

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(2003年9月26日設定)
運用方針	豪ドル建ての国債、政府機関債、州政府債、社債、資産担保証券(ABS)、モーゲージ証券(MBS)、国際機関債等に分散投資を行います。ブルームバーグオーストラリア債券(総合)インデックス(円換算ベース)をベンチマークとします。 ポートフォリオの平均格付は原則としてAA一格相当以上を維持することとし、投資する公社債は原則として取得時においてBBB一格相当以上の格付を取得しているものに限ります。 ポートフォリオの平均デュレーションは原則としてベンチマーク±1年以内の範囲で調整します。 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 運用指図に関する権限は、UBSアセット・マネジメント(オーストラリア)リミテッドに委託します。
主要運用対象	豪ドル建ての公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の利子等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を分配対象額とし、分配金額は、経費等を控除後の利子等収益等を中心に、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。また、基準価額水準、運用状況等によっては安定した分配とならないことがあります。

## 運用報告書(全体版)

オーストラリア  
インカムオープン

第83期(決算日:2024年6月17日)

第84期(決算日:2024年9月17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、お手持ちの「オーストラリアインカムオープン」は、去る9月17日に第84期の決算を行いましたので、法令に基づいて第83期～第84期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。  
今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



## 三菱UFJアセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号  
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用  
フリーダイヤル **0120-151034**  
(受付時間:営業日の9:00~17:00、  
土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

## 本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

## ○最近10期の運用実績

決算期	基準価額			ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックス		債券組入比率	債券先物比率	金利先物比率	純資産額
	(分配落)	税金	み	期	中				
	円	分	金	騰	率	円換算ベース	騰	率	
	円			落			落		百万円
75期(2022年6月15日)	8,283		30	1.3		861,969.64	1.5		7,013
76期(2022年9月15日)	8,712		30	5.5		915,662.12	6.2		7,127
77期(2022年12月15日)	8,487		30	△2.2		898,778.41	△1.8		6,829
78期(2023年3月15日)	8,230		30	△2.7		874,298.79	△2.7		6,520
79期(2023年6月15日)	8,521		30	3.9		909,293.24	4.0		6,587
80期(2023年9月15日)	8,554		30	0.7		916,043.04	0.7		6,444
81期(2023年12月15日)	8,651		30	1.5		931,358.81	1.7		6,259
82期(2024年3月15日)	8,939		30	3.7		965,291.50	3.6		5,483
83期(2024年6月17日)	9,539		30	7.0		1,035,510.64	7.3		5,719
84期(2024年9月17日)	8,936		30	△6.0		971,847.08	△6.1		5,218

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）は、三菱UFJアセットマネジメント株式会社（以下、委託会社）の関係会社ではなく、当ファンドを承認し、是認し、レビューまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックスは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標またはサービスマークであり、委託会社に対してライセンスされています。ブルームバーグは、ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックスに関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックス（円換算ベース）は、ブルームバーグオーストラリア債券（総合）インデックスをもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「債券先物比率」、「金利先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基準価額		ブルームバーグオーストラリア 債券（総合）インデックス (円換算ベース)		債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	金 利 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
第83期	(期 首) 2024年 3 月15日	円 8,939	% -		% -	% 92.1	% 8.6	% -
	3 月末	9,091	1.7	982,017.74	1.7	90.9	8.6	-
	4 月末	9,244	3.4	1,001,476.47	3.7	91.9	8.6	-
	5 月末	9,396	5.1	1,017,780.43	5.4	90.5	11.6	-
	(期 末) 2024年 6 月17日	9,569	7.0	1,035,510.64	7.3	93.5	6.9	-
第84期	(期 首) 2024年 6 月17日	9,539	-	1,035,510.64	-	93.5	6.9	-
	6 月末	9,670	1.4	1,051,428.50	1.5	93.0	2.2	-
	7 月末	9,113	△4.5	989,736.63	△4.4	93.2	5.8	-
	8 月末	9,209	△3.5	998,790.81	△3.5	94.2	9.2	-
	(期 末) 2024年 9 月17日	8,966	△6.0	971,847.08	△6.1	92.6	8.8	-

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」、「金利先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第83期～第84期：2024年3月16日～2024年9月17日

## ▶ 当作成期中の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



第83期首	8,939円
第84期末	8,936円
既払分配金	60円
騰落率	0.6%
	(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金(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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさま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。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

**基準価額の動き**

基準価額は期間の初めに比べ0.6%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

**ベンチマークとの差異**

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（0.7%）を0.1%下回りました。

**基準価額の主な変動要因****上昇要因**

豪州債券市況が上昇したこと等が基準価額にプラスに寄与しました。

**下落要因**

豪ドルが対円で下落したことや、信託報酬等が基準価額にマイナスに影響しました。

第83期～第84期：2024年3月16日～2024年9月17日

## 投資環境について

### ▶ 債券市況

**豪州債券市況は上昇しました。**

2024年4月頃にかけて一部経済指標からインフレ圧力の根強さが確認され、利下げ観測が後退したことなどを背景に、オーストラリアの長期金利が上昇する場面があったものの、その後、インフレ鈍化を示唆する一部経済指標を受けて、主要中銀による利下げ観測が高まったことなどをを受けて、オーストラリアの長期金利

が低下したことなどが影響し、期間を通じてみると、豪州債券市況は上昇しました。

### ▶ 為替市況

**豪ドルは対円で下落しました。**

主要中銀による利下げ観測の高まりにより米ドルが対円で下落したことなどが影響し、豪ドルは対円で下落しました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

### 組入比率

期間を通じて現物債券を高位に組み入れました。また、機動的なデュレーション（平均回収期間や金利感応度）調整等の為に債券先物も一部組み入れました。

### 種別構成

債券種別配分については、期間を通じて、ベンチマークに対し、国債をアンダーウエイト

とする一方、相対的な利回りの高さを享受するため、社債（事業債など）をオーバーウエイトとしました。

### デュレーション

デュレーションについては、期間の初めからベンチマーク対比で長めの水準とし、その後も期間末までベンチマークに対して長めの水準を維持しました。

第83期～第84期：2024/3/16～2024/9/17

## ▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（0.7%）を0.1%下回りました。

### プラス要因

#### 種別構成

当期間においては、社債をオーバーウエイトとしたことが、ベンチマーク比でのパフォーマンスにプラスに寄与しました。

#### デュレーション戦略

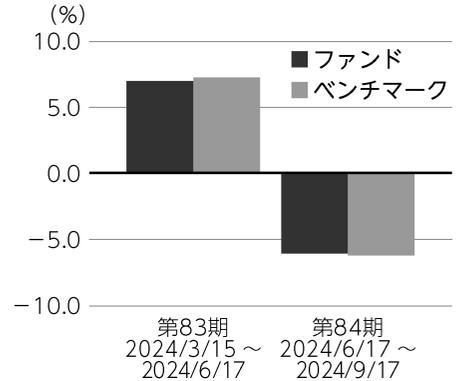
デュレーション戦略は、期間の初めからデュレーションをベンチマーク対比で長めとしており、豪州金利が低下した場面で、ベンチマーク比でのパフォーマンスにプラスに寄与しました。

### マイナス要因

#### 信託報酬等

信託報酬等のコストは、ベンチマーク比でのパフォーマンスにマイナスに影響しました。

### 基準価額とベンチマークの対比（騰落率）



※ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

## 分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）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いて運用します。

### 分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第83期	第84期
	2024年3月16日～2024年6月17日	2024年6月18日～2024年9月17日
当期分配金（対基準価額比率）	<b>30</b> (0.314%)	<b>30</b> (0.335%)
当期の収益	30	30
当期の収益以外	—	—
翌期繰越分配対象額	2,766	2,787

(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

(作成対象期間末での見解です。)

足元、米連邦準備制度理事会（F R B）が利下げに踏み切る可能性を示しているほか、イングランド銀行（B O E）などの他の主要先進国の中央銀行が利下げを実施しています。

豪州準備銀行（R B A）は他の中央銀行の政策転換から遅れをとる傾向があることから、足元の10年物豪州債券の利回りは魅力的な水準にあると考えています。

豪州のインフレは、今年の後半に鈍化に向かうことが予想され、R B Aは今後インフレ目標を達成することへの自信をより深めるものと思われます。労働市場のひっ迫が徐々に緩和する兆しがみられるうえ、消費は弱含んでおり、豪州経済は当面の間、財政支出に依存したトレンドを下回る水準での成長が続くと想定されます。現在の政策金利はすでに制約的な水準にあり、R B Aは世界的な金融緩和

の流れに加わり、2025年序盤に利下げを開始することを想定したポジションに、より大きな投資機会があるとみています。

## 金利

当ファンドでは現在、デュレーションをベンチマークに対し長めの水準としています。今後も金利水準や市場心理などを考慮しながら、必要に応じて機動的なデュレーション調整を行います。

## 種別構成

種別配分に関しては、社債など非国債セクターの組み入れを高めにして運用します。新規発行銘柄については、割安と判断される場合には積極的に組み入れを検討します。

2024年3月16日～2024年9月17日

## ▶ 1万口当たりの費用明細

項目	第83期～第84期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	57	0.616	(a) 信託報酬 = 作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (作成期中の日数 ÷ 年間日数)
( 投 信 会 社 )	(29)	(0.308)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
( 販 売 会 社 )	(26)	(0.280)	交付運用報告書等各种書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
( 受 託 会 社 )	(3)	(0.028)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.002	(b) 売買委託手数料 = 作成期中の売買委託手数料 ÷ 作成期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(c) その他費用	2	0.021	(c) その他費用 = 作成期中のその他費用 ÷ 作成期中の平均受益権口数
( 保 管 費 用 )	(2)	(0.019)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
( 監 査 費 用 )	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
( そ の 他 )	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	59	0.639	

作成期中の平均基準価額は、9,297円です。

(注) 作成期間の費用（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。

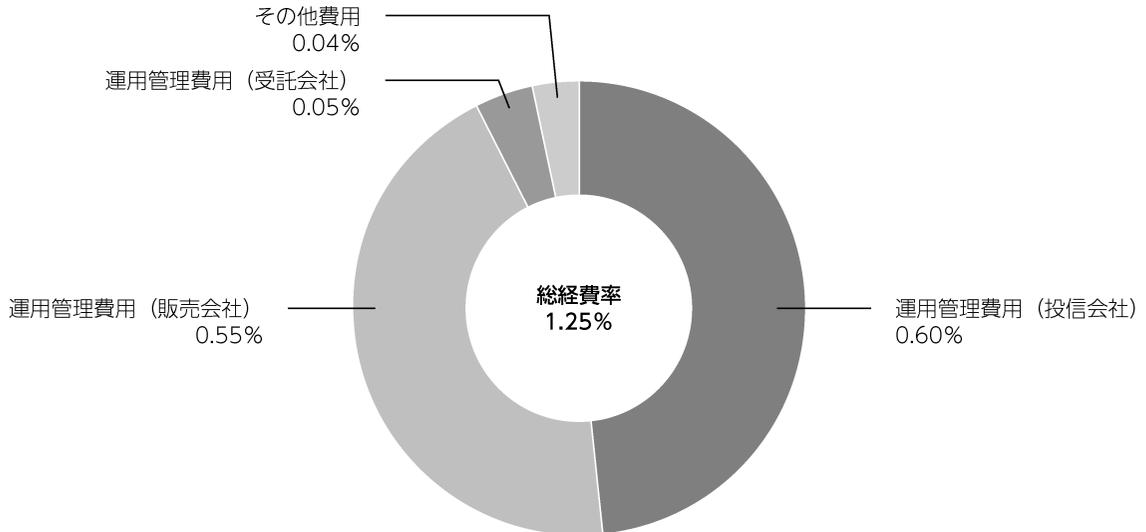
(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 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）を作成期間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

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成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1.25%**です。



(注) 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、売買委託手数料及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) 前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

(2024年3月16日～2024年9月17日)

## 公社債

			第83期～第84期	
			買付額	売付額
外国	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 2,339	千オーストラリアドル 2,462
		地方債証券	592	—
		特殊債券	2,895	7,062
		社債券	5,266	1,895 (1,560)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ( )内は償還等による増減分で、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		第83期～第84期			
		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 1,850	百万円 1,868	百万円 320	百万円 304

(注) 外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月の月初から決算日までの分については決算日)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

(2024年3月16日～2024年9月17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

(2024年9月17日現在)

## 外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	第84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 54,465	千オーストラリアドル 50,952	千円 4,834,913	% 92.6	% —	% 48.4	% 32.8	% 11.4
合 計	54,465	50,952	4,834,913	92.6	—	48.4	32.8	11.4

(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) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	第84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						
国債証券	1 AUST GOVT 301221	1.0	1,500	1,285	121,998	2030/12/21
	2.75 AUST GOVT 291121	2.75	1,600	1,546	146,754	2029/11/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	700	632	59,983	2035/6/21
	2.75 AUST GOVT 410521	2.75	1,400	1,163	110,421	2041/5/21
	3 AUST GOVT 470321	3.0	1,000	809	76,857	2047/3/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	300	273	25,985	2039/6/21
	3.5 AUST GOVT 341221	3.5	1,300	1,263	119,884	2034/12/21
	4.25 AUST GOVT 340621	4.25	500	517	49,136	2034/6/21
地方債証券	1.75 AUST CAPITAL 311023	1.75	700	596	56,601	2031/10/23
	4.5 AUST CAPITAL 341023	4.5	600	592	56,176	2034/10/23
	5.25 AUST CAPITAL 361023	5.25	600	621	58,994	2036/10/23
特殊債券	1 IADB 280804	1.0	500	449	42,659	2028/8/4
	1 NBN CO LTD 251203	1.0	1,500	1,439	136,547	2025/12/3
	1.5 VICTORIA 301120	1.5	1,100	945	89,753	2030/11/20
	1.75 NEWSWALES 340320	1.75	900	706	67,061	2034/3/20
	1.75 SOUTH AUST G 340524	1.75	500	390	37,007	2034/5/24
	2 NEWSWALES 330308	2.0	1,700	1,412	133,986	2033/3/8
	2 SOUTH AUST GOVT 360523	2.0	600	450	42,792	2036/5/23
	2 VICTORIA 350917	2.0	1,900	1,448	137,446	2035/9/17
	2 VICTORIA 371120	2.0	600	427	40,533	2037/11/20
	2.25 VICTORIA 330915	2.25	800	664	63,033	2033/9/15
	2.25 VICTORIA 341120	2.25	1,400	1,123	106,574	2034/11/20
	2.5 NORTHERN TERR 320521	2.5	600	523	49,683	2032/5/21
	2.5 TASMANIAN PUB 330121	2.5	800	694	65,896	2033/1/21
	2.5 VICTORIA 291022	2.5	100	93	8,872	2029/10/22
	4.3 SWEDISH CRE 280530	4.3	600	605	57,464	2028/5/30
	4.45 CPPIB CAPITA 270901	4.45	600	609	57,858	2027/9/1
	4.475 KOREA HOUSI 260406	4.475	700	699	66,368	2026/4/6
	4.75 NEWSWALES 350220	4.75	1,000	1,010	95,875	2035/2/20
	4.75 NEWSWALES 370220	4.75	700	696	66,057	2037/2/20
	4.75 SOUTH AUST G 380524	4.75	500	494	46,936	2038/5/24
4.75 TASMANIAN PU 350125	4.75	600	603	57,223	2035/1/25	
5.25 NORTHERN TER 340321	5.25	500	517	49,112	2034/3/21	
普通社債券	1.1 ING BANK (AUS 260819	1.1	600	566	53,739	2026/8/19
	1.85 WOOLWORTHS G 271115	1.85	500	465	44,139	2027/11/15
	1.9 DWPF FINANCE 280804	1.9	500	448	42,547	2028/8/4
	2.1 BANK OF QUEEN 261027	2.1	1,000	950	90,166	2026/10/27
	2.132 VICTORIA PO 280421	2.132	500	457	43,433	2028/4/21
	2.25 MACQUARIE UN 300522	2.25	600	526	49,922	2030/5/22
	2.35 NATIONAL A 250225	2.35	1,600	1,584	150,323	2025/2/25
	2.543 NSW ELECTRI 300923	2.543	800	686	65,098	2030/9/23
	2.65 ORIGIN ENERG 271111	2.65	500	471	44,724	2027/11/11
	2.7 WESTPAC BAN 250317	2.7	500	495	47,017	2025/3/17
	2.9 AURIZON NETWO 300902	2.9	600	526	49,981	2030/9/2

銘	柄	第84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					
	3.026 CIP FUNDING 271216	3.026	1,000	944	89,596	2027/12/16
	3.15 WESTCONNEX F 310331	3.15	800	716	67,988	2031/3/31
	3.25 SUNCORP-MET 260824	3.25	500	490	46,558	2026/8/24
	3.5 UNIVERSITY OF 271208	3.5	500	486	46,130	2027/12/8
	3.75 UNI OF TECHN 270720	3.75	500	492	46,776	2027/7/20
	3.8 PACIFIC NATIO 310908	3.8	600	524	49,776	2031/9/8
	4.3 INCITEC PIVOT 260318	4.3	500	496	47,105	2026/3/18
	4.4 SUNCORP-MET 250822	4.4	500	499	47,441	2025/8/22
	4.5 ING BANK (AUS 290526	4.5	700	702	66,685	2029/5/26
	4.674 UNIVERSITY 290822	4.674	500	501	47,584	2029/8/22
	4.75 SUNCORP-MET 290319	4.75	500	508	48,230	2029/3/19
	4.753 CLIFFORD CA 280831	4.753	500	515	48,949	2028/8/31
	4.8 WESTPAC BAN 280216	4.8	1,500	1,528	145,069	2028/2/16
	4.837 ING BANK (A 270322	4.837	500	506	48,052	2027/3/22
	4.95 AUST & NZ B 290205	4.95	600	615	58,441	2029/2/5
	5 COMMONWEALT 280113	5.0	900	921	87,462	2028/1/13
	5 SVENSKA HANDELS 280302	5.0	600	612	58,088	2028/3/2
	5.1 BENDIGO AND 270514	5.1	500	509	48,323	2027/5/14
	5.1 BENDIGO AND 280616	5.1	1,000	1,025	97,265	2028/6/16
	5.1082 ETSА UTILI 270603	5.1082	500	508	48,266	2027/6/3
	5.2 SUNCORP-MET 280712	5.2	500	516	49,021	2028/7/12
	5.35 NEW YORK LIF 280919	5.35	1,300	1,340	127,152	2028/9/19
	5.472 REGISTRY FI 311219	5.472	700	722	68,601	2031/12/19
	5.815 BANK OF AM 281030	5.815	800	843	80,074	2028/10/30
	5.95 WORLEY FIN S 281013	5.95	500	512	48,631	2028/10/13
	6.061 NETWORK FIN 300619	6.061	500	526	49,990	2030/6/19
	6.781 AUSTRALIAN 291108	6.781	500	532	50,531	2029/11/8
	FRN TORR 2021-1 A 521109	4.892	259	257	24,479	2052/11/9
	FRN TRTN 2021-1 A 521022	5.1425	105	105	10,006	2052/10/22
合 計					4,834,913	

(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。

### 先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	第84期末	
			買 建 額	売 建 額
外国	債券先物取引	AUST10Y	百万円 458	百万円 -

(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

(2024年9月17日現在)

項 目	第84期末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 4,834,913	% 91.2
コール・ローン等、その他	464,627	8.8
投資信託財産総額	5,299,540	100.0

(注) 作成期末における外貨建純資産 (5,219,620千円) の投資信託財産総額 (5,299,540千円) に対する比率は98.5%です。

(注) 外貨建資産は、作成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、作成期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 オーストラリアドル=94.89円		
--------------------	--	--

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第83期末	第84期末
	2024年6月17日現在	2024年9月17日現在
	円	円
(A) 資産	5,828,473,645	5,346,980,215
コール・ローン等	263,358,805	248,617,502
公社債(評価額)	5,349,576,538	4,834,913,997
未収入金	3,394,821	49,635,875
未収利息	40,696,647	44,766,988
前払費用	4,789,216	1,344,971
その他未収収益	—	1,486,866
差入委託証拠金	166,657,618	166,214,016
(B) 負債	109,217,195	128,190,799
前受収益	42,189	—
未払金	72,919,000	83,172,552
未払収益分配金	17,987,155	17,520,362
未払解約金	719,914	10,631,175
未払信託報酬	17,486,965	16,807,151
その他未払費用	61,972	59,559
(C) 純資産総額(A-B)	5,719,256,450	5,218,789,416
元本	5,995,718,380	5,840,120,767
次期繰越損益金	△ 276,461,930	△ 621,331,351
(D) 受益権総口数	5,995,718,380口	5,840,120,767口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,539円	8,936円

## ○損益の状況

項 目	第83期	第84期
	2024年3月16日～ 2024年6月17日	2024年6月18日～ 2024年9月17日
(A) 配当等収益	52,193,880	47,089,402
受取利息	51,244,027	45,969,185
その他収益金	949,863	1,120,217
支払利息	△ 10	—
(B) 有価証券売買損益	345,717,510	△ 376,102,064
売買益	372,032,534	116,990,011
売買損	△ 26,315,024	△ 493,092,075
(C) 先物取引等取引損益	△ 2,940,283	11,949,102
取引益	4,719,042	14,906,792
取引損	△ 7,659,325	△ 2,957,690
(D) 信託報酬等	△ 18,123,562	△ 17,361,089
(E) 当期損益金 (A+B+C+D)	376,847,545	△ 334,424,649
(F) 前期繰越損益金	92,683,525	438,504,646
(G) 追加信託差損益金	△ 728,005,845	△ 707,890,986
(配当等相当額)	( 1,207,033,251)	( 1,177,320,069)
(売買損益相当額)	(△1,935,039,096)	(△1,885,211,055)
(H) 計 (E+F+G)	△ 258,474,775	△ 603,810,989
(I) 収益分配金	△ 17,987,155	△ 17,520,362
次期繰越損益金 (H+I)	△ 276,461,930	△ 621,331,351
追加信託差損益金	△ 728,005,845	△ 707,890,986
(配当等相当額)	( 1,207,033,251)	( 1,177,320,069)
(売買損益相当額)	(△1,935,039,096)	(△1,885,211,055)
分準備積立金	451,543,915	450,712,597
繰越損益金	—	△ 364,152,962

(注) (B) 有価証券売買損益および(C) 先物取引等取引損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (D) 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) (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。

## &lt;注記事項&gt;

- ①作成期首（前作成期末）元本額 6,133,953,921円  
作成期中追加設定元本額 54,167,164円  
作成期中一部解約元本額 348,000,318円  
また、1口当たり純資産額は、作成期末0.8936円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は621,331,351円です。

## ③分配金の計算過程

項 目	2024年3月16日～ 2024年6月17日	2024年6月18日～ 2024年9月17日
費用控除後の配当等収益額	49,799,757円	29,728,313円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	318,481,372円	—円
収益調整金額	1,207,033,251円	1,177,320,069円
分準備積立金額	101,249,941円	438,504,646円
当ファンドの分配対象収益額	1,676,564,321円	1,645,553,028円
1万口当たり収益分配対象額	2,796円	2,817円
1万口当たり分配金額	30円	30円
収益分配金金額	17,987,155円	17,520,362円

④信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し、次に定める率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

信託財産の純資産総額

350億円未満の部分 年10,000分の25

350億円以上700億円未満の部分 年10,000分の20

700億円以上の部分 年10,000分の15

## ○分配金のお知らせ

	第83期	第84期
1 万口当たり分配金 (税込み)	30円	30円

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

\*三菱UFJアセットマネジメントでは本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。