

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   | 無期限（2003年3月14日設定）   |                                  |
| 運用方針   | 豪ドル債券インカムマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として高格付の豪ドル建ての公社債に実質的な投資を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。デュレーション調整等のため、債券先物取引等を利用する場合があります。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 |                                  |
| 主要運用対象 | ベビーフンド  | 豪ドル債券インカムマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
|        | マザーファンド   | 豪ドル建ての公社債を主要投資対象とします。            |
| 主な組入制限 | ベビーフンド  | 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   | 経費等控除後の利子等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。   |                                  |

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。  
 ※公募株式投資信託は税法上、「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 豪ドル債券インカムオープン

愛称：夢実月

第228期（決算日：2022年4月8日）

第229期（決算日：2022年5月9日）

第230期（決算日：2022年6月8日）

第231期（決算日：2022年7月8日）

第232期（決算日：2022年8月8日）

第233期（決算日：2022年9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 豪ドル債券インカムオープン」は、去る9月8日に第233期の決算を行いましたので、法令に基づいて第228期～第233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）

お客さま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<br>(分配落) | 準 価 額 |     |              | 債<br>組 入 比 | 券<br>先 物 比 | 純 資 産<br>総 額 |
|------------------|------------|-------|-----|--------------|------------|------------|--------------|
|                  |            | 税 分   | 込 配 | み 期<br>金 騰 落 |            |            |              |
|                  | 円          |       | 円   |              | %          | %          | 百万円          |
| 204期(2020年4月8日)  | 3,801      |       | 30  | △1.4         | 96.6       | △0.0       | 71,797       |
| 205期(2020年5月8日)  | 3,947      |       | 30  | 4.6          | 98.1       | △0.0       | 74,188       |
| 206期(2020年6月8日)  | 4,308      |       | 30  | 9.9          | 97.2       | —          | 80,737       |
| 207期(2020年7月8日)  | 4,190      |       | 30  | △2.0         | 96.9       | —          | 77,756       |
| 208期(2020年8月11日) | 4,232      |       | 30  | 1.7          | 96.7       | —          | 77,761       |
| 209期(2020年9月8日)  | 4,285      |       | 30  | 2.0          | 97.5       | —          | 77,499       |
| 210期(2020年10月8日) | 4,175      |       | 30  | △1.9         | 97.9       | —          | 74,595       |
| 211期(2020年11月9日) | 4,126      |       | 30  | △0.5         | 97.5       | —          | 72,945       |
| 212期(2020年12月8日) | 4,198      |       | 30  | 2.5          | 97.2       | —          | 72,712       |
| 213期(2021年1月8日)  | 4,345      |       | 30  | 4.2          | 97.6       | —          | 73,900       |
| 214期(2021年2月8日)  | 4,336      |       | 30  | 0.5          | 97.6       | △1.6       | 72,012       |
| 215期(2021年3月8日)  | 4,419      |       | 20  | 2.4          | 96.3       | △1.5       | 71,471       |
| 216期(2021年4月8日)  | 4,412      |       | 20  | 0.3          | 97.7       | —          | 68,947       |
| 217期(2021年5月10日) | 4,485      |       | 20  | 2.1          | 97.6       | —          | 68,378       |
| 218期(2021年6月8日)  | 4,431      |       | 20  | △0.8         | 96.8       | —          | 65,814       |
| 219期(2021年7月8日)  | 4,282      |       | 20  | △2.9         | 98.0       | —          | 62,150       |
| 220期(2021年8月10日) | 4,185      |       | 20  | △1.8         | 97.7       | —          | 59,722       |
| 221期(2021年9月8日)  | 4,193      |       | 20  | 0.7          | 97.6       | —          | 58,864       |
| 222期(2021年10月8日) | 4,165      |       | 20  | △0.2         | 97.1       | —          | 57,630       |
| 223期(2021年11月8日) | 4,196      |       | 20  | 1.2          | 98.4       | —          | 56,777       |
| 224期(2021年12月8日) | 4,015      |       | 20  | △3.8         | 97.1       | —          | 53,531       |
| 225期(2022年1月11日) | 4,089      |       | 20  | 2.3          | 97.7       | —          | 53,884       |
| 226期(2022年2月8日)  | 4,003      |       | 20  | △1.6         | 97.6       | —          | 52,229       |
| 227期(2022年3月8日)  | 4,082      |       | 20  | 2.5          | 97.0       | △4.5       | 52,900       |
| 228期(2022年4月8日)  | 4,335      |       | 20  | 6.7          | 97.0       | △3.1       | 54,575       |
| 229期(2022年5月9日)  | 4,215      |       | 20  | △2.3         | 98.3       | —          | 51,792       |
| 230期(2022年6月8日)  | 4,376      |       | 20  | 4.3          | 97.1       | —          | 53,442       |
| 231期(2022年7月8日)  | 4,261      |       | 20  | △2.2         | 97.2       | —          | 51,261       |
| 232期(2022年8月8日)  | 4,282      |       | 20  | 1.0          | 97.1       | —          | 51,151       |
| 233期(2022年9月8日)  | 4,384      |       | 20  | 2.8          | 97.2       | —          | 51,929       |

(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 | 券 率       |
|-------|--------------------|------------|-------|--------|-----------|-----------|-----------|
|       |                    |            | 騰 落   | 率      |           |           |           |
| 第228期 | (期 首)<br>2022年3月8日 | 円<br>4,082 |       | %<br>— | %<br>97.0 |           | %<br>△4.5 |
|       | 3月末                | 4,346      |       | 6.5    | 98.0      |           | △3.1      |
|       | (期 末)<br>2022年4月8日 | 4,355      |       | 6.7    | 97.0      |           | △3.1      |
| 第229期 | (期 首)<br>2022年4月8日 | 4,335      |       | —      | 97.0      |           | △3.1      |
|       | 4月末                | 4,275      |       | △1.4   | 97.7      |           | △3.1      |
|       | (期 末)<br>2022年5月9日 | 4,235      |       | △2.3   | 98.3      |           | —         |
| 第230期 | (期 首)<br>2022年5月9日 | 4,215      |       | —      | 98.3      |           | —         |
|       | 5月末                | 4,262      |       | 1.1    | 96.8      |           | —         |
|       | (期 末)<br>2022年6月8日 | 4,396      |       | 4.3    | 97.1      |           | —         |
| 第231期 | (期 首)<br>2022年6月8日 | 4,376      |       | —      | 97.1      |           | —         |
|       | 6月末                | 4,276      |       | △2.3   | 96.6      |           | —         |
|       | (期 末)<br>2022年7月8日 | 4,281      |       | △2.2   | 97.2      |           | —         |
| 第232期 | (期 首)<br>2022年7月8日 | 4,261      |       | —      | 97.2      |           | —         |
|       | 7月末                | 4,324      |       | 1.5    | 97.4      |           | —         |
|       | (期 末)<br>2022年8月8日 | 4,302      |       | 1.0    | 97.1      |           | —         |
| 第233期 | (期 首)<br>2022年8月8日 | 4,282      |       | —      | 97.1      |           | —         |
|       | 8月末                | 4,302      |       | 0.5    | 96.7      |           | —         |
|       | (期 末)<br>2022年9月8日 | 4,404      |       | 2.8    | 97.2      |           | —         |

(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。

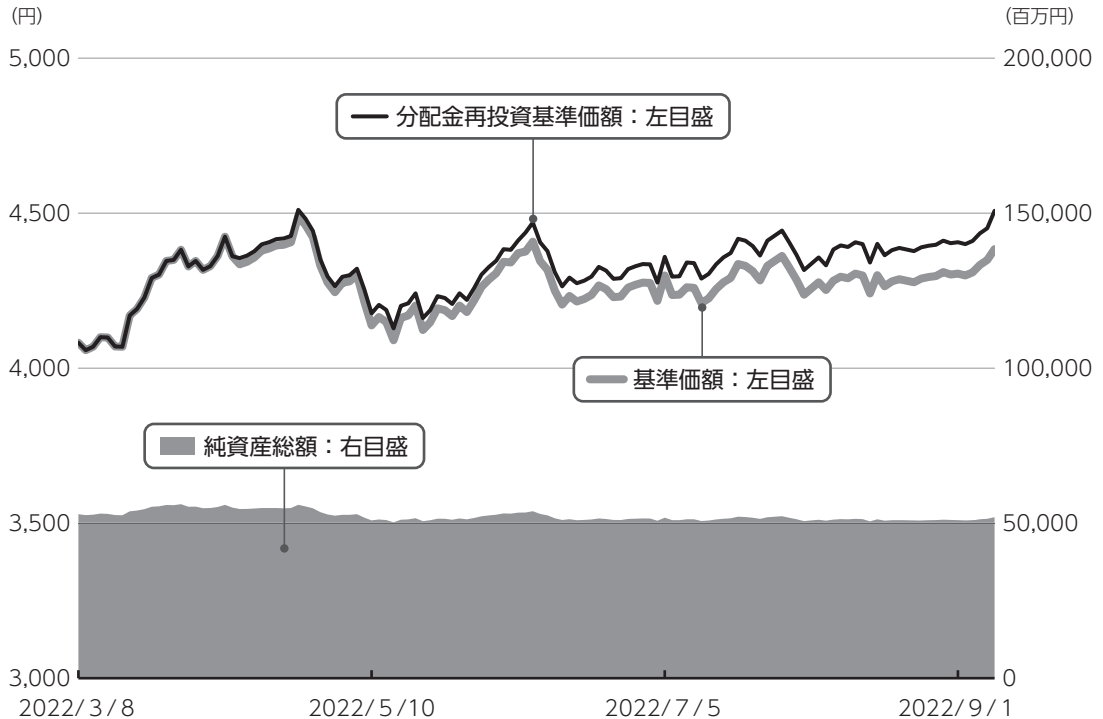
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第228期～第233期：2022年3月9日～2022年9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228期首 | 4,082円 |
| 第233期末 | 4,384円 |
| 既払分配金  | 120円   |
| 騰落率    | 10.4%  |

(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はありません。

※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10.4%（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

豪ドルが対円で上昇したことや債券利子収益を享受したことなどが基準価額の上昇要因となりました。

#### 下落要因

豪州金利が上昇したことなどが基準価額の下落要因となりました。

第228期～第233期：2022年3月9日～2022年9月8日

## 投資環境について

### ▶ 債券市況

**豪州金利は上昇しました。**

豪州準備銀行（RBA）が目標を上回るインフレを抑制するために、複数回の利上げを実施したことなどから、豪州金利は上昇基調で推移しました。

### ▶ 為替市況

**豪ドルは対円で上昇しました。**

日銀が緩和的な姿勢を維持する中、豪州金利が上昇し本邦との金利差が拡大したことなどから、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

### ▶ 三菱UFJ 豪ドル債券インカムオープン

主要投資対象である豪ドル債券インカムマザーファンド受益証券への投資を通じて、豪ドル建ての信用度の高い公社債を高位に組み入れた運用を行いました。

### ▶ 豪ドル債券インカムマザーファンド

当作成期を通じて、豪ドル建ての債券現物の組入比率は高位を維持しました。なお、デュレーション（平均回収期間や金利感応度）調整のため、債券先物も活用しました。

#### デュレーション

ファンド全体のデュレーションは、豪州や米国などの金融政策、インフレ動向などを注視しながら操作しました。結果、当作成期末のデュレーションは2.9年程度となっています。

#### 残存期間構成

イールドカーブの傾きに注目するとともに、デュレーションを短期化する局面では短期ゾーンの組入比率を高めとし、長期化する局面では中長期ゾーンの組入比率を高めとしました。

#### 債券種別構成

豪州国債に対する相対的なスプレッド（利回り格差）動向を睨みながら、債券種別構成を調整しました。当作成期は、国債の組入比率を引き上げ、国際機関債や州政府債などの非国債の組入比率を引き下げました。

## 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、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、1万円当たり、税込み)

| 項目                 | 第228期<br>2022年3月9日~<br>2022年4月8日 | 第229期<br>2022年4月9日~<br>2022年5月9日 | 第230期<br>2022年5月10日~<br>2022年6月8日 | 第231期<br>2022年6月9日~<br>2022年7月8日 | 第232期<br>2022年7月9日~<br>2022年8月8日 | 第233期<br>2022年8月9日~<br>2022年9月8日 |
|--------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 当期分配金<br>(対基準価額比率) | <b>20</b><br>(0.459%)            | <b>20</b><br>(0.472%)            | <b>20</b><br>(0.455%)             | <b>20</b><br>(0.467%)            | <b>20</b><br>(0.465%)            | <b>20</b><br>(0.454%)            |
| 当期の収益              | 12                               | 7                                | 11                                | 8                                | 11                               | 12                               |
| 当期の収益以外            | 8                                | 12                               | 8                                 | 12                               | 9                                | 8                                |
| 翌期繰越分配対象額          | 498                              | 486                              | 478                               | 466                              | 458                              | 450                              |

(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 豪ドル債券インカムオープン

豪ドル債券インカムマザーファンド受益証券の組入比率を高位に保ち、マザーファンドのポートフォリオの構成に近づけた状態を維持する方針です。

### ▶ 豪ドル債券インカムマザーファンド 組入比率

安定した利子収益の確保をめざし、引き続き債券現物の高位組み入れを維持する方針です。

### デュレーション

豪州の金融政策の方向性、グローバルな景気・インフレ動向を睨みながら、機動的に操作する方針です。

### 残存期間構成

デュレーションを長期化する局面では中長期ゾーンを、短期化する局面では短期ゾーンの組入比率を高めとする方針です。

### 債券種別構成

国債に対する相対的なスプレッド動向や市場のボラティリティ変動要因などに注視し、必要に応じて組入比率を調整する方針です。



2022年3月9日～2022年9月8日

## 1万口当たりの費用明細

| 項目          | 第228期～第233期 |         | 項目の概要   |
|-------------|-------------|---------|---|
|             | 金額 (円)      | 比率 (%)  |   |
| (a) 信託報酬    | 25          | 0.582   | (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 ) | (12)        | (0.277) | 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 ) | (12)        | (0.277) | 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)         | (0.028) | 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           | 0.000   | (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<br>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)         | (0.000) |   |
| (c) その他費用   | 0           | 0.007   | (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 ) | (0)         | (0.004) | 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         | 25          | 0.589   |   |

作成期中の平均基準価額は、4,274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。

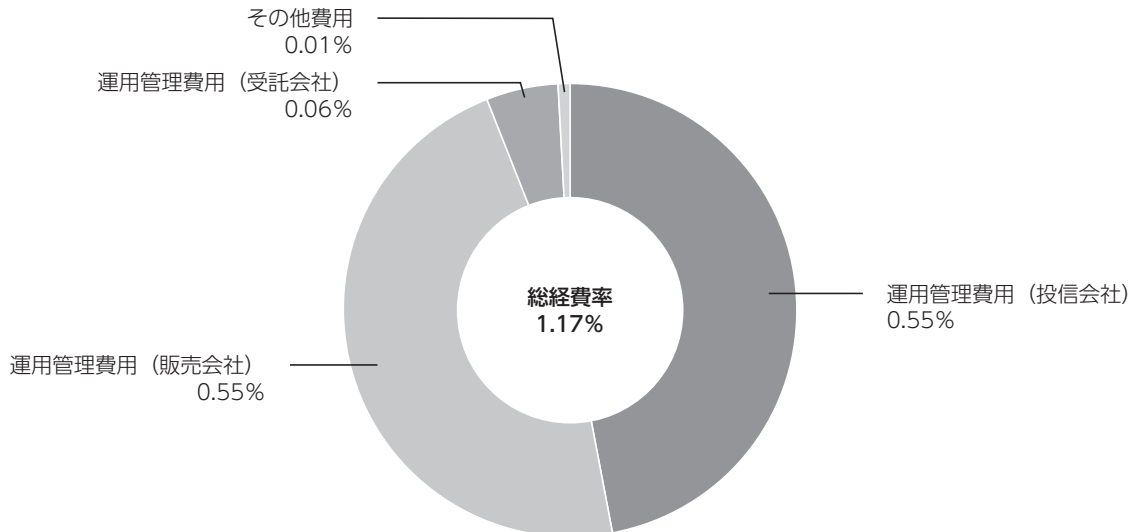
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.17%**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3月9日～2022年9月8日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄              | 第228期～第233期   |               |                 |                 |
|------------------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|
|                  | 設 定           |               | 解 約             |                 |
|                  | 口 数           | 金 額           | 口 数             | 金 額             |
| 豪ドル債券インカムマザーファンド | 千口<br>249,270 | 千円<br>300,864 | 千口<br>5,643,522 | 千円<br>6,880,744 |

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年3月9日～2022年9月8日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;三菱UFJ 豪ドル債券インカムオープン&gt;

該当事項はございません。

## &lt;豪ドル債券インカムマザーファンド&gt;

| 区 分    | 第228期～第233期        |               |                    |               |              |             |
|--------|--------------------|---------------|--------------------|---------------|--------------|-------------|
|        | 買付額等<br>A          |               |                    | 売付額等<br>C     |              |             |
|        | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |              |             |
| 為替直物取引 | 百万円<br>—           | 百万円<br>—      | 百万円<br>—           | 百万円<br>7,047  | 百万円<br>2,545 | 百万円<br>36.1 |

平均保有割合 96.4%

※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9月8日現在)

## 親投資信託残高

| 銘 柄              | 第227期末           |         | 第233期末           |                  |
|------------------|------------------|---------|------------------|------------------|
|                  | 口 数              |         | 口 数              |                  |
|                  | 口 数              | 評 価 額   | 口 数              | 評 価 額            |
| 豪ドル債券インカムマザーファンド | 千口<br>46,160,434 | 千円<br>— | 千口<br>40,766,183 | 千円<br>51,781,205 |

## ○投資信託財産の構成

(2022年9月8日現在)

| 項 目              | 第233期末           |           |
|------------------|------------------|-----------|
|                  | 評 価 額            | 比 率       |
| 豪ドル債券インカムマザーファンド | 千円<br>51,781,205 | %<br>99.1 |
| コール・ローン等、その他     | 495,604          | 0.9       |
| 投資信託財産総額         | 52,276,809       | 100.0     |

(注) 豪ドル債券インカム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 (53,532,681千円) の投資信託財産総額 (53,999,806千円) に対する比率は99.1%です。

(注) 外貨建資産は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、作成期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

|                    |  |  |  |
|--------------------|--|--|--|
| 1 オーストラリアドル=97.39円 |  |  |  |
|--------------------|--|--|--|

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目                   | 第228期末           | 第229期末           | 第230期末           | 第231期末           | 第232期末           | 第233期末           |
|-----------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
|                       | 2022年4月8日現在      | 2022年5月9日現在      | 2022年6月8日現在      | 2022年7月8日現在      | 2022年8月8日現在      | 2022年9月8日現在      |
|                       | 円                | 円                | 円                | 円                | 円                | 円                |
| (A) 資産                | 55,106,753,803   | 52,190,744,011   | 53,825,398,943   | 51,596,290,643   | 51,484,847,215   | 52,276,809,408   |
| コール・ローン等              | 184,875,191      | 167,475,581      | 192,730,833      | 190,878,753      | 199,566,088      | 222,993,303      |
| 豪ドル債券インカムマザーファンド(評価額) | 54,437,267,008   | 51,673,655,319   | 53,314,036,284   | 51,137,390,074   | 51,030,302,610   | 51,781,205,961   |
| 未収入金                  | 484,611,604      | 349,613,111      | 318,631,826      | 268,021,816      | 254,978,517      | 272,610,144      |
| (B) 負債                | 531,330,070      | 398,033,251      | 382,762,768      | 334,938,499      | 333,705,146      | 347,651,548      |
| 未払収益分配金               | 251,767,221      | 245,771,829      | 244,274,475      | 240,629,850      | 238,917,521      | 236,912,103      |
| 未払解約金                 | 225,968,769      | 99,138,913       | 89,322,654       | 45,120,238       | 44,156,170       | 60,445,887       |
| 未払信託報酬                | 53,380,551       | 52,910,807       | 48,969,528       | 48,992,413       | 50,429,679       | 50,092,921       |
| 未払利息                  | 20               | 67               | 246              | 38               | 67               | 279              |
| その他未払費用               | 213,509          | 211,635          | 195,865          | 195,960          | 201,709          | 200,358          |
| (C) 純資産総額(A-B)        | 54,575,423,733   | 51,792,710,760   | 53,442,636,175   | 51,261,352,144   | 51,151,142,069   | 51,929,157,860   |
| 元本                    | 125,883,610,792  | 122,885,914,571  | 122,137,237,838  | 120,314,925,419  | 119,458,760,952  | 118,456,051,992  |
| 次期繰越損益金               | △ 71,308,187,059 | △ 71,093,203,811 | △ 68,694,601,663 | △ 69,053,573,275 | △ 68,307,618,883 | △ 66,526,894,132 |
| (D) 受益権総口数            | 125,883,610,792口 | 122,885,914,571口 | 122,137,237,838口 | 120,314,925,419口 | 119,458,760,952口 | 118,456,051,992口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)       | 4,335円           | 4,215円           | 4,376円           | 4,261円           | 4,282円           | 4,384円           |

## ○損益の状況

| 項 目              | 第228期                   | 第229期                   | 第230期                    | 第231期                   | 第232期                   | 第233期                   |
|------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
|                  | 2022年3月9日～<br>2022年4月8日 | 2022年4月9日～<br>2022年5月9日 | 2022年5月10日～<br>2022年6月8日 | 2022年6月9日～<br>2022年7月8日 | 2022年7月9日～<br>2022年8月8日 | 2022年8月9日～<br>2022年9月8日 |
|                  | 円                       | 円                       | 円                        | 円                       | 円                       | 円                       |
| (A) 配当等収益        | △ 569                   | △ 1,921                 | △ 3,117                  | △ 5,058                 | △ 1,650                 | △ 4,459                 |
| 受取利息             | 9                       | —                       | —                        | 91                      | —                       | —                       |
| 支払利息             | △ 578                   | △ 1,921                 | △ 3,117                  | △ 5,149                 | △ 1,650                 | △ 4,459                 |
| (B) 有価証券売買損益     | 3,484,198,051           | △ 1,185,371,685         | 2,260,630,267            | △ 1,086,894,500         | 541,752,433             | 1,492,052,636           |
| 売買益              | 3,576,870,205           | 20,218,860              | 2,281,074,448            | 24,882,772              | 552,235,628             | 1,495,041,521           |
| 売買損              | △ 92,672,154            | △ 1,205,590,545         | △ 20,444,181             | △ 1,111,777,272         | △ 10,483,198            | △ 2,988,885             |
| (C) 信託報酬等        | △ 53,594,060            | △ 53,122,442            | △ 49,165,393             | △ 49,188,373            | △ 50,631,398            | △ 50,293,279            |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 3,430,603,422           | △ 1,238,496,048         | 2,211,461,757            | △ 1,136,087,931         | 491,119,395             | 1,441,754,898           |
| (E) 前期繰越損益金      | △13,219,635,731         | △ 9,672,522,591         | △10,851,634,416          | △ 8,594,711,060         | △ 9,683,086,140         | △ 9,180,151,732         |
| (F) 追加信託差損益金     | △61,267,387,529         | △59,936,413,343         | △59,810,154,529          | △59,082,144,434         | △58,876,734,617         | △58,551,585,195         |
| (配当等相当額)         | ( 6,372,714,457)        | ( 6,123,314,782)        | ( 5,939,787,303)         | ( 5,755,735,244)        | ( 5,572,119,886)        | ( 5,419,436,629)        |
| (売買損益相当額)        | (△67,640,101,986)       | (△66,059,728,125)       | (△65,749,941,832)        | (△64,837,879,678)       | (△64,448,854,503)       | (△63,971,021,824)       |
| (G) 計(D+E+F)     | △71,056,419,838         | △70,847,431,982         | △68,450,327,188          | △68,812,943,425         | △68,068,701,362         | △66,289,982,029         |
| (H) 収益分配金        | △ 251,767,221           | △ 245,771,829           | △ 244,274,475            | △ 240,629,850           | △ 238,917,521           | △ 236,912,103           |
| 次期繰越損益金(G+H)     | △71,308,187,059         | △71,093,203,811         | △68,694,601,663          | △69,053,573,275         | △68,307,618,883         | △66,526,894,132         |
| 追加信託差損益金         | △61,368,094,418         | △60,083,876,441         | △59,907,864,319          | △59,226,522,344         | △58,984,247,501         | △58,646,350,036         |
| (配当等相当額)         | ( 6,272,674,498)        | ( 5,976,159,488)        | ( 5,842,909,303)         | ( 5,612,038,057)        | ( 5,465,263,211)        | ( 5,325,207,730)        |
| (売買損益相当額)        | (△67,640,768,916)       | (△66,060,035,929)       | (△65,750,773,622)        | (△64,838,560,401)       | (△64,449,510,712)       | (△63,971,557,766)       |
| 分配準備積立金          | 5,286,246               | 4,505,430               | 464,770                  | 2,290,925               | 6,730,624               | 6,805,167               |
| 繰越損益金            | △ 9,945,378,887         | △11,013,832,800         | △ 8,787,202,114          | △ 9,829,341,856         | △ 9,330,102,006         | △ 7,887,349,263         |

(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 129,586,842,245円  
 作成期中追加設定元本額 4,767,708,920円  
 作成期中一部解約元本額 15,898,499,173円  
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.4384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66,526,894,132円です。

## ③ 分配金の計算過程

| 項 目                       | 2022年3月9日～<br>2022年4月8日 | 2022年4月9日～<br>2022年5月9日 | 2022年5月10日～<br>2022年6月8日 | 2022年6月9日～<br>2022年7月8日 | 2022年7月9日～<br>2022年8月8日 | 2022年8月9日～<br>2022年9月8日 |
|---------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | 153,290,036円            | 97,447,920円             | 142,283,638円             | 97,801,534円             | 135,657,276円            | 142,108,937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                      | —円                      |
| 収益調整金額                    | 6,373,381,387円          | 6,123,622,586円          | 5,940,619,093円           | 5,756,415,967円          | 5,572,776,095円          | 5,419,972,571円          |
| 分配準備積立金額                  | 3,056,542円              | 5,366,241円              | 4,745,817円               | 741,331円                | 2,477,985円              | 6,843,492円              |
| 当ファンドの分配対象収益額             | 6,529,727,965円          | 6,226,436,747円          | 6,087,648,548円           | 5,854,958,832円          | 5,710,911,356円          | 5,568,925,000円          |
| 1万口当たり収益分配対象額             | 518円                    | 506円                    | 498円                     | 486円                    | 478円                    | 470円                    |
| 1万口当たり分配金額                | 20円                     | 20円                     | 20円                      | 20円                     | 20円                     | 20円                     |
| 収益分配金金額                   | 251,767,221円            | 245,771,829円            | 244,274,475円             | 240,629,850円            | 238,917,521円            | 236,912,103円            |

## ○分配金のお知らせ

|                 | 第228期 | 第229期 | 第230期 | 第231期 | 第232期 | 第233期 |
|-----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 20円   | 20円   | 20円   | 20円   | 20円   | 20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。

\* 三菱UFJ 国際投信では本資料のほか、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。

## 豪ドル債券インカムマザーファンド

### 《第9期》決算日2022年3月8日

[計算期間：2021年3月9日～2022年3月8日]

「豪ドル債券インカムマザーファンド」は、3月8日に第9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9期の運用状況をご報告申し上げます。

|             |   |
|-------------|---|
| 運 用 方 針     | 主として高格付の豪ドル建ての公社債に投資を行います。<br>投資にあたっては、オーストラリアの国債、政府機関債、AA格相当以上の格付を有する州政府債および政府保証債等、ならびにオーストラリア以外のAA格相当以上の格付を有する政府機関債および国際機関債等に分散投資を行います。<br>運用にあたっては、ポートフォリオの平均デュレーションを1年以上5年以内とします。<br>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。<br>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 |
| 主 要 運 用 対 象 | 豪ドル建ての公社債を主要投資対象とします。   |
| 主 な 組 入 制 限 | 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。   |

### ○最近5期の運用実績

| 決 算 期         | 基 準    | 価 額   |     | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|---------------|--------|-------|-----|-------------|-------------|---------|
|               |        | 期 騰 落 | 中 率 |             |             |         |
|               | 円      |       | %   | %           | %           | 百万円     |
| 5期(2018年3月8日) | 10,433 | △ 1.9 |     | 97.9        | —           | 117,008 |
| 6期(2019年3月8日) | 10,182 | △ 2.4 |     | 97.8        | —           | 102,776 |
| 7期(2020年3月9日) | 9,228  | △ 9.4 |     | 97.9        | —           | 76,855  |
| 8期(2021年3月8日) | 11,558 | 25.2  |     | 96.5        | △1.6        | 73,999  |
| 9期(2022年3月8日) | 11,433 | △ 1.1 |     | 97.2        | △4.5        | 54,848  |

(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<br>騰 落 率 | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|----------------------|------------------|-----------|-----------|
|                      |                  |           |           |
| (期 首)<br>2021年 3月 8日 | 円<br>11,558      | %<br>—    | %<br>96.5 |
| 3月末                  | 11,689           | 1.1       | 97.4      |
| 4月末                  | 11,757           | 1.7       | 97.0      |
| 5月末                  | 11,743           | 1.6       | 97.6      |
| 6月末                  | 11,521           | △0.3      | 97.3      |
| 7月末                  | 11,260           | △2.6      | 98.4      |
| 8月末                  | 11,160           | △3.4      | 97.0      |
| 9月末                  | 11,178           | △3.3      | 97.9      |
| 10月末                 | 11,630           | 0.6       | 97.6      |
| 11月末                 | 11,108           | △3.9      | 98.0      |
| 12月末                 | 11,451           | △0.9      | 97.2      |
| 2022年 1月末            | 10,971           | △5.1      | 98.0      |
| 2月末                  | 11,182           | △3.3      | 98.0      |
| (期 末)<br>2022年 3月 8日 | 11,433           | △1.1      | 97.2      |

(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1.1%の下落となりました。

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や債券利子収益を享受したことなどが基準価額の上昇要因となりました。

## (下落要因)

豪州金利が上昇したことなどが基準価額の下落要因となりました。

## ●投資環境について

## ◎債券市況

- ・豪州金利は上昇しました。
- ・2021年8月にかけては、豪州では新型コロナウイルスのデルタ株の感染拡大が続いており、同国最大都市圏のシドニーを含む地域でのロックダウン長期化による経済への悪影響が懸念される中、豪州金利は低下しました。その後は、発



表された基調的な消費者物価指数の伸びが市場予想を上回る結果となったことなどから、豪州準備銀行（RBA）による早期利上げ観測が高まった結果、豪州金利は上昇基調で推移し、期を通じてみると上昇して終わりました。

#### ◎為替市況

- ・豪ドルは対円で上昇しました。
- ・豪州で新型コロナウイルスの感染拡大が懸念された局面では豪ドルは対円で下落したものの、豪州金利が上昇し本邦との金利差が拡大したことなどが豪ドルの対円での上昇要因となり、期を通じてみると豪ドルは対円で上昇して終わりました。

#### ●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・期を通じて、豪ドル建ての債券現物の組入比率は高位を維持しました。なお、デュレーション（平均回収期間や金利感応度）調整のため、債券先物も活用しました。

#### ◎デュレーション

- ・ファンド全体のデュレーションは、豪州や米国などの金融政策、インフレ動向などを注視しながら、機動的に操作しました。結果、期末のデュレーションは2.8年程度となっています。

#### ◎残存期間構成

- ・イールドカーブの傾きに注目するとともに、デュレーションを短期化する局面では短期ゾーンの組入比率を高めとし、長期化する局面では中長期ゾーンの組入比率を高めとしました。

#### ◎債券種別構成

- ・豪州国債に対する相対的なスプレッド（利回り格差）動向を睨みながら、債券種別構成を調整しました。当期は、国際機関債・政府機関債の組入比率を引き下げ、州政府債の組入比率を引き上げました。

#### ○今後の運用方針

##### （組入比率）

- ・安定した利子収益の確保をめざし、引き続き債券現物の高位組み入れを維持する方針です。

##### （デュレーション）

- ・豪州の金融政策の方向性、グローバルな景気・インフレ動向を睨みながら、機動的に操作する方針です。

##### （残存期間構成）

- ・デュレーションを長期化する局面では中長期ゾーンを、短期化する局面では短期ゾーンの組入比率を高めとする方針です。

##### （債券種別構成）

- ・国債に対する相対的なスプレッド動向や市場のボラティリティ変動要因などに注視し、必要に応じて組入比率を調整する方針です。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年3月9日～2022年3月8日)

| 項 目                                       | 当 期             |                             | 項 目 の 概 要   |
|---|-----------------|-----------------------------|---|
|   | 金 額             | 比 率                         |   |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料<br>(先物・オプション)           | 円<br>0<br>(0)   | %<br>0.001<br>(0.001)       | (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<br>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<br>( 保 管 費 用 )<br>( そ の 他 ) | 1<br>(1)<br>(0) | 0.009<br>(0.009)<br>(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<br>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<br>信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計                                       | 1               | 0.010                       |   |
| 期中の平均基準価額は、11,409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3月9日～2022年3月8日)

## 公社債

|     |         |      | 買 付 額      | 売 付 額                |
|-----|---------|------|------------|----------------------|
| 外 国 | 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           |
|     |         | 国債証券 | 254,465    | 290,328              |
|     |         | 特殊債券 | 297,902    | 421,942<br>( 27,000) |

(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、上段の数字に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<br>5,730 | 百万円<br>5,721 | 百万円<br>8,258 | 百万円<br>6,968 |

(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3月9日～2022年3月8日)

## 利害関係人との取引状況

| 区 分    | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|        |           |                    |               |           |                    |               |
| 為替直物取引 | —         | —                  | —             | 18,125    | 11,452             | 63.2          |

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、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

## ○組入資産の明細

(2022年3月8日現在)

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)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<br>組入比率 | 残存期間別組入比率 |      |      |
|         |            | 外貨建金額      | 邦貨換算金額     |      |                 | 5年以上      | 2年以上 | 2年未満 |
|         | 千オーストラリアドル | 千オーストラリアドル | 千円         | %    | %               | %         | %    | %    |
| オーストラリア | 604,000    | 630,155    | 53,311,161 | 97.2 | —               | 4.9       | 74.1 | 18.2 |
| 合 計     | 604,000    | 630,155    | 53,311,161 | 97.2 | —               | 4.9       | 74.1 | 18.2 |

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

## (B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘 柄     | 当 期 末                  |            |            |         |           |            |
|---------|------------------------|------------|------------|---------|-----------|------------|
|         | 利 率                    | 額面金額       | 評 価 額      |         | 償還年月日     |            |
|         |                        |            | 外貨建金額      | 邦貨換算金額  |           |            |
| オーストラリア | %                      | 千オーストラリアドル | 千オーストラリアドル | 千円      |           |            |
| 国債証券    | 0.5 AUST GOVT 260921   | 0.5        | 10,000     | 9,430   | 797,779   | 2026/9/21  |
|         | 1 AUST GOVT 311121     | 1.0        | 15,000     | 13,530  | 1,144,710 | 2031/11/21 |
|         | 3.25 AUST GOVT 250421  | 3.25       | 10,000     | 10,510  | 889,213   | 2025/4/21  |
|         | 4.25 AUST GOVT 260421  | 4.25       | 95,000     | 104,429 | 8,834,763 | 2026/4/21  |
| 特殊債券    | 0.8 ASIAN DEV 251106   | 0.8        | 10,000     | 9,534   | 806,624   | 2025/11/6  |
|         | 1 NEWSWALES 240208     | 1.0        | 10,000     | 9,950   | 841,822   | 2024/2/8   |
|         | 1.1 ASIAN DEV 240815   | 1.1        | 10,000     | 9,863   | 834,440   | 2024/8/15  |
|         | 1.45 INTL FINAN 240722 | 1.45       | 10,000     | 9,956   | 842,320   | 2024/7/22  |
|         | 1.5 VICTORIA 310910    | 1.5        | 20,000     | 18,272  | 1,545,880 | 2031/9/10  |
|         | 1.7 EIB 241115         | 1.7        | 10,000     | 9,981   | 844,426   | 2024/11/15 |
|         | 1.95 IADB 240423       | 1.95       | 10,000     | 10,085  | 853,259   | 2024/4/23  |
|         | 2.2 IBRD 240227        | 2.2        | 10,000     | 10,145  | 858,331   | 2024/2/27  |

| 銘       | 柄                        | 当 期 末 |            |            |            |            |
|---------|--------------------------|-------|------------|------------|------------|------------|
|         |                          | 利 率   | 額面金額       | 評 価 額      |            | 償還年月日      |
|         |                          |       |            | 外貨建金額      | 邦貨換算金額     |            |
| オーストラリア |                          | %     | 千オーストラリアドル | 千オーストラリアドル | 千円         |            |
|         | 特殊債券                     |       |            |            |            |            |
|         | 2.5 WEST AUST TRE 240723 | 2.5   | 30,000     | 30,724     | 2,599,330  | 2024/7/23  |
|         | 2.7 INTL FINAN 230315    | 2.7   | 5,000      | 5,094      | 430,964    | 2023/3/15  |
|         | 2.75 INTER-AMERIC 251030 | 2.75  | 15,000     | 15,360     | 1,299,519  | 2025/10/30 |
|         | 2.8 KFW 230307           | 2.8   | 15,000     | 15,304     | 1,294,781  | 2023/3/7   |
|         | 2.9 EUROPEAN INVE 251017 | 2.9   | 10,000     | 10,292     | 870,738    | 2025/10/17 |
|         | 3 SOUTH AUST GOVT 260720 | 3.0   | 15,000     | 15,601     | 1,319,908  | 2026/7/20  |
|         | 3 WEST AUST TREAS 261021 | 3.0   | 40,000     | 41,665     | 3,524,918  | 2026/10/21 |
|         | 3.25 QUEENSLAND 260721   | 3.25  | 40,000     | 42,033     | 3,556,053  | 2026/7/21  |
|         | 3.75 ASIAN DEVELO 250312 | 3.75  | 20,000     | 21,097     | 1,784,841  | 2025/3/12  |
|         | 4 INTER-AMERICAN 230522  | 4.0   | 10,000     | 10,374     | 877,650    | 2023/5/22  |
|         | 4 INTL FINANCE CO 250403 | 4.0   | 15,000     | 15,950     | 1,349,396  | 2025/4/3   |
|         | 4.25 INTL BK RECO 250624 | 4.25  | 10,000     | 10,729     | 907,724    | 2025/6/24  |
|         | 4.25 INTL FINANCE 230821 | 4.25  | 15,000     | 15,672     | 1,325,917  | 2023/8/21  |
|         | 4.25 LANDWIRTSCH 250109  | 4.25  | 20,000     | 21,282     | 1,800,479  | 2025/1/9   |
|         | 4.25 QUEENSLAND 230721   | 4.25  | 5,000      | 5,226      | 442,196    | 2023/7/21  |
|         | 4.25 RENTENBANK 230124   | 4.25  | 10,000     | 10,307     | 871,973    | 2023/1/24  |
|         | 4.5 KOMMUNALBANKE 230417 | 4.5   | 5,000      | 5,200      | 439,948    | 2023/4/17  |
|         | 4.75 AFRICAN DEVE 240306 | 4.75  | 10,000     | 10,615     | 898,113    | 2024/3/6   |
|         | 4.75 BK NEDERLAND 230306 | 4.75  | 10,000     | 10,389     | 878,911    | 2023/3/6   |
|         | 4.75 NEDER WATERS 230411 | 4.75  | 4,000      | 4,166      | 352,514    | 2023/4/11  |
|         | 4.75 QUEENSLAND 250721   | 4.75  | 35,000     | 38,299     | 3,240,141  | 2025/7/21  |
|         | 5 KFW 240319             | 5.0   | 10,000     | 10,699     | 905,178    | 2024/3/19  |
|         | 5.75 QUEENSLAND 240722   | 5.75  | 30,000     | 32,979     | 2,790,044  | 2024/7/22  |
|         | 6 WEST AUST TREAS 231016 | 6.0   | 5,000      | 5,394      | 456,340    | 2023/10/16 |
| 合       | 計                        |       |            |            | 53,311,161 |            |

(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 末 |       |
|----|--------|---------|-------|-------|
|    |        |         | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 外国 | 債券先物取引 | AUST10Y | 百万円   | 百万円   |
|    |        |         | —     | 2,492 |

(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3月8日現在)

| 項 目          | 当 期 末            |           |
|--------------|------------------|-----------|
|              | 評 価 額            | 比 率       |
| 公社債          | 千円<br>53,311,161 | %<br>96.6 |
| コール・ローン等、その他 | 1,848,033        | 3.4       |
| 投資信託財産総額     | 55,159,194       | 100.0     |

(注) 期末における外貨建純資産 (54,776,938千円) の投資信託財産総額 (55,159,194千円) に対する比率は99.3%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

|                    |  |  |
|--------------------|--|--|
| 1 オーストラリアドル=84.60円 |  |  |
|--------------------|--|--|

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年3月8日現在)

| 項 目             | 当 期 末           |
|-----------------|-----------------|
|                 | 円               |
| (A) 資産          | 55,159,194,947  |
| コール・ローン等        | 419,947,840     |
| 公社債(評価額)        | 53,311,161,382  |
| 未収入金            | 858,267,001     |
| 未収利息            | 415,163,767     |
| 前払費用            | 28,833,372      |
| 差入委託証拠金         | 125,821,585     |
| (B) 負債          | 310,272,375     |
| 未払金             | 2,966,752       |
| 未払解約金           | 307,305,572     |
| 未払利息            | 51              |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 54,848,922,572  |
| 元本              | 47,974,287,821  |
| 次期繰越損益金         | 6,874,634,751   |
| (D) 受益権総口数      | 47,974,287,821口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 11,433円         |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 64,025,517,381円  
 期中追加設定元本額 330,067,933円  
 期中一部解約元本額 16,381,297,493円  
 また、1口当たり純資産額は、期末11,433円です。

- ②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)
- |                             |                 |
|-----------------------------|-----------------|
| 三菱UFJ 豪ドル債券インカムオープン         | 46,160,434,828円 |
| 三菱UFJ 豪ドル債券インカムオープン(年1回決算型) | 1,813,852,993円  |
| 合計                          | 47,974,287,821円 |

## ○損益の状況 (2021年3月9日~2022年3月8日)

| 項 目                | 当 期            |
|--------------------|----------------|
|                    | 円              |
| (A) 配当等収益          | 1,938,303,939  |
| 受取利息               | 1,938,938,055  |
| 支払利息               | △ 634,116      |
| (B) 有価証券売買損益       | △2,595,347,285 |
| 売買益                | 847,073,951    |
| 売買損                | △3,442,421,236 |
| (C) 先物取引等取引損益      | △ 53,665,626   |
| 取引益                | 10,753,636     |
| 取引損                | △ 64,419,262   |
| (D) 保管費用等          | △ 5,500,655    |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | △ 716,209,627  |
| (F) 前期繰越損益金        | 9,973,805,530  |
| (G) 追加信託差損益金       | 42,048,188     |
| (H) 解約差損益金         | △2,425,009,340 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 6,874,634,751  |
| 次期繰越損益金(I)         | 6,874,634,751  |

- (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。