

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71期（決算日：2018年11月7日）
 第72期（決算日：2018年12月7日）
 第73期（決算日：2019年1月7日）
 第74期（決算日：2019年2月7日）
 第75期（決算日：2019年3月7日）
 第76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（毎月決算型）」は、去る4月8日に第76期の決算を行いましたので、法令に基づいて第71期～第76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。

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 | |
| 47期(2016年11月7日) | 8,242 | | 60 | | 1.4 | 96.2 | △0.8 | 5,955 | |
| 48期(2016年12月7日) | 8,620 | | 60 | | 5.3 | 93.9 | △1.0 | 6,182 | |
| 49期(2017年1月10日) | 8,619 | | 60 | | 0.7 | 94.4 | 0.1 | 6,004 | |
| 50期(2017年2月7日) | 8,609 | | 60 | | 0.6 | 95.1 | △1.3 | 5,997 | |
| 51期(2017年3月7日) | 8,679 | | 60 | | 1.5 | 96.5 | △1.6 | 5,891 | |
| 52期(2017年4月7日) | 8,414 | | 60 | | △2.4 | 97.2 | △1.4 | 5,669 | |
| 53期(2017年5月8日) | 8,336 | | 60 | | △0.2 | 97.1 | △2.2 | 5,571 | |
| 54期(2017年6月7日) | 8,229 | | 60 | | △0.6 | 96.7 | △0.7 | 5,504 | |
| 55期(2017年7月7日) | 8,499 | | 60 | | 4.0 | 96.3 | △2.4 | 5,598 | |
| 56期(2017年8月7日) | 8,666 | | 60 | | 2.7 | 96.2 | △0.7 | 5,613 | |
| 57期(2017年9月7日) | 8,590 | | 60 | | △0.2 | 94.7 | 0.3 | 5,488 | |
| 58期(2017年10月10日) | 8,510 | | 60 | | △0.2 | 96.5 | △8.5 | 5,328 | |
| 59期(2017年11月7日) | 8,537 | | 60 | | 1.0 | 96.5 | △2.4 | 5,138 | |
| 60期(2017年12月7日) | 8,249 | | 60 | | △2.7 | 96.6 | △2.5 | 4,823 | |
| 61期(2018年1月9日) | 8,548 | | 60 | | 4.4 | 94.8 | △0.5 | 4,842 | |
| 62期(2018年2月7日) | 8,236 | | 60 | | △2.9 | 95.3 | △0.5 | 4,614 | |
| 63期(2018年3月7日) | 7,789 | | 60 | | △4.7 | 96.1 | △1.8 | 4,296 | |
| 64期(2018年4月9日) | 7,745 | | 60 | | 0.2 | 92.8 | △4.7 | 4,240 | |
| 65期(2018年5月7日) | 7,666 | | 60 | | △0.2 | 95.4 | △4.5 | 4,180 | |
| 66期(2018年6月7日) | 7,836 | | 60 | | 3.0 | 94.4 | △1.2 | 4,203 | |
| 67期(2018年7月9日) | 7,618 | | 60 | | △2.0 | 92.5 | △5.7 | 4,024 | |
| 68期(2018年8月7日) | 7,561 | | 60 | | 0.0 | 93.6 | △3.3 | 3,948 | |
| 69期(2018年9月7日) | 7,290 | | 60 | | △2.8 | 95.1 | △2.3 | 3,750 | |
| 70期(2018年10月9日) | 7,258 | | 60 | | 0.4 | 95.2 | △3.8 | 3,703 | |
| 71期(2018年11月7日) | 7,392 | | 60 | | 2.7 | 95.5 | △0.5 | 3,749 | |
| 72期(2018年12月7日) | 7,343 | | 40 | | △0.1 | 94.6 | 0.0 | 3,700 | |
| 73期(2019年1月7日) | 6,965 | | 40 | | △4.6 | 94.6 | △3.6 | 3,470 | |
| 74期(2019年2月7日) | 7,050 | | 40 | | 1.8 | 95.0 | △0.1 | 3,498 | |
| 75期(2019年3月7日) | 7,088 | | 40 | | 1.1 | 96.0 | △3.8 | 3,453 | |
| 76期(2019年4月8日) | 7,164 | | 40 | | 1.6 | 95.7 | △0.1 | 3,446 | |

(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 率 | 債 先 物 比 率 |
|-------|------------------------|------------|--------|-------|-----------|-----------|
| | | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| 第71期 | (期 首) 2018年10月 9 日 | 円 7,258 | % — | | % 95.2 | % △3.8 |
| | 10月末 | 7,319 | 0.8 | | 95.6 | △0.8 |
| | (期 末) 2018年11月 7 日 | 7,452 | 2.7 | | 95.5 | △0.5 |
| 第72期 | (期 首) 2018年11月 7 日 | 7,392 | — | | 95.5 | △0.5 |
| | 11月末 | 7,499 | 1.4 | | 94.6 | △1.3 |
| | (期 末) 2018年12月 7 日 | 7,383 | △0.1 | | 94.6 | 0.0 |
| 第73期 | (期 首) 2018年12月 7 日 | 7,343 | — | | 94.6 | 0.0 |
| | 12月末 | 7,061 | △3.8 | | 94.4 | △4.4 |
| | (期 末) 2019年 1 月 7 日 | 7,005 | △4.6 | | 94.6 | △3.6 |
| 第74期 | (期 首) 2019年 1 月 7 日 | 6,965 | — | | 94.6 | △3.6 |
| | 1 月末 | 7,134 | 2.4 | | 95.6 | △0.8 |
| | (期 末) 2019年 2 月 7 日 | 7,090 | 1.8 | | 95.0 | △0.1 |
| 第75期 | (期 首) 2019年 2 月 7 日 | 7,050 | — | | 95.0 | △0.1 |
| | 2 月末 | 7,196 | 2.1 | | 95.1 | 2.1 |
| | (期 末) 2019年 3 月 7 日 | 7,128 | 1.1 | | 96.0 | △3.8 |
| 第76期 | (期 首) 2019年 3 月 7 日 | 7,088 | — | | 96.0 | △3.8 |
| | 3 月末 | 7,190 | 1.4 | | 95.6 | △0.2 |
| | (期 末) 2019年 4 月 8 日 | 7,204 | 1.6 | | 95.7 | △0.1 |

(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71期～第76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71期首 | 7,258円 |
| 第76期末 | 7,164円 |
| 既払分配金 | 260円 |
| 騰落率 | 2.3% |
| (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2.3%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

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。

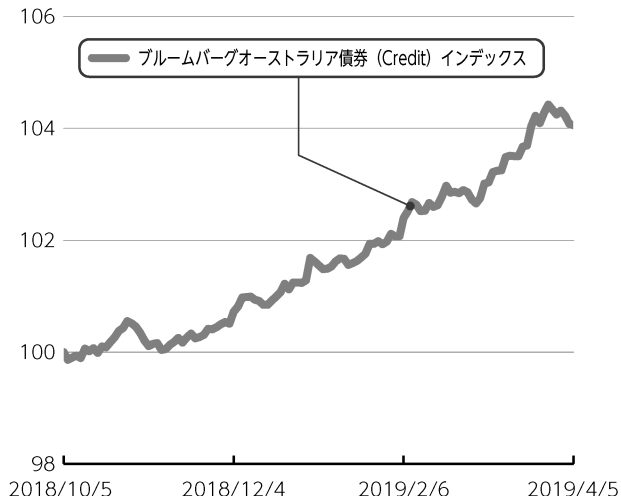
下落要因

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71期～第76期：2018年10月10日～2019年4月8日

投資環境について

市況の推移（当作成期首を100として指数化）



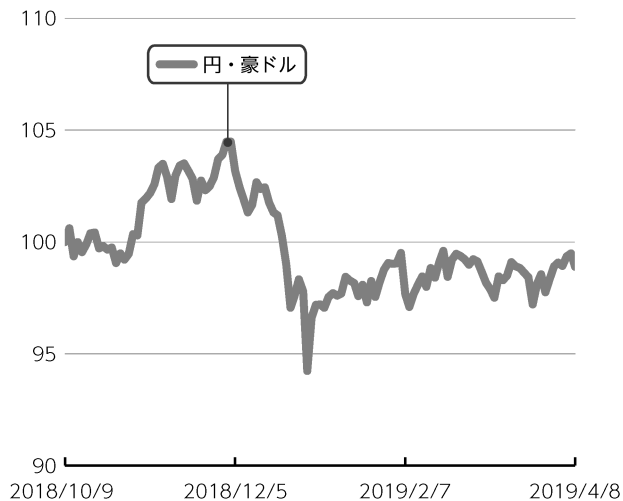
債券市況

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、レビューし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。

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。

▶ 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等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3.1%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運用を行いました。

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、実質的に豪ドル建てとなるように外国為替予約取引等を行っています。

また、デュレーション（平均回収期間や金利感応度）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。

デュレーションについては、2019年3月末時点において市場平均と比べて短めとしました。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、豪州社債市況が上昇したこと等がプラスとなり、基準価額は当作成期首と比べて上昇しました。

(ご参考)

■種別組入比率

2019年3月末

| 種別 | 比率 |
|-------|-------|
| 普通社債 | 77.6% |
| 劣後債 | 22.4% |
| 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。

(ご参考)

■組入上位10業種

2019年3月末

| | 業種 | 比率 |
|----|------------|-------|
| 1 | 銀行 | 34.0% |
| 2 | 公益 | 17.0% |
| 3 | 工業 | 15.3% |
| 4 | 不動産 | 9.0% |
| 5 | 素材 | 6.4% |
| 6 | 一般消費財・サービス | 5.2% |
| 7 | 通信サービス | 4.6% |
| 8 | エネルギー | 3.6% |
| 9 | 生活必需品 | 2.2% |
| 10 | 保険 | 1.4% |

- ・比率は現物債券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（保証会社）について独自に分類しています。

(ご参考)

■ ポートフォリオ特性

2019年3月末

| | ファンド |
|---------|------|
| 最終利回り | 2.8% |
| 直接利回り | 4.3% |
| 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。

（ご参考）

■債券格付分布

2019年3月末

| 格付種類 | 比率 |
|-------|-------|
| AAA格 | 1.3% |
| AA格 | 15.4% |
| A格 | 31.0% |
| BBB格 | 48.6% |
| BB格以下 | 0.3% |
| 無格付 | 0.0% |

- ・比率はベビーファンド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。

▶ 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、1万口当たり、税込み)

| 項目 | 第71期 2018年10月10日~ 2018年11月7日 | 第72期 2018年11月8日~ 2018年12月7日 | 第73期 2018年12月8日~ 2019年1月7日 | 第74期 2019年1月8日~ 2019年2月7日 | 第75期 2019年2月8日~ 2019年3月7日 | 第76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 (0.805%) | 40 (0.542%) | 40 (0.571%) | 40 (0.564%) | 40 (0.561%) | 40 (0.555%) |
| 当期の収益 | 23 | 17 | 16 | 23 | 21 | 25 |
| 当期の収益以外 | 36 | 23 | 23 | 16 | 19 | 15 |
| 翌期繰越分配対象額 | 536 | 513 | 490 | 474 | 456 | 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。）

▶ 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等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継続します。

▶ 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

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。

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71期～第76期 | | 項目の概要 |
|-------------|-----------|---------|---|
| | 金額 (円) | 比率 (%) | |
| (a) 信託報酬 | 54 | 0.749 | (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） | (31) | (0.433) | 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） | (21) | (0.294) | 交付運用報告書等各种書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価 |
| （受託会社） | (2) | (0.021) | 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 | 0 | 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 |
| （先物・オプション） | (0) | (0.003) | |
| (c) その他費用 | 1 | 0.019 | (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 |
| （保管費用） | (1) | (0.016) | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 |
| （監査費用） | (0) | (0.002) | ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用 |
| （その他） | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合計 | 55 | 0.771 | |

作成期中の平均基準価額は、7,216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。

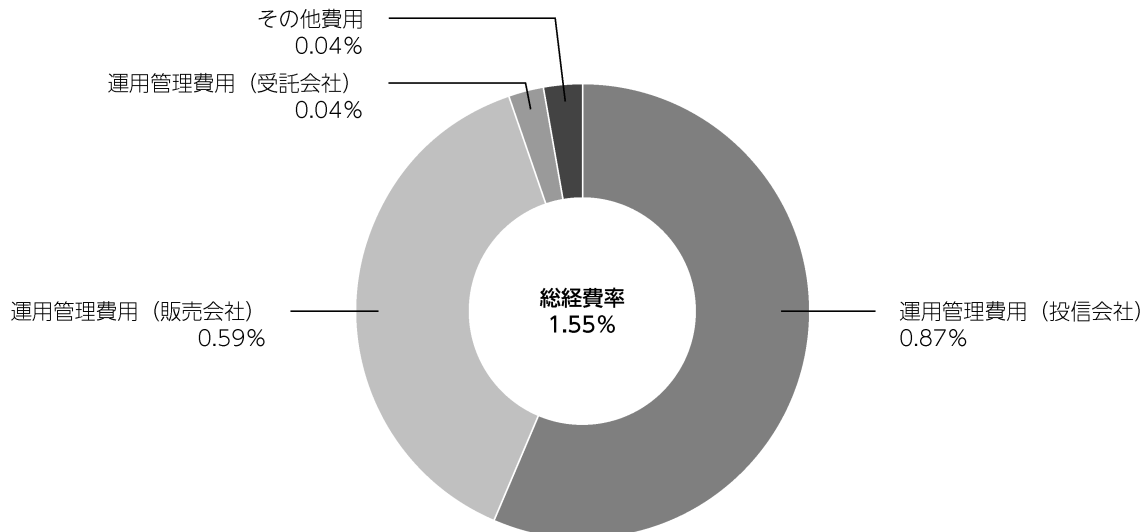
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

（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。）を作成中の平均受益権口数に作成中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.55%**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

(2018年10月10日～2019年4月8日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄 | 第71期～第76期 | | | |
|-----------------------------|--------------|--------------|---------------|---------------|
| | 設 定 | | 解 約 | |
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド | 千口 22,288 | 千円 27,000 | 千口 313,533 | 千円 395,000 |

○利害関係人との取引状況等

(2018年10月10日～2019年4月8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71期～第76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 | | |
| 為替直物取引 | 百万円 15,149 | 百万円 260 | % 1.7 | 百万円 13,889 | 百万円 - | % - |

平均保有割合 38.1%

※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モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2019年4月8日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 第70期末 | | 第76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 | 2,987,474 | | 2,696,229 | 3,430,142 |

○投資信託財産の構成

（2019年4月8日現在）

| 項 目 | 第76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 3,430,142 | % 98.8 |
| コール・ローン等、その他 | 40,459 | 1.2 |
| 投資信託財産総額 | 3,470,601 | 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（9,589,798千円）の投資信託財産総額（9,626,870千円）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=111.44円 | 1 オーストラリアドル=79.07円 | |
|------------------|--------------------|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第71期末 | 第72期末 | 第73期末 | 第74期末 | 第75期末 | 第76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 | 3,791,451,400 | 3,725,723,663 | 3,501,089,382 | 3,523,664,701 | 3,497,133,762 | 3,470,601,792 |
| コール・ローン等 | 20,300,053 | 34,621,174 | 47,913,055 | 36,763,024 | 47,047,990 | 40,458,841 |
| AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド(国債) | 3,731,151,347 | 3,691,102,489 | 3,453,176,327 | 3,486,901,677 | 3,450,085,772 | 3,430,142,951 |
| 未収入金 | 40,000,000 | — | — | — | — | — |
| (B) 負債 | 41,618,591 | 24,851,931 | 30,460,506 | 25,474,185 | 43,212,908 | 23,836,773 |
| 未払収益分配金 | 30,435,600 | 20,159,879 | 19,930,644 | 19,848,050 | 19,492,182 | 19,243,665 |
| 未払解約金 | 6,712,291 | — | 5,908,216 | 1,091,444 | 19,620,323 | 993 |
| 未払信託報酬 | 4,457,253 | 4,677,901 | 4,607,446 | 4,520,856 | 4,088,104 | 4,578,321 |
| 未払利息 | 50 | 65 | 41 | 58 | 45 | 69 |
| その他未払費用 | 13,397 | 14,086 | 14,159 | 13,777 | 12,254 | 13,725 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 3,749,832,809 | 3,700,871,732 | 3,470,628,876 | 3,498,190,516 | 3,453,920,854 | 3,446,765,019 |
| 元本 | 5,072,600,088 | 5,039,969,939 | 4,982,661,187 | 4,962,012,601 | 4,873,045,530 | 4,810,916,443 |
| 次期繰越損益金 | △1,322,767,279 | △1,339,098,207 | △1,512,032,311 | △1,463,822,085 | △1,419,124,676 | △1,364,151,424 |
| (D) 受益権総口数 | 5,072,600,088口 | 5,039,969,939口 | 4,982,661,187口 | 4,962,012,601口 | 4,873,045,530口 | 4,810,916,443口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 7,392円 | 7,343円 | 6,965円 | 7,050円 | 7,088円 | 7,164円 |

○損益の状況

| 項 目 | 第71期 | 第72期 | 第73期 | 第74期 | 第75期 | 第76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 | △ 778 | △ 1,317 | △ 2,091 | △ 1,111 | △ 811 | △ 813 |
| 受取利息 | — | — | — | — | 3 | — |
| 支払利息 | △ 778 | △ 1,317 | △ 2,091 | △ 1,111 | △ 814 | △ 813 |
| (B) 有価証券売買損益 | 103,158,078 | 9,730 | △ 163,521,603 | 66,295,809 | 41,925,541 | 60,712,199 |
| 売買益 | 103,415,553 | 382,959 | 713,188 | 66,725,326 | 43,196,015 | 61,158,740 |
| 売買損 | △ 257,475 | △ 373,229 | △ 164,234,791 | △ 429,517 | △ 1,270,474 | △ 446,541 |
| (C) 信託報酬等 | △ 4,470,650 | △ 4,691,952 | △ 4,621,605 | △ 4,534,405 | △ 4,100,358 | △ 4,592,046 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 98,686,650 | △ 4,683,539 | △ 168,145,299 | 61,760,293 | 37,824,372 | 56,119,340 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 946,708,803 | △ 852,737,717 | △ 854,456,366 | △ 1,024,100,268 | △ 953,428,420 | △ 912,350,161 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 444,309,526 | △ 461,517,072 | △ 469,500,002 | △ 481,634,060 | △ 484,028,446 | △ 488,676,938 |
| (配当等相当額) | (290,293,473) | (270,302,953) | (255,792,382) | (243,335,216) | (231,201,171) | (219,133,263) |
| (売買損益相当額) | (△ 734,602,999) | (△ 731,820,025) | (△ 725,292,384) | (△ 724,969,276) | (△ 715,229,617) | (△ 707,810,201) |
| (G) 計(D+E+F) | △ 1,292,331,679 | △ 1,318,938,328 | △ 1,492,101,667 | △ 1,443,974,035 | △ 1,399,632,494 | △ 1,344,907,759 |
| (H) 収益分配金 | △ 30,435,600 | △ 20,159,879 | △ 19,930,644 | △ 19,848,050 | △ 19,492,182 | △ 19,243,665 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △ 1,322,767,279 | △ 1,339,098,207 | △ 1,512,032,311 | △ 1,463,822,085 | △ 1,419,124,676 | △ 1,364,151,424 |
| 追加信託差損益金 | △ 462,570,886 | △ 473,109,003 | △ 480,960,122 | △ 489,573,280 | △ 493,287,233 | △ 495,893,312 |
| (配当等相当額) | (272,052,620) | (258,733,833) | (244,347,256) | (235,421,622) | (221,962,617) | (211,924,127) |
| (売買損益相当額) | (△ 734,623,506) | (△ 731,842,836) | (△ 725,307,378) | (△ 724,994,902) | (△ 715,249,850) | (△ 707,817,439) |
| 分配準備積立金 | 188,853 | 292,244 | 224,018 | 160,320 | 330,851 | 434,605 |
| 繰越損益金 | △ 860,385,246 | △ 866,281,448 | △ 1,031,296,207 | △ 974,409,125 | △ 926,168,294 | △ 868,692,717 |

(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 5,102,619,145円
 作成期中追加設定元本額 71,876,501円
 作成期中一部解約元本額 363,579,203円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.7164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1,364,151,424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 | 12,057,941円 | 8,672,974円 | 8,406,189円 | 11,846,646円 | 10,407,352円 | 12,135,862円 |
| 費用控除後・繰越火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 | 290,313,980円 | 270,325,764円 | 255,807,376円 | 243,360,842円 | 231,221,404円 | 219,140,501円 |
| 分配準備積立金額 | 305,152円 | 187,218円 | 288,353円 | 222,504円 | 156,894円 | 326,034円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 302,677,073円 | 279,185,956円 | 264,501,918円 | 255,429,992円 | 241,785,650円 | 231,602,397円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 596円 | 553円 | 530円 | 514円 | 496円 | 481円 |
| 1万口当たり分配金額 | 60円 | 40円 | 40円 | 40円 | 40円 | 40円 |
| 収益分配金金額 | 30,435,600円 | 20,159,879円 | 19,930,644円 | 19,848,050円 | 19,492,182円 | 19,243,665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71期 | 第72期 | 第73期 | 第74期 | 第75期 | 第76期 |
|----------------|------|------|------|------|------|------|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 60円 | 40円 | 40円 | 40円 | 40円 | 40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。

AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド

《第6期》決算日2018年10月9日

[計算期間：2017年10月11日～2018年10月9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9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 | 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。 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準 円 | 価額 | | 債 組 入 比 率 % | 債 先 物 比 率 % | 純 資 産 額 百万円 |
|-----------------|---------|-------------|-------------|----------------------------|----------------------------|-------------------------|
| | | 期 騰 落 | 中 率 % | | | |
| 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 | △ | 7,244 |
| 4期(2016年10月7日) | 11,325 | △ | 3.7 | 91.4 | △ | 5,892 |
| 5期(2017年10月10日) | 13,013 | | 14.9 | 96.8 | △ | 5,308 |
| 6期(2018年10月9日) | 12,344 | △ | 5.1 | 95.6 | △ | 8,179 |

(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。

○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 | 券 率 |
|----------------------|------------------|-----------|-----------|-----------|
| | | | | |
| (期 首) 2017年10月10日 | 円 13,013 | % — | % 96.8 | % △8.5 |
| 10月末 | 13,000 | △0.1 | 96.6 | △8.8 |
| 11月末 | 12,836 | △1.4 | 95.3 | 1.6 |
| 12月末 | 13,260 | 1.9 | 95.0 | △1.9 |
| 2018年1月末 | 13,189 | 1.4 | 96.9 | △2.9 |
| 2月末 | 12,664 | △2.7 | 96.5 | △1.7 |
| 3月末 | 12,410 | △4.6 | 91.6 | △2.2 |
| 4月末 | 12,488 | △4.0 | 94.9 | △5.9 |
| 5月末 | 12,562 | △3.5 | 93.7 | 2.3 |
| 6月末 | 12,425 | △4.5 | 93.0 | △5.8 |
| 7月末 | 12,624 | △3.0 | 91.9 | △3.5 |
| 8月末 | 12,446 | △4.4 | 92.2 | △1.8 |
| 9月末 | 12,630 | △2.9 | 94.1 | △1.2 |
| (期 末) 2018年10月9日 | 12,344 | △5.1 | 95.6 | △3.8 |

(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5.1%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

◎債券市況

・米中貿易摩擦を巡る不透明感やイタリアの政治不安等を背景に投資家のリスク回避姿勢が高まったほか、オーストラリアの消費者物価指数(CPI)の伸びが停滞したこと等から豪州金利は中・長期ゾーンを中心に低下しました。豪州金利が中・長期ゾーンを中心に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、豪州社債市況は上昇しました。

◎為替市況

・2018年7月の金融政策決定会合にて日銀が金利変動幅の拡大に対して容認姿勢を示したことなどを背景に、本邦金利が上昇したこと等を受け、豪州と日本の金利差が縮小したこと等から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等のハイブリッド証券を高位に組み入れる運用を行っています。
- ・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、実質的に豪ドル建てとなるように外国為替予約取引等を行っています。
- ・また、デュレーション（平均回収期間や金利感応度）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。
- ・デュレーションについては、当期末において市場平均と比べてやや短めとしました。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。
- ・前述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等がプラスとなったものの、豪ドルが対円で下落したこと等がマイナスとなり、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、英国の欧州連合（EU）離脱の影響が懸念されるものの、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。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、賃金上昇率や個人消費等が抑制された状態が続いているものの、豪州企業が増益基調を維持しており、足元の幾つかの経済指標において改善傾向が見られること等は豪州社債市況にとってプラス要因となると考えます。一方で、米国の財政政策や貿易政策における不透明感等は、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、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

(2017年10月11日～2018年10月9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) | % 0.008 (0.008) | (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) | 0.030 (0.030) (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 | 0.038 | |
| 期中の平均基準価額は、12,730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

(2017年10月11日～2018年10月9日)

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|-----|---------|-----|----------------------|----------------------------------|
| 外 国 | アメリカ | 社債券 | 千アメリカドル 6,343 | 千アメリカドル 991 |
| | オーストラリア | 社債券 | 千オーストラリアドル 53,327 | 千オーストラリアドル 18,228 (3,161) |

(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 5,293 | 百万円 4,926 | 百万円 6,689 | 百万円 6,493 |

(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

(2017年10月11日～2018年10月9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 15,802 | 百万円 749 | % 4.7 | 百万円 12,771 | 百万円 - | % - |

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モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2018年10月9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 8,150 | 千アメリカドル 8,312 | 千円 939,040 | % 11.5 | % - | % 9.7 | % 1.8 | % - |
| オーストラリア | 千オーストラリアドル 83,673 | 千オーストラリアドル 86,068 | 6,882,023 | 84.1 | 0.4 | 29.3 | 38.5 | 16.4 |
| 合 計 | - | - | 7,821,063 | 95.6 | 0.4 | 39.0 | 40.3 | 16.4 |

(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 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
|---------|--------------------------|--------|---------------|------------|---------|------------|
| | | | | 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 | | | | | |
| | 3.65 WOODSIDE FI 250305 | 3.65 | 1,200 | 1,146 | 129,498 | 2025/3/5 |
| | 4.45 NEWCREST FIN 211115 | 4.45 | 500 | 505 | 57,160 | 2021/11/15 |
| | 4.6 WOODSIDE FINA 210510 | 4.6 | 200 | 202 | 22,889 | 2021/5/10 |
| | 4.75 PACIFIC NATI 280322 | 4.75 | 600 | 570 | 64,462 | 2028/3/22 |
| | 4.875 MACQUARIE B 250610 | 4.875 | 1,050 | 1,039 | 117,454 | 2025/6/10 |
| | 5.125 SYDNEY AIRP 210222 | 5.125 | 250 | 255 | 28,880 | 2021/2/22 |
| | 6 GOODMAN US FIN 220322 | 6.0 | 300 | 317 | 35,843 | 2022/3/22 |
| | FRN BHP BILLITON 751019 | 6.75 | 1,000 | 1,093 | 123,541 | 2075/10/19 |
| | VAR AUSNET SERV 760317 | 5.75 | 1,300 | 1,348 | 152,368 | 2076/3/17 |
| | VAR BHP BILLITON 751019 | 6.25 | 1,750 | 1,831 | 206,939 | 2075/10/19 |
| 小 | 計 | | | | 939,040 | |
| 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 | | | | | |
| | 2.7 NATIONAL A 200804 | 2.7 | 1,500 | 1,503 | 120,184 | 2020/8/4 |
| | 2.9 COMMONWEAL 210712 | 2.9 | 1,500 | 1,503 | 120,182 | 2021/7/12 |
| | 2.9 TELSTRA COR 210419 | 2.9 | 500 | 499 | 39,976 | 2021/4/19 |
| | 2.95 AUST & NZ B 210716 | 2.95 | 500 | 501 | 40,119 | 2021/7/16 |
| | 3 NATIONAL A 211021 | 3.0 | 1,100 | 1,104 | 88,278 | 2021/10/21 |
| | 3 SUNCORP-MET 230913 | 3.0 | 500 | 496 | 39,713 | 2023/9/13 |
| | 3.1 AUST & NZ B 230118 | 3.1 | 700 | 699 | 55,898 | 2023/1/18 |
| | 3.125 WESTPAC BAN 221027 | 3.125 | 500 | 500 | 40,039 | 2022/10/27 |
| | 3.2 COMMONWEAL 230816 | 3.2 | 500 | 498 | 39,843 | 2023/8/16 |
| | 3.2 WESTPAC BAN 230306 | 3.2 | 1,500 | 1,501 | 120,054 | 2023/3/6 |
| | 3.25 COMMONWEAL 220117 | 3.25 | 1,500 | 1,514 | 121,136 | 2022/1/17 |
| | 3.25 COMMONWEAL 230425 | 3.25 | 2,000 | 2,004 | 160,274 | 2023/4/25 |
| | 3.25 MACQUARIE B 221215 | 3.25 | 1,600 | 1,597 | 127,702 | 2022/12/15 |
| | 3.25 MACQUARIE BA 200303 | 3.25 | 500 | 504 | 40,359 | 2020/3/3 |
| | 3.25 NATIONAL A 220324 | 3.25 | 500 | 504 | 40,361 | 2022/3/24 |
| | 3.35 AUST & NZ B 230509 | 3.35 | 500 | 503 | 40,226 | 2023/5/9 |
| | 3.5 BENDIGO AND 230125 | 3.5 | 1,500 | 1,506 | 120,442 | 2023/1/25 |
| | 3.5 ETSA UTILITIE 240829 | 3.5 | 1,200 | 1,193 | 95,454 | 2024/8/29 |
| | 3.5 SUNCORP-MET 210412 | 3.5 | 1,000 | 1,012 | 80,929 | 2021/4/12 |
| | 3.5 UNITED ENER 230912 | 3.5 | 500 | 501 | 40,086 | 2023/9/12 |
| | 3.591 GPT WHL OFF 231107 | 3.591 | 600 | 599 | 47,957 | 2023/11/7 |
| | 3.642 ENERGY PART 241211 | 3.642 | 500 | 495 | 39,592 | 2024/12/11 |
| | 3.66 WESFARMERS 201118 | 3.66 | 1,000 | 1,017 | 81,377 | 2020/11/18 |
| | 3.6725 GPT WHL OF 240919 | 3.6725 | 600 | 595 | 47,635 | 2024/9/19 |
| | 3.7 AUSTRALIAN CA 270803 | 3.7 | 500 | 503 | 40,265 | 2027/8/3 |
| | 3.75 AUSGRID FINA 241030 | 3.75 | 1,000 | 997 | 79,734 | 2024/10/30 |
| | 3.75 AUSTRALIAN P 240522 | 3.75 | 500 | 500 | 40,040 | 2024/5/22 |
| | 3.75 SGSP AUSTRAL 240927 | 3.75 | 500 | 503 | 40,223 | 2024/9/27 |
| | 3.85 UNITED ENER 241023 | 3.85 | 1,600 | 1,615 | 129,154 | 2024/10/23 |
| | 3.9 BRISBANE AIRP 250424 | 3.9 | 500 | 500 | 40,029 | 2025/4/24 |
| | 3.9 LONSDALE FINA 251015 | 3.9 | 1,600 | 1,593 | 127,424 | 2025/10/15 |
| | 3.9 SHOPPING CT 240607 | 3.9 | 1,000 | 986 | 78,853 | 2024/6/7 |

AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド

| 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 | |
| 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 | | | | | |
| | 4 TELSTRA COR 220916 | 4.0 | 3,150 | 3,233 | 258,521 | 2022/9/16 |
| | 4.2 AUSNET SERV 280821 | 4.2 | 500 | 501 | 40,082 | 2028/8/21 |
| | 4.225 DBNGP FINAN 250528 | 4.225 | 1,000 | 1,007 | 80,523 | 2025/5/28 |
| | 4.25 DEXUS WHOLES 220616 | 4.25 | 700 | 716 | 57,306 | 2022/6/16 |
| | 4.25 ENERGY PARTN 200615 | 4.25 | 900 | 910 | 72,830 | 2020/6/15 |
| | 4.4 AUSNET SERV 270816 | 4.4 | 700 | 718 | 57,419 | 2027/8/16 |
| | 4.5 AUST GAS NETW 211217 | 4.5 | 900 | 933 | 74,605 | 2021/12/17 |
| | 4.5 DOWNER GROUP 220311 | 4.5 | 800 | 819 | 65,534 | 2022/3/11 |
| | 4.5 SCENTRE MGMT 210908 | 4.5 | 1,700 | 1,759 | 140,657 | 2021/9/8 |
| | 4.5 WSO FINANCE P 270331 | 4.5 | 1,200 | 1,233 | 98,636 | 2027/3/31 |
| | 4.75 WESFARMERS 200312 | 4.75 | 2,000 | 2,060 | 164,759 | 2020/3/12 |
| | 5 AGL ENERGY LTD 211105 | 5.0 | 900 | 939 | 75,086 | 2021/11/5 |
| | 5 ALE DIRECT PROP 200820 | 5.0 | 1,000 | 1,024 | 81,880 | 2020/8/20 |
| | 5 AUSTRALIA PACIF 200604 | 5.0 | 1,210 | 1,256 | 100,503 | 2020/6/4 |
| | 5 NATIONAL AUSTRA 240311 | 5.0 | 1,000 | 1,091 | 87,285 | 2024/3/11 |
| | 5.25 PACIFIC NATI 250519 | 5.25 | 500 | 521 | 41,689 | 2025/5/19 |
| | 5.4 PACIFIC NATIO 270512 | 5.4 | 500 | 514 | 41,172 | 2027/5/12 |
| | 5.5 QIC SHOPPING 191120 | 5.5 | 1,000 | 1,023 | 81,810 | 2019/11/20 |
| | 5.5 SGSP AUST 210312 | 5.5 | 2,800 | 2,967 | 237,292 | 2021/3/12 |
| | 5.75 DOWNER GROUP 181129 | 5.75 | 1,000 | 1,003 | 80,268 | 2018/11/29 |
| | 5.75 MIRVAC GR 200918 | 5.75 | 1,000 | 1,051 | 84,056 | 2020/9/18 |
| | 6 BRISBANE AIRPOR 201021 | 6.0 | 1,840 | 1,951 | 156,003 | 2020/10/21 |
| | 6 DBNGP FINANCE 191011 | 6.0 | 1,500 | 1,520 | 121,612 | 2019/10/11 |
| | 7.25 CALTEX AUST 181123 | 7.25 | 500 | 502 | 40,209 | 2018/11/23 |
| | 7.25 COMMONWEALTH 200205 | 7.25 | 1,000 | 1,061 | 84,905 | 2020/2/5 |
| | 7.25 WESTPAC BANK 200211 | 7.25 | 500 | 531 | 42,482 | 2020/2/11 |
| | 7.5 AUSNET SERVIC 210401 | 7.5 | 2,200 | 2,437 | 194,862 | 2021/4/1 |
| | 7.5 QANTAS AIRWAY 210611 | 7.5 | 2,500 | 2,768 | 221,348 | 2021/6/11 |
| | 7.75 APT PIPELINE 200722 | 7.75 | 1,500 | 1,622 | 129,725 | 2020/7/22 |
| | 7.75 QANTAS AIRWA 220519 | 7.75 | 1,500 | 1,713 | 137,011 | 2022/5/19 |
| | 7.75 TELSTRA CORP 200715 | 7.75 | 500 | 543 | 43,422 | 2020/7/15 |
| | 8 BRISBANE AIRPOR 190709 | 8.0 | 600 | 623 | 49,850 | 2019/7/9 |
| | 8.25 STOCKLAND TR 201125 | 8.25 | 1,500 | 1,660 | 132,790 | 2020/11/25 |
| | FRN CROWN LTD PLA 700423 | 5.9159 | 413 | 428 | 34,254 | 2075/4/23 |
| | FRN INSURANCE 400319 | 4.722 | 500 | 503 | 40,258 | 2040/3/19 |
| | FRN NATIONAL A 250326 | 3.7915 | 2,200 | 2,221 | 177,645 | 2025/3/26 |
| | FRN SUNCORP-MET 231122 | 4.805 | 1,000 | 1,001 | 80,040 | 2023/11/22 |
| | FRN SUNCORP-MET 281205 | 4.0967 | 1,600 | 1,616 | 129,247 | 2028/12/5 |
| | FRN WESTPAC BAN 290816 | 4.334 | 500 | 498 | 39,850 | 2029/8/16 |
| | VAR AUST & NZ B 270513 | 4.75 | 3,900 | 3,999 | 319,837 | 2027/5/13 |
| | VAR WESTPAC BAN 270311 | 4.5 | 3,960 | 4,016 | 321,184 | 2027/3/11 |
| 小 | 計 | | | | 6,882,023 | |
| 合 | 計 | | | | 7,821,063 | |

(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

| 銘柄別 | | | 当 期 | |
|--------|--------|---------|-------|-------|
| | | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 外 国 | 債券先物取引 | NOTE5Y | — | 151 |
| | | NOTE2Y | — | 570 |
| | | NOTE10Y | — | 332 |
| | | ULTR10Y | — | 98 |
| | | AUST10Y | 1,206 | — |
| | | AUST3Y | — | 364 |
| | | | | |

(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

(2018年10月9日現在)

| 項 目 | 当 期 | |
|--------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 7,821,063 | % 93.1 |
| コール・ローン等、その他 | 579,453 | 6.9 |
| 投資信託財産総額 | 8,400,516 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産 (8,066,091千円) の投資信託財産総額 (8,400,516千円) に対する比率は96.0%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=112.97円 | 1 オーストラリアドル=79.96円 | | |
|------------------|--------------------|--|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年10月9日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 10,291,620,963 |
| コール・ローン等 | 412,123,467 |
| 公社債(評価額) | 7,821,063,855 |
| 未収入金 | 1,904,134,159 |
| 未収利息 | 70,839,038 |
| 前払費用 | 24,653,673 |
| 差入委託証拠金 | 58,806,771 |
| (B) 負債 | 2,112,406,253 |
| 未払金 | 2,078,406,014 |
| 未払解約金 | 34,000,000 |
| 未払利息 | 239 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 8,179,214,710 |
| 元本 | 6,626,133,501 |
| 次期繰越損益金 | 1,553,081,209 |
| (D) 受益権総口数 | 6,626,133,501口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,344円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 4,079,378,932円
 期中追加設定元本額 3,638,658,992円
 期中一部解約元本額 1,091,904,423円
 また、1口当たり純資産額は、期末12,344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)

| | |
|---------------------------------------|----------------|
| オーストラリア好利回り3資産バランス(年2回決算型) | 3,638,658,992円 |
| 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) | 2,987,474,509円 |
| 合計 | 6,626,133,501円 |

【お知らせ】

当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。

(変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)

(2018年1月1日)

○損益の状況 (2017年10月11日～2018年10月9日)

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 231,394,920 |
| 受取利息 | 231,449,065 |
| 支払利息 | △ 54,145 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 540,313,863 |
| 売買益 | 36,540,932 |
| 売買損 | △ 576,854,795 |
| (C) 先物取引等取引損益 | 16,528,438 |
| 取引益 | 53,893,636 |
| 取引損 | △ 37,365,198 |
| (D) 保管費用等 | △ 1,537,913 |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | △ 293,928,418 |
| (F) 前期繰越損益金 | 1,229,134,196 |
| (G) 追加信託差損益金 | 925,671,008 |
| (H) 解約差損益金 | △ 307,795,577 |
| (I) 計(E+F+G+H) | 1,553,081,209 |
| 次期繰越損益金(I) | 1,553,081,209 |

(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。