

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 | 2016年6月13日まで（2011年9月26日設定） | |
| 運用方針 | 豪ドル建て社債マザーファンド受益証券への投資を通じて、豪ドル建ての公社債を実質的な主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。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。デュレーション調整等のため、債券先物取引等を利用する場合があります。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。 | |
| 主要運用対象 | ベビーファンド | 豪ドル建て社債マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
| | マザーファンド | 豪ドル建て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 | 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。 | |

※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、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」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)

豪ドル建て社債ファンド (毎月決算型)



第33期（決算日：2014年7月14日）

第34期（決算日：2014年8月13日）

第35期（決算日：2014年9月16日）

第36期（決算日：2014年10月14日）

第37期（決算日：2014年11月13日）

第38期（決算日：2014年12月15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「豪ドル建て社債ファンド（毎月決算型）」は、去る12月15日に第38期の決算を行いましたので、法令に基づいて第33期～第38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。



東京都千代田区丸の内一丁目4番5号
URL:<http://www.am.mufig.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

営業企画推進部
お客様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)
お客様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。

◆ 目次

豪ドル建て社債ファンド（毎月決算型）のご報告

| | |
|---------------------|----|
| ◇最近30期の運用実績 | 1 |
| ◇当作成期中の基準価額等の推移 | 2 |
| ◇運用経過 | 3 |
| ◇今後の運用方針 | 7 |
| ◇1万口当たりの費用明細 | 8 |
| ◇売買及び取引の状況 | 8 |
| ◇利害関係人との取引状況等 | 9 |
| ◇自社による当ファンドの設定・解約状況 | 9 |
| ◇組入資産の明細 | 9 |
| ◇投資信託財産の構成 | 10 |
| ◇資産、負債、元本及び基準価額の状況 | 10 |
| ◇損益の状況 | 11 |
| ◇分配金のお知らせ | 12 |
| ◇お知らせ | 12 |

マザーファンドのご報告

| | |
|-----------------|----|
| ◇豪ドル建て社債マザーファンド | 14 |
|-----------------|----|

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 準 (分配落) | 価 額 | | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 純 資 産 総 額 |
|------------------|--------------|-----|-----|--------------|----------------|----------------|--------------|
| | | 税 分 | 込 配 | み 騰 金 落 率 | | | |
| | 円 | 円 | 円 | % | % | % | 百万円 |
| 9期(2012年7月13日) | 11,346 | 0 | 0 | 2.3 | 97.4 | — | 1,134 |
| 10期(2012年8月13日) | 11,605 | 0 | 0 | 2.3 | 96.8 | — | 1,160 |
| 11期(2012年9月13日) | 11,582 | 0 | 0 | △ 0.2 | 96.3 | — | 1,158 |
| 12期(2012年10月15日) | 11,556 | 0 | 0 | △ 0.2 | 97.7 | — | 1,155 |
| 13期(2012年11月13日) | 12,007 | 5 | 5 | 3.9 | 97.2 | — | 1,200 |
| 14期(2012年12月13日) | 12,760 | 5 | 5 | 6.3 | 96.9 | — | 1,276 |
| 15期(2013年1月15日) | 13,753 | 5 | 5 | 7.8 | 96.4 | — | 1,375 |
| 16期(2013年2月13日) | 14,086 | 5 | 5 | 2.5 | 96.0 | — | 1,408 |
| 17期(2013年3月13日) | 14,440 | 5 | 5 | 2.5 | 95.7 | — | 1,444 |
| 18期(2013年4月15日) | 15,209 | 5 | 5 | 5.4 | 95.3 | — | 1,520 |
| 19期(2013年5月13日) | 15,021 | 5 | 5 | △ 1.2 | 97.3 | — | 1,502 |
| 20期(2013年6月13日) | 13,318 | 5 | 5 | △ 11.3 | 97.8 | — | 1,331 |
| 21期(2013年7月16日) | 13,440 | 5 | 5 | 1.0 | 97.4 | — | 1,344 |
| 22期(2013年8月13日) | 13,143 | 5 | 5 | △ 2.2 | 97.2 | — | 1,314 |
| 23期(2013年9月13日) | 13,641 | 5 | 5 | 3.8 | 96.5 | — | 1,364 |
| 24期(2013年10月15日) | 13,905 | 5 | 5 | 2.0 | 96.1 | — | 1,390 |
| 25期(2013年11月13日) | 13,746 | 5 | 5 | △ 1.1 | 96.8 | — | 1,374 |
| 26期(2013年12月13日) | 13,799 | 5 | 5 | 0.4 | 96.1 | — | 1,379 |
| 27期(2014年1月14日) | 13,943 | 5 | 5 | 1.1 | 95.7 | — | 1,394 |
| 28期(2014年2月13日) | 13,736 | 5 | 5 | △ 1.4 | 95.2 | — | 1,373 |
| 29期(2014年3月13日) | 14,022 | 5 | 5 | 2.1 | 94.7 | — | 1,402 |
| 30期(2014年4月14日) | 14,389 | 5 | 5 | 2.7 | 97.7 | — | 1,438 |
| 31期(2014年5月13日) | 14,505 | 5 | 5 | 0.8 | 97.4 | — | 1,450 |
| 32期(2014年6月13日) | 14,584 | 5 | 5 | 0.6 | 97.7 | — | 1,458 |
| 33期(2014年7月14日) | 14,601 | 5 | 5 | 0.2 | 97.5 | — | 1,460 |
| 34期(2014年8月13日) | 14,564 | 5 | 5 | △ 0.2 | 97.2 | — | 1,456 |
| 35期(2014年9月16日) | 14,839 | 5 | 5 | 1.9 | 93.4 | — | 1,483 |
| 36期(2014年10月14日) | 14,430 | 5 | 5 | △ 2.7 | 96.6 | — | 1,442 |
| 37期(2014年11月13日) | 15,518 | 5 | 5 | 7.6 | 97.1 | — | 1,551 |
| 38期(2014年12月15日) | 15,164 | 5 | 5 | △ 2.2 | 97.3 | — | 1,516 |

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 豪ドル建ての公社債を主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざしますが、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、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) 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等の推移

| 決 算 期 | 年 月 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 券 率 |
|-------|-------------|---------|-------|-------|-----------|-----------|-----|
| | | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | |
| 第33期 | (期 首) | 円 | % | | % | | % |
| | 2014年6月13日 | 14,584 | — | | 97.7 | | — |
| | 6月末 | 14,600 | 0.1 | | 97.5 | | — |
| 第34期 | (期 末) | | | | | | |
| | 2014年7月14日 | 14,606 | 0.2 | | 97.5 | | — |
| | (期 首) | | | | | | |
| 第34期 | 2014年7月14日 | 14,601 | — | | 97.5 | | — |
| | 7月末 | 14,705 | 0.7 | | 97.3 | | — |
| | (期 末) | | | | | | |
| 第35期 | 2014年8月13日 | 14,569 | △0.2 | | 97.2 | | — |
| | (期 首) | | | | | | |
| | 2014年8月13日 | 14,564 | — | | 97.2 | | — |
| 第35期 | 8月末 | 14,917 | 2.4 | | 97.0 | | — |
| | (期 末) | | | | | | |
| | 2014年9月16日 | 14,844 | 1.9 | | 93.4 | | — |
| 第36期 | (期 首) | | | | | | |
| | 2014年9月16日 | 14,839 | — | | 93.4 | | — |
| | 9月末 | 14,632 | △1.4 | | 96.8 | | — |
| 第36期 | (期 末) | | | | | | |
| | 2014年10月14日 | 14,435 | △2.7 | | 96.6 | | — |
| | (期 首) | | | | | | |
| 第37期 | 2014年10月14日 | 14,430 | — | | 96.6 | | — |
| | 10月末 | 14,873 | 3.1 | | 96.5 | | — |
| | (期 末) | | | | | | |
| 第37期 | 2014年11月13日 | 15,523 | 7.6 | | 97.1 | | — |
| | (期 首) | | | | | | |
| | 2014年11月13日 | 15,518 | — | | 97.1 | | — |
| 第38期 | 11月末 | 15,583 | 0.4 | | 96.9 | | — |
| | (期 末) | | | | | | |
| | 2014年12月15日 | 15,169 | △2.2 | | 97.3 | | — |

(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合わせますので、「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。

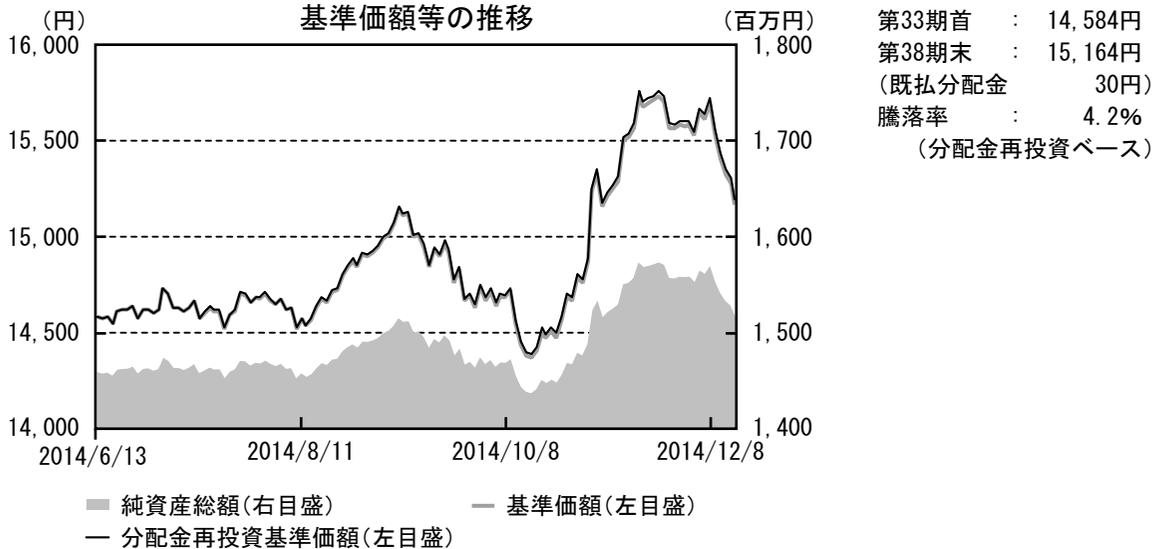
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当作成期中の基準価額等の推移について

（第33期～第38期：2014/6/14～2014/12/15）

| | |
|---------|--|
| 基準価額の動き | 基準価額は当作成期首に比べ4.2%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。 |
|---------|--|



- ・分配金再投資基準価額は、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、お客さまがご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なるため、お客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。

基準価額の変動要因

| | |
|------|---|
| 上昇要因 | 豪州金利が低下したことや、豪ドルが円に対して上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。 |
|------|---|

投資環境について

（第33期～第38期：2014/6/14～2014/12/15）

債券市況の推移

（当作成期首を100として指数化）



（注）現地日付ベースで記載しております。

（注）ブルームバーグオーストラリア債券（Credit）インデックスとは、オーストラリアの社債市場の値動きを表す代表的な指数です。

◎債券市況

豪州金利は、豪州の主要輸出産品である鉄鉱石や石炭の価格が下落したことや中国景気の先行きに対する懸念などから低下（債券価格は上昇）しました。また、国債に対する社債のスプレッド（利回り格差）は世界的な過剰流動性の縮小に対する懸念の高まりを背景に緩やかに拡大基調で推移しました。

為替市況の推移

（当作成期首を100として指数化）



◎為替市況

米国における政策金利引き上げに対する期待や日銀の追加金融緩和などを受けて、円が主要通貨に対して売られる展開となり、豪ドルは対円で上昇（円安）しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

＜豪ドル建て社債ファンド（毎月決算型）＞

- ・当ファンドは豪ドル建て社債マザーファンド受益証券（以下、マザーファンド）を通じて、豪ドル建ての公社債に投資しています。

＜豪ドル建て社債マザーファンド＞

基準価額は当作成期首に比べ4.9%の上昇となりました。

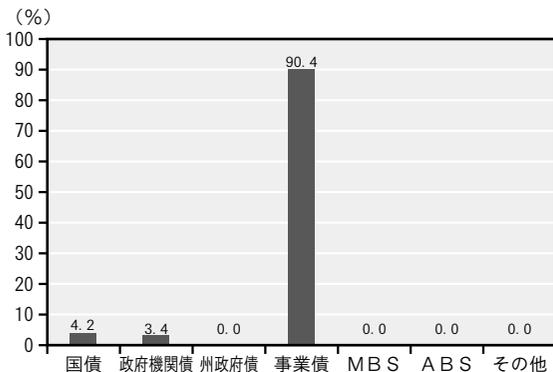
◎運用経過

- ・豪州のマクロ経済分析やクレジット市場分析をもとに、クレジットアナリストによる社内格付けや投資判断を勘案し、ポートフォリオを構築しました。
- ・残存期間が6年以内の債券を組み入れ、ファンド全体のデュレーション（平均回収期間や金利感応度）は概ね2年程度を維持しました。
- ・欧州債務問題に対する懸念が後退したことから、ポートフォリオの利回り向上を狙い社債の組入比率は概ね90%程度を維持しました。また、債券格付別ではA格相当の組入比率を引き下げ、利回りの観点からより魅力度の勝るBBB格相当の組入比率を引き上げました。
- ・豪州金利が低下したことや社債の債券利子収入を享受したことに加え、豪ドルが対円で上昇したことなどが基準価額の上昇要因となりました。

（ご参考）

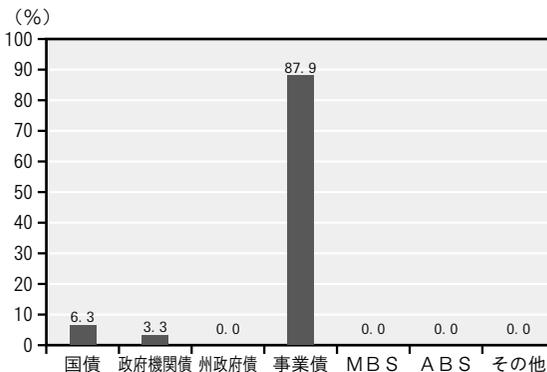
種類別組入比率

作成期首（2014年6月13日）



(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

作成期末（2014年12月15日）



(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

（ご参考）

利回り・デュレーション

作成期首（2014年6月13日）

| | |
|---------|------|
| 最終利回り | 3.8% |
| 直接利回り | 5.8% |
| デュレーション | 2.2年 |

- ・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮していません）。
- ・最終利回りは、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。

作成期末（2014年12月15日）

| | |
|---------|------|
| 最終利回り | 3.4% |
| 直接利回り | 5.3% |
| デュレーション | 2.3年 |

- ・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮していません）。
- ・最終利回りは、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。

（ご参考）

債券の格付分布

作成期首（2014年6月13日）

| 格付種類 | 比率 | 銘柄数 |
|-------|-------|-----|
| AAA格 | 4.2% | 1 |
| AA格 | 13.7% | 4 |
| A格 | 73.2% | 19 |
| BBB格 | 6.8% | 1 |
| BB格以下 | 0.0% | 0 |
| 無格付 | 0.0% | 0 |

- ・比率は純資産総額に対する割合です。
- ・格付の振分基準は、以下の通りです。
 - ・A A格 (AA+, AA, AA-, Aa1, Aa2, Aa3)
 - ・A格 (A+, A, A-, A1, A2, A3)
 - ・B B B格 (BBB+, BBB, BBB-, Baa1, Baa2, Baa3)
 - ・B B格 (BB+, BB, BB-, Ba1, Ba2, Ba3)
- ・原則として、個別銘柄格付を採用しておりますが、例外的に国債、地方債ならびに政府保証のある債券などについては、弊社の分類基準に基づいて、ソブリン格付（国の発行体格付）を採用しているものがあります。
- ・格付分布はR&I社、JCR社、S&P社、Moody's社、フィッチ・レーティングス社のうち最も高い格付を表示しています。

作成期末（2014年12月15日）

| 格付種類 | 比率 | 銘柄数 |
|-------|-------|-----|
| AAA格 | 6.3% | 2 |
| AA格 | 13.5% | 4 |
| A格 | 67.9% | 15 |
| BBB格 | 9.8% | 2 |
| BB格以下 | 0.0% | 0 |
| 無格付 | 0.0% | 0 |

- ・比率は純資産総額に対する割合です。
- ・格付の振分基準は、以下の通りです。
 - ・A A格 (AA+, AA, AA-, Aa1, Aa2, Aa3)
 - ・A格 (A+, A, A-, A1, A2, A3)
 - ・B B B格 (BBB+, BBB, BBB-, Baa1, Baa2, Baa3)
 - ・B B格 (BB+, BB, BB-, Ba1, Ba2, Ba3)
- ・原則として、個別銘柄格付を採用しておりますが、例外的に国債、地方債ならびに政府保証のある債券などについては、弊社の分類基準に基づいて、ソブリン格付（国の発行体格付）を採用しているものがあります。
- ・格付分布はR&I社、JCR社、S&P社、Moody's社、フィッチ・レーティングス社のうち最も高い格付を表示しています。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・豪ドル建ての公社債を主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざしますが、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、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。
- ・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、1万口当たり、税込み）

| 項 目 | 第33期 | 第34期 | 第35期 | 第36期 | 第37期 | 第38期 |
|--------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 2014年6月14日～ 2014年7月14日 | 2014年7月15日～ 2014年8月13日 | 2014年8月14日～ 2014年9月16日 | 2014年9月17日～ 2014年10月14日 | 2014年10月15日～ 2014年11月13日 | 2014年11月14日～ 2014年12月15日 |
| 当期分配金 （対基準価額比率） | 5 0.034% | 5 0.034% | 5 0.034% | 5 0.035% | 5 0.032% | 5 0.033% |
| 当期の収益 | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 |
| 当期の収益以外 | — | — | — | — | — | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 6,011 | 6,057 | 6,125 | 6,165 | 6,228 | 6,277 |

（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

<豪ドル建て社債ファンド（毎月決算型）>

- ・豪ドル建て社債マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保ち、マザーファンドのポートフォリオの構成に近づけた状態を維持する方針です。

<豪ドル建て社債マザーファンド>

◎運用環境の見通し

- ・豪州金利は世界景気に対する慎重な見方を背景に、低下余地を探る展開を予想します。雇用環境の先行きに不透明感が強いことや鉄鉱石などの商品価格の下落などから、RBA（豪州連邦準備銀行）は現行の緩和的な金融政策を当面維持するものと考えます。また、国債に対する社債のスプレッドは世界的な過剰流動性の縮小に対する懸念は残るものの横ばいで推移する展開を予想します。

◎今後の運用方針

- ・安定した利子収入確保をめざし、債券組入比率は引き続き高位に維持する方針です。
- ・ファンド全体のデュレーションは、当面2年程度で調整する方針です。
- ・債券種別構成は、当面社債を概ね90%程度、非社債を概ね9%程度を維持する方針です。
- ・債券種別構成は、高格付銘柄を中心に組み入れ、国債に対する社債のスプレッド動向を注視しながら機動的に対応する方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年 6 月 14 日～2014年12月15日)

| 項 目 | 第33期～第38期 | | 項 目 の 概 要 |
|-------------------------|-----------|------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 102 | % 0.684 | (a) 信託報酬＝作成期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (41) | (0.273) | 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 ） | (57) | (0.384) | 分配金・償還金・換金代金支払等の事務手続き、交付運用報告書等の送付、購入後の説明・情報提供等の対価 |
| （ 受 託 会 社 ） | (4) | (0.027) | 投資信託財産の保管・管理、運用指図の実行等の対価 |
| (b) そ の 他 費 用 | 2 | 0.016 | (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 |
| （ 保 管 費 用 ） | (2) | (0.013) | 外国での資産の保管等に要する費用 |
| （ 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 ） | (0) | (0.001) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 104 | 0.700 | |
| 作成期中の平均基準価額は、14,885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、簡便法により算出した結果です。

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(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まず。

(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。

○ 売買及び取引の状況

(2014年 6 月 14 日～2014年12月15日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄 | 第33期～第38期 | | | |
|----------------|-----------|---------|-------------|--------------|
| | 設 定 | | 解 約 | |
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 豪ドル建て社債マザーファンド | 千口 — | 千円 — | 千口 8,513 | 千円 13,316 |

○利害関係人との取引状況等

（2014年6月14日～2014年12月15日）

利害関係人との取引状況

<豪ドル建て社債ファンド（毎月決算型）>

該当事項はございません。

<豪ドル建て社債マザーファンド>

| 区 分 | 第33期～第38期 | | | | | |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | 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 — | 百万円 — | % — | 百万円 13 | 百万円 4 | % 30.8 |

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、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2014年12月15日現在）

| 作成期首残高(元本) | 当作成期設定元本 | 当作成期解約元本 | 作成期末残高(元本) | 取引の理由 |
|--------------|----------|----------|--------------|-------------|
| 百万円 1,000 | 百万円 — | 百万円 — | 百万円 1,000 | 当初設定時における取得 |

○組入資産の明細

（2014年12月15日現在）

親投資信託残高

| 銘 柄 | 第32期末 | | 第38期末 | |
|----------------|---------------|--|---------------|-----------------|
| | 口 数 | | 口 数 | 評 価 額 |
| 豪ドル建て社債マザーファンド | 千口 954,036 | | 千口 945,523 | 千円 1,511,986 |

○投資信託財産の構成

（2014年12月15日現在）

| 項 目 | 第38期末 | |
|----------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 豪ドル建て社債マザーファンド | 千円 1,511,986 | % 99.6 |
| コール・ローン等、その他 | 6,721 | 0.4 |
| 投資信託財産総額 | 1,518,707 | 100.0 |

（注）豪ドル建て社債マザーファンドにおいて、作成期末における外貨建純資産（1,510,905千円）の投資信託財産総額（1,512,567千円）に対する比率は99.9%です。

（注）外貨建資産は、作成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、作成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=97.52円 | | |
|-------------------|--|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第33期末 | 第34期末 | 第35期末 | 第36期末 | 第37期末 | 第38期末 |
|---------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | 2014年7月14日現在 | 2014年8月13日現在 | 2014年9月16日現在 | 2014年10月14日現在 | 2014年11月13日現在 | 2014年12月15日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 1,462,231,402 | 1,458,532,152 | 1,486,283,812 | 1,445,005,974 | 1,553,943,327 | 1,518,707,876 |
| コール・ローン等 | 5,738,058 | 5,691,030 | 6,025,616 | 5,558,109 | 5,871,539 | 6,168,377 |
| 豪ドル建て社債マザーファンド(評価額) | 1,455,867,803 | 1,452,142,791 | 1,479,680,773 | 1,438,830,183 | 1,547,323,832 | 1,511,986,956 |
| 未収入金 | 625,533 | 698,323 | 577,415 | 617,675 | 747,948 | 552,535 |
| 未収利息 | 8 | 8 | 8 | 7 | 8 | 8 |
| (B) 負債 | 2,181,160 | 2,127,248 | 2,379,328 | 2,031,804 | 2,147,072 | 2,350,229 |
| 未払収益分配金 | 500,000 | 500,000 | 500,000 | 500,000 | 500,000 | 500,000 |
| 未払信託報酬 | 1,675,541 | 1,621,810 | 1,873,047 | 1,526,683 | 1,641,566 | 1,844,043 |
| その他未払費用 | 5,619 | 5,438 | 6,281 | 5,121 | 5,506 | 6,186 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,460,050,242 | 1,456,404,904 | 1,483,904,484 | 1,442,974,170 | 1,551,796,255 | 1,516,357,647 |
| 元本 | 1,000,000,000 | 1,000,000,000 | 1,000,000,000 | 1,000,000,000 | 1,000,000,000 | 1,000,000,000 |
| 次期繰越損益金 | 460,050,242 | 456,404,904 | 483,904,484 | 442,974,170 | 551,796,255 | 516,357,647 |
| (D) 受益権総口数 | 1,000,000,000口 | 1,000,000,000口 | 1,000,000,000口 | 1,000,000,000口 | 1,000,000,000口 | 1,000,000,000口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,601円 | 14,564円 | 14,839円 | 14,430円 | 15,518円 | 15,164円 |

○損益の状況

| 項 目 | 第33期 | 第34期 | 第35期 | 第36期 | 第37期 | 第38期 |
|------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 2014年6月14日～ 2014年7月14日 | 2014年7月15日～ 2014年8月13日 | 2014年8月14日～ 2014年9月16日 | 2014年9月17日～ 2014年10月14日 | 2014年10月15日～ 2014年11月13日 | 2014年11月14日～ 2014年12月15日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 238 | 226 | 264 | 189 | 196 | 251 |
| 受取利息 | 238 | 226 | 264 | 189 | 196 | 251 |
| (B) 有価証券売買損益 | 3,818,540 | △ 1,518,316 | 29,878,644 | △ 38,898,699 | 110,968,961 | △ 33,088,630 |
| 売買益 | 3,818,804 | 5,315 | 29,878,644 | 2,320 | 110,969,865 | 11,052 |
| 売買損 | △ 264 | △ 1,523,631 | — | △ 38,901,019 | △ 904 | △ 33,099,682 |
| (C) 信託報酬等 | △ 1,681,160 | △ 1,627,248 | △ 1,879,328 | △ 1,531,804 | △ 1,647,072 | △ 1,850,229 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 2,137,618 | △ 3,145,338 | 27,999,580 | △ 40,430,314 | 109,322,085 | △ 34,938,608 |
| (E) 前期繰越損益金 | 458,412,624 | 460,050,242 | 456,404,904 | 483,904,484 | 442,974,170 | 551,796,255 |
| (F) 計(D+E) | 460,550,242 | 456,904,904 | 484,404,484 | 443,474,170 | 552,296,255 | 516,857,647 |
| (G) 収益分配金 | △ 500,000 | △ 500,000 | △ 500,000 | △ 500,000 | △ 500,000 | △ 500,000 |
| 次期繰越損益金(F+G) | 460,050,242 | 456,404,904 | 483,904,484 | 442,974,170 | 551,796,255 | 516,357,647 |
| 分配準備積立金 | 601,120,564 | 605,783,646 | 612,510,680 | 616,586,142 | 622,853,513 | 627,780,809 |
| 繰越損益金 | △141,070,322 | △149,378,742 | △128,606,196 | △173,611,972 | △ 71,057,258 | △111,423,162 |

(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。

＜注記事項＞

- ①作成期首（前作成期末）元本額 1,000,000,000円
 作成期中追加設定元本額 0円
 作成期中一部解約元本額 0円
- ②分配金の計算過程

| | | 第33期 | 第34期 | 第35期 | 第36期 | 第37期 | 第38期 |
|-------------------------------|--------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 5,420,269円 | 5,163,082円 | 7,227,034円 | 4,575,462円 | 6,767,371円 | 5,427,296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 | B | －円 | －円 | －円 | －円 | －円 | －円 |
| 収益調整金額 | C | －円 | －円 | －円 | －円 | －円 | －円 |
| 分配準備積立金額 | D | 596,200,295円 | 601,120,564円 | 605,783,646円 | 612,510,680円 | 616,586,142円 | 622,853,513円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 601,620,564円 | 606,283,646円 | 613,010,680円 | 617,086,142円 | 623,353,513円 | 628,280,809円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 1,000,000,000口 | 1,000,000,000口 | 1,000,000,000口 | 1,000,000,000口 | 1,000,000,000口 | 1,000,000,000口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 6,016円 | 6,062円 | 6,130円 | 6,170円 | 6,233円 | 6,282円 |
| 1万口当たり分配金額 | H | 5円 | 5円 | 5円 | 5円 | 5円 | 5円 |
| 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 500,000円 | 500,000円 | 500,000円 | 500,000円 | 500,000円 | 500,000円 |

○分配金のお知らせ

| | 第33期 | 第34期 | 第35期 | 第36期 | 第37期 | 第38期 |
|----------------|------|------|------|------|------|------|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 5円 | 5円 | 5円 | 5円 | 5円 | 5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。

※2014年1月1日より、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」がご利用になれます。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円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5年間非課税となります。

*三菱UFJ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 (<http://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お知らせ】

- ①書面決議を行う場合の受益者数要件の撤廃を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ②併合手続要件の緩和を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ③買取請求の一部適用除外を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ④運用報告書の二段階化について信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑤新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑥デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑦2014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。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2014年12月15日現在）

<豪ドル建て社債マザーファンド>

下記は、豪ドル建て社債マザーファンド全体(945,523千口)の内容です。

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 第38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 | 14,500 | 15,124 | 1,474,934 | 97.5 | — | 4.3 | 56.6 | 36.7 |
| 合 計 | 14,500 | 15,124 | 1,474,934 | 97.5 | — | 4.3 | 56.6 | 36.7 |

(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、親投資信託の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 | 第38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 | 4.5 | AUST GOVT 200415 | 4.5 | 600 | 659 | 64,333 | 2020/4/15 |
| | 6.0 | AUST GOVT 170215 | 6.0 | 300 | 323 | 31,518 | 2017/2/15 |
| 特殊債券 | 5.0 | EXP-IM BK KOREA 150727 | 5.0 | 500 | 505 | 49,274 | 2015/7/27 |
| 普通社債券 | 4.1 | JPMORGAN 180517 | 4.1 | 500 | 508 | 49,626 | 2018/5/17 |
| | 4.5 | BANK OF AMERI 180823 | 4.5 | 700 | 719 | 70,177 | 2018/8/23 |
| | 4.5 | BARCLAYS B 190404 | 4.5 | 500 | 516 | 50,371 | 2019/4/4 |
| | 4.5 | HYUNDAI CAPIT 170516 | 4.5 | 500 | 509 | 49,662 | 2017/5/16 |
| | 4.5 | SHINHAN BANK 151009 | 4.5 | 500 | 504 | 49,171 | 2015/10/9 |
| | 4.5 | WESTPAC BANKI 190225 | 4.5 | 500 | 521 | 50,902 | 2019/2/25 |
| | 4.75 | ABN AMRO B 190205 | 4.75 | 1,000 | 1,038 | 101,278 | 2019/2/5 |
| | 4.75 | BNP PARIBAS 180201 | 4.75 | 1,500 | 1,555 | 151,674 | 2018/2/1 |
| | 5.0 | GOLDMAN SACHS 190821 | 5.0 | 500 | 522 | 50,907 | 2019/8/21 |
| | 5.0 | ING BANK NV/SYD 181127 | 5.0 | 500 | 525 | 51,281 | 2018/11/27 |
| | 6.0 | CITIGROUP INC 160322 | 6.0 | 600 | 620 | 60,520 | 2016/3/22 |
| | 6.35 | GOLDMAN SACH 160412 | 6.35 | 500 | 519 | 50,678 | 2016/4/12 |
| | 6.5 | CITIGROUP INC 170213 | 6.5 | 900 | 958 | 93,481 | 2017/2/13 |
| | 7.0 | WEST RETAIL TRU 161018 | 7.0 | 800 | 851 | 83,048 | 2016/10/18 |
| | 7.25 | NATIONAL AUS 180307 | 7.25 | 500 | 562 | 54,856 | 2018/3/7 |
| | 7.5 | STOCKLAND TRU 160701 | 7.5 | 600 | 636 | 62,098 | 2016/7/1 |
| | 7.75 | GOLDMAN SACH 161123 | 7.75 | 500 | 540 | 52,714 | 2016/11/23 |
| | 8.25 | MIRVAC GROUP 150315 | 8.25 | 1,000 | 1,011 | 98,653 | 2015/3/15 |
| | 8.5 | STOCKLAND TRU 150218 | 8.5 | 500 | 504 | 49,182 | 2015/2/18 |
| | 3.935 | FRN GE CAP AUST 180130 | 3.935 | 500 | 507 | 49,519 | 2018/1/30 |
| 小 計 | | | | | | 1,474,934 | |
| 合 計 | | | | | | 1,474,934 | |

(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。

豪ドル建て社債マザーファンド

《第3期》決算日2014年6月13日

〔計算期間：2013年6月14日～2014年6月13日〕

「豪ドル建て社債マザーファンド」は、6月13日に第3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3期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 豪ドル建ての公社債を主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。投資にあたっては、原則として信託財産の純資産総額の70%以上を豪ドル建ての社債に投資を行うほか、豪ドル建ての国債、政府機関債、州政府債および国際機関債等に投資を行います。ポートフォリオの平均格付は、原則としてA-格相当以上を維持することとします。投資する債券は、原則として取得時においてBBB-格相当以上の格付を取得しているものに限り、デュレーション調整等のため、債券先物取引等を利用する場合があります。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 | 豪ドル建て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。 |

当期中の基準価額等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 債券組入 比 率 | 債券先物 比 率 |
|---------------------|---------|-------|-------------|-------------|
| | 円 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2013年6月13日 | 13,672 | — | 98.1 | — |
| 6月末 | 13,724 | 0.4 | 97.9 | — |
| 7月末 | 13,485 | △ 1.4 | 97.5 | — |
| 8月末 | 13,376 | △ 2.2 | 97.2 | — |
| 9月末 | 13,913 | 1.8 | 96.6 | — |
| 10月末 | 14,384 | 5.2 | 97.9 | — |
| 11月末 | 14,312 | 4.7 | 96.5 | — |
| 12月末 | 14,405 | 5.4 | 96.1 | — |
| 2014年1月末 | 14,132 | 3.4 | 95.6 | — |
| 2月末 | 14,301 | 4.6 | 95.1 | — |
| 3月末 | 14,926 | 9.2 | 98.1 | — |
| 4月末 | 15,034 | 10.0 | 97.8 | — |
| 5月末 | 15,058 | 10.1 | 97.5 | — |
| (期 末) 2014年6月13日 | 15,242 | 11.5 | 97.9 | — |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 豪ドル建ての公社債を主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざしますが、特定の指数を上回るまたは運動をめざした運用を行っていないため、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。

(注) 純資産総額は、期首1,327百万円、期末1,454百万円。

当期の運用経過

◆ 基準価額の推移

基準価額は期首に比べ11.5%の上昇となりました。

基準価額の推移



◆ 基準価額の変動要因

債券市況の推移 (期首を100として指数化)

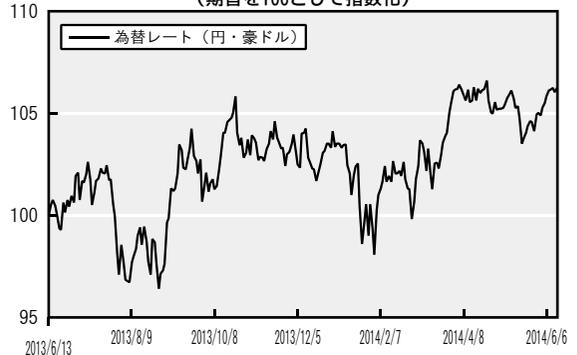


◎債券市況

- ・欧州債務問題に対する懸念の後退や2013年8月以降、世界的な過剰流動性の縮小に対する投資家の懸念が後退したことから国債

に対する社債のスプレッド（利回り格差）は縮小基調で推移し、豪州の社債市況は上昇（利回りは低下）しました。

為替市況の推移 (期首を100として指数化)



◎為替市況

- ・豪ドルは対円で上昇（円安）しました。世界景気の先行きに対する懸念が和らいだことやRBA（豪州連邦準備銀行）による追加緩和期待が後退したことなどから対円で上昇しました。

◎組入比率

- ・期を通じて高位組み入れを維持しました。
- ・残存期間が6年程度までの債券を組み入れ、ファンド全体のデュレーション（平均回収期間や金利感応度）は概ね2年程度を維持しました。

◎種別構成

- ・2013年8月以降、世界的な過剰流動性の縮小に対する投資家の懸念が後退したことから、ポートフォリオの利回り向上を狙い社債の組入比率を90%超まで引き上げました。

◆ 今後の運用方針

◆ 運用環境の見通し

- ・ 豪州経済は住宅部門を中心に改善方向にありますが、雇用の回復ペースが緩やかなため、賃金面からのインフレ圧力は今後も抑制されると考えます。豪州の新年度政府予算案が発表され、財政政策が今後も引き締め方向にあることが明らかになる中、金融政策面では、現在の緩和的な政策金利水準が当面維持されると考えます。こうした環境下、格付の高さに注目した豪州債需要の底堅さなども影響し、豪州金利はもみ合いながらも低下余地を探る展開を予想します。また、国債に対する社債の спреッドは世界的な過剰流動性の縮小に対する懸念は残りますが、良好な需給環境を背景にゆっくと縮小する展開を見込みます。

◆ 今後の運用方針

- ・ 安定した利子収入確保をめざし、債券組入比率は引き続き高位に維持する方針です。
- ・ ファンド全体のデュレーションは、当面2年程度で調整する方針です。
- ・ 債券種別構成は、当面社債を概ね90%程度、非社債を概ね7%程度を維持する方針です。
- ・ 債券種別構成は、高格付銘柄を中心に組み入れ、国債に対する社債の спреッド動向を注視しながら機動的に対応する方針です。

1万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

| 項 目 | 当 期 |
|---------------|-----|
| (a) 保 管 費 用 等 | 4円 |
| 合 計 | 4 |

(a) 保管費用等は、期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

売買および取引の状況 (2013年6月14日～2014年6月13日)

◆ 公社債

| 外 国 | オーストラリア | 国 債 証 券 特 殊 債 券 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 |
| | | | 1,191 | 2,873 |
| | | | 510 | — |
| | | | 9,473 | 7,723 |

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

組入資産の明細

◆ 公社債

(A) 外国(外貨建)公社債の種類別開示

| 区 分 | 額面金額 | 当 期 末 | | | | | | |
|---------|----------------------|----------------------|-----------------|-----------|-----------------|-----------|-----------|-----------|
| | | 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 14,300 | 千オーストラリアドル 14,852 | 千円 1,424,192 | % 97.9 | % — | % 7.6 | % 41.2 | % 49.2 |
| 合 計 | 14,300 | 14,852 | 1,424,192 | 97.9 | — | 7.6 | 41.2 | 49.2 |

(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) 公社債の詳細開示(個別銘柄別)

2014年6月13日現在

| 銘柄名 | 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 4.5 AUST GOVT 200415 | 4.5 | 600 | 635 | 60,977 | 2020/4/15 |
| 特殊債券 5 EXP-IM BK KOREA 150727 | 5.0 | 500 | 508 | 48,767 | 2015/7/27 |
| 普通社債券 | 4.5 BARCLAYS B 190404 | 500 | 503 | 48,279 | 2019/4/4 |
| | 4.5 SHINHAN BANK 151009 | 500 | 505 | 48,436 | 2015/10/9 |
| | 4.5 TELSTRA CORP 181113 | 500 | 512 | 49,163 | 2018/11/13 |
| | 4.5 WESTPAC BANK I 190225 | 500 | 508 | 48,717 | 2019/2/25 |
| | 4.75 ABN AMRO B 190205 | 500 | 505 | 48,504 | 2019/2/5 |
| | 4.75 BNP PARIBAS 180201 | 1,000 | 1,022 | 98,073 | 2018/2/1 |
| | 5 GOLDMAN SACHS 190821 | 500 | 509 | 48,837 | 2019/8/21 |
| | 5 ING BANK NV/SYD 181127 | 500 | 512 | 49,126 | 2018/11/27 |
| | 6 CITIGROUP INC 160322 | 500 | 520 | 49,894 | 2016/3/22 |
| | 6.35 GOLDMAN SACH 160412 | 500 | 523 | 50,170 | 2016/4/12 |
| | 6.5 CITIGROUP INC 170213 | 500 | 532 | 51,087 | 2017/2/13 |
| | 7 BNP PARIBAS AU 160524 | 500 | 532 | 51,026 | 2016/5/24 |
| | 7 ING BANK NV 160322 | 700 | 742 | 71,189 | 2016/3/22 |
| | 7 JPMORGAN CHASE 160316 | 500 | 529 | 50,800 | 2016/3/16 |
| | 7 VOLKSWAGEN FIN 150128 | 1,000 | 1,022 | 98,024 | 2015/1/28 |
| | 7 WEST RETAIL TRU 161018 | 500 | 533 | 51,156 | 2016/10/18 |
| | 7.25 NATIONAL AUS 180307 | 500 | 559 | 53,631 | 2018/3/7 |
| | 7.5 LLOYDS BK PLC 141001 | 500 | 506 | 48,531 | 2014/10/1 |
| 7.5 LLOYDS BK PLC 151002 | 500 | 525 | 50,396 | 2015/10/2 | |
| 7.75 GOLDMAN SACH 161123 | 500 | 544 | 52,227 | 2016/11/23 | |
| 8.25 MIRVAC GROUP 150315 | 1,000 | 1,032 | 99,034 | 2015/3/15 | |
| 8.5 STOCKLAND TRU 150218 | 500 | 515 | 49,468 | 2015/2/18 | |
| FRN GE CAP AUST 180130 | 3.8767 | 500 | 507 | 48,669 | 2018/1/30 |
| 合計 | | | | 1,424,192 | |

(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

2014年6月13日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|-----------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| 公社債 | 千円 1,424,192 | % 97.9 |
| コール・ローン等、その他 | 30,604 | 2.1 |
| 投資信託財産総額 | 1,454,796 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産(1,453,110千円)の投資信託財産総額(1,454,796千円)に対する比率は99.9%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=95.89円 | |
|--------------------|--|

資産、負債、元本および基準価額の状況

2014年6月13日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|---------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 1,454,796,728円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 11,057,846 |
| 公 社 債 (評価額) | 1,424,192,770 |
| 未 収 利 息 | 19,149,703 |
| 前 払 費 用 | 396,409 |
| (B) 負 債 | 612,961 |
| 未 払 解 約 金 | 612,961 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 1,454,183,767 |
| 元 本 | 954,036,841 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 500,146,926 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 954,036,841口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D) | 15,242円 |

損益の状況

(2013年6月14日～2014年6月13日)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 84,481,105円 |
| 受 取 利 息 | 84,289,325 |
| そ の 他 収 益 金 | 191,780 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 66,952,254 |
| 売 買 益 | 91,325,466 |
| 売 買 損 | △ 24,373,212 |
| (C) 保 管 費 用 等 | △ 405,847 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 151,027,512 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 356,568,794 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 31,282 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △ 7,480,662 |
| (H) 計 (D + E + F + G) | 500,146,926 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H) | 500,146,926 |

(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。

<注記事項>

- ①期首元本額 971,144,367円
 期中追加設定元本額 80,292円
 期中一部解約元本額 17,187,818円
 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)
 豪ドル建て社債ファンド (毎月決算型) 954,036,841円

[お知らせ]

委託会社が受益者に通知すべき事項が発生したときには、これを電子公告の方法により行い、「<http://www.am.mufg.jp/>」のアドレスに掲載することとし、信託約款に所要の変更を行いました。なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。(2013年6月21日)