

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投資／海外／不動産投資	特化型
信託期間	2025年3月14日まで（2015年3月20日設定）	
運用方針	<p>円建ての外国投資信託であるAMP オーストラリアリート ファンドの投資信託証券への投資を通じて、主としてオーストラリアの不動産投資信託証券への実質的な投資に加えて、円に対する豪ドルのコール・オプションおよびオーストラリアの不動産投資信託指数のコール・オプションの売却によってオプション・プレミアム収入を獲得する、カバード・コール戦略を実質的に活用します。なお、証券投資信託であるマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券への投資も行います。円建ての外国投資信託への投資は高位を維持することを基本とします。</p> <p>不動産投資信託証券等の運用にあたっては、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドが行います。また、カバード・コール戦略の運用は、クレディ・スイス・マネジメント（ケイマン）リミテッドが行います。</p>	
主要運用対象	三菱UFJ/AMP オーストラリア REITファンド <Wプレミアム> (毎月決算型)	AMP オーストラリア リート ファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンドの投資信託証券を主要投資対象とします。
	AMP オーストラリア リート ファンド	オーストラリアの不動産投資信託証券、ならびに円に対する豪ドルのコール・オプション取引およびオーストラリアの不動産投資信託指数のコール・オプション取引を主要投資対象とします。
	マネー・ マーケット・ マザーファンド	わが国の公社債等を主要投資対象とします。外貨建資産への投資は行いません。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への直接投資は行いません。	
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3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。

- ファンドは特化型運用を行います。一般社団法人投資信託協会は信用リスク集中回避を目的とした投資制限（分散投資規制）を設けており、投資対象に支配的な銘柄（寄与度が10%を超える又は超える可能性の高い銘柄）が存在し、又は存在することとなる可能性が高いものを、特化型としています。
 - ファンドは、オーストラリアの不動産投資信託証券に実質的に投資します。オーストラリアの不動産投資信託証券には、寄与度が10%を超える又は超える可能性の高い支配的な銘柄が存在するため、特定の銘柄への投資が集中することがあり、当該支配的な銘柄に経営破綻や経営・財務状況の悪化が生じた場合には、大きな損失が発生することがあります。
- * 寄与度とは、投資対象候補銘柄の時価総額の合計額における一発行体あたりの時価総額が占める比率または運用管理等に用いる指数における一発行体あたりの構成比率を指します。

運用報告書（全体版）

三菱UFJ/AMP オーストラリア REITファンド <Wプレミアム>（毎月決算型）

愛称：コアランド



第19期（決算日：2016年10月17日）
 第20期（決算日：2016年11月15日）
 第21期（決算日：2016年12月15日）
 第22期（決算日：2017年1月16日）
 第23期（決算日：2017年2月15日）
 第24期（決算日：2017年3月15日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「三菱UFJ/AMP オーストラリアREITファンド<Wプレミアム>（毎月決算型）」は、去る3月15日に第24期の決算を行いましたので、法令に基づいて第19期～第24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。

 **MUFG**
 三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 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

お客様専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034
 (9:00~17:00、土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く)
 お客様のお取引内容につきましては、お取引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。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	額			債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 分 配	み 金	期 騰 落 中 率				
	円	円	円	%	%	%	%	百万円
(設定日) 2015年3月20日	10,000	—	—	—	—	—	—	11,639
1期(2015年4月15日)	9,810	—	—	△1.9	0.1	—	99.7	16,546
2期(2015年5月15日)	9,926	—	—	1.2	0.1	—	98.8	18,469
3期(2015年6月15日)	9,905	—	—	△0.2	0.1	—	99.0	20,216
4期(2015年7月15日)	9,618	—	130	△1.6	0.1	—	99.0	20,123
5期(2015年8月17日)	9,487	—	130	△0.0	0.1	—	99.0	20,084
6期(2015年9月15日)	8,589	—	130	△8.1	0.0	—	99.0	18,320
7期(2015年10月15日)	8,591	—	130	1.5	0.1	—	99.0	16,830
8期(2015年11月16日)	8,594	—	130	1.5	0.1	—	99.0	15,783
9期(2015年12月15日)	8,589	—	130	1.5	0.1	—	99.0	14,832
10期(2016年1月15日)	8,037	—	130	△4.9	0.1	—	99.0	13,165
11期(2016年2月15日)	7,886	—	130	△0.3	0.1	—	99.0	12,351
12期(2016年3月15日)	8,408	—	130	8.3	0.1	—	99.0	12,631
13期(2016年4月15日)	8,419	—	130	1.7	0.1	—	98.4	12,235
14期(2016年5月16日)	8,129	—	130	△1.9	0.0	—	99.0	11,735
15期(2016年6月15日)	8,003	—	130	0.0	0.0	—	99.0	11,836
16期(2016年7月15日)	8,507	—	130	7.9	0.0	—	99.1	12,754
17期(2016年8月15日)	8,049	—	130	△3.9	0.0	—	98.7	11,890
18期(2016年9月15日)	7,363	—	130	△6.9	0.0	—	98.9	11,050
19期(2016年10月17日)	7,443	—	130	2.9	0.0	—	99.0	11,254
20期(2016年11月15日)	6,880	—	130	△5.8	0.0	—	99.0	10,357
21期(2016年12月15日)	7,337	—	130	8.5	0.0	—	99.0	10,925
22期(2017年1月16日)	7,247	—	130	0.5	0.0	—	99.0	10,603
23期(2017年2月15日)	7,303	—	130	2.6	0.0	—	99.0	10,367
24期(2017年3月15日)	6,978	—	130	△2.7	0.0	—	99.0	9,408

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 信託約款の規定にしたがい、第3期までの収益分配は行っていません。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドは、オーストラリアの不動産投資信託証券への実質的な投資に加えて、円に対する豪ドルのコール・オプションおよびオーストラリアの不動産投資信託指数のコール・オプションの売却によってオプション・プレミアム収入を獲得する、カバード・コール戦略を実質的に活用し値上がり益の獲得および配当収益の確保をめざしますが、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。

(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	投 資 信 託 組 入 比 率	信 託 券 率
			騰 落 率	騰 落 率				
第19期	(期 首) 2016年9月15日	円 7,363	% -	% -	% 0.0	% -	% 98.9	% 98.9
	9月末	7,659	4.0	0.0	-	98.9		
	(期 末) 2016年10月17日	7,573	2.9	0.0	-	99.0		
第20期	(期 首) 2016年10月17日	7,443	-	0.0	-	99.0		
	10月末	7,097	△4.6	0.0	-	99.2		
	(期 末) 2016年11月15日	7,010	△5.8	0.0	-	99.0		
第21期	(期 首) 2016年11月15日	6,880	-	0.0	-	99.0		
	11月末	7,201	4.7	0.0	-	98.8		
	(期 末) 2016年12月15日	7,467	8.5	0.0	-	99.0		
第22期	(期 首) 2016年12月15日	7,337	-	0.0	-	99.0		
	12月末	7,297	△0.5	0.0	-	99.0		
	(期 末) 2017年1月16日	7,377	0.5	0.0	-	99.0		
第23期	(期 首) 2017年1月16日	7,247	-	0.0	-	99.0		
	1月末	7,136	△1.5	0.0	-	97.7		
	(期 末) 2017年2月15日	7,433	2.6	0.0	-	99.0		
第24期	(期 首) 2017年2月15日	7,303	-	0.0	-	99.0		
	2月末	7,287	△0.2	0.0	-	98.1		
	(期 末) 2017年3月15日	7,108	△2.7	0.0	-	99.0		

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(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。

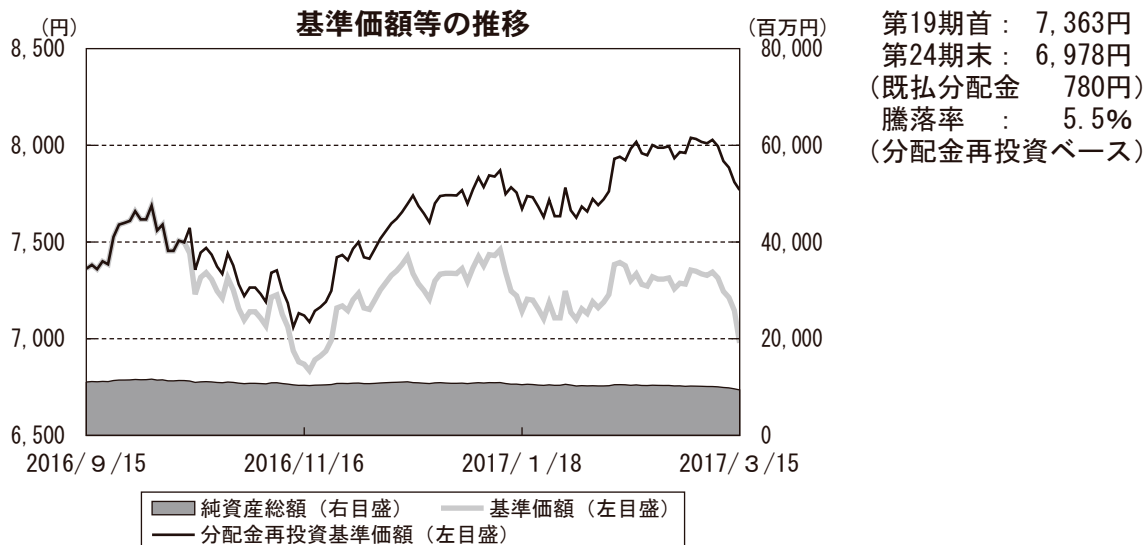
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当作成期中の基準価額等の推移について (第19期～第24期：2016/9/16～2017/3/15)

基準価額の動き

基準価額は当作成期首に比べ5.5% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。



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

基準価額の主な変動要因

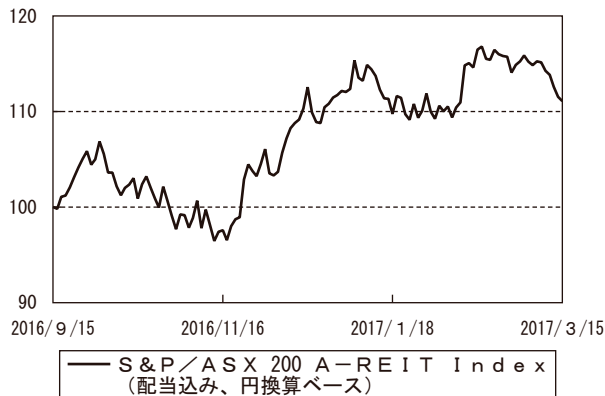
上昇要因	豪ドルが対円で上昇したことや、オプション・プレミアム収入を獲得したことが基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	オーストラリア不動産投資信託証券(REIT)市況がローカルベースで下落したことや、豪ドルが対円で上昇した局面で発生した円に対する豪ドルのコール・オプションの売却に係る損失などが、基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

(第19期～第24期：2016/9/16～2017/3/15)

(ご参考)

オーストラリアREIT市況の推移
(当作成期首を100として指数化)



(注) S&P/ASX 200 A-REIT Indexとは、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表している指数で、オーストラリア証券取引所の上場不動産投資信託の動向きを示す代表的な指数の1つです。S&P/ASX 200 A-REIT Index (配当込み、円換算ベース)とは、S&P/ASX 200 A-REIT Index (配当込み)をもとに、委託会社が計算したものです。S&P/ASX 200 A-REIT IndexはS&P Dow Jones Indices LLC (「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC (「S&P」)の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているのではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P/ASX 200 A-REIT Indexの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

◎オーストラリアREIT市況

・当作成期首から2016年11月中旬にかけては、国内経済の回復などを背景に豪州連邦準備銀行(RBA)による追加利下げの可能性が後退したとの見方や、長期金利の上昇などを背景に下落しました。11月中旬から当作成期末にかけては、商品市況の回復などを受けた投資家心理の改善に加え、金利上昇に対する売り圧力が一服するなかで上昇したものの、当作成期を通じてみるとオーストラリアREIT市況はローカルベースで下落しました。

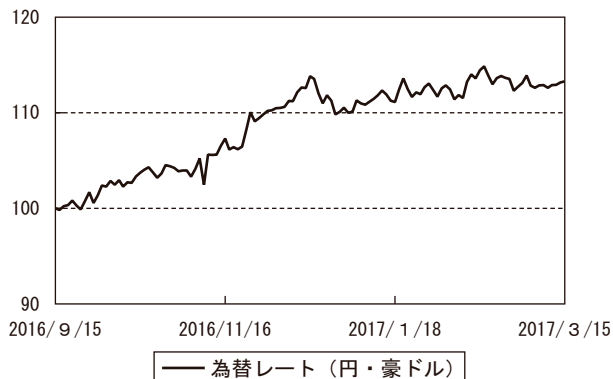
◎為替市況

・RBAによる追加利下げ観測の後退や米国の大統領選挙の結果を受けた円安・米ドル高の進行に加えて、中国の経済指標が概ね堅調な結果を示したことや鉄鉱石価格などの商品市況が回復したことなどから、豪ドルは対円で上昇しました。

◎国内短期金融市場

・当作成期の短期金融市場を見ると、日本銀行は2016年9月の金融政策決定会合で金融市場調整方針を、マネタリーベースの年間約80兆円に相当するペースでの増加から、長短金利の操作に変更する決定をしました。コール・レート(無担保・翌日物)はマイナス圏で推移しました。2017年3月15日のコール・レートは-0.046%となりました。

為替市況の推移
(当作成期首を100として指数化)



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REITファンド<Wプレミアム>(毎月決算型)>

- ・外国投資信託であるAMP オーストラリア リート ファンドを高位に組み入れた運用を行いました。また、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券を一部組み入れた運用を行いました。

<AMP オーストラリア リート ファンド>

基準価額は当作成期首に比べ6.1% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。

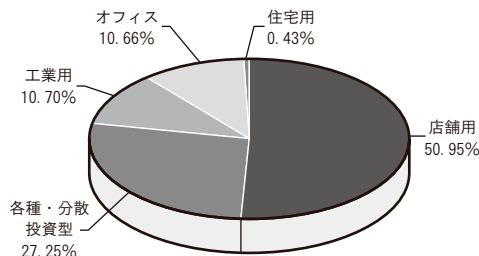
- ・オーストラリアのREITを高位に組み入れる運用を行うとともに、円に対する豪ドルのコール・オプションおよびオーストラリアのREIT指数のコール・オプションの売却によってオプション・プレミアム収入を獲得する、カバード・コール戦略を活用する運用を行いました。
- ・投資するREITについては、中長期的な不動産価値の向上による恩恵が期待される、店舗用の優良な物件を重視しながら、オフィス用REITについては都市毎の経済環境によって選別的な運用を行いました。
- ・個別銘柄では、オーストラリアREITで時価総額最大の銘柄である店舗用REITの「SCENTRE GROUP」や米国や英国に不動産を保有する店舗用REITの「WESTFIELD CORP」などが下落しました。
- ・当作成期においては、オーストラリアREIT市況がローカルベースで下落したことや、豪ドルが対円で上昇した局面で発生した円に対する豪ドルのコール・オプションの売却に係る損失などがマイナスとなったものの、豪ドルが対円で上昇したことや、オプション・プレミアム収入を獲得したことがプラスとなり、基準価額 (分配金再投資ベース) は上昇しました。

下記は、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドの資料（現地月末前営業日基準）に基づき作成したAMP オーストラリア リート ファンドの不動産投資信託証券部分の状況です。

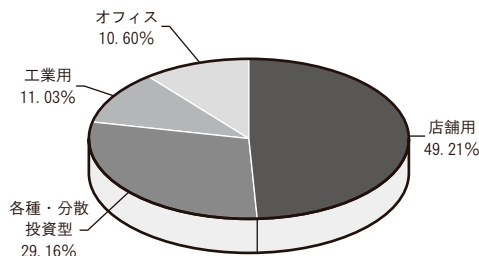
(ご参考)

用途別構成比率

2016年8月末



2017年2月末



(注) 比率はREIT評価額に対する割合です。

(注) GICS (世界産業分類基準) に基づいてAMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドの分類で表示しています。

下記は、クレディ・スイス・マネジメント (ケイマン) リミテッドの資料（現地月末前営業日基準）に基づき作成したAMP オーストラリア リート ファンドのカバード・コール戦略部分の状況です。

(ご参考)

ポートフォリオ特性値

2016年8月末

【通貨カバード・コール戦略】

オプション・プレミアム	7.61%
カバー率	49.70%
平均権利行使価格	100.03%
平均権利行使期間	31日

2017年2月末

【通貨カバード・コール戦略】

オプション・プレミアム	6.73%
カバー率	49.78%
平均権利行使価格	101.88%
平均権利行使期間	28日

【豪リート カバード・コール戦略】

オプション・プレミアム	7.68%
カバー率	49.70%
平均権利行使価格	100.44%
平均権利行使期間	31日

【豪リート カバード・コール戦略】

オプション・プレミアム	9.97%
カバー率	49.78%
平均権利行使価格	99.52%
平均権利行使期間	28日

- ・オプション・プレミアムは、円建外国投資信託の純資産総額に対する年率調整後のプレミアム収入です。
- ・カバー率は、円建外国投資信託の純資産総額に対するオプションのポジションです。
- ・平均権利行使価格は、原資産価格に対する権利行使価格の水準（現地月末前営業日基準）です。
- ・平均権利行使期間は、オプション権利行使日までの平均日数です。

<マネー・マーケット・マザーファンド>

基準価額は当作成期首に比べ横ばいとなりました。

- ・残存期間の短い社債を組み入れつつ、コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。その結果、利子等収益は積み上がったものの、運用資金に対するマイナス金利適用などの影響を受けて、基準価額は横ばいとなりました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・当ファンドは、オーストラリアの不動産投資信託証券への実質的な投資に加えて、円に対する豪ドルのコール・オプションおよびオーストラリアの不動産投資信託指数のコール・オプションの売却によってオプション・プレミアム収入を獲得する、カバード・コール戦略を実質的に活用し値上がり益の獲得および配当収益の確保をめざしますが、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19期	第20期	第21期	第22期	第23期	第24期
	2016年9月16日～ 2016年10月17日	2016年10月18日～ 2016年11月15日	2016年11月16日～ 2016年12月15日	2016年12月16日～ 2017年1月16日	2017年1月17日～ 2017年2月15日	2017年2月16日～ 2017年3月15日
当期分配金	130	130	130	130	130	130
(対基準価額比率)	1.717%	1.854%	1.741%	1.762%	1.749%	1.829%
当期の収益	130	130	130	130	130	130
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	1,162	1,176	1,187	1,195	1,197	1,202

(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REITファンド<Wプレミアム>(毎月決算型)>

◎今後の運用方針

- ・外国投資信託への投資を通じてオーストラリアのREITを高位に組み入れ、値上がり益の獲得および配当収益の確保をめざします。また、マネー・マーケット・マザーファンド投資信託証券を一部組み入れた運用を行います。

<AMP オーストラリア リート ファンド>

◎運用環境の見通し

- ・オーストラリアREITについては、国内経済は個人消費や雇用市場を中心に回復していることが確認されるものの、物価上昇率や賃金成長率が依然として低水準であることなどからRBAによる緩和的な金融政策は続くとみています。実物不動産市場では、こうした国内経済の回復が下支えとなるなかで海外機関投資家やテナントなどからの需要は安定的であり、シドニーやメルボルンなどの優良オフィス不動産を中心に不動産のファンダメンタルズは良好な状態にあります。また、足下のREIT価格はREITが保有する不動産の資産価値対比で割安感が高まっており、こうしたバリュエーションに注目した買い需要や、不動産開発や賃貸収益の成長などを背景とした堅調な不動産ファンダメンタルズに着目した資金流入が期待されます。

◎今後の運用方針

- ・運用については、不動産価値の向上が期待される優良な物件を重視した運用を行い、中長期的な信託財産の成長と配当収益の確保をめざします。セクター別では、オフィス用REITに注目しているほか、店舗用REITは、緩やかな資産価値の上昇が期待される優良な不動産を保有する銘柄に注目しています。個別銘柄では、高い物件開発能力を有する銘柄に注目しています。
- ・また、円に対する豪ドルのコール・オプションおよびオーストラリアのREIT指数のコール・オプションの売却によってオプション・プレミアム収入を獲得する、カバード・コール戦略を実質的に活用します。

<マネー・マーケット・マザーファンド>

◎運用環境の見通し

- ・原油価格の上昇などを背景に物価は緩やかに上昇していくと予想していますが、日本銀行の物価目標である2%には届かないと思われます。したがって、今後も金融緩和と政策が継続すると想定されることから、短期金利は低位で推移すると予想しています。

◎今後の運用方針

- ・コール・ローン等短期金融商品や残存期間の短い社債などへの投資を通じて、安定した収益の確保をめざしていく方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2016年9月16日～2017年3月15日)

項 目	第19期～第24期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(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)	(14)	(0.198)	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)	(0.321)	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)	(1)	(0.013)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	0	0.002	(b) その他費用＝作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数
(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
合 計	39	0.534	
作成期中の平均基準価額は、7,279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) 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) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)が支払った費用を含みません。

(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9月16日～2017年3月15日)

投資信託証券

銘 柄		第19期～第24期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	千口	千円	千口	千円	
AMP オーストラリア リート ファンド	222	1,397,000	382	2,390,230	

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2016年9月16日～2017年3月15日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2017年3月15日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	第18期末		第24期末			
		口	数	口	数	評 価 額	比 率
AMP オーストラリア リート ファンド			千口		千口	千円	%
			1,689		1,530	9,311,014	99.0
合	計		1,689		1,530	9,311,014	99.0

(注) 比率は三菱UFJ／AMP オーストラリアREITファンド<Wプレミアム> (毎月決算型) の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

銘	柄	第18期末		第24期末		
		口	数	口	数	評 価 額
マネー・マーケット・マザーファンド			千口		千口	千円
			11,293		11,293	11,501

○投資信託財産の構成

(2017年3月15日現在)

項	目	第24期末	
		評 価 額	比 率
投資信託受益証券		千円	%
		9,311,014	95.5
マネー・マーケット・マザーファンド		11,501	0.1
コール・ローン等、その他		428,677	4.4
投資信託財産総額		9,751,192	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第19期末	第20期末	第21期末	第22期末	第23期末	第24期末
	2016年10月17日現在	2016年11月15日現在	2016年12月15日現在	2017年1月16日現在	2017年2月15日現在	2017年3月15日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	11,483,509,623	10,600,665,284	11,198,923,021	10,841,940,118	10,570,802,130	9,751,192,018
コール・ローン等	147,237,289	147,290,378	108,537,420	148,252,879	97,500,017	246,046,160
投資信託受益証券(評価額)	11,145,391,204	10,251,313,776	10,820,724,471	10,498,356,109	10,268,380,983	9,311,014,728
マネー・マーケット・マザーファンド(評価額)	11,501,130	11,501,130	11,501,130	11,501,130	11,501,130	11,501,130
未収入金	179,380,000	190,560,000	258,160,000	183,830,000	193,420,000	182,630,000
(B) 負債	229,240,983	243,198,746	273,630,062	238,553,779	203,656,567	342,263,053
未払収益分配金	196,571,613	195,701,602	193,575,120	190,209,900	184,543,671	175,295,403
未払解約金	21,946,361	38,204,144	70,578,387	38,110,541	9,888,460	158,539,626
未払信託報酬	10,690,599	9,264,870	9,447,950	10,202,373	9,196,643	8,402,403
未払利息	186	207	128	214	77	296
その他未払費用	32,224	27,923	28,477	30,751	27,716	25,325
(C) 純資産総額(A-B)	11,254,268,640	10,357,466,538	10,925,292,959	10,603,386,339	10,367,145,563	9,408,928,965
元本	15,120,893,355	15,053,969,425	14,890,393,916	14,631,530,827	14,195,667,024	13,484,261,802
次期繰越損益金	△ 3,866,624,715	△ 4,696,502,887	△ 3,965,100,957	△ 4,028,144,488	△ 3,828,521,461	△ 4,075,332,837
(D) 受益権総口数	15,120,893,355口	15,053,969,425口	14,890,393,916口	14,631,530,827口	14,195,667,024口	13,484,261,802口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,443円	6,880円	7,337円	7,247円	7,303円	6,978円

○損益の状況

項 目	第19期	第20期	第21期	第22期	第23期	第24期
	2016年9月16日～ 2016年10月17日	2016年10月18日～ 2016年11月15日	2016年11月16日～ 2016年12月15日	2016年12月16日～ 2017年1月16日	2017年1月17日～ 2017年2月15日	2017年2月16日～ 2017年3月15日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	227,626,231	224,883,557	210,267,668	209,614,149	192,614,354	188,530,855
受取配当金	227,632,269	224,887,903	210,272,396	209,618,593	192,619,131	188,534,516
受取利息	355	—	—	248	523	327
支払利息	△ 6,393	△ 4,346	△ 4,728	△ 4,692	△ 5,300	△ 3,988
(B) 有価証券売買損益	95,650,395	△ 863,466,817	669,457,819	△ 141,422,262	80,411,067	△ 444,792,484
売買益	96,827,313	9,274,734	675,917,623	2,805,737	88,439,955	10,483,362
売買損	△ 1,176,918	△ 872,741,551	△ 6,459,804	△ 144,227,999	△ 8,027,988	△ 455,275,846
(C) 信託報酬等	△ 10,722,823	△ 9,292,793	△ 9,476,427	△ 10,233,124	△ 9,224,359	△ 8,427,728
(D) 当期損益金(A+B+C)	312,553,803	△ 647,876,053	870,249,060	57,958,763	263,801,062	△ 264,689,357
(E) 前期繰越損益金	△3,181,687,399	△3,007,778,195	△3,762,865,271	△2,994,543,456	△3,002,776,988	△2,753,264,499
(F) 追加信託差損益金	△ 800,919,506	△ 845,147,037	△ 878,909,626	△ 901,349,895	△ 905,001,864	△ 882,083,578
(配当等相当額)	(511,255,410)	(528,426,629)	(538,480,756)	(544,820,022)	(540,486,677)	(522,531,029)
(売買損益相当額)	(△1,312,174,916)	(△1,373,573,666)	(△1,417,390,382)	(△1,446,169,917)	(△1,445,488,541)	(△1,404,614,607)
(G) 計(D+E+F)	△3,670,053,102	△4,500,801,285	△3,771,525,837	△3,837,934,588	△3,643,977,790	△3,900,037,434
(H) 収益分配金	△ 196,571,613	△ 195,701,602	△ 193,575,120	△ 190,209,900	△ 184,543,671	△ 175,295,403
次期繰越損益金(G+H)	△3,866,624,715	△4,696,502,887	△3,965,100,957	△4,028,144,488	△3,828,521,461	△4,075,332,837
追加信託差損益金	△ 800,919,506	△ 845,147,037	△ 878,909,626	△ 901,349,895	△ 905,001,864	△ 882,083,578
(配当等相当額)	(511,255,412)	(528,426,630)	(538,480,756)	(544,820,024)	(540,486,678)	(522,531,030)
(売買損益相当額)	(△1,312,174,918)	(△1,373,573,667)	(△1,417,390,382)	(△1,446,169,919)	(△1,445,488,542)	(△1,404,614,608)
分配準備積立金	1,246,307,415	1,243,411,376	1,230,003,668	1,203,879,419	1,159,181,156	1,098,567,526
繰越損益金	△4,312,012,624	△5,094,767,226	△4,316,194,999	△4,330,674,012	△4,082,700,753	△4,291,816,785

(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 15,007,567,215円

 作成期中追加設定元本額 1,180,164,401円

 作成期中一部解約元本額 2,703,469,814円

 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.6978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4,075,332,837円です。

③分配金の計算過程

項 目	2016年9月16日～ 2016年10月17日	2016年10月18日～ 2016年11月15日	2016年11月16日～ 2016年12月15日	2016年12月16日～ 2017年1月16日	2017年1月17日～ 2017年2月15日	2017年2月16日～ 2017年3月15日
費用控除後の配当等収益額	220,077,723円	215,592,181円	208,004,998円	199,382,808円	186,108,192円	180,104,361円
費用控除後・繰越大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	511,255,412円	528,426,630円	538,480,756円	544,820,024円	540,486,678円	522,531,030円
分配準備積立金額	1,222,801,305円	1,223,520,797円	1,215,573,790円	1,194,706,511円	1,157,616,635円	1,093,758,568円
当ファンドの分配対象収益額	1,954,134,440円	1,967,539,608円	1,962,059,544円	1,938,909,343円	1,884,211,505円	1,796,393,959円
1万口当たり収益分配対象額	1,292円	1,306円	1,317円	1,325円	1,327円	1,332円
1万口当たり分配金額	130円	130円	130円	130円	130円	130円
収益分配金金額	196,571,613円	195,701,602円	193,575,120円	190,209,900円	184,543,671円	175,295,403円

○分配金のお知らせ

	第19期	第20期	第21期	第22期	第23期	第24期
1 万口当たり分配金 (税込み)	130円	130円	130円	130円	130円	130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。

○ (参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2017年3月15日現在)

<マネー・マーケット・マザーファンド>

下記は、マネー・マーケット・マザーファンド全体(1,574,773千円)の内容です。

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	第24期末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
普通社債券	千円 100,000 (100,000)	千円 100,200 (100,200)	% 6.2 (6.2)	% — (—)	% — (—)	% — (—)	% 6.2 (6.2)
合 計	100,000 (100,000)	100,200 (100,200)	6.2 (6.2)	— (—)	— (—)	— (—)	6.2 (6.2)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	第24期末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券 第113回オリスックス	% 2.19	千円 100,000	千円 100,200	2017/4/18
合 計		100,000	100,200	

国内その他有価証券

区 分	第24期末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 1,399,999	% 87.3

(注) 比率は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

＜参考＞投資する投資信託証券およびその概要

ファンド名	AMP オーストラリア リート ファンド
運用方針	主としてオーストラリアの不動産投資信託証券に投資することにより、資産の中長期的な成長をめざします。また、原則として円に対する豪ドルのコール・オプションおよびオーストラリアの不動産投資信託指数のコール・オプションを売却し、オプションのプレミアム収入の獲得をめざします。
主要運用対象	オーストラリアの不動産投資信託証券、ならびに円に対する豪ドルのコール・オプション取引およびオーストラリアの不動産投資信託指数のコール・オプション取引
主な組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・オーストラリアの不動産投資信託証券について、同一の発行体が発行する銘柄への投資比率は、純資産総額の35%以内とします。 ・オーストラリア国債への投資比率は、取得時において純資産総額の10%以内とします。 ・対円での為替ヘッジは行いません。
決算日	毎年9月30日
分配方針	原則として毎月分配を行う方針です。

運用計算書、純資産変動計算書、投資有価証券明細表はAUDITED ANNUAL REPORT SEPTEMBER 30, 2016版から抜粋して作成しています。

(1) 運用計算書

(2015年10月1日～2016年9月30日)

AMP オーストラリア
リート ファンド

円

投資収入：

純配当収入	460,509,246
預金利息	1,804,003
	<hr/> 462,313,249

費用：

管理費用、保管費用	(16,444,320)
代行費用、マネジャー費用	(26,409,824)
その他費用	(15,954,207)
監査報酬	(2,052,053)
副マネージャー費用	(58,113,067)
副保管費用	(4,567,670)
受託費用	(920,892)
	<hr/> (124,462,033)

投資純収入

337,851,216

実現純利益(損失)：

実現純利益(損失) 投資有価証券	(777,237,025)
実現純利益(損失) その他資産、負債の外貨換算	(14,651,998)
実現純利益(損失) 為替予約	6,633,513
実現純利益(損失) オプション	(32,461,984)
	<hr/> (817,717,494)

実現純利益(損失)

(817,717,494)

未実現評価益(評価損)の純変動：

投資有価証券	1,982,038,985
為替予約	(539,185)
その他資産、負債の外貨換算	2,631,402
オプション	(132,161,583)
	<hr/> 1,851,969,619

運用による純資産の純増(減)額

1,372,103,341

(注) データ提供元：クレディ・スイス・マネジメント(ケイマン) リミテッド

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(2) 純資産変動計算書

(2015年10月1日～2016年9月30日)

AMP オーストラリア
リート ファンド

円

期首純資産	17,025,092,097
投資純収入	337,851,216
実現純利益(損失) :	
実現純利益(損失) 投資有価証券	(777,237,025)
実現純利益(損失) その他資産、負債の外貨換算	(14,651,998)
実現純利益(損失) 為替予約	6,663,513
実現純利益(損失) オプション	(32,461,984)
	(817,717,494)
未実現評価益(評価損)の純変動 :	
投資有価証券	1,982,038,985
為替予約	(539,185)
その他資産、負債の外貨換算	2,631,402
オプション	(132,161,583)
	1,851,969,619
出資	4,312,990,784
償還	(7,867,830,000)
分配金額	(3,454,660,784)
	(7,009,500,000)
期末純資産	11,387,695,438

(注) データ提供元 : クレディ・スイス・マネジメント (ケイマン) リミテッド

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(3) 投資有価証券明細表
(2016年9月30日現在)

銘柄	通貨	口数	取得原価	市場価格	対純資産比率 (%)
TRANSFERABLE SECURITIES ADMITTED TO AN OFFICIAL STOCK EXCHANGE OR DEALT IN ON ANOTHER REGULATED MARKET					
REAL ESTATE INVESTMENT TRUST					
<i>AUSTRALIA</i>					
ABACUS PROPERTY GROUP	AUD	85,133	21,124,891	19,065,952	0.17%
AVENTUS RETAIL P	AUD	503,510	85,904,919	96,375,748	0.85%
BWP TRUST	AUD	195,271	56,225,913	48,574,182	0.43%
CHARTER HALL GROUP	AUD	722,080	319,841,295	285,936,063	2.51%
CHARTER HALL RETAIL REIT	AUD	208,302	79,048,889	68,280,472	0.60%
DEXUS PROPERTY GROUP	AUD	1,248,309	885,001,695	885,127,600	7.77%
GOODMAN GROUP	AUD	2,085,285	1,200,859,844	1,176,412,191	10.33%
GPT GROUP/THE	AUD	2,185,269	926,528,654	856,876,283	7.52%
INGENIA COMMUNITIES GROUP	AUD	230,355	50,156,474	50,161,055	0.44%
INVESTA OFFICE FUND	AUD	931,529	341,066,787	329,894,672	2.90%
MIRVAC GROUP	AUD	5,225,972	970,015,334	907,147,283	7.97%
SCENTRE GROUP	AUD	7,305,866	2,639,000,390	2,660,922,637	23.37%
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GROUP	AUD	747,222	139,895,292	130,285,137	1.14%
STOCKLAND	AUD	2,940,725	1,229,036,488	1,084,736,097	9.53%
VICINITY CENTERS	AUD	3,807,860	1,070,125,279	935,412,029	8.21%
WESTFIELD CORP	AUD	2,550,103	2,329,606,474	1,922,796,165	16.88%
			12,343,438,618	11,458,003,566	100.62%
TOTAL INVESTMENTS IN SECURITIES			12,343,438,618	11,458,003,566	100.62%
CASH AT BANKS AND BROKERS				266,236,931	2.34%
INVESTMENTS IN OPTIONS				(302,516,011)	-2.66%
OTHER NET LIABILITIES				(34,029,048)	-0.30%
TOTAL NET ASSETS				11,387,695,438	100.00%

マネー・マーケット・マザーファンド

《第24期》決算日2016年11月21日

[計算期間：2016年5月21日～2016年11月21日]

「マネー・マーケット・マザーファンド」は、11月21日に第24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24期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主要運用対象	わが国の公社債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は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率	債組入比率	債券先物比率	純資産額
20期(2014年11月20日)	10,183	0.0	84.3	—	2,373
21期(2015年5月20日)	10,183	0.0	89.3	—	1,959
22期(2015年11月20日)	10,185	0.0	91.2	—	27,834
23期(2016年5月20日)	10,183	△0.0	39.0	—	5,562
24期(2016年11月21日)	10,184	0.0	24.4	—	4,420

(注) 当ファンドは主として短期債券、コール・ローンなどによる運用を行い、安定的な収益の確保をめざすファンドであり、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	債券先物比率
(期首) 2016年5月20日	10,183	—	39.0	—
5月末	10,184	0.0	37.2	—
6月末	10,185	0.0	29.1	—
7月末	10,184	0.0	27.4	—
8月末	10,183	0.0	17.7	—
9月末	10,184	0.0	17.0	—
10月末	10,184	0.0	21.1	—
(期末) 2016年11月21日	10,184	0.0	24.4	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

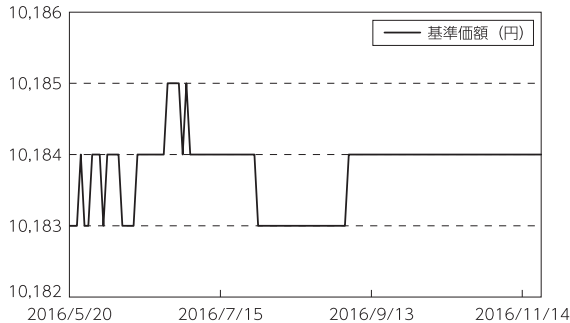
○運用経過

●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0.01%の上昇となりました。

基準価額の推移



●投資環境について

◎国内短期金融市場

- ・当期の短期金融市場を見ると、日銀は2016年9月の金融政策決定会合で金融市場調整方針を、マネタリーベースの年間約80兆円に相当するペースでの増加から、長短金利の操作に変更する決定をしました。コール・レート（無担保・翌日物）は、2016年1月末に日銀が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」で決定した-0.1%金利の適用開始以降であることから、マイナス圏で推移しました。11月21日のコール・レートは-0.051%となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・残存期間の短い国債や社債などを組み入れつつ、コール・ローン等短期金融商品を活用し、利子等収益の確保を図りました。その結果、利子等収益が積み上がったことなどから、基準価額は上昇しました。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・足下の為替は円安方向に推移していますが、1年前と比較すると依然として円高水準であることから、物価を押し上げる効果はまだ期待できない状況です。したがって、今後も金融緩和政策が継続すると想定されることから、短期金利は低位で推移すると予想しています。

◎今後の運用方針

- ・コール・ローン等短期金融商品や残存期間の短い社債などへの投資を通じて、安定した収益の確保をめざしていく方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2016年5月21日～2016年11月21日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2016年5月21日～2016年11月21日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 —	千円 — (183,750)
	特殊債券	—	— (400,000)
	社債券	—	— (500,000)

(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す。

(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。

その他有価証券

		買付額	売付額
国内	コマーシャル・ペーパー	千円 500,099,403	千円 499,999,414

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2016年5月21日～2016年11月21日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2016年11月21日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
普通社債券	1,077,900 (1,077,900)	1,079,434 (1,079,434)	24.4 (24.4)	— (—)	— (—)	— (—)	24.4 (24.4)
合 計	1,077,900 (1,077,900)	1,079,434 (1,079,434)	24.4 (24.4)	— (—)	— (—)	— (—)	24.4 (24.4)

(注) ()内は非上場債で内書き。

(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) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期			末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
普通社債券	%	千円	千円		
第300回北陸電力	0.5	177,900	177,907	2016/11/30	
第459回東北電力	0.869	200,000	200,408	2017/2/24	
第282回四国電力	0.35	200,000	200,024	2016/12/22	
第3回コニカミノルタホールディングス	0.61	200,000	200,020	2016/12/2	
第3回興銀リース	0.267	100,000	100,000	2016/12/2	
第113回オリックス	2.19	100,000	100,882	2017/4/18	
第156回オリックス	1.14	100,000	100,193	2017/1/27	
合 計		1,077,900	1,079,434		

国内その他有価証券

区 分	当 期	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 3,099,994	% 70.1

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

○投資信託財産の構成

(2016年11月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	1,079,434	20.9
その他有価証券	3,099,994	60.1
コール・ローン等、その他	978,776	19.0
投資信託財産総額	5,158,204	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年11月21日現在)

項目	当期末
(A) 資産	5,158,204,613
コール・ローン等	976,375,992
公社債(評価額)	1,079,434,116
その他有価証券(評価額)	3,099,994,388
未収利息	2,400,117
(B) 負債	737,658,191
未払解約金	737,656,790
未払利息	1,401
(C) 純資産総額(A-B)	4,420,546,422
元本	4,340,785,954
次期繰越損益金	79,760,468
(D) 受益権総口数	4,340,785,954口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,184円

<注記事項>

- ①期首元本額 5,462,308,836円
 期中追加設定元本額 1,301,104,721円
 期中一部解約元本額 2,422,627,603円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0184円で。

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 DC金利連動アロケーション型バランスファンド	260,403,123円
三菱UFJ 新興国通貨建て債券ファンド(毎月決算型)	5,226,135円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	8,898,354円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	1,628,029円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース>(毎月分配型)	62,265円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	47,179,877円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	94,134,350円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>(毎月分配型)	233,263円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(毎月分配型)	3,078,471円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	309,607,834円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<中国元コース>(毎月分配型)	89,620円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<インドネシアルピアコース>(毎月分配型)	1,033,322円
ブラデスコ ブラジル成長株オープン・マネーボール・ファンド	2,016,989円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	212,322円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型)	26,506,400円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド(毎月分配型)	2,272,200円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース>(毎月分配型)	15,211,722円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	457,302円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	358,088円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	2,100,667円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	3,836,590円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	393,503円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	6,333,539円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	13,745,897円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	3,037,917円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	1,970,066円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	43,682,881円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	217,654円

○損益の状況 (2016年5月21日～2016年11月21日)

項目	当期
(A) 配当等収益	5,619,165
受取利息	5,706,293
支払利息	△ 87,128
(B) 有価証券売買損益	△ 5,360,511
売買損	△ 5,360,511
(C) 当期損益金(A+B)	258,654
(D) 前期繰越損益金	100,161,728
(E) 追加信託差損益金	23,908,894
(F) 解約差損益金	△ 44,568,808
(G) 計(C+D+E+F)	79,760,468
次期繰越損益金(G)	79,760,468

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (E)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) (F)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。

三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<アジアバスケット通貨コース> (毎月分配型)	407, 171円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド>	25, 034, 575円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	1, 364, 852円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース> (毎月分配型)	945, 824円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	2, 576, 702円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	3, 148, 614円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース> (毎月分配型)	67, 305円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド>	3, 491, 685円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド ユーロ円プレミアム (毎月分配型)	31, 208, 972円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジあり)	756, 099円
欧州ハイイールド債券ファンド (為替ヘッジなし)	684, 529円
三菱UFJ 米国リートファンドA<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	491, 836円
三菱UFJ 米国リートファンドB<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	98, 368円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (毎月分配型)	12, 561, 714円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド (年2回分配型)	69, 931円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド (年2回分配型)	158, 381円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (年2回分配型)	20, 660円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジルリアルコース> (年2回分配型)	40, 278円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース> (年2回分配型)	955, 887円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	1, 559, 264円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	442, 974円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	19, 658円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	19, 658円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	19, 658円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	491, 449円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9, 828, 976円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	12, 234, 366円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	554, 804円
バリュース・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	1, 936, 118円
バリュース・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9, 829円
バリュース・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	9, 829円
バリュース・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	9, 829円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (毎月分配型)	9, 834, 580円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (毎月分配型)	13, 128, 307円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (毎月分配型)	3, 730, 759円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (毎月分配型)	5, 059, 469円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (毎月分配型)	1, 395, 312円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	163, 666円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース> (毎月分配型)	3, 908, 079円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース> (年2回分配型)	3, 737, 703円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース> (年2回分配型)	4, 117, 720円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース> (年2回分配型)	686, 803円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース> (年2回分配型)	961, 645円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース> (年2回分配型)	608, 110円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (年2回分配型)	27, 087円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース> (年2回分配型)	365, 661円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドA>	977, 814円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンドB>	979, 545円
三菱UFJ/ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (毎月決算型)	3, 730, 849円
三菱UFJ/ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	8, 859, 081円
三菱UFJ/ビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> (年1回決算型)	1, 168, 184円
三菱UFJ/ビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	2, 065, 331円
ビムコ・エマーシング・ボンド・オープン Cコース (為替ヘッジなし) (年1回決算型)	983円
ビムコ・エマーシング・ボンド・オープン Dコース (為替ヘッジなし) (年1回決算型)	983円

米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり> (毎月分配型)	2,827,156円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし> (毎月分配型)	9,387,547円
三菱UFJ/ビムコ トータル・リターン・ファンド2014	256,356円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	3,545,187円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	8,124,755円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり> (年1回決算型)	2,990,177円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	3,377,211円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (毎月分配型)	1,084,126円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム> (年2回分配型)	168,922円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (毎月分配型)	3,874,252円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム> (年2回分配型)	658,018円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	9,991,470円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	1,616,484円
三菱UFJ/AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド 豪ドル円プレミアム (毎月決算型)	25,537,767円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム (毎月分配型)	42,906,570円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム (年2回分配型)	4,824,746円
Navi o インド債券ファンド	885,566円
Navi o マネーボールファンド	2,298,520円
三菱UFJ インド債券オープン (毎月決算型)	39,351円
バンクローンファンドUSA (為替ヘッジあり) 2014-08	11,276,260円
マネーボールファンド (FOF s 用) (適格機関投資家限定)	9,896,661円
MUAMトピックスリスクコントロール (5%) インデックスファンド (FOF s 用) (適格機関投資家限定)	6,999,249円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Aコース (為替ヘッジなし)	10,766,608円
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース (為替ヘッジあり)	21,620,196円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	365,273,064円
三菱UFJ/AMP オーストラリアREITファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	11,293,333円
三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<Wプレミアム> (毎月決算型)	6,324,266円
三菱UFJ Jリート不動産株ファンド<米ドル投資型> (3ヵ月決算型)	3,063,931円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム> (毎月分配型)	1,375,824円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム> (年2回分配型)	1,071,396円
マルチストラテジー・ファンド (ラップ向け)	491,015円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース> (毎月分配型)	564,702円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース> (年2回分配型)	89,371円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (年2回分配型)	10,804円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム> (毎月分配型)	40,262円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替ヘッジなし> (年1回決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替リスク軽減型> (年1回決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替リスク軽減型> (毎月決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	983円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	2,559,476,016円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	42,678,508円
MUAMトピックスリスクコントロール (10%) インデックスファンド (FOF s 用) (適格機関投資家限定)	133,410,509円
マクロ・トータル・リターン・ファンド	9,820円
合計	4,340,785,954円