

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9期 決算日 2017年12月11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、2017年12月11日に第9期の決算を行いましたので、第9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>

○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 金	騰 落 率			
	円	円	%	%	%	百万円
5期(2015年12月10日)	10,450	0	△5.5	96.4	1.2	956
6期(2016年6月10日)	9,682	0	△7.3	96.8	1.7	1,010
7期(2016年12月12日)	10,290	0	6.3	97.4	0.8	1,146
8期(2017年6月12日)	10,232	0	△0.6	97.1	△3.5	1,175
9期(2017年12月11日)	10,614	0	3.7	98.0	△1.8	1,095

(注1) 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2) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

(注3) 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 額	騰落率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2017年6月12日	円 10,232	% —	% —	% 97.1	% △3.5
6月末	10,547	3.1	97.7	△2.5	
7月末	10,766	5.2	97.6	0.7	
8月末	10,737	4.9	98.0	△2.2	
9月末	10,804	5.6	97.0	1.2	
10月末	10,718	4.7	98.0	0.4	
11月末	10,556	3.2	98.1	△1.1	
(期末) 2017年12月11日	円 10,614	% 3.7	% 98.0	% △1.8	

(注1) 騰落率は期首比です。

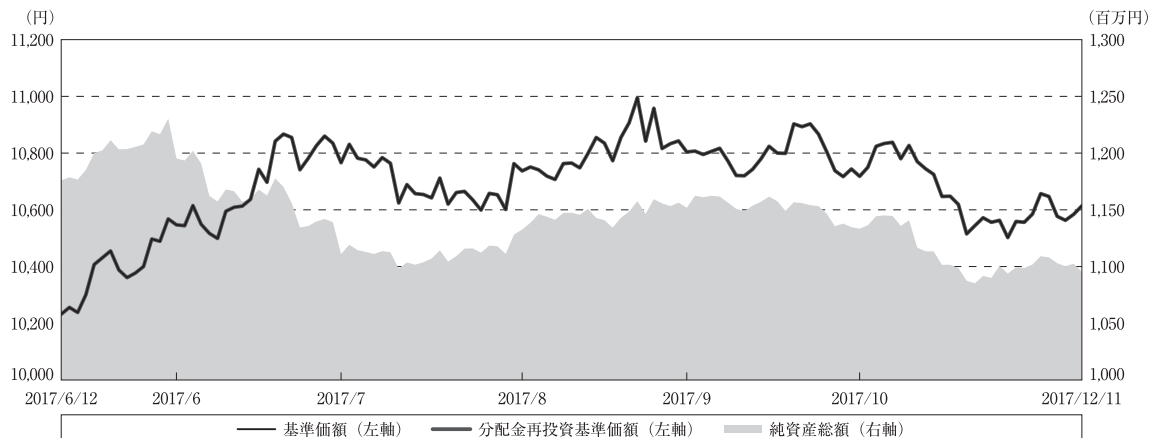
(注2) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(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

(2017年6月13日～2017年12月11日)



期首：10,232円

期末：10,614円（既払分配金(税込み)：0円）

騰落率： 3.7%（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。したがって、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(2017年6月12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

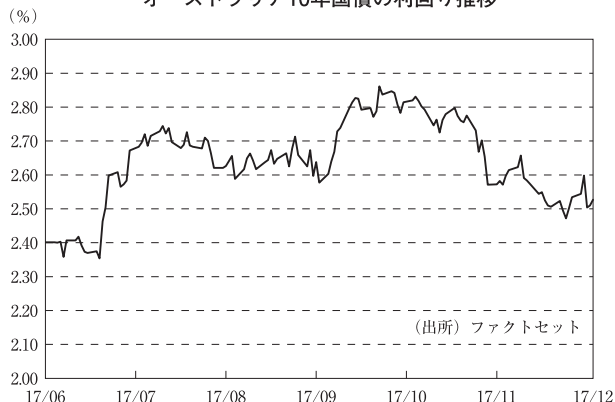
期末(2017年12月11日)のLM・オーストラリア債券ファンド(年2回決算型)(以下、当ファンド)の基準価額は10,614円となりました。当期の当ファンドのパフォーマンス(騰落率)はプラス3.7%、基準価額は382円上昇しました。オーストラリア債券市場の金利水準が相対的に高いことから、公社債利金を手堅く確保しました。さらに、豪ドル高・円安を受けて為替損益がプラスとなりました。一方、公社債損益については、利回りの上昇を受けてマイナスとなりました。

オーストラリア債券市場は、利回りが上昇（価格は下落）しました。期の前半は、オーストラリア準備銀行（RBA）議事録の公表を受け、利上げ観測が広がったことから、利回りは上昇しました。欧州中央銀行（ECB）総裁が金融緩和策の縮小に前向きな姿勢を示し、欧州の債券利回りが上昇したことも、豪債券利回りの上昇要因となりました。期の半ばは、2017年4－6月期の豪GDP成長率が予想をやや下回ったことなどを受け、利回りは一時低下（価格は上昇）しましたが、豪雇用統計で雇用者数が前月の水準を上回ると、上昇に向かいました。期の後半は、ECBによる資産買い入れ期間の延長観測が強まり、欧州の国債利回りが低下した影響で、オーストラリアの債券利回りも低下しました。その後も、豪消費者物価指数（CPI）や豪賃金価格指数が予想を下回ったことなどから、利回りは低下傾向となりました。

社債セクターについては、オーストラリアの株式相場が上昇したことや、鉄鉱石や原油などの資源価格が上昇したことなどを背景に、社債スプレッド（国債に対する上乗せ利回り）は縮小しました。

豪ドル・円相場は、豪ドル高・円安となりました。期の前半は、オーストラリアの債券利回りが上昇し、日本との金利差拡大が意識されたことなどから、豪ドルは対円で上昇しました。その後も、鉄鉱石や原油などの資源価格が上昇したことから、豪ドル高・円安が進行しました。期の半ばにかけては、北朝鮮情勢の緊迫化を受け、投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから、豪ドル売り・円買いが優勢となりました。しかしその後は、豪雇用統計が改善し、豪景気の底堅さが意識される中、豪ドル買い・円売りが優勢となりました。期の後半は、RBA総裁が利上げに慎重な姿勢を示し、利上げ観測が後退したことなどから、豪ドルは対円で下落しました。その後も、豪債券利回りが低下傾向となったことや、CPIや賃金価格指数などのオーストラリアの経済指標が予想を下回ったことなどを受け、豪ドル売り・円買いが優勢となりました。

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

(2017年6月13日～2017年12月11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9期
	2017年6月13日～ 2017年12月11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	2,275

(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

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ファンドです。引き続き、市場環境に注視しながら、組入債券の信用リスク、金利リスク等に配慮しつつ銘柄を厳選し、運用に注力していく所存です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年6月13日～2017年12月11日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 72	% 0.673	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(35)	(0.323)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(35)	(0.328)	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 ）	(1)	(0.008)	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)	(0.017)	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	75	0.703	
期中の平均基準価額は、10,688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

(2017年6月13日～2017年12月11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 74,189	千円 180,152	千口 129,612	千円 314,251

(注) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2017年6月13日～2017年12月11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

(2017年6月13日～2017年12月11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

(2017年6月13日～2017年12月11日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2017年12月11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
LM・豪ドル債券マザーファンド	千口 512,188	千口 456,765	千円 1,103,225

(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

(2017年12月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
LM・豪ドル債券マザーファンド	千円 1,103,225	% 99.1
コール・ローン等、その他	10,362	0.9
投資信託財産総額	1,113,587	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（110,980,766千円）の投資信託財産総額（111,915,446千円）に対する比率は99.2%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11日における邦貨換算レートは1オーストラリアドル=85.41円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年12月11日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,113,587,135
LM・豪ドル債券マザーファンド(評価額)	1,103,225,127
未収入金	10,362,008
(B) 負債	18,331,401
未払解約金	10,362,008
未払信託報酬	7,684,382
その他未払費用	285,011
(C) 純資産総額(A-B)	1,095,255,734
元本	1,031,910,973
次期繰越損益金	63,344,761
(D) 受益権総口数	1,031,910,973口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,614円

<注記事項>

元本の状況

期首元本額

1,149,289,444円

期中追加設定元本額

168,189,979円

期中一部解約元本額

285,568,450円

○損益の状況 (2017年6月13日～2017年12月11日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	40,068,965
売買益	52,603,624
売買損	△ 12,534,659
(B) 信託報酬等	△ 7,969,393
(C) 当期損益金(A+B)	32,099,572
(D) 前期繰越損益金	△ 8,464,498
(E) 追加信託差損益金	39,709,687
(配当等相当額)	(155,892,396)
(売買損益相当額)	(△116,182,709)
(F) 計(C+D+E)	63,344,761
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	63,344,761
追加信託差損益金	39,709,687
(配当等相当額)	(156,157,749)
(売買損益相当額)	(△116,448,062)
分配準備積立金	78,666,009
繰越損益金	△ 55,030,935

(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)	18,393,369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	156,157,749
(D) 分 配 準 備 積 立 金	60,272,640
分 配 対 象 収 益 額(A+B+C+D)	234,823,758
(1万口当たり収益分配対象額)	(2,275)
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29期 決算日 2017年12月11日

(計算期間：2017年6月13日～2017年12月11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29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・オブ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	債券率	債先物比率	債券率	純総資産額
		騰落	期中率					
25期(2015年12月10日)	円		%	%		%		百万円
	23,127		△4.9	95.8		1.2		207,038
26期(2016年6月10日)	21,583		△6.7	96.1		1.7		172,135
27期(2016年12月12日)	23,091		7.0	96.8		0.8		147,221
28期(2017年6月12日)	23,121		0.1	96.4		△3.5		123,870
29期(2017年12月11日)	24,153		4.5	97.3		△1.8		111,319

(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	債券率	債先物比率	債券率
		騰落	期中率				
(期首)	円		%		%		%
2017年6月12日	23,121		—		96.4		△3.5
6月末	23,850		3.2		97.6		△2.5
7月末	24,373		5.4		97.4		0.7
8月末	24,337		5.3		97.7		△2.2
9月末	24,514		6.0		96.6		1.2
10月末	24,350		5.3		97.4		0.4
11月末	24,012		3.9		97.5		△1.1
(期末)							
2017年12月11日	24,153		4.5		97.3		△1.8

(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。



○基準価額の主な変動要因

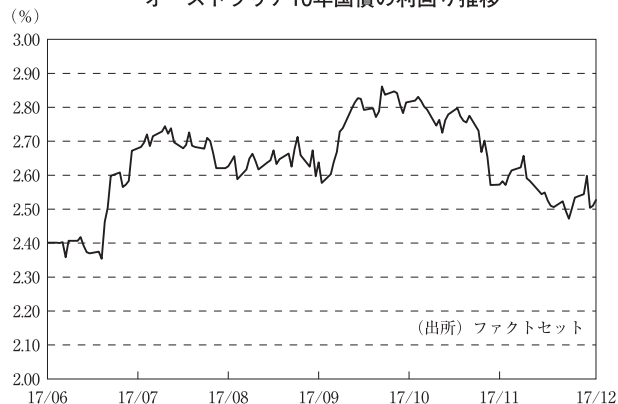
当期末（2017年12月11日）のLM・豪ドル債券マザーファンド（以下、当ファンド）の基準価額は24,153円となりました。当期の当ファンドのパフォーマンス（騰落率）はプラス4.5%、基準価額は1,032円上昇しました。オーストラリア債券市場の金利水準が相対的に高いことから、公社債利金を手堅く確保しました。さらに、豪ドル高・円安を受けて為替損益がプラスとなりました。一方、公社債損益については、利回りの上昇を受けてマイナスとなりました。

オーストラリア債券市場は、利回りが上昇（価格は下落）しました。期の前半は、オーストラリア準備銀行（RBA）議事録の公表を受け、利上げ観測が広がったことから、利回りは上昇しました。欧州中央銀行（ECB）総裁が金融緩和策の縮小に前向きな姿勢を示し、欧州の債券利回りが上昇したことも、豪債券利回りの上昇要因となりました。期の半ばは、2017年4－6月期の豪GDP成長率が予想をやや下回ったことなどを受け、利回りは一時低下（価格は上昇）しましたが、豪雇用統計で雇用者数が前月の水準を上回ると、上昇に向かいました。期の後半は、ECBによる資産買い入れ期間の延長観測が強まり、欧州の国債利回りが低下した影響で、オーストラリアの債券利回りも低下しました。その後も、豪消費者物価指数（CPI）や豪賃金価格指数が予想を下回ったことなどから、利回りは低下傾向となりました。

社債セクターについては、オーストラリアの株式相場が上昇したことや、鉄鉱石や原油などの資源価格が上昇したことなどを背景に、社債スプレッド（国債に対する上乘せ利回り）は縮小しました。

豪ドル・円相場は、豪ドル高・円安となりました。期の前半は、オーストラリアの債券利回りが上昇し、日本との金利差拡大が意識されたことなどから、豪ドルは対円で上昇しました。その後も、鉄鉱石や原油などの資源価格が上昇したことから、豪ドル高・円安が進行しました。期の半ばにかけては、北朝鮮情勢の緊迫化を受け、投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから、豪ドル売り・円買いが優勢となりました。しかしその後は、豪雇用統計が改善し、豪景気の底堅さが意識される中、豪ドル買い・円売りが優勢となりました。期の後半は、RBA総裁が利上げに慎重な姿勢を示し、利上げ観測が後退したことなどから、豪ドルは対円で下落しました。その後も、豪債券利回りが低下傾向となったことや、CPIや賃金価格指数などのオーストラリアの経済指標が予想を下回ったことなどを受け、豪ドル売り・円買いが優勢となりました。

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

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ファンドです。引き続き、市場環境に注視しながら、組入債券の信用リスク、金利リスク等に配慮しつつ銘柄を厳選し、運用に注力していく所存です。

○1万口当たりの費用明細

(2017年6月13日～2017年12月11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、24,239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

(2017年6月13日～2017年12月11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	5,846	35,975
		地方債証券	5,449	43,058
		特殊債証券	2,025	24,948
	社債券(投資法人債券を含む)	38,758	(174)	
			49,803	
			(59,770)	

(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。

その他有価証券

			買付額	売付額
外国	オーストラリア	譲渡性預金証書	千オーストラリアドル 11,981	千オーストラリアドル － (7,000)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) ()内は償還等による増減分です。

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 17,654	百万円 15,652	百万円 23,789	百万円 24,373

(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

(2017年6月13日～2017年12月11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12月11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 1,187,068	千オーストラリアドル 1,268,138	千円 108,311,678	% 97.3	% —	% 41.0	% 41.5	% 14.8
合 計	1,187,068	1,268,138	108,311,678	97.3	—	41.0	41.5	14.8

(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) 金額の単位未満は切捨て。

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	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	AUSTRALIA GOVT	3.25	15,500	16,387	1,399,619	2025/4/21
	AUSTRALIA GOVT	4.25	23,000	26,089	2,228,292	2026/4/21
	AUSTRALIA GOVT	4.75	21,500	25,514	2,179,210	2027/4/21
	AUSTRALIA GOVT	3.25	27,050	28,695	2,450,878	2029/4/21
	AUSTRALIA GOVT	4.5	20,510	24,800	2,118,192	2033/4/21
	AUSTRALIAN GOVT	2.75	12,000	12,222	1,043,922	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVT	2.25	15,800	15,332	1,309,587	2028/5/21
	AUSTRALIAN GOVT	2.75	20,800	20,209	1,726,074	2035/6/21
	AUSTRALIAN GOVT	3.75	13,600	15,048	1,285,283	2037/4/21
	AUSTRALIAN GOVT	3.25	12,500	12,773	1,090,973	2039/6/21
	AUSTRALIAN GOVT	3.0	17,400	16,483	1,407,814	2047/3/21
地方債証券	AUCKLAND COUNCIL	5.843	5,000	5,538	473,034	2022/3/22
	AUST CAPITAL TERRITORY	4.25	2,000	2,099	179,345	2020/5/22
	AUST CAPITAL TERRITORY	4.25	1,900	2,044	174,626	2022/4/11
	BRITISH COLUMBIA PROV OF	4.25	4,500	4,837	413,178	2024/11/27
	NEW S WALES TREAS CORP	6.0	9,000	10,358	884,693	2022/3/1
	NEW S WALES TREAS CORP	5.0	17,500	20,127	1,719,070	2024/8/20
	NEW S WALES TREAS CORP	4.0	6,500	7,118	607,988	2026/5/20
	NEW S WALES TREAS CORP	3.0	1,500	1,506	128,668	2028/3/20
	NORTHERN TERRITORY TREAS	6.0	2,000	2,369	202,365	2024/3/15
	NORTHERN TERRITORY TREAS	3.5	2,000	2,025	172,984	2028/4/21
	ONTARIO PROVINCE	6.25	6,200	6,825	582,946	2020/9/29
	QUEBEC PROVINCE	6.5	4,000	4,513	385,482	2021/7/12
	QUEBEC PROVINCE	4.2	4,000	4,274	365,042	2025/3/10
	QUEENSLAND TREASURY	6.25	2,000	2,181	186,311	2020/2/21
	QUEENSLAND TREASURY	5.5	15,000	16,669	1,423,780	2021/6/21
	QUEENSLAND TREASURY	6.0	16,000	18,531	1,582,736	2022/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	4.25	26,000	28,341	2,420,630	2023/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	3.0	2,000	2,047	174,849	2024/3/22
	QUEENSLAND TREASURY	5.75	17,500	20,785	1,775,300	2024/7/22
	QUEENSLAND TREASURY	3.25	4,500	4,618	394,495	2026/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	2.75	2,500	2,442	208,613	2027/8/20
	QUEENSLAND TREASURY	3.25	2,000	2,024	172,922	2028/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	6.5	2,000	2,748	234,766	2033/3/14
	QUEENSLAND TREASURY CORP	4.75	6,400	7,265	620,560	2025/7/21
	SOUTH AUST GOVT FIN	5.0	6,000	6,558	560,175	2021/5/20
	SOUTH AUST GOVT FIN	4.25	2,000	2,183	186,467	2023/11/20
	SOUTH AUST GOVT FIN	2.75	2,000	1,991	170,114	2025/4/16
	SOUTH AUST GOVT FIN	3.0	5,500	5,516	471,183	2026/7/20
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	6.0	2,000	2,187	186,825	2020/6/15
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	4.0	7,500	8,046	687,272	2024/6/11
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3.25	2,000	2,036	173,940	2026/2/19
TREASURY CORP VICTORIA	5.5	1,000	1,214	103,752	2026/11/17	
VICTORIA TREASURY	6.0	2,500	2,741	234,164	2020/6/15	
VICTORIA TREASURY	6.0	19,500	22,766	1,944,498	2022/10/17	
VICTORIA TREASURY	5.5	9,000	10,674	911,720	2024/12/17	
WEST AUSTRALIA TREASURY	5.0	12,250	14,073	1,202,010	2025/7/23	

銘柄	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	
地方債証券	WESTERN AUST TREAS CORP	2.5	8,000	8,075	689,723	2020/7/22
	WESTERN AUST TREAS CORP	7.0	6,000	6,975	595,755	2021/7/15
	WESTERN AUST TREAS CORP	6.0	11,000	13,033	1,113,169	2023/10/16
	WESTERN AUST TREAS CORP	3.0	3,000	2,964	253,237	2027/10/21
特殊債券 (除く金融債)	AFRICAN DEV BANK	5.25	2,000	2,221	189,777	2022/3/23
	AFRICAN DEV BANK	4.75	6,000	6,670	569,706	2024/3/6
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	6.25	3,500	3,813	325,713	2020/3/5
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	2.75	2,000	2,024	172,876	2022/1/19
	AUSTRALIAN POSTAL CORP	5.0	2,000	2,128	181,759	2020/11/13
	CORP ANDINA DE FOMENTO	6.25	5,000	5,758	491,824	2023/11/8
	CORP ANDINA DE FOMENTO	4.5	8,000	8,329	711,390	2025/6/5
	COUNCIL OF EUROPE	6.0	5,368	5,901	504,076	2020/10/8
	EUROFIMA	5.5	5,000	5,391	460,445	2020/6/30
	EUROPEAN INVT BK	6.5	5,000	5,358	457,673	2019/8/7
	EUROPEAN INVT BK	6.0	6,000	6,584	562,373	2020/8/6
	EUROPEAN INVT BK	6.25	1,500	1,695	144,796	2021/6/8
	EXPORT FIN & INS	6.0	4,000	4,415	377,156	2020/11/12
	FMACB 2013-1E A1	2.72	469	470	40,199	2044/12/10
	INTER-AMERICAN DEVEL BK	3.25	3,000	3,071	262,353	2020/2/7
	INTERAMER DEV BANK	6.0	1,500	1,672	142,836	2021/2/26
	INTL BK RECON & DEVELOP	5.0	7,000	7,723	659,671	2022/3/7
	INTL FIN CORP	5.75	4,500	4,912	419,554	2020/7/28
	KFW	6.25	7,000	7,561	645,813	2019/12/4
	KFW	5.5	8,500	9,518	813,001	2022/2/9
	KFW	5.0	4,000	4,518	385,923	2024/3/19
	KFW	4.0	2,000	2,148	183,465	2025/2/27
	KOMMUNAL BANKEN	6.5	3,000	3,393	289,857	2021/4/12
	KOMMUNAL BANKEN	4.5	5,250	5,685	485,597	2022/7/18
	KOMMUNAL BANKEN	4.5	2,500	2,725	232,772	2023/4/17
	KOMMUNINVEST	3.25	2,000	2,021	172,675	2018/11/25
	KOMMUNINVEST	5.375	3,000	3,302	282,088	2021/11/18
	KOMMUNINVEST	4.75	2,000	2,167	185,155	2022/8/17
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	5.5	6,000	6,433	549,490	2020/3/9
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	5.5	3,500	3,927	335,408	2022/3/29
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.25	2,000	2,156	184,159	2023/1/24
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.75	2,000	2,228	190,300	2024/4/8
LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.25	3,000	3,264	278,806	2025/1/9	
LGFW PROGRAM TRUST	4.31	6,000	6,229	532,020	2021/11/12	
MEDL 2013-2 A3	4.5	4,000	4,050	345,937	2045/10/11	
MEDL 2014-1 A3	4.5	3,500	3,577	305,580	2046/4/22	
NORDIC INV BANK	2.7	4,500	4,554	389,034	2020/2/4	
NORDIC INV BANK	5.0	4,000	4,414	377,047	2022/4/19	
RESI 2013-1 A3	2.825	275	275	23,498	2044/3/7	
普通社債券 (含む投資法人債券)	ABN AMRO BANK NV	4.75	4,500	4,626	395,160	2019/2/5
	ABN AMRO BANK NV	3.25	6,000	6,086	519,875	2020/4/9
	AIRPORT MOTORWAY TRUST	5.5	3,600	3,826	326,828	2020/12/9
	AIRSERVICES AUSTRALIA	4.75	4,300	4,579	391,113	2020/11/19
	AMP WHOLESALE OFFICE FUN	4.75	6,500	6,818	582,379	2021/10/7

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)	2.85	6,500	6,564	560,655	2019/8/28
	APPLE INC	3.7	3,500	3,645	311,382	2022/8/28
	AUST & NZ BANKING GROUP	4.5	5,000	5,107	436,261	2018/11/6
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.75	7,500	7,676	655,673	2019/7/25
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.25	8,000	8,152	696,316	2020/6/3
	AUSTRALIA PACIFIC AIRPOR	4.0	1,600	1,656	141,493	2022/9/15
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	5.0	3,600	3,749	320,276	2019/11/7
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	5.5	5,000	5,465	466,799	2022/11/4
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	3.75	6,000	6,073	518,696	2024/5/22
	AUSTRALIAN RAIL TRACK	7.25	3,500	3,503	299,272	2017/12/20
	BARCLAYS BANK PLC/AUST	4.5	8,300	8,530	728,624	2019/4/4
	BHP BILLITON FINANCE LTD	3.0	6,500	6,578	561,860	2020/3/30
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	5.5	4,000	4,485	383,111	2022/5/23
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	5.25	4,500	5,119	437,242	2024/5/20
	BMW AUSTRALIA FINANCE	2.75	4,500	4,505	384,810	2018/2/23
	BNP PARIBAS/AUSTRALIA	4.75	2,866	2,876	245,705	2018/2/1
	BNP PARIBAS/AUSTRALIA	3.75	5,000	5,138	438,875	2020/5/21
	BP CAPITAL MARKETS PLC	4.75	4,000	4,087	349,084	2018/11/15
	BPCE SA	4.5	4,270	4,303	367,585	2018/4/17
	BPCE SA	3.5	4,600	4,683	400,028	2020/4/24
	BWP TRUST	4.5	1,500	1,537	131,321	2019/5/27
	BWP TRUST	3.5	1,500	1,514	129,361	2022/5/11
	COM BK AUSTRALIA	4.25	2,000	2,055	175,544	2019/4/24
	COM BK AUSTRALIA	3.75	7,000	7,181	613,336	2019/10/18
	COM BK AUSTRALIA	7.25	3,000	3,305	282,309	2020/2/5
	COM BK AUSTRALIA	4.75	6,000	6,590	562,886	2024/5/27
	COMMONWEALTH BANK AUST	2.75	3,000	3,000	256,278	2021/11/17
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	3,000	3,051	260,639	2022/1/17
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	3,000	2,953	252,296	2026/11/17
	COMMONWEALTH BANK FRN	2.48	3,000	3,013	257,400	2018/10/19
	COMMONWEALTH PROP FUND	5.25	7,000	7,323	625,467	2019/12/13
	CREDIT SUISSE SYDNEY	4.0	2,000	2,051	175,242	2019/7/16
	CREDIT SUISSE SYDNEY	3.5	5,000	5,109	436,406	2020/4/29
	CREDIT SUISSE SYDNEY	4.0	4,500	4,673	399,149	2021/3/9
	DEXUS FINANCE PTY LTD	4.25	3,200	3,251	277,712	2027/5/11
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.25	2,000	2,033	173,701	2019/7/1
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.25	5,000	5,174	441,928	2022/6/16
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.75	1,000	1,058	90,369	2025/6/16
	ETSA UTILITIES FINANCE	3.5	3,500	3,504	299,284	2024/8/29
	EXPORT DEVELOPMNT CANADA	3.5	3,200	3,268	279,177	2019/6/5
	EXPORT-IMPORT BANK KOREA	3.7	3,000	3,046	260,175	2021/2/19
	EXPORT-IMPORT BK KOR	4.5	3,000	3,067	262,025	2019/4/17
	EXPORT-IMPORT BK KOR	4.25	3,700	3,806	325,083	2020/5/21
	EXPORT-IMPORT BK KOR	3.5	2,000	2,010	171,701	2022/2/14
	FBG FINANCE PTY LTD	3.75	4,500	4,631	395,544	2020/8/7
	FBG FINANCE PTY LTD	3.25	6,000	6,063	517,851	2022/9/6
	FEDERATION CENTRES LTD	5.75	3,000	3,178	271,475	2019/12/13
	FEDERATION CENTRES LTD	5.0	6,800	7,214	616,152	2021/5/27

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)					
	FONTERRA COOPERATIVE GRO	4.5	6,700	7,066	603,571	2021/6/30
	FONTERRA COOPERATIVE GRO	5.5	4,000	4,483	382,896	2024/2/26
	GE CAP AUSTRALIA FUNDING	5.25	5,000	5,349	456,917	2020/9/4
	GE CAP AUSTRALIA FUNDING	5.5	8,000	8,894	759,657	2022/8/8
	GPT RE LTD	6.75	9,000	9,411	803,872	2019/1/24
	GPT RE LTD	4.5	4,600	4,753	406,031	2020/9/11
	GPT WHL OFFICE FD NO1	4.0	3,000	3,080	263,094	2022/5/18
	GPT WHOLESALE SHOP CENTR	3.993	3,500	3,564	304,429	2024/9/11
	HSBC BANK AUSTRALIA	5.25	5,000	5,481	468,157	2022/9/7
	HSBC HOLDINGS PLC	3.35	3,000	3,001	256,329	2024/2/16
	ICPF FINANCE PTY LTD	4.25	2,500	2,541	217,069	2027/4/21
	ING BANK NV/SYDNEY	5.0	8,000	8,212	701,393	2018/11/27
	JP MORGAN CHASE & CO	4.5	5,000	5,346	456,601	2026/1/30
	KOREA NATIONAL OIL CORP	4.25	3,500	3,576	305,466	2019/10/8
	KOREA SOUTH-EAST POWER	5.75	5,580	5,957	508,795	2020/9/25
	L-BANK BW FOERDERBANK	2.7	4,000	3,973	339,337	2023/6/19
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.75	2,000	2,265	193,492	2026/5/6
	LLOYDS BANK PLC	3.25	6,000	6,092	520,331	2020/4/1
	MACQUARIE BANK LTD	3.0	6,000	6,042	516,083	2018/10/26
	MACQUARIE BANK LTD	3.25	5,300	5,388	460,268	2020/3/3
	MACQUARIE UNIVERSITY	6.75	7,000	7,784	664,897	2020/9/9
	MC FINANCE AUSTRALIA P/L	4.25	2,000	2,097	179,137	2021/12/1
	MET LIFE GLOB FUNDING I	4.0	1,000	1,015	86,743	2027/7/13
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.5	9,500	9,679	826,706	2018/10/10
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.75	2,000	2,132	182,121	2021/9/17
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	4.25	4,000	4,115	351,516	2019/5/20
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	3.0	2,000	2,021	172,654	2021/5/12
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	4.0	1,500	1,569	134,014	2021/12/16
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	4,000	4,452	380,258	2024/3/11
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	5,000	5,524	471,839	2024/6/25
	NATIONAL BK OF ABU DHABI	5.0	2,000	2,010	171,742	2018/3/7
	NATIONAL BK OF ABU DHABI	4.75	5,500	5,628	480,770	2019/3/19
	NATIONAL WEALTH MANAGEME	6.0	4,000	4,473	382,103	2022/8/8
	NED WATERSCHAPBK	5.25	2,000	2,265	193,491	2024/4/18
	NEDER FINANCIERINGS-MAAT	4.75	3,500	3,876	331,097	2024/9/11
	NEW ZEALAND MILK PTY LTD	5.25	2,000	2,178	186,070	2022/5/23
	OPTUS FINANCE PTY LTD	4.75	5,600	5,740	490,282	2018/12/12
	OPTUS FINANCE PTY LTD	4.0	5,000	5,218	445,741	2022/6/17
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	5.0	2,500	2,540	216,994	2018/7/25
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	5.5	1,200	1,253	107,045	2019/11/20
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	3.75	3,200	3,251	277,674	2021/2/24
	RABOBANK NEDERLAND AU	3.25	6,400	6,505	555,610	2020/2/11
	RABOBANK NEDERLAND(AUST)	5.5	5,000	5,622	480,204	2024/4/11
	ROYAL BK CANADA/SYD	3.25	8,000	8,127	694,130	2020/2/10
	SCENTRE GROUP TRUST	6.0	5,000	5,523	471,753	2022/7/4
	SCENTRE MGMT LTD	4.5	9,000	9,389	801,958	2021/9/8
	SGSP AUSTRALIA ASSETS	3.75	1,100	1,120	95,695	2024/9/27
	SPARK FINANCE LTD	4.0	1,500	1,531	130,772	2027/10/20

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)					
	STOCKLAND TRUST MGMT	5.5	3,000	3,143	268,511	2019/9/6
	STOCKLAND TRUST MGMT	4.5	9,000	9,456	807,716	2022/11/23
	SUNCORP-METWAY	3.75	7,000	7,156	611,208	2019/11/5
	SUNCORP-METWAY	3.5	4,000	4,074	347,980	2020/10/20
	SUNCORP-METWAY	3.5	5,000	5,089	434,689	2021/4/12
	SUNCORP-METWAY LTD	3.25	6,500	6,333	540,930	2026/8/24
	SVENSKA HANDELSBANKEN	4.5	4,000	4,118	351,721	2019/4/10
	TELSTRA CORP LTD	4.5	6,500	6,633	566,551	2018/11/13
	TELSTRA CORP LTD	7.75	5,000	5,654	482,972	2020/7/15
	TELSTRA CORP LTD	4.0	2,700	2,834	242,056	2022/9/16
	TELSTRA CORP LTD	4.0	3,000	3,096	264,480	2027/4/19
	TORONTO-DOMINION BANK	3.7	5,000	5,160	440,788	2020/12/22
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	4.25	3,000	3,012	257,329	2018/2/26
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	4.25	2,000	2,055	175,529	2019/5/15
	TRANSPower NEW ZEALAND L	4.25	3,000	3,138	268,029	2021/8/6
	TRANSPower NEW ZEALAND L	5.75	500	568	48,584	2023/8/28
	UBS AG AUSTRALIA	4.0	3,000	3,084	263,471	2019/8/27
	UBS AG AUSTRALIA	2.7	4,000	4,016	343,006	2020/8/10
	UNIV OF SYDNEY	4.75	2,500	2,669	228,036	2021/4/16
	UNIVERSITY OF MELBOURNE	4.25	6,800	7,170	612,435	2021/6/30
	UNIVERSITY OF WOLLONGONG	3.5	2,000	2,007	171,458	2027/12/8
	VICINITY CENTRES	3.5	3,000	2,972	253,916	2024/4/26
	VICINITY HOLDINGS LTD	5.0	6,600	6,890	588,525	2019/12/19
	WELLS FARGO & COMPANY	4.0	3,000	3,079	263,032	2019/8/8
	WELLS FARGO & COMPANY	5.25	6,480	7,086	605,254	2022/9/7
	WELLS FARGO & COMPANY	4.75	3,000	3,248	277,486	2024/8/27
	WELLS FARGO & COMPANY	4.0	1,500	1,551	132,509	2027/4/27
	WESFARMERS LTD	6.25	2,500	2,622	223,964	2019/3/28
	WESFARMERS LTD	4.75	5,000	5,235	447,164	2020/3/12
	WESFARMERS LTD	3.66	5,500	5,636	481,376	2020/11/18
	WESTPAC BANKING	4.5	5,000	5,139	438,947	2019/2/25
	WESTPAC BANKING	3.25	7,000	7,129	608,894	2020/1/22
	WESTPAC BANKING	3.1	3,500	3,547	302,970	2021/6/3
	WESTPAC BANKING	5.25	1,500	1,689	144,295	2023/11/21
合	計				108,311,678	

(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。

外国その他有価証券

区 分	当 期		末
	外貨建金額	邦貨換算金額	比 率
(オーストラリア) 譲渡性預金証書	千オーストラリアドル 4,991	千円 426,281	% 0.4
合 計	4,991	426,281	0.4

(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) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 金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 国	債券先物取引	オーストラリア国債(10年)2017.12限月	百万円 6,656	百万円 —	—
		オーストラリア国債(20年)2017.12限月	—	—	317
		オーストラリア国債(3年)2017.12限月	—	—	8,337

(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

(2017年12月11日現在)

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
公社債	千円 108,311,678	% 96.8	
その他有価証券	426,281	0.4	
コール・ローン等、その他	3,177,487	2.8	
投資信託財産総額	111,915,446	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(110,980,766千円)の投資信託財産総額(111,915,446千円)に対する比率は99.2%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11日における邦貨換算レートは1オーストラリアドル=85.41円です。

○特定資産の価格等の調査

(2017年6月13日～2017年12月11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 (2017年12月11日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	112,701,937,039
コール・ローン等	1,599,886,396
公社債(評価額)	108,311,678,377
其他有価証券	426,281,468
未収入金	1,149,373,238
未収利息	1,131,174,075
前払費用	8,898,270
差入委託証拠金	74,645,215
(B) 負債	1,382,562,370
未払金	1,151,771,591
未払解約金	230,789,730
未払利息	1,049
(C) 純資産総額(A-B)	111,319,374,669
元本	46,089,292,991
次期繰越損益金	65,230,081,678
(D) 受益権総口数	46,089,292,991口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,153円

<注記事項>

元本の状況

期首元本額

53,575,237,743円

期中追加設定元本額

1,087,755,254円

期中一部解約元本額

8,573,700,006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

44,394,389,350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)

1,103,043,516円

LM・オーストラリア債券ファンド(年2回決算型)

456,765,258円

LM・オーストラリア・インカム・アロケーション・ファンド(毎月分配型)

83,370,656円

LM・オーストラリア・インカム・アロケーション・ファンド(年2回決算型)

51,724,211円

○損益の状況 (2017年6月13日～2017年12月11日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,425,074,023
受取利息	2,424,997,279
その他収益金	302,966
支払利息	△ 226,222
(B) 有価証券売買損益	3,061,496,680
売買益	4,017,491,202
売買損	△ 955,994,522
(C) 先物取引等取引損益	70,047,691
取引益	173,965,955
取引損	△ 103,918,264
(D) 保管費用等	△ 4,795,904
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	5,551,822,490
(F) 前期繰越損益金	70,295,652,805
(G) 追加信託差損益金	1,549,170,949
(H) 解約差損益金	△12,166,564,566
(I) 計(E+F+G+H)	65,230,081,678
次期繰越損益金(I)	65,230,081,678

(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。