

## LM・オーストラリア債券ファンド (年2回決算型)

### 運用報告書（全体版）

第12期 決算日 2019年6月10日

◇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／海外／債券	
信託期間	無期限	
運用方針	主として豪ドル建の公社債に投資を行い、中長期的な信託財産の成長を目指します。	
主要運用対象	当ファンド	「LM・豪ドル債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
	LM・豪ドル債券マザーファンド	主として豪ドル建の国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券及び資産担保証券等を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。	
分配方針	決算日（原則として毎年6月10日及び12月10日。休業日の場合は翌営業日）に、基準価額水準等を勘案して収益の分配を行います。	

当報告書に関するお問い合わせ先：

レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社

お問い合わせ窓口

電話番号：03-5219-5947

#### － 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、「LM・オーストラリア債券ファンド（年2回決算型）」は、2019年6月10日に第12期の決算を行いましたので、期中の運用状況と収益分配金をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社

〒100-6536 東京都千代田区丸の内一丁目5番1号

<http://www.leggmason.co.jp>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 分 配 金	騰 落 率			
	円	円	%	%	%	百万円
8期(2017年6月12日)	10,232	0	△0.6	97.1	△3.5	1,175
9期(2017年12月11日)	10,614	0	3.7	98.0	△1.8	1,095
10期(2018年6月11日)	10,326	0	△2.7	97.9	△0.1	1,054
11期(2018年12月10日)	10,282	0	△0.4	98.0	0.5	1,098
12期(2019年6月10日)	10,193	0	△0.9	97.9	△0.3	1,186

(注1) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「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2) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

(注3) 市場に広く認知されているベンチマーク等で、当ファンドのリスク特性を正確に反映する指標が見当たらないため、現状では、当ファンドの収益率およびリスク特性を特定のベンチマーク等と比較しておりません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	率		
(期首)	円	%	%	%	%
2018年12月10日	10,282	—	98.0	0.5	
12月末	9,974	△3.0	97.1	△1.5	
2019年1月末	10,132	△1.5	97.6	△2.1	
2月末	10,271	△0.1	98.3	△1.7	
3月末	10,365	0.8	98.0	△1.1	
4月末	10,359	0.7	98.0	△1.2	
5月末	10,109	△1.7	98.8	△0.9	
(期末)					
2019年6月10日	10,193	△0.9	97.9	△0.3	

(注1) 騰落率は期首比です。

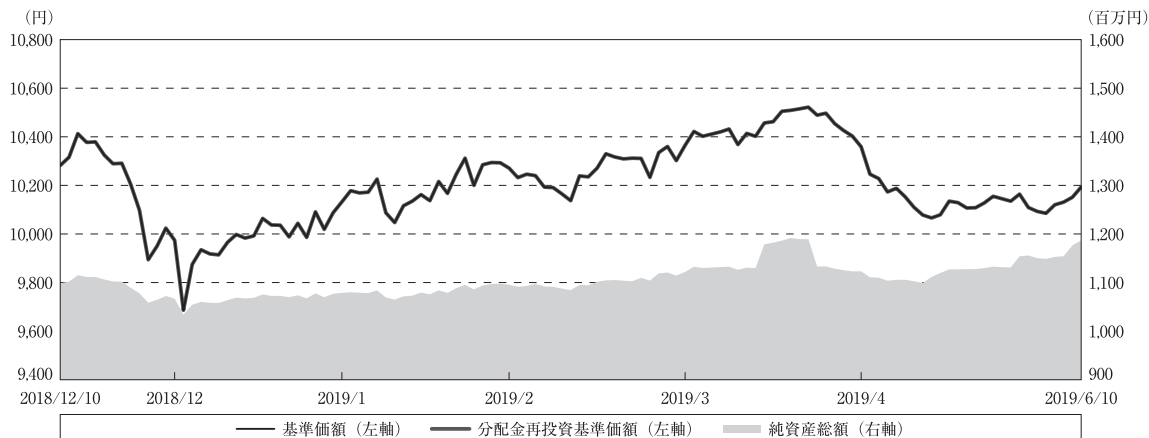
(注2) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

### 期中の基準価額等の推移

(2018年12月11日～2019年6月10日)



期 首：10,282円

期 末：10,193円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 0.9% (分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかかどうかについてはお客様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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額は、期首(2018年12月10日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

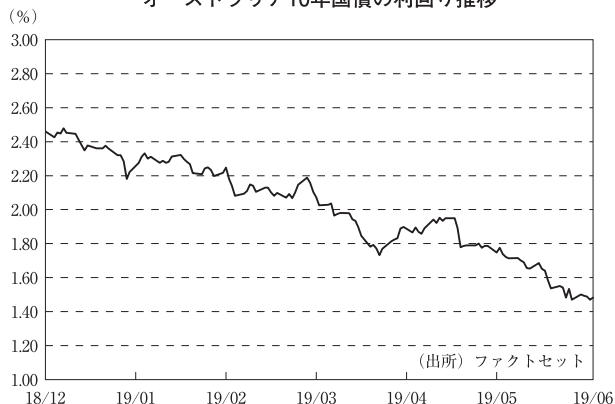
当期のパフォーマンス(騰落率)は小幅マイナス(分配金再投資ベース)となりました。公社債利金を手堅く確保したことに加え、公社債損益についても、債券利回りの低下を受けてプラスとなりました。しかし、為替相場が豪ドル安・円高となったことから、為替損益はマイナスとなりました。

当期のオーストラリア債券市場は、利回りが低下（価格は上昇）しました。期の前半は、米中貿易摩擦への警戒感が意識され、世界的な株安となる場面で、安全資産とされる債券が買われ、利回りは低下しました。期の半ばにかけては、オーストラリア準備銀行（RBA）による金融政策姿勢が従来の利上げバイアスから中立的な姿勢へ変化したと受け止められたことから、利回りは低下しました。その後も、2018年10-12月期の豪GDP成長率が予想を下回り、RBAによる利下げの可能性が意識されたことなどから、利回りの低下が続きました。期の後半は、2019年1-3月期の豪消費者物価指数（CPI）が予想を下回り、RBAによる利下げ観測が強まったことから、利回りは低下しました。その後も、トランプ米大統領が対中関税の引き上げを表明し、米中貿易摩擦への懸念が広がったことから、利回りは低下しました。

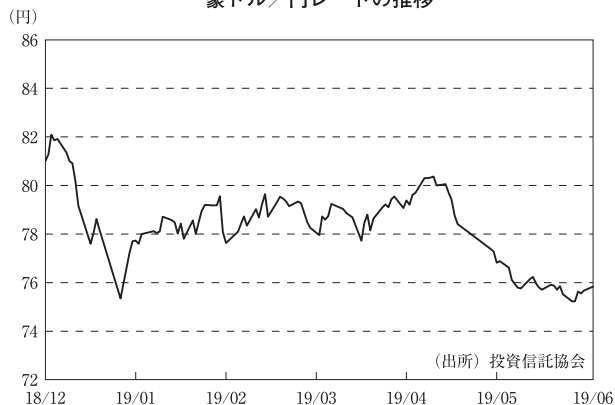
社債セクターについては、オーストラリアの株式相場が前期末に比べて上昇したことなどから堅調となり、社債スプレッド（国債に対する上乗せ利回り）は縮小しました。

当期の豪ドル・円相場は、豪ドル安・円高となりました。期の前半は、債券利回りの低下を受けて、豪ドルは対円で軟調な展開となりました。その後も、世界的な株安を背景にリスク回避の動きが強まったことなどから、豪ドル売り・円買いが強まりました。しかし、米中貿易協議進展への期待感などから投資家のリスク回避姿勢が緩むと、豪ドルは反発しました。期の半ばは、豪ドルは対円で概ね横ばいとなりました。世界的に株式相場が回復し投資家のリスク回避姿勢が緩んだことなどが豪ドルの下支えとなる一方、RBAが従来の利上げバイアスから中立姿勢へ変化したと受け止められ、市場で利下げ観測が浮上したことが上値を抑えました。期の後半は、世界経済の減速懸念が後退し投資家のリスク回避姿勢が緩んだことなどから、豪ドル買い・円売りが優勢となりました。しかし、その後、2019年1-3月期豪CPIが予想を下回り、RBAによる利下げ観測が強まったことなどから、豪ドル売り・円買いが優勢となりました。

オーストラリア10年国債の利回り推移



豪ドル／円レートの推移



当ファンドは豪ドル建ての国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券および資産担保証券等を主要投資対象とする「LM・豪ドル債券マザーファンド」受益証券に投資を行い、長期的に安定した利金（インカム）収入が期待できるポートフォリオの運用を行いました。当ファンドは原則としてA-/A3格以上の格付けの公社債へ投資し、信用リスクの抑制を図る等、安定的な運用を目指しております。当期においては、金融債、リート・セクター等を中心とした社債を引き続き厚めとしました。金融債の組み入れにおいては、カバードボンド（債権担保付社債の一種）や、大手金融機関が発行する流動性・信用力が相対的に高い債券が組み入れの中心となっています。また、ポートフォリオ全体の平均格付けは引き続き高位に保ちました。

## 分配金

(2018年12月11日～2019年6月10日)

当期の分配金につきましては、以下の通りとさせていただきます。なお、収益分配に充当しなかった利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き運用を行います。

### ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第12期
	2018年12月11日～ 2019年6月10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	2,672

(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ります。

(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。

### ○今後の運用方針

当ファンドは、豪ドル建ての国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券および資産担保証券等を主要投資対象とするファンドです。引き続き、市場環境に注視しながら、組入債券の信用リスク、金利リスク等に配慮しつつ銘柄を厳選し、運用に注力していく所存です。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2018年12月11日～2019年6月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 69	% 0.673	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(33)	(0.323)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(34)	(0.328)	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
（ 受 託 会 社 ）	( 2 )	(0.022)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0 )	(0.001)	売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) そ の 他 費 用	3	0.029	(c) 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 )	(0.004)	保管費用は、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 費 用 ）	( 1 )	(0.007)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ 印 刷 等 費 用 ）	( 2 )	(0.018)	印刷等費用は、印刷業者等に支払う法定書類の作成、印刷、交付および届出に係る費用
合 計	72	0.703	
期中の平均基準価額は、10,201円です。			

(注1) 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2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 売買委託手数料およびその他費用は、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4) 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

(2018年12月11日～2019年6月10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
LM・豪ドル債券マザーファンド	千口 91,945	千円 218,497	千口 53,850	千円 129,194

(注) 単位未満は切捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2018年12月11日～2019年6月10日)

該当事項はございません。

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す。

## ○第二種金融商品取引業を兼業している投資信託委託会社の自己取引状況

(2018年12月11日～2019年6月10日)

該当事項はございません。

## ○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2018年12月11日～2019年6月10日)

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2019年6月10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
LM・豪ドル債券マザーファンド	千口 466,239	千口 504,333	千円 1,194,564

(注) 単位未満は切捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

## ○投資信託財産の構成

(2019年6月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
LM・豪ドル債券マザーファンド	千円 1,194,564	% 100.0
コール・ローン等、その他	329	0.0
投資信託財産総額	1,194,893	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) LM・豪ドル債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(77,815,532千円)の投資信託財産総額(79,424,936千円)に対する比率は98.0%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、6月10日における邦貨換算レートは1オーストラリアドル=75.84円です。



○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年6月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,194,893,830
LM・豪ドル債券マザーファンド(評価額)	1,194,564,105
未収入金	329,725
(B) 負債	8,034,735
未払解約金	329,725
未払信託報酬	7,430,153
その他未払費用	274,857
(C) 純資産総額(A-B)	1,186,859,095
元本	1,164,374,774
次期繰越損益金	22,484,321
(D) 受益権総口数	1,164,374,774口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,193円

<注記事項>

元本の状況

期首元本額

1,068,486,343円

期中追加設定元本額

213,201,987円

期中一部解約元本額

117,313,556円

○損益の状況 (2018年12月11日～2019年6月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	△ 1,878,451
売買益	2,379,081
売買損	△ 4,257,532
(B) 信託報酬等	△ 7,705,010
(C) 当期損益金(A+B)	△ 9,583,461
(D) 前期繰越損益金	△ 7,229,791
(E) 追加信託差損益金	39,297,573
(配当等相当額)	( 217,731,336)
(売買損益相当額)	(△178,433,763)
(F) 計(C+D+E)	22,484,321
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	22,484,321
追加信託差損益金	39,297,573
(配当等相当額)	( 218,018,518)
(売買損益相当額)	(△178,720,945)
分配準備積立金	93,153,567
繰越損益金	△109,966,819

(注1) 損益の状況の中で(A)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) 損益の状況の中で(B)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) 損益の状況の中で(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4) 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するため要する費用として、委託者報酬のうち販売会社へ支払う手数料を除いた額の100分の50相当額を支払っております。

<分配金の計算過程>

決 算 期	当 期
(A) 配 当 等 収 益(費用控除後)	13,368,666円
(B) 有 価 証 券 売 買 等 損 益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)	0
(C) 収 益 調 整 金	218,018,518
(D) 分 配 準 備 積 立 金	79,784,901
分 配 対 象 収 益 額(A+B+C+D)	311,172,085
(1万口当たり収益分配対象額)	( 2,672)
収 益 分 配 金	0
(1万口当たり収益分配金)	( 0)

# LM・豪ドル債券マザーファンド

## 運用状況のご報告

第32期 決算日 2019年6月10日

(計算期間：2018年12月11日～2019年6月10日)

－ 受益者のみなさまへ －

法令・諸規則に基づき、「LM・豪ドル債券マザーファンド」の第32期の運用状況を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。

商 品 分 類	親投資信託
信 託 期 間	無期限
運 用 方 針	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックス（為替ヘッジなし、円換算ベース）を参考指標として運用を行います。</li> <li>2. 豪ドル建の国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券及び資産担保証券等を主要投資対象とします。投資を行う公社債は、取得時において、原則として格付機関からA-/A3以上の格付を付与されたものとします。</li> <li>3. デュレーション・コントロール、セクター配分、銘柄選定の3つの戦略により超過収益の獲得を目指します。</li> <li>4. シナリオ・ディペンデント・オペティマイゼーション（SDO）を活用したデュレーション・コントロールを行います。ポートフォリオの平均デュレーションは、原則として参考指標のデュレーション±1年とします。</li> <li>5. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。したがって、基準価額は、円と豪ドルとの為替変動の影響を受けます。</li> </ol>
主 要 運 用 対 象	主として豪ドル建の国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券及び資産担保証券等を主要投資対象とします。
組 入 制 限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

## ○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	騰 落 中 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰	落 中 率			
28期(2017年6月12日)	円 23,121		% 0.1	% 96.4	% △3.5	百万円 123,870
29期(2017年12月11日)	24,153		4.5	97.3	△1.8	111,319
30期(2018年6月11日)	23,663		△2.0	97.3	△0.1	97,236
31期(2018年12月10日)	23,726		0.3	97.3	0.5	86,022
32期(2019年6月10日)	23,686		△0.2	97.3	△0.3	78,307

(注1) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

(注2) 市場に広く認知されているベンチマーク等で、当ファンドのリスク特性を正確に反映する指標が見当たらないため、現状では、当ファンドの収益率およびリスク特性を特定のベンチマーク等と比較しておりません。

## ○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		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰	落 率			
(期 首) 2018年12月10日	円 23,726		% -	% 97.3	% 0.5	
12月末	23,032		△2.9	97.0	△1.5	
2019年1月末	23,428		△1.3	97.4	△2.1	
2月末	23,772		0.2	98.0	△1.6	
3月末	24,017		1.2	97.6	△1.1	
4月末	24,028		1.3	97.5	△1.2	
5月末	23,484		△1.0	98.1	△0.9	
(期 末) 2019年6月10日	23,686		△0.2	97.3	△0.3	

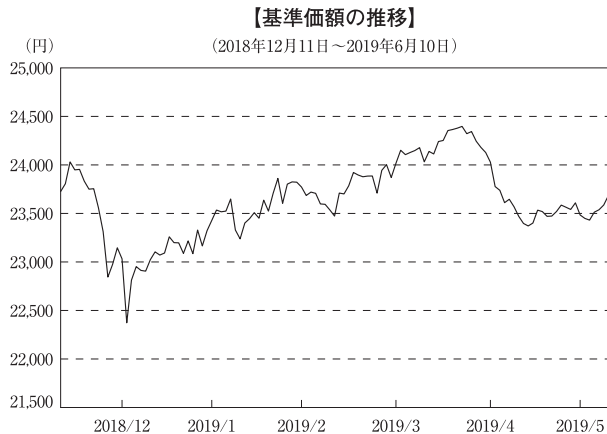
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

### 期中の基準価額等の推移

(2018年12月11日～2019年6月10日)



### ○基準価額の主な変動要因

当期の当ファンドのパフォーマンス（騰落率）は小幅マイナスとなりました。公社債利金を手堅く確保したことに加え、公社債損益についても、債券利回りの低下を受けてプラスとなりました。しかし、為替相場が豪ドル安・円高となったことから、為替損益はマイナスとなりました。

当期のオーストラリア債券市場は、利回りが低下（価格は上昇）しました。期の前半は、米中貿易摩擦への警戒感が意識され、世界的な株安となる場面で、安全資産とされる債券が買われ、利回りは低下しました。期の半ばにかけては、オーストラリア準備銀行（RBA）による金融政策姿勢が従来の利上げバイアスから中立的な姿勢へ変化したと受け止められたことから、利回りは低下しました。その後も、2018年10-12月期の豪GDP成長率が予想を下回り、RBAによる利下げの可能性が意識されたことなどから、利回りの低下が続きました。期の後半は、2019年1-3月期の豪消費者物価指数（CPI）が予想を下回り、RBAによる利下げ観測が強まったことから、利回りは低下しました。その後も、トランプ米大統領が対中関税の引き上げを表明し、米中貿易摩擦への懸念が広がったことから、利回りは低下しました。

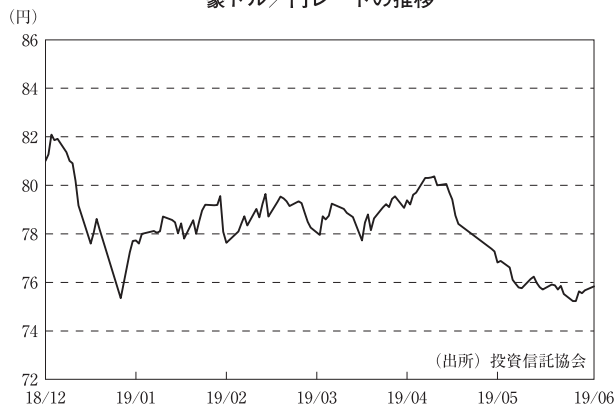
社債セクターについては、オーストラリアの株式相場が前期末に比べて上昇したことなどから堅調となり、社債スプレッド（国債に対する上乗せ利回り）は縮小しました。

当期の豪ドル・円相場は、豪ドル安・円高となりました。期の前半は、債券利回りの低下を受けて、豪ドルは対円で軟調な展開となりました。その後も、世界的な株安を背景にリスク回避の動きが強まったことなどから、豪ドル売り・円買いが強まりました。しかし、米中貿易協議進展への期待感などから投資家のリスク回避姿勢が緩むと、豪ドルは反発しました。期の半ばは、豪ドルは対円で概ね横ばいとなりました。世界的に株式相場が回復し投資家のリスク回避姿勢が緩んだことなどが豪ドルの下支えとなる一方、RBAが従来の利上げバイアスから中立姿勢へ変化したと受け止められ、市場で利下げ観測が浮上したことが上値を抑えました。期の後半は、世界経済の減速懸念が後退し投資家のリスク回避姿勢が緩んだことなどから、豪ドル買い・円売りが優勢となりました。しかし、その後、2019年1-3月期豪CPIが予想を下回り、RBAによる利下げ観測が強まったことなどから、豪ドル売り・円買いが優勢となりました。

オーストラリア10年国債の利回り推移



豪ドル／円レートの推移



## 当ファンドのポートフォリオ

当ファンドは豪ドル建ての国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券および資産担保証券等を主要投資対象とし、長期的に安定した利金（インカム）収入が期待できるポートフォリオの運用を行いました。当ファンドは原則としてA-/A3格以上の格付けの公社債へ投資し、信用リスクの抑制を図る等、安定的な運用を目指しております。当期においては、金融債、リート・セクター等を中心とした社債を引き続き厚めとしました。金融債の組み入れにおいては、カバードボンド（債権担保付社債の一種）や、大手金融機関が発行する流動性・信用力が相対的に高い債券が組み入れの中心となっています。また、ポートフォリオ全体の平均格付けは引き続き高位に保ちました。

## ○今後の運用方針

当ファンドは、豪ドル建ての国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券および資産担保証券等を主要投資対象とするファンドです。引き続き、市場環境に注視しながら、組入債券の信用リスク、金利リスク等に配慮しつつ銘柄を厳選し、運用に注力していく所存です。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2018年12月11日～2019年6月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.002 (0.002)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 )	1 (1)	0.004 (0.004)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、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
合 計	1	0.006	
期中の平均基準価額は、23,626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

(2018年12月11日～2019年6月10日)

### 公社債

		買 付 額	売 付 額	
外 国	オーストラリア	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	
		国債証券	9,541	16,509
		地方債証券	22,297	41,975
		特殊債証券	8,034	17,586
	社債券(投資法人債券を含む)	27,920	(3,538)	
			22,443	
			(35,901)	

(注1) 金額は受渡し代金。(経過利息分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) ( ) 内は償還による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(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)は含まれておりません。

## その他有価証券

			買 付 額	売 付 額
外 国	オーストラリア	譲渡性預金証書	千オーストラリアドル 2,994	千オーストラリアドル － (3,000)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) ( )内は償還等による増減分です。

## 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	債券先物取引	百万円 17,098	百万円 17,990	百万円 18,416	百万円 18,269

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2018年12月11日～2019年6月10日)

該当事項はございません。

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す。

## ○組入資産の明細

(2019年6月10日現在)

### 外国公社債

#### (A)外国(外貨建)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		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
オーストラリア	千オーストラリアドル 914,083	千オーストラリアドル 1,004,745	千円 76,199,914	% 97.3	% —	% 45.4	% 31.1	% 20.8
合 計	914,083	1,004,745	76,199,914	97.3	—	45.4	31.1	20.8

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。



## (B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当期末				
		利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
	国債証券					
	AUSTRALIAN GOVT	4.25	16,600	19,835	1,504,299	2026/4/21
	AUSTRALIAN GOVT	4.75	16,700	20,932	1,587,554	2027/4/21
	AUSTRALIAN GOVT	2.75	10,200	11,307	857,523	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVT	2.25	18,600	19,894	1,508,831	2028/5/21
	AUSTRALIAN GOVT	3.25	13,750	16,022	1,215,153	2029/4/21
	AUSTRALIAN GOVT	2.75	3,500	3,934	298,375	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVT	2.5	2,520	2,779	210,775	2030/5/21
	AUSTRALIAN GOVT	4.5	18,710	25,440	1,929,411	2033/4/21
	AUSTRALIAN GOVT	2.75	13,800	15,785	1,197,196	2035/6/21
	AUSTRALIAN GOVT	3.75	10,300	13,355	1,012,865	2037/4/21
	AUSTRALIAN GOVT	3.25	9,000	11,019	835,685	2039/6/21
	AUSTRALIAN GOVT	2.75	3,500	3,965	300,754	2041/5/21
	AUSTRALIAN GOVT	3.0	16,880	20,085	1,523,298	2047/3/21
	地方債証券					
	AUCKLAND COUNCIL	5.843	5,000	5,570	422,447	2022/3/22
	AUST CAPITAL TERRITORY	4.25	1,900	2,051	155,554	2022/4/11
	AUST CAPITAL TERRITORY	3.0	2,000	2,163	164,087	2028/4/18
	AUST CAPITAL TERRITORY	2.25	1,000	1,009	76,586	2029/5/22
	BRITISH COLUMBIA PROV OF	4.25	4,500	5,063	384,008	2024/11/27
	NEW S WALES TREAS CORP	5.0	15,500	18,250	1,384,151	2024/8/20
	NEW S WALES TREAS CORP	4.0	7,500	8,660	656,821	2026/5/20
	NEW S WALES TREAS CORP	3.0	2,000	2,184	165,680	2027/5/20
	NEW S WALES TREAS CORP	3.0	1,500	1,637	124,220	2028/3/20
	NEW S WALES TREAS CORP	3.0	4,940	5,372	407,420	2030/2/20
	NEW S WALES TREASURY	3.0	1,000	1,091	82,761	2029/4/20
	NORTHERN TERRITORY TREAS	6.0	2,000	2,396	181,758	2024/3/15
	NORTHERN TERRITORY TREAS	2.75	1,000	1,051	79,745	2027/4/21
	NORTHERN TERRITORY TREAS	3.5	2,000	2,209	167,533	2028/4/21
	NORTHERN TERRITORY TREAS	3.75	2,000	2,285	173,294	2033/4/21
	QUEBEC PROVINCE	6.5	3,000	3,297	250,119	2021/7/12
	QUEBEC PROVINCE	4.2	3,000	3,362	255,029	2025/3/10
	QUEENSLAND TREASURY	6.0	3,500	3,996	303,068	2022/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	4.25	19,500	21,702	1,645,949	2023/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	3.0	1,000	1,068	81,007	2024/3/22
	QUEENSLAND TREASURY	5.75	17,500	21,168	1,605,381	2024/7/22
	QUEENSLAND TREASURY	4.75	6,400	7,569	574,093	2025/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	3.25	14,500	15,954	1,210,021	2026/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	2.75	2,500	2,669	202,458	2027/8/20
	QUEENSLAND TREASURY	3.25	1,000	1,109	84,147	2028/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	2.5	2,000	2,080	157,779	2029/3/6
	QUEENSLAND TREASURY	3.25	2,760	3,061	232,207	2029/8/21
	QUEENSLAND TREASURY	6.5	2,000	3,015	228,677	2033/3/14
	SOUTH AUST GOVT FIN	2.25	1,000	1,034	78,473	2024/8/15
	SOUTH AUST GOVT FIN	2.75	2,000	2,123	161,023	2025/4/16
	SOUTH AUST GOVT FIN	3.0	5,500	5,953	451,544	2026/7/20
	SOUTH AUST GOVT FIN	3.0	1,200	1,301	98,730	2028/5/24
	SOUTH AUST GOVT FIN	2.75	500	527	40,030	2030/5/24
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	4.0	7,500	8,359	634,018	2024/6/11

銘	柄	当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
	地方債証券					
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3.25	2,000	2,177	165,126	2026/2/19
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3.25	2,000	2,191	166,209	2028/1/24
	TREASURY CORP VICTORIA	5.5	2,000	2,532	192,055	2026/11/17
	TREASURY CORP VICTORIA	3.0	9,000	9,840	746,270	2028/10/20
	VICTORIA TREASURY	6.0	5,500	6,345	481,252	2022/10/17
	VICTORIA TREASURY	5.5	9,000	10,908	827,330	2024/12/17
	WESTERN AUST TREAS CORP	6.0	10,000	11,936	905,286	2023/10/16
	WESTERN AUST TREAS CORP	2.5	3,000	3,149	238,834	2024/7/23
	WESTERN AUST TREAS CORP	5.0	2,250	2,698	204,638	2025/7/23
	WESTERN AUST TREAS CORP	3.0	4,500	4,887	370,705	2026/10/21
	WESTERN AUST TREAS CORP	3.0	4,000	4,353	330,180	2027/10/21
	WESTERN AUST TREAS CORP	3.25	2,320	2,574	195,276	2028/7/20
	WESTERN AUST TREAS CORP	2.75	1,700	1,809	137,221	2029/7/24
	特殊債券 (除く金融債)					
	AFRICAN DEV BANK	5.25	2,000	2,203	167,119	2022/3/23
	AFRICAN DEV BANK	4.75	5,000	5,690	431,540	2024/3/6
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	2.75	1,000	1,033	78,364	2022/1/19
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	3.4	3,000	3,339	253,263	2027/9/10
	AUSTRALIAN POSTAL CORP	5.0	2,000	2,091	158,602	2020/11/13
	CORP ANDINA DE FOMENTO	6.25	5,000	5,805	440,296	2023/11/8
	CORP ANDINA DE FOMENTO	4.5	8,000	8,727	661,895	2025/6/5
	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1.7	2,000	2,000	151,725	2024/11/15
	EUROPEAN INVT BK	6.25	500	547	41,498	2021/6/8
	EUROPEAN INVT BK	4.75	1,500	1,732	131,416	2024/8/7
	FMACB 2013-1E A1	2.77	343	342	25,992	2044/12/10
	INTL BK RECON & DEVELOP	5.0	2,000	2,191	166,169	2022/3/7
	KFW	5.5	3,500	3,870	293,504	2022/2/9
	KFW	2.8	2,000	2,094	158,816	2023/3/7
	KFW	5.0	4,000	4,627	350,978	2024/3/19
	KFW	4.0	2,000	2,250	170,659	2025/2/27
	KFW	3.2	5,000	5,467	414,647	2026/9/11
	KOMMUNAL BANKEN	4.5	2,750	2,999	227,472	2022/7/18
	KOMMUNAL BANKEN	4.5	2,500	2,776	210,539	2023/4/17
	KOMMUNINVEST	5.375	3,000	3,261	247,318	2021/11/18
	KOMMUNINVEST	4.75	2,000	2,185	165,713	2022/8/17
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.25	2,000	2,192	166,257	2023/1/24
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.75	2,000	2,292	173,843	2024/4/8
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.25	2,000	2,273	172,437	2025/1/9
	LGFV PROGRAM TRUST	4.31	6,000	6,281	476,385	2021/11/12
	NORDIC INV BANK	5.0	4,000	4,392	333,122	2022/4/19
	普通社債券 (含む投資法人債券)					
	ABN AMRO BANK NV	3.25	6,000	6,071	460,495	2020/4/9
	AIRPORT MOTORWAY TRUST	5.5	3,600	3,764	285,495	2020/12/9
	AIRSERVICES AUSTRALIA	4.75	4,300	4,490	340,548	2020/11/19
	AMP BANK LIMITED FRN	2.4122	1,000	998	75,736	2020/4/9
	AMP WHOLESALE OFFICE FUN	4.75	6,500	6,802	515,897	2021/10/7
	APPLE INC	2.85	1,500	1,503	114,033	2019/8/28
	APPLE INC	2.65	2,600	2,625	199,122	2020/6/10
	APPLE INC	3.7	3,500	3,713	281,642	2022/8/28
	AUSNET SERVICES HOLDINGS	4.2	2,000	2,236	169,600	2028/8/21

銘柄	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
オーストラリア						
	普通社債券 (含む投資法人債券)					
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.75	1,500	1,503	114,038	2019/7/25
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.25	8,000	8,124	616,160	2020/6/3
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.35	1,500	1,580	119,849	2023/5/9
	AUST & NZ BANKING GROUP	5.0	1,500	1,689	128,144	2023/8/16
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.1	2,500	2,617	198,514	2024/2/8
	AUSTRALIA PACIFIC AIRPOR	4.0	1,600	1,700	128,943	2022/9/15
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	5.0	3,600	3,643	276,308	2019/11/7
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	5.5	5,000	5,483	415,895	2022/11/4
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	3.75	6,000	6,276	476,030	2024/5/22
	BANK OF NOVA SCOTIA	3.2	1,400	1,465	111,142	2023/9/7
	BHP BILLITON FINANCE LTD	3.0	6,500	6,565	497,899	2020/3/30
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	5.5	1,500	1,674	127,008	2022/5/23
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	5.25	3,500	4,086	309,917	2024/5/20
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	3.5	2,000	2,219	168,334	2027/7/19
	BK TOKYO-MIT UFJ SYDNEY	3.4	2,000	2,097	159,089	2023/3/20
	BNP PARIBAS/AUSTRALIA	3.75	5,000	5,092	386,230	2020/5/21
	BPCE SA	3.5	4,600	4,661	353,549	2020/4/24
	BWP TRUST	3.5	1,500	1,559	118,255	2022/5/11
	BWP TRUST	3.3	600	617	46,816	2026/4/10
	CIBC AUSTRALIA FRN	1.9928	1,500	1,501	113,904	2020/2/24
	CITIBANK NA FRN	2.3	2,500	2,497	189,438	2022/5/20
	COCA-COLA CO	2.6	2,000	2,017	153,004	2020/6/9
	COM BK AUSTRALIA	7.25	3,000	3,108	235,717	2020/2/5
	COM BK AUSTRALIA	4.75	2,000	2,255	171,085	2024/5/27
	COMMONWEALTH BANK AUST	2.75	1,500	1,538	116,697	2021/11/17
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	3,000	3,115	236,290	2022/1/17
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	2,500	2,623	198,968	2023/4/25
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.2	1,500	1,573	119,339	2023/8/16
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.0	1,200	1,249	94,774	2024/1/11
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	3,000	3,180	241,223	2026/11/17
	COMMONWEALTH PROP FUND	5.25	7,000	7,112	539,390	2019/12/13
	CREDIT SUISSE SYDNEY	4.0	2,000	2,004	151,997	2019/7/16
	CREDIT SUISSE SYDNEY	3.5	5,000	5,075	384,960	2020/4/29
	CREDIT SUISSE SYDNEY	4.0	4,500	4,668	354,095	2021/3/9
	DEUTSCHE BAHN FIN GMBH	3.8	1,000	1,105	83,871	2027/9/27
	DEXUS FINANCE PTY LTD	4.25	3,200	3,470	263,231	2027/5/11
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.25	2,000	2,001	151,822	2019/7/1
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.25	5,000	5,250	398,216	2022/6/16
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.75	1,000	1,103	83,653	2025/6/16
	ETSA UTILITIES FINANCE	3.5	3,500	3,698	280,511	2024/8/29
	EXPORT DEVELOPMNT CANADA	2.8	500	524	39,754	2023/5/31
	EXPORT-IMPORT BANK K FRN	2.5133	3,000	3,012	228,452	2023/10/30
	EXPORT-IMPORT BANK KOREA	3.7	2,000	2,058	156,151	2021/2/19
	EXPORT-IMPORT BK KOR	4.25	3,700	3,782	286,862	2020/5/21
	EXPORT-IMPORT BK KOR	3.5	2,000	2,079	157,716	2022/2/14
	FEDERATION CENTRES LTD	5.75	1,000	1,019	77,326	2019/12/13
	FEDERATION CENTRES LTD	5.0	6,800	7,175	544,163	2021/5/27
	FONTERRA COOPERATIVE GRO	4.5	6,700	7,067	535,983	2021/6/30

銘柄	当	期 末			償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
	%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円		
オーストラリア						
普通社債券 (含む投資法人債券)	FONTERRA COOPERATIVE GRO	5.5	4,000	4,585	347,726	2024/2/26
	GPT RE LTD	4.5	4,600	4,687	355,485	2020/9/11
	GPT RE LTD	3.6725	1,900	2,003	151,972	2024/9/19
	GPT WHL OFFICE FD NO1	4.0	3,000	3,134	237,731	2022/5/18
	GPT WHL OFFICE FD NO1	4.52	1,000	1,104	83,768	2027/2/22
	GPT WHOLESALE SHOP CENTR	3.993	3,500	3,725	282,563	2024/9/11
	GPT WHOLESALE SHOP CENTR	4.49	3,000	3,276	248,454	2028/2/28
	HSBC BANK AUSTRALIA	5.25	5,000	5,493	416,646	2022/9/7
	HSBC HOLDINGS PLC	3.35	3,000	3,092	234,564	2024/2/16
	HSBC LTD SYDNEY	2.75	700	714	54,189	2021/8/16
	ICPF FINANCE PTY LTD	4.25	2,500	2,704	205,114	2027/4/21
	ING BANK (AUSTRALIA) LTD	3.0	1,300	1,352	102,565	2023/9/7
	INTEL CORP	4.0	2,000	2,136	162,039	2022/12/1
	JP MORGAN CHASE & CO	4.5	3,000	3,355	254,503	2026/1/30
	KOREA DEVELOPMENT BA FRN	2.6662	1,300	1,305	99,025	2023/10/19
	KOREA NATIONAL OIL CORP	4.25	3,500	3,523	267,199	2019/10/8
	KOREA SOUTH-EAST POWER	5.75	5,580	5,837	442,679	2020/9/25
	L-BANK BW FOERDERBANK	2.7	4,000	4,163	315,727	2023/6/19
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.75	5,500	6,564	497,866	2026/5/6
	LLOYDS BANK PLC	3.25	6,000	6,069	460,323	2020/4/1
	MACQUARIE BANK LTD	3.25	5,300	5,357	406,349	2020/3/3
	MACQUARIE UNIVERSITY	6.75	7,000	7,444	564,569	2020/9/9
	MACQUARIE UNIVERSITY	3.5	1,500	1,638	124,270	2028/9/7
	MC FINANCE AUSTRALIA P/L	4.25	2,000	2,106	159,791	2021/12/1
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.75	2,000	2,122	160,988	2021/9/17
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.0	3,000	3,246	246,185	2027/7/13
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	3.0	2,000	2,050	155,491	2021/5/12
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	4.0	1,500	1,584	120,165	2021/12/16
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	6.0	4,000	4,497	341,082	2022/8/8
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	3.0	1,500	1,562	118,524	2023/3/16
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	2.9	1,500	1,555	118,000	2024/2/26
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	1,000	1,138	86,369	2024/3/11
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	5,000	5,672	430,232	2024/6/25
	NED WATERSCHAPBK	5.25	2,000	2,328	176,619	2024/4/18
	NEDER FINANCIERINGS-MAAT	4.75	3,500	4,022	305,043	2024/9/11
	NEDER WATERSCHAPS BANK	3.15	1,000	1,078	81,777	2026/9/2
	NISSAN FIN SERVICES AU	3.0	4,000	4,026	305,377	2020/3/3
	NISSAN FIN SERVICES AU	3.0	1,700	1,725	130,851	2021/3/22
	OPTUS FINANCE PTY LTD	4.0	5,000	5,317	403,260	2022/6/17
	OPTUS FINANCE PTY LTD	3.25	3,000	3,137	237,963	2023/9/6
	PACCAR FINANCIAL PTY LTD	3.0	1,400	1,448	109,839	2022/9/13
	PACCAR FINANCIAL PTY LTD	2.1	1,800	1,802	136,685	2023/6/13
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	5.5	1,200	1,208	91,617	2019/11/20
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	3.75	3,200	3,263	247,478	2021/2/24
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	3.75	3,500	3,705	281,039	2023/12/6
	RABOBANK NEDERLAND AU	3.25	4,400	4,446	337,223	2020/2/11
	RABOBANK NEDERLAND(AUST)	5.5	5,000	5,766	437,297	2024/4/11
	ROYAL BK CANADA/SYD	3.25	6,000	6,061	459,690	2020/2/10

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
	普通社債券 (含む投資法人債券)					
	SCENTRE GROUP TRUST	6.0	5,000	5,510	417,904	2022/7/4
	SCENTRE MGMT LTD	4.5	9,000	9,450	716,763	2021/9/8
	SGSP AUSTRALIA ASSETS	3.75	1,100	1,182	89,649	2024/9/27
	SPARK FINANCE LTD	4.0	1,500	1,631	123,703	2027/10/20
	STOCKLAND TRUST MGMNT	5.5	3,000	3,024	229,351	2019/9/6
	STOCKLAND TRUST MGMNT	4.5	9,000	9,616	729,349	2022/11/23
	STOCKLAND TRUST MGMNT	3.3	1,900	1,946	147,650	2024/3/22
	SUNCORP-METWAY	3.75	5,000	5,039	382,191	2019/11/5
	SUNCORP-METWAY	3.5	4,000	4,091	310,267	2020/10/20
	SUNCORP-METWAY	3.5	5,000	5,144	390,151	2021/4/12
	SUNCORP-METWAY	3.0	2,000	2,081	157,845	2023/9/13
	SUNCORP-METWAY LTD	3.25	5,000	5,268	399,536	2026/8/24
	SVENSKA HANDELSBANKEN AB	3.25	2,000	2,094	158,871	2023/9/27
	TELSTRA CORP LTD	7.75	4,000	4,260	323,111	2020/7/15
	TELSTRA CORP LTD	4.0	6,700	7,111	539,306	2022/9/16
	TELSTRA CORP LTD	4.0	3,000	3,280	248,827	2027/4/19
	TORONTO-DOMINION BANK	3.7	5,000	5,152	390,731	2020/12/22
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	2.7	2,000	2,023	153,430	2020/8/14
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	3.3	2,700	2,835	215,063	2023/11/22
	TRANSPower NEW ZEALAND L	4.25	3,000	3,155	239,291	2021/8/6
	TRANSPower NEW ZEALAND L	5.75	500	577	43,790	2023/8/28
	UBS AG AUSTRALIA	4.0	3,000	3,013	228,580	2019/8/27
	UBS AG AUSTRALIA	2.7	4,000	4,043	306,687	2020/8/10
	UBS AG AUSTRALIA	3.25	3,000	3,136	237,847	2023/3/8
	UNITED ENERGY DISTRIBUTI	3.85	2,400	2,577	195,476	2024/10/23
	UNIV OF SYDNEY	4.75	2,500	2,644	200,575	2021/4/16
	UNIVERSITY OF MELBOURNE	4.25	6,800	7,170	543,777	2021/6/30
	UNIVERSITY OF WOLLONGONG	3.5	2,000	2,183	165,607	2027/12/8
	VICINITY CENTRES	3.5	3,000	3,125	237,012	2024/4/26
	VICINITY CENTRES	4.0	500	533	40,424	2027/4/26
	VICINITY HOLDINGS LTD	5.0	5,600	5,691	431,635	2019/12/19
	VICTORIA POWER NETWORKS	4.0	2,000	2,166	164,331	2027/8/18
	WELLS FARGO & COMPANY	4.0	3,000	3,009	228,248	2019/8/8
	WELLS FARGO & COMPANY	5.25	3,480	3,823	289,977	2022/9/7
	WELLS FARGO & COMPANY	4.75	3,000	3,346	253,794	2024/8/27
	WELLS FARGO & COMPANY	4.0	1,500	1,631	123,714	2027/4/27
	WESFARMERS LTD	4.75	5,000	5,112	387,739	2020/3/12
	WESFARMERS LTD	3.66	5,500	5,647	428,328	2020/11/18
	WESTPAC BANKING	3.25	4,000	4,038	306,299	2020/1/22
	WESTPAC BANKING	3.1	3,500	3,597	272,869	2021/6/3
	WESTPAC BANKING	3.2	3,000	3,139	238,106	2023/3/6
	WESTPAC BANKING	5.25	1,500	1,715	130,139	2023/11/21
	WESTPAC BANKING	3.0	1,500	1,563	118,560	2024/4/24
	WESTPAC BANKING	2.25	1,500	1,507	114,362	2024/8/16
	ZURICH FIN AUSTRALIA LTD	3.477	3,000	3,167	240,252	2023/5/31
合	計				76,199,914	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

## 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期		末	
			買 建 額	売 建 額	買 建 額	売 建 額
外国	債券先物取引	オーストラリア国債(10年)2019.6限月	百万円 6,517		百万円 —	
		オーストラリア国債(3年)2019.6限月	—		6,773	

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

## ○投資信託財産の構成

(2019年6月10日現在)

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
公社債	千円 76,199,914	% 95.9		
コール・ローン等、その他	3,225,022	4.1		
投資信託財産総額	79,424,936	100.0		

(注1) 金額の単位未満は切捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産(77,815,532千円)の投資信託財産総額(79,424,936千円)に対する比率は98.0%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、6月10日における邦貨換算レートは1オーストラリアドル=75.84円です。

## ○特定資産の価格等の調査

(2018年12月11日～2019年6月10日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年6月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	80,040,305,940
コール・ローン等	1,311,310,538
公社債(評価額)	76,199,914,769
未収入金	1,866,957,572
未収利息	673,066,025
前払費用	6,057,948
差入委託証拠金	△ 17,000,912
(B) 負債	1,733,098,381
未払金	1,593,268,559
未払解約金	139,828,060
未払利息	1,762
(C) 純資産総額(A-B)	78,307,207,559
元本	33,060,485,104
次期繰越損益金	45,246,722,455
(D) 受益権総口数	33,060,485,104口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,686円

<注記事項>

元本の状況

期首元本額

36,256,777,073円

期中追加設定元本額

1,233,257,369円

期中一部解約元本額

4,429,549,338円

期末における元本の内訳

LM・オーストラリア毎月分配型ファンド

31,529,494,477円

LM・オーストラリア毎月分配型ファンド(適格機関投資家専用)

876,526,665円

LM・オーストラリア債券ファンド(年2回決算型)

504,333,406円

LM・オーストラリア・インカム・アロケーション・ファンド(毎月分配型)

75,673,431円

LM・オーストラリア・インカム・アロケーション・ファンド(年2回決算型)

74,457,125円

○損益の状況 (2018年12月11日～2019年6月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,508,155,641
受取利息	1,507,183,959
その他収益金	1,213,903
支払利息	△ 242,221
(B) 有価証券売買損益	△ 2,024,222,687
売買益	3,222,812,420
売買損	△ 5,247,035,107
(C) 先物取引等取引損益	358,682,181
取引益	538,239,103
取引損	△ 179,556,922
(D) 保管費用等	△ 3,182,158
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 160,567,023
(F) 前期繰越損益金	49,765,858,924
(G) 追加信託差損益金	1,679,608,511
(H) 解約差損益金	△ 6,038,177,957
(I) 計(E+F+G+H)	45,246,722,455
次期繰越損益金(I)	45,246,722,455

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(G)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) 損益の状況の中で(H)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。