

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／インデックス型	
信託期間	無期限（2016年7月1日設定）	
運用方針	<p>豪州債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として豪州の公社債に投資を行い、シティ・オーストラリア国債インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p>	
主要運用対象	ベビーファンド	豪州債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、豪州の公社債に直接投資することがあります。
	マザーファンド	豪州の公社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	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	<p>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。</p>	

※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。  
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。  
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 運用報告書（全体版）

**eMAXIS**  
 イーマックス

### eMAXIS 豪州債券インデックス



第1期（決算日：2017年1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「eMAXIS 豪州債券インデックス」は、去る1月26日に第1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。

**MUFG**

三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号

URL:<http://www.am.mufig.jp/>

eMAXIS専用サイト URL:<http://emaxis.muam.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル **TEL. 0120-151034**

(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、お取り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			シティ・オーストラリア 国債インデックス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配	み 期 騰 落 率	(円換算ベース)	騰 落 率			
(設定日)	円	円	%		%	%	%	百万円
2016年7月1日	10,000	—	—	122,062.21	—	—	—	150
1期(2017年1月26日)	10,764	0	7.6	132,366.71	8.4	96.8	—	191

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) シティ・オーストラリア国債インデックスとは、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、オーストラリア国債の総合収益率を指数化した債券インデックスです。シティ・オーストラリア国債インデックス(円換算ベース)とは、Citigroup Index LLCが算出し公表しているシティ・オーストラリア国債インデックスをもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み合わせるので、「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		シティ・オーストラリア 国債インデックス		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(円換算ベース)	騰 落 率		
(設定日)	円	%		%	%	%
2016年7月1日	10,000	—	122,062.21	—	—	—
7月末	10,283	2.8	125,941.42	3.2	93.3	—
8月末	10,168	1.7	124,619.45	2.1	94.7	—
9月末	10,029	0.3	122,916.30	0.7	95.4	—
10月末	10,172	1.7	124,776.03	2.2	95.2	—
11月末	10,562	5.6	129,717.01	6.3	96.1	—
12月末	10,538	5.4	129,501.79	6.1	96.9	—
(期 末)						
2017年1月26日	10,764	7.6	132,366.71	8.4	96.8	—

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み合わせるので、「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

## 当期中の基準価額等の推移について

(第1期：2016/7/1～2017/1/26)

基準価額の動き	基準価額は設定時に比べ7.6%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(8.4%)を0.8%下回りました。



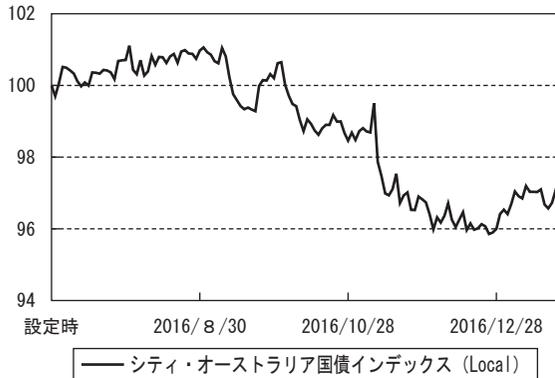
## 基準価額の主な変動要因

上昇要因	・米大統領選の結果を受けて、豪ドルが対円で買われたことが、基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	・豪州における追加金融緩和期待が剥落したことや、米大統領選の結果を受けて金利が上昇したことが、基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

(第1期：2016/7/1～2017/1/26)

市況の推移  
(設定時を100として指数化)



(注) 現地日付ベースで記載しております。

為替市況の推移  
(設定時を100として指数化)



◎債券市況

- ・豪州における追加金融緩和期待が剥落したことや、米大統領選の結果を受けて金利が上昇しました。

◎為替市況

- ・円・豪ドル相場は、米大統領選の結果を受けて、豪ドルが対円で買われました。設定時との比較では、豪ドルは対円で11.9%上昇しました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

### < eMAXIS 豪州債券インデックス >

- ・豪州債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ・オーストラリア国債インデックス（円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・債券の実質組入比率は運用の基本方針にしたがって高水準を維持しました。このため基準価額は、マザーファンドに組み入れられた資産の市況変動の影響を反映しています。

### < 豪州債券インデックスマザーファンド >

基準価額は設定時に比べ8.1%の上昇となりました。

- ・豪州の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ・オーストラリア国債インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

（ご参考）

### 利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

期末（2017年1月26日）

最終利回り	2.4%
直接利回り	3.6%
デュレーション	6.0年

- ・数値は債券現物部分で計算しております。
- ・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。
- ・デュレーション調整のため、債券先物を組み入れることがあります。この場合、デュレーションについては債券先物を含めて計算しています。

## 当該投資信託のベンチマークとの差異について

＜eMAXIS 豪州債券インデックス＞  
基準価額とベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.8\%$ 程度となりました。

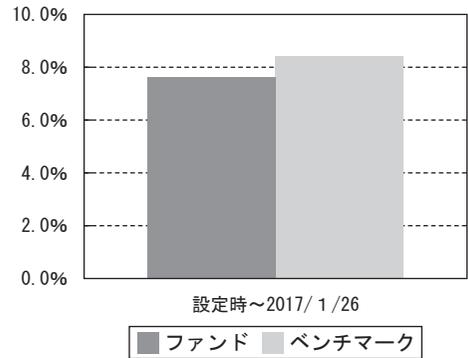
	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	$\Delta 0.4\%$ 程度	$\Delta 0.3\%$ 程度	$\Delta 0.8\%$ 程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎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は $\Delta 0.4\%$ 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 $\Delta 0.3\%$ 程度でした。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



＜豪州債券インデックスマザーファンド＞  
ベンチマークは $8.4\%$ の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.3\%$ 程度となりました。

	ポートフォリオ 要 因	管理コスト等 要 因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	$\Delta 0.3\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度	$0.1\%$ 程度	$\Delta 0.3\%$ 程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎ポートフォリオ要因  
ポートフォリオ要因による影響は $\Delta 0.3\%$ 程度でした。  
・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

◎管理コスト等要因  
管理コスト等による影響は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。  
・取引コスト、カストディーフィー等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因  
評価時価差異による影響は $0.1\%$ 程度でした。  
・為替の効果および債券の効果による要因です。  
為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。  
債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

## 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1期
	2016年7月1日～2017年1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	764

(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

＜eMAXIS 豪州債券インデックス＞

- ・ファンドの資産のほぼ全額を豪州債券インデックスマザーファンド受益証券に投資し、高い実質外国公社債組入比率を維持します。

＜豪州債券インデックスマザーファンド＞

- ・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

(2016年7月1日～2017年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(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 )	(17)	(0.167)	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 )	(17)	(0.167)	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 )	( 4 )	(0.037)	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	7	0.068	(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 )	( 5 )	(0.053)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
( 監 査 費 用 )	( 0 )	(0.002)	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
( そ の 他 )	( 1 )	(0.013)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	45	0.440	
期中の平均基準価額は、10,292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。

## ○売買及び取引の状況

(2016年7月1日～2017年1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
豪州債券インデックスマザーファンド	千口 181,185	千円 182,543	千口 3,655	千円 3,868

## ○利害関係人との取引状況等

(2016年7月1日～2017年1月26日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt; eMAXIS 豪州債券インデックス &gt;

該当事項はございません。

## &lt; 豪州債券インデックスマザーファンド &gt;

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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 182	百万円 182	% 100.0	百万円 3	百万円 3	% 100.0

平均保有割合 100.0%

※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。

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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

## ○自社による当ファンドの設定・解約状況

設定時残高(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 150	百万円 -	百万円 -	百万円 150	当初設定時における取得

## ○組入資産の明細

(2017年1月26日現在)

## 親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
豪州債券インデックスマザーファンド		千口 177,530	千円 191,821

マザーファンドの組入資産の明細につきましては、マザーファンド頁をご参照ください。

## ○投資信託財産の構成

(2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
豪州債券インデックスマザーファンド	千円 191,821	% 99.7
コール・ローン等、その他	656	0.3
投資信託財産総額	192,477	100.0

(注) 豪州債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（191,524千円）の投資信託財産総額（191,841千円）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、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 オーストラリアドル=85.77円			
--------------------	--	--	--

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	192,477,497
コール・ローン等	635,513
豪州債券インデックスマザーファンド(評価額)	191,821,494
未収入金	20,490
(B) 負債	622,246
未払信託報酬	618,609
その他未払費用	3,637
(C) 純資産総額(A-B)	191,855,251
元本	178,229,895
次期繰越損益金	13,625,356
(D) 受益権総口数	178,229,895口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,764円

## ＜注記事項＞

- ①設定元本額 150,000,000円  
 期中追加設定元本額 37,448,847円  
 期中一部解約元本額 9,218,952円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0764円です。

## ②分配金の計算過程

項 目	2016年7月1日～ 2017年1月26日
費用控除後の配当等収益額	3,033,217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	9,059,079円
収益調整金額	1,533,060円
分配準備積立金額	－円
当ファンドの分配対象収益額	13,625,356円
1万口当たり収益分配対象額	764円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金額	－円

\*三菱UFJ国際投信では本資料のほか、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 (<http://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

## 〔お知らせ〕

2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5% (法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。)) の税率が適用されます。

## ○損益の状況 (2016年7月1日～2017年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 28
受取利息	2
支払利息	△ 30
(B) 有価証券売買損益	12,714,570
売買益	13,308,951
売買損	△ 594,381
(C) 信託報酬等	△ 622,246
(D) 当期損益金(A+B+C)	12,092,296
(E) 追加信託差損益金	1,533,060
(売買損益相当額)	( 1,533,060)
(F) 計(D+E)	13,625,356
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	13,625,356
追加信託差損益金	1,533,060
(配当等相当額)	( 105,393)
(売買損益相当額)	( 1,427,667)
分配準備積立金	12,092,296

- (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) (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。

## 豪州債券インデックスマザーファンド

### 《第1期》決算日2017年1月26日

〔計算期間：2016年7月1日～2017年1月26日〕

「豪州債券インデックスマザーファンド」は、1月26日に第1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1期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	主として豪州の公社債に投資を行い、シティ・オーストラリア国債インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 公社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公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主 要 運 用 対 象	豪州の公社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割合に制限を設けません。

### ○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		シティ・オーストラリア 国 債 イ ン デ ッ ク ス (円換算ベース)		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) 2016年7月1日	円	%	122,062.21	%	%	%	百万円 149
1期(2017年1月26日)	10,805	8.1	132,366.71	8.4	96.8	—	191

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) シティ・オーストラリア国債インデックスとは、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、オーストラリア国債の総合収益率を指数化した債券インデックスです。シティ・オーストラリア国債インデックス（円換算ベース）とは、Citigroup Index LLCが算出し公表しているシティ・オーストラリア国債インデックスをもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(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		シテイ・オーストラリア 国 債 イ ン デ ッ ク ス (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(設定日) 2016年7月1日	円	%	122,062.21	%	%	%	%
7月末	10,288	2.9	125,941.42	3.2	93.3	—	—
8月末	10,179	1.8	124,619.45	2.1	94.7	—	—
9月末	10,046	0.5	122,916.30	0.7	95.4	—	—
10月末	10,194	1.9	124,776.03	2.2	95.2	—	—
11月末	10,591	5.9	129,717.01	6.3	96.1	—	—
12月末	10,573	5.7	129,501.79	6.1	96.9	—	—
(期 末) 2017年1月26日	10,805	8.1	132,366.71	8.4	96.8	—	—

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

(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

基準価額は設定時に比べ8.1%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(8.4%)を0.3%下回りました。

## 基準価額の推移



(注) ベンチマークは設定時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。

●投資環境について

◎債券市況

- ・豪州における追加金融緩和期待が剥落したことや、米大統領選の結果を受けて金利が上昇しました。

◎為替市況

- ・円・豪ドル相場は、米大統領選の結果を受けて、豪ドルが対円で買われました。設定時との比較では、豪ドルは対円で11.9%上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・豪州の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ・オーストラリア国債インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

●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8.4%の上昇となったため、カイ離は△0.3%程度となりました。

	ポートフォリオ 要 因	管理コスト 等 要 因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	△0.3%程度	△0.2%程度	0.1%程度	△0.3%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は△0.3%程度でした。

- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

◎管理コスト等要因

- ・管理コスト等による影響は△0.2%程度でした。
- ・取引コスト、カストディーフィー等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

- ・評価時価差異による影響は0.1%程度でした。
- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

◎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

(2016年7月1日～2017年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)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 )	7	0.066	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
( そ の 他 )	(5)	(0.053)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	(1)	(0.013)	
期中の平均基準価額は、10,311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

(2016年7月1日～2017年1月26日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル
外 国	オーストラリア	国債証券	2,788	515

(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

(2016年7月1日～2017年1月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況 B	B/A	%	うち利害関係人との取引状況 D	D/C	%
為替直物取引	百万円 182	百万円 182	100.0	百万円 3	百万円 3	100.0

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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2017年1月26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 2,030	千オーストラリアドル 2,164	千円 185,656	% 96.8	% —	% 60.3	% 28.2	% 8.3
合 計	2,030	2,164	185,656	96.8	—	60.3	28.2	8.3

(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) 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)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期 末						償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額		債 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							
1.75 AUST GOVT 201121	1.75	170	168	14,414		2020/11/21	
2.25 AUST GOVT 280521	2.25	90	84	7,278		2028/5/21	
2.75 AUST GOVT 191021	2.75	120	122	10,520		2019/10/21	
2.75 AUST GOVT 240421	2.75	130	131	11,317		2024/4/21	
2.75 AUST GOVT 271121	2.75	80	79	6,832		2027/11/21	
2.75 AUST GOVT 350621	2.75	30	27	2,353		2035/6/21	
3 AUST GOVT 470321	3.0	40	34	2,956		2047/3/21	
3.25 AUST GOVT 181021	3.25	70	71	6,155		2018/10/21	
3.25 AUST GOVT 250421	3.25	150	157	13,468		2025/4/21	
3.25 AUST GOVT 290421	3.25	60	61	5,316		2029/4/21	
3.25 AUST GOVT 390621	3.25	20	18	1,629		2039/6/21	
3.75 AUST GOVT 370421	3.75	50	52	4,465		2037/4/21	
4.25 AUST GOVT 260421	4.25	150	169	14,518		2026/4/21	
4.5 AUST GOVT 200415	4.5	110	118	10,173		2020/4/15	
4.5 AUST GOVT 330421	4.5	60	69	6,000		2033/4/21	
4.75 AUST GOVT 270421	4.75	150	176	15,172		2027/4/21	
5.25 AUST GOVT 190315	5.25	100	107	9,184		2019/3/15	
5.5 AUST GOVT 180121	5.5	110	114	9,778		2018/1/21	
5.5 AUST GOVT 230421	5.5	120	141	12,141		2023/4/21	
5.75 AUST GOVT 210515	5.75	100	114	9,850		2021/5/15	
5.75 AUST GOVT 220715	5.75	120	141	12,127		2022/7/15	
合 計				185,656			

(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

(2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	185,656	96.8
コール・ローン等、その他	6,185	3.2
投資信託財産総額	191,841	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (191,524千円) の投資信託財産総額 (191,841千円) 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、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 オーストラリアドル=85.77円		
--------------------	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	192,441,628
コール・ローン等	4,692,680
公社債(評価額)	185,656,380
未収入金	600,250
未収利息	1,337,486
前払費用	154,832
(B) 負債	620,782
未払金	600,292
未払解約金	20,490
(C) 純資産総額(A-B)	191,820,846
元本	177,530,305
次期繰越損益金	14,290,541
(D) 受益権総口数	177,530,305口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,805円

<注記事項>

- ①設定元本額 149,985,000円  
 期中追加設定元本額 31,200,750円  
 期中一部解約元本額 3,655,445円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0805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)

eMAXIS 豪州債券インデックス 177,530,305円

○損益の状況 (2016年7月1日～2017年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,370,017
受取利息	3,371,166
支払利息	△ 1,149
(B) 有価証券売買損益	9,885,244
売買益	19,228,830
売買損	△ 9,343,586
(C) 保管費用等	△ 109,945
(D) 当期損益金(A+B+C)	13,145,316
(E) 追加信託差損益金	1,357,967
(F) 解約差損益金	△ 212,742
(G) 計(D+E+F)	14,290,541
次期繰越損益金(G)	14,290,541

(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。