

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（2012年12月7日設定）	
運用方針	AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、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実質的な投資を行い、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。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。マザーファンドの債券等の運用にあたっては、AMP キャピタル・インベスターズ・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。	
主要運用対象	ベビーファンド	AMP オーストラリア・ハイインカム債券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	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。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（毎月決算型）

愛称：カンガルー・ジャンプ



第41期（決算日：2016年5月9日）  
 第42期（決算日：2016年6月7日）  
 第43期（決算日：2016年7月7日）  
 第44期（決算日：2016年8月8日）  
 第45期（決算日：2016年9月7日）  
 第46期（決算日：2016年10月7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（毎月決算型）（愛称：カンガルー・ジャンプ）」は、去る10月7日に第46期の決算を行いましたので、法令に基づいて第41期～第46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  
 URL:<http://www.am.mufg.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。

# ◆目次

## 三菱UFJ/AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド（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と市況等の推移	2
◇運用経過	3
◇今後の運用方針	9
◇1万口当たりの費用明細	10
◇売買及び取引の状況	11
◇利害関係人との取引状況等	11
◇組入資産の明細	11
◇投資信託財産の構成	12
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	12
◇損益の状況	13
◇分配金のお知らせ	14
◇お知らせ	14

## マザーファンドのご報告

◇AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド	15
------------------------------	----

## 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 組 入 比	券 率 率	債 先 物 比	券 率 率	純 資 産 総 額
		税 分	込 配	み 期 金 騰 落					
	円		円		%	%	%	百万円	
17期(2014年5月7日)	10,700		60		0.1	93.5	0.8	4,224	
18期(2014年6月9日)	10,808		60		1.6	96.1	△ 0.3	4,249	
19期(2014年7月7日)	10,840		60		0.9	95.1	△ 4.2	4,522	
20期(2014年8月7日)	10,785		60		0.0	93.3	△ 8.1	4,826	
21期(2014年9月8日)	11,086		60		3.3	94.4	△ 7.4	5,752	
22期(2014年10月7日)	10,705		60		△2.9	95.3	△16.2	6,202	
23期(2014年11月7日)	11,054		60		3.8	97.2	△ 5.3	6,920	
24期(2014年12月8日)	11,352		60		3.2	94.9	△ 1.3	7,143	
25期(2015年1月7日)	10,807		60		△4.3	94.3	△ 1.7	7,407	
26期(2015年2月9日)	10,425		60		△3.0	95.1	△ 1.9	7,530	
27期(2015年3月9日)	10,489		60		1.2	97.3	△ 1.2	7,814	
28期(2015年4月7日)	10,230		60		△1.9	96.2	△ 1.5	8,360	
29期(2015年5月7日)	10,530		60		3.5	96.9	△ 0.8	8,579	
30期(2015年6月8日)	10,554		60		0.8	98.1	△ 4.2	8,485	
31期(2015年7月7日)	10,102		60		△3.7	95.2	△ 2.8	8,139	
32期(2015年8月7日)	10,060		60		0.2	95.4	△ 0.9	8,166	
33期(2015年9月7日)	9,063		60		△9.3	96.6	△ 0.6	7,186	
34期(2015年10月7日)	9,373		60		4.1	96.5	△ 0.6	7,283	
35期(2015年11月9日)	9,383		60		0.7	97.3	△ 0.6	7,196	
36期(2015年12月7日)	9,655		60		3.5	96.2	△ 0.7	7,268	
37期(2016年1月7日)	8,981		60		△6.4	96.2	△ 1.1	6,548	
38期(2016年2月8日)	8,828		60		△1.0	95.2	△ 0.0	6,388	
39期(2016年3月7日)	8,873		60		1.2	94.2	△ 2.2	6,363	
40期(2016年4月7日)	8,815		60		0.0	94.7	△ 1.8	6,284	
41期(2016年5月9日)	8,408		60		△3.9	97.3	△ 3.6	5,865	
42期(2016年6月7日)	8,402		60		0.6	93.6	△ 0.1	5,917	
43期(2016年7月7日)	8,063		60		△3.3	93.7	0.3	5,650	
44期(2016年8月8日)	8,218		60		2.7	93.6	△ 3.8	5,766	
45期(2016年9月7日)	8,202		60		0.5	95.5	△ 1.6	5,796	
46期(2016年10月7日)	8,188		60		0.6	90.9	△ 0.7	5,925	

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 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と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
			騰 落 率	騰 落 率		
第41期	(期 首) 2016年4月7日	円 8,815	% —	% —	% 94.7	% △1.8
	4月末	8,816	0.0		97.4	△6.0
	(期 末) 2016年5月9日	8,468	△3.9		97.3	△3.6
第42期	(期 首) 2016年5月9日	8,408	—		97.3	△3.6
	5月末	8,498	1.1		93.4	△3.9
	(期 末) 2016年6月7日	8,462	0.6		93.6	△0.1
第43期	(期 首) 2016年6月7日	8,402	—		93.6	△0.1
	6月末	8,170	△2.8		93.1	0.1
	(期 末) 2016年7月7日	8,123	△3.3		93.7	0.3
第44期	(期 首) 2016年7月7日	8,063	—		93.7	0.3
	7月末	8,361	3.7		92.9	△4.7
	(期 末) 2016年8月8日	8,278	2.7		93.6	△3.8
第45期	(期 首) 2016年8月8日	8,218	—		93.6	△3.8
	8月末	8,243	0.3		91.4	△2.1
	(期 末) 2016年9月7日	8,262	0.5		95.5	△1.6
第46期	(期 首) 2016年9月7日	8,202	—		95.5	△1.6
	9月末	8,118	△1.0		92.6	△0.3
	(期 末) 2016年10月7日	8,248	0.6		90.9	△0.7

(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。

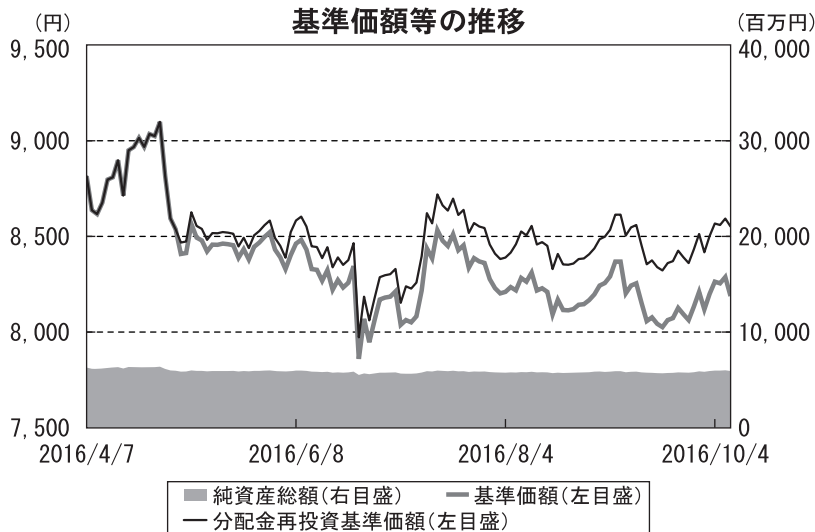
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## 運用経過

当作成期中の基準価額等の推移について （第41期～第46期：2016/4/8～2016/10/7）

基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ3.0%（分配金再投資ベース）の下落となりました。



第41期首 : 8,815円  
 第46期末 : 8,188円  
 (既払分配金 360円)  
 騰落率 : -3.0%  
 (分配金再投資ベース)

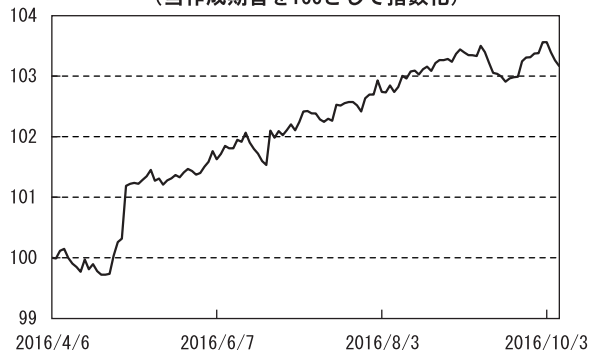
- ・分配金再投資基準価額は、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- ・実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なるため、お客さまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

## 基準価額の変動要因

上昇要因	豪州社債市況が上昇したことなど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などが基準価額の下落要因となりました。

## 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)



ーブルームバーグオーストラリア債券(Credit)インデックス

(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・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」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。ブルームバーグおよびブルームバーグオーストラリア債券（Credit）インデックスは、ブルームバーグ・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。ブルームバーグは、ブルームバーグ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。

(第41期～第46期：2016/4/8～2016/10/7)

### ◎債券市況

・2016年5月上旬にRBA（豪州連邦準備銀行）が利下げを決定しインフレ率見通しを下方修正したこと、英国のEU（欧州連合）離脱の影響が懸念されたことなどを受けて、豪州金利は低下（債券価格は上昇）しました。この間、原油をはじめとした国際商品市況が上昇したことなどを背景に投資家のリスク回避姿勢が後退し、スプレッド（国債に対する上乘せ金利）が縮小したこともプラス要因となり、豪州社債市況は上昇しました。

為替市況の推移  
(当作成期首を100として指数化)



◎為替市況

- ・2016年5月上旬にRBAが利下げを決定しインフレ率見通しを下方修正したこと、4月下旬や7月下旬に日銀が決定した金融政策が市場の期待を下回る内容であったことなどを受けて、豪ドルは対円で下落しました。

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（毎月決算型）>

- ・AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド受益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および劣後債などのハイブリッド証券を高位に組み入れる運用を行いました。

<AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド>

基準価額は当作成期首に比べ2.3%の下落となりました。

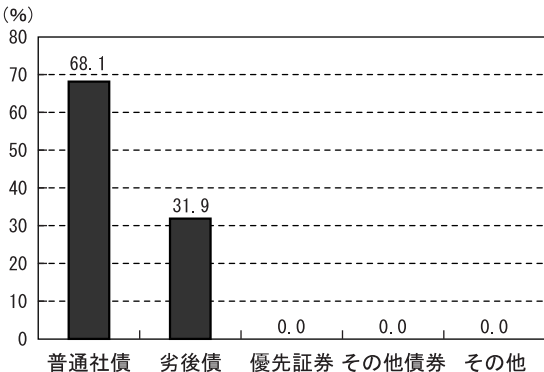
- ・オーストラリアの企業が発行する普通社債および劣後債などのハイブリッド証券を高位に組み入れる運用を行いました。
- ・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）については、概ね市場平均と比べてやや短めの水準としました。また、債券種別配分については、相対的に魅力度が高いと考えられるハイブリッド証券を組み入れました。

前記のような運用を行った結果、豪州社債市況が上昇したことなどがプラスとなったものの、豪ドルが対円で下落したことなどがマイナスとなり、基準価額は当作成期首と比べて下落しました。

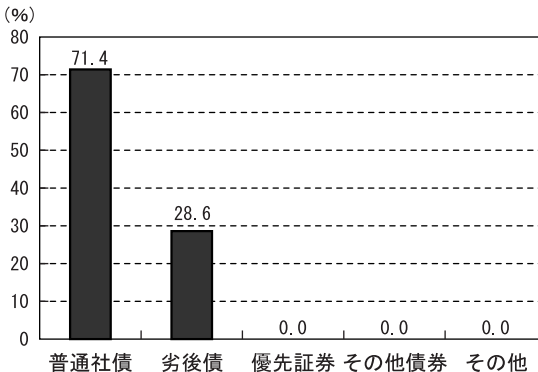
（ご参考）

種別構成比

作成期首（2016年4月7日）



作成期末（2016年10月7日）



（注）比率は現物債券等評価額に対する割合です。

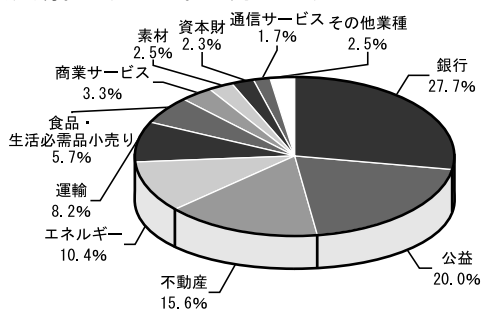
（注）その他債券は、国債等です。

（注）その他は、債券および優先証券以外の証券です。

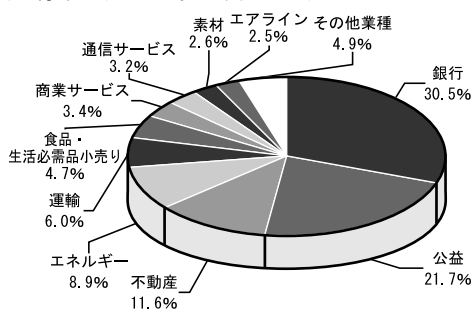
（ご参考）

業種別構成比

作成期首（2016年4月7日）



作成期末（2016年10月7日）



（注）比率は現物債券評価額に対する割合です。

（注）業種分類は、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（保証会社）について独自に分類したものです。



（ご参考）

利回り・デュレーション

作成期首前営業日（現地2016年4月6日）

最終利回り	4.3%
直接利回り	5.3%
デュレーション	3.3年

作成期末前営業日（現地2016年10月6日）

最終利回り	3.2%
直接利回り	4.8%
デュレーション	3.0年



- ・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（2016年4月7日）

格付種類	比率	銘柄数
AAA格	0.0%	0
AA格	12.5%	8
A格	32.5%	19
BBB格	41.4%	24
BB格以下	8.6%	3
無格付	0.0%	0

作成期末（2016年10月7日）

格付種類	比率	銘柄数
AAA格	0.0%	0
AA格	16.3%	10
A格	33.8%	18
BBB格	30.9%	19
BB格以下	10.4%	4
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。
  - ・AAA格（AAA、Aaa）
  - ・AA格（AA+、AA、AA-、Aa1、Aa2、Aa3）
  - ・A格（A+、A、A-、A1、A2、A3）
  - ・BBB格（BBB+、BBB、BBB-、Baa1、Baa2、Baa3）
  - ・BB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。
- ・格付の表示にあたっては、S&P社、Moody's社、フィッチ・レーティングス社の3社のうち2番めに高い格付を採用します。2社の格付のみの場合には、低い方の格付を採用、1社の格付のみの場合にはその格付を採用します。
- ・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。

### 当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・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41期	第42期	第43期	第44期	第45期	第46期
	2016年4月8日～ 2016年5月9日	2016年5月10日～ 2016年6月7日	2016年6月8日～ 2016年7月7日	2016年7月8日～ 2016年8月8日	2016年8月9日～ 2016年9月7日	2016年9月8日～ 2016年10月7日
当期分配金 (対基準価額比率)	60 0.709%	60 0.709%	60 0.739%	60 0.725%	60 0.726%	60 0.727%
当期の収益	28	27	25	32	25	27
当期の収益以外	31	32	35	27	35	32
翌期繰越分配対象額	1,556	1,524	1,491	1,463	1,429	1,398

（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

＜三菱UFJ／AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド（毎月決算型）＞

### ◎今後の運用方針

- ・AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド受益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および劣後債などのハイブリッド証券を高位に組み入れ、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざす運用を行います。

＜AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド＞

### ◎運用環境の見通し

- ・世界経済は、短期的には中国など新興国経済の先行き不透明感や英国のEU離脱の影響が懸念されるものの、中長期的には米国主導で緩やかながらも回復が続くと予想しています。欧州では一部の経済指標に改善の兆しが見られます。こうした環境は、引き続き豪州企業のファンダメンタルズにとってもプラスに働くと考えます。豪州経済においては、鉱業部門を中心とした投資ブーム終了後の景気動向が注目されるものの、個人消費などの内需が堅調に推移していることは、豪州社債市況のサポート要因になると見ています。クレジットスプレッド（信用力格差による国債に対する上乘せ金利）は、豪州企業の良いファンダメンタルズを背景に、さらに縮小する余地があると見ています。また、豪州社債市場において、引き続き投資家の旺盛な需要がみられることも豪州社債市況にとってのプラス要因になると考えます。

### ◎今後の運用方針

- ・債券種別については、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、市場平均対比やや短めの水準としていますが、今後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。

## ○ 1万口当たりの費用明細

（2016年4月8日～2016年10月7日）

項 目	第41期～第46期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 ( 投 信 会 社 ) ( 販 売 会 社 ) ( 受 託 会 社 )	63 (37) (25) ( 2 )	0.756 (0.437) (0.297) (0.022)	(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) 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 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 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) 売 買 委 託 手 数 料 ( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	0 ( 0 )	0.003 (0.003)	(b) 売買委託手数料＝作成期中の売買委託手数料÷作成期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(c) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 ) ( 監 査 費 用 ) ( そ の 他 )	2 ( 1 ) ( 0 ) ( 0 )	0.019 (0.016) (0.002) (0.000)	(c) 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 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 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 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	65	0.778	
作成期中の平均基準価額は、8,367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) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を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

(2016年4月8日～2016年10月7日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第41期～第46期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド	123,936	138,000	324,276	370,000

## ○利害関係人との取引状況等

(2016年4月8日～2016年10月7日)

## 利害関係人との取引状況

<三菱UFJ/AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド（毎月決算型）>

該当事項はございません。

<AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド>

区 分	第41期～第46期					
	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		
	百万円	%	百万円	百万円	%	
為替直物取引	7,348	—	7,586	59	0.8	

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信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2016年10月7日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	第40期末		第46期末	
	口 数		評 価 額	
	千口	千円	千口	千円
AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド	5,403,413		5,203,073	5,892,480

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

（2016年10月7日現在）

項 目	第46期末	
	評 価 額	比 率
AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド	千円 5,892,480	% 98.6
コール・ローン等、その他	83,281	1.4
投資信託財産総額	5,975,761	100.0

(注) AMP オーストラリア・ハイインカム債券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（5,885,652千円）の投資信託財産総額（5,911,577千円）に対する比率は99.6%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 アメリカドル=103.75円	1 ユーロ=115.50円	1 オーストラリアドル=78.50円
------------------	---------------	--------------------

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第41期末	第42期末	第43期末	第44期末	第45期末	第46期末
	2016年5月9日現在	2016年6月7日現在	2016年7月7日現在	2016年8月8日現在	2016年9月7日現在	2016年10月7日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	5,915,971,791	5,970,306,499	5,733,375,241	5,816,496,655	5,849,677,729	5,975,761,470
コール・ローン等	33,217,932	62,484,110	67,679,235	72,958,877	77,015,738	83,280,535
AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド(信託)	5,832,753,859	5,907,822,389	5,625,696,006	5,743,537,778	5,772,661,991	5,892,480,935
未収入金	50,000,000	—	40,000,000	—	—	—
(B) 負債	50,156,570	53,040,871	83,269,151	50,127,947	53,225,140	50,650,790
未払収益分配金	41,858,108	42,253,793	42,042,355	42,102,962	42,405,275	43,416,072
未払解約金	62,473	3,650,311	34,029,921	263,520	3,584,345	—
未払信託報酬	8,211,283	7,115,314	7,175,241	7,738,163	7,213,782	7,213,054
未払利息	64	99	118	98	107	35
その他未払費用	24,642	21,354	21,516	23,204	21,631	21,629
(C) 純資産総額(A-B)	5,865,815,221	5,917,265,628	5,650,106,090	5,766,368,708	5,796,452,589	5,925,110,680
元本	6,976,351,414	7,042,298,876	7,007,059,234	7,017,160,362	7,067,545,882	7,236,012,161
次期繰越損益金	△1,110,536,193	△1,125,033,248	△1,356,953,144	△1,250,791,654	△1,271,093,293	△1,310,901,481
(D) 受益権総口数	6,976,351,414口	7,042,298,876口	7,007,059,234口	7,017,160,362口	7,067,545,882口	7,236,012,161口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,408円	8,402円	8,063円	8,218円	8,202円	8,188円

## ○損益の状況

項 目	第41期	第42期	第43期	第44期	第45期	第46期
	2016年4月8日～ 2016年5月9日	2016年5月10日～ 2016年6月7日	2016年6月8日～ 2016年7月7日	2016年7月8日～ 2016年8月8日	2016年8月9日～ 2016年9月7日	2016年9月8日～ 2016年10月7日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 1,334	△ 2,396	△ 1,964	△ 1,898	△ 2,095	△ 2,207
受取利息	—	50	47	28	—	192
支払利息	△ 1,334	△ 2,446	△ 2,011	△ 1,926	△ 2,095	△ 2,399
(B) 有価証券売買損益	△ 233,673,986	44,898,141	△ 186,491,944	156,052,353	38,913,468	42,739,373
売買益	3,264,214	45,072,542	2,657,592	157,850,342	39,190,688	42,777,781
売買損	△ 236,938,200	△ 174,401	△ 189,149,536	△ 1,797,989	△ 277,220	△ 38,408
(C) 信託報酬等	△ 8,235,925	△ 7,136,650	△ 7,196,757	△ 7,761,367	△ 7,235,413	△ 7,234,683
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 241,911,245	37,759,095	△ 193,690,665	148,289,088	31,675,960	35,502,483
(E) 前期繰越損益金	△ 1,189,613,040	△ 1,462,870,945	△ 1,438,056,606	△ 1,630,165,447	△ 1,479,327,842	△ 1,443,897,070
(F) 追加信託差損益金	362,846,200	342,332,395	316,836,482	273,187,667	218,963,864	140,909,178
(配当等相当額)	( 1,063,801,808)	( 1,074,282,305)	( 1,068,461,275)	( 1,045,696,773)	( 1,034,336,371)	( 1,034,064,570)
(売買損益相当額)	(△ 700,955,608)	(△ 731,949,910)	(△ 751,624,793)	(△ 772,509,106)	(△ 815,372,507)	(△ 893,155,392)
(G) 計(D+E+F)	△ 1,068,678,085	△ 1,082,779,455	△ 1,314,910,789	△ 1,208,688,692	△ 1,228,688,018	△ 1,267,485,409
(H) 収益分配金	△ 41,858,108	△ 42,253,793	△ 42,042,355	△ 42,102,962	△ 42,405,275	△ 43,416,072
次期繰越損益金(G+H)	△ 1,110,536,193	△ 1,125,033,248	△ 1,356,953,144	△ 1,250,791,654	△ 1,271,093,293	△ 1,310,901,481
追加信託差損益金	362,846,200	341,628,165	292,311,775	254,241,334	194,227,453	117,753,940
(配当等相当額)	( 1,063,858,683)	( 1,073,834,948)	( 1,044,183,246)	( 1,026,958,306)	( 1,009,978,379)	( 1,011,546,300)
(売買損益相当額)	(△ 701,012,483)	(△ 732,206,783)	(△ 751,871,471)	(△ 772,716,972)	(△ 815,750,926)	(△ 893,792,360)
分配準備積立金	22,138,634	1,308	647,225	187,702	289,660	276,339
繰越損益金	△ 1,495,521,027	△ 1,466,662,721	△ 1,649,912,144	△ 1,505,220,690	△ 1,465,610,406	△ 1,428,931,760

(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。

## &lt;注記事項&gt;

- ①作成期首（前作成期末）元本額 7,129,073,672円  
 作成期中追加設定元本額 781,314,702円  
 作成期中一部解約元本額 674,376,213円  
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.8188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1,310,901,481円です。

③分配金の計算過程

項 目	2016年4月8日～ 2016年5月9日	2016年5月10日～ 2016年6月7日	2016年6月8日～ 2016年7月7日	2016年7月8日～ 2016年8月8日	2016年8月9日～ 2016年9月7日	2016年9月8日～ 2016年10月7日
費用控除後の配当等収益額	19,591,559円	19,570,179円	18,163,592円	22,704,602円	17,774,026円	20,251,747円
費用控除後・繰越欠損金繰戻後の有価証券売買等損益額	—円	—円	—円	—円	—円	—円
収益調整金額	1,063,858,683円	1,074,539,178円	1,068,707,953円	1,045,904,639円	1,034,714,790円	1,034,701,538円
分配準備積立金額	44,405,183円	21,980,692円	1,281円	639,729円	184,498円	285,426円
当ファンドの分配対象収益額	1,127,855,425円	1,116,090,049円	1,086,872,826円	1,069,248,970円	1,052,673,314円	1,055,238,711円
1万口当たり収益分配対象額	1,616円	1,584円	1,551円	1,523円	1,489円	1,458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	41,858,108円	42,253,793円	42,042,355円	42,102,962円	42,405,275円	43,416,072円

- ④「AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の44以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

## ○分配金のお知らせ

	第41期	第42期	第43期	第44期	第45期	第46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（<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。



## AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド

## 《第4期》決算日2016年10月7日

[計算期間：2015年10月8日～2016年10月7日]

「AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド」は、10月7日に第4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4期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	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。 債券等への投資にあたっては、高水準のインカム収入を確保しつつ、マクロ要因分析、業種分析、個別企業の財務・業績分析等の信用リスク分析に基づき割安度を評価し、銘柄選定を行います。 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。また、ファンドの流動性等を勘案して、一部、国債等に投資する場合があります。 オーストラリア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、実質的にオーストラリアドル建てとなるように外国為替予約取引等を行います。 債券等の運用にあたっては、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。 組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジは行いません。
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		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	円	騰落中率 %			
(設定日) 2012年12月7日	10,000	—	—	—	百万円 13,326
1期(2013年10月7日)	11,005	10.1	94.0	△ 0.6	4,677
2期(2014年10月7日)	12,344	12.2	96.2	△16.3	6,141
3期(2015年10月7日)	11,757	△ 4.8	97.0	△ 0.6	7,244
4期(2016年10月7日)	11,325	△ 3.7	91.4	△ 0.7	5,892

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 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) 「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	騰 落 率	債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
			%	%
(期 首) 2015年10月 7 日	円 11,757	% —	% 97.0	% △0.6
10月末	11,797	0.3	96.1	△0.4
11月末	12,034	2.4	96.0	△0.6
12月末	12,062	2.6	96.1	△0.4
2016年1月末	11,710	△0.4	96.2	△0.9
2月末	11,158	△5.1	95.0	0.1
3月末	11,933	1.5	93.9	△1.4
4月末	11,597	△1.4	97.9	△6.0
5月末	11,272	△4.1	94.1	△4.0
6月末	10,927	△7.1	93.9	0.1
7月末	11,281	△4.0	93.8	△4.8
8月末	11,218	△4.6	92.6	△2.2
9月末	11,140	△5.2	93.3	△0.3
(期 末) 2016年10月 7 日	11,325	△3.7	91.4	△0.7

(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3.7%の下落となりました。

基準価額の推移



## ●投資環境について

## ◎債券市況

・期首から2016年2月中旬にかけては、原油をはじめとした国際商品市況が下落したことや中国経済に対する懸念の高まりなどを背景に株式市況が下落したこと、5月上旬にRBA（豪州連邦準備銀行）が利下げを決定しインフレ率見通しを下方修正したこと、英国のEU（欧州連合）離脱の影響が懸念されたことなどを受けて、豪州金利が低下（債券価格は上昇）したことから、豪州社債市況は上昇しました。

## ◎為替市況

・期首から2016年2月中旬にかけては、原油をはじめとした国際商品市況が下落したことや中国経済に対する懸念の高まりなどを背景に株式市況が下落したこと、5月上旬にRBAが利下げを決定しインフレ率見通しを下方修正したこと、4月下旬や7月下旬に日銀が決定した金融政策

が市場の期待を下回る内容であったことなどを  
受けて、豪ドルは対円で下落しました。

- 当該投資信託のポートフォリオについて
  - ・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などのハイブリッド証券を高位に組み入れる運用を行いました。
  - ・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）については、機動的に対応し、期首から2016年3月上旬にかけては、短期的には中国をはじめとした新興国経済の低迷などが豪州金利の低下圧力となるとの見方から、概ね市場平均と比べて長めの水準としました。4月中旬から期末にかけては、豪州金利が低下したことを受けて概ね市場平均と比べてやや短めの水準としました。また、債券種別配分については、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ました。
  - ・前記のような運用を行った結果、豪州社債市況が上昇したことなどがプラスとなったものの、豪ドルが対円で下落したことなどがマイナスとなり、基準価額は期首と比べて下落しました。

## ○今後の運用方針

### ◎運用環境の見通し

- ・世界経済は、短期的には中国など新興国経済の

先行き不透明感や英国のEU離脱の影響が懸念されるものの、中長期的には米国主導で緩やかながらも回復が続くと予想しています。欧州では一部の経済指標に改善の兆しが見られます。こうした環境は、引き続き豪州企業のファンダメンタルズにとってもプラスに働くと考えます。豪州経済においては、鉱業部門を中心とした投資ブーム終了後の景気動向が注目されるものの、個人消費などの内需が堅調に推移していることは、豪州社債市況のサポート要因になると見えています。クレジットスプレッド（信用力格差による国債に対する上乗せ金利）は、豪州企業の良好なファンダメンタルズを背景に、さらに縮小する余地があると見えています。また、豪州社債市場において、引き続き投資家の旺盛な需要がみられることも豪州社債市況にとってのプラス要因になると考えます。

### ◎今後の運用方針

- ・債券種別については、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、市場平均対比やや短めの水準としていますが、今後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。

## ○1万口当たりの費用明細

(2015年10月8日～2016年10月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 1 (1)	% 0.006 (0.006)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 ) ( そ の 他 )	4 (4) (0)	0.036 (0.035) (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	5	0.042	
期中の平均基準価額は、11,510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

(2015年10月8日～2016年10月7日)

## 公社債

			買 付 額	売 付 額
外	アメリカ	社債券	千アメリカドル —	千アメリカドル 3,047 ( 2,300)
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
国	オーストラリア	社債券	—	912
	オーストラリア	社債券	千オーストラリアドル 16,076	千オーストラリアドル 13,633 ( 5,700)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

## 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	債券先物取引	百万円 6,511	百万円 6,911	百万円 5,921	百万円 6,182

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月の月初から決算日までの分については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2015年10月8日～2016年10月7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	$\frac{B}{A}$	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 21,272	百万円 —	% —	百万円 22,400	百万円 414	% 1.8

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

(2016年10月7日現在)

## 外国公社債

## (A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	額面金額	当 期		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		評 価 額				5年以上	2年以上	2年未満
		外貨建金額	邦貨換算金額					
アメリカ	千アメリカドル 2,885	千アメリカドル 3,077	千円 319,283	% 5.4	% —	% 2.7	% 2.7	% —
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
オーストラリア	950	987	114,047	1.9	1.9	1.9	—	—
オーストラリア	千オーストラリアドル 59,841	千オーストラリアドル 63,054	4,949,803	84.0	8.5	28.7	49.6	5.7
合 計	—	—	5,383,134	91.4	10.4	33.4	52.2	5.7

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 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	銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	社債券					
	4.6 WOODSIDE FINA 210510	4.6	635	675	70,117	2021/5/10
	5.125 SYDNEY AIRP 210222	5.125	750	840	87,164	2021/2/22
	6 GOODMAN FUNDING 220322	6.0	300	347	36,047	2022/3/22
	VAR AUST & NZ BAN 220808	3.45	1,200	1,214	125,953	2022/8/8
小	計				319,283	
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ		
	オーストラリア 社債券					
	STEP SANTOS FINAN 700922	8.25	950	987	114,047	2070/9/22
小	計				114,047	
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		
	社債券					
	3 BHP BILLITON FI 200330	3.0	1,300	1,305	102,484	2020/3/30
	3.25 AUST & NZ B 210407	3.25	1,000	1,019	80,060	2021/4/7
	3.25 MACQUARIE BA 200303	3.25	1,200	1,215	95,378	2020/3/3
	3.25 WESTPAC BAN 200122	3.25	1,000	1,021	80,149	2020/1/22
	3.5 UNITED ENER 230912	3.5	500	494	38,784	2023/9/12
	3.5 WESTPAC BAN 200728	3.5	700	721	56,600	2020/7/28
	3.75 BHP BILLITON 171018	3.75	500	505	39,697	2017/10/18
	3.75 COMMONWEALTH 191018	3.75	2,000	2,069	162,491	2019/10/18
	4 NATIONAL A 180523	4.0	700	718	56,440	2018/5/23
	4.25 DEXUS WHOLE 220616	4.25	700	734	57,675	2022/6/16
	4.25 ENERGY PARTN 200615	4.25	900	909	71,414	2020/6/15
	4.25 NATIONAL AUS 190520	4.25	2,200	2,299	180,480	2019/5/20
	4.5 AUST GAS NETW 211217	4.5	900	942	73,991	2021/12/17
	4.5 DOWNER GROUP 220311	4.5	800	802	63,002	2022/3/11
	4.5 SCENTRE MGMT 210908	4.5	1,200	1,270	99,747	2021/9/8
	4.5 TELSTRA CORP 181113	4.5	2,100	2,182	171,324	2018/11/13
	5 AGL ENERGY LTD 211105	5.0	1,900	2,021	158,699	2021/11/5
	5 ALE DIRECT PROP 200820	5.0	1,000	1,045	82,103	2020/8/20
	5 AUSTRALIA PACIF 200604	5.0	610	653	51,329	2020/6/4
	5.5 SGSP AUST 210312	5.5	1,500	1,632	128,131	2021/3/12
	5.75 DOWNER GROUP 181129	5.75	1,500	1,559	122,400	2018/11/29
	5.75 MIRVAC GR 200918	5.75	1,000	1,093	85,824	2020/9/18
	6 BRISBANE AIRPOR 201021	6.0	1,000	1,103	86,641	2020/10/21
	6 DBNGP FINANCE 191011	6.0	1,500	1,596	125,331	2019/10/11
	6 NATIONAL AUSTR 170215	6.0	1,000	1,013	79,576	2017/2/15
	6 WOOLWORTHS LIM 190321	6.0	700	748	58,759	2019/3/21
	6.25 WESFARMERS 190328	6.25	1,500	1,621	127,250	2019/3/28
	6.75 MACQUARIE UN 200909	6.75	500	580	45,579	2020/9/9
	7.25 CALTEX AUST 181123	7.25	500	544	42,779	2018/11/23
	7.25 COMMONWEALTH 200205	7.25	1,900	2,181	171,268	2020/2/5
	7.25 WESTPAC BANK 200211	7.25	500	574	45,098	2020/2/11
	7.5 AUSNET SERVIC 170925	7.5	500	522	41,012	2017/9/25
	7.5 AUSNET SERVIC 210401	7.5	1,500	1,757	137,935	2021/4/1
	7.5 QANTAS AIRWAY 210611	7.5	1,500	1,718	134,865	2021/6/11
	7.75 APT PIPELINE 200722	7.75	1,500	1,729	135,787	2020/7/22

銘柄	銘柄	利率	当期		期末		償還年月日
			額面金額	評価額			
				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		
	社債券						
	8 BRISBANE AIRPOR 190709	8.0	1,100	1,242	97,536	2019/7/9	
	8.25 STOCKLAND TR 201125	8.25	1,500	1,796	141,015	2020/11/25	
	8.75 DEXUS FINANC 170421	8.75	1,500	1,548	121,519	2017/4/21	
	FRN APT PIPELINES 720930	6.23	3,186	3,262	256,106	2072/9/30	
	FRN AUST & NZ BAN 230619	3.93	700	712	55,935	2023/6/19	
	FRN CALTEX AUST 370915	6.24	3,125	3,185	250,094	2037/9/15	
	FRN CROWN LTD PLA 700423	5.7433	743	649	50,946	2075/4/23	
	FRN INSURANCE 400319	4.53	500	508	39,886	2040/3/19	
	FRN WESTPAC BANK 220823	4.475	3,158	3,188	250,273	2022/8/23	
	FRN WOOLWORTHS 361124	4.98	2,443	2,449	192,259	2036/11/24	
	FRN(IN)AUST&NZBAN 220620	4.485	2,574	2,600	204,129	2022/6/20	
小	計				4,949,803		
合	計				5,383,134		

(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。

### 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	銘柄	別	当期		期末	
			買建額	売建額	買建額	売建額
			百万円		百万円	
外国	債券先物取引	EU SCTZ		—		38
		NOTE5Y		75		—
		EU BOBL		—		60
		NOTE2Y		—		995
		NOTE10Y		26		—
		AUST10Y		856		—
		AUST3Y		97		—

(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

(2016年10月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 5,383,134	% 91.1
コール・ローン等、その他	528,443	8.9
投資信託財産総額	5,911,577	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (5,885,652千円) の投資信託財産総額 (5,911,577千円) に対する比率は99.6%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 アメリカドル=103.75円	1 ユーロ=115.50円	1 オーストラリアドル=78.50円
------------------	---------------	--------------------

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年10月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,736,849,249
コール・ローン等	393,330,919
公社債(評価額)	5,383,134,944
未収入金	834,223,613
未収利息	53,306,856
前払費用	2,450,074
差入委託証拠金	70,402,843
(B) 負債	844,331,091
未払金	844,331,086
未払利息	5
(C) 純資産総額(A-B)	5,892,518,158
元本	5,203,073,674
次期繰越損益金	689,444,484
(D) 受益権総口数	5,203,073.674口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,325円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 6,161,766,401円  
期中追加設定元本額 123,936,595円  
期中一部解約元本額 1,082,629,322円  
また、1口当たり純資産額は、期末1.1325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/AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド (毎月決算型) 5,203,073,674円

## ○損益の状況 (2015年10月8日~2016年10月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	320,305,575
受取利息	320,391,496
その他収益金	96,286
支払利息	△ 182,207
(B) 有価証券売買損益	△ 586,354,186
売買益	218,518,717
売買損	△ 804,872,903
(C) 先物取引等取引損益	41,690,495
取引益	88,634,697
取引損	△ 46,944,202
(D) 保管費用等	△ 2,238,540
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 226,596,656
(F) 前期繰越損益金	1,082,348,413
(G) 追加信託差損益金	14,063,405
(H) 解約差損益金	△ 180,370,678
(I) 計(E+F+G+H)	689,444,484
次期繰越損益金(I)	689,444,484

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) (H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。