

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	2022年10月7日まで（2014年7月1日設定）	
運用方針	主として円建ての外国投資信託であるAMP オーストラリア インカム ボンド ファンドの投資信託証券への投資を通じて、オーストラリアの企業が発行する普通社債、劣後債および優先証券等への投資に加えて、円に対する豪ドルのコール・オプションの売却によってオプション・プレミアム収入を獲得する、通貨カバード・コール戦略を実質的に活用することにより、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。なお、証券投資信託であるマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券への投資も行います。円建ての外国投資信託への投資は高位を維持することを基本とします。債券等の運用は、AMP キャピタル・インベスターズ・リミテッドが行います。また、通貨カバード・コール戦略の運用は、クレディ・スイス・マネジメント（ケイマン）リミテッドが行います。	
主要運用対象	三菱UFJ / AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド豪ドル円プレミアム（毎月決算型）	AMP オーストラリア インカム ボンド ファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券を主要投資対象とします。
	AMP オーストラリア インカム ボンド ファンド	オーストラリアの企業が発行する普通社債、劣後債および優先証券等、ならびに円に対する豪ドルのコール・オプション取引を主要投資対象とします。
	マネー・マーケット・マザーファンド	わが国の公社債等を主要投資対象とします。外貨建資産への投資は行いません。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行いません。	
分配方針	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は分配を行わないことがあります。なお、第2計算期末までの間は、収益の分配は行いません。	

※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）

三菱UFJ / AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド 豪ドル円プレミアム（毎月決算型）

愛称：コアラ・プレミアム



第52期（決算日：2018年11月7日）
 第53期（決算日：2018年12月7日）
 第54期（決算日：2019年1月7日）
 第55期（決算日：2019年2月7日）
 第56期（決算日：2019年3月7日）
 第57期（決算日：2019年4月8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「三菱UFJ / AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド 豪ドル円プレミアム（毎月決算型）」は、去る4月8日に第57期の決算を行いましたので、法令に基づいて第52期～第57期の運用状況をまとめて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。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用フリーダイヤル **0120-151034**
 （受付時間：営業日の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。

○最近30期の運用実績

決 算 期	基 (分配落)	準 価 額		債 券 率	債 券 率	投 資 信 託 券 率	純 資 産 額
		税 分 込 配	み 期 騰 落 中 率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
28期(2016年11月7日)	6,803	80	0.8	0.1	—	99.2	9,914
29期(2016年12月7日)	6,842	80	1.7	0.1	—	99.1	9,717
30期(2017年1月10日)	6,866	80	1.5	0.0	—	99.1	9,477
31期(2017年2月7日)	6,876	80	1.3	0.0	—	99.1	9,187
32期(2017年3月7日)	6,872	80	1.1	0.0	—	99.1	8,874
33期(2017年4月7日)	6,709	80	△1.2	0.0	—	99.0	8,442
34期(2017年5月8日)	6,689	80	0.9	—	—	99.1	8,199
35期(2017年6月7日)	6,553	80	△0.8	—	—	98.6	7,708
36期(2017年7月7日)	6,484	80	0.2	—	—	99.1	7,330
37期(2017年8月7日)	6,492	80	1.4	—	—	99.2	7,163
38期(2017年9月7日)	6,406	80	△0.1	—	—	99.1	6,907
39期(2017年10月10日)	6,366	80	0.6	—	—	99.2	6,641
40期(2017年11月7日)	6,401	80	1.8	—	—	99.1	6,403
41期(2017年12月7日)	6,175	80	△2.3	—	—	98.5	5,977
42期(2018年1月9日)	6,159	80	1.0	—	—	98.9	5,857
43期(2018年2月7日)	5,979	60	△1.9	—	—	98.7	5,505
44期(2018年3月7日)	5,704	60	△3.6	—	—	98.8	5,077
45期(2018年4月9日)	5,635	60	△0.2	—	—	98.9	4,855
46期(2018年5月7日)	5,616	60	0.7	—	—	99.5	4,737
47期(2018年6月7日)	5,662	60	1.9	—	—	98.6	4,677
48期(2018年7月9日)	5,581	60	△0.4	—	—	98.9	4,451
49期(2018年8月7日)	5,569	60	0.9	—	—	98.6	4,370
50期(2018年9月7日)	5,410	60	△1.8	—	—	98.5	4,129
51期(2018年10月9日)	5,302	60	△0.9	—	—	98.7	3,939
52期(2018年11月7日)	5,334	60	1.7	—	—	99.0	3,924
53期(2018年12月7日)	5,225	60	△0.9	—	—	98.9	3,788
54期(2019年1月7日)	4,896	60	△5.1	—	—	99.1	3,528
55期(2019年2月7日)	4,939	60	2.1	—	—	99.2	3,544
56期(2019年3月7日)	4,943	60	1.3	—	—	97.7	3,530
57期(2019年4月8日)	4,993	60	2.2	—	—	98.2	3,533

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	投 資 信 託 組 入 比	投 資 信 託 券 率
第52期	(期 首) 2018年10月9日	円 5,302	% -		% -		% -		% 98.7	
	10月末	5,319	0.3		-		-		99.4	
	(期 末) 2018年11月7日	5,394	1.7		-		-		99.0	
第53期	(期 首) 2018年11月7日	5,334	-		-		-		99.0	
	11月末	5,389	1.0		-		-		98.5	
	(期 末) 2018年12月7日	5,285	△0.9		-		-		98.9	
第54期	(期 首) 2018年12月7日	5,225	-		-		-		98.9	
	12月末	5,022	△3.9		-		-		97.9	
	(期 末) 2019年1月7日	4,956	△5.1		-		-		99.1	
第55期	(期 首) 2019年1月7日	4,896	-		-		-		99.1	
	1月末	4,992	2.0		-		-		97.6	
	(期 末) 2019年2月7日	4,999	2.1		-		-		99.2	
第56期	(期 首) 2019年2月7日	4,939	-		-		-		99.2	
	2月末	5,023	1.7		-		-		98.1	
	(期 末) 2019年3月7日	5,003	1.3		-		-		97.7	
第57期	(期 首) 2019年3月7日	4,943	-		-		-		97.7	
	3月末	5,001	1.2		-		-		98.2	
	(期 末) 2019年4月8日	5,053	2.2		-		-		98.2	

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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

第52期～第57期：2018年10月10日～2019年4月8日

▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第 52 期 首	5,302円
第 57 期 末	4,993円
既払分配金	360円
騰 落 率	1.1%

(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさま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。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ1.1%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

オプション・プレミアム収入を獲得したことや豪州社債市況が上昇したこと等が基準価額の上昇要因となりました。

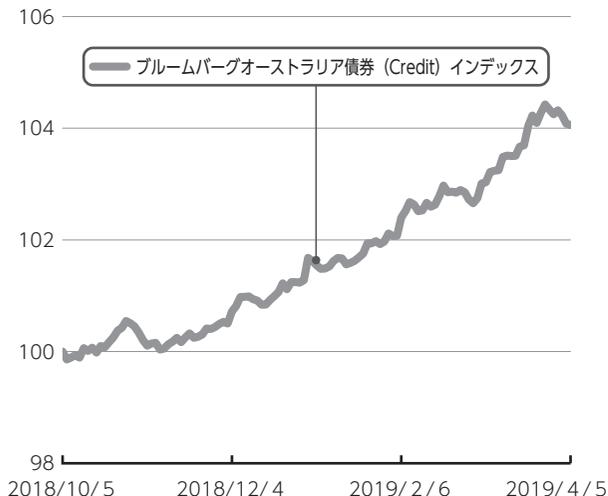
下落要因

豪ドルが対円で下落したこと等が基準価額の下落要因となりました。

第52期～第57期：2018年10月10日～2019年4月8日

投資環境について

債券市況の推移（当作成期首を100として指数化）



▶ 債券市況

豪州社債市況は上昇しました。債券市場では、米中貿易摩擦および英国の欧州連合（EU）離脱を巡る不透明感の高まり等を受け、投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、オーストラリア準備銀行のロウ総裁が同国の金融政策に関して、これまでの利上げ姿勢から中立姿勢への転換を示唆したこと等を受け、豪州金利は低下しました。こうした環境下、豪州金利が低下したことや債券利子収入を享受したこと等がプラスとなり、上昇しました。

（注）現地日付ベースで記載しております。

（注）ブルームバーク・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーク」と総称します。）は、三菱UFJ国際投信株式会社（以下、委託会社）の関係会社ではなく、当ファンドを承認し、是認し、レビューまたは推奨するものではありません。ブルームバークおよびブルームバークオーストラリア債券（Credit）インデックスは、ブルームバーク・ファイナンス・エル・ピーの商標またはサービスマークであり、委託会社に対してライセンスされています。ブルームバークは、ブルームバークオーストラリア債券（Credit）インデックスに関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

為替市況の推移（当作成期首を100として指数化、対円）



▶ 為替市況

消費を中心に豪州経済に減速感がみられたことや、豪州金利が低下し、日豪金利差が縮小したことなどから、豪ドルは対円で下落しました。

▶ 国内短期金融市場

当作成期の短期金融市場をみると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス圏で推移し、2019年4月8日のコール・レートは-0.063%となりました。

▶ 当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 三菱UFJ/AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド 豪ドル円プレミアム (毎月決算型)

外国投資信託であるAMP オーストラリア インカム ボンド ファンドを高位に組み入れた運用を行いました。また、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券を一部組み入れた運用を行いました。

▶ AMP オーストラリア インカム ボンド ファンド

基準価額は当作成期首に比べ1.6% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。

オーストラリアの企業が発行する普通社債および劣後債等のハイブリッド証券を高位に組み入れることに加え、円に対する豪ドルのコール・オプション売却によってオプション・プレミアム収入を獲得する通貨カバード・コール戦略を活用した運用を行いました。

豪州債券運用では、デュレーション (平均回収期間や金利感応度) については、2019年3月末において市場平均と比べて短めとしました。また、相対的に投資魅力度が高いと考えられるハイブリッド証券を組み入れる運用を継続しました。

前述のような運用を行った結果、豪ドルが対円で下落したこと等がマイナスとなったものの、オプション・プレミアム

収入を獲得したことや豪州社債市況が上昇したこと等がプラスとなり、基準価額 (分配金再投資ベース) は当作成期首と比べて上昇しました。

下記は、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドの資料（現地月末前営業日基準）に基づき作成したAMPオーストラリア インカム ボンド ファンドの債券部分の状況です。

■種別組入比率

2019年3月末

種別	比率
普通社債	76.1%
劣後債	23.9%
優先証券	0.0%
その他債券	0.0%
その他	0.0%

- ・比率は現物債券等評価額に対する割合です。
- ・その他債券は、国債等です。
- ・その他は、債券および優先証券以外の証券です。

■組入上位10業種

2019年3月末

	業種	比率
1	銀行	28.8%
2	不動産	20.7%
3	公益	19.4%
4	工業	11.4%
5	素材	6.1%
6	一般消費財・サービス	5.3%
7	通信サービス	3.6%
8	エネルギー	3.5%
9	保険	1.2%
10	－	－

- ・比率は現物債券等評価額に対する割合です。
- ・業種は、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドが債券の発行体企業等について独自に分類しています。

■債券格付分布

2019年3月末

格付種類	比率
AAA格	3.8%
AA格	12.1%
A格	23.4%
BBB格	58.3%
B格以下	0.4%
無格付	0.0%

- ・比率は円建外国投資信託の純資産総額に対する割合です。
- ・格付は、S & P、Moody's、Fitchのうち2番めに高い格付を表示しています。2社の格付のみの場合には、低い方の格付を表示、1社の格付のみの場合にはその格付を表示しています。
- ・上記3社の格付を取得していない場合は、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドが独自に判断した格付です。
- ・なお、付加記号（+、-等）を省略して集計し、S & Pの格付記号に基づき表示しています。

■ポートフォリオ特性

2019年3月末

	ファンド
最終利回り	2.9%
直接利回り	4.4%
デュレーション	3.6

- ・データはAMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドより提供された運用ポートフォリオベース（債券先物を含む）のものです。
- ・最終利回りとは、個別債券ごとの複利利回りを加重平均したものです。
- ・最終利回り、デュレーションは個別債券ごとに、繰上償還条項が付与されている銘柄は原則として直近の繰上償還予定日、それ以外は償還日を使用して計算しています。
- ・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基づくものであり、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。

下記は、クレディ・スイス・マネジメント（ケイマン）リミテッドの資料（現地月末前営業日基準）に基づき作成したAMP オーストラリア インカム ボンド ファンドの通貨オプション部分の状況です。

■ポートフォリオ特性

2019年3月末

オプション・プレミアム	7.9%
カバー率	97.7%
平均権利行使価格	101.9%
平均権利行使期間	31日

- ・オプション・プレミアムは、円建外国投資信託の純資産総額に対する年率調整後のプレミアム収入です。
- ・カバー率は、組入外貨建資産に対するオプションのポジションです。
- ・平均権利行使価格は、原資産価格（通貨）に対する権利行使価格の水準（現地月末前営業日基準）です。
- ・平均権利行使期間は、オプション権利行使日までの平均日数です。

▶マネー・マーケット・マザーファンド

基準価額は当作成期首に比べ横ばいとなりました。

コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。その結

果、利子等収益は積み上がったものの、運用資金に対するマイナス金利適用などの影響を受けて、基準価額は横ばいとなりました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

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、1万円当たり、税込み）

項目	第52期 2018年10月10日～ 2018年11月7日	第53期 2018年11月8日～ 2018年12月7日	第54期 2018年12月8日～ 2019年1月7日	第55期 2019年1月8日～ 2019年2月7日	第56期 2019年2月8日～ 2019年3月7日	第57期 2019年3月8日～ 2019年4月8日
当期分配金 （対基準価額比率）	60 (1.112%)	60 (1.135%)	60 (1.211%)	60 (1.200%)	60 (1.199%)	60 (1.187%)
当期の収益	60	59	58	56	55	55
当期の収益以外	—	0	1	3	4	4
翌期繰越分配対象額	291	291	290	286	282	278

（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（作成対象期間末での見解です。）

▶ 三菱UFJ／AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド 豪ドル円プレミアム（毎月決算型）

今後の運用方針

外国投資信託への投資を通じてオーストラリアの企業が発行する普通社債および劣後債等のハイブリッド証券を高位に組み入れることに加え、一部マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券の組み入れを維持します。

▶ AMP オーストラリア インカム ボンド ファンド

運用環境の見通し

豪州では住宅価格下落の影響が個人消費へと波及しつつあります。今後消費の減速が進み、雇用へも影響を及ぼすことになれば、中央銀行が利下げを実施する可能性もあると考えます。社債市場については、豪州における健全な企業財務状況や堅調な経済指標等が市場を下支えするとみられる一方、足下にかけて市場のボラティリティが高まっていること等には注意を要すると考えます。また、米国の貿易政策における不透明感や地政学的リスクの高まり等は、今後のリスク要因となると考えます。

今後の運用方針

債券種別については、引き続き相対的に魅力度が高いと考えられるハイブリッド証券を組み入れる方針です。ファンドのデュレーションについては、債券先物を適宜活用しつつ市場環境に応じて機動的に調整する方針です。

円に対する豪ドルのコール・オプション売却によってオプション・プレミアム収入を獲得する通貨力バード・コール戦略を活用した運用を行います。

▶ マネー・マーケット・マザーファンド

運用環境の見通し

物価は緩やかに上昇していくと予想していますが、日銀の物価目標である2%には届かないと思われる。したがって、今後も金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は低位で推移すると予想しています。

今後の運用方針

コール・ローンおよびCP現先取引等への投資を通じて、安定した収益の確保をめざした運用を行う方針です。

2018年10月10日～2019年4月8日

1万口当たりの費用明細

項目	第52期～第57期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	27	0.532	(a) 信託報酬 = 作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (作成期中の日数 ÷ 年間日数)
（投信会社）	(10)	(0.198)	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）	(16)	(0.321)	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）	(1)	(0.013)	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	0	0.002	(b) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数
（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）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	27	0.534	

作成期中の平均基準価額は、5,125円です。

(注) 作成期間の費用（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) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

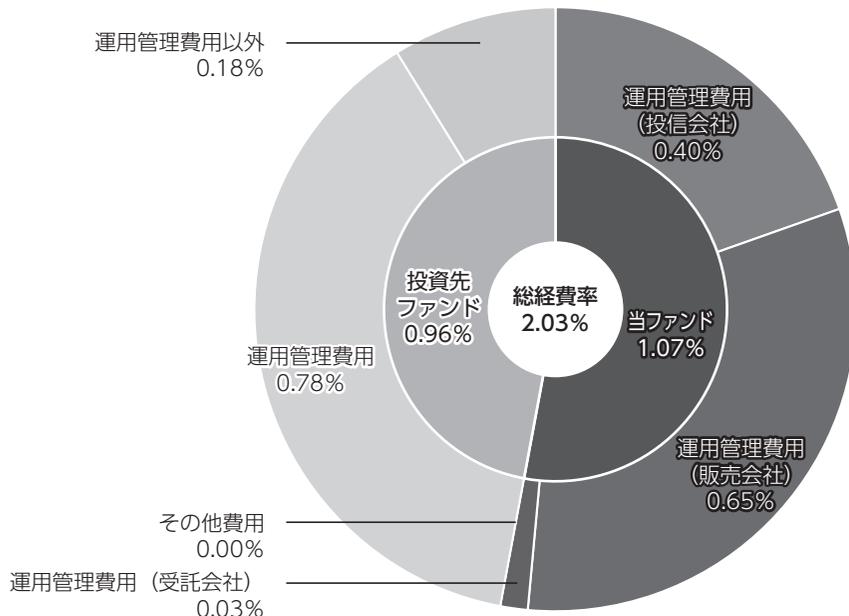
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(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）を作成期間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

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成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2.03%**です。



総経費率 (①+②+③)	(%)	2.03
①当ファンドの費用の比率	(%)	1.07
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	(%)	0.78
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	(%)	0.18

(注) ①の費用は、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) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及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) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 前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

(2018年10月10日～2019年4月8日)

投資信託証券

銘柄		第52期～第57期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	AMP オーストラリア インカム ボンド ファンド	千口 54	千円 266,765	千口 96	千円 478,500

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2018年10月10日～2019年4月8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4月8日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄		第51期末		第57期末	
		口数	金額	口数	評価額
	AMP オーストラリア インカム ボンド ファンド	千口 756	千円 713	千円 3,468,675	% 98.2
	合計	756	713	3,468,675	98.2

(注) 比率は三菱UFJ/AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド 豪ドル円プレミアム (毎月決算型) の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

銘柄		第51期末		第57期末	
		口数	金額	口数	評価額
	マネー・マーケット・マザーファンド	千口 5,899	千円 5,899	千円 5,899	千円 6,007

○投資信託財産の構成

(2019年4月8日現在)

項 目	第57期末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 3,468,675	% 96.6
マネー・マーケット・マザーファンド	6,007	0.2
コール・ローン等、その他	116,877	3.2
投資信託財産総額	3,591,559	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第52期末	第53期末	第54期末	第55期末	第56期末	第57期末
	2018年11月7日現在	2018年12月7日現在	2019年1月7日現在	2019年2月7日現在	2019年3月7日現在	2019年4月8日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	3,988,316,568	3,860,590,598	3,574,937,321	3,591,269,781	3,583,002,801	3,591,559,670
コール・ローン等	98,852,711	109,457,895	70,735,129	68,237,991	65,654,149	116,877,525
投資信託受益証券(評価額)	3,883,456,786	3,745,125,632	3,498,195,121	3,517,024,719	3,448,541,581	3,468,675,074
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	6,007,071	6,007,071	6,007,071	6,007,071	6,007,071	6,007,071
未収入金	—	—	—	—	62,800,000	—
(B) 負債	63,715,110	72,438,262	46,644,497	46,345,083	52,384,140	58,161,988
未払収益分配金	44,145,752	43,499,275	43,241,952	43,068,190	42,852,414	42,460,723
未払解約金	16,210,603	25,461,001	—	—	6,578,658	12,351,411
未払信託報酬	3,348,391	3,467,245	3,392,032	3,266,887	2,944,138	3,339,593
未払利息	246	206	61	108	63	202
その他未払費用	10,118	10,535	10,452	9,898	8,867	10,059
(C) 純資産総額(A-B)	3,924,601,458	3,788,152,336	3,528,292,824	3,544,924,698	3,530,618,661	3,533,397,682
元本	7,357,625,441	7,249,879,210	7,206,992,000	7,178,031,762	7,142,069,005	7,076,787,288
次期繰越損益金	△3,433,023,983	△3,461,726,874	△3,678,699,176	△3,633,107,064	△3,611,450,344	△3,543,389,606
(D) 受益権総口数	7,357,625,441口	7,249,879,210口	7,206,992,000口	7,178,031,762口	7,142,069,005口	7,076,787,288口
1万口当たり基準価額(C/D)	5.334円	5.225円	4.896円	4.939円	4.943円	4.993円

○損益の状況

項 目	第52期	第53期	第54期	第55期	第56期	第57期
	2018年10月10日～ 2018年11月7日	2018年11月8日～ 2018年12月7日	2018年12月8日～ 2019年1月7日	2019年1月8日～ 2019年2月7日	2019年2月8日～ 2019年3月7日	2019年3月8日～ 2019年4月8日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	46,520,069	46,791,680	45,727,351	42,497,635	42,387,875	41,327,523
受取配当金	46,522,417	46,793,888	45,729,972	42,499,570	42,389,400	41,330,205
受取利息	-	3	-	-	10	-
支払利息	△ 2,348	△ 2,211	△ 2,621	△ 1,935	△ 1,535	△ 2,682
(B) 有価証券売買損益	24,724,508	△ 78,788,877	△ 236,533,112	34,576,345	6,869,493	39,466,373
売買益	25,679,480	153,124	197,982	34,814,259	7,172,566	39,626,570
売買損	△ 954,972	△ 78,942,001	△ 236,731,094	△ 237,914	△ 303,073	△ 160,197
(C) 信託報酬等	△ 3,358,509	△ 3,477,747	△ 3,402,484	△ 3,276,725	△ 2,953,005	△ 3,349,652
(D) 当期繰越損益 (A+B+C)	67,886,068	△ 35,474,944	△ 194,208,245	73,797,255	46,304,363	77,444,244
(E) 前期繰越損益	△3,161,147,050	△3,083,460,096	△3,135,284,585	△3,344,274,182	△3,287,366,497	△3,240,043,365
(F) 追加信託差損益金	△ 295,617,249	△ 299,292,559	△ 305,964,394	△ 319,561,947	△ 327,535,796	△ 338,329,762
(配当等相当額)	(100,972,389)	(99,783,741)	(99,490,861)	(99,638,887)	(99,447,688)	(98,970,744)
(売買損益相当額)	(△ 396,589,638)	(△ 399,076,300)	(△ 405,455,255)	(△ 419,200,834)	(△ 426,983,484)	(△ 437,300,506)
(G) 計 (D+E+F)	△3,388,878,231	△3,418,227,599	△3,635,457,224	△3,590,038,874	△3,568,937,930	△3,500,928,883
(H) 収益分配金	△ 44,145,752	△ 43,499,275	△ 43,241,952	△ 43,068,190	△ 42,852,414	△ 42,460,723
次期繰越損益金 (G+H)	△3,433,023,983	△3,461,726,874	△3,678,699,176	△3,633,107,064	△3,611,450,344	△3,543,389,606
追加信託差損益金	△ 295,617,249	△ 299,292,559	△ 305,964,394	△ 319,561,947	△ 327,535,796	△ 338,329,762
(配当等相当額)	(100,972,389)	(99,783,741)	(99,490,861)	(99,638,887)	(99,447,688)	(98,970,744)
(売買損益相当額)	(△ 396,589,638)	(△ 399,076,300)	(△ 405,455,255)	(△ 419,200,834)	(△ 426,983,484)	(△ 437,300,506)
分配準備積立金	113,548,473	111,410,696	109,537,134	106,235,436	102,390,505	98,176,055
繰越損益金	△3,250,955,207	△3,273,845,011	△3,482,271,916	△3,419,780,553	△3,386,305,053	△3,303,235,899

(注) (B) 有価証券売買損益は各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) (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。

<注記事項>

①作成期首(前作成期末)元本額 7,430,697,518円

 作成期中追加設定元本額 141,314,815円

 作成期中一部解約元本額 495,225,045円

また、1口当たり純資産額は、作成期末0.4993円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は3,543,389,606円です。

③分配金の計算過程

項 目	2018年10月10日～ 2018年11月7日	2018年11月8日～ 2018年12月7日	2018年12月8日～ 2019年1月7日	2019年1月8日～ 2019年2月7日	2019年2月8日～ 2019年3月7日	2019年3月8日～ 2019年4月8日
費用控除後の配当等収益額	44,326,950円	43,313,925円	42,324,858円	40,690,814円	39,846,795円	39,614,150円
費用控除後・繰越大損金補填後の有価証券売買等損益額	－円	－円	－円	－円	－円	－円
収益調整金額	100,972,389円	99,783,741円	99,490,861円	99,638,887円	99,447,688円	98,970,744円
分配準備積立金額	113,367,275円	111,596,046円	110,454,228円	108,612,812円	105,396,124円	101,022,628円
当ファンドの分配対象収益額	258,666,614円	254,693,712円	252,269,947円	248,942,513円	244,690,607円	239,607,522円
1万口当たり収益分配対象額	351円	351円	350円	346円	342円	338円
1万口当たり分配金額	60円	60円	60円	60円	60円	60円
収益分配金金額	44,145,752円	43,499,275円	43,241,952円	43,068,190円	42,852,414円	42,460,723円

○分配金のお知らせ

	第52期	第53期	第54期	第55期	第56期	第57期
1 万口当たり分配金（税込み）	60円	60円	60円	60円	60円	60円

◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに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（<https://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。

＜参考＞投資する投資信託証券およびその概要

ファンド名	AMP オーストラリア インカム ボンド ファンド
運用方針	主としてオーストラリアの企業が発行する普通社債、劣後債および優先証券等に投資することにより、資産の中長期的な成長をめざします。また、原則として円に対する豪ドルのコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得をめざします。
主要運用対象	オーストラリアの企業が発行する普通社債、劣後債および優先証券等、ならびに円に対する豪ドルのコール・オプション取引
主な組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・オーストラリアの国債、準国債等に投資する場合があります。 ・豪ドル以外の通貨建て債券等に投資した場合は、原則として、豪ドル以外の通貨売り、豪ドル買いの為替取引を行います。 ・同一の発行体が発行する銘柄への投資比率は、純資産総額の10%以内とします（国債や準国債等を除きます。）。 ・デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。 ・対円での為替ヘッジは行いません。
決算日	毎年10月31日
分配方針	原則として毎月分配を行う方針です。

運用計算書、純資産変動計算書、投資有価証券明細表はAUDITED ANNUAL REPORT OCTOBER 31, 2018版から抜粋して作成しています。

(1) 運用計算書

AMP オーストラリア インカム ボンド ファンド

(2017年11月1日～2018年10月31日)

	AMP オーストラリア インカム ボンド ファンド
	円
投資収入：	
預金金利	999,925
社債利息	233,461,855
仲介入金金利	244,013
	234,705,793
費用：	
管理費用、保管費用	(6,092,943)
支払利息	(125,983)
代行費用、マネージャー費用	(9,731,638)
その他費用	(4,991,097)
監査報酬	(1,828,480)
副マネージャー費用	(21,436,574)
副保管費用	(1,486,851)
先物取引費用	(504,637)
受託費用	(1,222,668)
	(47,420,871)
投資純収入	187,284,922
実現純利益（損失）：	
投資有価証券	(339,531,794)
その他資産、負債の外貨換算	(15,516,332)
為替予約	(51,281,351)
先物取引	24,450,346
オプション	66,951,762
当期実現純利益（損失）	(314,927,369)
未実現評価益（評価損）の純変動：	
投資有価証券	(96,540,411)
為替予約	10,991,292
その他資産、負債の外貨換算	(190,386)
先物	(6,102,132)
オプション	(15,898,109)
	(107,739,746)
運用による純資産の純増（減）額	(235,382,193)

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(2) 純資産変動計算書

AMP オーストラリア インカム ボンド ファンド
(2017年11月1日～2018年10月31日)

	AMP オーストラリア インカム ボンド ファンド
	円
期首純資産	6,379,622,639
投資純収入	187,284,922
実現純利益（損失）：	
投資有価証券	(339,531,794)
その他資産、負債の外貨換算 為替予約	(15,516,332)
先物取引	(51,281,351)
オプション	24,450,346
	66,951,762
	(314,927,369)
未実現評価益（評価損）の純変動：	
投資有価証券	(96,540,411)
為替予約	10,991,292
その他資産、負債の外貨換算	(190,386)
先物	(6,102,132)
オプション	(15,898,109)
	(107,739,746)
出資	723,337,196
償還	(2,252,500,000)
分配金額	(723,337,196)
	(2,252,500,000)
期末純資産	3,891,740,446

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(3) 投資有価証券明細表 (the Schedule of Investments)
 AMP オーストラリア インカム ボンド ファンド
 (2018年10月31日現在)

銘柄	通貨	額面	取得原価	市場価格	対純資産 比率(%)
I. TRANSFERABLE SECURITIES ADMITTED TO AN OFFICIAL STOCK EXCHANGE OR DEALT IN ON ANOTHER REGULATED MARKET					
BONDS					
<i>AUSTRALIA</i>					
APT PIPELINES LTD 7.75% 07/22/2020	AUD	500,000	54,589,323	43,190,830	1.11%
AUSNET SERVICES HOLDINGS PTY LTD FRN 03/17/2076	USD	1,000,000	112,277,347	116,695,452	3.00%
AUSNET SERVICES HOLDINGS PTY LTD 4.2% 08/21/2028	AUD	500,000	42,315,175	40,547,293	1.04%
AUSNET SERVICES HOLDINGS PTY LTD 7.5% 04/01/2021	AUD	1,300,000	144,270,077	115,104,706	2.96%
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD FRN 05/13/2027	AUD	2,100,000	189,736,807	172,303,813	4.43%
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 3.1% 01/18/2023	AUD	800,000	70,740,703	64,115,483	1.65%
BHP BILLITON FINANCE USA LTD FRN 10/19/2075	USD	1,950,000	228,249,356	228,775,306	5.88%
BRISBANE AIRPORT CORP PTY LTD 6% 10/21/2020	AUD	1,440,000	149,029,098	122,089,450	3.14%
CROWN RESORTS LTD FRN 04/23/2075	AUD	2,518	22,958,281	20,744,684	0.53%
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD FRN 03/26/2025	AUD	1,800,000	159,778,301	145,345,411	3.73%
SUNCORP GROUP LTD FRN 11/22/2023	AUD	5,000	40,695,772	40,322,933	1.04%
WESTPAC BANKING CORP FRN 03/11/2027	AUD	2,340,000	207,222,792	190,328,114	4.89%
WESTPAC BANKING CORP 3.2% 03/06/2023	AUD	1,700,000	140,034,876	136,619,335	3.51%
WOODSIDE FINANCE LTD 4.6% 05/10/2021	USD	275,000	32,264,049	31,437,649	0.81%
			1,594,161,957	1,467,620,459	37.72%
TOTAL I.			1,594,161,957	1,467,620,459	37.72%
II. SECURITIES NOT ADMITTED ON ANY REGULATED MARKET					
BONDS					
<i>AUSTRALIA</i>					
AGL ENERGY LTD 5% 11/05/2021	AUD	1,600,000	152,985,044	133,908,051	3.44%
AIRPORT MOTORWAY TRUST 5.5% 12/09/2020	AUD	600,000	60,296,445	50,350,855	1.29%
ALE DIRECT PROPERTY TRUST 5% 08/20/2020	AUD	1,600,000	156,609,714	130,886,500	3.36%
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 3.35% 05/09/2023	AUD	500,000	41,149,143	40,398,919	1.04%
AUSTRALIAN CATHOLIC UNIVERSITY LTD 3.7% 08/03/2027	AUD	500,000	44,165,126	40,679,670	1.05%
BRISBANE AIRPORT CORP PTY LTD 3.9% 04/24/2025	AUD	500,000	41,505,470	40,374,124	1.04%
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 3.2% 08/16/2023	AUD	500,000	40,435,304	40,052,580	1.03%
CONNECTEAST FINANCE PTY LTD 5.75% 09/02/2020	AUD	1,100,000	110,927,180	92,560,657	2.38%
DBNGP FINANCE CO PTY LTD 4.225% 05/28/2025	AUD	500,000	41,605,604	40,632,879	1.03%
DBNGP FINANCE CO PTY LTD 6% 10/11/2019	AUD	500,000	50,746,727	40,488,104	1.04%
DEXUS WHOLESALE PROPERTY FUND 4.25% 06/16/2022	AUD	1,800,000	171,727,621	147,581,334	3.79%
DOWNER GROUP FINANCE PTY LTD 4.5% 03/11/2022	AUD	1,200,000	111,089,099	98,638,072	2.53%
ENERGY PARTNERSHIP GAS PTY LTD 3.642% 12/11/2024	AUD	500,000	42,476,340	39,811,023	1.02%
ENERGY PARTNERSHIP GAS PTY LTD 4.25% 06/15/2020	AUD	1,400,000	133,330,428	113,308,461	2.91%
GENERAL PROPERTY TRUST 3.591% 11/07/2023	AUD	1,000,000	79,911,321	80,461,898	2.07%
GPT RE LTD 3.6725% 09/19/2024	AUD	500,000	39,707,697	39,925,003	1.03%
MACQUARIE BANK LTD 4.875% 06/10/2025	USD	200,000	21,943,127	22,286,153	0.57%
MIRVAC GROUP FINANCE LTD 5.75% 09/18/2020	AUD	800,000	82,137,544	67,244,534	1.73%

銘柄	通貨	額面	取得原価	市場価格	対純資産 比率(%)
II. SECURITIES NOT ADMITTED ON ANY REGULATED MARKET (continued)					
<i>AUSTRALIA (continued)</i>					
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 3% 10/21/2021	AUD	600,000	49,036,010	48,268,500	1.24%
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 5% 03/11/2024	AUD	1,500,000	141,079,106	131,494,554	3.38%
PACIFIC NATIONAL FINANCE PTY LTD 5.4% 05/12/2027	AUD	500,000	41,679,856	41,575,513	1.07%
QANTAS AIRWAYS LTD 7.5% 06/11/2021	AUD	1,410,000	129,546,092	124,840,952	3.21%
SCENTRE GROUP TRUST 1 4.5% 09/08/2021	AUD	1,300,000	124,996,642	107,785,429	2.77%
SGSP AUSTRALIA ASSETS PTY LTD 5.5% 03/12/2021	AUD	1,600,000	158,906,116	135,680,540	3.49%
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY RETAIL TRUST 3.9% 06/07/2024	AUD	500,000	41,055,068	39,693,843	1.02%
SUNCORP GROUP LTD FRN 12/05/2028	AUD	500,000	40,714,767	40,470,907	1.04%
SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD 3.9% 03/22/2023	USD	390,000	40,527,096	43,826,830	1.13%
TELSTRA CORP LTD 4% 09/16/2022	AUD	1,500,000	125,503,631	123,610,735	3.18%
UNITED ENERGY DISTRIBUTION PTY LTD 3.5% 09/12/2023	AUD	500,000	38,896,782	40,267,343	1.03%
UNITED ENERGY DISTRIBUTION PTY LTD 3.85% 10/23/2024	AUD	500,000	43,520,677	40,574,889	1.04%
WSO FINANCE PTY LTD 4.5% 03/31/2027	AUD	500,000	41,890,760	41,439,937	1.06%
			2,440,101,537	2,219,118,789	57.01%
<i>UNITED STATES OF AMERICA</i>					
GOODMAN US FINANCE ONE LLC 6.375% 04/15/2021	USD	825,000	98,288,212	98,539,747	2.53%
			98,288,212	98,539,747	2.53%
TOTAL II.			2,538,389,749	2,317,658,536	59.54%
TOTAL INVESTMENTS IN SECURITIES			4,132,551,706	3,785,278,995	97.26%
CASH AT BANKS				60,464,783	1.55%
CASH AT BROKERS				11,151,383	0.29%
UNREALIZED APPRECIATION ON FORWARD FOREIGN EXCHANGE CONTRACTS				731,007	0.02%
UNREALIZED DEPRECIATION ON FORWARD FOREIGN EXCHANGE CONTRACTS				(3,283,329)	-0.08%
UNREALIZED APPRECIATION ON FUTURES CONTRACTS				3,052,380	0.08%
UNREALIZED DEPRECIATION ON FUTURES CONTRACTS				(1,207,599)	-0.03%
INVESTMENTS IN OPTIONS				-	0.00%
OTHER NET ASSETS				35,552,826	0.91%
TOTAL NET ASSETS				3,891,740,446	100.00%

マネー・マーケット・マザーファンド

《第28期》決算日2018年11月20日

[計算期間：2018年5月22日～2018年11月20日]

「マネー・マーケット・マザーファンド」は、11月20日に第28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28期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主要運用対象	わが国の公社債等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は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率	債組入比率	債券先物比率	純資産額
24期(2016年11月21日)	10,184	0.0	24.4	—	4,420
25期(2017年5月22日)	10,184	0.0	—	—	1,681
26期(2017年11月20日)	10,184	0.0	—	—	1,266
27期(2018年5月21日)	10,184	0.0	—	—	1,269
28期(2018年11月20日)	10,183	△0.0	—	—	1,882

(注) 当ファンドは主として短期債券、コール・ローンなどによる運用を行い、安定的な収益の確保をめざすファンドであり、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○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	債券先物比率
(期首) 2018年5月21日	10,184	—	—	—
5月末	10,184	0.0	—	—
6月末	10,184	0.0	—	—
7月末	10,184	0.0	—	—
8月末	10,184	0.0	—	—
9月末	10,183	△0.0	—	—
10月末	10,183	△0.0	—	—
(期末) 2018年11月20日	10,183	△0.0	—	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

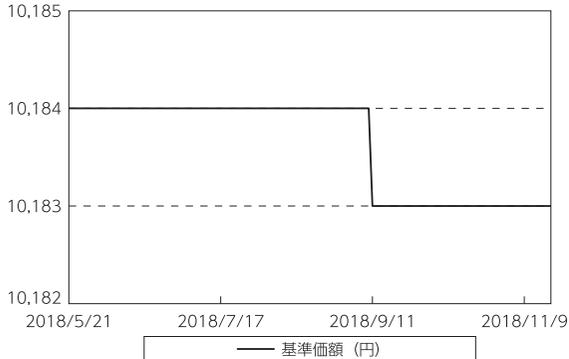
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.01%の下落となりました。

基準価額等の推移



●投資環境について

◎国内短期金融市場

- ・当期の短期金融市場をみると、日銀は長短金利を操作目標として金融市場調整を行いました。コール・レート（無担保・翌日物）はマイナス圏で推移し、2018年11月20日のコール・レートは-0.066%となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。その結果、利子等収益は積み上がったものの、運用資金に対するマイナス金利適用などの影響を受けて、基準価額は下落となりました。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・物価は緩やかに上昇していくと予想していますが、日銀の物価目標である2%には届かないと思われます。したがって、今後も金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は低位で推移すると予想しています。

◎今後の運用方針

- ・コール・ローンおよびCP現先取引等への投資を通じて、安定した収益の確保をめざした運用を行う方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2018年5月22日～2018年11月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、10,183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

(2018年5月22日～2018年11月20日)

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 164,899,918	千円 164,299,921

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2018年5月22日～2018年11月20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

(2018年11月20日現在)

国内その他有価証券

区 分	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 1,799,999	% 95.6

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

○投資信託財産の構成

(2018年11月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
その他有価証券	千円 1,799,999	% 95.6
コール・ローン等、その他	82,984	4.4
投資信託財産総額	1,882,983	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年11月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,882,983,572
コール・ローン等	82,984,049
其他有価証券(評価額)	1,799,999,523
(B) 負債	140,959
未払解約金	140,557
未払利息	167
其他未払費用	235
(C) 純資産総額(A-B)	1,882,842,613
元本	1,848,959,925
次期繰越損益金	33,882,688
(D) 受益権総口数	1,848,959,925口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,183円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,246,790,223円
 期中追加設定元本額 891,597,773円
 期中一部解約元本額 289,428,071円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0183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)

三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンド	334,544,012円
三菱UFJ 新興国通貨建て債券ファンド(毎月決算型)	2,280,337円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	5,874,002円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	1,048,688円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース>(毎月分配型)	111,354円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	20,147,276円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	52,804,813円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>(毎月分配型)	635,856円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(毎月分配型)	3,078,471円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	149,179,043円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<中国元コース>(毎月分配型)	89,620円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<インドネシアルピアコース>(毎月分配型)	1,033,322円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	212,322円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型)	16,402,315円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド(毎月分配型)	2,272,200円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース>(毎月分配型)	15,211,722円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	270,734円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	358,088円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	667,045円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	3,836,590円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	275,663円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	1,049,877円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	5,850,843円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	2,016,707円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	1,970,066円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	43,682,881円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	1,513,806円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<アジアバスケット通貨コース>(毎月分配型)	1,182,898円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	84,006,970円

○損益の状況 (2018年5月22日~2018年11月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 29,356
受取利息	3,679
支払利息	△ 33,035
(B) 保管費用等	△ 235
(C) 当期損益金(A+B)	△ 29,591
(D) 前期繰越損益金	22,896,956
(E) 追加信託差損益金	16,324,880
(F) 解約差損益金	△ 5,309,557
(G) 計(C+D+E+F)	33,882,688
次期繰越損益金(G)	33,882,688

(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。

三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	847, 016円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース> (毎月分配型)	600, 566円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	992, 946円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	1, 979, 971円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース> (毎月分配型)	140, 355円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド>	990, 683円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド ユーロ円プレミアム (毎月分配型)	19, 635, 282円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり)	6, 336, 371円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし)	11, 400, 264円
三菱UFJ 米国リートファンドA<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	491, 836円
三菱UFJ 米国リートファンドB<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	98, 368円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (毎月分配型)	12, 561, 714円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド (年2回分配型)	50, 290円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド (年2回分配型)	99, 465円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (年2回分配型)	69, 757円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース> (年2回分配型)	30, 457円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (年2回分配型)	641, 668円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	1, 559, 264円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	4, 881, 309円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	19, 658円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	19, 658円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	19, 658円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	491, 449円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9, 828, 976円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	7, 717, 476円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	348, 598円
バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	1, 936, 118円
バリュー・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9, 829円
バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	9, 829円
バリュー・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	9, 829円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	5, 504, 257円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	13, 128, 307円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	2, 424, 660円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	9, 340, 694円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	3, 123, 514円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	6, 722, 976円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルールコース> (毎月分配型)	13, 206, 980円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (年2回分配型)	2, 304, 081円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (年2回分配型)	4, 117, 720円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (年2回分配型)	421, 681円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (年2回分配型)	961, 645円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (年2回分配型)	608, 110円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (年2回分配型)	734, 038円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルールコース> (年2回分配型)	1, 043, 194円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドA>	37, 783, 200円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドB>	979, 528円
三菱UFJ /ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (毎月決算型)	5, 144, 832円
三菱UFJ /ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	8, 859, 081円
三菱UFJ /ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (年1回決算型)	1, 609, 969円
三菱UFJ /ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	2, 065, 331円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Cコース (為替ヘッジなし) (年1回決算型)	40, 261円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Dコース (為替ヘッジあり) (年1回決算型)	50, 083円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (毎月分配型)	3, 828, 727円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし> (毎月分配型)	9, 387, 547円

三菱UFJ/ビムコ トータル・リターン・ファンド2014	109,051円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	3,545,187円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	8,124,755円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり> (年1回決算型)	2,990,177円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	3,377,211円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (毎月分配型)	8,478,079円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (年2回分配型)	4,145,749円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (毎月分配型)	8,067,104円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (年2回分配型)	3,319,056円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	20,075,917円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	1,616,484円
三菱UFJ/AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド 豪ドル円プレミアム (毎月決算型)	5,899,118円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム (毎月分配型)	10,826,836円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム (年2回分配型)	2,026,238円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (毎月分配型)	128,636円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (年2回分配型)	79,540円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム> (毎月分配型)	1,375,824円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム> (年2回分配型)	698,261円
マルチストラテジー・ファンド (ラップ向け)	491,015円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	564,702円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	89,371円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	983円
三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<米ドル投資型> (3ヵ月決算型)	3,063,931円
三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	6,324,266円
三菱UFJ ターゲット・イヤール・ファンド2030 (確定拠出年金)	2,399,448円
マクロ・トータル・リターン・ファンド	9,820円
スマート・プロテクター90 (限定追加型) 2016-12	6,313,826円
米国政策テーマ株式オープン (為替ヘッジあり)	412,412円
米国政策テーマ株式オープン (為替ヘッジなし)	1,188,139円
スマート・プロテクター90オープン	981,933円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (資産成長型)	609,781円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし> (資産成長型)	305,382円
テンブルトン新興国小型株ファンド	49,097円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり> (毎月決算型)	3,683,229円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり> (年2回決算型)	17,656,128円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	5,843,481円
ビムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし> (年2回決算型)	25,393,755円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり) (年1回決算型)	36,457円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし) (年1回決算型)	87,384円
わたしの未来設計<安定重視型> (分配コース)	9,820円
わたしの未来設計<安定重視型> (分配抑制コース)	9,820円
わたしの未来設計<成長重視型> (分配コース)	9,820円
わたしの未来設計<成長重視型> (分配抑制コース)	9,820円
北欧小型株ファンド (為替ヘッジあり)	9,821円
北欧小型株ファンド (為替ヘッジなし)	9,821円
N a v i o インド債券ファンド	296,406円
N a v i o マネーボールファンド	5,223,339円
三菱UFJ インド債券オープン (毎月決算型)	39,351円
三菱UFJ/AMP オーストラリアREITファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	11,293,333円
マネーボールファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定)	9,988,373円
MUAMトピックスリスクコントロール (5%) インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家限定)	6,042,045円

ビムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド（毎月分配型）	11,784,347円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Aコース（為替ヘッジなし）	10,766,608円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース（為替ヘッジあり）	21,620,196円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2020	417,607,779円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2020	225,031,917円
合計	1,848,959,925円