Asset Management One

償還 運用報告書（全体版）

＜償還日2019年１月21日＞

グリーン公社債投信４月号

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	1978年４月20日から2019年１月21日（当初、原則無期限）まで。	
運用方針	公社債Ｂ号マザーファンド受益証券ならびに本邦通貨建の公社債への投資により、安定した収益の確保を目指した運用を行います。	
主要運用対象	当ファンド	公社債Ｂ号マザーファンド受益証券ならびに本邦通貨建の公社債を投資対象とします。
	公社債Ｂ号マザーファンド	本邦通貨建の公社債を投資対象とします。
組入制限	当ファンドの公社債Ｂ号マザーファンドの組入上限比率	制限なし。
	公社債Ｂ号マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	決算時に、運用収益（純資産総額の元本超過額）の全額を分配します。	

＜運用報告書に関するお問い合わせ先＞
コールセンター：0120-104-694
受付時間：営業日の午前９時から午後５時まで
お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

さて、ご投資いただいておりました「グリーン公社債投信４月号」は、当初、信託期間を原則、無期限としておりましたが、投資信託契約を解約し、2019年１月21日をもちまして繰上償還させていただきました。ここに第41期の運用状況とともに設定以来の運用経過をお知らせいたします。

ご愛顧誠にありがとうございました。

アセットマネジメントOne株式会社
東京都千代田区丸の内1-8-2
http://www.am-one.co.jp/

○最近３期の運用実績

決算期	基準価額			債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率			
	円 銭	円 銭	%	%	%	百万円
39期(2017年４月19日)	10,000	3.59	0.04	101.2	－	411
40期(2018年４月19日)	10,000	1.81	0.02	95.0	－	406
(償還時)	(償還価額)					
41期(2019年１月21日)	9,999.27	－	△0.01	－	－	374

※基準価額の騰落率は分配金込み。
※△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。
※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。
※実質的に本邦通貨建の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指して運用を行いますが、特定の指数を上回るまたは連動を目指した運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。
※ベンチマークとは、ファンドの運用成果の評価基準（目標基準）となる指標をいい、約款または投資信託説明書（目論見書）において、その旨の記載があるものを指します。
※計理処理の関係上、組入比率が一時的に100%を超える場合があります。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		
(期　首)	円 銭	%	%	%
2018年４月19日	10,000	－	95.0	－
４月末	10,000	0.00	93.9	－
５月末	10,000	0.00	94.1	－
６月末	10,000	0.00	84.6	－
７月末	10,000	0.00	84.6	－
８月末	10,000	0.00	98.0	－
９月末	10,000	0.00	91.8	－
10月末	10,000	0.00	96.7	－
11月末	10,000	0.00	81.0	－
12月末	10,000	0.00	47.2	－
(償還時)	(償還価額)			
2019年１月21日	9,999.27	△0.01	－	－

※騰落率は期首比。
※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。

○設定以来の運用概況

（1978年４月20日から2019年１月21日）

１．当ファンドの特色

公社債Ｂ号マザーファンドへの投資を通じてまたは直接わが国の公社債に投資することにより、安定した収益の確保を目指した運用を行いました。

２．設定時から前期（第１期から第40期）までの運用経過

○投資環境

金融市場では第二次オイルショックによる物価上昇を抑制するため金融引き締め政策が始まり、1980年には戦後最高水準の9.0％まで公定歩合が引き上げられました。

しかし、1981年から米国景気の低迷を受けて国内景気も軟調に推移したため、日銀は金融緩和政策に転じました。1983年に入ると、米国景気の持ち直しや原油価格の低下などから、景気回復局面となりました。1985年にはドル高是正のため為替の協調介入が合意（プラザ合意）されました。

プラザ合意により円高が急速に進んだことから景気後退局面入りし、日銀は金融緩和を強力に推し進めました。公定歩合は1986年以降５度に亘り引き下げられ、2.5％まで低下しました。1986年末には景気は内需中心に持ち直しましたが、国際的な政策協調の観点もあり、金融緩和政策は維持されました。1989年には景気の過熱から金融引き締めに転じ、公定歩合は1990年には6.0％まで引き上げられました。

1991年にはいわゆるバブル景気は崩壊し、景気は厳しい調整局面に入りました。景気の減速を受けて、日銀は金融緩和に転じました。その後も景気低迷は続いたため、金融緩和政策は継続され、公定歩合は1995年には0.5％まで引き下げられました。この間、一時的に景気回復の兆しが顕れたことから利上げ観測が台頭する局面もありましたが、バブル崩壊が日本経済に与えた傷は深く、本格的な景気回復と利上げは実現には至りませんでした。

1996年には景気回復期待が高まったものの、1997年の消費税率引き上げと緊縮財政への転換、金融システム不安によって景気の腰折れが懸念される状況となりました。また、アジア通貨危機がロシアへ波及し、世界的に信用リスクが高まりました。日銀は金融緩和政策を推し進め、1999年にはゼロ金利政策を実施しましたが、一時景気が持ち直したことから2000年に約10年振りの金融引き締めとなるゼロ金利解除を決定しました。しかし、米国の景気減速などから世界的な株安へとつながり、国内景気も再び後退に転じました。

日銀は景気減速を受けて金融緩和姿勢へと転じ、2001年には量的緩和政策を開始しました。これ以降も度重なる量的緩和の拡大を実施、国内金利もほぼ一貫して低下しました。

2003年半ば頃に世界的なデフレ懸念が後退し、国内金利も上昇に転じました。過度な金利低下の反動もあり急激な金利上昇となりましたが、日銀が量的緩和政策の堅持する姿勢を示したことなどから2003年後半には金利上昇は止まり、それ以降はおおむねレンジ内で推移しました。

景気回復が鮮明となり、デフレ懸念も薄らいできたことから、2006年に量的緩和政策が解除されました。

しかし、2007年以降は米国のサブプライム問題を原因として、グローバルに金融システム不安が拡大しました。欧米の金融危機を受けた景気減速に対応するため日銀はオーバーナイト金利の引き下げ、資産買い入れの多様化など金融緩和を拡大させました。

さらに2013年には２％の物価安定目標を目指してマネタリーベース（資金供給量）および長期国債・上場投資信託（ＥＴＦ）の保有額を２年間で２倍に拡大し、長期国債買入れの平均残存期間を２倍以上に延長する「量的・質的金融緩和」を導入しました。また2016年には２％の物価安定目標を早期に達成することを目指して１月に「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」を導入しました。あわせて９月にはイールドカーブ・コントロールを導入し短期の政策金利を－0.1％・10年物国債利回りの操作目標を概ねゼロ％とすることを決定しました。

一方で、米国を中心とする景気回復を受けて、欧米の中央銀行が金融緩和的な政策の縮小や金融引き締め政策に変更しました。日銀については景気が緩やかな回復ペースを維持する中、緩和的な金融政策を維持しました。

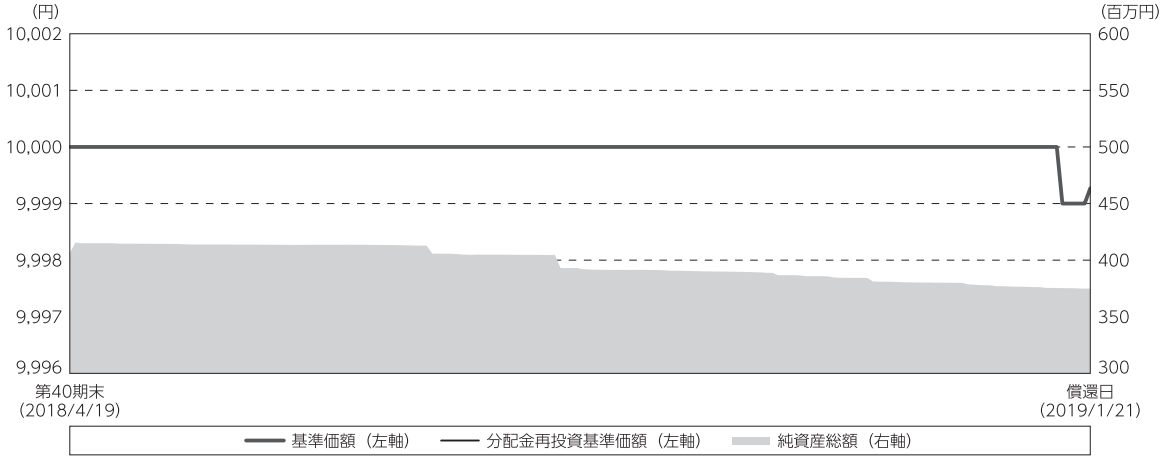
○ポートフォリオについて

当ファンドは、設定当初好利回りの公社債を中心に効率的な運用を行い安定収益の確保を目指して運用を行ってきました。その後、2001年に分配方針を予想分配型から実績分配型に変更するとともにファミリーファンド方式に変更し、公社債Ｂ号マザーファンドへの投資を通じてまたは直接わが国の公社債に投資することにより、安定した収益の確保を目指した運用を行いました。

３．当期（第41期）の運用経過

運用経過の説明

基準価額等の推移（2018年４月20日～2019年１月21日）



期　　首：10,000円
期末(償還日)：9,999円27銭（既払分配金：－円）
騰　　落　　率：△ 0.01%　　（分配金再投資ベース）

（注１）分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
（注２）分配金を再投資するかどうかについてはお客さまが利用する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、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
（注３）分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
（注４）上記騰落率は、小数点以下第３位を四捨五入して表示してあります。
（注５）当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

当ファンドは、公社債Ｂ号マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）ならびにわが国の公社債へ投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行います。

基準価額は、ポートフォリオのインカム（利子）収入などもありましたが、組入資産の売却時における市場環境や取引コストの影響から、期首10,000円からスタートし、9,999円27銭で償還を迎えました。

投資環境（2018年４月20日～2019年１月21日）

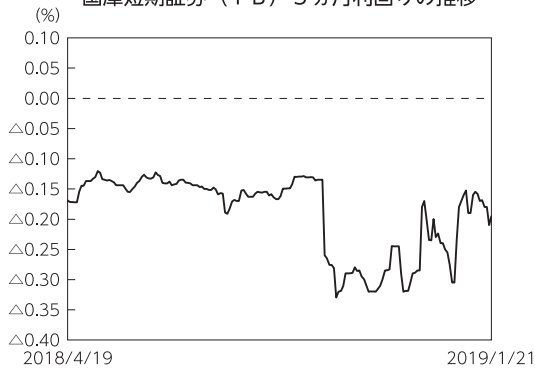
国内債券市場

当期間の残存１年程度の日本国債の利回りについては、日銀の金融緩和の影響もあり、マイナス金利が継続しました。

日銀は黒田総裁の第２期以降も「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を続けています。また、2018年７月の日銀政策決定会合において、長期金利を０％程度に誘導する目標自体は維持しつつ、変動幅の上限を0.2％程度まで容認する金融政策の調整を行いました。発表直後は、一時的にボラティリティが高まる場面もありましたが、イールドカーブは全体的に狭いレンジでの動きに留まっています。

一方、国債を除く債券については、プラス利回りに対するニーズも強いことから、０％前後の利回りに張り付いた状態になっています。

国庫短期証券（ＴＢ）３ヵ月利回りの推移



※国庫短期証券（TB）３ヵ月利回りの低下は価格の上昇を示し、逆の場合は下落したことを示します。

ポートフォリオについて（2018年４月20日～2019年１月21日）

○当ファンド

マザーファンドへの投資を通じて、実質的にわが国の公社債に投資することにより、安定した収益の確保を目指した運用を行いました。

期首はマザーファンドへ100％程度投資し、平均残存年数を0.3年程度でスタートさせました。

当期はマザーファンドの売買を行いました。

当ファンドは2019年１月21日の信託終了（繰上償還）が決定したため、保有していた公社債Ｂ号マザーファンドを売却し償還を迎えました。

○公社債Ｂ号マザーファンド

主としてわが国の公社債への投資により、安定した収益の確保を目指した運用を行いました。

期首は債券組入比率95％程度投資を行い、平均残存年数を0.3年程度でスタートさせました。

当ファンドは2019年１月18日の信託終了（繰上償還）が決定したため、保有していた公社債を売却し償還を迎えました。

ベンチマークとの差異について（2018年４月20日～2019年１月21日）

実質的に本邦通貨建の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指して運用を行いますが、特定の指数を上回るまたは連動を目指した運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。そのため、グラフは掲載していません。

償還にあたって

当ファンドは、2019年１月21日をもちまして償還となりました。およそ40年もの長きにわたるご愛顧を賜りまことに有難うございました。今後とも弊社の投資信託を変わらずご愛顧賜りますよう、何卒、お願い申し上げます。

○１万口当たりの費用明細

（2018年４月20日～2019年１月21日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	0	0.001	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(0)	(0.000)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
（販売会社）	(0)	(0.000)	販売会社分は、購入後の情報提供、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等の対価
（受託会社）	(0)	(0.001)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
合計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、10,000円です。			

※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・解約によって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。
※金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
※比率欄は「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を乗じたものです。項目ごとに小数点以下第４位を四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2018年４月20日～2019年１月21日）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定 口数	設定 金額	解約 口数	解約 金額
	千口	千円	千口	千円
公社債Ｂ号マザーファンド	8,203	8,500	400,021	414,478

○利害関係人との取引状況等

（2018年４月20日～2019年１月21日）

利害関係人との取引状況

＜グリーン公社債投信４月号＞

該当事項はございません。

＜公社債Ｂ号マザーファンド＞

区　　分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況Ｂ	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況Ｄ	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	4,598	1,363	29.6	2,834	1,303	46.0

平均保有割合　8.5%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

利害関係人の発行する有価証券等

＜公社債Ｂ号マザーファンド＞

種　　類	買　付　額	売　付　額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
公社債	100	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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、みずほ証券、オリエントコーポレーションです。

○組入資産の明細

（2019年１月21日現在）

2019年１月21日現在、有価証券等の組入れはございません。

親投資信託残高

銘　　柄	期首（前期末） 口　　数
	千口
公社債Ｂ号マザーファンド	391,818

○投資信託財産の構成

（2019年１月21日現在）

項　　目	償還時	
	評価額	比率
	千円	%
コール・ローン等、その他	374,964	100.0
投資信託財産総額	374,964	100.0

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 （2019年１月21日現在）

項　　目	償還時
	円
(A) 資産	374,964,674
コール・ローン等	374,964,674
(B) 負債	74,495
未払解約金	70,749
未払信託報酬	2,936
未払利息	810
(C) 純資産総額（Ａ－Ｂ）	374,890,179
元本	374,917,443
償還差損金	△ 27,264
(D) 受益権総口数	374,917,443口
１万口当たり償還価額（Ｃ／Ｄ）	9,999円27銭

○損益の状況 （2018年４月20日～2019年１月21日）

項　　目	当期
	円
(A) 受取利息等収益	△ 936
支払利息	△ 936
(B) 有価証券売買損益	△23,710
売買益	16,263
売買損	△39,973
(C) 信託報酬等	△ 2,936
(D) 当期利益（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	△27,582
(E) 前期繰越損益金	275
(F) 解約差損益金	43
償還差損金（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	△27,264

・**信託報酬等**には、消費税相当額を含めて表示しております。
・**解約差損益金**とは、解約元本額と解約代金との差額で解約元本額を上（下）回って支払うため損（益）金として処理することになっております。

注記事項

・信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額
　期首元本額　406,326,224円
　期中追加設定元本額　9,199,607円
　期中一部解約元本額　40,608,388円
・分配金の計算過程
　当ファンドは、信託約款に基づき、当計算期間末をもって償還されるため、該当事項はありません。

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	1978年４月20日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2019年１月21日		資産総額	374,964,674円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	74,495円
				純資産総額	374,890,179円
受益権口数	201,500,000口	374,917,443口	173,417,443口	受益権口数	374,917,443口
元本額	201,500,000円	374,917,443円	173,417,443円	１万口当たり償還金	9,999円27銭

最近11期の毎計算期末の状況

計算期	元本額	純資産総額	基準価額	１万口当たり分配金	
				金額	分配率
第30期	938,485,045円	938,485,843円	10,000円	43.55円	0.4355%
第31期	846,588,347	846,589,165	10,000	39.94	0.3994
第32期	778,727,662	778,728,403	10,000	25.77	0.2577
第33期	721,550,669	721,550,920	10,000	13.25	0.1325
第34期	651,143,973	651,144,073	10,000	11.99	0.1199
第35期	583,166,476	583,166,968	10,000	9.31	0.0931
第36期	537,221,637	537,222,115	10,000	9.18	0.0918
第37期	501,757,601	501,757,915	10,000	7.47	0.0747
第38期	458,554,761	458,554,844	10,000	6.17	0.0617
第39期	411,866,153	411,866,448	10,000	3.59	0.0359
第40期	406,326,224	406,326,499	10,000	1.81	0.0181

○償還金のお知らせ

１万口当たり償還金	9,999円27銭

＜お知らせ＞

■金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第１項第８号の２に規定する信用リスクを適正に管理する方法について、その整備を行うため、約款に所要の変更を行いました。
なお、上記約款変更により商品としての同一性が失われるものではありません。

（変更年月日　2018年４月20日）

公社債Ｂ号マザーファンド

繰上償還　運用報告書

（償還日　2019年１月18日）

「公社債Ｂ号マザーファンド」は、去る2019年１月18日をもちまして繰上償還させていただきました。ここに当期（第18期）の運用状況とともに設定以来の運用経過をお知らせいたします。

当ファンドの仕組みは次のとおりです。

形態	親投資信託
信託期間	2001年４月20日から2019年１月18日（当初、原則無期限）まで。
運用方針	主としてわが国の公社債への投資により、安定した収益の確保を目指した運用を行います。
主要運用対象	本邦通貨建の公社債を投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	運用による収益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

アセットマネジメントOne株式会社
東京都千代田区丸の内1-8-2

○最近３期の運用実績

決算期	基準価額		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率			
	円 銭	%	%	%	百万円
16期(2017年４月19日)	10,360	0.04	101.2	－	5,046
17期(2018年４月19日)	10,362	0.02	95.1	－	4,826
(償還時)	(償還価額)				
18期(2019年１月18日)	10,361.35	△0.01	－	－	4,500

※△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。
※本邦通貨建の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指して運用を行いますが、特定の指数を上回るまたは連動を目指した運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。
※ベンチマークとは、ファンドの運用成果の評価基準（目標基準）となる指標をいい、約款または投資信託説明書（目論見書）において、その旨の記載があるものを指します。
※計理処理の関係上、組入比率が一時的に100％を超える場合があります。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		
(期　首)	円 銭	%	%	%
2018年４月19日	10,362	－	95.1	－
４月末	10,362	0.00	94.0	－
５月末	10,362	0.00	94.2	－
６月末	10,362	0.00	84.6	－
７月末	10,362	0.00	84.7	－
８月末	10,362	0.00	97.8	－
９月末	10,362	0.00	91.9	－
10月末	10,362	0.00	96.7	－
11月末	10,362	0.00	81.1	－
12月末	10,362	0.00	47.2	－
(償還時)	(償還価額)			
2019年１月18日	10,361.35	△0.01	－	－

※騰落率は期首比。

○設定以来の運用概況

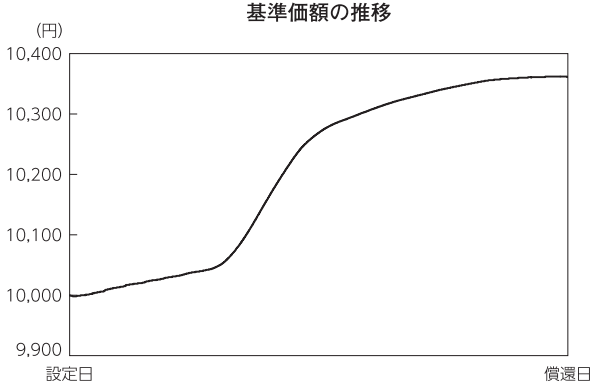
（2001年４月20日から2019年１月18日）

１．当ファンドの特色

主としてわが国の公社債への投資により、安定した収益の確保を目指した運用を行いました。

２．設定時から前期（第１期から第17期）までの運用経過

基準価額の推移



○投資環境

金融市場では景気減速を受けて日銀は金融緩和姿勢へと転じ、2001年には量的緩和政策を開始しました。それを受けて、国内金利は低下傾向で推移しました。

2003年半ば頃に世界的なデフレ懸念が後退し、国内金利も上昇に転じました。過度な金利低下の反動もあり急激な金利上昇となりましたが、日銀が量的緩和政策の堅持する姿勢を示したことなどから2003年後半には金利上昇は止まり、それ以降はおおむねレンジ内で推移しました。

景気回復が鮮明となり、デフレ懸念も薄らいできたことから、2006年に量的緩和政策が解除されました。

しかし、2007年以降は米国のサブプライム問題を原因として、グローバルに金融システム不安が拡大しました。欧米の金融危機を受けた景気減速に対応するため日銀はオーバーナイト金利の引き下げ、資産買い入れの多様化など金融緩和を拡大させました。

さらに2013年には２％の物価安定目標を目指してマネタリーベース（資金供給量）および長期国債・上場投資信託（ＥＴＦ）の保有額を２年間で２倍に拡大し、長期国債買入れの平均残存期間を２倍以上に延長する「量的・質的金融緩和」を導入しました。また2016年には２％の物価安定目標を早期に達成することを目指して１月に「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」を導入しました。あわせて９月にはイールドカーブ・コントロールを導入し短期の政策金利を－0.1％・10年物国債利回りの操作目標を概ねゼロ％とすることを決定しました。

一方で、米国を中心とする景気回復を受けて、欧米の中央銀行が金融緩和的な政策の縮小や金融引き締め政策に変更しました。日銀については景気が緩やかな回復ペースを維持する中、緩和的な金融政策を維持しました。

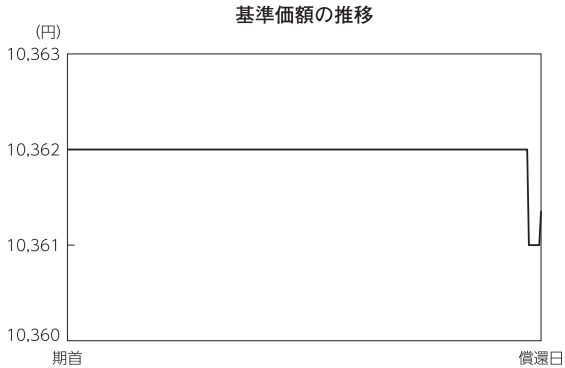
○ポートフォリオについて

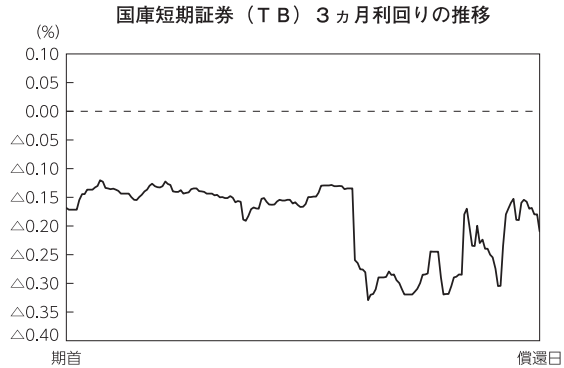
当ファンドは、公社債を中心に効率的な運用を行い安定収益の確保を目指して運用を行ってきました。

３．当期（第18期）の運用経過

運用経過の説明

基準価額等の推移（2018年４月20日～2019年１月18日）





※国庫短期証券（ＴＢ）３ヵ月利回りの低下は価格の上昇を示し、逆の場合は下落したことを示します。

基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主としてわが国の公社債へ投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行いました。

基準価額は、ポートフォリオのインカム（利子）収入などもありましたが、組入資産の売却時における市場環境や取引コストの影響から、期首10,362円からスタートし、10,361円35銭で償還を迎えました。

投資環境（2018年４月20日～2019年１月18日）

当期間の残存１年程度の日本国債の利回りについては、日銀の金融緩和の影響もあり、マイナス金利が継続しました。

日銀は黒田総裁の第２期以降も「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を続けています。また、2018年７月の日銀政策決定会合において、長期金利を０％程度に誘導する目標自体は維持しつつ、変動幅の上限を0.2％程度まで容認する金融政策の調整を行いました。発表直後は、一時的にボラティリティが高まる場面もありましたが、イールドカーブは全体的に狭いレンジでの動きに留まっています。

一方、国債を除く債券については、プラス利回りに対するニーズも強いことから、０％前後の利回りに張り付いた状態になっています。

ポートフォリオについて（2018年４月20日～2019年１月18日）

主としてわが国の公社債への投資により、安定した収益の確保を目指した運用を行いました。
期首は債券組入比率を95％程度投資とし、平均残存年数を0.3年程度でスタートさせました。
当期は残存１年以内の地方債、普通社債、特殊債を中心に買い付けました。当ファンドは2019年１月18日の信託終了（繰上償還）が決定したため、保有していた公社債を売却し償還を迎えました。

ベンチマークとの差異について（2018年４月20日～2019年１月18日）

本邦通貨建の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指して運用を行いますが、特定の指数を上回るまたは連動を目指した運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。そのため、グラフは掲載していません。

償還にあたって

当ファンドは、2019年１月18日をもちまして償還となりました。長きにわたるご愛顧を賜りまことに有難うございました。今後とも弊社の投資信託を変わらずご愛顧賜りますよう、何卒、お願い申し上げます。

○１万口当たりの費用明細

（2018年４月20日～2019年１月18日）

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

（2018年４月20日～2019年１月18日）

公社債

		買付額	売付額
国内	地方債証券	千円 678,401	千円 628,444 (　368,100)
	特殊債券	100,985	100,292 (　200,000)
	社債券（投資法人債券を含む）	3,818,957	2,105,375 (5,759,000)

※金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）
※(　)内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
※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）は含まれておりません。

その他有価証券

		買付額	売付額
国内	コマーシャル・ペーパー	千円 999,977	千円 － (1,000,000)

※金額は受渡代金。
※(　)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。

○利害関係人との取引状況等

（2018年４月20日～2019年１月18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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	4,598	1,363	29.6	2,834	1,303	46.0

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
	百万円	百万円	百万円
公社債	100	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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、みずほ証券、オリエントコーポレーションです。

○組入資産の明細

（2019年１月18日現在）

2019年１月18日現在、有価証券等の組入れはございません。

○投資信託財産の構成

（2019年１月18日現在）

項　　目	償還時	
	評価額	比率
	千円	%
コール・ローン等、その他	4,504,679	100.0
投資信託財産総額	4,504,679	100.0

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2019年１月18日現在)

項　　目	償 還 時
	円
(A) 資産	4,504,679,874
コール・ローン等	4,504,679,874
(B) 負債	3,829,589
未払解約金	3,800,000
未払利息	29,589
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	4,500,850,285
元本	4,343,885,762
償還差益金	156,964,523
(D) 受益権総口数	4,343,885,762口
１万口当たり償還価額(Ｃ／Ｄ)	10,361円35銭

○損益の状況 (2018年４月20日～2019年１月18日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 受取利息等収益	28,690,402
受取利息	29,093,363
支払利息	△ 402,961
(B) 有価証券売買損益	△ 28,831,451
売買益	28,998
売買損	△ 28,860,449
(C) 当期利益(Ａ＋Ｂ)	△ 141,049
(D) 前期繰越損益金	168,488,045
(E) 追加信託差損益金	2,679,537
(F) 解約差損益金	△ 14,062,010
償還差益金(Ｃ＋Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	156,964,523

・**追加信託差損益金**とは、追加設定をした金額のうち元本を上下する額を処理する項目です。
・**解約差損益金**とは、解約元本額と解約代金との差額で解約元本額を上（下）回って支払うため損（益）金として処理することになっております。

注記事項

・投資信託の期首元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額

期首元本額	4,658,353,289円
期中追加設定元本額	74,020,463円
期中一部解約元本額	388,487,990円
期末元本の内訳	
グリーン公社債投信１月号	371,056,219円
グリーン公社債投信２月号	334,940,964円
グリーン公社債投信３月号	272,697,175円
グリーン公社債投信４月号	361,419,075円
グリーン公社債投信５月号	343,369,426円
グリーン公社債投信６月号	320,884,321円
グリーン公社債投信７月号	360,497,882円
グリーン公社債投信８月号	390,195,545円
グリーン公社債投信９月号	354,590,157円
グリーン公社債投信10月号	373,161,927円
グリーン公社債投信11月号	323,544,321円
グリーン公社債投信12月号	537,528,750円
合　　計	4,343,885,762円

＜お知らせ＞

■金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第１項第８号の２に規定する信用リスクを適正に管理する方法について、その整備を行うため、約款に所要の変更を行いました。
なお、上記約款変更により商品としての同一性が失われるものではありません。

（変更年月日　2018年４月20日）