

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11期 決算日 2018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：

レッグ・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12月10日に第11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。

レッグ・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
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
11期(2018年12月10日)	10,282	0	△0.4	98.0	0.5	1,098

(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およ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) 2018年6月11日	円	円	%	%	%
6月末	10,326	10,148	－	97.9	△0.1
7月末	10,148	10,278	△1.7	97.8	△2.0
8月末	10,278	10,148	△0.5	97.6	△1.3
9月末	10,148	10,254	△1.7	98.3	△1.5
10月末	10,254	10,111	△0.7	97.9	0.5
11月末	10,111	10,470	△2.1	98.0	0.7
(期末) 2018年12月10日	10,470	10,282	1.4	98.3	0.3
	10,282		△0.4	98.0	0.5

(注1) 騰落率は期首比です。

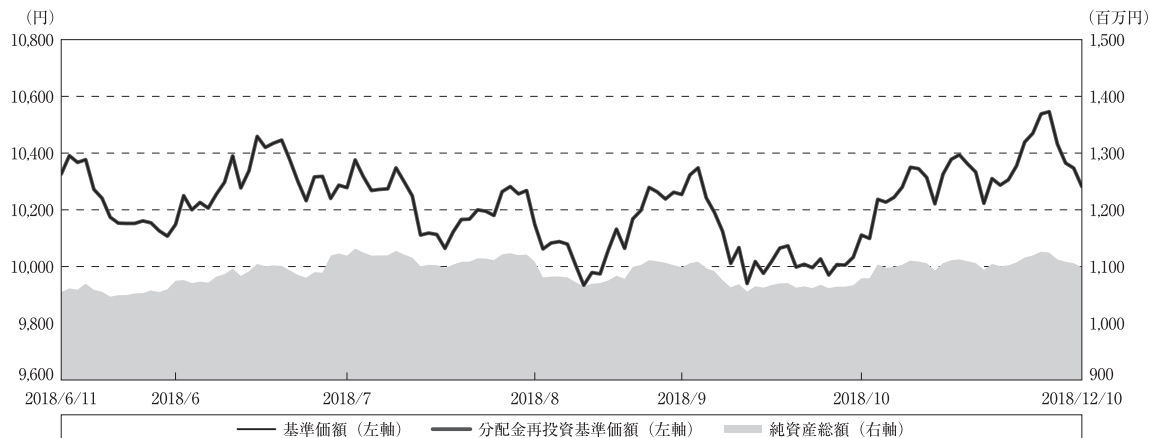
(注2) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(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

(2018年6月12日～2018年12月10日)



期 首：10,326円

期 末：10,282円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 0.4% (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(2018年6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

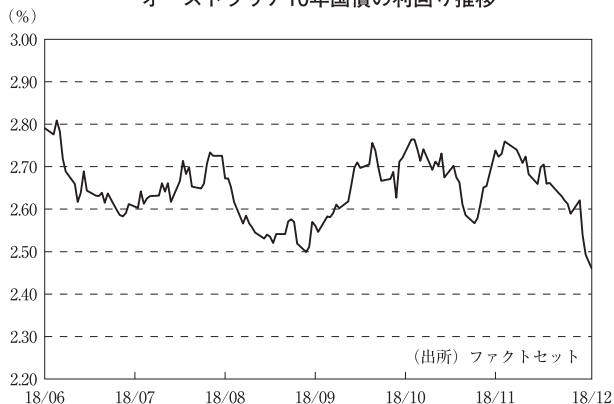
当期末(2018年12月10日)のLM・オーストラリア債券ファンド(年2回決算型)(以下、当ファンド)の基準価額は10,282円となりました。当期の当ファンドのパフォーマンス(騰落率)はマイナス0.4%、基準価額は44円下落しました。オーストラリア債券市場の金利水準が相対的に高いことから、公社債利金を手堅く確保しました。公社債損益についても、債券利回りの低下を受けてプラスとなりました。一方、為替損益は豪ドル・円相場が豪ドル安・円高となったことを受けてマイナスとなりました。

当期のオーストラリア債券市場は、利回りが低下（価格は上昇）しました。期の前半は、オーストラリア準備銀行（RBA）総裁が政策金利を当面据え置くことを示唆したことなどから、利回りは低下しました。その後、良好な豪経済指標を受けて利回りは上昇しましたが、上昇幅は限定的でした。期の半ばは、米中貿易摩擦の拡大懸念やトルコ情勢の悪化を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり、安全資産としての債券買いが意識されたことなどから、利回りは低下しました。しかし、米国10年国債利回りが節目とされる3%を上回ると、オーストラリアの債券利回りも上昇（価格は下落）に転じました。期の後半は、世界的な株安などを背景に債券利回りが世界的に低下する中、オーストラリアの債券利回りも低下しました。また、原油価格が下落基調で推移し、物価上昇への警戒感が和らいだことも、利回りの低下要因となりました。

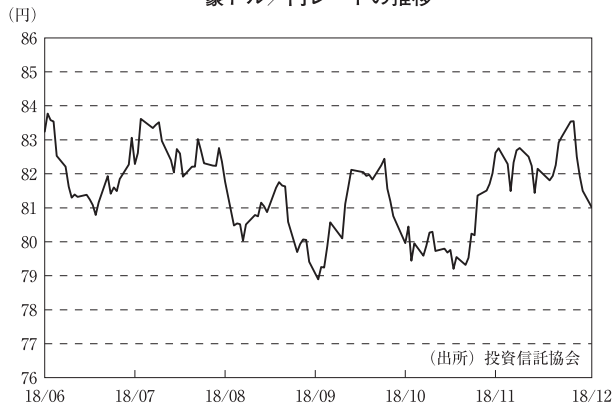
社債セクターについては、国債利回りが総じて低下する中、社債利回りも低下しました。社債スプレッド（国債に対する上乗せ利回り）については、世界的な株安が進行する局面などにおいて拡大しました。

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、RBAが当面、金融緩和姿勢を維持するとの見方が広がったことなどから、豪ドルは対円で下落しましたが、国内景気の堅調さが意識されると再び上昇しました。期の半ばは、米中貿易摩擦懸念の広がりやトルコ情勢の悪化を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから、豪ドルは対円で下落しました。しかしその後は、好調な国内景気などを背景に、豪ドル買い・円売りが優勢となりました。期の後半は、豪貿易収支の黒字幅が市場予想を大きく上回ったことが好感され、豪ドルは対円で一時上昇しましたが、世界的な株安を背景に上値の重い展開となりました。オーストラリアの主要産出品である鉄鉱石の価格が下落基調となったことも、豪ドルの上値を抑える要因となりました。

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

(2018年6月12日～2018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11期
	2018年6月12日～ 2018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	2,555

(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

(2018年6月12日～2018年12月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 69	% 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 ）	(33)	(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	0.001	(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)	(0.007)	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)	(0.018)	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	72	0.703	
期中の平均基準価額は、10,234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

(2018年6月12日～2018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 72,777	千円 170,595	千口 55,476	千円 130,266

(注) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2018年6月12日～2018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

(2018年6月12日～2018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

(2018年6月12日～2018年12月10日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2018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
LM・豪ドル債券マザーファンド	千口 448,938	千口 466,239	千円 1,106,198

(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12月10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 1,106,198	% 99.9
コール・ローン等、その他	799	0.1
投資信託財産総額	1,106,997	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(85,442,530千円)の投資信託財産総額(86,216,014千円)に対する比率は99.1%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=81.01円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年12月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,106,997,251
LM・豪ドル債券マザーファンド(評価額)	1,106,198,917
未収入金	798,334
(B) 負債	8,419,734
未払解約金	798,334
未払信託報酬	7,350,073
その他未払費用	271,327
(C) 純資産総額(A-B)	1,098,577,517
元本	1,068,486,343
次期繰越損益金	30,091,174
(D) 受益権総口数	1,068,486,343口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,282円

<注記事項>

元本の状況

期首元本額

1,021,733,426円

期中追加設定元本額

167,180,608円

期中一部解約元本額

120,427,691円

○損益の状況 (2018年6月12日～2018年12月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	4,840,091
売買益	6,832,038
売買損	△ 1,991,947
(B) 信託報酬等	△ 7,621,400
(C) 当期損益金(A+B)	△ 2,781,309
(D) 前期繰越損益金	△ 5,268,365
(E) 追加信託差損益金	38,140,848
(配当等相当額)	(183,910,875)
(売買損益相当額)	(△145,770,027)
(F) 計(C+D+E)	30,091,174
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	30,091,174
追加信託差損益金	38,140,848
(配当等相当額)	(184,182,418)
(売買損益相当額)	(△146,041,570)
分配準備積立金	88,832,738
繰越損益金	△ 96,882,412

(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)	14,380,966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	184,182,418
(D) 分 配 準 備 積 立 金	74,451,772
分 配 対 象 収 益 額(A+B+C+D)	273,015,156
(1万口当たり収益分配対象額)	(2,555)
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31期 決算日 2018年12月10日

(計算期間：2018年6月12日～2018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31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	債券率	債先物比率	純総資産額
		期騰	中率				
27期(2016年12月12日)	円 23,091		% 7.0	% 96.8	% 0.8	百万円 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	
31期(2018年12月10日)	23,726		0.3	97.3	0.5	86,022	

(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およ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	債券率	債先物比率
		騰	落率			
(期首) 2018年6月11日	円 23,663		% -	% 97.3	% 0.1	
6月末	23,272		△1.7	97.7	△2.0	
7月末	23,600		△0.3	97.4	△1.3	
8月末	23,330		△1.4	98.0	△1.5	
9月末	23,597		△0.3	97.5	0.5	
10月末	23,298		△1.5	97.5	0.7	
11月末	24,148		2.0	97.7	0.3	
(期末) 2018年12月10日	23,726		0.3	97.3	0.5	

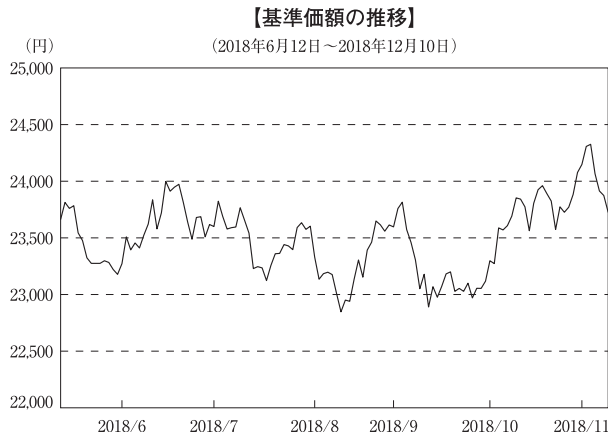
(注1) 騰落率は期首比です。

(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

(2018年6月12日～2018年12月10日)



○基準価額の主な変動要因

当期末（2018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23,726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0.3%、基準価額は63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。公社債損益についても、債券利回りの低下を受けてプラスとなりました。一方、為替損益は豪ドル・円相場が豪ドル安・円高となったことを受けて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、利回りが低下（価格は上昇）しました。期の前半は、オーストラリア準備銀行（RBA）総裁が政策金利を当面据え置くことを示唆したことなどから、利回りは低下しました。その後、良好な豪経済指標を受けて利回りは上昇しましたが、上昇幅は限定的でした。期の半ばは、米中貿易摩擦の拡大懸念やトルコ情勢の悪化を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり、安全資産としての債券買いが意識されたことなどから、利回りは低下しました。しかし、米国10年国債利回りが節目とされる3%を上回ると、オーストラリアの債券利回りも上昇（価格は下落）に転じました。期の後半は、世界的な株安などを背景に債券利回りが世界的に低下する中、オーストラリアの債券利回りも低下しました。また、原油価格が下落基調で推移し、物価上昇への警戒感が和らいだことも、利回りの低下要因となりました。

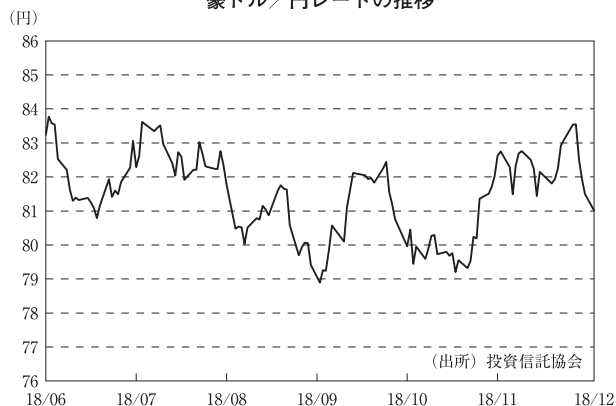
社債セクターについては、国債利回りが総じて低下する中、社債利回りも低下しました。社債スプレッド（国債に対する上乗せ利回り）については、世界的な株安が進行する局面などにおいて拡大しました。

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、RBAが当面、金融緩和姿勢を維持するとの見方が広がったことなどから、豪ドルは対円で下落しましたが、国内景気の堅調さが意識されると再び上昇しました。期の半ばは、米中貿易摩擦懸念の広がりやトルコ情勢の悪化を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから、豪ドルは対円で下落しました。しかしその後は、好調な国内景気などを背景に、豪ドル買い・円売りが優勢となりました。期の後半は、豪貿易収支の黒字幅が市場予想を大きく上回ったことが好感され、豪ドルは対円で一時上昇しましたが、世界的な株安を背景に上値の重い展開となりました。オーストラリアの主要産出品である鉄鉱石の価格が下落基調となったことも、豪ドルの上値を抑える要因となりました。

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

(2018年6月12日～2018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、23,540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

(2018年6月12日～2018年12月10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	7,231	28,882
		地方債証券	22,957	40,128
		特殊債券	—	16,962 (4,043)
	社債券(投資法人債券を含む)	32,745	63,399 (21,000)	

(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 3,992	千オーストラリアドル － (6,000)

(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 15,343	百万円 14,459	百万円 15,091	百万円 14,610

(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

(2018年6月12日～2018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

(2018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 978,789	千オーストラリアドル 1,033,250	千円 83,703,645	% 97.3	% —	% 44.0	% 32.2	% 21.1
合 計	978,789	1,033,250	83,703,645	97.3	—	44.0	32.2	21.1

(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	銘柄	当期末					
		利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVT	4.25	17,600	19,891	1,611,383	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	4.75	16,700	19,696	1,595,638	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	12,000	12,313	997,540	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.25	18,600	18,293	1,481,924	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.25	18,850	20,219	1,638,008	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.5	2,520	2,521	204,230	2030/5/21
		AUSTRALIAN GOVT	4.5	18,710	22,904	1,855,516	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	16,000	16,019	1,297,728	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.75	10,300	11,704	948,182	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.25	9,500	10,061	815,093	2039/6/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	3,000	2,914	236,093	2041/5/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.0	16,580	16,638	1,347,887	2047/3/21
	地方債証券	AUCKLAND COUNCIL	5.843	5,000	5,490	444,785	2022/3/22
		AUST CAPITAL TERRITORY	4.25	1,900	2,019	163,575	2022/4/11
		AUST CAPITAL TERRITORY	3.0	2,000	1,999	162,016	2028/4/18
		BRITISH COLUMBIA PROV OF	4.25	4,500	4,859	393,661	2024/11/27
		NEW S WALES TREAS CORP	6.0	8,000	8,945	724,708	2022/3/1
		NEW S WALES TREAS CORP	5.0	17,500	19,835	1,606,835	2024/8/20
		NEW S WALES TREAS CORP	4.0	7,500	8,165	661,503	2026/5/20
		NEW S WALES TREAS CORP	3.0	1,500	1,513	122,604	2028/3/20
		NEW S WALES TREASURY	3.0	640	636	51,539	2030/2/20
		NORTHERN TERRITORY TREAS	6.0	2,000	2,321	188,035	2024/3/15
		NORTHERN TERRITORY TREAS	3.5	2,000	2,050	166,102	2028/4/21
		NORTHERN TERRITORY TREAS	3.75	2,000	2,067	167,452	2033/4/21
		ONTARIO PROVINCE	6.25	1,200	1,282	103,915	2020/9/29
		QUEBEC PROVINCE	6.5	3,000	3,299	267,308	2021/7/12
		QUEBEC PROVINCE	4.2	3,000	3,212	260,246	2025/3/10
		QUEENSLAND TREASURY	5.5	2,000	2,162	175,190	2021/6/21
		QUEENSLAND TREASURY	6.0	11,500	12,977	1,051,308	2022/7/21
		QUEENSLAND TREASURY	4.25	19,500	21,042	1,704,648	2023/7/21
		QUEENSLAND TREASURY	3.0	1,000	1,023	82,919	2024/3/22
		QUEENSLAND TREASURY	5.75	17,500	20,427	1,654,795	2024/7/22
		QUEENSLAND TREASURY	3.25	14,500	14,944	1,210,624	2026/7/21
		QUEENSLAND TREASURY	2.75	2,500	2,469	200,062	2027/8/20
		QUEENSLAND TREASURY	3.25	1,000	1,022	82,808	2028/7/21
		QUEENSLAND TREASURY	3.25	1,260	1,278	103,570	2029/8/21
		QUEENSLAND TREASURY	6.5	2,000	2,745	222,377	2033/3/14
		QUEENSLAND TREASURY CORP	4.75	6,400	7,213	584,402	2025/7/21
		SOUTH AUST GOVT FIN	5.0	1,000	1,067	86,466	2021/5/20
		SOUTH AUST GOVT FIN	2.75	2,000	2,006	162,554	2025/4/16
		SOUTH AUST GOVT FIN	3.0	5,500	5,551	449,747	2026/7/20
		SOUTH AUST GOVT FIN AUTH	3.0	1,200	1,196	96,917	2028/5/24
		TASMANIAN PUBLIC FINANCE	4.0	7,500	8,017	649,497	2024/6/11
		TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3.25	2,000	2,050	166,072	2026/2/19
		TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3.25	2,000	2,032	164,651	2028/1/24
		TREASURY CORP VICTORIA	5.5	2,000	2,399	194,407	2026/11/17
		TREASURY CORP VICTORIA	3.0	3,500	3,526	285,698	2028/10/20

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	
地方債証券	VICTORIA TREASURY	6.0	16,500	18,761	1,519,895	2022/10/17
	VICTORIA TREASURY	5.5	9,000	10,490	849,871	2024/12/17
	WESTERN AUST TREAS CORP	7.0	4,000	4,479	362,853	2021/7/15
	WESTERN AUST TREAS CORP	6.0	10,000	11,605	940,185	2023/10/16
	WESTERN AUST TREAS CORP	2.5	3,000	2,983	241,676	2024/7/23
	WESTERN AUST TREAS CORP	5.0	2,250	2,566	207,892	2025/7/23
	WESTERN AUST TREAS CORP	3.0	4,500	4,541	367,924	2026/10/21
	WESTERN AUST TREAS CORP	3.0	4,000	4,016	325,375	2027/10/21
特殊債券 (除く金融債)	WESTERN AUST TREAS CORP	3.25	2,320	2,366	191,724	2028/7/20
	AFRICAN DEV BANK	5.25	2,000	2,178	176,515	2022/3/23
	AFRICAN DEV BANK	4.75	5,000	5,509	446,328	2024/3/6
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	2.75	1,000	1,012	82,005	2022/1/19
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	3.4	3,000	3,115	252,350	2027/9/10
	AUSTRALIAN POSTAL CORP	5.0	2,000	2,085	168,972	2020/11/13
	CORP ANDINA DE FOMENTO	6.25	5,000	5,698	461,611	2023/11/8
	CORP ANDINA DE FOMENTO	4.5	8,000	8,355	676,841	2025/6/5
	COUNCIL OF EUROPE	6.0	2,368	2,522	204,331	2020/10/8
	EUROFIMA	5.5	5,000	5,241	424,622	2020/6/30
	EUROPEAN INVT BK	6.25	500	547	44,350	2021/6/8
	FMACB 2013-1E A1	2.97	381	380	30,787	2044/12/10
	INTL BK RECON & DEVELOP	5.0	4,000	4,333	351,022	2022/3/7
	KFW	5.5	6,500	7,118	576,709	2022/2/9
	KFW	5.0	4,000	4,474	362,490	2024/3/19
	KFW	4.0	2,000	2,150	174,221	2025/2/27
	KFW	3.2	5,000	5,125	415,224	2026/9/11
	KOMMUNAL BANKEN	6.5	3,000	3,283	266,008	2021/4/12
	KOMMUNAL BANKEN	4.5	2,750	2,944	238,561	2022/7/18
	KOMMUNAL BANKEN	4.5	1,500	1,620	131,250	2023/4/17
KOMMUNINVEST	5.375	3,000	3,235	262,105	2021/11/18	
KOMMUNINVEST	4.75	2,000	2,143	173,604	2022/8/17	
LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.25	2,000	2,138	173,247	2023/1/24	
LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.75	2,000	2,213	179,328	2024/4/8	
LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.25	2,000	2,175	176,251	2025/1/9	
LGFV PROGRAM TRUST	4.31	6,000	6,174	500,160	2021/11/12	
MEDL 2014-1 A3	4.5	3,500	3,511	284,442	2046/4/22	
NORDIC INV BANK	5.0	4,000	4,334	351,132	2022/4/19	
普通社債券 (含む投資法人債券)	ABN AMRO BANK NV	4.75	4,500	4,515	365,769	2019/2/5
	ABN AMRO BANK NV	3.25	6,000	6,046	489,846	2020/4/9
	AIRPORT MOTORWAY TRUST	5.5	3,600	3,771	305,506	2020/12/9
	AIRSERVICES AUSTRALIA	4.75	4,300	4,483	363,245	2020/11/19
	AMP BANK LIMITED FRN	2.6259	3,500	3,488	282,585	2020/4/9
	AMP WHOLESALE OFFICE FUN	4.75	6,500	6,732	545,394	2021/10/7
	APPLE INC	2.85	1,500	1,503	121,837	2019/8/28
	APPLE INC	3.7	3,500	3,615	292,902	2022/8/28
	AUSNET SERVICES HOLDINGS	4.2	2,000	2,034	164,829	2028/8/21
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.75	2,500	2,520	204,171	2019/7/25
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.25	8,000	8,082	654,787	2020/6/3
	AUST & NZ BANKING GROUP	3.35	1,500	1,517	122,896	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	
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)					
	AUSTRALIA PACIFIC AIRPOR	4.0	1,600	1,656	134,166	2022/9/15
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	5.0	3,600	3,672	297,506	2019/11/7
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	5.5	5,000	5,370	435,052	2022/11/4
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	3.75	6,000	6,044	489,666	2024/5/22
	BANK OF NOVA SCOTIA	3.2	1,400	1,402	113,640	2023/9/7
	BARCLAYS BANK PLC/AUST	4.5	3,300	3,319	268,953	2019/4/4
	BHP BILLITON FINANCE LTD	3.0	6,500	6,541	529,950	2020/3/30
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	5.5	3,000	3,303	267,651	2022/5/23
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	5.25	3,500	3,954	320,363	2024/5/20
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	3.5	2,000	2,076	168,228	2027/7/19
	BNP PARIBAS/AUSTRALIA	3.75	5,000	5,079	411,482	2020/5/21
	BPCE SA	3.5	4,600	4,641	376,003	2020/4/24
	BWP TRUST	4.5	1,500	1,511	122,428	2019/5/27
	BWP TRUST	3.5	1,500	1,512	122,527	2022/5/11
	COCA-COLA CO	2.6	2,000	2,003	162,335	2020/6/9
	COM BK AUSTRALIA	3.75	3,000	3,033	245,713	2019/10/18
	COM BK AUSTRALIA	7.25	3,000	3,162	256,168	2020/2/5
	COM BK AUSTRALIA	4.75	2,000	2,168	175,653	2024/5/27
	COMMONWEALTH BANK AUST	2.75	3,000	3,010	243,858	2021/11/17
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	3,000	3,035	245,939	2022/1/17
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	2,500	2,521	204,305	2023/4/25
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.2	1,500	1,506	122,037	2023/8/16
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	3,000	2,963	240,045	2026/11/17
	COMMONWEALTH PROP FUND	5.25	7,000	7,169	580,815	2019/12/13
	CREDIT SUISSE SYDNEY	4.0	2,000	2,017	163,414	2019/7/16
	CREDIT SUISSE SYDNEY	3.5	5,000	5,057	409,683	2020/4/29
	CREDIT SUISSE SYDNEY	4.0	4,500	4,619	374,209	2021/3/9
	DEXUS FINANCE PTY LTD	4.25	3,200	3,226	261,357	2027/5/11
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.25	2,000	2,003	162,308	2019/7/1
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.25	5,000	5,136	416,103	2022/6/16
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.75	1,000	1,042	84,435	2025/6/16
	ETSA UTILITIES FINANCE	3.5	3,500	3,519	285,091	2024/8/29
	EXPORT-IMPORT BANK K FRN	2.865	3,000	2,981	241,532	2023/10/30
	EXPORT-IMPORT BANK KOREA	3.7	2,000	2,029	164,393	2021/2/19
	EXPORT-IMPORT BK KOR	4.5	3,000	3,017	244,407	2019/4/17
	EXPORT-IMPORT BK KOR	4.25	3,700	3,769	305,399	2020/5/21
	EXPORT-IMPORT BK KOR	3.5	2,000	2,021	163,755	2022/2/14
	FBG FINANCE PTY LTD	3.75	4,500	4,569	370,144	2020/8/7
	FBG FINANCE PTY LTD	3.25	6,000	6,000	486,098	2022/9/6
	FEDERATION CENTRES LTD	5.75	1,000	1,029	83,420	2019/12/13
	FEDERATION CENTRES LTD	5.0	6,800	7,114	576,384	2021/5/27
	FONTERRA COOPERATIVE GRO	4.5	6,700	6,983	565,764	2021/6/30
	FONTERRA COOPERATIVE GRO	5.5	4,000	4,430	358,906	2024/2/26
	GPT RE LTD	6.75	6,000	6,028	488,393	2019/1/24
	GPT RE LTD	4.5	4,600	4,680	379,141	2020/9/11
	GPT RE LTD	3.6725	1,900	1,901	154,039	2024/9/19
	GPT WHL OFFICE FD N01	4.0	3,000	3,066	248,408	2022/5/18
	GPT WHOLESALE SHOP CENTR	3.993	3,500	3,529	285,936	2024/9/11

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)					
	GPT WHOLESALE SHOP CENTR	4.49	3,000	2,999	242,976	2028/2/28
	HSBC BANK AUSTRALIA	5.25	5,000	5,359	434,156	2022/9/7
	HSBC HOLDINGS PLC	3.35	3,000	2,983	241,678	2024/2/16
	HSBC LTD SYDNEY	2.75	700	700	56,708	2021/8/16
	ICPF FINANCE PTY LTD	4.25	2,500	2,530	205,005	2027/4/21
	ING BANK (AUSTRALIA) LTD	3.0	1,300	1,297	105,137	2023/9/7
	INTEL CORP	4.0	2,000	2,078	168,367	2022/12/1
	JP MORGAN CHASE & CO	4.5	4,000	4,238	343,394	2026/1/30
	KOREA DEVELOPMENT BA FRN	2.9112	1,300	1,296	104,999	2023/10/19
	KOREA NATIONAL OIL CORP	4.25	3,500	3,534	286,299	2019/10/8
	KOREA SOUTH-EAST POWER	5.75	5,580	5,829	472,228	2020/9/25
	L-BANK BW FOERDERBANK	2.7	4,000	4,017	325,459	2023/6/19
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.75	6,500	7,348	595,339	2026/5/6
	LLOYDS BANK PLC	3.25	6,000	6,043	489,559	2020/4/1
	MACQUARIE BANK LTD	3.25	5,300	5,343	432,877	2020/3/3
	MACQUARIE UNIVERSITY	6.75	7,000	7,506	608,114	2020/9/9
	MACQUARIE UNIVERSITY	3.5	1,500	1,507	122,155	2028/9/7
	MC FINANCE AUSTRALIA P/L	4.25	2,000	2,075	168,144	2021/12/1
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.75	2,000	2,095	169,766	2021/9/17
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.0	3,000	3,017	244,412	2027/7/13
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	3.0	2,000	2,012	163,022	2021/5/12
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	4.0	1,500	1,551	125,698	2021/12/16
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	6.0	4,000	4,405	356,852	2022/8/8
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	3.0	1,500	1,509	122,310	2023/3/16
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	1,000	1,100	89,136	2024/3/11
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	5,000	5,447	441,314	2024/6/25
	NATIONAL BK OF ABU DHABI	4.75	5,500	5,526	447,702	2019/3/19
	NED WATERSCHAPBK	5.25	2,000	2,250	182,287	2024/4/18
	NEDER FINANCIERINGS-MAAT	4.75	3,500	3,866	313,206	2024/9/11
	NEDER WATERSCHAPS BANK	3.15	1,000	1,014	82,178	2026/9/2
	NISSAN FIN SERVICES AU	3.0	3,000	3,002	243,231	2020/3/3
	NISSAN FIN SERVICES AU	3.0	1,700	1,695	137,320	2021/3/22
	OPTUS FINANCE PTY LTD	4.75	3,600	3,600	291,636	2018/12/12
	OPTUS FINANCE PTY LTD	4.0	5,000	5,187	420,198	2022/6/17
	OPTUS FINANCE PTY LTD	3.25	2,000	2,009	162,805	2023/9/6
	PACCAR FINANCIAL PTY LTD	3.0	1,400	1,401	113,521	2022/9/13
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	5.5	1,200	1,221	98,988	2019/11/20
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	3.75	3,200	3,229	261,653	2021/2/24
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	3.75	3,500	3,511	284,464	2023/12/6
	RABOBANK NEDERLAND AU	3.25	4,400	4,438	359,527	2020/2/11
	RABOBANK NEDERLAND (AUST)	5.5	5,000	5,541	448,920	2024/4/11
	ROYAL BK CANADA/SYD	3.25	6,000	6,048	489,987	2020/2/10
	SCENTRE GROUP TRUST	6.0	5,000	5,422	439,252	2022/7/4
	SCENTRE MGMT LTD	4.5	9,000	9,310	754,221	2021/9/8
	SGSP AUSTRALIA ASSETS	3.75	1,100	1,118	90,581	2024/9/27
	SPARK FINANCE LTD	4.0	1,500	1,510	122,366	2027/10/20
	STOCKLAND TRUST MGMNT	5.5	3,000	3,057	247,722	2019/9/6
	STOCKLAND TRUST MGMNT	4.5	9,000	9,357	758,056	2022/11/23

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)					
	SUNCORP-METWAY	3.75	5,000	5,049	409,055	2019/11/5
	SUNCORP-METWAY	3.5	4,000	4,049	328,058	2020/10/20
	SUNCORP-METWAY	3.5	5,000	5,066	410,429	2021/4/12
	SUNCORP-METWAY	3.0	2,000	2,001	162,123	2023/9/13
	SUNCORP-METWAY LTD	3.25	5,000	4,903	397,224	2026/8/24
	SVENSKA HANDELSBANKEN	4.5	4,000	4,026	326,204	2019/4/10
	SVENSKA HANDELSBANKEN AB	3.25	2,000	2,007	162,588	2023/9/27
	TELSTRA CORP LTD	7.75	4,000	4,314	349,480	2020/7/15
	TELSTRA CORP LTD	4.0	6,700	6,903	559,218	2022/9/16
	TELSTRA CORP LTD	4.0	3,000	3,034	245,802	2027/4/19
	TORONTO-DOMINION BANK	3.7	5,000	5,106	413,653	2020/12/22
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	4.25	2,000	2,014	163,205	2019/5/15
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	2.7	2,000	2,003	162,263	2020/8/14
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	3.3	2,700	2,710	219,555	2023/11/22
	TRANSPower NEW ZEALAND L	4.25	3,000	3,106	251,628	2021/8/6
	TRANSPower NEW ZEALAND L	5.75	500	561	45,471	2023/8/28
	UBS AG AUSTRALIA	4.0	3,000	3,030	245,484	2019/8/27
	UBS AG AUSTRALIA	2.7	4,000	4,002	324,276	2020/8/10
	UBS AG AUSTRALIA	3.25	3,000	3,024	245,032	2023/3/8
	UNITED ENERGY DISTRIBUTI	3.85	2,400	2,444	198,024	2024/10/23
	UNIV OF SYDNEY	4.75	2,500	2,626	212,744	2021/4/16
	UNIVERSITY OF MELBOURNE	4.25	6,800	7,094	574,737	2021/6/30
	UNIVERSITY OF WOLLONGONG	3.5	2,000	2,021	163,727	2027/12/8
	VICINITY CENTRES	3.5	3,000	2,985	241,846	2024/4/26
	VICINITY HOLDINGS LTD	5.0	5,600	5,725	463,840	2019/12/19
	VICTORIA POWER NETWORKS	4.0	2,000	2,007	162,590	2027/8/18
	WELLS FARGO & COMPANY	4.0	3,000	3,027	245,292	2019/8/8
	WELLS FARGO & COMPANY	5.25	3,480	3,734	302,511	2022/9/7
	WELLS FARGO & COMPANY	4.75	3,000	3,210	260,117	2024/8/27
	WELLS FARGO & COMPANY	4.0	1,500	1,525	123,574	2027/4/27
	WESFARMERS LTD	6.25	2,500	2,527	204,740	2019/3/28
	WESFARMERS LTD	4.75	5,000	5,133	415,893	2020/3/12
	WESFARMERS LTD	3.66	5,500	5,602	453,833	2020/11/18
	WESTPAC BANKING	3.25	4,000	4,035	326,881	2020/1/22
	WESTPAC BANKING	3.1	3,500	3,530	286,001	2021/6/3
	WESTPAC BANKING	3.2	3,000	3,020	244,685	2023/3/6
	WESTPAC BANKING	5.25	1,500	1,665	134,942	2023/11/21
	ZURICH FIN AUSTRALIA LTD	3.477	3,000	3,046	246,828	2023/5/31
合	計				83,703,645	

(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	
			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)2018.12限月	百万円 7,340	百万円 —
		オーストラリア国債(3年)2018.12限月	—	6,937

(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12月10日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 83,703,645	% 97.1
コール・ローン等、その他	2,512,369	2.9
投資信託財産総額	86,216,014	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(85,442,530千円)の投資信託財産総額(86,216,014千円)に対する比率は99.1%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=81.01円です。

○特定資産の価格等の調査

(2018年6月12日～2018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 (2018年12月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	86,527,195,985
コール・ローン等	1,054,613,425
公社債(評価額)	83,703,645,538
未収入金	856,889,703
未収利息	825,770,408
前払費用	7,046,363
差入委託証拠金	79,230,548
(B) 負債	504,559,988
未払金	334,530,000
未払解約金	170,027,838
未払利息	2,150
(C) 純資産総額(A-B)	86,022,635,997
元本	36,256,777,073
次期繰越損益金	49,765,858,924
(D) 受益権総口数	36,256,777,073口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,726円

<注記事項>

元本の状況

期首元本額

41,092,404,195円

期中追加設定元本額

879,950,298円

期中一部解約元本額

5,715,577,420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

34,711,627,929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)

917,321,062円

LM・オーストラリア債券ファンド(年2回決算型)

466,239,112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)

82,815,383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)

78,773,587円

○損益の状況 (2018年6月12日～2018年12月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,807,152,847
受取利息	1,807,008,045
その他収益金	342,428
支払利息	△ 197,626
(B) 有価証券売買損益	△ 1,799,755,398
売買益	910,674,977
売買損	△ 2,710,430,375
(C) 先物取引等取引損益	142,849,723
取引益	223,304,412
取引損	△ 80,454,689
(D) 保管費用等	△ 3,700,310
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	146,546,862
(F) 前期繰越損益金	56,144,185,584
(G) 追加信託差損益金	1,184,756,611
(H) 解約差損益金	△ 7,709,630,133
(I) 計(E+F+G+H)	49,765,858,924
次期繰越損益金(I)	49,765,858,924

(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。