

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（2013年12月6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。	
	分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）	

※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 （年1回決算型）

愛称：夢実月

第7期（決算日：2020年3月9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（年1回決算型）」は、去る3月9日に第7期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況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5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額			債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		税 分 配	み 騰 落	中 率			
3期(2016年3月8日)	円 9,771	円 0	% △ 8.3	% 97.8	% —	百万円 705	
4期(2017年3月8日)	10,121	0	3.6	96.6	—	655	
5期(2018年3月8日)	9,829	0	△ 2.9	97.7	—	1,299	
6期(2019年3月8日)	9,491	0	△ 3.4	97.5	—	2,686	
7期(2020年3月9日)	8,507	0	△10.4	97.7	—	2,942	

(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。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落	率			
(期首) 2019年3月8日	円 9,491		% —	% 97.5	% —	% —
3月末	9,609		1.2	97.6	—	—
4月末	9,609		1.2	97.4	—	—
5月末	9,306		△ 1.9	97.4	—	—
6月末	9,361		△ 1.4	97.2	—	0.0
7月末	9,296		△ 2.1	96.8	—	△0.0
8月末	8,959		△ 5.6	97.1	—	—
9月末	9,103		△ 4.1	97.6	—	—
10月末	9,366		△ 1.3	97.9	—	0.0
11月末	9,278		△ 2.2	97.3	—	—
12月末	9,493		0.0	96.3	—	—
2020年1月末	9,184		△ 3.2	97.0	—	△0.0
2月末	9,040		△ 4.8	98.1	—	—
(期末) 2020年3月9日	8,507		△10.4	97.7	—	—

(注) 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。

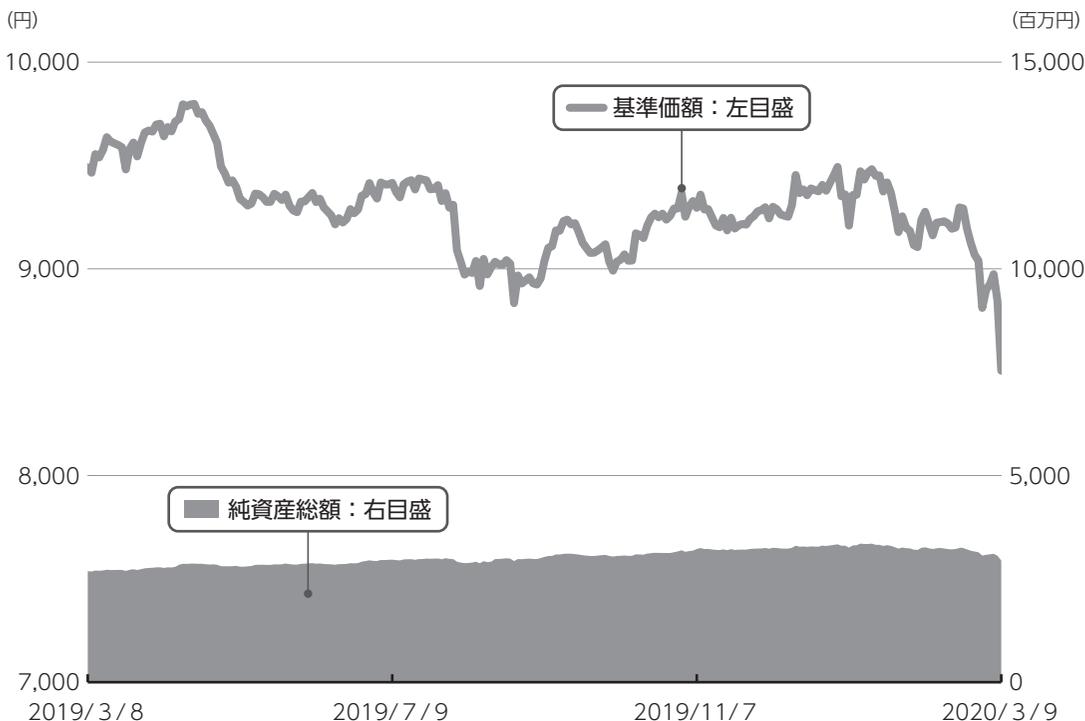
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第7期：2019年3月9日～2020年3月9日

## 当期中の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



第7期首	9,491円
第7期末	8,507円
既払分配金	0円
騰落率	-10.4%

※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

基準価額は期首に比べ10.4%の下落となりました。

## ▶ 基準価額の変動要因

### 上昇要因

債券利子収益を享受したことや豪州金利が低下したことなどが基準価額の上昇要因となりました。

### 下落要因

豪ドルが対円で下落したことなどが基準価額の下落要因となりました。

第7期：2019年3月9日～2020年3月9日

## 投資環境について

### ▶ 債券市況

**豪州金利は低下しました。**

豪州の低迷しているインフレ率などを背景に豪州連邦準備銀行（RBA）が政策金利を複数回引き下げたことや、新型コロナウイルスの拡散などにより世界経済の減速懸念が高まったことなどから、豪州金利は低下しました。

### ▶ 為替市況

**豪ドルは対円で下落しました。**

2019年8月にかけては、米中通商問題に対する懸念が高まった局面で、豪ドルは対円で下落しました。12月にかけて、米中通商問題や英国の欧州連合（EU）からの合意なき離脱に対する懸念が後退したことなどを背景に、豪ドルは対円で緩やかな上昇基調で推移しましたが、その後、新型コロナウイルスの拡散により、投資家のリスクセンチメントが悪化したことなどから、豪ドルは対円で下落しました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

### ▶ 三菱UFJ 豪ドル債券インカムオープン（年1回決算型）

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組入比率

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、RBAの緩和的な金融政策を見込み、利下げの織り込みを注視しながら、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

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、国債の組入比率を引き下げ、国際機関債などの組入比率を引き上げました。

## 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、1万口当たり、税込み）

項目	第7期 2019年3月9日～2020年3月9日
当期分配金（対基準価額比率）	－（－％）
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	1,676

（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（年1回決算型）

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。

2019年3月9日～2020年3月9日

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	107	1.150	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数)
（投信会社）	(46)	(0.496)	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）	(56)	(0.599)	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）	(5)	(0.055)	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 = 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
（先物・オプション）	(0)	(0.002)	
(c) その他費用	1	0.014	(c) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.010)	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)	(0.004)	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	108	1.166	

期中の平均基準価額は、9,294円です。

(注) 期中の費用（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。

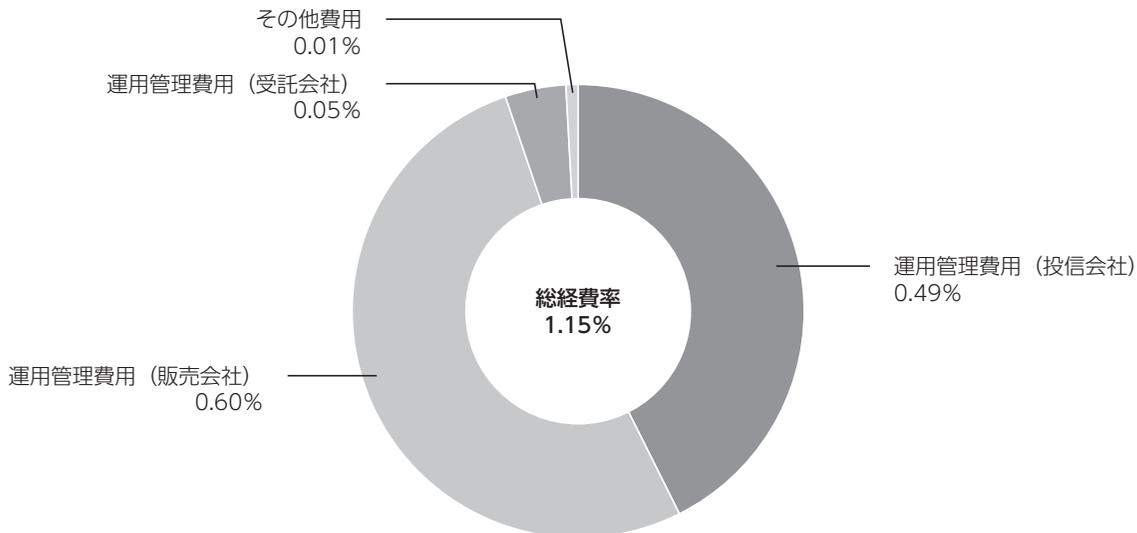
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

## （参考情報）

### ■ 総経費率

当期中の運用・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。）を期中の平均受益権口数に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1.15%**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

(2019年3月9日～2020年3月9日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	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 692,403	千円 695,196	千口 144,438	千円 144,120

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年3月9日～2020年3月9日)

## 利害関係人との取引状況

<三菱UFJ 豪ドル債券インカムオープン（年1回決算型）>  
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	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 -	百万円 -	% -	百万円 17,590	百万円 509	% 2.9

平均保有割合 3.3%

※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銀行です。

## ○組入資産の明細

(2020年3月9日現在)

## 親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
豪ドル債券インカムマザーファンド	千口 2,632,284	千口 3,180,249	千円 2,934,734

## ○投資信託財産の構成

(2020年3月9日現在)

項 目	当 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 2,934,734	% 99.0
コール・ローン等、その他	28,257	1.0
投資信託財産総額	2,962,991	100.0

(注) 豪ドル債券インカムマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（77,327,214千円）の投資信託財産総額（78,241,917千円）に対する比率は98.8%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=67.44円			
--------------------	--	--	--

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年3月9日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,962,991,836
コール・ローン等	25,848,643
豪ドル債券インカムマザーファンド(評価額)	2,934,734,005
未収入金	2,409,188
(B) 負債	20,871,708
未払解約金	2,320,842
未払信託報酬	18,487,500
未払利息	39
その他未払費用	63,327
(C) 純資産総額(A-B)	2,942,120,128
元本	3,458,414,023
次期繰越損益金	△ 516,293,895
(D) 受益権総口数	3,458,414,023口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,507円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 2,830,745,843円  
 期中追加設定元本額 981,352,489円  
 期中一部解約元本額 353,684,309円  
 また、1口当たり純資産額は、期末0.8507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516,293,895円です。

## ③分配金の計算過程

項 目	2019年3月9日～ 2020年3月9日
費用控除後の配当等収益額	65,496,531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
収益調整金額	410,401,138円
分配準備積立金額	103,766,895円
当ファンドの分配対象収益額	579,664,564円
1万口当たり収益分配対象額	1,676円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

## ○損益の状況（2019年3月9日～2020年3月9日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 7,519
受取利息	63
支払利息	△ 7,582
(B) 有価証券売買損益	△289,735,764
売買益	5,336,033
売買損	△295,071,797
(C) 信託報酬等	△ 35,009,263
(D) 当期損益金(A+B+C)	△324,752,546
(E) 前期繰越損益金	△111,396,084
(F) 追加信託差損益金	△ 80,145,265
(配当等相当額)	( 408,910,973)
(売買損益相当額)	(△489,056,238)
(G) 計(D+E+F)	△516,293,895
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△516,293,895
追加信託差損益金	△ 80,145,265
(配当等相当額)	( 410,401,138)
(売買損益相当額)	(△490,546,403)
分配準備積立金	169,263,426
繰越損益金	△605,412,056

(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) (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。

\*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

## 豪ドル債券インカムマザーファンド

### 《第7期》決算日2020年3月9日

[計算期間：2019年3月9日～2020年3月9日]

「豪ドル債券インカムマザーファンド」は、3月9日に第7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7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。 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。 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。 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。 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	基準額	価額		債組入比率	債券先物比率	純総資産額
		期騰落	中率			
3期(2016年3月8日)	円		%	%	%	百万円
	10,150		△7.3	98.1	—	133,102
4期(2017年3月8日)	10,635		4.8	96.9	—	128,734
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

(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) 2019年3月8日	円 10,182	% —	% 97.8	% —	% —
3月末	10,315	1.3	97.9	—	—
4月末	10,324	1.4	97.7	—	—
5月末	10,008	△1.7	97.6	—	—
6月末	10,076	△1.0	97.4	0.0	—
7月末	10,016	△1.6	97.2	△0.0	—
8月末	9,661	△5.1	97.3	—	—
9月末	9,827	△3.5	97.8	—	—
10月末	10,122	△0.6	98.1	0.0	—
11月末	10,035	△1.4	97.5	—	—
12月末	10,278	0.9	96.5	—	—
2020年1月末	9,952	△2.3	97.3	△0.0	—
2月末	9,804	△3.7	98.4	—	—
(期 末) 2020年3月9日	9,228	△9.4	97.9	—	—

(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9.4%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)

- ・債券利子収益を享受したことや豪州金利が低下したことなどが基準価額の上昇要因となりました。

## (下落要因)

- ・豪ドルが対円で下落したことなどが基準価額の下落要因となりました。

## ●投資環境について

## ◎債券市況

- ・豪州金利は低下しました。
- ・豪州の低迷しているインフレ率などを背景に豪州連邦準備銀行(RBA)が政策金利を複数回引き下げたことや、新型コロナウイルスの拡散などにより世界経済の減速懸念が高まったことなどから、豪州金利は低下しました。

## ◎為替市況

- ・豪ドルは対円で下落しました。
- ・2019年8月にかけては、米中通商問題に対する懸念が高まった局面で、豪ドルは対円で下落しました。12月にかけて、米中通商問題や英国の欧州連合（EU）からの合意なき離脱に対する懸念が後退したことなどを背景に、豪ドルは対円で緩やかな上昇基調で推移しましたが、その後、新型コロナウイルスの拡散により、投資家のリスクセンチメントが悪化したことなどから、豪ドルは対円で下落しました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

## ◎組入比率

- ・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、RBAの緩和的な金融政策を見込み、利下げの織り込みを注視しながら、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

- ・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、国債の組入比率を引き下げ、国際機関債など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

(2019年3月9日～2020年3月9日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.002 (0.002)	(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 )	1 (1) (0)	0.010 (0.010) (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	1	0.012	
期中の平均基準価額は、10,027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

(2019年3月9日～2020年3月9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	480,702	738,932
		特殊債券	396,891	328,864

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分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 29,559	百万円 29,092	百万円 29,555	百万円 29,092

(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

(2019年3月9日～2020年3月9日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
為替直物取引	—	—	—	17,590	509	2.9

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銀行です。

## ○組入資産の明細

(2020年3月9日現在)

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	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		
		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	1,038,000	1,115,825	75,251,296	97.9	—	10.4	60.2	27.3
合 計	1,038,000	1,115,825	75,251,296	97.9	—	10.4	60.2	27.3

(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						償還年月日
	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	1.75 AUST GOVT 201121	1.75	90,000	90,842	6,126,415	2020/11/21	
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	45,000	49,330	3,326,836	2024/4/21	
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	5,000	5,794	390,812	2023/4/21	
	AUSTRALIA T-BILL 200821	—	65,000	64,829	4,372,080	2020/8/21	
特殊債券	1 NEWSWALES 240208	1.0	15,000	15,162	1,022,569	2024/2/8	
	1.1 ASIAN DEV 240815	1.1	10,000	10,081	679,881	2024/8/15	
	1.45 INTL FINAN 240722	1.45	10,000	10,230	689,961	2024/7/22	
	1.5 VICTORIA 301120	1.5	15,000	15,426	1,040,329	2030/11/20	
	1.7 EIB 241115	1.7	10,000	10,345	697,687	2024/11/15	
	1.95 IADB 240423	1.95	10,000	10,433	703,606	2024/4/23	
	2 NEWSWALES 330308	2.0	10,000	10,689	720,930	2033/3/8	
	2.2 IBRD 240227	2.2	25,000	26,291	1,773,127	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	2.4 EXPORT DEVELO 210607	2.4	15,000	15,307	1,032,315	2021/6/7
	2.4 KFW 200702	2.4	10,000	10,054	678,094	2020/7/2
	2.5 INTL BK RECON 200312	2.5	10,000	10,001	674,473	2020/3/12
	2.65 ASIAN DEV 230111	2.65	10,000	10,521	709,545	2023/1/11
	2.7 EXPORT DEVELO 221024	2.7	10,000	10,493	707,701	2022/10/24
	2.7 INTL FINAN 210205	2.7	20,000	20,356	1,372,868	2021/2/5
	2.7 INTL FINAN 230315	2.7	5,000	5,277	355,907	2023/3/15
	2.7 LANDWIRTSCH. 220905	2.7	20,000	20,946	1,412,657	2022/9/5
	2.75 ASIAN DEV 220119	2.75	20,000	20,736	1,398,483	2022/1/19
	2.75 INTER-AMERIC 251030	2.75	10,000	10,974	740,122	2025/10/30
	2.75 WEST AUST TR 221020	2.75	40,000	42,188	2,845,211	2022/10/20
	2.8 IBRD 210113	2.8	15,000	15,258	1,029,019	2021/1/13
	2.8 IBRD 220112	2.8	20,000	20,746	1,399,175	2022/1/12
	2.8 INTL FINAN 220815	2.8	27,000	28,321	1,910,019	2022/8/15
	2.8 KFW 210217	2.8	30,000	30,582	2,062,456	2021/2/17
	2.8 KFW 230307	2.8	30,000	31,748	2,141,118	2023/3/7
	2.9 EUROPEAN INVE 251017	2.9	10,000	11,035	744,235	2025/10/17
	3.25 QUEENSLAND 280721	3.25	20,000	23,462	1,582,315	2028/7/21
	3.75 ASIAN DEVELO 250312	3.75	20,000	22,752	1,534,404	2025/3/12
	3.75 INTER-AMERIC 220725	3.75	30,000	32,094	2,164,451	2022/7/25
	4 INTER-AMERICAN 230522	4.0	10,000	10,997	741,664	2023/5/22
	4.25 INTL BK RECO 250624	4.25	10,000	11,712	789,893	2025/6/24
	4.25 INTL FINANCE 230821	4.25	15,000	16,739	1,128,901	2023/8/21
	4.25 LANDWIRTSCH 250109	4.25	20,000	23,139	1,560,541	2025/1/9
	4.25 QUEENSLAND 230721	4.25	120,000	134,225	9,052,156	2023/7/21
	4.25 RENTENBANK 230124	4.25	20,000	21,938	1,479,558	2023/1/24
	4.75 BK NEDERLAND 230306	4.75	10,000	11,143	751,500	2023/3/6
	4.75 NEDER WATERS 230411	4.75	4,000	4,467	301,268	2023/4/11
	4.75 QUEENSLAND 250721	4.75	10,000	12,071	814,083	2025/7/21
	5 EUROPEAN INVEST 220822	5.0	10,000	11,029	743,811	2022/8/22
	5 KFW 240319	5.0	10,000	11,639	784,977	2024/3/19
	5.5 LANDWIRTSCH 220329	5.5	30,000	32,889	2,218,062	2022/3/29
	5.75 QUEENSLAND 240722	5.75	20,000	24,325	1,640,530	2024/7/22
	6 QUEENSLAND 220721	6.0	15,000	16,881	1,138,502	2022/7/21
	6 WEST AUST TREAS 231016	6.0	40,000	47,555	3,207,169	2023/10/16
	6.5 KOMMUNALBANKE 210412	6.5	12,000	12,749	859,857	2021/4/12
合 計					75,251,296	

(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

(2020年3月9日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	75,251,296	96.2
コール・ローン等、その他	2,990,621	3.8
投資信託財産総額	78,241,917	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (77,327,214千円) の投資信託財産総額 (78,241,917千円) に対する比率は98.8%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=67.44円		
--------------------	--	--

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年3月9日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	78,916,217,268
コール・ローン等	2,280,045,462
公社債(評価額)	75,251,296,359
未収入金	702,100,000
未収利息	441,686,663
前払費用	44,041,692
差入委託証拠金	197,047,092
(B) 負債	2,060,893,835
未払金	1,383,074,168
未払解約金	677,819,393
未払利息	274
(C) 純資産総額(A-B)	76,855,323,433
元本	83,285,682,362
次期繰越損益金	△ 6,430,358,929
(D) 受益権総口数	83,285,682,362口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,228円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 100,938,698,555円  
期中追加設定元本額 2,984,775,524円  
期中一部解約元本額 20,637,791,717円  
また、1口当たり純資産額は、期末0.9228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 80,105,433,115円  
三菱UFJ 豪ドル債券インカムオープン(年1回決算型) 3,180,249,247円  
合計 83,285,682,362円

- ③純資産総額が元本額を下回っており、その差額は6,430,358,929円です。

## ○損益の状況 (2019年3月9日～2020年3月9日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,825,710,507
受取利息	2,825,906,306
支払利息	△ 195,799
(B) 有価証券売買損益	△11,051,308,876
売買益	1,682,377,506
売買損	△12,733,686,382
(C) 先物取引等取引損益	△ 9,500,243
取引益	207,777,552
取引損	△ 217,277,795
(D) 保管費用等	△ 9,215,885
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 8,244,314,497
(F) 前期繰越損益金	1,837,674,446
(G) 追加信託差損益金	13,940,721
(H) 解約差損益金	△ 37,659,599
(I) 計(E+F+G+H)	△ 6,430,358,929
次期繰越損益金(I)	△ 6,430,358,929

(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。