



FRANKLIN
TEMPLETON

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16期 決算日 2021年6月10日

－ 受益者のみなさまへ －

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
さて、「LM・オーストラリア債券ファンド(年2回決算型)」は、2021年6月10日に第16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。

◇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：
フランクリン・テンプレトン・ジャパン株式会社

お問い合わせ窓口

電話番号：03-5219-5947

フランクリン・テンプレトン・ジャパン株式会社

(旧：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

フランクリン・テンプレトン・ジャパン株式会社（金融商品取引業者
関東財務局長（金商）第417号）はフランクリン・リソース・インク傘下の資産運用会社です。

<https://www.franklintempleton.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	込 配	み 金 騰 落			
	円		円		%	%	百万円
12期(2019年6月10日)	10,193		0	△0.9	97.9	△0.3	1,186
13期(2019年12月10日)	10,196		0	0.0	98.5	△0.4	1,360
14期(2020年6月10日)	10,330		0	1.3	97.4	2.7	1,282
15期(2020年12月10日)	10,884		0	5.4	98.7	0.4	1,018
16期(2021年6月10日)	11,651		0	7.0	98.8	△0.6	799

(注) 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) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

(注) 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	債 先 物 比 率
		騰 落	率			
(期首)	円		%	%	%	
2020年12月10日	10,884		—	98.7		0.4
12月末	11,078		1.8	98.1		0.2
2021年1月末	11,202		2.9	98.5		△0.0
2月末	11,222		3.1	98.8		0.0
3月末	11,423		5.0	98.7		0.1
4月末	11,537		6.0	99.1		△0.7
5月末	11,553		6.1	98.4		△0.9
(期末)						
2021年6月10日	11,651		7.0	98.8		△0.6

(注) 騰落率は期首比です。

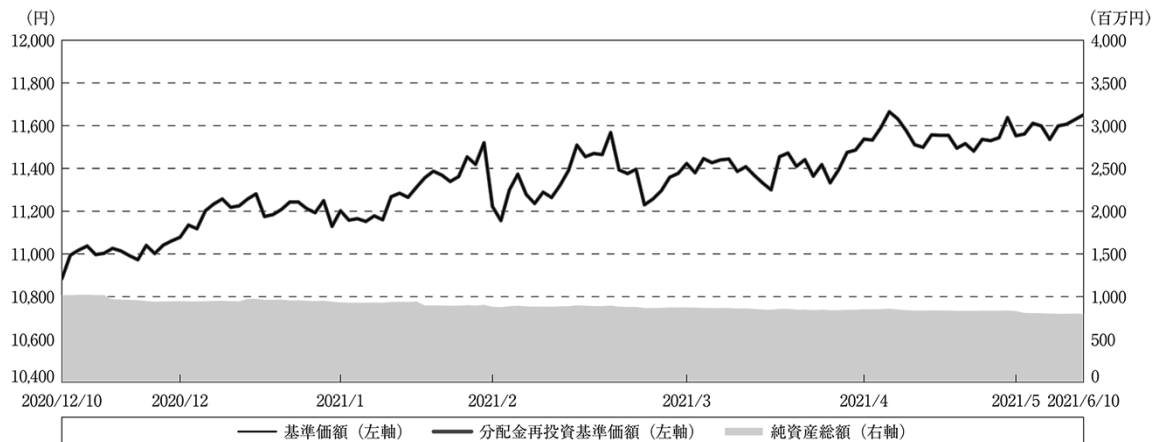
(注) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 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

(2020年12月11日～2021年6月10日)



期首：10,884円

期末：11,651円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 7.0% (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(2020年12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

当期の当ファンドのパフォーマンス(騰落率)は、プラスとなりました。

公社債利金を手堅く確保しました。為替損益についても、豪ドル・円相場が豪ドル高・円安となったことから、プラスとなりました。一方、公社債損益については、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、短期債利回りが若干低下（価格は上昇）する一方、中長期債利回りは上昇（価格は下落）しました。

期の前半は、米バイデン新政権下での財政拡大観測を背景に米国国債利回りが上昇した影響などから、オーストラリアの債券利回りは上昇しました。

期の半ばは、新型コロナウイルスのワクチンが普及し、経済活動の正常化が進むとの見方が広がったことから、投資家のリスク回避姿勢が和らぐ中、利回りの上昇が続きました。米国において追加経済対策に伴い米国国債利回りの上昇が続いたことも、オーストラリア債券利回りの押し上げ要因となりました。

期の後半は、ワクチン接種の進展を受けて景気の回復期待が広がる場面で、利回りは上昇しました。しかし、オーストラリア準備銀行（RBA）が長期にわたって低金利政策を維持するとの見方が広がる中、利回りは緩やかに低下しました。

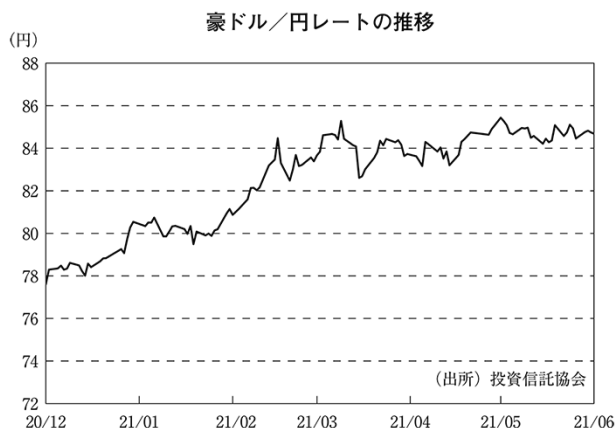
社債セクターについては、債券利回りの急上昇を受けて社債スプレッド（国債に対する上乘せ利回り）は一時拡大しましたが、その後は縮小傾向に転じ、前期末比ではほぼ横ばいとなりました。

当期の豪ドル・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豪金利差の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。

期の半ばは、オーストラリアの債券利回りが上昇傾向となる中、豪ドル買い・円売りが強まりました。2020年10-12月期の豪国内総生産（GDP）成長率が予想を上回ったことや、新型コロナウイルスのワクチン普及により景気回復への期待感が高まったことなども、豪ドルを押し上げました。

期の後半は、新興国を中心にウイルスの感染が再拡大し、リスク回避姿勢が意識されたことなどから、豪ドルは対円で一時上値の重い展開となりました。しかしその後は、主要国におけるワクチン接種の進展やオーストラリア国内の経済活動の正常化などを背景に、豪ドルは対円で底堅い展開となりました。



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

(2020年12月11日～2021年6月10日)

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16期
	2020年12月11日～ 2021年6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	3,561

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

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

(2020年12月11日～2021年6月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 78	% 0.686	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(37)	(0.329)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(38)	(0.335)	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	0.030	(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)	(0.011)	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)	(0.015)	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	81	0.718	
期中の平均基準価額は、11,335円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

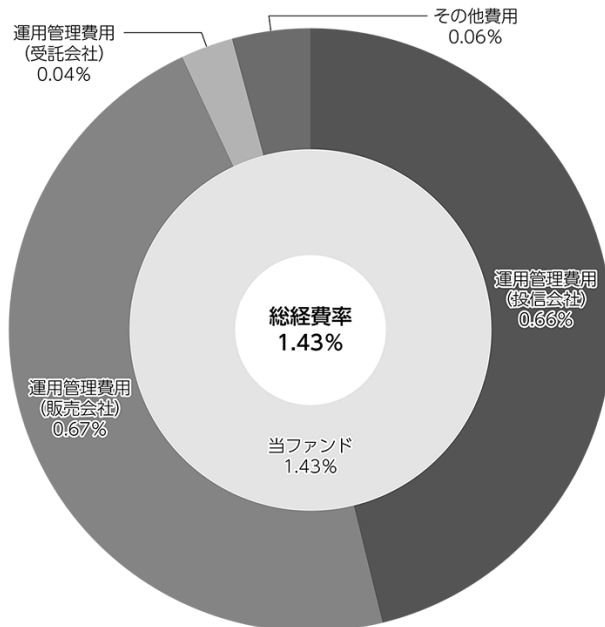
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.43%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2020年12月11日～2021年6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 21,949	千円 58,828	千口 129,889	千円 347,682

(注) 単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2020年12月11日～2021年6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

(2020年12月11日～2021年6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

(2020年12月11日～2021年6月10日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2021年6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 397,490	千口 289,550	千円 805,846

(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

(2021年6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 805,846	% 99.5
コール・ローン等、その他	4,190	0.5
投資信託財産総額	810,036	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(注) 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(56,441,087千円)の投資信託財産総額(56,975,143千円)に対する比率は99.1%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、6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=84.69円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年6月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	810,036,115
LM・豪ドル債券マザーファンド(評価額)	805,846,713
未収入金	4,189,402
(B) 負債	10,559,969
未払解約金	4,189,402
未払信託報酬	6,144,491
その他未払費用	226,076
(C) 純資産総額(A-B)	799,476,146
元本	686,188,561
次期繰越損益金	113,287,585
(D) 受益権総口数	686,188,561口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,651円

<注記事項>

元本の状況

期首元本額

935,477,735円

期中追加設定元本額

52,194,169円

期中一部解約元本額

301,483,343円

○損益の状況 (2020年12月11日～2021年6月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	57,298,030
売買益	68,051,059
売買損	△ 10,753,029
(B) 信託報酬等	△ 6,370,567
(C) 当期損益金(A+B)	50,927,463
(D) 前期繰越損益金	41,063,821
(E) 追加信託差損益金	21,296,301
(配当等相当額)	(152,349,025)
(売買損益相当額)	(△131,052,724)
(F) 計(C+D+E)	113,287,585
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	113,287,585
追加信託差損益金	21,296,301
(配当等相当額)	(152,429,271)
(売買損益相当額)	(△131,132,970)
分配準備積立金	91,991,284

(注) 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) 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) 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) 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 取 益(費用控除後)	10,678,412円
(B) 有 価 証 券 売 買 等 損 益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)	24,813,752
(C) 收 益 調 整 金	152,429,271
(D) 分 配 準 備 積 立 金	56,499,120
分 配 対 象 取 益 額(A+B+C+D)	244,420,555
(1 万 口 当 たり 取 益 分 配 対 象 額)	(3,561)
取 益 分 配 金	0
(1 万 口 当 たり 取 益 分 配 金)	(0)

<お知らせ>

<合併について>

レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社は、2021年4月1日付でフランクリン・テンプルトン・インベストメンツ株式会社を吸収合併し、商号を「フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社」に変更致しました。

<主な約款変更に関するお知らせ>

当ファンドおよび当ファンドの主要投資対象である親投資信託「LM・豪ドル債券マザーファンド」の信託約款中の委託者名を「レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社」から「フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社」に変更しました。

(変更日：2021年4月1日)

LM・豪ドル債券マザーファンド

運用状況のご報告

第36期 決算日 2021年6月10日

(計算期間：2020年12月11日～2021年6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36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・オペ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	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				
32期(2019年6月10日)	円 23,686		% △0.2	% 97.3	% 97.3	% △0.3	百万円 78,307
33期(2019年12月10日)	23,858		0.7	97.8	97.8	△0.4	70,460
34期(2020年6月10日)	24,336		2.0	96.7	96.7	2.7	65,235
35期(2020年12月10日)	25,821		6.1	97.9	97.9	0.4	60,661
36期(2021年6月10日)	27,831		7.8	98.0	98.0	△0.6	56,883

(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率。

(注) 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	純総資産額
		期騰	中率				
(期首) 2020年12月10日	円 25,821		% —	% 97.9	% 97.9	% 0.4	
12月末	26,301		1.9	98.0	98.0	0.1	
2021年1月末	26,627		3.1	98.3	98.3	△0.0	
2月末	26,704		3.4	98.5	98.5	0.0	
3月末	27,216		5.4	98.2	98.2	0.1	
4月末	27,517		6.6	98.5	98.5	△0.7	
5月末	27,589		6.8	97.7	97.7	△0.9	
(期末) 2021年6月10日	27,831		7.8	98.0	98.0	△0.6	

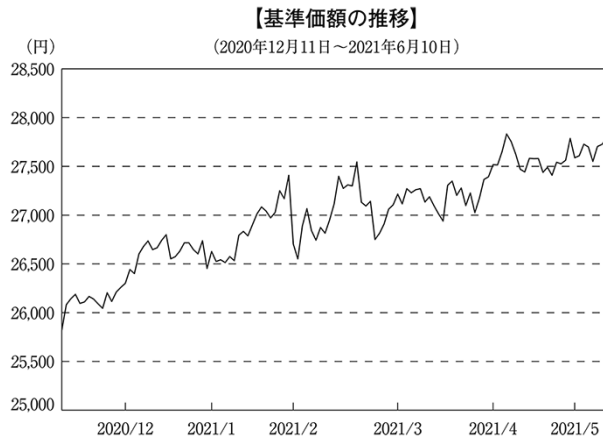
(注) 騰落率は期首比です。

(注) 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

(2020年12月11日～2021年6月10日)



○基準価額の変動要因

当期の当ファンドのパフォーマンス（騰落率）は、プラスとなりました。

公社債利金を手堅く確保しました。為替損益についても、豪ドル・円相場が豪ドル高・円安となったことから、プラスとなりました。一方、公社債損益については、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、短期債利回りが若干低下（価格は上昇）する一方、中長期債利回りは上昇（価格は下落）しました。

期の前半は、米バイデン新政権下での財政拡大観測を背景に米国国債利回りが上昇した影響などから、オーストラリアの債券利回りは上昇しました。

期の半ばは、新型コロナウイルスのワクチンが普及し、経済活動の正常化が進むとの見方が広がったことから、投資家のリスク回避姿勢が和らぐ中、利回りの上昇が続きました。米国において追加経済対策に伴い米国国債利回りの上昇が続いたことも、オーストラリア債券利回りの押し上げ要因となりました。

期の後半は、ワクチン接種の進展を受けて景気の回復期待が広がる場面で、利回りは上昇しました。しかし、オーストラリア準備銀行（RBA）が長期にわたって低金利政策を維持するとの見方が広がる中、利回りは緩やかに低下しました。

社債セクターについては、債券利回りの急上昇を受けて社債スプレッド（国債に対する上乗せ利回り）は一時拡大しましたが、その後は縮小傾向に転じ、前期末比ではほぼ横ばいとなりました。

当期の豪ドル・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豪金利差の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。

期の半ばは、オーストラリアの債券利回りが上昇傾向となる中、豪ドル買い・円売りが強まりました。2020年10-12月期の豪国内総生産（GDP）成長率が予想を上回ったことや、新型コロナウイルスのワクチン普及により景気回復への期待感が高まったことなども、豪ドルを押し上げました。

期の後半は、新興国を中心にウイルスの感染が再拡大し、リスク回避姿勢が意識されたことなどから、豪ドルは対円で一時上値の重い展開となりました。しかしその後は、主要国におけるワクチン接種の進展やオーストラリア国内の経済活動の正常化などを背景に、豪ドルは対円で底堅い展開となりました。

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

(2020年12月11日～2021年6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)	% 0.002 (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、26,992円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2020年12月11日～2021年6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	5,959	34,999
		地方債証券	6,655	30,764
		特殊債券	—	6,664 (27)
	社債券(投資法人債券を含む)	17,864	32,741 (13,800)	

(注) 金額は受渡し代金。(経過利息分は含まれておりません。)

(注) 単位未満は切捨て。

(注) () 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) 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 13,514	百万円 14,266	百万円 14,073	百万円 14,430

(注) 単位未満は切捨て。

(注) 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

(2020年12月11日～2021年6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

(2021年6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 603,561	千オーストラリアドル 658,107	千円 55,735,115	% 98.0	% —	% 52.3	% 33.6	% 12.0
合 計	603,561	658,107	55,735,115	98.0	—	52.3	33.6	12.0

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 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	AUSTRALIA GOVT INFL	2.3008	1,140	1,724	146,037	2035/8/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	6,700	7,458	631,632	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.25	13,100	14,167	1,199,824	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.25	9,750	11,273	954,739	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	3,400	3,803	322,125	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.5	520	570	48,350	2030/5/21
		AUSTRALIAN GOVT	1.0	3,000	2,883	244,191	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVT	1.5	5,300	5,310	449,705	2031/6/21
		AUSTRALIAN GOVT	4.5	8,410	11,048	935,737	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	13,800	15,383	1,302,856	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.75	8,900	11,069	937,457	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.25	7,390	8,645	732,198	2039/6/21
		AUSTRALIAN GOVT	2.75	7,970	8,644	732,102	2041/5/21
		AUSTRALIAN GOVT	3.0	5,280	5,915	500,956	2047/3/21
		AUSTRALIAN GOVT	1.75	10,910	9,328	789,992	2051/6/21
	地方債証券	AUCKLAND COUNCIL	5.843	4,000	4,162	352,493	2022/3/22
		AUCKLAND COUNCIL	2.9	700	744	63,072	2027/9/16
		AUST CAPITAL TERRITORY	1.25	1,000	1,028	87,141	2025/5/22
		AUST CAPITAL TERRITORY	3.0	2,000	2,230	188,929	2028/4/18
		AUST CAPITAL TERRITORY	2.25	1,000	1,058	89,627	2029/5/22
		BRITISH COLUMBIA PROV OF	4.25	6,000	6,754	572,033	2024/11/27
		KUNTARAHOHITUS OYJ	3.5	1,000	1,112	94,216	2026/2/4
		MANITOBA PROVANCE	3.75	500	563	47,703	2026/6/9
		MANITOBA PROVANCE	3.5	500	560	47,496	2028/8/22
		NEW S WALES TREAS CORP	4.0	6,000	6,941	587,857	2026/5/20
		NEW S WALES TREAS CORP	3.0	3,000	3,347	283,509	2027/5/20
		NEW S WALES TREAS CORP	3.0	2,500	2,800	237,180	2028/3/20
		NEW S WALES TREAS CORP	3.0	4,240	4,761	403,213	2030/2/20
		NEW S WALES TREASURY	3.0	8,000	8,986	761,037	2029/4/20
		NEW S WALES TREASURY	2.0	9,400	9,693	820,979	2031/3/20
		NORTHERN TERRITORY TREAS	6.0	2,000	2,306	195,335	2024/3/15
		NORTHERN TERRITORY TREAS	2.75	1,000	1,095	92,738	2027/4/21
		NORTHERN TERRITORY TREAS	3.5	2,000	2,289	193,882	2028/4/21
		NORTHERN TERRITORY TREAS	2.0	1,000	1,036	87,742	2029/5/21
		NORTHERN TERRITORY TREAS	3.75	4,000	4,611	390,542	2033/4/21
		PROVINCE OF QUEBEC	3.7	2,000	2,248	190,418	2026/5/20
		QUEBEC PROVINCE	4.2	3,000	3,371	285,516	2025/3/10
		QUEENSLAND TREASURY	4.75	6,400	7,489	634,272	2025/7/21
		QUEENSLAND TREASURY	3.25	8,300	9,309	788,452	2026/7/21
		QUEENSLAND TREASURY	2.75	4,000	4,405	373,127	2027/8/20
		QUEENSLAND TREASURY	3.25	7,100	8,085	684,759	2028/7/21
		QUEENSLAND TREASURY	2.5	5,700	6,193	524,532	2029/3/6
		QUEENSLAND TREASURY	3.25	3,100	3,543	300,063	2029/8/21
		QUEENSLAND TREASURY	1.75	3,700	3,708	314,111	2031/8/21
		QUEENSLAND TREASURY	1.5	1,000	964	81,687	2032/8/20
		QUEENSLAND TREASURY	6.5	1,500	2,222	188,229	2033/3/14
		SOUTH AUST GOVT FIN	2.25	1,000	1,059	89,709	2024/8/15

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		
	地方債証券						
		SOUTH AUST GOVT FIN	2.75	2,000	2,169	183,733	2025/4/16
		SOUTH AUST GOVT FIN	3.0	5,500	6,097	516,426	2026/7/20
		SOUTH AUST GOVT FIN	3.0	1,200	1,340	113,548	2028/5/24
		SOUTH AUST GOVT FIN	2.75	500	548	46,418	2030/5/24
		TASMANIAN PUBLIC FINANCE	4.0	1,500	1,660	140,662	2024/6/11
		TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3.25	1,500	1,665	141,050	2026/2/19
		TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3.25	2,000	2,252	190,743	2028/1/24
		TREASURY CORP VICTORIA	5.5	4,500	5,606	474,799	2026/11/17
		TREASURY CORP VICTORIA	3.0	11,200	12,550	1,062,873	2028/10/20
		TREASURY CORP VICTORIA	2.5	5,500	5,958	504,614	2029/10/22
		TREASURY CORP VICTORIA	4.75	1,600	2,042	173,011	2030/11/20
		TREASURY CORP VICTORIA	1.5	4,900	4,843	410,183	2030/11/20
		TREASURY CORP VICTORIA	4.25	900	1,125	95,314	2032/12/20
		TREASURY CORP VICTORIA	2.25	500	512	43,412	2033/9/15
		VICTORIA TREASURY	5.5	4,000	4,705	398,530	2024/12/17
		WESTERN AUST TREAS CORP	2.5	2,000	2,134	180,782	2024/7/23
		WESTERN AUST TREAS CORP	3.0	3,500	3,892	329,631	2026/10/21
		WESTERN AUST TREAS CORP	3.0	3,000	3,355	284,182	2027/10/21
		WESTERN AUST TREAS CORP	3.25	2,320	2,643	223,917	2028/7/20
		WESTERN AUST TREAS CORP	2.75	2,700	2,982	252,560	2029/7/24
		WESTERN AUST TREAS CORP	1.75	600	601	50,923	2031/10/22
		WESTERN AUST TREAS CORP	2.0	900	882	74,749	2034/10/24
	特殊債券 (除く金融債)						
		AFRICAN DEV BANK	4.75	500	559	47,391	2024/3/6
		ASIAN DEVELOPMENT BANK	3.4	3,000	3,402	288,153	2027/9/10
		ASIAN DEVELOPMENT BANK	3.3	1,500	1,699	143,926	2028/8/8
		CORP ANDINA DE FOMENTO	6.25	5,000	5,529	468,297	2023/11/8
		CORP ANDINA DE FOMENTO	4.5	8,000	8,738	740,048	2025/6/5
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	1.7	2,000	2,083	176,460	2024/11/15
		EUROPEAN INVT BK	4.75	1,500	1,704	144,360	2024/8/7
		FMACB 2013-1E A1	1.11	224	225	19,120	2044/12/10
		INTL FINANCE CORP	3.2	1,500	1,672	141,632	2026/7/22
		KFW	5.0	2,000	2,258	191,307	2024/3/19
		KFW	4.0	3,000	3,375	285,897	2025/2/27
		KFW	3.2	3,000	3,345	283,331	2026/9/11
		LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.75	4,000	4,739	401,423	2026/5/6
		LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.25	2,000	2,261	191,555	2025/1/9
		LGFV PROGRAM TRUST	4.31	5,000	5,069	429,348	2021/11/12
	普通社債券 (含む投資法人債券)						
		AIRSERVICES AUSTRALIA	2.2	500	511	43,309	2030/5/15
		APPLE INC	3.35	1,500	1,609	136,314	2024/1/10
		APPLE INC	3.6	1,000	1,121	94,938	2026/6/10
		AUSNET SERVICES HOLDINGS	4.4	2,000	2,326	197,016	2027/8/16
		AUSNET SERVICES HOLDINGS	4.2	4,500	5,217	441,895	2028/8/21
		AUSNET SERVICES HOLDINGS	2.6	500	518	43,872	2029/7/31
		AUST & NZ BANKING GROUP	3.35	5,000	5,287	447,836	2023/5/9
		AUST & NZ BANKING GROUP	5.0	1,500	1,650	139,810	2023/8/16
		AUST & NZ BANKING GROUP	3.1	2,500	2,670	226,177	2024/2/8
		AUST & NZ BANKING GROUP	1.55	2,000	2,058	174,363	2024/8/29
		AUST & NZ BANKING GROUP	1.65	1,500	1,547	131,025	2025/1/16

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	
	普通社債券 (含む投資法人債類)					
	AUSTRALIAN CATHOLIC UNI	3.7	1,290	1,397	118,388	2027/8/3
	AUSTRALIAN GAS LIGHT	2.1486	1,900	1,920	162,677	2028/4/28
	AUSTRALIAN NATIONAL UNIV	3.98	1,000	1,120	94,893	2025/11/18
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	5.5	5,000	5,229	442,856	2022/11/4
	AUSTRALIAN PRIME PROPERT	3.75	6,000	6,234	527,977	2024/5/22
	BANK OF MONTREAL	3.25	1,500	1,558	131,965	2022/10/6
	BANK OF NOVA SCOTIA	3.2	1,400	1,484	125,710	2023/9/7
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	5.25	3,500	3,996	338,455	2024/5/20
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	3.5	2,000	2,264	191,795	2027/7/19
	BK TOKYO-MIT UFJ SYDNEY	3.4	2,000	2,105	178,286	2023/3/20
	BNG BANK NV	3.3	1,500	1,691	143,253	2029/4/26
	BPCE SA	1.8	3,000	3,083	261,143	2024/9/11
	BPCE SA	2.0	2,500	2,588	219,230	2025/6/5
	BWP TRUST	3.5	1,500	1,535	130,038	2022/5/11
	BWP TRUST	3.3	600	652	55,292	2026/4/10
	BWP TRUST	2.2	500	510	43,215	2028/3/24
	CANADIAN IMPERIAL BANK	1.6	2,000	2,042	172,958	2023/6/9
	CHARTER HALL EXCH FIN	2.317	1,200	1,179	99,851	2030/9/25
	COCA-COLA CO	3.25	2,000	2,151	182,229	2024/6/11
	COM BK AUSTRALIA	4.75	2,000	2,243	189,986	2024/5/27
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.2	1,500	1,591	134,784	2023/8/16
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.0	1,200	1,277	108,189	2024/1/11
	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	3,000	3,325	281,669	2026/11/17
	DEUTSCHE BAHN FIN GMBH	3.8	1,000	1,121	94,995	2027/9/27
	DEXUS FINANCE PTY LTD	4.25	3,200	3,634	307,829	2027/5/11
	DEXUS FINANCE PTY LTD	2.5	1,600	1,628	137,876	2029/10/17
	DEXUS FINANCE PTY LTD	3.0	1,500	1,541	130,557	2032/2/3
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.25	5,000	5,098	431,796	2022/6/16
	DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.75	1,000	1,125	95,321	2025/6/16
	ETSA UTILITIES FINANCE	3.5	5,500	5,943	503,356	2024/8/29
	FONTERRA COOPERATIVE GRO	5.5	4,000	4,530	383,727	2024/2/26
	FONTERRA COOPERATIVE GRO	4.0	2,500	2,866	242,804	2027/11/2
	GENERAL PROPERTY TRUST	2.849	600	607	51,490	2032/2/20
	GPT RE LTD	3.6725	1,900	2,057	174,250	2024/9/19
	GPT WHL OFFICE FD NO1	4.0	3,000	3,046	258,015	2022/5/18
	GPT WHL OFFICE FD NO1	4.52	1,950	2,239	189,692	2027/2/22
	HSBC BANK AUSTRALIA	5.25	5,000	5,298	448,713	2022/9/7
	HSBC HOLDINGS PLC	3.35	3,000	3,125	264,657	2024/2/16
	ICPF FINANCE PTY LTD	4.25	2,500	2,822	238,999	2027/4/21
	ING BANK (AUSTRALIA) LTD	3.0	1,300	1,373	116,288	2023/9/7
	ING BANK (AUSTRALIA) LTD	1.45	1,000	1,021	86,537	2024/8/20
	JOHN DEERE FINANCIAL LTD	1.75	3,000	3,097	262,319	2024/10/4
	JP MORGAN CHASE & CO	4.5	3,000	3,426	290,155	2026/1/30
	KOREA DEVELOPMENT BANK	1.5	2,000	2,043	173,031	2024/8/29
	KOREA EXPRESSWAY CORP	0.928	1,300	1,304	110,519	2023/9/2
	L-BANK BW FOERDERBANK	2.7	1,300	1,362	115,424	2023/6/19
	LLOYDS BANK PLC	1.65	2,500	2,535	214,725	2022/8/12
	MACQUARIE BANK LTD	1.75	1,500	1,545	130,846	2024/8/7

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 (含む投資法人債類)					
	MACQUARIE UNIVERSITY	3.5	2,000	2,229	188,811	2028/9/7
	MACQUARIE UNIVERSITY	2.25	2,500	2,517	213,179	2030/5/22
	MC FINANCE AUSTRALIA P/L	4.25	2,000	2,033	172,244	2021/12/1
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.75	1,000	1,011	85,678	2021/9/17
	METLIFE GLOB FUNDING I	4.0	3,767	4,241	359,195	2027/7/13
	MIRVAC GROUP FINANCE LTD	2.6	1,500	1,536	130,118	2029/9/18
	MIZUHO BANK LTD/SYDNEY	1.7	2,600	2,675	226,579	2024/8/7
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	6.0	4,000	4,254	360,281	2022/8/8
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	2.9	1,500	1,596	135,171	2024/2/26
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	1,000	1,123	95,133	2024/3/11
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	2.15	1,200	1,256	106,408	2024/6/19
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	5,000	5,663	479,641	2024/6/25
	NBN CO LTD	1.0	500	493	41,769	2025/12/3
	NBN CO LTD	2.15	700	704	59,701	2028/6/2
	NBN CO LTD	2.2	1,500	1,445	122,446	2030/12/16
	NED WATERSCHAPBK	5.25	2,000	2,274	192,647	2024/4/18
	NEDER FINANCIERINGS-MAAT	4.75	3,500	3,975	336,644	2024/9/11
	NEDER WATERSCHAPSBANK	3.15	1,000	1,108	93,896	2026/9/2
	OPTUS FINANCE PTY LTD	4.0	5,000	5,187	439,320	2022/6/17
	OPTUS FINANCE PTY LTD	3.25	3,000	3,181	269,474	2023/9/6
	OPTUS FINANCE PTY LTD	1.6	1,000	1,021	86,537	2025/7/1
	OPTUS FINANCE PTY LTD	2.5	2,000	2,044	173,184	2030/7/1
	PACCAR FINANCIAL PTY LTD	3.0	1,400	1,444	122,318	2022/9/13
	PACCAR FINANCIAL PTY LTD	2.1	1,800	1,855	157,170	2023/6/13
	PACCAR FINANCIAL PTY LTD	0.75	700	701	59,437	2024/5/24
	PACCAR FINANCIAL PTY LTD	0.9	1,500	1,506	127,595	2024/9/24
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	3.75	3,500	3,719	314,970	2023/12/6
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	2.0	1,800	1,841	155,914	2025/8/15
	RABOBANK NEDERLAND(AUST)	5.5	5,000	5,677	480,785	2024/4/11
	SCENTRE GROUP TRUST	6.0	5,000	5,223	442,357	2022/7/4
	SGSP AUSTRALIA ASSETS	3.75	500	533	45,183	2023/6/28
	SGSP AUSTRALIA ASSETS	3.75	3,100	3,398	287,826	2024/9/27
	SGSP AUSTRALIA ASSETS	1.843	2,700	2,675	226,566	2028/9/15
	SHINHAN BANK	1.183	2,700	2,697	228,461	2025/9/29
	SPARK FINANCE LTD	4.0	2,000	2,272	192,461	2027/10/20
	SPARK FINANCE LTD	2.6	3,100	3,145	266,361	2030/3/18
	STOCKLAND TRUST MGMNT	4.5	8,000	8,388	710,393	2022/11/23
	STOCKLAND TRUST MGMNT	3.3	1,900	2,019	171,014	2024/3/22
	STOCKLAND TRUST MGMNT	2.3	1,000	1,022	86,593	2028/3/24
	SUMITOMO MITSUI FINL FRN	1.2924	2,000	2,043	173,069	2024/10/16
	SUNCORP-METWAY	3.0	2,000	2,117	179,339	2023/9/13
	SUNCORP-METWAY LTD	1.85	1,000	1,033	87,507	2024/7/30
	SUNCORP-METWAY LTD	3.25	6,000	6,597	558,740	2026/8/24
	SVENSKA HANDELSBANKEN AB	3.25	2,000	2,123	179,861	2023/9/27
	TELSTRA CORP LTD	4.0	3,000	3,408	288,692	2027/4/19
	TORONTO-DOMINION BANK	2.05	2,700	2,804	237,512	2024/7/10
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	1.3	3,000	3,046	257,992	2023/2/17
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	3.3	2,700	2,878	243,782	2023/11/22

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)					
	TRANSPower NEW ZEALAND L	5.75	1,000	1,118	94,718	2023/8/28
	UBS AG AUSTRALIA	3.25	3,000	3,146	266,496	2023/3/8
	UBS AG AUSTRALIA	1.2	900	905	76,666	2025/7/30
	UBS AG AUSTRALIA	1.1	2,500	2,484	210,401	2026/2/26
	UNI OF TECHNOLOGY/SYDNEY	3.75	830	937	79,421	2027/7/20
	UNITED ENERGY DISTRIBUTI	3.85	2,400	2,627	222,540	2024/10/23
	UNITED ENERGY DISTRIBUTI	2.2	2,000	2,069	175,225	2026/10/29
	UNIVERSITY OF SYDNEY	3.75	2,500	2,776	235,110	2025/8/28
	UNIVERSITY OF WOLLONGONG	3.5	2,000	2,222	188,238	2027/12/8
	UNIVERSITY OF WOLLONGONG	1.746	500	494	41,899	2028/12/15
	VICINITY CENTRES	3.5	3,000	3,200	271,013	2024/4/26
	VICINITY CENTRES	4.0	1,370	1,517	128,503	2027/4/26
	VICTORIA POWER NETWORKS	4.0	2,500	2,831	239,795	2027/8/18
	WESTERN SYDNEY UNI	1.606	700	696	58,946	2027/12/8
	WESTPAC BANKING	3.2	1,000	1,050	88,925	2023/3/6
	WESTPAC BANKING	3.0	3,500	3,743	317,036	2024/4/24
	WESTPAC BANKING	2.25	1,500	1,576	133,548	2024/8/16
	WOORI BANK	0.839	3,000	3,010	254,989	2023/10/23
	WSO FINANCE PTY LTD	3.5	500	523	44,367	2023/7/14
	ZURICH FIN AUSTRALIA LTD	3.477	3,000	3,165	268,097	2023/5/31
合	計				55,735,115	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 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
			百万円	百万円
外	債券先物取引	オーストラリア国債(5年)2021.6限月	—	855
		オーストラリア国債(10年)2021.6限月	5,187	—
国		オーストラリア国債(3年)2021.6限月	—	2,425
		オーストラリア国債(3年)2021.9限月	—	2,235

(注) 単位未満は切捨て。

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2021年6月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 55,735,115	% 97.8
コール・ローン等、その他	1,240,028	2.2
投資信託財産総額	56,975,143	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨て。

(注) 当期末における外貨建純資産 (56,441,087千円) の投資信託財産総額 (56,975,143千円) に対する比率は99.1%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売相場場の仲値により邦貨換算したものです。なお、6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=84.69円です。

○特定資産の価格等の調査

(2020年12月11日～2021年6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 (2021年6月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	57,088,390,842
コール・ローン等	662,143,356
公社債(評価額)	55,735,115,185
未収入金	188,287,928
未収利息	378,021,311
前払費用	4,583,863
差入委託証拠金	120,239,199
(B) 負債	204,811,145
未払金	123,644,914
未払解約金	81,165,332
未払利息	899
(C) 純資産総額(A-B)	56,883,579,697
元本	20,438,820,714
次期繰越損益金	36,444,758,983
(D) 受益権総口数	20,438,820,714口
1万口当たり基準価額(C/D)	27,831円

<注記事項>

元本の状況

期首元本額

23,493,216,260円

期中追加設定元本額

215,482,101円

期中一部解約元本額

3,269,877,647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

19,489,403,344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)

659,867,331円

LM・オーストラリア債券ファンド(年2回決算型)

289,550,039円

○損益の状況 (2020年12月11日～2021年6月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	931,053,880
受取利息	931,515,011
その他収益金	△ 361,616
支払利息	△ 99,515
(B) 有価証券売買損益	3,701,049,312
売買益	5,295,978,028
売買損	△ 1,594,928,716
(C) 先物取引等取引損益	△ 180,565,586
取引益	101,510,919
取引損	△ 282,076,505
(D) 保管費用等	△ 2,627,800
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	4,448,909,806
(F) 前期繰越損益金	37,168,722,528
(G) 追加信託差損益金	363,343,635
(H) 解約差損益金	△ 5,536,216,986
(I) 計(E+F+G+H)	36,444,758,983
次期繰越損益金(I)	36,444,758,983

(注) 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) 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) 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。

＜お知らせ＞

＜合併について＞

レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社は、2021年4月1日付でフランクリン・テンプルトン・インベストメンツ株式会社を吸収合併し、商号を「フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社」に変更致しました。

＜主な約款変更に関するお知らせ＞

信託約款中の委託者名を「レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社」から「フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社」に変更しました。

(変更日：2021年4月1日)