

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14期 決算日 2020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、2020年6月10日に第14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
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
13期(2019年12月10日)	10,196	0	0.0	98.5	△0.4	1,360
14期(2020年6月10日)	10,330	0	1.3	97.4	2.7	1,282

(注) 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) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

(注) 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	騰 落 率		
(期首)	円	%	%	%	%
2019年12月10日	10,196	—	—	98.5	△0.4
12月末	10,407	2.1	2.1	97.4	0.9
2020年1月末	10,170	△0.3	△0.3	98.4	△1.6
2月末	10,038	△1.5	△1.5	98.1	0.6
3月末	9,116	△10.6	△10.6	97.3	4.2
4月末	9,628	△5.6	△5.6	96.9	3.4
5月末	9,890	△3.0	△3.0	97.1	2.2
(期末)					
2020年6月10日	10,330	1.3	1.3	97.4	2.7

(注) 騰落率は期首比です。

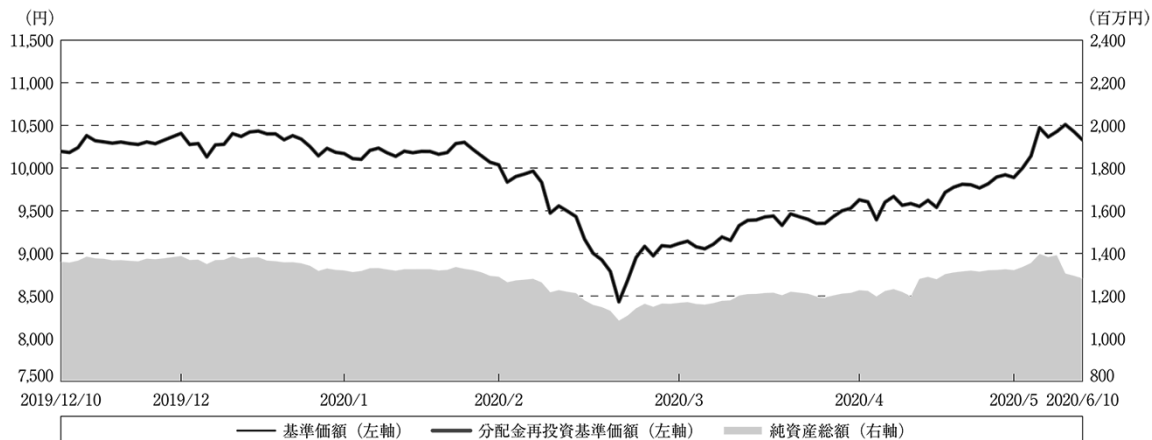
(注) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 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

(2019年12月11日～2020年6月10日)



期 首：10,196円

期 末：10,330円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 1.3% (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(2019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

当期の当ファンドのパフォーマンス(騰落率)は、プラスとなりました。

公社債利金を手堅く確保しました。豪ドル・円相場が豪ドル高・円安となったことから、為替損益もプラスとなりました。一方、公社債損益については、小幅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、米中が貿易協定の「第1段階」で合意し、投資家のリスク回避姿勢が後退したことなどから、利回りは上昇（価格は下落）しました。しかしその後は、大規模な森林火災による豪経済への影響が懸念されたことや、新型コロナウイルスの感染拡大により、世界経済への影響が懸念されたことなどから、利回りは低下しました。

期の半ばは、新型コロナウイルスの感染地域の拡大を受けて株式相場が急落し、リスク回避姿勢が強まったことから、利回りの低下が進みました。その後は、金融市場の混乱が増す中、現金確保の動きが見られたことから、利回りは急上昇しましたが、外出を制限する動きが世界的に広がり、経済活動停滞の長期化が意識されると急低下するなど、値動きの荒い展開となりました。

期の後半は、新型コロナウイルスの感染拡大ペースに鈍化の兆しが見られ、経済活動の回復期待が高まったことなどから、リスク回避姿勢が和らぐ中、利回りは上昇しました。

社債セクターについては、新型コロナウイルス感染拡大の影響でリスク回避姿勢が強まる場面で、社債スプレッド（国債に対する上乗せ利回り）は拡大する展開となりました。



当期の豪ドル・円相場は、豪ドル高・円安となりました。

期の前半は、米中が貿易協定で合意したことを受けて、投資家のリスク回避姿勢が後退したことから、豪ドルは対円で上昇しました。しかし、その後、中東情勢の緊迫化が警戒され、豪ドル売り・円買いが優勢となる場面も見られました。

期の半ばは、新型コロナウイルスの感染拡大への警戒感から、投資家のリスク回避姿勢が強まる中、豪ドルは対円で上値を抑えられました。その後、世界的な感染拡大に歯止めがかからず、投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、豪ドル売り・円買いが強まりました。

期の後半は、各国が協調して金融・財政支援策を決定したことなどから、過度のリスク回避の動きが和らぎ、豪ドルは対円で買い戻されました。その後も、オーストラリアや欧米各国における新型コロナウイルスの感染拡大ペースに鈍化の兆しが見られ、経済活動再開への期待が高まったことから、豪ドルは対円で値を戻す展開となりました。



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

(2019年12月11日～2020年6月10日)

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14期
	2019年12月11日～ 2020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	2,898

(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

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

(2019年12月11日～2020年6月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 68	% 0.687	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(33)	(0.330)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(33)	(0.335)	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	0.002	(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)	(0.002)	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)	(0.006)	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)	(0.019)	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	71	0.718	
期中の平均基準価額は、9,874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。

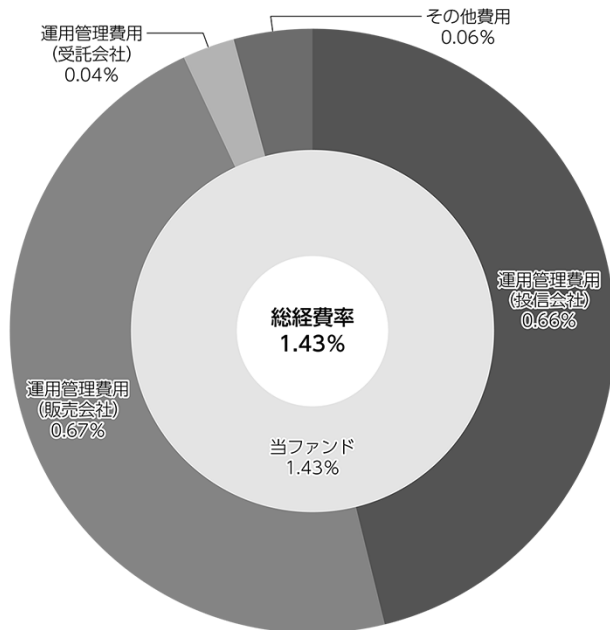
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 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

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1.43%です。



(注) 当ファンドの費用は1万円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、売買委託手数料およ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) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 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は異なります。

○売買及び取引の状況

(2019年12月11日～2020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 70,564	千円 160,944	千口 113,729	千円 269,399

(注) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2019年12月11日～2020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

(2019年12月11日～2020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

(2019年12月11日～2020年6月10日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2020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 574,028	千口 530,862	千円 1,291,907

(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

(2020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 1,291,907	% 100.0
コール・ローン等、その他	277	0.0
投資信託財産総額	1,292,184	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(注) 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（65,195,544千円）の投資信託財産総額（65,346,006千円）に対する比率は99.8%です。

(注) 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=74.81円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年6月10日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	1,292,184,634	
LM・豪ドル債券マザーファンド(評価額)	1,291,907,790	
未収入金	276,844	
(B) 負債	9,435,040	
未払解約金	276,844	
未払信託報酬	8,836,540	
その他未払費用	321,656	
(C) 純資産総額(A-B)	1,282,749,594	
元本	1,241,830,960	
次期繰越損益金	40,918,634	
(D) 受益権総口数	1,241,830,960口	
1万口当たり基準価額(C/D)	10,330円	

<注記事項>

元本の状況

期首元本額

1,334,400,057円

期中追加設定元本額

165,924,280円

期中一部解約元本額

258,493,377円

○損益の状況 (2019年12月11日～2020年6月10日)

項 目	当 期	円
(A) 有価証券売買損益	33,289,081	
売買益	43,071,084	
売買損	△ 9,782,003	
(B) 信託報酬等	△ 9,158,196	
(C) 当期損益金(A+B)	24,130,885	
(D) 前期繰越損益金	△ 11,387,413	
(E) 追加信託差損益金	28,175,162	
(配当等相当額)	(261,975,738)	
(売買損益相当額)	(△233,800,576)	
(F) 計(C+D+E)	40,918,634	
(G) 収益分配金	0	
次期繰越損益金(F+G)	40,918,634	
追加信託差損益金	28,175,162	
(配当等相当額)	(262,213,267)	
(売買損益相当額)	(△234,038,105)	
分配準備積立金	97,688,715	
繰越損益金	△ 84,945,243	

(注) 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) 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) 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) 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	円
(A) 配 当 等 収 益(費用控除後)	14,902,905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	262,213,267	
(D) 分 配 準 備 積 立 金	82,785,810	
分 配 対 象 収 益 額(A+B+C+D)	359,901,982	
(1 万 口 当 たり 収 益 分 配 対 象 額)	(2,898)	
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34期 決算日 2020年6月10日

(計算期間：2019年12月11日～2020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34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"> 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。 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。 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。 シナリオ・ディペンデント・オプ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。 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。
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	騰落率		債組入比率	債券率	債先物比率	純総資産額
		期騰	中率				
30期(2018年6月11日)	円 23,663		% △2.0	% 97.3	% 97.3	% △0.1	百万円 97,236
31期(2018年12月10日)	23,726		0.3	97.3	97.3	0.5	86,022
32期(2019年6月10日)	23,686		△0.2	97.3	97.3	△0.3	78,307
33期(2019年12月10日)	23,858		0.7	97.8	97.8	△0.4	70,460
34期(2020年6月10日)	24,336		2.0	96.7	96.7	2.7	65,235

(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

(注) 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	債券率	債先物比率	債券率
		期騰	中率				
(期首) 2019年12月10日	円 23,858		% —	% 97.8	% 97.8	% △0.4	% △0.4
12月末	24,371		2.2	97.3	97.3	0.8	0.8
2020年1月末	23,846		△0.1	98.2	98.2	△1.6	△1.6
2月末	23,563		△1.2	97.8	97.8	0.6	0.6
3月末	21,434		△10.2	96.8	96.8	4.2	4.2
4月末	22,656		△5.0	96.4	96.4	3.4	3.4
5月末	23,295		△2.4	96.5	96.5	2.2	2.2
(期末) 2020年6月10日	24,336		2.0	96.7	96.7	2.7	2.7

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 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

(2019年12月11日～2020年6月10日)



○基準価額の変動要因

当期の当ファンドのパフォーマンス（騰落率）は、プラスとなりました。

公社債利金を手堅く確保しました。豪ドル・円相場が豪ドル高・円安となったことから、為替損益もプラスとなりました。一方、公社債損益については、小幅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、米中が貿易協議の「第1段階」で合意し、投資家のリスク回避姿勢が後退したことなどから、利回りは上昇（価格は下落）しました。しかしその後は、大規模な森林火災による豪経済への影響が懸念されたことや、新型コロナウイルスの感染拡大により、世界経済への影響が懸念されたことなどから、利回りは低下しました。

期の半ばは、新型コロナウイルスの感染地域の拡大を受けて株式相場が急落し、リスク回避姿勢が強まったことから、利回りの低下が進みました。その後は、金融市場の混乱が増す中、現金確保の動きが見られたことから、利回りは急上昇しましたが、外出を制限する動きが世界的に広がり、経済活動停滞の長期化が意識されると急低下するなど、値動きの荒い展開となりました。

期の後半は、新型コロナウイルスの感染拡大ペースに鈍化の兆しが見られ、経済活動の回復期待が高まったことなどから、リスク回避姿勢が和らぐ中、利回りは上昇しました。

社債セクターについては、新型コロナウイルス感染拡大の影響でリスク回避姿勢が強まる場面で、社債スプレッド（国債に対する上乗せ利回り）は拡大する展開となりました。



当期の豪ドル・円相場は、豪ドル高・円安となりました。

期の前半は、米中が貿易協議で合意したことを受けて、投資家のリスク回避姿勢が後退したことから、豪ドルは対円で上昇しました。しかし、その後、中東情勢の緊迫化が警戒され、豪ドル売り・円買いが優勢となる場面も見られました。

期の半ばは、新型コロナウイルスの感染拡大への警戒感から、投資家のリスク回避姿勢が強まる中、豪ドルは対円で上値を抑えられました。その後、世界的な感染拡大に歯止めがかからず、投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、豪ドル売り・円買いが強まりました。

期の後半は、各国が協調して金融・財政支援策を決定したことなどから、過度のリスク回避の動きが和らぎ、豪ドルは対円で買い戻されました。その後も、オーストラリアや欧米各国における新型コロナウイルスの感染拡大ペースに鈍化の兆しが見られ、経済活動再開への期待が高まったことから、豪ドルは対円で値を戻す展開となりました。



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

(2019年12月11日～2020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、23,194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

(2019年12月11日～2020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	10,089	29,818
		地方債証券	24,835	19,807
		特殊債券	—	13,152 (34)
	社債券(投資法人債券を含む)	26,181	37,938 (42,600)	

(注) 金額は受渡し代金。(経過利息分は含まれておりません。)

(注) 単位未満は切捨て。

(注) () 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) 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。

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 20,344	百万円 18,265	百万円 14,609	百万円 14,349

(注) 単位未満は切捨て。

(注) 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

(2019年12月11日～2020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

(2020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 756,838	千オーストラリアドル 842,995	千円 63,064,492	% 96.7	% —	% 44.7	% 38.3	% 13.7
合 計	756,838	842,995	63,064,492	96.7	—	44.7	38.3	13.7

(注) 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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 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	AUSTRALIA GOVT INFL	2.278	1,640	2,373	177,532	2035/8/21
		AUSTRALIAN GOVT	4.25	3,600	4,369	326,917	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	4.75	16,700	21,259	1,590,405	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	10,200	11,652	871,752	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.25	18,600	20,595	1,540,742	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.25	10,750	12,846	961,044	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	2,400	2,778	207,832	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.5	4,020	4,576	342,349	2030/5/21
		AUSTRALIAN GOVT	1.5	3,500	3,644	272,612	2031/6/21
		AUSTRALIAN GOVT	4.5	11,410	15,919	1,190,926	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	12,800	15,131	1,131,969	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.75	8,900	11,788	881,870	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.25	9,450	11,802	882,908	2039/6/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	4,870	5,665	423,833	2041/5/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.0	10,730	13,170	985,296	2047/3/21
	地方債証券	AUCKLAND COUNCIL	5.843	5,000	5,397	403,786	2022/3/22
		AUST CAPITAL TERRITORY	1.25	1,000	1,021	76,383	2025/5/22
		AUST CAPITAL TERRITORY	3.0	2,000	2,240	167,640	2028/4/18
		AUST CAPITAL TERRITORY	2.25	1,000	1,052	78,705	2029/5/22
		BRITISH COLUMBIA PROV OF	4.25	6,000	6,843	511,978	2024/11/27
		MANITOBA PROVANCE	3.75	500	570	42,694	2026/6/9
		NEW S WALES TREAS CORP	5.0	9,000	10,627	795,074	2024/8/20
		NEW S WALES TREAS CORP	4.0	7,500	8,872	663,746	2026/5/20
		NEW S WALES TREAS CORP	3.0	2,000	2,262	169,235	2027/5/20
		NEW S WALES TREAS CORP	3.0	1,500	1,699	127,154	2028/3/20
		NEW S WALES TREAS CORP	3.0	6,040	6,863	513,426	2030/2/20
		NEW S WALES TREASURY	3.0	7,000	7,956	595,255	2029/4/20
		NEW S WALES TREASURY	2.0	5,400	5,599	418,929	2031/3/20
		NORTHERN TERRITORY TREAS	6.0	2,000	2,392	178,955	2024/3/15
		NORTHERN TERRITORY TREAS	2.75	1,000	1,103	82,589	2027/4/21
		NORTHERN TERRITORY TREAS	3.5	2,000	2,303	172,327	2028/4/21
		NORTHERN TERRITORY TREAS	2.0	1,000	1,030	77,109	2029/5/21
		NORTHERN TERRITORY TREAS	3.75	2,000	2,298	171,917	2033/4/21
		PROVINCE OF QUEBEC	3.7	2,000	2,274	170,141	2026/5/20
		QUEBEC PROVINCE	4.2	3,000	3,420	255,852	2025/3/10
		QUEENSLAND TREASURY	5.75	16,500	19,963	1,493,495	2024/7/22
		QUEENSLAND TREASURY	4.75	6,400	7,696	575,747	2025/7/21
		QUEENSLAND TREASURY	3.25	12,500	14,263	1,067,033	2026/7/21
		QUEENSLAND TREASURY	2.75	4,000	4,459	333,580	2027/8/20
		QUEENSLAND TREASURY	3.25	6,100	7,044	526,978	2028/7/21
		QUEENSLAND TREASURY	2.5	5,700	6,230	466,129	2029/3/6
		QUEENSLAND TREASURY	3.25	5,100	5,903	441,667	2029/8/21
		QUEENSLAND TREASURY	1.75	1,000	1,005	75,243	2031/8/21
		QUEENSLAND TREASURY	6.5	2,000	3,063	229,160	2033/3/14
		SOUTH AUST GOVT FIN	2.25	1,000	1,067	79,834	2024/8/15
		SOUTH AUST GOVT FIN	2.75	2,000	2,190	163,886	2025/4/16
		SOUTH AUST GOVT FIN	3.0	5,500	6,183	462,574	2026/7/20

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					
	SOUTH AUST GOVT FIN	3.0	1,200	1,355	101,420	2028/5/24
	SOUTH AUST GOVT FIN	2.75	500	552	41,359	2030/5/24
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	4.0	5,500	6,198	463,685	2024/6/11
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3.25	2,000	2,233	167,073	2026/2/19
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3.25	2,000	2,274	170,179	2028/1/24
	TREASURY CORP VICTORIA	5.5	4,500	5,807	434,474	2026/11/17
	TREASURY CORP VICTORIA	3.0	11,200	12,786	956,548	2028/10/20
	TREASURY CORP VICTORIA	2.5	5,500	6,050	452,625	2029/10/22
	TREASURY CORP VICTORIA	4.75	1,600	2,099	157,087	2030/11/20
	TREASURY CORP VICTORIA	1.5	2,000	2,000	149,673	2030/11/20
	VICTORIA TREASURY	5.5	6,000	7,305	546,522	2024/12/17
	WESTERN AUST TREAS CORP	2.5	3,000	3,234	242,000	2024/7/23
	WESTERN AUST TREAS CORP	5.0	2,250	2,736	204,745	2025/7/23
	WESTERN AUST TREAS CORP	3.0	4,500	5,094	381,115	2026/10/21
	WESTERN AUST TREAS CORP	3.0	4,000	4,538	339,496	2027/10/21
	WESTERN AUST TREAS CORP	3.25	2,320	2,682	200,709	2028/7/20
	WESTERN AUST TREAS CORP	2.75	2,700	3,009	225,152	2029/7/24
	WESTERN AUST TREAS CORP	2.0	900	889	66,525	2034/10/24
	特殊債券 (除く金融債)					
	AFRICAN DEV BANK	5.25	2,000	2,164	161,896	2022/3/23
	AFRICAN DEV BANK	4.75	5,000	5,710	427,168	2024/3/6
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	3.4	3,000	3,449	258,072	2027/9/10
	AUSTRALIAN POSTAL CORP	5.0	2,000	2,034	152,199	2020/11/13
	CORP ANDINA DE FOMENTO	6.25	5,000	5,677	424,700	2023/11/8
	CORP ANDINA DE FOMENTO	4.5	8,000	8,832	660,733	2025/6/5
	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1.7	2,000	2,075	155,256	2024/11/15
	EUROPEAN INVT BK	4.75	1,500	1,742	130,338	2024/8/7
	FMACB 2013-1E A1	1.1917	281	278	20,852	2044/12/10
	INTL FINANCE CORP	3.2	1,500	1,689	126,384	2026/7/22
	KFW	5.0	2,500	2,894	216,524	2024/3/19
	KFW	4.0	3,000	3,434	256,918	2025/2/27
	KFW	3.2	3,500	3,955	295,907	2026/9/11
	KOMMUNAL BANKEN	4.5	2,750	2,970	222,228	2022/7/18
	KOMMUNAL BANKEN	4.5	1,500	1,660	124,191	2023/4/17
	KOMMUNINVEST	5.375	2,000	2,129	159,319	2021/11/18
	KOMMUNINVEST	4.75	2,000	2,164	161,948	2022/8/17
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.75	4,000	4,854	363,199	2026/5/6
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.25	2,000	2,186	163,587	2023/1/24
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.75	2,000	2,299	172,048	2024/4/8
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.25	2,000	2,303	172,345	2025/1/9
	LGFV PROGRAM TRUST	4.31	6,000	6,197	463,654	2021/11/12
	NORDIC INV BANK	5.0	2,000	2,161	161,695	2022/4/19
	普通社債券 (含む投資法人債券)					
	AIRPORT MOTORWAY TRUST	5.5	3,600	3,643	272,588	2020/12/9
	AIRSERVICES AUSTRALIA	2.2	500	499	37,387	2030/5/15
	AMP WHOLESALE OFFICE FUN	4.75	6,500	6,658	498,159	2021/10/7
	APPLE INC	3.7	3,500	3,720	278,314	2022/8/28
	APPLE INC	3.35	1,500	1,618	121,059	2024/1/10
	AUSNET SERVICES HOLDINGS	4.4	2,000	2,336	174,780	2027/8/16
	AUSNET SERVICES HOLDINGS	4.2	2,000	2,290	171,374	2028/8/21

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	
	普通社債券 (含む投資法人債類)					
	AUSNET SERVICES HOLDINGS	2.6	500	499	37,339	2029/7/31
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.35	5,000	5,365	401,378	2023/5/9
	AUST & NZ BANKING GROUP	5.0	1,500	1,694	126,788	2023/8/16
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.1	2,500	2,694	201,584	2024/2/8
	AUST & NZ BANKING GROUP	1.55	2,000	2,040	152,622	2024/8/29
	AUST & NZ BANKING GROUP	1.65	1,500	1,536	114,924	2025/1/16
	AUSTRALIA PACIFIC AIRPOR	4.0	1,600	1,664	124,534	2022/9/15
	AUSTRALIAN NATIONAL UNIV	3.98	1,000	1,124	84,120	2025/11/18
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	5.5	5,000	5,320	398,049	2022/11/4
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	3.75	6,000	6,187	462,909	2024/5/22
	BANK OF MONTREAL	3.25	1,500	1,577	118,023	2022/10/6
	BANK OF NOVA SCOTIA	3.2	1,400	1,490	111,540	2023/9/7
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	5.25	3,500	4,097	306,538	2024/5/20
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	3.5	2,000	2,283	170,846	2027/7/19
	BK OF COMMUNICATIONS FRN	0.9994	1,700	1,692	126,641	2022/10/28
	BK TOKYO-MIT UFJ SYDNEY	3.4	2,000	2,118	158,476	2023/3/20
	BNG BANK NV	3.3	3,000	3,440	257,403	2029/4/26
	BPCE SA	1.8	3,000	2,995	224,057	2024/9/11
	BPCE SA	2.0	2,500	2,507	187,601	2025/6/5
	BWP TRUST	3.5	1,500	1,552	116,136	2022/5/11
	BWP TRUST	3.3	600	636	47,650	2026/4/10
	CANADIAN IMPERIAL BANK	1.6	2,000	2,001	149,727	2023/6/9
	CITIBANK NA FRN	0.84	2,500	2,496	186,766	2022/5/20
	COCA-COLA CO	3.25	1,000	1,072	80,267	2024/6/11
	COM BK AUSTRALIA	4.75	2,000	2,283	170,837	2024/5/27
	COMMONWEALTH BANK AUST	2.75	1,500	1,546	115,723	2021/11/17
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	1,000	1,042	78,008	2022/1/17
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	2,500	2,676	200,217	2023/4/25
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.2	1,500	1,611	120,567	2023/8/16
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.0	1,200	1,287	96,337	2024/1/11
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	3,000	3,335	249,516	2026/11/17
	CREDIT SUISSE SYDNEY	4.0	4,500	4,609	344,869	2021/3/9
	DEUTSCHE BAHN FIN GMBH	3.8	1,000	1,132	84,749	2027/9/27
	DEXUS FINANCE PTY LTD	4.25	3,200	3,517	263,130	2027/5/11
	DEXUS FINANCE PTY LTD	2.5	1,600	1,509	112,916	2029/10/17
	DEXUS FINANCE PTY LTD	3.0	1,000	969	72,552	2032/2/3
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.25	5,000	5,182	387,687	2022/6/16
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.75	1,000	1,098	82,184	2025/6/16
	ETSA UTILITIES FINAN FRN	1.115	1,000	999	74,792	2022/8/29
	ETSA UTILITIES FINANCE	3.5	3,500	3,745	280,228	2024/8/29
	EXPORT DEVELOPMNT CANADA	2.8	500	531	39,729	2023/5/31
	EXPORT-IMPORT BANK K FRN	1.0602	3,000	2,988	223,545	2023/10/30
	EXPORT-IMPORT BANK KOREA	3.7	2,000	2,035	152,286	2021/2/19
	EXPORT-IMPORT BANK KOREA	1.311	900	900	67,351	2023/5/29
	EXPORT-IMPORT BK KOR	3.5	2,000	2,075	155,254	2022/2/14
	FEDERATION CENTRES LTD	5.0	6,800	7,029	525,861	2021/5/27
	FONTERRA COOPERATIVE GRO	4.5	6,700	6,924	518,028	2021/6/30
	FONTERRA COOPERATIVE GRO	5.5	4,000	4,572	342,040	2024/2/26

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		
普通社債券 (含む投資法人債類)	FONTERRA COOPERATIVE GRO	4.0	500	562	42,047	2027/11/2
	GENERAL PROPERTY TRUST	2.849	600	575	43,071	2032/2/20
	GPT RE LTD	3.6725	1,900	2,010	150,437	2024/9/19
	GPT WHL OFFICE FD NO1	4.0	3,000	3,104	232,217	2022/5/18
	GPT WHL OFFICE FD NO1	4.52	1,000	1,124	84,087	2027/2/22
	HSBC BANK AUSTRALIA	5.25	5,000	5,451	407,804	2022/9/7
	HSBC HOLDINGS PLC	3.35	3,000	3,122	233,613	2024/2/16
	HSBC LTD SYDNEY	2.75	700	715	53,519	2021/8/16
	ICPF FINANCE PTY LTD	4.25	2,500	2,805	209,901	2027/4/21
	ING BANK (AUSTRALIA) LTD	3.0	1,300	1,380	103,280	2023/9/7
	ING BANK (AUSTRALIA) LTD	1.45	1,000	1,007	75,346	2024/8/20
	INTEL CORP	4.0	1,500	1,606	120,181	2022/12/1
	JOHN DEERE FINANCIAL LTD	1.75	2,500	2,511	187,849	2024/10/4
	JP MORGAN CHASE & CO	4.5	3,000	3,394	253,940	2026/1/30
	KOREA DEVELOPMENT BA FRN	1.105	1,300	1,297	97,059	2023/10/19
	KOREA DEVELOPMENT BANK	1.5	2,000	2,000	149,627	2024/8/29
	KOREA SOUTH-EAST POWER	5.75	5,580	5,652	422,879	2020/9/25
	L-BANK BW FOERDERBANK	2.7	4,000	4,224	316,006	2023/6/19
	LLOYDS BANK PLC	1.65	2,500	2,524	188,829	2022/8/12
	MACQUARIE BANK LTD	1.75	2,500	2,543	190,286	2022/6/21
	MACQUARIE UNIVERSITY	3.5	1,500	1,679	125,671	2028/9/7
	MC FINANCE AUSTRALIA P/L	4.25	2,000	2,084	155,924	2021/12/1
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.75	2,000	2,078	155,458	2021/9/17
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.0	3,767	4,065	304,137	2027/7/13
	MIZUHO BANK LTD/SYDNEY	1.7	1,600	1,613	120,714	2024/8/7
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	6.0	4,000	4,434	331,776	2022/8/8
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	3.0	1,500	1,588	118,851	2023/2/10
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	3.0	1,500	1,592	119,100	2023/3/16
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	2.9	1,500	1,606	120,217	2024/2/26
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	1,000	1,148	85,912	2024/3/11
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	2.15	1,200	1,254	93,863	2024/6/19
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	5,000	5,793	433,374	2024/6/25
	NED WATERSCHAPBK	5.25	2,000	2,329	174,281	2024/4/18
	NEDER FINANCIERINGS-MAAT	4.75	3,500	4,054	303,348	2024/9/11
	NEDER WATERSCHAPS BANK	3.15	1,000	1,113	83,294	2026/9/2
	OPTUS FINANCE PTY LTD	4.0	6,000	6,322	472,986	2022/6/17
	OPTUS FINANCE PTY LTD	3.25	3,000	3,155	236,071	2023/9/6
	PACCAR FINANCIAL PTY LTD	3.0	1,400	1,448	108,396	2022/9/13
	PACCAR FINANCIAL PTY LTD	2.1	1,800	1,818	136,004	2023/6/13
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	3.75	3,200	3,214	240,450	2021/2/24
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	3.75	3,500	3,688	275,960	2023/12/6
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	2.0	1,300	1,267	94,826	2025/8/15
	RABOBANK NEDERLAND (AUST)	5.5	5,000	5,764	431,238	2024/4/11
	SCENTRE GROUP TRUST	6.0	5,000	5,371	401,864	2022/7/4
	SCENTRE MGMT LTD	4.5	9,000	9,260	692,761	2021/9/8
	SGSP AUSTRALIA ASSETS	5.5	1,500	1,549	115,886	2021/3/12
	SGSP AUSTRALIA ASSETS	3.75	500	533	39,889	2023/6/28
	SGSP AUSTRALIA ASSETS	3.75	2,600	2,824	211,286	2024/9/27

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	
	普通社債券 (含む数資法人債券)					
	SPARK FINANCE LTD	4.0	2,000	2,257	168,846	2027/10/20
	SPARK FINANCE LTD	2.6	1,100	1,103	82,525	2030/3/18
	STOCKLAND TRUST MGMNT	4.5	9,000	9,374	701,339	2022/11/23
	STOCKLAND TRUST MGMNT	3.3	1,900	1,930	144,393	2024/3/22
	SUMITOMO MITSUI FINL FRN	1.39	2,000	1,963	146,898	2024/10/16
	SUNCORP-METWAY	3.5	4,000	4,041	302,346	2020/10/20
	SUNCORP-METWAY	3.5	5,000	5,116	382,727	2021/4/12
	SUNCORP-METWAY	3.0	2,000	2,123	158,869	2023/9/13
	SUNCORP-METWAY LTD	3.25	5,000	5,478	409,839	2026/8/24
	SVENSKA HANDELSBANKEN AB	3.25	2,000	2,133	159,619	2023/9/27
	TELSTRA CORP LTD	7.75	2,000	2,012	150,580	2020/7/15
	TELSTRA CORP LTD	4.0	4,700	4,998	373,923	2022/9/16
	TELSTRA CORP LTD	4.0	3,000	3,382	253,040	2027/4/19
	TORONTO-DOMINION BANK	3.7	1,000	1,016	76,015	2020/12/22
	TORONTO-DOMINION BANK	2.05	2,200	2,245	168,006	2024/7/10
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	1.3	3,000	2,971	222,315	2023/2/17
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	3.3	2,700	2,842	212,629	2023/11/22
	TRANSPower NEW ZEALAND L	4.25	3,000	3,113	232,929	2021/8/6
	TRANSPower NEW ZEALAND L	5.75	1,000	1,143	85,525	2023/8/28
	UBS AG AUSTRALIA	2.7	4,000	4,012	300,203	2020/8/10
	UBS AG AUSTRALIA	3.25	3,000	3,178	237,794	2023/3/8
	UNITED ENERGY DISTRIBUTI	3.85	2,400	2,597	194,322	2024/10/23
	UNITED ENERGY DISTRIBUTI	2.2	1,500	1,512	113,159	2026/10/29
	UNIVERSITY OF MELBOURNE	4.25	6,800	7,043	526,929	2021/6/30
	UNIVERSITY OF WOLLONGONG	3.5	2,000	2,238	167,438	2027/12/8
	VICINITY CENTRES	3.5	3,000	3,128	234,010	2024/4/26
	VICINITY CENTRES	4.0	500	526	39,415	2027/4/26
	VICTORIA POWER NETWORKS	4.0	2,500	2,783	208,244	2027/8/18
	WELLS FARGO & COMPANY	5.25	3,480	3,774	282,371	2022/9/7
	WELLS FARGO & COMPANY	4.75	3,000	3,366	251,814	2024/8/27
	WELLS FARGO & COMPANY	4.0	1,500	1,649	123,364	2027/4/27
	WESFARMERS LTD	3.66	5,500	5,562	416,125	2020/11/18
	WESTPAC BANKING	3.2	3,000	3,199	239,345	2023/3/6
	WESTPAC BANKING	5.25	1,500	1,722	128,822	2023/11/21
	WESTPAC BANKING	3.0	3,500	3,769	281,988	2024/4/24
	WESTPAC BANKING	2.25	1,500	1,574	117,765	2024/8/16
	ZURICH FIN AUSTRALIA LTD	3.477	3,000	3,176	237,651	2023/5/31
合	計				63,064,492	

(注) 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) 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	
			買 建 額	売 建 額
外 国	債券先物取引		百万円	百万円
		オーストラリア国債(10年)2020.9限月	7,117	—
		オーストラリア国債(3年)2020.6限月	—	5,455
		オーストラリア国債(3年)2020.9限月	70	—

(注) 単位未満は切捨て。

(注) 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

(2020年6月10日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	63,064,492	96.5
コール・ローン等、その他	2,281,514	3.5
投資信託財産総額	65,346,006	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨て。

(注) 当期末における外貨建純資産(65,195,544千円)の投資信託財産総額(65,346,006千円)に対する比率は99.8%です。

(注) 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=74.81円です。

○特定資産の価格等の調査

(2019年12月11日～2020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 (2020年6月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	66,007,854,838
コール・ローン等	1,186,237,021
公社債(評価額)	63,064,492,057
未収入金	1,086,162,656
未収利息	477,456,347
前払費用	9,736,765
差入委託証拠金	183,769,992
(B) 負債	772,824,032
未払金	677,029,790
未払解約金	95,793,854
未払利息	388
(C) 純資産総額(A-B)	65,235,030,806
元本	26,805,735,846
次期繰越損益金	38,429,294,960
(D) 受益権総口数	26,805,735,846口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,336円

<注記事項>

元本の状況

期首元本額 29,533,537,598円

期中追加設定元本額 525,022,564円

期中一部解約元本額 3,252,824,316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
25,390,945,514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)
793,965,551円LM・オーストラリア債券ファンド(年2回決算型)
530,862,833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)
45,647,027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)
44,314,921円

○損益の状況 (2019年12月11日～2020年6月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,125,245,606
受取利息	1,125,429,631
その他収益金	△ 49,704
支払利息	△ 134,321
(B) 有価証券売買損益	38,974,214
売買益	833,050,023
売買損	△ 794,075,809
(C) 先物取引等取引損益	△ 29,711,369
取引益	168,363,673
取引損	△ 198,075,042
(D) 保管費用等	△ 2,823,344
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	1,131,685,107
(F) 前期繰越損益金	40,926,758,303
(G) 追加信託差損益金	697,411,641
(H) 解約差損益金	△ 4,326,560,091
(I) 計(E+F+G+H)	38,429,294,960
次期繰越損益金(I)	38,429,294,960

(注) 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) 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) 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。