

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10期 決算日 2018年6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、2018年6月11日に第10期の決算を行いましたので、期中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
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
10期(2018年6月11日)	10,326	0	△2.7	97.9	△0.1	1,054

(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	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	率		
(期首)	円	%	%	%	%
2017年12月11日	10,614	—	98.0	△1.8	
12月末	10,889	2.6	97.4	△1.6	
2018年1月末	10,805	1.8	98.0	△1.0	
2月末	10,342	△2.6	98.1	△1.2	
3月末	10,158	△4.3	97.8	△0.4	
4月末	10,195	△3.9	98.1	0.1	
5月末	10,251	△3.4	98.6	△2.3	
(期末)					
2018年6月11日	10,326	△2.7	97.9	△0.1	

(注1) 騰落率は期首比です。

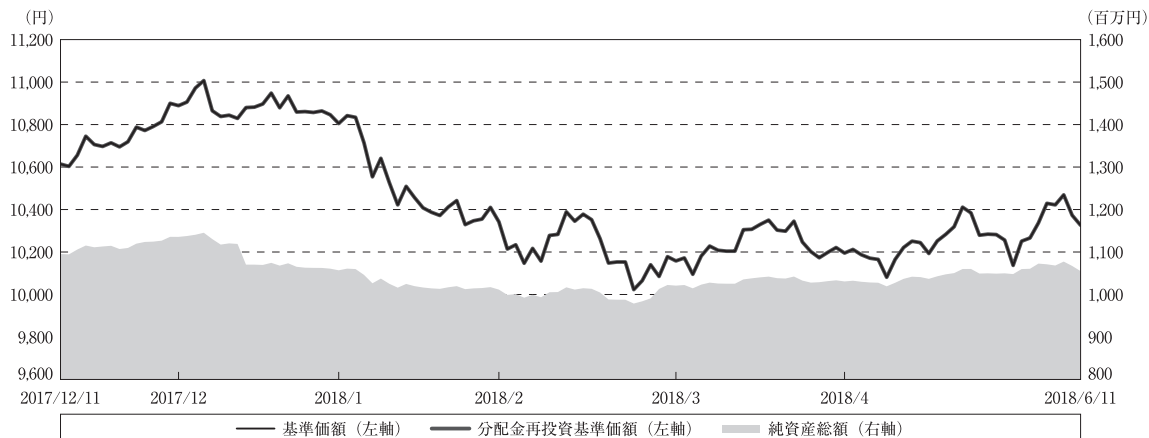
(注2) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(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12月12日～2018年6月11日)



期 首：10,614円

期 末：10,326円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 2.7% (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12月11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

当期末(2018年6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10,326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2.7%、基準価額は288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。しかし、債券利回りの上昇を受けて公社債損益はマイナスとなりました。また、為替損益についても、豪ドル・円相場が豪ドル安・円高となったことを受け、マイナスとなりました。

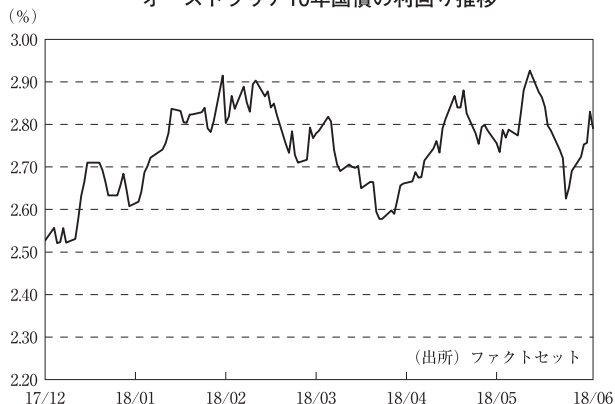
当期のオーストラリア債券市場は、利回りが上昇（価格は下落）しました。期の前半は、2017年12月のオーストラリア準備銀行（RBA）理事会議事録でRBAが2018年の景気加速に自信を強めていると受け止められたことから、利回りは上昇しました。さらに、小売売上高などの豪経済指標が予想を上回ったことなどから、利回りの上昇が続きました。期の半ばにかけては、米国株式相場の急落をきっかけとした世界的な株安を受けて、安全資産としての債券買いが見られたことから、利回りは低下（価格は上昇）に向かいました。その後も、株式相場が世界的に不安定となる中、利回りの低下が続きました。期の後半にかけては、株式相場が回復に向かう中、利回りは上昇傾向となりました。その後、北朝鮮情勢を巡る地政学リスクの再燃や、欧州の政局混乱などを受け、利回りは一時大きく低下しましたが、2018年1－3月期の豪GDP成長率が予想を上回ると、再び上昇する展開となりました。

社債セクターについては、オーストラリアの債券利回りが総じて上昇する中、社債利回りは上昇し、社債スプレッド（国債に対する上乗せ利回り）についても、拡大する展開となりました。

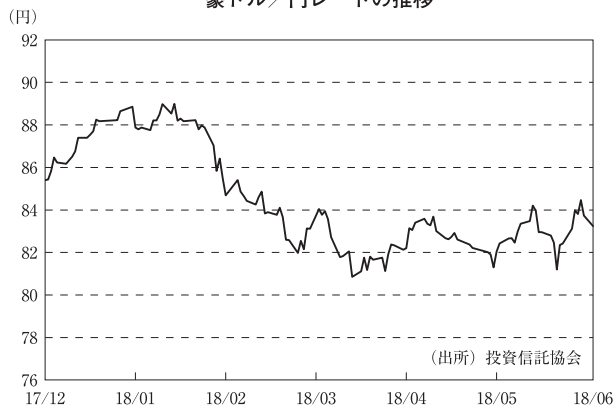
当期の豪ドル・円相場は、豪ドル安・円高となりました。期の前半は、豪雇用統計で雇用者数が予想を上回ったことや、2017年12月のRBA理事会議事録で2018年の景気加速が示唆されたことなどから、豪ドル買い・円売りがやや優勢となりました。期の半ばにかけては、米国をはじめとする世界的な株安を背景に投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、豪ドル売り・円買いが優勢となりました。期の後半にかけては、株式相場が回復に向かう中、豪ドルは対円で上昇に向かいました。

その後、地政学リスクの再燃や、欧州の政局混乱などを受け、豪ドル売り・円買いが優勢となる場面も見られましたが、2018年1－3月期の豪GDP成長率が予想を上回ったことなどに支えられ、豪ドルは底堅く推移しました。

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、モーゲージ証券およ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12月12日～2018年6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10期
	2017年12月12日～ 2018年6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	2,418

(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、モーゲージ証券およ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12月12日～2018年6月11日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 70	% 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 ）	(34)	(0.323)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(34)	(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	0.002	(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
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.002)	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)	(0.009)	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)	(0.016)	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	0.704	
期中の平均基準価額は、10,440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12月12日～2018年6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 53,789	千円 127,533	千口 61,616	千円 149,860

(注) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2017年12月12日～2018年6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12月12日～2018年6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12月12日～2018年6月11日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2018年6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 456,765	千口 448,938	千円 1,062,323

(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

(2018年6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 1,062,323	% 99.3
コール・ローン等、その他	7,658	0.7
投資信託財産総額	1,069,981	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(96,368,772千円)の投資信託財産総額(97,460,142千円)に対する比率は98.9%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、6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=83.24円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年6月11日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,069,981,868
LM・豪ドル債券マザーファンド(評価額)	1,062,323,447
未収入金	7,658,421
(B) 負債	14,989,350
未払解約金	7,658,421
未払信託報酬	7,068,406
その他未払費用	262,523
(C) 純資産総額(A-B)	1,054,992,518
元本	1,021,733,426
次期繰越損益金	33,259,092
(D) 受益権総口数	1,021,733,426口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,326円

<注記事項>

元本の状況

期首元本額

1,031,910,973円

期中追加設定元本額

122,882,747円

期中一部解約元本額

133,060,294円

○損益の状況 (2017年12月12日～2018年6月11日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	△ 19,279,936
売買益	2,812,453
売買損	△ 22,092,389
(B) 信託報酬等	△ 7,330,929
(C) 当期損益金(A+B)	△ 26,610,865
(D) 前期繰越損益金	20,715,860
(E) 追加信託差損益金	39,154,097
(配当等相当額)	(163,558,263)
(売買損益相当額)	(△124,404,166)
(F) 計(C+D+E)	33,259,092
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	33,259,092
追加信託差損益金	39,154,097
(配当等相当額)	(163,750,844)
(売買損益相当額)	(△124,596,747)
分配準備積立金	83,307,298
繰越損益金	△ 89,202,303

(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)	14,357,485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	163,750,844
(D) 分 配 準 備 積 立 金	68,949,813
分 配 対 象 収 益 額(A+B+C+D)	247,058,142
(1万口当たり収益分配対象額)	(2,418)
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30期 決算日 2018年6月11日

(計算期間：2017年12月12日～2018年6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30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"> 1. 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。 2. 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。 3. 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。 4. 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。 5. 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	騰 落 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰	中 率			
26期(2016年6月10日)	円 21,583		% △6.7	% 96.1	% 1.7	百万円 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
30期(2018年6月11日)	23,663		△2.0	97.3	△0.1	97,236

(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	騰 落 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰	中 率			
(期 首) 2017年12月11日	円 24,153		% —	% 97.3	% △1.8	
12月末	24,795		2.7	97.3	△1.6	
2018年1月末	24,636		2.0	97.8	△1.0	
2月末	23,609		△2.3	97.7	△1.2	
3月末	23,216		△3.9	97.4	△0.4	
4月末	23,325		△3.4	97.6	0.1	
5月末	23,484		△2.8	98.0	△2.3	
(期 末) 2018年6月11日	23,663		△2.0	97.3	△0.1	

(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

期中の基準価額等の推移

(2017年12月12日～2018年6月11日)



○基準価額の主な変動要因

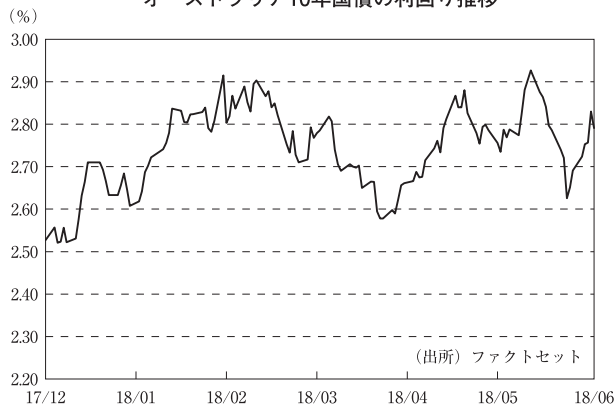
当期末（2018年6月11日）のLM・豪ドル債券マザーファンド（以下、当ファンド）の基準価額は23,663円となりました。当期の当ファンドのパフォーマンス（騰落率）はマイナス2.0%、基準価額は490円下落しました。オーストラリア債券市場の金利水準が相対的に高いことから、公社債利金を手堅く確保しました。しかし、債券利回りの上昇を受けて公社債損益はマイナスとなりました。また、為替損益についても、豪ドル・円相場が豪ドル安・円高となったことを受け、マイナスとなりました。

当期の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、2017年12月のオーストラリア準備銀行（RBA）理事会議事録でRBAが2018年の景気加速に自信を強めていると受け止められたことから、利回りは上昇しました。さらに、小売売上高などの豪経済指標が予想を上回ったことなどから、利回りの上昇が続きました。期の半ばにかけては、米国株式相場の急落をきっかけとした世界的な株安を受けて、安全資産としての債券買いが見られたことから、利回りは低下（価格は上昇）に向かいました。その後も、株式相場が世界的に不安定となる中、利回りの低下が続きました。期の後半にかけては、株式相場が回復に向かう中、利回りは上昇傾向となりました。その後、北朝鮮情勢を巡る地政学リスクの再燃や、欧州の政局混乱などを受け、利回りは一時大きく低下しましたが、2018年1－3月期の豪GDP成長率が予想を上回ると、再び上昇する展開となりました。

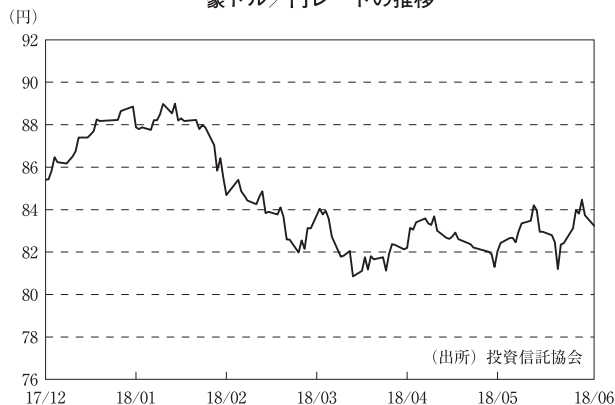
社債セクターについては、オーストラリアの債券利回りが総じて上昇する中、社債利回りは上昇し、社債スプレッド（国債に対する上乗せ利回り）についても、拡大する展開となりました。

当期の豪ドル・円相場は、豪ドル安・円高となりました。期の前半は、豪雇用統計で雇用者数が予想を上回ったことや、2017年12月のRBA理事会議事録で2018年の景気加速が示唆されたことなどから、豪ドル買い・円売りがやや優勢となりました。期の半ばにかけては、米国をはじめとする世界的な株安を背景に投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、豪ドル売り・円買いが優勢となりました。期の後半にかけては、株式相場が回復に向かう中、豪ドルは対円で上昇に向かいました。その後、地政学リスクの再燃や、欧州の政局混乱などを受け、豪ドル売り・円買いが優勢となる場面も見られましたが、2018年1－3月期の豪GDP成長率が予想を上回ったことなどに支えられ、豪ドルは底堅く推移しました。

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、モーゲージ証券およ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、モーゲージ証券およ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12月12日～2018年6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)	% 0.002 (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 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	0.006	
期中の平均基準価額は、23,844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12月12日～2018年6月11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	11,360 32,506
		地方債証券	15,978 42,921
		特殊債券	8,024 53,422
		社債券(投資法人債券を含む)	50,278 (319) 49,725 (20,136)

(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 12,978	千オーストラリアドル － (16,000)

(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 20,426	百万円 20,421	百万円 22,821	百万円 24,740

(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12月12日～2018年6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

(2018年6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 1,082,093	千オーストラリアドル 1,136,137	千円 94,572,089	% 97.3	% —	% 45.1	% 33.8	% 18.4
合 計	1,082,093	1,136,137	94,572,089	97.3	—	45.1	33.8	18.4

(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) 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	AUSTRALIAN GOVT	3.25	1,900	1,973	164,267	2025/4/21
	AUSTRALIAN GOVT	4.25	19,800	21,963	1,828,229	2026/4/21
	AUSTRALIAN GOVT	4.75	20,700	23,938	1,992,607	2027/4/21
	AUSTRALIAN GOVT	2.75	12,000	11,967	996,163	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVT	2.25	20,600	19,635	1,634,493	2028/5/21
	AUSTRALIAN GOVT	3.25	26,050	27,126	2,258,000	2029/4/21
	AUSTRALIAN GOVT	4.5	20,510	24,232	2,017,152	2033/4/21
	AUSTRALIAN GOVT	2.75	17,000	16,224	1,350,552	2035/6/21
	AUSTRALIAN GOVT	3.75	13,600	14,766	1,229,138	2037/4/21
	AUSTRALIAN GOVT	3.25	10,000	10,059	837,327	2039/6/21
	AUSTRALIAN GOVT	3.0	17,580	16,529	1,375,923	2047/3/21
地方債証券	AUCKLAND COUNCIL	5.843	5,000	5,507	458,419	2022/3/22
	AUST CAPITAL TERRITORY	4.25	2,000	2,072	172,536	2020/5/22
	AUST CAPITAL TERRITORY	4.25	1,900	2,015	167,748	2022/4/11
	AUST CAPITAL TERRITORY	3.0	2,000	1,945	161,963	2028/4/18
	BRITISH COLUMBIA PROV OF	4.25	4,500	4,790	398,736	2024/11/27
	NEW S WALES TREAS CORP	6.0	9,000	10,138	843,921	2022/3/1
	NEW S WALES TREAS CORP	5.0	17,500	19,736	1,642,851	2024/8/20
	NEW S WALES TREAS CORP	4.0	6,500	6,974	580,573	2026/5/20
	NEW S WALES TREAS CORP	3.0	1,500	1,476	122,925	2028/3/20
	NORTHERN TERRITORY TREAS	6.0	2,000	2,323	193,418	2024/3/15
	NORTHERN TERRITORY TREAS	3.5	2,000	2,006	167,021	2028/4/21
	NORTHERN TERRITORY TREAS	3.75	2,000	1,966	163,679	2033/4/21
	ONTARIO PROVINCE	6.25	5,200	5,623	468,138	2020/9/29
	QUEBEC PROVINCE	6.5	4,000	4,440	369,642	2021/7/12
	QUEBEC PROVINCE	4.2	4,000	4,221	351,412	2025/3/10
	QUEENSLAND TREASURY	5.5	10,000	10,897	907,066	2021/6/21
	QUEENSLAND TREASURY	6.0	11,500	13,035	1,085,054	2022/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	4.25	21,500	23,065	1,919,947	2023/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	3.0	2,000	2,021	168,236	2024/3/22
	QUEENSLAND TREASURY	5.75	17,500	20,362	1,694,957	2024/7/22
	QUEENSLAND TREASURY	3.25	14,500	14,650	1,219,484	2026/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	2.75	2,500	2,409	200,558	2027/8/20
	QUEENSLAND TREASURY	3.25	2,000	1,996	166,216	2028/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	6.5	2,000	2,693	224,243	2033/3/14
	QUEENSLAND TREASURY CORP	4.75	6,400	7,131	593,595	2025/7/21
	SOUTH AUST GOVT FIN	5.0	6,000	6,442	536,293	2021/5/20
	SOUTH AUST GOVT FIN	4.25	2,000	2,148	178,871	2023/11/20
	SOUTH AUST GOVT FIN	2.75	2,000	1,967	163,798	2025/4/16
	SOUTH AUST GOVT FIN	3.0	5,500	5,436	452,555	2026/7/20
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	4.0	7,500	7,923	659,579	2024/6/11
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3.25	2,000	2,006	167,029	2026/2/19
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3.25	2,000	1,974	164,382	2028/1/24
	TREASURY CORP VICTORIA	5.5	1,000	1,188	98,949	2026/11/17
	VICTORIA TREASURY	6.0	19,500	22,307	1,856,852	2022/10/17
	VICTORIA TREASURY	5.5	9,000	10,470	871,587	2024/12/17
	WESTERN AUST TREAS CORP	7.0	6,000	6,808	566,769	2021/7/15

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					
	WESTERN AUST TREAS CORP	6.0	11,000	12,769	1,062,948	2023/10/16
	WESTERN AUST TREAS CORP	5.0	2,250	2,540	211,457	2025/7/23
	WESTERN AUST TREAS CORP	3.0	3,000	2,937	244,515	2027/10/21
	特殊債券 (除く金融債)					
	AFRICAN DEV BANK	5.25	2,000	2,186	181,965	2022/3/23
	AFRICAN DEV BANK	4.75	5,000	5,456	454,224	2024/3/6
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	2.75	2,000	2,007	167,120	2022/1/19
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	3.4	3,000	3,035	252,654	2027/9/10
	AUSTRALIAN POSTAL CORP	5.0	2,000	2,100	174,877	2020/11/13
	CORP ANDINA DE FOMENTO	6.25	5,000	5,699	474,434	2023/11/8
	CORP ANDINA DE FOMENTO	4.5	8,000	8,199	682,508	2025/6/5
	COUNCIL OF EUROP	6.0	2,368	2,552	212,485	2020/10/8
	EUROFIMA	5.5	5,000	5,300	441,205	2020/6/30
	EUROPEAN INVT BK	6.0	6,000	6,450	536,917	2020/8/6
	EUROPEAN INVT BK	6.25	500	552	46,031	2021/6/8
	EXPORT FIN & INS	6.0	4,000	4,329	360,412	2020/11/12
	FMACB 2013-1E A1	2.945	425	423	35,237	2044/12/10
	INTERAMER DEV BANK	3.25	1,000	1,015	84,515	2020/2/7
	INTL BK RECON & DEVELOP	5.0	4,000	4,337	361,035	2022/3/7
	INTL FIN CORP	5.75	2,000	2,141	178,225	2020/7/28
	KFW	5.5	6,500	7,143	594,646	2022/2/9
	KFW	5.0	4,000	4,438	369,492	2024/3/19
	KFW	4.0	2,000	2,114	176,007	2025/2/27
	KFW	3.2	5,000	4,994	415,717	2026/9/11
	KOMMUNAL BANKEN	6.5	3,000	3,323	276,607	2021/4/12
	KOMMUNAL BANKEN	4.5	3,250	3,467	288,631	2022/7/18
	KOMMUNAL BANKEN	4.5	2,500	2,679	223,041	2023/4/17
	KOMMUNINVEST	5.375	3,000	3,247	270,301	2021/11/18
	KOMMUNINVEST	4.75	2,000	2,136	177,800	2022/8/17
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.25	2,000	2,124	176,821	2023/1/24
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.75	2,000	2,190	182,340	2024/4/8
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.25	2,000	2,140	178,168	2025/1/9
	LGFV PROGRAM TRUST	4.31	6,000	6,146	511,611	2021/11/12
	MEDL 2013-2 A3	4.5	4,000	4,011	333,892	2045/10/11
	MEDL 2014-1 A3	4.5	3,500	3,537	294,445	2046/4/22
	NORDIC INV BANK	2.7	500	503	41,905	2020/2/4
	NORDIC INV BANK	5.0	4,000	4,339	361,181	2022/4/19
	普通社債券 (含む投資法人債券)					
	ABN AMRO BANK NV	4.75	4,500	4,564	379,910	2019/2/5
	ABN AMRO BANK NV	3.25	6,000	6,052	503,805	2020/4/9
	AIRPORT MOTORWAY TRUST	5.5	3,600	3,797	316,124	2020/12/9
	AIRSERVICES AUSTRALIA	4.75	4,300	4,510	375,449	2020/11/19
	AMP BANK LIMITED FRN	2.745	3,500	3,490	290,550	2020/4/9
	AMP WHOLESALE OFFICE FUN	4.75	6,500	6,739	561,008	2021/10/7
	APPLE INC	2.85	6,500	6,530	543,586	2019/8/28
	APPLE INC	3.7	3,500	3,598	299,573	2022/8/28
	AUSNET SERVICES HOLDINGS	4.2	2,000	1,996	166,225	2028/8/21
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.75	4,500	4,563	379,854	2019/7/25
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.25	8,000	8,087	673,171	2020/6/3
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.35	1,500	1,499	124,815	2023/5/9

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	
		%	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						
	普通社債券 (含む投資法人債類)					
	AUSTRALIA PACIFIC AIRPOR	4.0	1,600	1,646	137,064	2022/9/15
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	5.0	3,600	3,706	308,537	2019/11/7
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	5.5	5,000	5,361	446,253	2022/11/4
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	3.75	6,000	5,971	497,037	2024/5/22
	BARCLAYS BANK PLC/AUST	4.5	5,300	5,384	448,186	2019/4/4
	BHP BILLITON FINANCE LTD	3.0	6,500	6,547	544,977	2020/3/30
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	5.5	4,000	4,411	367,171	2022/5/23
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	5.25	4,500	5,038	419,387	2024/5/20
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	3.5	2,000	2,022	168,317	2027/7/19
	BNP PARIBAS/AUSTRALIA	3.75	5,000	5,092	423,908	2020/5/21
	BP CAPITAL MARKETS PLC	4.75	4,000	4,034	335,830	2018/11/15
	BPCE SA	3.5	4,600	4,648	386,962	2020/4/24
	BWP TRUST	4.5	1,500	1,523	126,796	2019/5/27
	BWP TRUST	3.5	1,500	1,499	124,856	2022/5/11
	COM BK AUSTRALIA	4.25	2,000	2,031	169,095	2019/4/24
	COM BK AUSTRALIA	3.75	5,000	5,079	422,846	2019/10/18
	COM BK AUSTRALIA	7.25	3,000	3,224	268,414	2020/2/5
	COM BK AUSTRALIA	4.75	6,000	6,461	537,836	2024/5/27
	COMMONWEALTH BANK AUST	2.75	3,000	2,982	248,271	2021/11/17
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	3,000	3,019	251,328	2022/1/17
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	4,000	3,985	331,738	2023/4/25
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	3,000	2,890	240,635	2026/11/17
	COMMONWEALTH PROP FUND	5.25	7,000	7,241	602,817	2019/12/13
	CREDIT SUISSE SYDNEY	4.0	2,000	2,030	169,023	2019/7/16
	CREDIT SUISSE SYDNEY	3.5	5,000	5,066	421,731	2020/4/29
	CREDIT SUISSE SYDNEY	4.0	4,500	4,617	384,345	2021/3/9
	DEXUS FINANCE PTY LTD	4.25	3,200	3,180	264,756	2027/5/11
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.25	2,000	2,015	167,768	2019/7/1
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.25	5,000	5,125	426,667	2022/6/16
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.75	1,000	1,035	86,227	2025/6/16
	ETSA UTILITIES FINANCE	3.5	3,500	3,456	287,715	2024/8/29
	EXPORT-IMPORT BANK KOREA	3.7	3,000	3,027	252,024	2021/2/19
	EXPORT-IMPORT BK KOR	4.5	3,000	3,039	252,991	2019/4/17
	EXPORT-IMPORT BK KOR	4.25	3,700	3,776	314,369	2020/5/21
	EXPORT-IMPORT BK KOR	3.5	2,000	1,995	166,115	2022/2/14
	FBG FINANCE PTY LTD	3.75	4,500	4,591	382,228	2020/8/7
	FBG FINANCE PTY LTD	3.25	6,000	6,005	499,929	2022/9/6
	FEDERATION CENTRES LTD	5.75	1,000	1,043	86,846	2019/12/13
	FEDERATION CENTRES LTD	5.0	6,800	7,121	592,827	2021/5/27
	FONTERRA COOPERATIVE GRO	4.5	6,700	6,992	582,029	2021/6/30
	FONTERRA COOPERATIVE GRO	5.5	4,000	4,405	366,685	2024/2/26
	GE CAP AUSTRALIA FUNDING	5.25	5,000	5,256	437,521	2020/9/4
	GE CAP AUSTRALIA FUNDING	5.5	8,000	8,689	723,342	2022/8/8
	GPT RE LTD	6.75	9,000	9,216	767,147	2019/1/24
	GPT RE LTD	4.5	4,600	4,709	392,024	2020/9/11
	GPT WHL OFFICE FD NO1	4.0	3,000	3,057	254,517	2022/5/18
	GPT WHOLESALE SHOP CENTR	3.993	3,500	3,494	290,862	2024/9/11
	GPT WHOLESALE SHOP CENTR	4.49	3,000	2,982	248,289	2028/2/28

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)	HSBC BANK AUSTRALIA	5.25	5,000	5,352	445,533	2022/9/7
	HSBC HOLDINGS PLC	3.35	3,000	2,961	246,511	2024/2/16
	ICPF FINANCE PTY LTD	4.25	2,500	2,509	208,917	2027/4/21
	ING BANK NV/SYDNEY	5.0	6,000	6,066	505,008	2018/11/27
	JP MORGAN CHASE & CO	4.5	4,000	4,191	348,872	2026/1/30
	KOREA NATIONAL OIL CORP	4.25	3,500	3,550	295,526	2019/10/8
	KOREA SOUTH-EAST POWER	5.75	5,580	5,869	488,585	2020/9/25
	L-BANK BW FOERDERBANK	2.7	4,000	3,954	329,147	2023/6/19
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.75	7,500	8,323	692,848	2026/5/6
	LLOYDS BANK PLC	3.25	6,000	6,054	503,959	2020/4/1
	MACQUARIE BANK LTD	3.0	4,000	4,007	333,619	2018/10/26
	MACQUARIE BANK LTD	3.25	5,300	5,350	445,336	2020/3/3
	MACQUARIE UNIVERSITY	6.75	7,000	7,619	634,264	2020/9/9
	MC FINANCE AUSTRALIA P/L	4.25	2,000	2,069	172,285	2021/12/1
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.5	7,500	7,548	628,314	2018/10/10
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.75	2,000	2,098	174,682	2021/9/17
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.0	3,000	2,974	247,572	2027/7/13
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	4.25	2,000	2,033	169,300	2019/5/20
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	3.0	2,000	2,003	166,761	2021/5/12
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	4.0	1,500	1,547	128,839	2021/12/16
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	3.0	3,500	3,470	288,910	2023/3/16
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	4,000	4,354	362,480	2024/3/11
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	5,000	5,415	450,777	2024/6/25
	NATIONAL BK OF ABU DHABI	4.75	5,500	5,576	464,160	2019/3/19
	NATIONAL WEALTH MANAGEME	6.0	4,000	4,375	364,244	2022/8/8
	NED WATERSCHAPBK	5.25	2,000	2,230	185,655	2024/4/18
	NEDER FINANCIERINGS-MAAT	4.75	3,500	3,815	317,592	2024/9/11
	NEW ZEALAND MILK PTY LTD	5.25	2,000	2,150	178,980	2022/5/23
	NISSAN FIN SERVICES AU	3.0	1,700	1,698	141,400	2021/3/22
	OPTUS FINANCE PTY LTD	4.75	5,600	5,662	471,332	2018/12/12
	OPTUS FINANCE PTY LTD	4.0	5,000	5,174	430,696	2022/6/17
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	5.0	2,500	2,506	208,674	2018/7/25
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	5.5	1,200	1,235	102,841	2019/11/20
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	3.75	3,200	3,225	268,528	2021/2/24
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	3.75	3,500	3,476	289,361	2023/12/6
	RABOBANK NEDERLAND AU	3.25	4,400	4,442	369,794	2020/2/11
	RABOBANK NEDERLAND(AUST)	5.5	5,000	5,500	457,890	2024/4/11
	ROYAL BK CANADA/SYD	3.25	6,000	6,055	504,074	2020/2/10
	SCENTRE GROUP TRUST	6.0	5,000	5,432	452,238	2022/7/4
	SCENTRE MGMT LTD	4.5	9,000	9,318	775,672	2021/9/8
	SGSP AUSTRALIA ASSETS	3.75	1,100	1,102	91,768	2024/9/27
	SPARK FINANCE LTD	4.0	1,500	1,490	124,075	2027/10/20
	STOCKLAND TRUST MGMNT	5.5	3,000	3,097	257,818	2019/9/6
	STOCKLAND TRUST MGMNT	4.5	9,000	9,353	778,624	2022/11/23
	SUNCORP-METWAY	3.75	7,000	7,095	590,633	2019/11/5
	SUNCORP-METWAY	3.5	4,000	4,041	336,426	2020/10/20
	SUNCORP-METWAY	3.5	5,000	5,045	419,995	2021/4/12
	SUNCORP-METWAY LTD	3.25	6,500	6,206	516,636	2026/8/24

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)					
	SVENSKA HANDELSBANKEN	4.5	4,000	4,066	338,510	2019/4/10
	TELSTRA CORP LTD	7.75	4,000	4,403	366,549	2020/7/15
	TELSTRA CORP LTD	4.0	6,700	6,897	574,121	2022/9/16
	TELSTRA CORP LTD	4.0	3,000	2,983	248,351	2027/4/19
	TORONTO-DOMINION BANK	3.7	5,000	5,104	424,931	2020/12/22
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	4.25	2,000	2,031	169,127	2019/5/15
	TRANSPower NEW ZEALAND L	4.25	3,000	3,104	258,392	2021/8/6
	TRANSPower NEW ZEALAND L	5.75	500	559	46,564	2023/8/28
	UBS AG AUSTRALIA	4.0	3,000	3,051	254,012	2019/8/27
	UBS AG AUSTRALIA	2.7	4,000	3,989	332,054	2020/8/10
	UBS AG AUSTRALIA	3.25	3,000	2,982	248,299	2023/3/8
	UNITED ENERGY DISTRIBUTI	3.85	2,400	2,409	200,527	2024/10/23
	UNIV OF SYDNEY	4.75	2,500	2,633	219,252	2021/4/16
	UNIVERSITY OF MELBOURNE	4.25	6,800	7,083	589,607	2021/6/30
	UNIVERSITY OF WOLLONGONG	3.5	2,000	1,974	164,320	2027/12/8
	VICINITY CENTRES	3.5	3,000	2,942	244,942	2024/4/26
	VICINITY HOLDINGS LTD	5.0	5,600	5,780	481,186	2019/12/19
	VICTORIA POWER NETWORKS	4.0	2,000	1,975	164,408	2027/8/18
	WELLS FARGO & COMPANY	4.0	3,000	3,047	253,693	2019/8/8
	WELLS FARGO & COMPANY	5.25	5,480	5,879	489,422	2022/9/7
	WELLS FARGO & COMPANY	4.75	3,000	3,183	264,997	2024/8/27
	WELLS FARGO & COMPANY	4.0	1,500	1,507	125,491	2027/4/27
	WESFARMERS LTD	6.25	2,500	2,571	214,062	2019/3/28
	WESFARMERS LTD	4.75	5,000	5,171	430,467	2020/3/12
	WESFARMERS LTD	3.66	5,500	5,588	465,204	2020/11/18
	WESTPAC BANKING	3.25	7,000	7,074	588,856	2020/1/22
	WESTPAC BANKING	3.1	3,500	3,515	292,639	2021/6/3
	WESTPAC BANKING	3.2	3,000	2,984	248,421	2023/3/6
	WESTPAC BANKING	5.25	1,500	1,653	137,636	2023/11/21
	ZURICH FIN AUSTRALIA LTD	3.477	3,000	3,006	250,264	2023/5/31
合	計				94,572,089	

(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)	千オーストラリアドル	千円	%
譲渡性預金証書	1,996	166,222	0.2
合 計	1,996	166,222	0.2

(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	
			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)2018.6限月	百万円 4,238	百万円 —
		オーストラリア国債(10年)2018.9限月	2,181	—
		オーストラリア国債(20年)2018.6限月	—	197
		オーストラリア国債(3年)2018.6限月	—	4,136
		オーストラリア国債(3年)2018.9限月	—	2,216

(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

(2018年6月11日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	94,572,089	97.0
その他有価証券	166,222	0.2
コール・ローン等、その他	2,721,831	2.8
投資信託財産総額	97,460,142	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(96,368,772千円)の投資信託財産総額(97,460,142千円)に対する比率は98.9%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、6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=83.24円です。

○特定資産の価格等の調査

(2017年12月12日～2018年6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 (2018年6月11日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	97,701,990,037
コール・ローン等	1,358,892,095
公社債(評価額)	94,572,089,342
その他有価証券	166,222,195
未収入金	533,804,301
未収利息	944,074,980
前払費用	19,791,209
差入委託証拠金	107,115,915
(B) 負債	465,400,258
未払金	249,660,000
未払解約金	215,737,147
未払利息	3,111
(C) 純資産総額(A-B)	97,236,589,779
元本	41,092,404,195
次期繰越損益金	56,144,185,584
(D) 受益権総口数	41,092,404,195口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,663円

<注記事項>

元本の状況

期首元本額

46,089,292,991円

期中追加設定元本額

953,854,283円

期中一部解約元本額

5,950,743,079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

39,480,921,042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)

1,014,036,389円

LM・オーストラリア債券ファンド(年2回決算型)

448,938,616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)

89,541,294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)

58,966,854円

○損益の状況 (2017年12月12日～2018年6月11日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,082,326,129
受取利息	2,082,259,447
その他収益金	326,729
支払利息	△ 260,047
(B) 有価証券売買損益	△ 4,125,521,624
売買益	132,242,294
売買損	△ 4,257,763,918
(C) 先物取引等取引損益	△ 43,231,393
取引益	98,591,402
取引損	△ 141,822,795
(D) 保管費用等	△ 4,115,082
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 2,090,541,970
(F) 前期繰越損益金	65,230,081,678
(G) 追加信託差損益金	1,318,618,869
(H) 解約差損益金	△ 8,313,972,993
(I) 計(E+F+G+H)	56,144,185,584
次期繰越損益金(I)	56,144,185,584

(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。