

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	マッコーリー 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、マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・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	ベビード ファンド	マッコーリー 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	ベビード 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。

「マッコーリー」の商標は、マッコーリー・グループ・リミテッドからのライセンスに基づき利用しています。  
Macquarie Bank Limited（以下「MBL」といいます）を除き、当資料に言及しているマッコーリー並びにマッコーリー関連会社は何れも1959年銀行法（オーストラリア連邦）上の預金受入機関として認可されておらず、これらの法人の負債にはMBLの預金その他の負債は含まれません。別段の記載がない限りMBLは上述の法人の何れに対しても、その負債に関する保証またはそれ以外の支援提供を行うものではありません。

## 償還報告書（全体版）

[満期償還]

## 三菱UFJ／マッコーリー 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113期（決算日：2022年5月9日）

第114期（決算日：2022年6月7日）

第115期（決算日：2022年7月7日）

第116期（決算日：2022年8月8日）

第117期（決算日：2022年9月7日）

信託終了日：2022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、「三菱UFJ／マッコーリー 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、この度、信託期間を満了し、償還の運びとなりました。ここに謹んで運用経過と償還内容をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



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）

お客様のお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

## 本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

## ○最近30期の運用実績

決 算 期	基 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 配	込 配 金	期 騰 落 中 率			
	円 銭		円	%	%	%	百万円
89期(2020年5月7日)	5,968		20	2.3	93.0	△2.6	2,456
90期(2020年6月8日)	6,722		20	13.0	93.9	△0.8	2,747
91期(2020年7月7日)	6,643		20	△0.9	93.9	△2.6	2,696
92期(2020年8月7日)	6,795		20	2.6	94.9	△1.7	2,758
93期(2020年9月7日)	6,901		20	1.9	94.1	△1.5	2,774
94期(2020年10月7日)	6,671		20	△3.0	94.6	0.9	2,671
95期(2020年11月9日)	6,716		20	1.0	93.7	△7.5	2,616
96期(2020年12月7日)	6,937		20	3.6	94.5	△4.7	2,687
97期(2021年1月7日)	7,191		20	3.9	93.6	△4.1	2,705
98期(2021年2月8日)	7,229		20	0.8	94.0	△0.0	2,680
99期(2021年3月8日)	7,324		20	1.6	95.2	△9.1	2,682
100期(2021年4月7日)	7,397		20	1.3	94.9	△5.1	2,700
101期(2021年5月7日)	7,465		20	1.2	93.3	△1.1	2,631
102期(2021年6月7日)	7,458		20	0.2	94.7	△2.4	2,574
103期(2021年7月7日)	7,294		10	△2.1	93.4	△0.0	2,494
104期(2021年8月10日)	7,172		10	△1.5	92.4	△0.3	2,439
105期(2021年9月7日)	7,231		10	1.0	93.3	△0.1	2,433
106期(2021年10月7日)	7,104		10	△1.6	91.8	△0.7	2,243
107期(2021年11月8日)	7,246		10	2.1	94.2	△1.1	2,209
108期(2021年12月7日)	6,911		10	△4.5	93.2	△2.6	2,087
109期(2022年1月7日)	7,137		10	3.4	91.8	△2.3	2,130
110期(2022年2月7日)	6,962		10	△2.3	91.7	△2.7	2,038
111期(2022年3月7日)	7,163		10	3.0	92.2	△1.6	2,046
112期(2022年4月7日)	7,565		10	5.8	93.7	△0.0	2,082
113期(2022年5月9日)	7,302		10	△3.3	94.8	△3.4	1,945
114期(2022年6月7日)	7,534		10	3.3	94.0	△3.3	1,984
115期(2022年7月7日)	7,305		10	△2.9	94.3	△2.6	1,903
116期(2022年8月8日)	7,483		10	2.6	93.3	△1.8	1,877
117期(2022年9月7日)	7,581		10	1.4	95.9	△0.9	1,830
(償還時)	(償還価額)						
118期(2022年10月7日)	7,257.83		—	△4.3	—	—	1,694

(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 円 銭	騰 落 率		債 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
第113期	(期 首) 2022年4月7日	7,565		—	93.7	△0.0
	4月末	7,420		△1.9	94.4	△3.9
	(期 末) 2022年5月9日	7,312		△3.3	94.8	△3.4
第114期	(期 首) 2022年5月9日	7,302		—	94.8	△3.4
	5月末	7,374		1.0	93.5	△0.9
	(期 末) 2022年6月7日	7,544		3.3	94.0	△3.3
第115期	(期 首) 2022年6月7日	7,534		—	94.0	△3.3
	6月末	7,374		△2.1	94.0	△3.7
	(期 末) 2022年7月7日	7,315		△2.9	94.3	△2.6
第116期	(期 首) 2022年7月7日	7,305		—	94.3	△2.6
	7月末	7,506		2.8	92.8	△2.2
	(期 末) 2022年8月8日	7,493		2.6	93.3	△1.8
第117期	(期 首) 2022年8月8日	7,483		—	93.3	△1.8
	8月末	7,510		0.4	94.7	△1.1
	(期 末) 2022年9月7日	7,591		1.4	95.9	△0.9
第118期	(期 首) 2022年9月7日	7,581		—	95.9	△0.9
	9月末	7,260		△4.2	—	—
	(償還時) 2022年10月7日	(償還価額) 7,257.83		△4.3	—	—

(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1期～第118期：2012年12月7日～2022年10月7日

## ▶ 設定来の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



第1期首	10,000円
第118期末	7,257.83円
既払分配金	5,110円
購落率	30.7%
	(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

償還価額は設定時に比べ30.7%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

### 基準価額の主な変動要因

#### 上昇要因

豪州社債市況が上昇したこと等。  
豪ドルが対円で上昇したこと等。  
債券利子収入を享受したこと等。

#### 下落要因

信託報酬等のコスト等。

第1期～第118期：2012年12月7日～2022年10月7日

## 投資環境について

### ▶ 債券市況

豪州社債市況は上昇しました。

債券市場では、2022年における豪州準備銀行（RBA）による利上げ等を受けて豪州金利が上昇したものの、債券利子収入を享受したこと等がプラス要因となり、

設定来で見ると、同市場は上昇しました。

### ▶ 為替市況

豪ドルは対円で上昇しました。

資源価格の上昇等を背景に、豪ドルは対円で上昇しました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

### ▶ 三菱UFJ／マッコーリー オーストラリア・ハイインカム債券ファンド（毎月決算型）

信託期間を通して、マッコーリー 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。

最終作成期（2022年4月8日～信託終了日）は、償還に向けて、マッコーリー 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の組入れ比率をゼロにしました。

### ▶ マッコーリー オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド

信託期間を通して、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。

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。

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。

最終作成期は「三菱UFJ／マッコーリー オーストラリア・ハイインカム債券ファンド（毎月決算型）」の償還に向けて一部保有資産の売却を実施しました。

## 当該投資信託のベンチマークとの差異について

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、第3期から第71期までは各60円、第72期から第81期までは各40円、第82期から第102期までは各20円、第103期から第117期までは各10円の分配とし、その他の期は見送りとさせていただきます。なお、信託約款の規定に従い第2期までの収益分配は行っていません。信託期間中、累計で5,110円の分配を行わせていただきました。

## 分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第113期 2022年4月8日～ 2022年5月9日	第114期 2022年5月10日～ 2022年6月7日	第115期 2022年6月8日～ 2022年7月7日	第116期 2022年7月8日～ 2022年8月8日	第117期 2022年8月9日～ 2022年9月7日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 (0.137%)	10 (0.133%)	10 (0.137%)	10 (0.133%)	10 (0.132%)
当期の収益	9	10	10	10	10
当期の収益以外	0	－	－	－	－
翌期繰越分配対象額	271	279	280	291	301

(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。

## 償還価額

### 三菱UFJ／マッコーリー オーストラリア・ハイインカム債券ファンド（毎月決算型）

償還価額は、7,257円83銭となりました。

信託期間中はご愛顧を賜り、誠にありがとうございました。

2022年4月8日～2022年10月7日

## 1万口当たりの費用明細

項目	第113期～第118期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	57	0.772	(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 )	(33)	(0.447)	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 )	(23)	(0.303)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
( 受 託 会 社 )	(2)	(0.022)	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	0.002	(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)	(0.002)	
(c) その他費用	1	0.017	(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)	(0.015)	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	58	0.791	

作成期中の平均基準価額は、7,427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。

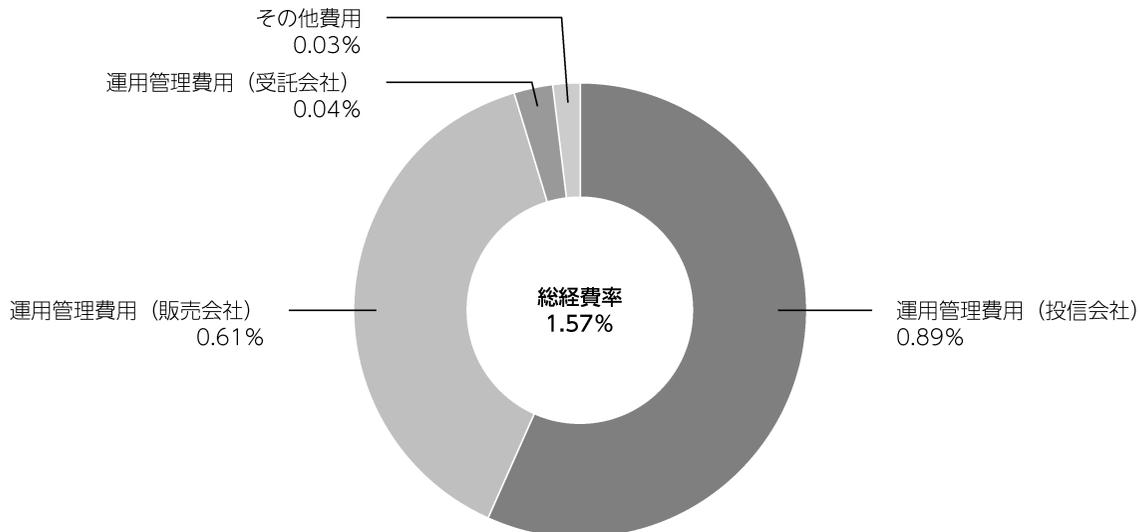
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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1.57%**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

(2022年4月8日～2022年10月7日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	第113期～第118期			
		設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
マッコーリー オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド		—	—	1,321,075	2,019,475

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年4月8日～2022年10月7日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;三菱UFJ／マッコーリー オーストラリア・ハイインカム債券ファンド（毎月決算型）&gt;

該当事項はございません。

&lt;マッコーリー オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド&gt;

区 分	第113期～第118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	$\frac{B}{A}$		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 3,833	百万円 —	% —	百万円 6,453	百万円 2,215	% 34.3

平均保有割合 33.5%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

## ○組入資産の明細

(2022年10月7日現在)

信託終了日現在、有価証券等の組入れはございません。

## 親投資信託残高

銘	柄	第112期末	
		口	数
マッコーリー オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド			千口 1,321,075

## ○投資信託財産の構成

(2022年10月7日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 1,699,388	% 100.0
投資信託財産総額	1,699,388	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準(償還)価額の状況

項 目	第113期末	第114期末	第115期末	第116期末	第117期末	償 還 時
	2022年5月9日現在	2022年6月7日現在	2022年7月7日現在	2022年8月8日現在	2022年9月7日現在	2022年10月7日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	1,966,017,713	1,990,679,194	1,911,755,587	1,923,492,477	1,835,248,259	1,699,388,640
コール・ローン等	12,831,158	18,868,259	14,893,591	58,510,917	9,663,710	1,699,388,640
マッコーリーオーストラリアハイインカム債券ファンド(簿勘)	1,925,186,555	1,971,810,935	1,896,861,996	1,864,981,560	1,825,584,549	—
未総入金	28,000,000	—	—	—	—	—
(B) 負債	20,434,196	6,029,999	7,934,185	46,409,593	4,772,151	4,594,191
未払収益分配金	2,664,368	2,634,378	2,606,269	2,508,472	2,414,656	—
未払解約金	14,995,963	1,038,482	2,871,930	41,302,847	—	2,335,918
未払信託報酬	2,765,573	2,350,071	2,448,649	2,590,497	2,350,440	2,247,203
未払利息	5	26	3	19	13	4,338
その他未払費用	8,287	7,042	7,334	7,758	7,042	6,732
(C) 純資産総額(A-B)	1,945,583,517	1,984,649,195	1,903,821,402	1,877,082,884	1,830,476,108	1,694,794,449
元本	2,664,368,915	2,634,378,187	2,606,269,299	2,508,472,746	2,414,656,935	2,335,125,590
次期繰越損益金	△ 718,785,398	△ 649,728,992	△ 702,447,897	△ 631,389,862	△ 584,180,827	—
償還差損金	—	—	—	—	—	△ 640,331,141
(D) 受益権総口数	2,664,368,915口	2,634,378,187口	2,606,269,299口	2,508,472,746口	2,414,656,935口	2,335,125,590口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,302円	7,534円	7,305円	7,483円	7,581円	—
1万口当たり償還価額(C/D)	—	—	—	—	—	7,257円83銭

## ○損益の状況

項 目	第113期	第114期	第115期	第116期	第117期	第118期
	2022年4月8日～ 2022年5月9日	2022年5月10日～ 2022年6月7日	2022年6月8日～ 2022年7月7日	2022年7月8日～ 2022年8月8日	2022年8月9日～ 2022年9月7日	2022年9月8日～ 2022年10月7日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 166	△ 281	△ 302	△ 161	△ 441	△ 10,247
受取利息	—	—	10	—	—	458
支払利息	△ 166	△ 281	△ 312	△ 161	△ 441	△ 10,705
(B) 有価証券売買損益	△ 64,645,003	65,959,870	△ 54,508,854	49,797,783	28,366,779	△ 73,119,360
売買益	1,175,799	66,343,971	490,346	51,124,267	28,610,707	716,536
売買損	△ 65,820,802	△ 384,101	△ 54,999,200	△ 1,326,484	△ 243,928	△ 73,835,896
(C) 信託報酬等	△ 2,773,860	△ 2,357,113	△ 2,455,983	△ 2,598,255	△ 2,357,482	△ 2,253,935
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 67,419,029	63,602,476	△ 56,965,139	47,199,367	26,008,856	△ 75,383,542
(E) 前期繰越損益金	△ 290,318,854	△ 356,176,158	△ 291,623,696	△ 337,846,053	△ 282,030,064	△ 249,806,788
(F) 追加信託差損益金	△ 358,383,147	△ 354,520,932	△ 351,252,793	△ 338,234,704	△ 325,744,963	△ 315,140,811
(配当等相当額)	( 64,860,563)	( 64,136,213)	( 63,467,440)	( 61,096,471)	( 58,819,930)	( 56,890,978)
(売買損益相当額)	(△ 423,243,710)	(△ 418,657,145)	(△ 414,720,233)	(△ 399,331,175)	(△ 384,564,893)	(△ 372,031,789)
(G) 計(D+E+F)	△ 716,121,030	△ 647,094,614	△ 699,841,628	△ 628,881,390	△ 581,766,171	—
(H) 収益分配金	△ 2,664,368	△ 2,634,378	△ 2,606,269	△ 2,508,472	△ 2,414,656	—
次期繰越損益金(G+H)	△ 718,785,398	△ 649,728,992	△ 702,447,897	△ 631,389,862	△ 584,180,827	—
償還差損金(D+E+F+H)	—	—	—	—	—	△ 640,331,141
追加信託差損益金	△ 358,383,147	△ 354,520,932	△ 351,252,793	△ 338,234,704	△ 325,744,963	—
(配当等相当額)	( 64,862,831)	( 64,137,929)	( 63,473,584)	( 61,098,358)	( 58,822,079)	( — )
(売買損益相当額)	(△ 423,245,978)	(△ 418,658,861)	(△ 414,726,377)	(△ 399,333,062)	(△ 384,567,042)	( — )
分配準備積立金	7,430,884	9,429,564	9,622,057	12,051,062	14,068,762	—
繰越損益金	△ 367,833,135	△ 304,637,624	△ 360,817,161	△ 305,206,220	△ 272,504,626	—

(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 2,752,394,365円  
 作成期中追加設定元本額 10,820,343円  
 作成期中一部解約元本額 428,089,118円  
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.725783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640,331,141円です。
- ③ 分配金の計算過程

項 目	2022年4月8日～ 2022年5月9日	2022年5月10日～ 2022年6月7日	2022年6月8日～ 2022年7月7日	2022年7月8日～ 2022年8月8日	2022年8月9日～ 2022年9月7日
費用控除後の配当等収益額	2,526,652円	4,720,193円	2,913,255円	5,303,216円	4,889,688円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	—円	—円	—円	—円	—円
収益調整金額	64,862,831円	64,137,929円	63,473,584円	61,098,358円	58,822,079円
分配準備積立金額	7,568,600円	7,343,749円	9,315,071円	9,256,318円	11,593,730円
当ファンドの分配対象収益額	74,958,083円	76,201,871円	75,701,910円	75,657,892円	75,305,497円
1万口当たり収益分配対象額	281円	289円	290円	301円	311円
1万口当たり分配金額	10円	10円	10円	10円	10円
収益分配金金額	2,664,368円	2,634,378円	2,606,269円	2,508,472円	2,414,656円

- ④ 「マッコーリー 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。

## ○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2012年12月7日			投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年10月7日			資産総額	1,699,388,640円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	4,594,191円	
				純資産総額	1,694,794,449円	
受益権口数	13,412,447,529口	2,335,125,590口	△11,077,321,939口	受益権口数	2,335,125,590口	
元本額	13,412,447,529円	2,335,125,590円	△11,077,321,939円	1万円当たり償還金	7,257円83銭	
毎計算期末の状況						
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万円当たり分配金		
				金額	分配率	
第1期	16,182,246,567円	17,190,458,776円	10,623円	－円	－%	
第2期	15,112,570,294	16,805,940,114	11,121	－	－	
第3期	13,363,920,753	14,839,925,968	11,104	60	0.6	
第4期	11,523,460,394	13,598,756,106	11,801	60	0.6	
第5期	10,641,773,647	12,571,590,029	11,813	60	0.6	
第6期	8,751,539,725	9,413,860,804	10,757	60	0.6	
第7期	5,641,218,008	5,850,558,019	10,371	60	0.6	
第8期	5,142,042,718	5,104,920,850	9,928	60	0.6	
第9期	4,752,113,288	4,885,471,818	10,281	60	0.6	
第10期	4,563,472,858	4,735,329,292	10,377	60	0.6	
第11期	4,481,957,923	4,712,820,034	10,515	60	0.6	
第12期	4,210,787,531	4,424,711,345	10,508	60	0.6	
第13期	4,175,167,635	4,373,547,835	10,475	60	0.6	
第14期	4,040,285,007	4,150,979,120	10,274	60	0.6	
第15期	3,938,431,233	4,138,179,812	10,507	60	0.6	
第16期	3,961,210,903	4,257,329,427	10,748	60	0.6	
第17期	3,948,549,807	4,224,841,958	10,700	60	0.6	
第18期	3,932,053,117	4,249,691,830	10,808	60	0.6	
第19期	4,172,442,330	4,522,990,352	10,840	60	0.6	
第20期	4,474,984,597	4,826,273,223	10,785	60	0.6	
第21期	5,188,731,675	5,752,478,334	11,086	60	0.6	
第22期	5,793,428,028	6,202,114,498	10,705	60	0.6	
第23期	6,260,249,740	6,920,376,950	11,054	60	0.6	
第24期	6,292,314,521	7,143,086,746	11,352	60	0.6	
第25期	6,854,621,992	7,407,575,321	10,807	60	0.6	
第26期	7,223,600,836	7,530,525,438	10,425	60	0.6	
第27期	7,449,594,035	7,814,233,124	10,489	60	0.6	
第28期	8,172,660,358	8,360,265,449	10,230	60	0.6	
第29期	8,147,462,856	8,579,452,843	10,530	60	0.6	
第30期	8,039,939,844	8,485,096,314	10,554	60	0.6	
第31期	8,057,839,841	8,139,653,998	10,102	60	0.6	

## 三菱UFJマッコーリー オーストラリア・ハイインカム債券ファンド（毎月決算型）

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第32期	8,117,241,415円	8,166,230,086円	10,060円	60円	0.6%
第33期	7,929,690,510	7,186,826,542	9,063	60	0.6
第34期	7,770,984,873	7,283,998,896	9,373	60	0.6
第35期	7,669,949,035	7,196,546,564	9,383	60	0.6
第36期	7,528,607,551	7,268,908,473	9,655	60	0.6
第37期	7,291,381,921	6,548,631,407	8,981	60	0.6
第38期	7,237,100,430	6,388,857,144	8,828	60	0.6
第39期	7,171,503,169	6,363,157,845	8,873	60	0.6
第40期	7,129,073,672	6,284,227,790	8,815	60	0.6
第41期	6,976,351,414	5,865,815,221	8,408	60	0.6
第42期	7,042,298,876	5,917,265,628	8,402	60	0.6
第43期	7,007,059,234	5,650,106,090	8,063	60	0.6
第44期	7,017,160,362	5,766,368,708	8,218	60	0.6
第45期	7,067,545,882	5,796,452,589	8,202	60	0.6
第46期	7,236,012,161	5,925,110,680	8,188	60	0.6
第47期	7,225,807,086	5,955,667,149	8,242	60	0.6
第48期	7,172,485,490	6,182,810,715	8,620	60	0.6
第49期	6,966,683,384	6,004,788,223	8,619	60	0.6
第50期	6,966,611,448	5,997,559,299	8,609	60	0.6
第51期	6,788,588,676	5,891,740,437	8,679	60	0.6
第52期	6,737,381,386	5,669,054,384	8,414	60	0.6
第53期	6,684,351,134	5,571,863,643	8,336	60	0.6
第54期	6,688,421,481	5,504,154,499	8,229	60	0.6
第55期	6,587,408,654	5,598,614,300	8,499	60	0.6
第56期	6,477,362,735	5,613,270,182	8,666	60	0.6
第57期	6,388,557,451	5,488,003,967	8,590	60	0.6
第58期	6,261,521,601	5,328,742,155	8,510	60	0.6
第59期	6,019,168,685	5,138,321,274	8,537	60	0.6
第60期	5,847,167,784	4,823,529,666	8,249	60	0.6
第61期	5,665,181,905	4,842,670,344	8,548	60	0.6
第62期	5,603,121,946	4,614,727,614	8,236	60	0.6
第63期	5,516,418,438	4,296,678,767	7,789	60	0.6
第64期	5,475,368,929	4,240,457,652	7,745	60	0.6
第65期	5,452,567,321	4,180,181,958	7,666	60	0.6
第66期	5,364,731,277	4,203,990,077	7,836	60	0.6
第67期	5,283,032,732	4,024,645,149	7,618	60	0.6
第68期	5,222,345,279	3,948,722,310	7,561	60	0.6
第69期	5,145,581,853	3,750,913,220	7,290	60	0.6
第70期	5,102,619,145	3,703,369,080	7,258	60	0.6
第71期	5,072,600,088	3,749,832,809	7,392	60	0.6

## 三菱UFJマッコーリー オーストラリア・ハイインカム債券ファンド（毎月決算型）

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第72期	5,039,969,939円	3,700,871,732円	7,343円	40円	0.4%
第73期	4,982,661,187	3,470,628,876	6,965	40	0.4
第74期	4,962,012,601	3,498,190,516	7,050	40	0.4
第75期	4,873,045,530	3,453,920,854	7,088	40	0.4
第76期	4,810,916,443	3,446,765,019	7,164	40	0.4
第77期	4,789,770,598	3,371,191,256	7,038	40	0.4
第78期	4,742,315,431	3,273,906,470	6,904	40	0.4
第79期	4,765,953,442	3,303,389,699	6,931	40	0.4
第80期	4,744,255,919	3,139,418,833	6,617	40	0.4
第81期	4,709,944,328	3,144,559,583	6,676	40	0.4
第82期	4,709,894,514	3,116,990,872	6,618	20	0.2
第83期	4,527,548,285	3,063,118,007	6,766	20	0.2
第84期	4,426,715,980	2,980,065,803	6,732	20	0.2
第85期	4,325,826,510	2,935,253,127	6,785	20	0.2
第86期	4,277,363,611	2,855,462,901	6,676	20	0.2
第87期	4,239,526,626	2,602,604,380	6,139	20	0.2
第88期	4,144,472,049	2,425,253,745	5,852	20	0.2
第89期	4,115,015,708	2,456,044,805	5,968	20	0.2
第90期	4,087,128,797	2,747,174,222	6,722	20	0.2
第91期	4,059,481,291	2,696,854,638	6,643	20	0.2
第92期	4,058,894,489	2,758,174,834	6,795	20	0.2
第93期	4,021,333,558	2,774,997,655	6,901	20	0.2
第94期	4,004,970,057	2,671,791,818	6,671	20	0.2
第95期	3,896,199,766	2,616,625,666	6,716	20	0.2
第96期	3,874,235,493	2,687,454,577	6,937	20	0.2
第97期	3,763,013,324	2,705,899,366	7,191	20	0.2
第98期	3,707,717,804	2,680,261,677	7,229	20	0.2
第99期	3,662,325,290	2,682,422,001	7,324	20	0.2
第100期	3,651,065,785	2,700,619,736	7,397	20	0.2
第101期	3,524,836,309	2,631,232,956	7,465	20	0.2
第102期	3,452,682,168	2,574,940,556	7,458	20	0.2
第103期	3,420,493,622	2,494,912,754	7,294	10	0.1
第104期	3,401,427,780	2,439,659,555	7,172	10	0.1
第105期	3,365,172,934	2,433,216,671	7,231	10	0.1
第106期	3,158,457,232	2,243,668,497	7,104	10	0.1
第107期	3,049,473,003	2,209,549,903	7,246	10	0.1
第108期	3,020,178,600	2,087,199,591	6,911	10	0.1
第109期	2,985,113,237	2,130,345,756	7,137	10	0.1
第110期	2,928,287,613	2,038,746,333	6,962	10	0.1
第111期	2,856,777,279	2,046,368,608	7,163	10	0.1

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1 万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第112期	2,752,394,365円	2,082,253,134円	7,565円	10円	0.1%
第113期	2,664,368,915	1,945,583,517	7,302	10	0.1
第114期	2,634,378,187	1,984,649,195	7,534	10	0.1
第115期	2,606,269,299	1,903,821,402	7,305	10	0.1
第116期	2,508,472,746	1,877,082,884	7,483	10	0.1
第117期	2,414,656,935	1,830,476,108	7,581	10	0.1

## ○分配金のお知らせ

	第113期	第114期	第115期	第116期	第117期
1 万口当たり分配金（税込み）	10円	10円	10円	10円	10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。
- ・分配時において、外国税控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※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。

## ○償還金のお知らせ

1 万口当たり償還金（税込み）	7,257円83銭
-----------------	-----------

◆償還金は償還日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆課税上の取り扱い

- ・個人受益者の場合、償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得等として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。
- ・特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

※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。

## マッコーリー オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド(旧ファンド名称「AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド」)

## 《第10期》決算日2022年10月7日

[計算期間：2021年10月8日～2022年10月7日]

「マッコーリー 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10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10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、マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・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。

「マッコーリー」の商標は、マッコーリー・グループ・リミテッドからのライセンスに基づき利用しています。  
Macquarie Bank Limited (以下「MBL」といいます)を除き、当資料に言及しているマッコーリー並びにマッコーリー関連会社は何れも1959年銀行法(オーストラリア連邦)上の預金受入機関として認可されておらず、これらの法人の負債にはMBLの預金その他の負債は含まれません。別段の記載がない限りMBLは上述の法人の何れに対しても、その負債に関する保証またはそれ以外の支援提供を行うものではありません。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準 額	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰 落	中 率			
	円		%	%	%	百万円
6期(2018年10月9日)	12,344	△	5.1	95.6	△3.8	8,179
7期(2019年10月7日)	12,226	△	1.0	94.7	△1.5	9,525
8期(2020年10月7日)	12,985		6.2	95.6	0.9	8,444
9期(2021年10月7日)	14,445		11.2	92.1	△0.7	6,838
10期(2022年10月7日)	15,277		5.8	92.8	△9.2	3,555

(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) 「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)		円	%			%
	2021年10月7日		14,445	—	92.1		△0.7
	10月末		15,009	3.9	94.4		△0.8
	11月末		14,309	△0.9	93.9		△3.0
	12月末		14,794	2.4	93.4		△2.5
	2022年1月末		14,182	△1.8	94.3		△7.0
	2月末		14,417	△0.2	93.5		△1.3
	3月末		15,577	7.8	92.9		1.0
	4月末		15,356	6.3	95.1		△3.9
	5月末		15,302	5.9	94.4		△0.9
	6月末		15,344	6.2	94.9		△3.7
	7月末		15,664	8.4	93.1		△2.2
	8月末		15,716	8.8	94.8		△1.1
	9月末		15,342	6.2	88.7		△7.7
	(期 末)						
	2022年10月7日		15,277	5.8	92.8		△9.2

(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5.8%の上昇となりました。

## 基準価額等の推移



## ●基準価額の主な変動要因

## (上昇要因)

- ・豪ドルが対円で上昇したこと等。
- ・債券利子収入を享受したこと等。

## (下落要因)

- ・豪州社債市況が下落したこと等。

## ●投資環境について

## ◎債券市況

- ・豪州社債市況は下落しました。
- ・債券市場では、豪州準備銀行(RBA)による利上げ等を受けて豪州金利が上昇したこと等がマイナス要因となり、期を通じてみると同市場は下落しました。

## ◎為替市況

- ・豪ドルは対円で上昇しました。
  - ・商品市況が堅調だったこと等から、豪ドルは対円で上昇しました。
- 当該投資信託のポートフォリオについて
- ・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、2022年8月末において市場平均と比べて長めとしました。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。

## ○今後の運用方針

- ・豪州では、ハイ・イールド市場を含めた社債市場全体で見ると、デフォルト（債務不履行）率は今後、経済回復に伴い低下することが見込まれます。また、商品価格の上昇等が市場の上昇要因になると考えられます。今後は地政学的リスクの高まり等、想定されるリスク要因をふまえて、米国、豪州の景気動向や金融政策等、豪州社債市況を取り巻く環境を注視しつつ、より慎重な銘柄選択を行っていく方針です。
- ・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。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年10月8日～2022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)	% 0.008 (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 )	5 (5) (0)	0.034 (0.034) (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	6	0.042	
期中の平均基準価額は、15,084円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2021年10月8日～2022年10月7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 —	千アメリカドル 2,489
		特殊債券	千オーストラリアドル 499	千オーストラリアドル 530
	オーストラリア	社債券	12,235	42,915 (1,297)

(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 7,098	百万円 7,250	百万円 6,451	百万円 6,555

(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

(2021年10月8日～2022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 9,154	百万円 57	% 0.6	百万円 12,775	百万円 2,377	% 18.6

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

## ○組入資産の明細

(2022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 1,250	千アメリカドル 1,143	千円 165,684	% 4.7	% —	% 2.5	% 2.2	% —
オーストラリア	千オーストラリアドル 36,250	千オーストラリアドル 33,700	3,134,822	88.2	—	48.0	34.7	5.4
合 計	—	—	3,300,506	92.8	—	50.5	36.9	5.4

(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	額面金額	当期		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	4.2	200	192	27,826	2025/3/23	
		4.75	200	178	25,833	2028/3/22	
		4.875	350	343	49,710	2025/6/10	
		4.75	500	429	62,314	2080/9/24	
小	計				165,684		
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			
	特殊債券	1.0	900	804	74,836	2025/12/3	
		2.2	500	412	38,392	2030/5/15	
		4.2	500	484	45,087	2027/4/14	
	社債券	1.814	700	602	56,021	2027/2/5	
		1.9	700	570	53,029	2028/8/4	
		2.1	500	422	39,345	2027/10/15	
		2.119	1,500	1,287	119,762	2027/6/24	
		2.2	500	425	39,587	2027/8/26	
		2.25	500	405	37,760	2030/5/22	
		2.3	900	774	72,036	2027/7/29	
		2.4	500	454	42,246	2027/1/14	
		2.4	500	403	37,509	2028/9/21	
		2.5	900	813	75,676	2027/1/25	
		2.525	500	465	43,269	2026/1/12	
		2.6	500	406	37,808	2029/9/18	
		2.7	500	396	36,873	2030/6/28	
		2.849	500	378	35,199	2032/2/20	
		2.9	500	377	35,084	2030/9/2	
		3.0	500	418	38,916	2028/3/9	
		3.0	450	392	36,511	2029/4/11	
		3.1	500	492	45,858	2024/2/8	
		3.15	600	474	44,094	2031/3/31	
		3.25	500	395	36,781	2031/8/5	
		3.6725	600	591	54,980	2024/9/19	
		3.7	500	471	43,828	2026/4/29	
		3.75	500	497	46,244	2023/10/12	
		3.8	500	492	45,810	2025/5/20	
		3.85	600	591	55,029	2024/10/23	
		3.9	750	728	67,785	2025/4/24	
		4.0	500	493	45,934	2024/6/21	
		4.0	800	783	72,912	2025/4/17	
		4.2	500	457	42,594	2028/8/21	
		4.225	500	489	45,579	2025/5/28	
		4.3	1,000	962	89,562	2026/3/18	
		4.4	500	491	45,705	2027/8/18	
		4.5	500	445	41,396	2030/12/30	
		4.5	700	682	63,447	2027/3/31	
		4.75	500	484	45,053	2026/10/12	

マッコーリー 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 額面金額	期 末		償還年月日
				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					
	5.25 PACIFIC NATI 250519	5.25	500	495	46,133	2025/5/19
	5.25 QANTAS AIRWA 300909	5.25	500	450	41,886	2030/9/9
	FRN AMPOL LTD 801209	6.2099	600	599	55,750	2080/12/9
	FRN AUSNET SERV 801006	5.9654	700	699	65,077	2080/10/6
	FRN AUST & NZ B 290726	4.251	500	502	46,770	2029/7/26
	FRN AUST & NZ B 310226	4.2573	1,000	987	91,902	2031/2/26
	FRN AUST & NZ B 320812	5.906	500	494	46,019	2032/8/12
	FRN BANK OF QUEEN 261027	3.0908	500	491	45,673	2026/10/27
	FRN BANK OF QUEEN 320519	4.0786	500	479	44,564	2032/5/19
	FRN BENDIGO AND 301119	4.2786	500	491	45,756	2030/11/19
	FRN COMMONWEALT 300910	4.4729	1,100	1,093	101,708	2030/9/10
	FRN MACQUARIE B 300528	5.3331	600	610	56,809	2030/5/28
	FRN NATIONAL A 290517	4.4392	1,100	1,108	103,137	2029/5/17
	FRN NATIONAL A 301118	4.0167	900	888	82,689	2030/11/18
	FRN NATIONAL A 311118	3.225	550	493	45,900	2031/11/18
	FRN SUNCORP-MET 281205	4.6911	1,000	1,002	93,290	2028/12/5
	FRN WESTPAC BAN 280614	4.8	1,100	1,103	102,626	2028/6/14
	FRN WESTPAC BAN 290816	4.334	1,000	984	91,569	2029/8/16
	小 計				3,134,822	
	合 計				3,300,506	

(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 末	
			買 建 額	売 建 額
			百万円	百万円
外 国	債券先物取引	NOTE5Y	93	—
		NOTE2Y	—	862
		NOTE10Y	129	—
		AUST5YR 2212	112	—
		AUST10Y	329	—
		AUST3Y	—	129

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

○投資信託財産の構成

(2022年10月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	3,300,506	90.3
コール・ローン等、その他	355,180	9.7
投資信託財産総額	3,655,686	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (3,544,932千円) の投資信託財産総額 (3,655,686千円) に対する比率は97.0%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=144.92円	1 オーストラリアドル=93.02円
------------------	--------------------

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年10月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,486,620,457
コール・ローン等	196,491,631
公社債(評価額)	3,300,506,745
未収入金	853,001,013
未収利息	25,401,648
前払費用	578,119
差入委託証拠金	110,641,301
(B) 負債	931,377,672
未払金	931,377,656
未払利息	16
(C) 純資産総額(A-B)	3,555,242,785
元本	2,327,225,445
次期繰越損益金	1,228,017,340
(D) 受益権総口数	2,327,225,445口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,277円

<注記事項>

- ①期首元本額 4,734,109,848円  
 期中追加設定元本額 358,247,647円  
 期中一部解約元本額 2,765,132,050円  
 また、1口当たり純資産額は、期末15,277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)	2,302,562,762円
オーストラリア好利回り3資産バランス<為替ヘッジあり>(年2回決算型)	24,662,683円
合計	2,327,225,445円

○損益の状況 (2021年10月8日~2022年10月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	195,599,975
受取利息	197,155,926
支払利息	△ 1,555,951
(B) 有価証券売買損益	237,756,320
売買益	934,298,679
売買損	△ 696,542,359
(C) 先物取引等取引損益	△ 68,620,367
取引益	113,448,065
取引損	△ 182,068,432
(D) 保管費用等	△ 2,063,843
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	362,672,085
(F) 前期繰越損益金	2,104,535,963
(G) 追加信託差損益金	175,662,353
(H) 解約差損益金	△1,414,853,061
(I) 計(E+F+G+H)	1,228,017,340
次期繰越損益金(I)	1,228,017,340

(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。

【お 知 ら せ】

AMP キャピタル・インベスターズ・リミテッドのパブリック・マーケット部門がマッコリー・アセット・マネジメント・ホールディングス・ピーティーワイ・リミテッドに売却されることに伴い、運用指図権限の委託先の変更およびファンド名称の変更等をするため、信託約款に所要の変更を行いました。

ファンド名称の変更について

変更前：AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド

変更後：マッコリー オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド

運用指図権限の委託先の変更について

変更前：AMP キャピタル・インベスターズ・リミテッド

変更後：マッコリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッド

(2022年3月26日)