

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（2022年1月27日設定）	
運用方針	日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ受益証券への投資を通じて、主としてわが国の国債に投資を行います。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	ベビーファンド	日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ受益証券を主要投資対象とします。
	マザーファンド	わが国の国債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	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。	
	<div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。） </div>	

※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。

運用報告書（全体版）

ラップ向け 日本超長期国債インデックスファンドⅡ

第2期（決算日：2023年6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「ラップ向け日本超長期国債インデックスファンドⅡ」は、去る6月26日に第2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）

お客さまのお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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI 国債超長期(11-)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税 分 配	込 み 金	期 騰 落	中 率			
(設定日)	円		円		%	%	%	百万円
2022年1月27日	10,000		—		—	—	—	1
1期(2022年6月27日)	9,312		0	△6.9	9,227.57	△6.8	99.6	62
2期(2023年6月26日)	9,425		0	1.2	9,364.89	1.5	99.4	38

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) NOMURA-BPI国債超長期(11-)とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表している日本国が発行した固定利付債(個人向けは対象外)の残存期間11年以上の債券のパフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI国債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。ベンチマークは、当該指数を三菱UFJ国際投信が計算し指数化したものです。

(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		N O M U R A - B P I 国 債 超 長 期 (1 1 -)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年 6 月27日	円	%		%	%	%
	9,312	—	9,227.57	—	99.6	—
6 月 末	9,367	0.6	9,283.88	0.6	99.6	—
7 月 末	9,465	1.6	9,382.27	1.7	99.5	—
8 月 末	9,445	1.4	9,366.80	1.5	99.3	—
9 月 末	9,194	△1.3	9,114.21	△1.2	97.6	—
10 月 末	9,150	△1.7	9,078.30	△1.6	99.6	—
11 月 末	9,036	△3.0	8,964.01	△2.9	99.6	—
12 月 末	8,821	△5.3	8,758.96	△5.1	98.1	—
2023年 1 月 末	8,728	△6.3	8,668.10	△6.1	99.3	—
2 月 末	9,025	△3.1	8,963.40	△2.9	99.3	—
3 月 末	9,267	△0.5	9,207.88	△0.2	99.4	—
4 月 末	9,334	0.2	9,268.63	0.4	99.4	—
5 月 末	9,303	△0.1	9,242.21	0.2	99.4	—
(期 末) 2023年 6 月26日	9,425	1.2	9,364.89	1.5	99.4	—

(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2期：2022年6月28日～2023年6月26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2期首	9,312円
第2期末	9,425円
既払分配金	0円
騰落率	1.2%

※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

基準価額は期間の初めに比べ1.2%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（1.5%）を0.3%下回りました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

第2期：2022年6月28日～2023年6月26日

▶ 投資環境について

▶ 国内超長期国債市況

国内債券市況は上昇しました。

国内債券市況は、期間の前半はインフレ率の高止まりを受けた欧米金利の上昇や、日銀がイールドカーブコントロール（Y

CC）の修正を決定したことなどにより下落しましたが、期間の終わりにかけては欧米金融不安などを背景に反発しました。期間を通じてみると国内債券市況は上昇しました。

▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

▶ ラップ向け日本超長期国債インデックスファンドⅡ

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、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

▶ 日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ

資産のほぼ全額を国債（先物を含む）に投資し、高い国債組入比率を維持しました。

ベンチマークであるNOMURA-BPI国債 超長期（11-）の構成銘柄を年限の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました*。
※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ ラップ向け日本超長期国債インデックスファンドⅡ

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.3\%$ 程度となりました。

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による影響は $\Delta 0.2\%$ 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影響は $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

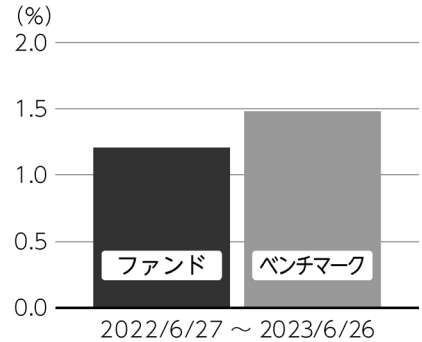
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：評価時価差異要因*によるものです。

*ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価が異なるため生じる要因です。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

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

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2期 2022年6月28日～2023年6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	243

(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 （作成対象期間末での見解です。）

▶ **ラップ向け日本超長期国債インデックスファンドⅡ**
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ **日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ**
ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2022年6月28日～2023年6月26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	20	0.219	(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)	(16)	(0.175)	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)	(1)	(0.011)	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)	(3)	(0.033)	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	20	0.222	

期中の平均基準価額は、9,168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。

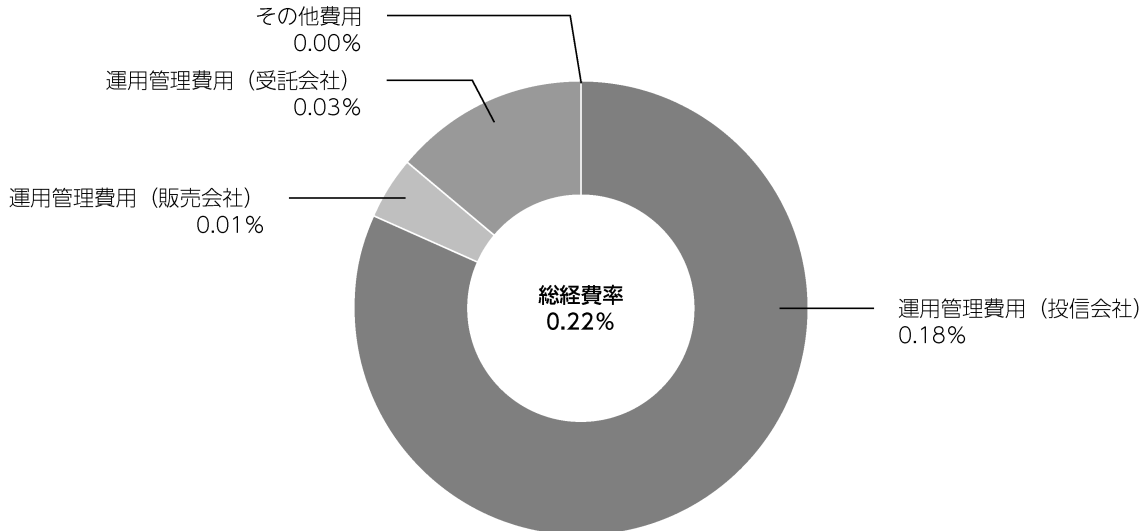
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.22%**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

(2022年6月28日～2023年6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
日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ	千口 155,980	千円 143,761	千口 182,756	千円 166,856

○利害関係人との取引状況等

(2022年6月28日～2023年6月26日)

利害関係人との取引状況

<ラップ向け日本超長期国債インデックスファンドⅡ>

該当事項はございません。

<日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ>

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 41,934	百万円 13,329	% 31.8	百万円 80,781	百万円 16,334	% 20.2

平均保有割合 0.3%

※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

(2022年6月28日～2023年6月26日)

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 1	百万円 —	百万円 —	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2023年6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
日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ	千口 68,066	千口 41,290	千円 38,627

○投資信託財産の構成

(2023年6月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ	千円 38,627	% 99.6
コール・ローン等、その他	155	0.4
投資信託財産総額	38,782	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年6月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	38,782,306
コール・ローン等	94,847
日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ(詳細額)	38,627,023
未収入金	60,436
(B) 負債	152,395
未払解約金	119,546
未払信託報酬	32,482
その他未払費用	367
(C) 純資産総額(A－B)	38,629,911
元本	40,988,119
次期繰越損益金	△ 2,358,208
(D) 受益権総口数	40,988,119口
1万口当たり基準価額(C/D)	9.425円

<注記事項>

- ①期首元本額 67,415,032円
 期中追加設定元本額 158,828,303円
 期中一部解約元本額 185,255,216円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9425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2,358,208円です。

③分配金の計算過程

項 目	2022年6月28日～ 2023年6月26日
費用控除後の配当等収益額	469,195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	267,535円
収益調整金額	252,145円
分配準備積立金額	9,768円
当ファンドの分配対象収益額	998,643円
1万口当たり収益分配対象額	243円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

*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 (2022年6月28日～2023年6月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 2
支払利息	△ 2
(B) 有価証券売買損益	1,009,172
売買益	3,439,664
売買損	△2,430,492
(C) 信託報酬等	△ 136,598
(D) 当期損益金(A+B+C)	872,572
(E) 前期繰越損益金	△ 126,074
(F) 追加信託差損益金	△3,104,706
(配当等相当額)	(101,663)
(売買損益相当額)	(△3,206,369)
(G) 計(D+E+F)	△2,358,208
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△2,358,208
追加信託差損益金	△3,104,706
(配当等相当額)	(252,145)
(売買損益相当額)	(△3,356,851)
分配準備積立金	746,498

- (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。

【お知らせ】

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。

日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ

《第3期》決算日2023年5月12日

〔計算期間：2022年5月13日～2023年5月12日〕

「日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ」は、5月12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	主としてわが国の国債に投資を行い、NOMURA-BPI国債 超長期(11-)に連動する投資成果をめざして運用を行います。国債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	わが国の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		N O M U R A - B P I 国 債 超 長 期 (1 1 -)		債 券 組 入 比 率	債 券 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
2020年12月28日	10,000	—	277.89	—	—	—	499
1期(2021年5月12日)	9,974	△0.3	277.41	△0.2	99.8	—	122,927
2期(2022年5月12日)	9,504	△4.7	264.34	△4.7	99.3	—	96,031
3期(2023年5月12日)	9,250	△2.7	257.40	△2.6	99.4	—	2,911

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) NOMURA-BPI国債 超長期(11-)とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表している日本国が発行した固定利付債(個人向けは対象外)の残存期間11年以上の債券のパフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI国債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。

(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		N O M U R A - B P I 国 債 超 長 期 (1 1 -)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年 5 月12日	円	%		%	%	%
	9,504	—	264.34	—	99.3	—
5 月末	9,510	0.1	264.49	0.1	99.5	—
6 月末	9,277	△2.4	257.99	△2.4	99.6	—
7 月末	9,375	△1.4	260.72	△1.4	99.6	—
8 月末	9,358	△1.5	260.29	△1.5	99.3	—
9 月末	9,111	△4.1	253.27	△4.2	97.6	—
10 月末	9,069	△4.6	252.28	△4.6	99.6	—
11 月末	8,958	△5.7	249.10	△5.8	99.6	—
12 月末	8,746	△8.0	243.40	△7.9	98.1	—
2023年 1 月末	8,656	△8.9	240.88	△8.9	99.3	—
2 月末	8,952	△5.8	249.08	△5.8	99.3	—
3 月末	9,194	△3.3	255.88	△3.2	99.4	—
4 月末	9,262	△2.5	257.56	△2.6	99.4	—
(期 末) 2023年 5 月12日	9,250	△2.7	257.40	△2.6	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

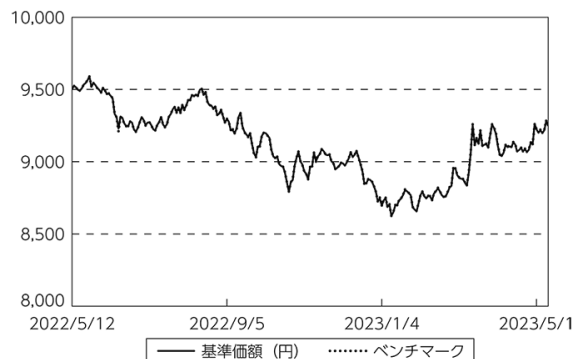
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ2.7%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(−2.6%)を0.1%下回りました。

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

(下落要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

● 投資環境について

◎ 国内超長期国債市況

国内債券市況は下落しました。

- ・ 国内債券市況は、期間の前半はインフレ率の高止まりを受けた欧米金利の上昇などから下落しました。2022年12月には日銀がイールドカーブコントロール（YCC）の修正を決定したことなどにより国内債券市況は下落しましたが、期間の終わりにかけては米欧金融不安などを背景に反発しました。期間を通じてみると国内債券市況は下落しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 資産のほぼ全額を国債（先物を含む）に投資し、高い国債組入比率を維持しました。
- ・ ベンチマークであるNOMURA-BPI国債超長期（11-）の構成銘柄を年限の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました*。
※一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは2.6%の下落になったため、乖離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 評価時価差異要因*によるものです。

*ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価が異なるため生じる要因です。

(主なマイナス要因)

- ・ ポートフォリオ要因によるものです。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2022年5月13日～2023年5月12日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2022年5月13日～2023年5月12日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 57,346,915	千円 144,889,987

(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

(2022年5月13日～2023年5月12日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A			B A	売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B				うち利害関係人 との取引状況D		
公社債	百万円 57,346	百万円 13,915	% 24.3	百万円 144,889	百万円 30,723	% 21.2	

(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

(2023年5月12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	
国債証券	千円 2,876,000	千円 2,894,728	% 99.4	% —	% 99.4	% —	% —	
合計	2,876,000	2,894,728	99.4	—	99.4	—	—	

(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
国債証券	%	千円	千円
第4回利付国債(40年)	2.2	36,000	43,880
第5回利付国債(40年)	2.0	40,000	47,109
第6回利付国債(40年)	1.9	21,000	24,337
第7回利付国債(40年)	1.7	22,000	24,421
第8回利付国債(40年)	1.4	22,000	22,699
第9回利付国債(40年)	0.4	39,000	29,788
第10回利付国債(40年)	0.9	28,000	25,014
第11回利付国債(40年)	0.8	20,000	17,229
第12回利付国債(40年)	0.5	23,000	17,741
第13回利付国債(40年)	0.5	36,000	27,522
第14回利付国債(40年)	0.7	32,000	26,103
第15回利付国債(40年)	1.0	40,000	35,748
第20回利付国債(30年)	2.5	50,000	61,418
第23回利付国債(30年)	2.5	20,000	24,704
第25回利付国債(30年)	2.3	3,000	3,638
第26回利付国債(30年)	2.4	40,000	49,141
第27回利付国債(30年)	2.5	10,000	12,444
第28回利付国債(30年)	2.5	50,000	62,355
第29回利付国債(30年)	2.4	8,000	9,878
第30回利付国債(30年)	2.3	6,000	7,327
第31回利付国債(30年)	2.2	40,000	48,271
第32回利付国債(30年)	2.3	25,000	30,567
第34回利付国債(30年)	2.2	65,000	78,536
第35回利付国債(30年)	2.0	30,000	35,308
第36回利付国債(30年)	2.0	40,000	47,127
第37回利付国債(30年)	1.9	11,000	12,770
第38回利付国債(30年)	1.8	20,000	22,819
第39回利付国債(30年)	1.9	27,000	31,302
第40回利付国債(30年)	1.8	12,000	13,692
第41回利付国債(30年)	1.7	15,000	16,836
第42回利付国債(30年)	1.7	25,000	28,067
第43回利付国債(30年)	1.7	23,000	25,827
第44回利付国債(30年)	1.7	13,000	14,588
第45回利付国債(30年)	1.5	25,000	27,076
第46回利付国債(30年)	1.5	28,000	30,319
第47回利付国債(30年)	1.6	24,000	26,438
第48回利付国債(30年)	1.4	26,000	27,597
第49回利付国債(30年)	1.4	24,000	25,464
第50回利付国債(30年)	0.8	23,000	21,602
第51回利付国債(30年)	0.3	29,000	24,235
第52回利付国債(30年)	0.5	22,000	19,226
第53回利付国債(30年)	0.6	17,000	15,165
第54回利付国債(30年)	0.8	27,000	25,160
第55回利付国債(30年)	0.8	19,000	17,661
第56回利付国債(30年)	0.8	28,000	25,962

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57回利付国債 (30年)		0.8	19,000	17,573	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)		0.8	46,000	42,437	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)		0.7	18,000	16,170	2048/6/20
第60回利付国債 (30年)		0.9	23,000	21,595	2048/9/20
第61回利付国債 (30年)		0.7	15,000	13,374	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)		0.5	35,000	29,525	2049/3/20
第63回利付国債 (30年)		0.4	15,000	12,261	2049/6/20
第64回利付国債 (30年)		0.4	19,000	15,476	2049/9/20
第65回利付国債 (30年)		0.4	25,000	20,331	2049/12/20
第66回利付国債 (30年)		0.4	40,000	32,352	2050/3/20
第67回利付国債 (30年)		0.6	30,000	25,535	2050/6/20
第68回利付国債 (30年)		0.6	20,000	16,969	2050/9/20
第69回利付国債 (30年)		0.7	30,000	26,105	2050/12/20
第71回利付国債 (30年)		0.7	25,000	21,689	2051/6/20
第72回利付国債 (30年)		0.7	30,000	26,001	2051/9/20
第73回利付国債 (30年)		0.7	22,000	19,049	2051/12/20
第75回利付国債 (30年)		1.3	29,000	29,246	2052/6/20
第76回利付国債 (30年)		1.4	18,000	18,599	2052/9/20
第77回利付国債 (30年)		1.6	20,000	21,652	2052/12/20
第78回利付国債 (30年)		1.4	10,000	10,337	2053/3/20
第149回利付国債 (20年)		1.5	50,000	55,432	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)		1.4	49,000	53,794	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)		1.2	51,000	54,823	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	55,000	59,107	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)		1.3	46,000	49,941	2035/6/20
第155回利付国債 (20年)		1.0	43,000	45,094	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	47,000	45,769	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)		0.2	19,000	17,978	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)		0.5	46,000	45,152	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)		0.6	43,000	42,677	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)		0.7	9,000	9,034	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)		0.6	25,000	24,710	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)		0.6	43,000	42,383	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)		0.6	30,000	29,485	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)		0.5	8,000	7,732	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)		0.5	20,000	19,269	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)		0.7	49,000	48,462	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)		0.5	35,000	33,497	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)		0.4	44,000	41,321	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)		0.3	25,000	23,020	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)		0.3	6,000	5,502	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)		0.3	32,000	29,248	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)		0.4	32,000	29,637	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)		0.4	24,000	22,156	2040/6/20
第174回利付国債 (20年)		0.4	75,000	69,009	2040/9/20
第175回利付国債 (20年)		0.5	27,000	25,186	2040/12/20

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177回利付国債	(20年)	0.4	25,000	22,771	2041/6/20
第178回利付国債	(20年)	0.5	38,000	35,162	2041/9/20
第179回利付国債	(20年)	0.5	38,000	35,075	2041/12/20
第180回利付国債	(20年)	0.8	30,000	29,163	2042/3/20
第181回利付国債	(20年)	0.9	30,000	29,637	2042/6/20
第182回利付国債	(20年)	1.1	62,000	63,261	2042/9/20
第183回利付国債	(20年)	1.4	37,000	39,652	2042/12/20
第184回利付国債	(20年)	1.1	10,000	10,157	2043/3/20
合	計		2,876,000	2,894,728	

○投資信託財産の構成

(2023年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 2,894,728	% 99.1
コール・ローン等、その他	27,466	0.9
投資信託財産総額	2,922,194	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,922,194,579
コール・ローン等	11,191,131
公社債(評価額)	2,894,728,440
未収入金	9,272,700
未収利息	6,746,095
前払費用	256,213
(B) 負債	10,838,203
未払解約金	10,838,190
未払利息	13
(C) 純資産総額(A-B)	2,911,356,376
元本	3,147,545,624
次期繰越損益金	△ 236,189,248
(D) 受益権総口数	3,147,545,624口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,250円

<注記事項>

- ①期首元本額 101,046,994,955円
 期中追加設定元本額 54,756,182,370円
 期中一部解約元本額 152,655,631,701円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.9250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)

日本超長期国債インデックスファンド(ラップ向け)	3,112,614,577円
ラップ向け日本超長期国債インデックスファンドⅡ	34,931,047円
合計	3,147,545,624円

- ③純資産総額が元本額を下回っており、その差額は236,189,248円です。

○損益の状況 (2022年5月13日～2023年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	314,660,060
受取利息	314,997,660
支払利息	△ 337,600
(B) 有価証券売買損益	△ 4,933,477,000
売買益	24,536,450
売買損	△ 4,958,013,450
(C) 当期損益金(A+B)	△ 4,618,816,940
(D) 前期繰越損益金	△ 5,015,120,479
(E) 追加信託差損益金	△ 2,868,528,560
(F) 解約差損益金	12,266,276,731
(G) 計(C+D+E+F)	△ 236,189,248
次期繰越損益金(G)	△ 236,189,248

- (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。

[お知らせ]

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。