

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、FTSE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> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）</p> </div>	

※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6期（決算日：2022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6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
 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）

お客様の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。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

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5期の運用実績

決算期	基準価額			FTSEオーストラリア 国債インデックス		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額		
	(分配落)	税 分	込 配	み 金	期 騰				中 落	率
	円		円		率			百万円		
2期(2018年1月26日)	11,238		0		4.4	139,360.82	5.3	97.5	—	219
3期(2019年1月28日)	10,637		0		△5.3	132,822.81	△4.7	98.1	—	277
4期(2020年1月27日)	10,904		0		2.5	137,334.11	3.4	98.1	—	373
5期(2021年1月26日)	11,831		0		8.5	150,271.06	9.4	98.5	—	256
6期(2022年1月26日)	11,458		0		△3.2	146,684.20	△2.4	98.8	—	274

(注) FTSEオーストラリア国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。FTSEオーストラリア国債インデックス（円換算ベース）とは、FTSE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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 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
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2021年 1 月26日	円 11,831	% —	150,271.06	% —	% 98.5	% —
1 月末	11,871	0.3	150,835.24	0.4	98.6	—
2 月末	11,889	0.5	150,989.13	0.5	97.5	—
3 月末	12,038	1.7	152,957.50	1.8	98.0	—
4 月末	12,183	3.0	154,993.68	3.1	98.6	—
5 月末	12,188	3.0	155,143.83	3.2	99.0	—
6 月末	12,085	2.1	154,031.42	2.5	98.8	—
7 月末	12,044	1.8	153,557.83	2.2	98.1	—
8 月末	11,938	0.9	152,335.91	1.4	98.3	—
9 月末	11,718	△1.0	149,615.05	△0.4	98.3	—
10 月末	12,106	2.3	154,633.31	2.9	98.1	—
11 月末	11,611	△1.9	148,496.43	△1.2	98.7	—
12 月末	12,065	2.0	154,373.21	2.7	99.3	—
(期 末) 2022年 1 月26日	11,458	△3.2	146,684.20	△2.4	98.8	—

(注) 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6期：2021年1月27日～2022年1月26日

▶ 当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第6期首	11,831円
第6期末	11,458円
既払分配金	0円
騰落率	-3.2%

※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

基準価額は期首に比べ3.2%の下落となりました。

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（-2.4%）を0.8%下回りました。

基準価額の主な変動要因**下落要因**

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

第6期：2021年1月27日～2022年1月26日

投資環境について

▶ 債券市況

豪州の債券市況は下落しました。

豪州の債券市況は、期の中頃には新型コロナウイルス感染再拡大によるリスク回避的な動きが高まったことなどから上昇する局面もありましたが、世界的な経済回復期待やインフレ懸念による金利上昇などにより、期首との比較では下落しました。

▶ 為替市況

豪ドルは対円で上昇しました。

期首に比べて豪ドルは対円で上昇しました。

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

資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

▶ 豪州債券インデックスマザーファンド

豪州の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE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。

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

▶ eMAXIS 豪州債券インデックス

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.8\%$ 程度となりました。

マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は $\Delta 0.7\%$ 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 $\Delta 0.1\%$ 程度でした。

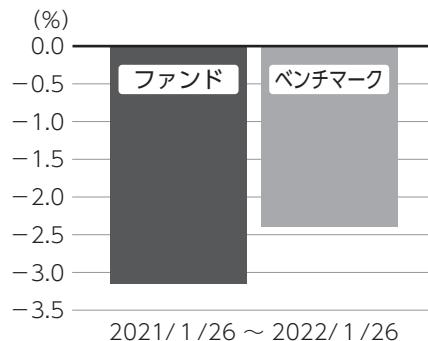
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：評価時価差異要因^{*}によるものです。

^{*}ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

主なマイナス要因：ポートフォリオ要因によるものです。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



▶ 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6期 2021年1月27日～2022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	2,441

(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。)

▶ eMAXIS 豪州債券インデックス
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ 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。

2021年1月27日～2022年1月26日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a)信託報酬	79	0.660	(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）	(36)	(0.297)	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）	(36)	(0.297)	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）	(8)	(0.066)	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	27	0.225	(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）	(26)	(0.219)	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)	(0.004)	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)	(0.002)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	106	0.885	

期中の平均基準価額は、11,962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。

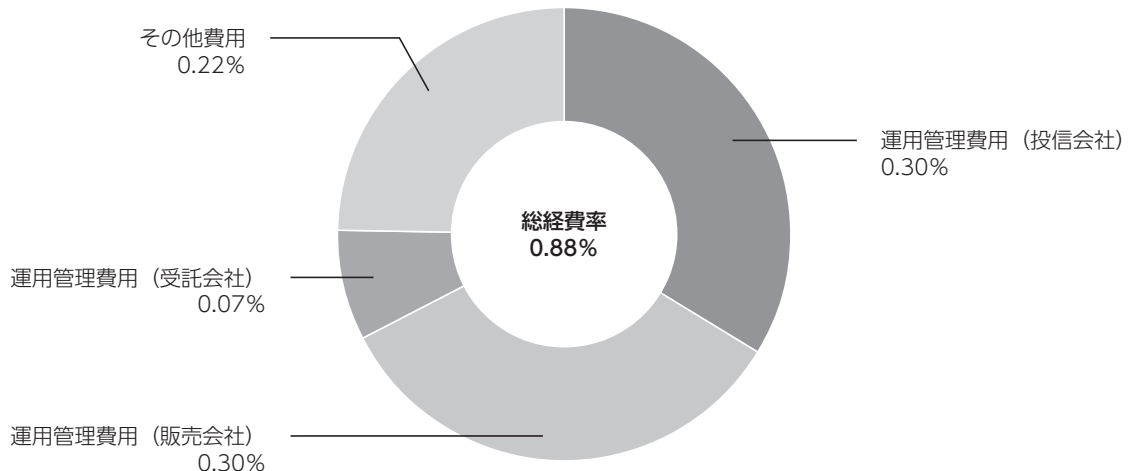
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

(参考情報)

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及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0.88%**です。



(注) 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) 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

(2021年1月27日～2022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 111,276	千円 138,290	千口 90,593	千円 111,852

○利害関係人との取引状況等

(2021年1月27日～2022年1月26日)

利害関係人との取引状況

<eMAXIS 豪州債券インデックス>

該当事項はございません。

<豪州債券インデックスマザーファンド>

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$

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UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2022年1月26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
豪州債券インデックスマザーファンド	千口 210,387	千口 231,069	千円 274,649

○投資信託財産の構成

(2022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 274,649	% 99.6
コール・ローン等、その他	1,185	0.4
投資信託財産総額	275,834	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(272,995千円)の投資信託財産総額(276,391千円)に対する比率は98.8%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=81.45円		
--------------------	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	275,834,723
コール・ローン等	1,185,059
豪州債券インデックスマザーファンド(評価額)	274,649,664
(B) 負債	1,112,286
未払解約金	117,001
未払信託報酬	989,409
その他未払費用	5,876
(C) 純資産総額(A-B)	274,722,437
元本	239,762,969
次期繰越損益金	34,959,468
(D) 受益権総口数	239,762,969口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,458円

<注記事項>

①期首元本額	216,857,988円
期中追加設定元本額	158,949,934円
期中一部解約元本額	136,044,953円
また、1口当たり純資産額は、期末1,1458円です。	

②分配金の計算過程

項 目	2021年1月27日～ 2022年1月26日
費用控除後の配当等収益額	4,572,474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	－円
収益調整金額	40,935,391円
分配準備積立金額	13,026,104円
当ファンドの分配対象収益額	58,533,969円
1万口当たり収益分配対象額	2,441円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

*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。

○損益の状況 (2021年1月27日～2022年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 56
支払利息	△ 56
(B) 有価証券売買損益	△ 8,989,670
売買益	1,626,333
売買損	△10,616,003
(C) 信託報酬等	△ 1,917,163
(D) 当期損益金(A+B+C)	△10,906,889
(E) 前期繰越損益金	13,026,104
(F) 追加信託差損益金	32,840,253
(配当等相当額)	(40,579,631)
(売買損益相当額)	(△ 7,739,378)
(G) 計(D+E+F)	34,959,468
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	34,959,468
追加信託差損益金	32,840,253
(配当等相当額)	(40,935,391)
(売買損益相当額)	(△ 8,095,138)
分配準備積立金	17,598,578
繰越損益金	△15,479,363

- (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) (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。

豪州債券インデックスマザーファンド

《第6期》決算日2022年1月26日

[計算期間：2021年1月27日～2022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6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6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、FTSE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。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		FTSEオーストラリア 国 債 イ ン デ ッ ク ス		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	円	騰 落 中 率 %	(円換算ベース)	騰 落 中 率 %			
2期(2018年1月26日)	11,354	5.1	139,360.82	5.3	97.5	—	百万円 218
3期(2019年1月28日)	10,817	△4.7	132,822.81	△4.7	98.1	—	277
4期(2020年1月27日)	11,162	3.2	137,334.11	3.4	98.1	—	373
5期(2021年1月26日)	12,192	9.2	150,271.06	9.4	98.5	—	256
6期(2022年1月26日)	11,886	△2.5	146,684.20	△2.4	98.8	—	274

(注) FTSEオーストラリア国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。FTSEオーストラリア国債インデックス（円換算ベース）とは、FTSE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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 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
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021年 1 月26日	円	%		%	%	%
	12,192	—	150,271.06	—	98.5	—
1 月末	12,234	0.3	150,835.24	0.4	98.6	—
2 月末	12,258	0.5	150,989.13	0.5	97.6	—
3 月末	12,419	1.9	152,957.50	1.8	98.0	—
4 月末	12,576	3.1	154,993.68	3.1	98.6	—
5 月末	12,588	3.2	155,143.83	3.2	99.0	—
6 月末	12,489	2.4	154,031.42	2.5	98.8	—
7 月末	12,453	2.1	153,557.83	2.2	98.1	—
8 月末	12,351	1.3	152,335.91	1.4	98.3	—
9 月末	12,130	△0.5	149,615.05	△0.4	98.3	—
10 月末	12,538	2.8	154,633.31	2.9	98.1	—
11 月末	12,032	△1.3	148,496.43	△1.2	98.7	—
12 月末	12,510	2.6	154,373.21	2.7	99.3	—
(期 末) 2022年 1 月26日	11,886	△2.5	146,684.20	△2.4	98.8	—

(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

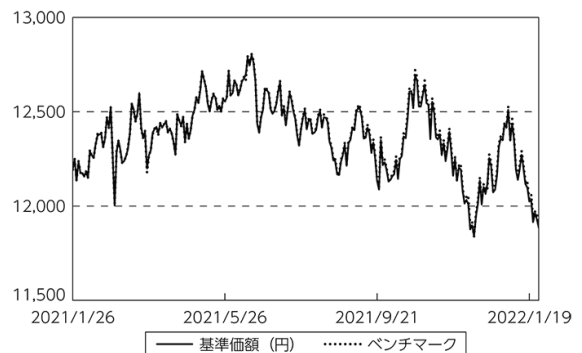
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.5%の下落となりました。

◎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(−2.4%)を0.1%下回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首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。

● 基準価額の主な変動要因

(下落要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

● 投資環境について

◎ 債券市況

豪州の債券市況は下落しました。

- ・ 豪州の債券市況は、期中頃には新型コロナウイルス感染再拡大によるリスク回避的な動きが高まったことなどから上昇する局面もありましたが、世界的な経済回復期待やインフレ懸念による金利上昇などにより、期首との比較では下落しました。

◎ 為替市況

豪ドルは対円で上昇しました。

- ・ 期首に比べて豪ドルは対円で上昇しました。

● 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FTSE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。
- ・ 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2.4%の下落になったため、乖離は△0.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 評価時価差異要因[※]によるものです。
※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

(主なマイナス要因)

- ・ ポートフォリオ要因によるものです。

○ 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

(2021年1月27日～2022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)	(27)	(0.219)	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)	(0)	(0.002)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	27	0.221	
期中の平均基準価額は、12,367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

(2021年1月27日～2022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	2,324	1,932

(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

(2021年1月27日～2022年1月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
		百万円	%		百万円	%
為替直物取引	137	124	90.5	111	76	68.5

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UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2022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
	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	3,250	3,333	271,487	98.8	—	71.4	23.7	3.8
合 計	3,250	3,333	271,487	98.8	—	71.4	23.7	3.8

(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		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	0.25 AUST GOVT 241121	0.25	180	175	14,273	2024/11/21	
	0.25 AUST GOVT 251121	0.25	120	114	9,314	2025/11/21	
	0.5 AUST GOVT 260921	0.5	130	123	10,054	2026/9/21	
	1 AUST GOVT 301221	1.0	210	194	15,851	2030/12/21	
	1 AUST GOVT 311121	1.0	190	174	14,203	2031/11/21	
	1.25 AUST GOVT 320521	1.25	170	159	12,955	2032/5/21	
	1.5 AUST GOVT 310621	1.5	170	164	13,359	2031/6/21	
	1.75 AUST GOVT 321121	1.75	120	117	9,573	2032/11/21	
	1.75 AUST GOVT 510621	1.75	120	100	8,148	2051/6/21	
	2.25 AUST GOVT 280521	2.25	110	113	9,228	2028/5/21	
	2.5 AUST GOVT 300521	2.5	170	178	14,524	2030/5/21	
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	100	104	8,472	2024/4/21	
	2.75 AUST GOVT 271121	2.75	120	126	10,329	2027/11/21	
	2.75 AUST GOVT 281121	2.75	90	95	7,785	2028/11/21	
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	110	117	9,555	2029/11/21	
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	60	64	5,252	2035/6/21	
	2.75 AUST GOVT 410521	2.75	90	94	7,661	2041/5/21	
	3 AUST GOVT 470321	3.0	80	86	7,055	2047/3/21	
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	140	148	12,067	2025/4/21	
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	110	120	9,836	2029/4/21	
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	60	67	5,514	2039/6/21	
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	100	119	9,747	2037/4/21	
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	120	133	10,845	2026/4/21	
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	130	163	13,296	2033/4/21	
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	130	150	12,221	2027/4/21	
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	120	127	10,357	2023/4/21	
合 計					271,487		

(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

(2022年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 271,487	% 98.2
コール・ローン等、その他	4,904	1.8
投資信託財産総額	276,391	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (272,995千円) の投資信託財産総額 (276,391千円) に対する比率は98.8%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=81.45円		
--------------------	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	277,938,874
コール・ローン等	3,469,224
公社債(評価額)	271,487,221
未収入金	1,547,550
未収利息	1,301,032
前払費用	133,847
(B) 負債	3,292,543
未払金	3,292,543
(C) 純資産総額(A-B)	274,646,331
元本	231,069,884
次期繰越損益金	43,576,447
(D) 受益権総口数	231,069,884口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,886円

<注記事項>

①期首元本額 210,387,454円
 期中追加設定元本額 111,276,192円
 期中一部解約元本額 90,593,762円
 また、1口当たり純資産額は、期末11,886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)
 e MAX I S 豪州債券インデックス 231,069,884円

○損益の状況 (2021年1月27日~2022年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	6,423,365
受取利息	6,423,520
支払利息	△ 155
(B) 有価証券売買損益	△14,089,996
売買益	3,954,965
売買損	△18,044,961
(C) 保管費用等	△ 638,115
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 8,304,746
(E) 前期繰越損益金	46,125,925
(F) 追加信託差損益金	27,013,900
(G) 解約差損益金	△21,258,632
(H) 計(D+E+F+G)	43,576,447
次期繰越損益金(H)	43,576,447

(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) (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) (G) 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。