

# Amundi

ASSET MANAGEMENT  
アムンディ アセットマネジメント

## ■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	2016年9月26日から無期限です。	
運用方針	アムンディ円建債券アクティブ・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として円建ての公社債に実質的に投資をすることにより、投資信託財産の成長をめざして運用を行います。公社債への投資については、「ワールドカーブ戦略」、「クレジット戦略」および「住宅ローン担保証券（RMBS）戦略」の3つの戦略を積み上げるボトムアップ・アプローチを基にしたアクティブ運用を行います。NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目標とします。	
主要運用対象	アムンディ円建債券アクティブ・マザーファンド（ダイワ投資一任専用）	アムンディ円建債券アクティブ・マザーファンドの受益証券
	アムンディ円建債券アクティブ・マザーファンド	円建ての公社債
組入制限	アムンディ円建債券アクティブ・マザーファンド（ダイワ投資一任専用）	株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（ただし、転換社債の転換、新株引受権の行使および新株予約権の行使により取得する case に限ります。）外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。
	アムンディ円建債券アクティブ・マザーファンド	株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（ただし、転換社債の転換、新株引受権の行使および新株予約権の行使により取得する case に限ります。）外貨建資産への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。
分配方針	毎決算時（年1回、原則毎年6月15日。休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益（評価益を含みます）等の全額とします。分配金額は、委託者が基準価額水準および市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。	

## アムンディ円建債券アクティブ・ファンド （ダイワ投資一任専用）

### 運用報告書（全体版）

第7期（決算日 2023年6月15日）

#### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに、期中の運用状況についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

#### アムンディ・ジャパン株式会社

〒105-0021 東京都港区東新橋1丁目9番2号

お客様サポートライン: 050-4561-2500

受付は委託会社の営業日の午前9時から午後5時まで

ホームページアドレス: <https://www.amundi.co.jp/>

<2974742・2968001>

## アムンディ円建債券アクティブ・ファンド（ダイワ投資一任専用）

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	ベンチマーク		債券組入 比率	純資産 総額
				NOMURA-BPI 総合	期中 騰落率		
3期 (2019年6月17日)	円 10,178	円 0	% 2.4	10,192	% 2.5	% 99.6	百万円 1,340
4期 (2020年6月15日)	10,042	0	△1.3	10,088	△1.0	99.6	1,957
5期 (2021年6月15日)	10,042	0	0.0	10,069	△0.2	99.6	3,498
6期 (2022年6月15日)	9,691	0	△3.5	9,739	△3.3	99.5	3,881
7期 (2023年6月15日)	9,722	0	0.3	9,770	0.3	99.5	5,152

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」は実質組入比率を記載しています。以下同じ。

(注2) ベンチマークはNOMURA-BPI総合です。ベンチマークは、設定日（2016年9月26日）前日を10,000として指数化しています。NOMURA-BPI総合とは、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（以下「NFRC」という。）が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数です。同指数の知的財産権とその他一切の権利はNFRCに帰属します。以下同じ。

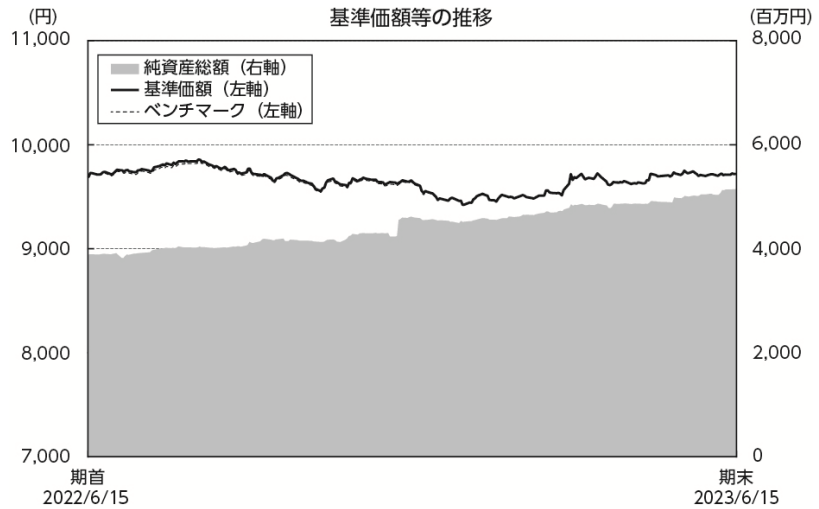
### ■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク		債券組入 比率
			NOMURA-BPI 総合	騰落率	
(期首) 2022年6月15日	円 9,691	% —	9,739	% —	% 99.5
6月末	9,741	0.5	9,779	0.4	99.7
7月末	9,821	1.3	9,843	1.1	99.5
8月末	9,789	1.0	9,820	0.8	99.2
9月末	9,682	△0.1	9,714	△0.3	99.4
10月末	9,676	△0.2	9,705	△0.4	99.6
11月末	9,625	△0.7	9,655	△0.9	99.2
12月末	9,486	△2.1	9,532	△2.1	99.6
2023年1月末	9,456	△2.4	9,506	△2.4	99.3
2月末	9,562	△1.3	9,609	△1.3	98.3
3月末	9,690	△0.0	9,744	0.0	99.4
4月末	9,723	0.3	9,766	0.3	99.2
5月末	9,713	0.2	9,758	0.2	98.4
(期末) 2023年6月15日	9,722	0.3	9,770	0.3	99.5

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第7期首	9,691円
第7期末	9,722円
既払分配金 (税込)	0円
騰落率	0.3%



(注1) ベンチマーク（ファンド運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指数）は、NOMURA-BPI総合です。  
 (注2) ベンチマークは、2022年6月15日の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ①2022年7月、欧米で物価上昇に対応した積極的な金融引き締めが景気の鈍化を招くとの懸念から、国内債券利回りが低下（債券価格は上昇）したこと
- ②2023年2月から3月には、年度末に向けた国内債券への買い需要や日本銀行による金融政策変更の見送りに加え、欧米の一部金融機関で信用不安が高まったことにより、国内債券利回りが低下したこと

下落要因

- ①2022年9月、米国の物価指標が予想を上回ったことから米国での大幅利上げに対する警戒感が広がり、国内債券利回りも上昇（債券価格は下落）したこと
- ②2022年12月、日本銀行が金融政策決定会合において長期金利の変動幅を拡大し、長期金利の上限が引き上げられたことから、国内債券利回りが上昇したこと

【投資環境】

投資環境につきましては、主要投資対象であるアムンディ・円建債券アクティブ・マザーファンドの運用報告書（後述）をご参照ください。

【ポートフォリオ】

<当ファンド>

当ファンドは、アムンディ・円建債券アクティブ・マザーファンド受益証券を通じて主として円建ての公社債に投資することにより、投資信託財産の成長を目指して運用を行いました。当期においては、基本方針に基づきマザーファンドの組入比率を高位に維持しました。

<アムンディ円建債券アクティブ・マザーファンド>

マザーファンドのポートフォリオについては、アムンディ・円建債券アクティブ・マザーファンドの運用報告書（後述）をご参照ください。

**【ベンチマークとの差異】**

当期の基準価額の騰落率は+0.3%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の騰落率+0.3%と同水準となりました。

プラス要因：イールドカーブの形状変化をふまえ主に5－10年ゾーンで入れ替えを行ったことや、金利が上昇した30年・40年ゾーンをアンダーウェイトしていたこと、保有銘柄のスプレッドが相対的に縮小したこと

マイナス要因：金利が上昇する中でデュレーションがベンチマークに対し長めであったことや、信託報酬等の費用を負担したこと

**【分配金】**

収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、見送りとさせていただきます（分配原資の内訳につきましては、後記の「分配金のお知らせ」をご覧ください）。なお、収益分配に充てず、信託財産内に留保した収益については、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

**【今後の運用方針】**

**<当ファンド>**

引き続きアムンディ・円建債券アクティブ・マザーファンド受益証券を高位に組み入れて運用を行います。

**<アムンディ円建債券アクティブ・マザーファンド>**

マザーファンドの今後の運用方針については、アムンディ・円建債券アクティブ・マザーファンドの運用報告書（後述）をご参照ください。

# アムンディ円建債券アクティブ・ファンド（ダイワ投資一任専用）

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第7期 (2022年6月16日 ～2023年6月15日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社)  (受託会社)	35円 (27) (5)  (3)	0.363% (0.275) (0.055)  (0.033)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) その他費用 (保管費用)  (監査費用) (印刷費用) (その他)	5 (0)  (1) (4) (0)	0.049 (0.000)  (0.010) (0.037) (0.001)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・ 資産の移転等に要する費用 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ファンドの法定開示資料の印刷に係る費用 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	40	0.412	

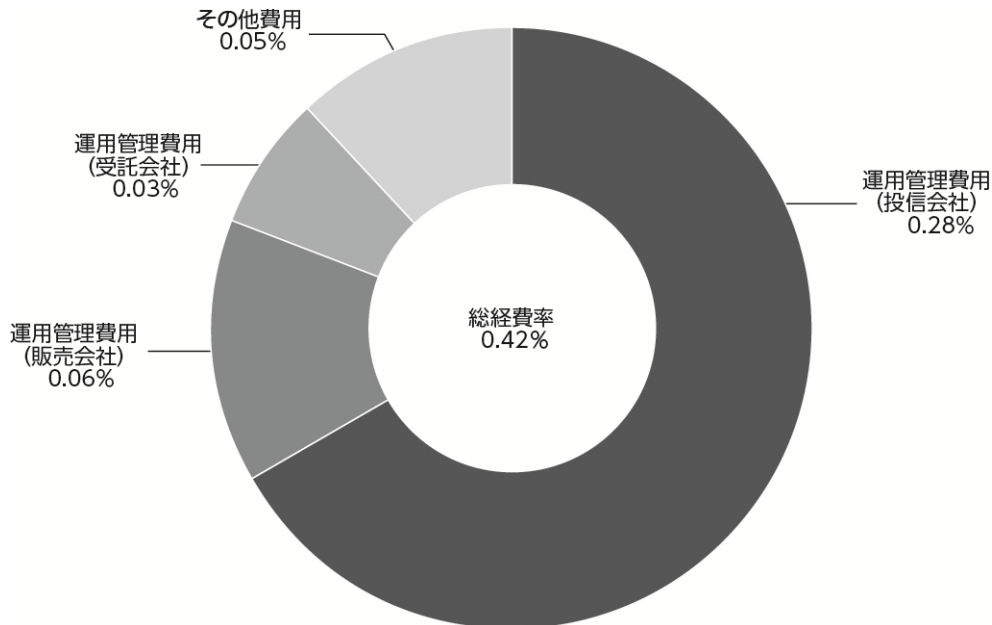
期中の平均基準価額は9,663円です。

- (注1) 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2) 消費税は報告日の税率を採用しています。  
(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。  
(注4) その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンド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5) 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、売買委託手数料およ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0.42%です。



- (注1) 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2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。  
(注3) 各比率は、年率換算した値です。  
(注4) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応する費用を含みます。  
(注5) 上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異なります。

## アムンディ円建債券アクティブ・ファンド（ダイワ投資一任専用）

### ■売買及び取引の状況（2022年6月16日から2023年6月15日まで）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
アムンディ円建債券アクティブ・マザーファンド	1,559,552	1,544,791	326,056	322,733

(注) 単位未満は切捨てです。

### ■利害関係人との取引状況等（2022年6月16日から2023年6月15日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(注) 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す。

### ■組入資産の明細（2023年6月15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
アムンディ円建債券アクティブ・マザーファンド	3,914,979	5,148,475	5,138,693

(注1) 単位未満は切捨てです。

(注2) アムンディ円建債券アクティブ・マザーファンド全体の受益権口数は、当期末15,359,233千口です。

### ■投資信託財産の構成（2023年6月15日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
アムンディ円建債券アクティブ・マザーファンド	5,138,693	99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	23,446	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	5,162,139	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨てです。

# アムンディ円建債券アクティブ・ファンド（ダイワ投資一任専用）

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2023年6月15日現在

項目	当 期 末
(A) 資 産	5,162,139,331円
コール・ローン等	23,445,471
アムンディ円建債券アクティブ・マザーファンド(評価額)	5,138,693,860
(B) 負 債	9,768,066
未払信託報酬	8,640,931
その他未払費用	1,127,135
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	5,152,371,265
元 本	5,299,964,743
次期繰越損益金	△147,593,478
(D) 受 益 権 総 口 数	5,299,964,743口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,722円

(注記事項)

期首元本額	4,005,115,497円
期中追加設定元本額	1,946,491,867円
期中一部解約元本額	651,642,621円

## ■損益の状況

当期 自2022年6月16日 至2023年6月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 22,636円
支 払 利 息	△ 22,636
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	40,951,834
売 買 益	44,508,110
売 買 損	△ 3,556,276
(C) 信 託 報 酬 等	△ 18,243,569
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	22,685,629
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△111,245,906
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 59,033,201
(配当等相当額)	( 136,768,733)
(売買損益相当額)	(△195,801,934)
(G) 計 (D + E + F)	△147,593,478
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△147,593,478
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 59,033,201
(配当等相当額)	( 137,465,910)
(売買損益相当額)	(△196,499,111)
分 配 準 備 積 立 金	29,579,892
繰 越 損 益 金	△118,140,169

(注1) (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2) (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3) (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。

## ■分配金のお知らせ

当期の分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、見送りとさせていただきます。

### 収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

### 【分配原資の内訳】

(単位：円・1万口当たり・税込み)

項目	第7期
	(2022年6月16日～2023年6月15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	315

(注1) 「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る点にご留意ください。

(注2) 「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。

# アムンディ円建債券アクティブ・マザーファンド

## 運用報告書

《第7期》

決算日：2023年6月15日

(計算期間：2022年6月16日～2023年6月15日)

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに、期中の運用状況についてご報告申し上げます。

### ■当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	主として円建ての公社債に投資をすることにより、投資信託財産の成長をめざして運用を行います。公社債への投資については、「イールドカーブ戦略」、「クレジット戦略」および「住宅ローン担保証券（RMBS）戦略」の3つの戦略を積み上げるボトムアップ・アプローチを基にしたアクティブ運用を行います。NOMURA-BPI 総合をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目標とします。
主要運用対象	円建ての公社債
組入制限	株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（ただし、転換社債の転換、新株引受権の行使および新株予約権の行使により取得する場合に限りません。）外貨建資産への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。



■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマ ー ク		債券組入 比 率	純 資 産 額
	円	騰 落 率	NOMURA-BPI 総 合	騰 落 率		
3期 (2019年6月17日)	10,268	2.6	10,192	2.5	99.6	10,732
4期 (2020年6月15日)	10,179	△0.9	10,088	△1.0	99.6	11,267
5期 (2021年6月15日)	10,221	0.4	10,069	△0.2	99.7	16,773
6期 (2022年6月15日)	9,904	△3.1	9,739	△3.3	99.6	22,606
7期 (2023年6月15日)	9,981	0.8	9,770	0.3	99.7	15,330

(注) ベンチマークはNOMURA-BPI総合です。ベンチマークは、設定日(2016年9月26日)前日を10,000として指数化しています。NOMURA-BPI総合とは、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(以下「NFRC」という。)が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数です。同指数の知的財産権とその他一切の権利はNFRCに帰属します。以下同じ。

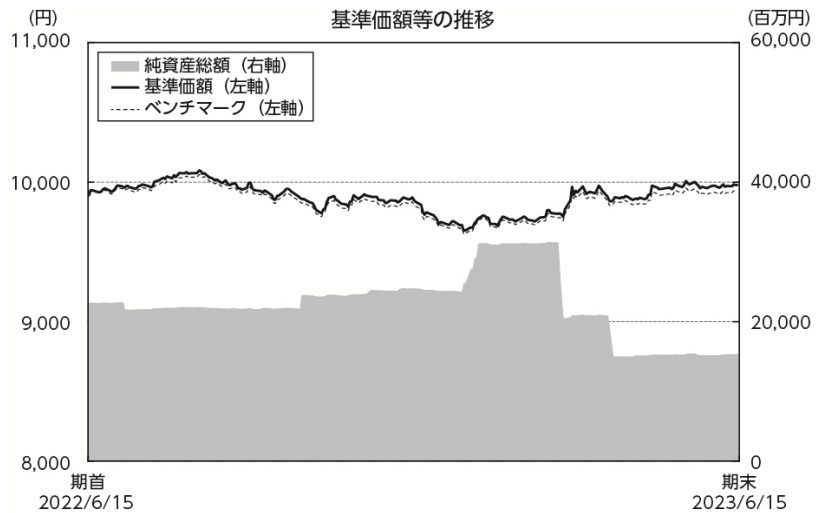
■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマ ー ク		債券組入 比 率
	円	騰 落 率	NOMURA-BPI 総 合	騰 落 率	
(期 首) 2022年6月15日	9,904	—	9,739	—	99.6
6月末	9,956	0.5	9,779	0.4	99.8
7月末	10,042	1.4	9,843	1.1	99.7
8月末	10,013	1.1	9,820	0.8	99.7
9月末	9,905	0.0	9,714	△0.3	99.8
10月末	9,902	△0.0	9,705	△0.4	99.8
11月末	9,854	△0.5	9,655	△0.9	99.8
12月末	9,715	△1.9	9,532	△2.1	99.8
2023年1月末	9,687	△2.2	9,506	△2.4	99.8
2月末	9,800	△1.1	9,609	△1.3	99.8
3月末	9,939	0.4	9,744	0.0	99.7
4月末	9,976	0.7	9,766	0.3	99.8
5月末	9,970	0.7	9,758	0.2	99.7
(期 末) 2023年6月15日	9,981	0.8	9,770	0.3	99.7

(注) 騰落率は期首比です。

【基準価額等の推移】

第7期首	9,904円
第7期末	9,981円
騰落率	0.8%



(注1) ベンチマーク（ファンド運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指数）は、NOMURA-BPI総合です。  
 (注2) ベンチマークは、2022年6月15日の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ①2022年7月、欧米で物価上昇に対応した積極的な金融引き締めが景気の鈍化を招くとの懸念から、国内債券利回りが低下（債券価格は上昇）したこと
- ②2023年2月から3月には、年度末に向けた国内債券への買い需要や日本銀行による金融政策変更の見送りに加え、欧米の一部金融機関で信用不安が高まったことにより、国内債券利回りが低下したこと

下落要因

- ①2022年9月、米国の物価指標が予想を上回ったことから米国での大幅利上げに対する警戒感が広がり、国内債券利回りも上昇（債券価格は下落）したこと
- ②2022年12月、日本銀行が金融政策決定会合において長期金利の変動幅を拡大し、長期金利の上限が引き上げられたことから、国内債券利回りが上昇したこと

【投資環境】

<国内債券市場>

当期において、国内長期・超長期債券利回りは上昇しました。2022年8月下旬から11月にかけて、欧米で物価上昇に対応した利上げが実施されると世界的な金利上昇に合わせて国内債券利回りも上昇しました。長期金利については日本銀行が変動幅の上限としていた0.25%まで上昇した後その近辺での推移が続き、超長期金利は2015年以来となる高水準まで利回りが上昇しました。12月には、日本銀行が金融政策決定会合で長期金利の変動幅を拡大し、長期金利はその上限が0.5%となったことで0.5%近辺まで上昇しました。しかし、その後は年度末に向けた国内債券への買い需要や日本銀行によるさらなる変動幅の拡大がなかったことに加え、欧米の一部金融機関で信用不安が起こったことなどを背景に、国内債券利回りはピークからは低下して当期末を迎えました。また、事業債スプレッドは拡大しました。欧米を中心とした利上げの影響により、世界的に景気後退の懸念があったことから事業債スプレッドは拡大傾向となりました。日本銀行による金利の変動幅の拡大や、欧米の一部金融機関における信用不安も事業債市場への懸念を高め、スプレッドを拡大させました。ただし、金利上昇時には利回り確保を目的とした買いも入り、スプレッドはピークからは縮小して当期末を迎えました。

**【ポートフォリオ】**

当ファンドは、「イールドカーブ戦略」「クレジット戦略」「住宅ローン担保証券（RMB S）戦略」に基づいて収益を獲得します。イールドカーブ戦略では、利回りを高めるため、主に20年ゾーンをオーバーウェイト、2年・40年ゾーンをアンダーウェイトとし、5年・7年・10年・30年ゾーンは市場環境に応じて調整しました。また、ポートフォリオ全体のデュレーションはベンチマークに対し長めとしました。クレジット戦略は、スプレッドの厚い円建外債およびユーロ円債をオーバーウェイトとしました。住宅ローン担保証券（RMB S）戦略においては、スプレッドの厚い銘柄群のオーバーウェイトを維持しました。

**【ベンチマークとの差異】**

当期の基準価額の騰落率は+0.8%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の騰落率+0.3%を0.5%上回りました。

プラス要因：イールドカーブの形状変化をふまえ主に5－10年ゾーンで入れ替えを行ったことや、金利が上昇した30年・40年ゾーンをアンダーウェイトしていたこと、保有銘柄のスプレッドが相対的に縮小したこと

マイナス要因：金利が上昇する中でデュレーションがベンチマークに対し長めであったこと

**【今後の運用方針】**

今後も、「イールドカーブ戦略」、「クレジット戦略」、「住宅ローン担保証券（RMB S）戦略」に基づいて収益を獲得します。イールドカーブ戦略では、イールドカーブの形状変化に対応して、各年限の比率を適宜調整します。クレジット戦略では、円建外債やユーロ円債のオーバーウェイトを維持します。住宅ローン担保証券（RMB S）戦略では、当面は現状のウェイトを維持しますが、環境の変化により機動的にウェイトを変更する方針です。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第7期 (2022年6月16日 ～2023年6月15日)		項目の概要
	金額	比率	
その他費用 (保管費用)	0円 (0)	0.001% (0.000)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・ 資産の移転等に要する費用 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	0	0.001	

期中の平均基準価額は9,896円です。

(注1) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 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 (2022年6月16日から2023年6月15日まで)

## 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	53,961,878	59,367,576
	特殊債証券	839,052	1,379,945 (191,281)
	社債券(投資法人債券を含む)	1,791,720	2,892,608

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれていません。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

(注4) 社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれていません。

## ■ 主要な売買銘柄 (2022年6月16日から2023年6月15日まで)

## 公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
		千円	
第153回利付国債(5年)	6,017,226	第153回利付国債(5年)	6,006,912
第154回利付国債(5年)	5,209,340	第356回利付国債(10年)	4,771,497
第356回利付国債(10年)	4,787,299	第367回利付国債(10年)	4,472,145
第367回利付国債(10年)	4,506,776	第154回利付国債(5年)	4,307,432
第357回利付国債(10年)	4,051,950	第355回利付国債(10年)	4,279,319
第364回利付国債(10年)	2,802,126	第357回利付国債(10年)	4,037,214
第439回利付国債(2年)	2,545,758	第150回利付国債(5年)	2,661,341
第150回利付国債(5年)	2,276,103	第174回利付国債(20年)	2,636,877
第155回利付国債(5年)	2,087,739	第439回利付国債(2年)	2,545,472
第174回利付国債(20年)	1,862,519	第364回利付国債(10年)	2,300,722

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれていません。

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれていません。

## ■ 利害関係人との取引状況等 (2022年6月16日から2023年6月15日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(注) 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す。

## ■組入資産の明細（2023年6月15日現在）

## 公社債

## (A) 債券種類別開示

## 国内／外国（邦貨建）公社債

区 分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 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
国 債 証 券	12,619,000 (1,229,000)	12,303,469 (1,197,717)	80.3 (7.8)	— (—)	56.2 (5.2)	22.1 (1.3)	2.0 (1.3)
特 殊 債 券 ( 除 く 金 融 債 )	1,153,037 (390,230)	1,182,299 (400,085)	7.7 (2.6)	— (—)	7.7 (2.6)	— (—)	— (—)
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	1,800,000 (1,800,000)	1,802,492 (1,802,492)	11.8 (11.8)	— (—)	— (—)	5.3 (5.3)	6.5 (6.5)
合 計	15,572,037 (3,419,230)	15,288,261 (3,400,294)	99.7 (22.2)	— (—)	63.9 (7.8)	27.4 (6.6)	8.4 (7.8)

(注1) ( )内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 単位未満は切捨てです。

(注4) 一印は組入れなしです。

(注5) 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。

## (B) 個別銘柄開示

## 国内／外国（邦貨建）公社債

銘 柄 名	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154回利付国債（5年）	0.1	918,000	920,928	2027/9/20
第155回利付国債（5年）	0.3	1,607,000	1,625,448	2027/12/20
第157回利付国債（5年）	0.2	216,000	217,226	2028/3/20
第158回利付国債（5年）	0.1	427,000	427,303	2028/3/20
第360回利付国債（10年）	0.1	425,000	420,601	2030/9/20
第361回利付国債（10年）	0.1	304,000	300,193	2030/12/20
第362回利付国債（10年）	0.1	655,000	645,554	2031/3/20
第364回利付国債（10年）	0.1	529,000	519,419	2031/9/20
第370回利付国債（10年）	0.5	143,000	144,003	2033/3/20
第62回利付国債（30年）	0.5	452,000	381,849	2049/3/20
第63回利付国債（30年）	0.4	595,000	487,590	2049/6/20
第73回利付国債（30年）	0.7	105,000	91,135	2051/12/20
第75回利付国債（30年）	1.3	220,000	222,340	2052/6/20
第76回利付国債（30年）	1.4	44,000	45,560	2052/9/20
第147回利付国債（20年）	1.6	227,000	252,821	2033/12/20
第148回利付国債（20年）	1.5	627,000	692,070	2034/3/20
第150回利付国債（20年）	1.4	684,000	748,439	2034/9/20
第166回利付国債（20年）	0.7	142,000	140,354	2038/9/20
第167回利付国債（20年）	0.5	687,000	657,197	2038/12/20
第168回利付国債（20年）	0.4	178,000	167,099	2039/3/20
第169回利付国債（20年）	0.3	438,000	403,196	2039/6/20
第170回利付国債（20年）	0.3	129,000	118,271	2039/9/20
第171回利付国債（20年）	0.3	751,000	685,723	2039/12/20
第174回利付国債（20年）	0.4	660,000	606,612	2040/9/20
第175回利付国債（20年）	0.5	388,000	361,782	2040/12/20
第177回利付国債（20年）	0.4	237,000	215,790	2041/6/20
第179回利付国債（20年）	0.5	331,000	305,383	2041/12/20
第1回メキシコ合衆国円貨債券（2022）	1.0	100,000	100,025	2025/9/8
第25回インドネシア共和国円貨債券（2022）	0.96	100,000	100,577	2025/6/9
第29回インドネシア共和国円貨債券（2023）	0.74	100,000	100,036	2026/5/26
第4回ウルグアイ東方共和国円貨債券（2021）	0.52	100,000	99,527	2024/12/9
第9回ハンガリー円貨債券（2022）	0.45	100,000	99,404	2025/2/25
小 計		12,619,000	12,303,469	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>				
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.09	9,710	9,762	2037/11/10
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16	36,906	36,904	2033/1/10
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.14	52,581	52,188	2034/2/10
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	13,961	14,561	2044/5/10
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	40,700	42,805	2045/3/10

銘柄名	当 期 末		
	利 率	額 面 金 額	評 価 額
	%	千円	千円
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	74,205	77,079
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	27,058	27,977
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	30,255	31,087
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	62,276	63,991
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	220,318	226,284
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	34,983	35,922
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	209,562	215,195
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	150,156	153,911
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	36,693	37,565
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	38,853	39,659
第88回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.93	39,828	40,585
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	55,402	56,129
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	19,590	20,688
小 計		1,153,037	1,182,299
普通社債券(含む投資法人債券)			
第15回楽天株式会社無担保社債	0.5	100,000	95,353
第33回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.21	100,000	104,352
第18回SBIホールディングス株式会社無担保社債	0.69	100,000	99,996
第27回SBIホールディングス株式会社無担保社債	0.8	100,000	99,978
第52回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.65	100,000	100,231
第38回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	0.802	100,000	100,496
第4回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	1.258	100,000	100,455
第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.45	100,000	99,155
第1回パークレイズ・ビーエルシー期限前償還条項付円貨社債	1.232	100,000	100,080
第7回エイチエスピーシー・ホールディングス・ビーエルシー期限前償還条項付円貨社債	1.478	100,000	100,736
第24回ルノー円貨社債	1.54	200,000	200,894
第25回ルノー円貨社債	3.5	100,000	102,856
第1回A号ロッテコーポレーション円貨社債	0.32	100,000	99,460
CPI PROPERTY GROUP SA 0.35 04/07/25	0.35	100,000	99,157
INTESA SANPAOLO SPA 1.05/27/25	1.0	100,000	99,598
INTESA SANPAOLO SPA 1.464 03/09/26	1.464	100,000	99,925
SOCIETE GENERALE 1.553 10/20/26	1.553	100,000	99,770
小 計		1,800,000	1,802,492
合 計		15,572,037	15,288,261

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨てです。

■投資信託財産の構成 (2023年6月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	15,288,261	99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	42,496	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	15,330,757	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨てです。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A)資 産	15,330,757,236円
コール・ローン等	15,798,985
公社債(評価額)	15,288,261,016
未収利息	21,877,704
前払費用	4,819,531
(B)負 債	5,940
その他未払費用	5,940
(C)純資産総額(A-B)	15,330,751,296
元 本	15,359,233,617
次期繰越損益金	△28,482,321
(D)受益権総口数	15,359,233,617口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,981円

(注記事項)

期首元本額	22,826,435,532円
期中追加設定元本額	11,107,249,886円
期中一部解約元本額	18,574,451,801円

(当期末元本の内訳)

アムンディ円債アクティブ・ファンド (適格機関投資家専用)	10,210,757,652円
アムンディ円建債券アクティブ・ファンド (ダイワ投資一任専用)	5,148,475,965円

■損益の状況

当期 自2022年6月16日 至2023年6月15日

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	103,534,835円
受 取 利 息	103,691,104
支 払 利 息	△ 156,269
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	9,593,173
売 買 益	419,004,926
売 買 損	△409,411,753
(C)そ の 他 費 用 等	△ 141,685
(D)当 期 損 益 金 (A+B+C)	112,986,323
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△219,781,559
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	△255,422,886
(G)解 約 差 損 益 金	333,735,801
(H) 計 (D+E+F+G)	△ 28,482,321
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	△ 28,482,321

(注1) (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2) (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3) (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。