネラル円貨社債 (2018)		0.804	100,000	99,679	2023/10/12
NATWEST MARKETS		0.737	100,000	100,080	2022/7/4
小	計		5,800,000	5,795,864	
合	計		5,950,000	5,946,945	

○投資信託財産の構成

(2022年4月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 5,946,945	% 97.7
コール・ローン等、その他	142,824	2.3
投資信託財産総額	6,089,769	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年4月19日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,089,769,565
コール・ローン等	136,948,264
国債証券(評価額)	151,081,000
社債証券(評価額)	5,795,864,652
未収利息	5,793,184
前払費用	82,465
(B) 負債	24,405
未払解約金	24,162
未払利息	243
(C) 純資産総額(A-B)	6,089,745,160
元本	5,524,745,845
次期繰越損益金	564,999,315
(D) 受益権総口数	5,524,745,845口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,023円

<注記事項>

- ①期首元本額 5,746,481,927円  
 期中追加設定元本額 11,904,552円  
 期中一部解約元本額 233,640,634円  
 また、1口当たり純資産額は、期末11,023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)	744,395,500円
追加型・公社債証券投資信託(12月設定)	684,813,261円
追加型・公社債証券投資信託(4月設定)	583,246,113円
追加型・公社債証券投資信託(11月設定)	543,674,913円
追加型・公社債証券投資信託(8月設定)	531,033,138円
追加型・公社債証券投資信託(6月設定)	446,128,550円
追加型・公社債証券投資信託(1月設定)	421,975,911円
追加型・公社債証券投資信託(7月設定)	353,746,335円
追加型・公社債証券投資信託(3月設定)	348,571,381円
追加型・公社債証券投資信託(5月設定)	333,015,672円
追加型・公社債証券投資信託(10月設定)	273,927,966円
追加型・公社債証券投資信託(9月設定)	260,217,105円
合計	5,524,745,845円

○損益の状況 (2021年4月20日～2022年4月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 受取利息等収益	23,462,483
受取利息	23,551,262
支払利息	△ 88,779
(B) 有価証券売買損益	△ 15,238,715
売買益	1,677,194
売買損	△ 16,915,909
(C) 保管費用等	△ 20,455
(D) 当期利益(A+B+C)	8,203,313
(E) 前期繰越損益金	579,476,324
(F) 追加信託差損益金	1,215,578
(G) 解約差損益金	△ 23,895,900
(H) 計(D+E+F+G)	564,999,315
次期繰越損益金(H)	564,999,315

- (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。