

LM・オーストラリア債券ファンド (年2回決算型)

運用報告書（全体版）

第5期 決算日 2015年12月10日

◇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	
運用方針	主として豪ドル建の公社債に投資を行い、中長期的な信託財産の成長を目指します。	
主要運用対象	当ファンド	「LM・豪ドル債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
	LM・豪ドル債券マザーファンド	主として豪ドル建の国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券及び資産担保証券等を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。	
分配方針	決算日（原則として毎年6月10日及び12月10日。休業日の場合は翌営業日）に、基準価額水準等を勘案して収益の分配を行います。	

当報告書に関するお問い合わせ先：

レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社

お問い合わせ窓口

電話番号：03-5219-5947

－ 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、「LM・オーストラリア債券ファンド（年2回決算型）」は、2015年12月10日に第5期の決算を行いましたので、第5期の運用状況と収益分配金をご報告申し上げます。今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社

〒100-6536 東京都千代田区丸の内一丁目5番1号

<http://www.leggmason.co.jp>

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額		債組入比率	債券先物比率	純資産総額
		税金 分配	騰落率			
(設定日) 2013年10月25日	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	百万円 4
1期(2013年12月10日)	9,987	0	△0.1	97.0	△2.8	8
2期(2014年6月10日)	10,581	0	5.9	96.9	△4.1	207
3期(2014年12月10日)	11,385	0	7.6	97.2	△3.9	457
4期(2015年6月10日)	11,063	0	△2.8	97.2	0.7	815
5期(2015年12月10日)	10,450	0	△5.5	96.4	1.2	956

(注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注2) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「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4) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

(注5) 市場に広く認知されているベンチマーク等で、当ファンドのリスク特性を正確に反映する指標が見当たらないため、現状では、当ファンドの収益率及びリスク特性を特定のベンチマーク等と比較しておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	標準価額		債組入比率	債券先物比率	債券率
		騰落率	騰落率			
(期首) 2015年6月10日	円 11,063	% —	% —	% 97.2	% —	% 0.7
6月末	10,901	△1.5	97.2	97.2	—	1.4
7月末	10,621	△4.0	96.8	96.8	△0.4	—
8月末	10,202	△7.8	96.1	96.1	△1.8	—
9月末	9,930	△10.2	96.1	96.1	△2.0	—
10月末	10,160	△8.2	98.4	98.4	△2.3	—
11月末	10,334	△6.6	96.7	96.7	1.5	—
(期末) 2015年12月10日	10,450	△5.5	96.4	96.4	1.2	—

(注1) 騰落率は期首比です。

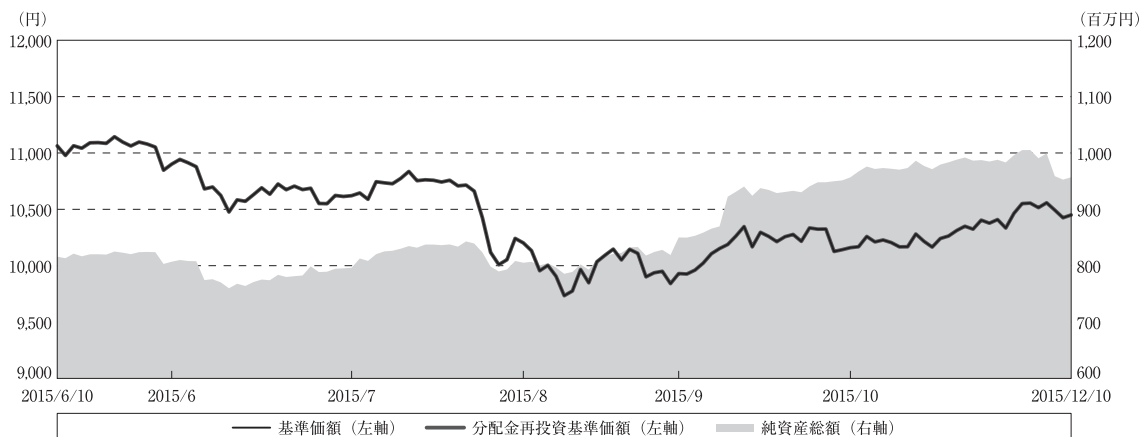
(注2) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

○運用経過

期中の基準価額等の推移

(2015年6月11日～2015年12月10日)



期首：11,063円

期末：10,450円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率：△5.5%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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りますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額は、期首（2015年6月10日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

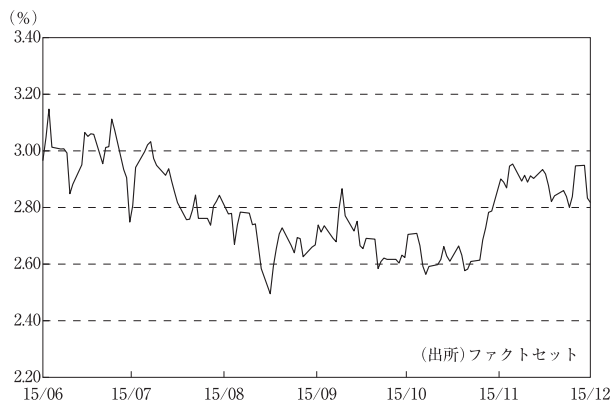
期末（2015年12月10日）のLM・オーストラリア債券ファンド（年2回決算型）（以下、当ファンド）の基準価額は10,450円となりました。当期の当ファンドのパフォーマンス（騰落率）はマイナス5.5%、基準価額は613円下落しました。オーストラリア債券市場の金利水準が相対的に高いことから、公社債利金を手堅く確保しましたが、為替損益がマイナスとなったことが基準価額の主な下落要因となりました。

オーストラリア債券市場は、長期債を中心に利回りが低下（価格は上昇）しました。期の前半は、ギリシャへの金融支援を巡る不透明感や、中国経済に対する懸念の広がりなどを受け、投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、利回りは低下しました。期の半ばは、中国景気への懸念などから世界的に株式相場が下落し、オーストラリアの株式相場も下落したため、利回りは一時大きく低下しました。しかし、その後は株式相場が下げ止まったことや、豪企業景況感指数が前月から改善したことなどを背景に、利回りは上昇（価格は下落）しました。期の後半は、欧州中央銀行（ECB）による追加緩和観測の強まりや、中国人民銀行による追加金融緩和策の実施を受けて世界的に株価が堅調となる中、利回りは上昇しました。また、米連邦準備制度理事会（FRB）による早期利上げ観測によって米国国債利回りが上昇したことも、オーストラリアの国債利回りの上昇要因となりました。

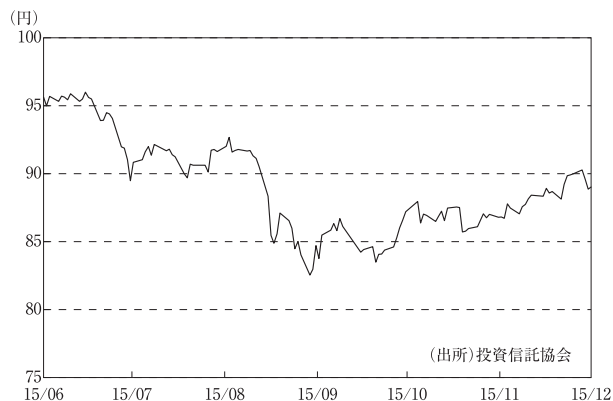
社債セクターは、軟調となりました。オーストラリアの株式相場が下落したことや、同国の主要輸出資源である鉄鉱石の価格が下落したことなどを受け、社債スプレッド（国債に対する上乗せ金利）は拡大しました。

為替市場は、豪ドル安・円高となりました。期の前半は、ギリシャ支援を巡る不透明感の強まりや、中国経済の減速懸念を受け、投資家のリスク回避の動きが強まったことから、豪ドルは対円で下落し、その後も上値の重い展開が続きました。期の半ばは、中国経済の不透明感が一段と強まり、世界経済の減速懸念が意識されたことから、世界的に株価が急落する中、豪ドル安・円高が進みました。期の後半は、ECBによる追加緩和観測の強まりや、中国人民銀行による追加金融緩和策の実施を受け、世界的に株価が堅調となる中、豪ドルは対円で上昇に向かいました。期末にかけても、豪雇用統計で雇用者数が予想を上回る伸びを示すとともに、失業率が前月から大きく改善したことなどが好感され、豪ドルは対円で上昇傾向となりました。

オーストラリア10年国債の利回り推移



豪ドル／円レートの推移



当ファンドは豪ドル建ての国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券及び資産担保証券等を主要投資対象とする「LM・豪ドル債券マザーファンド」受益証券に投資を行い、長期的に安定した利金（インカム）収入が期待できるポートフォリオの運用を行いました。当ファンドは原則としてA-／A3格以上の格付けの公社債へ投資し、信用リスクの抑制を図る等、安定的な運用を目指しております。当作成期においては、金融債、リート・セクター等を中心とした社債を引き続き厚めとしました。金融債の組み入れにおいては、カバードボンド（債権担保付社債の一種）や、大手金融機関が発行する、流動性・信用力が相対的に高い債券が組み入れの中心となっています。また、ポートフォリオ全体の平均格付けは引き続き高位に保ちました。

分配金

(2015年6月11日～2015年12月10日)

当期の分配金につきましては、以下の通りとさせていただきます。なお、収益分配に充当しなかった利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き運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第5期
	2015年6月11日～ 2015年12月10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	1,610

(注1) 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2) 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

2015年11月12日に発表された豪雇用統計では、雇用者数が予想を上回るとともに、失業率が予想以上に低下し、豪雇用情勢が改善傾向にあることが示されました。オーストラリアの景気は今後も緩やかな拡大傾向を続けるものと予想されます。

運用方針に関しては、市場動向を睨みながらデュレーション（利回りが変動した場合の債券価格変動性）を調整する方針です。資産配分については、金融債、リート・セクター等を中心とした社債を引き続き厚めとする方針です。金融債については、カバードボンド、大手金融機関が発行する流動性・信用力が相対的に高い債券等を組み入れの中心とします。

為替相場については、オーストラリア準備銀行（RBA）による追加利下げの思惑が高まる局面などにおいて、豪ドルの上値が抑えられる可能性があります。しかし、オーストラリアの景気は今後も緩やかな成長基調を辿ると見込まれる一方、日本では日銀が積極的な金融緩和を継続していることから、豪ドルは対円で底堅く推移するものと予想されます。

○1万口当たりの費用明細

(2015年6月11日～2015年12月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 70	% 0.675	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(34)	(0.324)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(34)	(0.329)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.022)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(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
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.001)	売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) そ の 他 費 用	3	0.029	(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)	(0)	(0.004)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(印 刷 等 費 用)	(2)	(0.021)	印刷等費用は、印刷業者等に支払う法定書類の作成、印刷、交付および届出に係る費用
合 計	73	0.705	
期中の平均基準価額は、10,358円です。			

(注1) 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2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 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4) 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

(2015年6月11日～2015年12月10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
LM・豪ドル債券マザーファンド	千口 134,200	千円 306,484	千口 55,227	千円 129,488

(注) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2015年6月11日～2015年12月10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。

○第二種金融商品取引業を兼業している投資信託委託会社の自己取引状況

(2015年6月11日～2015年12月10日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2015年6月11日～2015年12月10日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2015年12月10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
	千口	千口	千円
LM・豪ドル債券マザーファンド	337,397	416,370	962,939

(注) 単位未満は切捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2015年12月10日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
LM・豪ドル債券マザーファンド	962,939	100.0
投資信託財産総額	962,939	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) LM・豪ドル債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(206,195,316千円)の投資信託財産総額(207,397,385千円)に対する比率は99.4%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売相場場の仲値により邦貨換算したものです。なお、12月10日における邦貨換算レートは1オーストラリアドル=89.01円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年12月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	962,939,759
LM・豪ドル債券マザーファンド(評価額)	962,939,759
(B) 負債	6,055,171
未払信託報酬	5,839,940
その他未払費用	215,231
(C) 純資産総額(A-B)	956,884,588
元本	915,719,200
次期繰越損益金	41,165,388
(D) 受益権総口数	915,719,200口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,450円

<注記事項>

元本の状況	
期首元本額	737,578,798円
期中追加設定元本額	296,066,736円
期中一部解約元本額	117,926,334円

○損益の状況 (2015年6月11日～2015年12月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	△30,513,390
売買益	3,258,094
売買損	△33,771,484
(B) 信託報酬等	△ 6,055,171
(C) 当期損益金(A+B)	△36,568,561
(D) 前期繰越損益金	19,982,017
(E) 追加信託差損益金	57,751,932
(配当等相当額)	(97,186,629)
(売買損益相当額)	(△39,434,697)
(F) 計(C+D+E)	41,165,388
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	41,165,388
追加信託差損益金	57,751,932
(配当等相当額)	(97,744,142)
(売買損益相当額)	(△39,992,210)
分配準備積立金	49,698,367
繰越損益金	△66,284,911

(注1) 損益の状況の中で(A)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2) 損益の状況の中で(B)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3) 損益の状況の中で(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4) 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するため要する費用として、委託者報酬のうち販売会社へ支払う手数料を除いた額の100分の50相当額を支払っております。

<分配金の計算過程>

決 算 期	当 期
(A) 配当等収益(費用控除後)	14,095,456円
(B) 有価証券売買等損益(費用控除後、繰越欠損金補填後)	0
(C) 収益調整金	97,744,142
(D) 分配準備積立金	35,602,911
分配対象収益額(A+B+C+D)	147,442,509
(1万口当たり収益分配対象額)	(1,610)
収益分配金	0
(1万口当たり収益分配金)	(0)

LM・豪ドル債券マザーファンド

運用状況のご報告

第25期 決算日 2015年12月10日

(計算期間：2015年6月11日～2015年12月10日)

－ 受益者のみなさまへ －

法令・諸規則に基づき、「LM・豪ドル債券マザーファンド」の第25期の運用状況をご報告申し上げます。

◇当ファンドの仕組みは、次の通りです。

商 品 分 類	親投資信託
信 託 期 間	無期限
運 用 方 針	<ol style="list-style-type: none"> ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックス（為替ヘッジなし、円換算ベース）を参考指標として運用を行います。 豪ドル建の国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券及び資産担保証券等を主要投資対象とします。投資を行う公社債は、取得時において、原則として格付機関からA-/A3以上の格付を付与されたものとします。 デュレーション・コントロール、セクター配分、銘柄選定の3つの戦略により超過収益の獲得を目指します。 シナリオ・ディペンデント・オプティマイゼーション（SDO）を活用したデュレーション・コントロールを行います。ポートフォリオの平均デュレーションは、原則として参考指標のデュレーション±1年とします。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。したがって、基準価額は、円と豪ドルとの為替変動の影響を受けます。
主 要 運 用 対 象	主として豪ドル建の国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券及び資産担保証券等を主要投資対象とします。
組 入 制 限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準	価額		債組入比率	債券先物比率	純資産総額
		騰落	率			
	円		%	%	%	百万円
21期(2013年12月10日)	21,511		1.4	96.9	△2.8	161,034
22期(2014年6月10日)	22,939		6.6	96.6	△4.1	185,499
23期(2014年12月10日)	24,850		8.3	96.7	△3.9	223,058
24期(2015年6月10日)	24,314		△2.2	96.6	0.7	238,599
25期(2015年12月10日)	23,127		△4.9	95.8	1.2	207,038

(注1) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

(注2) 市場に広く認知されているベンチマーク等で、当ファンドのリスク特性を正確に反映する指標が見当たらないため、現状では、当ファンドの収益率及びリスク特性を特定のベンチマーク等と比較しておりません。

○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	債券先物比率
		騰落	率		
(期首) 2015年6月10日	円		%	%	%
	24,314		—	96.6	0.7
6月末	23,977		△1.4	97.1	1.4
7月末	23,390		△3.8	96.6	△0.4
8月末	22,496		△7.5	95.8	△1.8
9月末	21,924		△9.8	95.8	△2.0
10月末	22,454		△7.6	97.9	△2.3
11月末	22,863		△6.0	96.1	1.4
(期末) 2015年12月10日	23,127		△4.9	95.8	1.2

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

○運用経過

期中の基準価額の推移

(2015年6月11日～2015年12月10日)



○基準価額の変動要因

当期末（2015年12月10日）のLM・豪ドル債券マザーファンド（以下、当ファンド）の基準価額は23,127円となりました。当期の当ファンドのパフォーマンス（騰落率）はマイナス4.9%、基準価額は1,187円下落しました。オーストラリア債券市場の金利水準が相対的に高いことから、公社債利金を手堅く確保しましたが、為替損益がマイナスとなったことが基準価額の下落要因となりました。

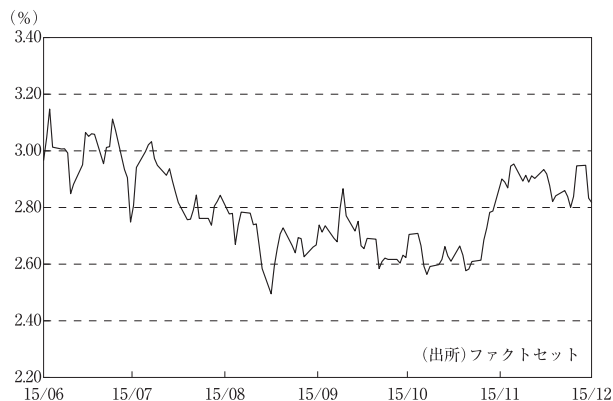
オーストラリア債券市場は、長期債を中心に利回りが低下（価格は上昇）しました。期の前半は、ギリシャへの金融支援を巡る不透明感や、中国経済に対する懸念の広がりなどを受け、投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、利回りは低下しました。期の半ばは、中国景気への懸念などから世界的に株式相場が下落し、オーストラリアの株式相場も下落したため、利回りは一時大きく低下しました。しかし、その後は株式相場が下げ止まったことや、豪企業景況感指数が前月から改善したことなどを背景に、利回りは上昇（価格は下落）しました。期の後半は、欧州中央銀行（ECB）による追加緩和観測の強まりや、中国人民銀行による追加金融緩和策の実施を受けて世界的に株価が堅調

となる中、利回りは上昇しました。また、米連邦準備制度理事会（FRB）による早期利上げ観測によって米国国債利回りが上昇したことも、オーストラリアの国債利回りの上昇要因となりました。

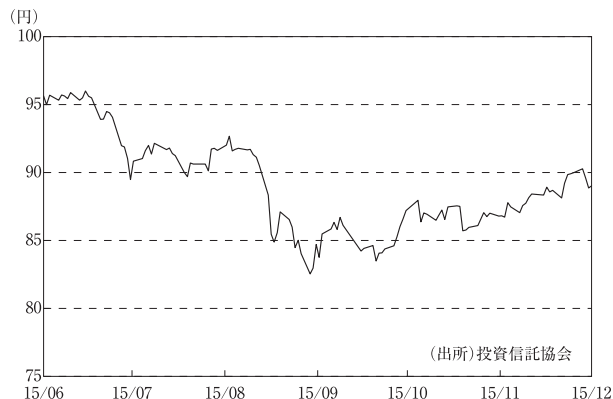
社債セクターは、軟調となりました。オーストラリアの株式相場が下落したことや、同国の主要輸出資源である鉄鉱石の価格が下落したことなどを受け、社債スプレッド（国債に対する上乘せ金利）は拡大しました。

為替市場は、豪ドル安・円高となりました。期の前半は、ギリシャ支援を巡る不透明感の強まりや、中国経済の減速懸念を受け、投資家のリスク回避の動きが強まったことから、豪ドルは対円で下落し、その後も上値の重い展開が続きました。期の半ばは、中国経済の不透明感が一段と強まり、世界経済の減速懸念が意識されたことから、世界的に株価が急落する中、豪ドル安・円高が進みました。期の後半は、ECBによる追加緩和観測の強まりや、中国人民銀行による追加金融緩和策の実施を受け、世界的に株価が堅調となる中、豪ドルは対円で上昇に向かいました。当作成期末にかけても、豪雇用統計で雇用者数が予想を上回る伸びを示すとともに、失業率が前月から大きく改善したことなどが好感され、豪ドルは対円で上昇傾向となりました。

オーストラリア10年国債の利回り推移



豪ドル／円レートの推移



当ファンドのポートフォリオ

当ファンドは豪ドル建ての国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券及び資産担保証券等を主要投資対象とし、長期的に安定した利金（インカム）収入が期待できるポートフォリオの運用を行いました。当ファンドは原則としてA－/A3格以上の格付けの公社債へ投資し、信用リスクの抑制を図る等、安定的な運用を目指しております。当期においては、金融債、リート・セクター等を中心とした社債を引き続き厚めとしました。金融債の組み入れにおいては、カバードボンド（債権担保付社債の一種）や、大手金融機関が発行する、流動性・信用力が相対的に高い債券が組み入れの中心となっています。また、ポートフォリオ全体の平均格付けは引き続き高位に保ちました。

○今後の運用方針

2015年11月12日に発表された豪雇用統計では、雇用者数が予想を上回るとともに、失業率が予想以上に低下し、豪雇用情勢が改善傾向にあることが示されました。オーストラリアの景気は今後も緩やかな拡大傾向を続けるものと予想されます。

運用方針に関しては、市場動向を睨みながらデュレーション（利回りが変動した場合の債券価格変動性）を調整する方針です。資産配分については、金融債、リート・セクター等を中心とした社債を引き続き厚めとする方針です。金融債については、カバードボンド、大手金融機関が発行する流動性・信用力が相対的に高い債券等を組み入れの中心とします。

為替相場については、オーストラリア準備銀行（RBA）による追加利下げの思惑が高まる局面などにおいて、豪ドルの上値が抑えられる可能性があります。しかし、オーストラリアの景気が今後も緩やかな成長基調を辿ると見込まれる一方、日本では日銀が積極的な金融緩和を継続していることから、豪ドルは対円で底堅く推移するものと予想されます。

○1万口当たりの費用明細

(2015年6月11日～2015年12月10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)	% 0.001 (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 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	1 (1)	0.004 (0.004)	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
合 計	1	0.005	
期中の平均基準価額は、22,850円です。			

(注1) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 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

(2015年6月11日～2015年12月10日)

公社債

		買 付 額		売 付 額	
		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル	
外 国	オーストラリア	国債証券	69,705		47,975
		地方債証券	10,212		92,796 (16,000)
		特殊債券	11,582 (45)		31,121 (35,311)
		社債券(投資法人債券を含む)	92,499		42,915 (97,363)

(注1) 金額は受渡し代金。(経過利息分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) () 内は償還による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 社債券(投資法人債券を含む)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 27,467	百万円 30,588	百万円 21,830	百万円 25,851

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）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

(2015年6月11日～2015年12月10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

(2015年12月10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
オーストラリア	千オーストラリアドル 2,085,705	千オーストラリアドル 2,227,953	千円 198,310,180	% 95.8	% —	% 41.5	% 35.4	% 18.9
合 計	2,085,705	2,227,953	198,310,180	95.8	—	41.5	35.4	18.9

(注1) 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2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 金額単位未満は切捨て。

(注4) 一印は組み入れなし。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
国債証券	AUSTRALIA GOVT	4.5	2,000	2,188	194,793	2020/4/15
	AUSTRALIA GOVT	5.75	21,500	25,185	2,241,744	2021/5/15
	AUSTRALIA GOVT	5.75	16,500	19,721	1,755,407	2022/7/15
	AUSTRALIA GOVT	5.5	500	595	53,013	2023/4/21
	AUSTRALIA GOVT	2.75	24,000	23,980	2,134,488	2024/4/21
	AUSTRALIA GOVT	3.25	20,000	20,695	1,842,097	2025/4/21
	AUSTRALIA GOVT	4.25	22,500	25,221	2,244,994	2026/4/21
	AUSTRALIA GOVT	4.75	30,000	35,147	3,128,443	2027/4/21
	AUSTRALIA GOVT	3.25	31,750	32,193	2,865,575	2029/4/21
	AUSTRALIA GOVT	4.5	31,210	36,190	3,221,315	2033/4/21
	AUSTRALIAN GOVT	2.75	31,800	28,799	2,563,402	2035/6/21
	AUSTRALIAN GOVT	3.75	28,900	30,266	2,694,011	2037/4/21
	AUSTRALIAN GOVT	3.25	9,000	8,649	769,903	2039/6/21
地方債証券	AUCKLAND COUNCIL	5.843	5,000	5,583	497,017	2022/3/22
	AUST CAPITAL TERRITORY	5.5	13,500	14,504	1,291,024	2018/6/7
	AUST CAPITAL TERRITORY	4.25	4,000	4,272	380,297	2020/5/22
	AUST CAPITAL TERRITORY	4.25	5,000	5,376	478,566	2022/4/11
	BRITISH COLUMBIA PROV OF	4.25	4,500	4,691	417,608	2024/11/27
	NEW S WALES TREAS CORP	4.0	13,000	13,277	1,181,800	2017/2/20
	NEW S WALES TREAS CORP	6.0	21,000	22,649	2,016,017	2018/2/1
	NEW S WALES TREAS CORP	6.0	21,800	25,018	2,226,862	2020/5/1
	NEW S WALES TREAS CORP	6.0	21,000	24,933	2,219,369	2022/3/1
	NEW S WALES TREAS CORP	6.0	1,500	1,820	162,083	2023/5/1
	NEW S WALES TREAS CORP	5.0	27,000	31,090	2,767,341	2024/8/20
	NEW S WALES TREAS CORP	4.0	6,500	6,970	620,447	2026/5/20
	NORTHERN TERRITORY TREAS	5.75	2,000	2,062	183,608	2016/11/20
	NORTHERN TERRITORY TREAS	4.75	2,000	2,089	185,943	2017/11/17
	NORTHERN TERRITORY TREAS	4.75	5,000	5,300	471,775	2018/9/20
	NORTHERN TERRITORY TREAS	6.0	2,000	2,387	212,541	2024/3/15
	ONTARIO PROVINCE	6.25	7,200	8,164	726,748	2020/9/29
	ONTARIO PROVINCE	4.25	5,000	5,244	466,852	2024/8/22
	QUEBEC PROVINCE	6.5	4,000	4,657	414,551	2021/7/12
	QUEBEC PROVINCE	4.2	4,000	4,109	365,745	2025/3/10
	QUEENSLAND TREASURY	6.0	6,000	6,391	568,896	2017/9/14
	QUEENSLAND TREASURY	3.5	5,000	5,104	454,369	2017/9/21
	QUEENSLAND TREASURY	6.0	32,200	34,717	3,090,195	2018/2/21
	QUEENSLAND TREASURY	6.25	6,500	7,345	653,795	2019/6/14
	QUEENSLAND TREASURY	4.0	20,500	21,538	1,917,108	2019/6/21
	QUEENSLAND TREASURY	6.25	23,000	26,321	2,342,870	2020/2/21
	QUEENSLAND TREASURY	5.5	25,500	29,008	2,582,050	2021/6/21
	QUEENSLAND TREASURY	6.0	27,000	31,898	2,839,319	2022/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	4.25	20,500	22,031	1,961,028	2023/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	5.75	15,500	18,402	1,638,009	2024/7/22
	QUEENSLAND TREASURY	3.25	2,000	1,959	174,420	2026/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	6.5	2,000	2,658	236,658	2033/3/14

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
	地方債証券					
	QUEENSLAND TREASURY CORP	4.75	6,400	7,138	635,363	2025/7/21
	SOUTH AUST GOVT FIN	5.75	5,000	5,297	471,512	2017/9/20
	SOUTH AUST GOVT FIN	5.0	10,000	11,095	987,592	2021/5/20
	SOUTH AUST GOVT FIN	4.25	5,000	5,369	477,961	2023/11/20
	SOUTH AUST GOVT FIN	2.75	2,000	1,897	168,932	2025/4/16
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	5.0	3,500	3,660	325,840	2017/9/20
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	6.0	4,000	4,574	407,167	2020/6/15
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	4.0	7,500	7,923	705,313	2024/6/11
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3.25	3,000	2,941	261,798	2026/2/19
	TREASURY CORP VICTORIA	5.5	9,000	9,807	872,923	2018/11/15
	TREASURY CORP VICTORIA	5.5	2,000	2,421	215,567	2026/11/17
	VICTORIA TREASURY	6.0	22,500	25,868	2,302,512	2020/6/15
	VICTORIA TREASURY	6.0	26,500	31,769	2,827,805	2022/10/17
	VICTORIA TREASURY	5.5	16,000	19,076	1,697,954	2024/12/17
	WEST AUSTRALIA TREASURY	8.0	12,000	13,062	1,162,659	2017/7/15
	WEST AUSTRALIA TREASURY	7.0	23,000	26,723	2,378,697	2019/10/15
	WEST AUSTRALIA TREASURY	5.0	8,250	9,328	830,353	2025/7/23
	WESTERN AUST TREAS CORP	2.5	11,000	10,878	968,310	2020/7/22
	WESTERN AUST TREAS CORP	7.0	9,500	11,524	1,025,757	2021/7/15
	WESTERN AUST TREAS CORP	6.0	13,000	15,502	1,379,912	2023/10/16
	特殊債券 (除く金融債)					
	AFRICAN DEV BANK	5.25	6,000	6,692	595,674	2022/3/23
	AFRICAN DEV BANK	4.75	7,000	7,654	681,283	2024/3/6
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	3.5	3,000	3,072	273,462	2018/7/25
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	6.25	8,500	9,680	861,697	2020/3/5
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	5.0	5,500	6,106	543,562	2022/3/9
	AUSTRALIAN POSTAL CORP	5.0	2,000	2,151	191,469	2020/11/13
	CORP ANDINA DE FOMENTO	4.25	7,500	7,563	673,195	2016/9/1
	CORP ANDINA DE FOMENTO	6.25	5,000	5,612	499,568	2023/11/8
	CORP ANDINA DE FOMENTO	4.5	8,000	7,970	709,452	2025/6/5
	COUNCIL OF EUROP	5.625	1,000	1,000	89,010	2015/12/14
	COUNCIL OF EUROP	6.0	5,368	6,066	539,944	2020/10/8
	EUROFIMA	5.625	3,000	3,078	274,052	2016/10/24
	EUROFIMA	6.25	8,000	8,801	783,451	2018/12/28
	EUROFIMA	5.5	6,000	6,614	588,790	2020/6/30
	EUROPEAN INVT BK	6.125	9,000	9,354	832,676	2017/1/23
	EUROPEAN INVT BK	6.5	10,000	11,299	1,005,750	2019/8/7
	EUROPEAN INVT BK	6.0	10,000	11,350	1,010,334	2020/8/6
	EUROPEAN INVT BK	6.25	4,500	5,228	465,353	2021/6/8
	EXPORT FIN & INS	6.0	6,000	6,866	611,220	2020/11/12
	FMACB 2013-1E A1	3.155	943	942	83,903	2044/12/10
	FPPT 2014-1 A	2.955	1,303	1,303	116,015	2022/10/15
	INTER-AMERICAN DEVEL BK	3.25	3,000	3,055	271,943	2020/2/7
	INTERAMER DEV BANK	3.5	5,500	5,594	497,965	2017/9/26
	INTERAMER DEV BANK	3.75	2,000	2,063	183,661	2018/10/9
	INTERAMER DEV BANK	6.5	5,000	5,668	504,508	2019/8/20
	INTERAMER DEV BANK	6.0	1,500	1,724	153,514	2021/2/26

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
特殊債券 (除く金融債)	INTL BK RECON & DEVELOP	4.5	6,000	6,149	547,358	2017/3/7
	INTL BK RECON & DEVELOP	5.75	8,000	9,051	805,633	2020/10/1
	INTL BK RECON & DEVELOP	5.0	9,000	9,999	890,099	2022/3/7
	INTL FIN CORP	3.25	3,000	3,037	270,359	2017/7/26
	INTL FIN CORP	5.75	6,500	7,331	652,575	2020/7/28
	INTL FIN CORP	4.0	3,500	3,690	328,494	2025/4/3
	KFW	6.0	9,000	9,400	836,754	2017/3/28
	KFW	6.25	7,000	7,550	672,030	2018/2/23
	KFW	6.25	10,000	11,311	1,006,809	2019/12/4
	KFW	5.5	6,000	6,814	606,601	2022/2/9
	KFW	4.0	3,000	3,149	280,365	2025/2/27
	KOMMUNAL BANKEN	4.75	2,000	2,057	183,127	2017/4/12
	KOMMUNAL BANKEN	6.5	3,000	3,501	311,693	2021/4/12
	KOMMUNAL BANKEN	4.5	5,250	5,641	502,139	2022/7/18
	KOMMUNINVEST	3.25	2,000	2,032	180,928	2018/11/25
	KOMMUNINVEST	5.375	3,000	3,340	297,351	2021/11/18
	KOMMUNINVEST	4.75	3,000	3,245	288,891	2022/8/17
	KOREA DEVELOP BANK FRN	5.28	3,500	3,513	312,746	2016/2/17
	L-BANK BW FOERDERBANK	3.75	7,000	7,147	636,210	2018/1/23
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	6.5	2,500	2,631	234,258	2017/4/12
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	6.25	6,000	6,496	578,274	2018/4/13
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.0	11,000	11,474	1,021,329	2019/7/17
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	5.5	6,000	6,632	590,397	2020/3/9
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	5.5	5,500	6,238	555,316	2022/3/29
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.25	4,000	4,237	377,149	2023/1/24
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.75	4,000	4,382	390,102	2024/4/8
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.25	4,000	4,249	378,239	2025/1/9
	LBRTY 2012-1 A4	4.405	2,000	2,015	179,399	2043/7/10
	LBRTY 2013-2 A2	3.155	430	431	38,379	2044/4/15
	LGFV PROGRAM TRUST	4.31	6,000	6,254	556,704	2021/11/12
	MEDL 2013-2 A3	4.5	4,000	4,113	366,151	2045/10/11
	MEDL 2014-1 A3	4.5	3,500	3,610	321,335	2046/4/22
	NORDIC INV BANK	3.5	5,000	5,078	452,028	2017/8/8
	NORDIC INV BANK	2.7	5,500	5,476	487,498	2020/2/4
	NORDIC INV BANK	5.0	6,000	6,644	591,407	2022/4/19
	REDSE 2013-1 A	3.05	593	594	52,888	2019/3/18
	RESI 2013-1 A3	3.22	875	877	78,089	2044/3/7
普通社債券 (含む投資法人債券)	ABB FINANCE AUSTRALIA	4.25	4,400	4,484	399,136	2017/11/22
	ABN AMRO BANK NV	4.75	4,500	4,665	415,232	2019/2/5
	ABN AMRO BANK NV	3.25	6,000	5,893	524,537	2020/4/9
	AIRPORT MOTORWAY TRUST	5.5	3,600	3,869	344,436	2020/12/9
	AIRSERVICES AUSTRALIA	5.5	5,000	5,118	455,575	2016/11/15
	AIRSERVICES AUSTRALIA	4.75	4,300	4,601	409,600	2020/11/19
	AMP WHOLESALE OFFICE FUN	4.75	11,000	11,290	1,004,948	2021/10/7
	APPLE INC	2.85	6,500	6,472	576,094	2019/8/28
	APPLE INC	3.7	3,500	3,515	312,877	2022/8/28

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
	普通社債券 (含む投資法人債券)					
	AUST & NZ BANKING FRN	5.2517	3,000	3,087	274,795	2022/7/24
	AUST & NZ BANKING FRN	4.385	4,000	4,083	363,509	2023/6/19
	AUST & NZ BANKING GROUP	5.25	3,000	3,021	268,912	2016/3/23
	AUST & NZ BANKING GROUP	4.25	1,976	2,034	181,054	2018/4/17
	AUST & NZ BANKING GROUP	4.5	3,000	3,120	277,799	2018/11/6
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.75	7,500	7,634	679,511	2019/7/25
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.25	8,000	7,953	707,949	2020/6/3
	AUSTRALIA PACIFIC AIRPOR	7.0	5,000	5,132	456,848	2016/8/25
	AUSTRALIA PACIFIC AIRPOR	4.0	1,600	1,610	143,334	2022/9/15
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	4.5	5,000	5,118	455,579	2017/11/7
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	5.0	3,600	3,757	334,416	2019/11/7
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	5.5	5,000	5,348	476,069	2022/11/4
	AUSTRALIAN RAIL TRACK	7.25	8,500	9,189	817,974	2017/12/20
	BANK OF QUEENSLAND	4.0	5,000	5,096	453,675	2018/6/12
	BANK OF QUEENSLAND L FRN	2.9917	7,000	6,989	622,116	2017/5/19
	BARCLAYS BANK PLC/AUST	4.5	12,300	12,674	1,128,182	2019/4/4
	BHP BILLITON FINANCE LTD	3.0	9,500	9,110	810,934	2020/3/30
	BHP FINANCE LTD	3.75	12,000	12,035	1,071,302	2017/10/18
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	6.75	10,000	10,851	965,847	2018/3/2
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	5.5	4,000	4,498	400,402	2022/5/23
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	5.25	5,500	6,208	552,585	2024/5/20
	BK OF QUEENSLAND	4.0	2,000	2,032	180,921	2019/11/6
	BMW AUSTRALIA FINANCE	2.75	11,500	11,360	1,011,188	2018/2/23
	BNP PARIBAS/AUSTRALIA	7.0	5,000	5,087	452,856	2016/5/24
	BNP PARIBAS/AUSTRALIA	4.5	9,000	9,195	818,481	2017/10/4
	BNP PARIBAS/AUSTRALIA	4.75	2,866	2,946	262,255	2018/2/1
	BNP PARIBAS/AUSTRALIA	3.75	5,000	5,002	445,232	2020/5/21
	BP CAPITAL MARKETS PLC	4.5	8,500	8,684	772,965	2017/9/5
	BP CAPITAL MARKETS PLC	4.75	4,000	4,143	368,782	2018/11/15
	BPCE SA	4.5	4,270	4,373	389,319	2018/4/17
	BPCE SA	3.5	4,600	4,526	402,890	2020/4/24
	BWP TRUST	4.5	1,500	1,551	138,115	2019/5/27
	CATERPILLAR FIN AUSTRALI	4.0	3,750	3,784	336,861	2016/11/28
	CATERPILLAR FIN AUSTRALI	4.75	5,000	5,094	453,443	2017/5/31
	COM BK AUSTRALIA	5.75	6,000	6,201	552,009	2017/1/25
	COM BK AUSTRALIA	4.25	6,000	6,169	549,189	2018/1/25
	COM BK AUSTRALIA	4.25	4,000	4,141	368,647	2019/4/24
	COM BK AUSTRALIA	3.75	7,000	7,126	634,341	2019/10/18
	COM BK AUSTRALIA	7.25	5,000	5,767	513,365	2020/2/5
	COM BK AUSTRALIA	4.75	6,000	6,521	580,464	2024/5/27
	COMMONWEALTH BANK FRN	2.915	5,000	4,999	444,969	2018/10/19
	COMMONWEALTH PROP FUND	7.25	8,000	8,075	718,780	2016/3/11
	COMMONWEALTH PROP FUND	5.25	7,000	7,403	659,027	2019/12/13
	CREDIT SUISSE SYDNEY	4.0	2,000	2,032	180,907	2019/7/16
	CREDIT SUISSE SYDNEY	3.5	5,000	4,976	442,940	2020/4/29
	DEXUS FINANCE PTY LTD	8.75	3,000	3,211	285,868	2017/4/21

銘柄	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
	普通社債券 (含む投資法人債券)					
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.25	2,000	2,051	182,582	2019/7/1
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.25	5,000	4,990	444,191	2022/6/16
	DNB NOR BANK	6.25	13,000	13,211	1,175,921	2016/6/8
	ETSA UTILITIES FINANCE	6.75	1,500	1,541	137,210	2016/9/29
	ETSA UTILITIES FINANCE	6.25	4,200	4,396	391,356	2017/9/7
	EXPORT DEVELOPMNT CANADA	6.0	5,000	5,031	447,822	2016/2/18
	EXPORT DEVELOPMNT CANADA	3.5	5,200	5,334	474,784	2019/6/5
	EXPORT-IMPORT BANK KOREA	3.7	3,000	2,971	264,482	2021/2/19
	EXPORT-IMPORT BK KOR	4.5	3,000	3,084	274,533	2019/4/17
	EXPORT-IMPORT BK KOR	4.25	6,700	6,833	608,288	2020/5/21
	FBG TREASURY AUSTRALIA L	3.75	4,500	4,456	396,671	2020/8/7
	FEDERATION CENTRES LTD	5.75	3,000	3,227	287,313	2019/12/13
	FEDERATION CENTRES LTD	5.0	6,800	7,168	638,055	2021/5/27
	FMS WERTMANAGEMENT	5.0	7,000	7,212	641,967	2017/3/20
	FONTERRA COOPERATIVE GRO	4.5	11,700	11,979	1,066,286	2021/6/30
	FONTERRA COOPERATIVE GRO	5.5	4,000	4,326	385,064	2024/2/26
	GE CAP AUSTRALIA FUN FRN	3.095	3,500	3,509	312,404	2016/11/9
	GE CAP AUSTRALIA FUNDING	5.25	2,000	2,074	184,685	2017/8/23
	GE CAP AUSTRALIA FUNDING	5.25	5,000	5,397	480,409	2020/9/4
	GE CAP AUSTRALIA FUNDING	5.5	8,000	8,902	792,395	2022/8/8
	GPT RE LTD	6.75	9,000	9,835	875,415	2019/1/24
	GPT RE LTD	4.5	6,600	6,790	604,437	2020/9/11
	GPT WHL OFFICE FD NO1	4.0	3,000	2,954	262,955	2022/5/18
	GPT WHOLESALE SHOP CENTR	5.0	9,000	9,266	824,842	2017/11/13
	HSBC BANK AUSTRALIA	5.25	5,000	5,391	479,892	2022/9/7
	HSBC LTD SYDNEY	4.25	6,270	6,423	571,749	2017/11/16
	ICPF FINANCE PTY LTD	6.75	15,000	15,225	1,355,230	2016/6/3
	ING BANK NV/SYDNEY	7.0	12,000	12,128	1,079,527	2016/3/22
	ING BANK NV/SYDNEY	5.0	8,000	8,377	745,654	2018/11/27
	JP MORGAN CHASE & CO	7.0	7,000	7,071	629,406	2016/3/16
	JP MORGAN CHASE & CO	4.65	7,000	7,178	638,964	2017/11/7
	JP MORGAN CHASE & CO	4.5	5,000	5,056	450,043	2026/1/30
	KOREA NATIONAL OIL CORP	4.25	3,500	3,563	317,195	2019/10/8
	KOREA SOUTH-EAST POWER	5.75	5,580	6,007	534,696	2020/9/25
	LLOYDS BANK PLC	3.25	6,000	5,934	528,254	2020/4/1
	MACQUARIE BANK LTD	3.0	6,000	5,948	529,493	2018/10/26
	MACQUARIE BANK LTD	3.25	5,300	5,218	464,511	2020/3/3
	MACQUARIE UNIVERSITY	6.75	7,000	8,101	721,116	2020/9/9
	MC FINANCE AUSTRALIA P/L	4.25	2,000	2,038	181,429	2021/12/1
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.75	12,500	12,834	1,142,432	2017/9/28
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.5	10,500	10,832	964,166	2018/10/10
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.75	2,000	2,090	186,116	2021/9/17
	NATIONAL AUSTRALIA B FRN	4.925	5,000	5,063	450,702	2022/6/18
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	6.0	5,000	5,188	461,841	2017/2/15
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	7.25	3,000	3,280	292,013	2018/3/7
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	4.25	4,000	4,141	368,640	2019/5/20

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
	普通社債券 (含む投資法人債券)					
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	4.0	3,000	3,053	271,764	2021/12/16
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	4,000	4,357	387,859	2024/3/11
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	5,000	5,362	477,356	2024/6/25
	NATIONAL BK OF ABU DHABI	5.0	5,000	5,155	458,891	2018/3/7
	NATIONAL BK OF ABU DHABI	4.75	5,500	5,643	502,322	2019/3/19
	NATIONAL WEALTH MANAGEME	5.25	5,000	5,201	462,976	2017/12/7
	NATIONAL WEALTH MANAGEME	6.0	4,000	4,433	394,634	2022/8/8
	NATIONAL WEALTH SUB	6.75	12,000	12,075	1,074,838	2026/6/16
	NED WATERSCHAPBK	5.25	2,000	2,247	200,060	2024/4/18
	NEDER FINANCIERINGS-MAAT	4.75	3,500	3,833	341,190	2024/9/11
	NETWORK RAIL INFRA FIN	6.0	2,000	2,063	183,652	2016/11/15
	NEW ZEALAND MILK PTY LTD	6.25	10,000	10,185	906,629	2016/7/11
	NEW ZEALAND MILK PTY LTD	5.25	2,000	2,125	189,156	2022/5/23
	OPTUS FINANCE PTY LTD	4.75	5,600	5,830	518,977	2018/12/12
	OPTUS FINANCE PTY LTD	4.0	5,000	4,976	442,962	2022/6/17
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	5.0	7,900	8,095	720,596	2017/7/27
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	5.0	2,500	2,588	230,375	2018/7/25
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	5.5	1,200	1,269	113,041	2019/11/20
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	3.75	3,200	3,129	278,597	2021/2/24
	RABOBANK NEDERLAND AU	3.25	6,400	6,350	565,260	2020/2/11
	RABOBANK NEDERLAND(AUST)	5.5	5,000	5,477	487,565	2024/4/11
	ROYAL BK CANADA/SYD	2.75	8,000	7,940	706,767	2018/8/7
	ROYAL BK CANADA/SYD	3.25	10,000	9,952	885,854	2020/2/10
	SCENTRE GROUP TRUST	6.0	5,000	5,492	488,842	2022/7/4
	SCENTRE GROUP TRUST 2	7.0	16,000	16,493	1,468,109	2016/10/18
	SCENTRE MGMT LTD	4.5	7,000	7,086	630,802	2021/9/8
	STADSHYPOTEK AB	4.25	12,500	12,761	1,135,912	2017/10/10
	STOCKLAND TRUST MGMNT	5.5	3,000	3,179	283,043	2019/9/6
	STOCKLAND TRUST MGMNT	4.5	9,000	8,948	796,491	2022/11/23
	SUNCORP-METWAY	4.75	5,000	5,095	453,581	2016/12/6
	SUNCORP-METWAY	4.0	9,000	9,184	817,472	2017/11/9
	SUNCORP-METWAY	3.75	7,000	7,125	634,279	2019/11/5
	SUNCORP-METWAY	3.5	4,000	3,960	352,518	2020/10/20
	SVENSKA HANDELSBANKEN	4.5	4,000	4,138	368,405	2019/4/10
	TELSTRA CORP LTD	4.0	12,000	12,215	1,087,260	2017/11/15
	TELSTRA CORP LTD	4.5	6,500	6,737	599,682	2018/11/13
	TELSTRA CORP LTD	7.75	5,000	5,886	523,988	2020/7/15
	TELSTRA CORP LTD	4.0	3,700	3,716	330,845	2022/9/16
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	4.25	6,000	6,109	543,838	2018/2/26
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	4.25	2,000	2,053	182,783	2019/5/15
	TRANSPower NEW ZEALAND L	4.25	3,000	3,099	275,900	2021/8/6
	TRANSPower NEW ZEALAND L	5.75	500	559	49,775	2023/8/28
	UBS AG AUSTRALIA	4.0	3,000	3,060	272,391	2019/8/27
	UNIV OF SYDNEY	4.75	2,500	2,686	239,147	2021/4/16
	UNIVERSITY OF MELBOURNE	4.25	9,300	9,775	870,142	2021/6/30
	VERO INSURANCE LTD FRN	6.75	4,440	4,533	403,570	2026/10/6

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
	普通社債券 (含む数資法人債券)					
	VICINITY HOLDINGS	7.25	8,000	8,130	723,679	2016/5/2
	VICINITY HOLDINGS LTD	5.0	10,100	10,669	949,677	2019/12/19
	WELLS FARGO & COMPANY	4.25	3,000	3,064	272,805	2018/1/25
	WELLS FARGO & COMPANY	4.0	5,000	5,080	452,193	2019/8/8
	WELLS FARGO & COMPANY	5.25	9,480	10,247	912,096	2022/9/7
	WELLS FARGO & COMPANY	4.75	3,000	3,139	279,476	2024/8/27
	WELLS FARGO BANK NA	6.75	14,000	14,656	1,304,596	2017/5/25
	WESFARMERS LTD	6.0	4,000	4,105	365,464	2016/11/4
	WESFARMERS LTD	6.25	3,000	3,262	290,397	2019/3/28
	WESFARMERS LTD	4.75	5,000	5,215	464,262	2020/3/12
	WESFARMERS LTD	3.66	5,500	5,472	487,077	2020/11/18
	WESTPAC BANKING	7.25	4,000	4,167	370,933	2016/11/18
	WESTPAC BANKING	5.75	6,000	6,207	552,533	2017/2/6
	WESTPAC BANKING	6.0	7,000	7,267	646,840	2017/2/20
	WESTPAC BANKING	4.5	8,000	8,339	742,329	2019/2/25
	WESTPAC BANKING	3.25	5,000	4,989	444,155	2020/1/22
	WESTPAC BANKING	7.25	5,000	5,769	513,516	2020/2/11
	WESTPAC BANKING	5.25	1,500	1,675	149,098	2023/11/21
	WESTPAC BANKING FRN	3.1017	2,500	2,517	224,053	2018/1/24
合	計				198,310,180	

(注1) 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2) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

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	債券先物取引		百万円	百万円
国		オーストラリア国債(10年)2015.12限月	8,563	—
		オーストラリア国債(20年)2015.12限月	—	97
		オーストラリア国債(3年)2015.12限月	—	6,042

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 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

(2015年12月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 198,310,180	% 95.6
コール・ローン等、その他	9,087,205	4.4
投資信託財産総額	207,397,385	100.0

(注1) 金額の単位未満は切捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産(206,195,316千円)の投資信託財産総額(207,397,385千円)に対する比率は99.4%です。

(注3) 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、12月10日における邦貨換算レートは1オーストラリアドル=89.01円です。

○特定資産の価格等の調査

(2015年6月11日～2015年12月10日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年12月10日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	209,496,133,636	
コール・ローン等	4,487,562,602	
公社債(評価額)	198,310,180,759	
未収入金	4,142,503,771	
未収利息	2,249,759,013	
前払費用	26,584,617	
差入委託証拠金	279,542,874	
(B) 負債	2,457,488,052	
未払金	2,173,113,654	
未払解約金	284,374,398	
(C) 純資産総額(A-B)	207,038,645,584	
元本	89,521,125,359	
次期繰越損益金	117,517,520,225	
(D) 受益権総口数	89,521,125,359口	
1万口当たり基準価額(C/D)	23,127円	

<注記事項>

元本の状況

期首元本額 98,134,700,856円

期中追加設定元本額 8,566,292,322円

期中一部解約元本額 17,179,867,819円

期末における元本の内訳

LM・オーストラリア毎月分配型ファンド 87,451,480,564円

LM・オーストラリア毎月分配型ファンド(適格機関投資家専用) 1,653,274,423円

LM・オーストラリア債券ファンド(年2回決算型) 416,370,372円

○損益の状況 (2015年6月11日～2015年12月10日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	5,047,638,917	
受取利息	5,046,350,091	
その他収益金	1,288,826	
(B) 有価証券売買損益	△ 17,081,282,290	
売買益	1,085,164,572	
売買損	△ 18,166,446,862	
(C) 先物取引等取引損益	126,723,936	
取引益	401,893,187	
取引損	△ 275,169,251	
(D) 保管費用等	△ 8,290,542	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 11,915,209,979	
(F) 前期繰越損益金	140,465,163,215	
(G) 追加信託差損益金	11,237,701,642	
(H) 解約差損益金	△ 22,270,134,653	
(I) 計(E+F+G+H)	117,517,520,225	
次期繰越損益金(I)	117,517,520,225	

(注1) 損益の状況の中で(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2) 損益の状況の中で(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3) 損益の状況の中で(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。