



FRANKLIN  
TEMPLETON

# フランクリン・templton・ 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20期 決算日 2023年6月12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	「フランクリン・templton・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。
	フランクリン・templton・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合わせ先：  
フランクリン・templton・ジャパン株式会社

お問合わせ窓口

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、「フランクリン・templton・オーストラリア債券ファンド(年2回決算型)」は、2023年6月12日に第20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。

## フランクリン・templton・ジャパン株式会社

〒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・templton・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 配 金	騰 落 率			
	円	円	%	%	%	百万円
16期(2021年6月10日)	11,651	0	7.0	98.8	△0.6	799
17期(2021年12月10日)	10,931	0	△6.2	98.4	0.4	647
18期(2022年6月10日)	11,495	0	5.2	98.1	0.4	632
19期(2022年12月12日)	11,404	0	△0.8	98.6	0.5	551
20期(2023年6月12日)	11,450	0	0.4	98.2	0.7	520

(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
		騰 落 率	騰 落 率		
(期首)	円	%	%	%	%
2022年12月12日	11,404	—	98.6	0.5	
12月末	10,710	△6.1	97.2	0.6	
2023年1月末	11,286	△1.0	98.2	△1.1	
2月末	11,139	△2.3	98.6	△0.1	
3月末	11,193	△1.9	98.7	△4.4	
4月末	11,093	△2.7	98.8	△1.2	
5月末	11,265	△1.2	98.7	0.6	
(期末)					
2023年6月12日	11,450	0.4	98.2	0.7	

(注) 騰落率は期首比です。

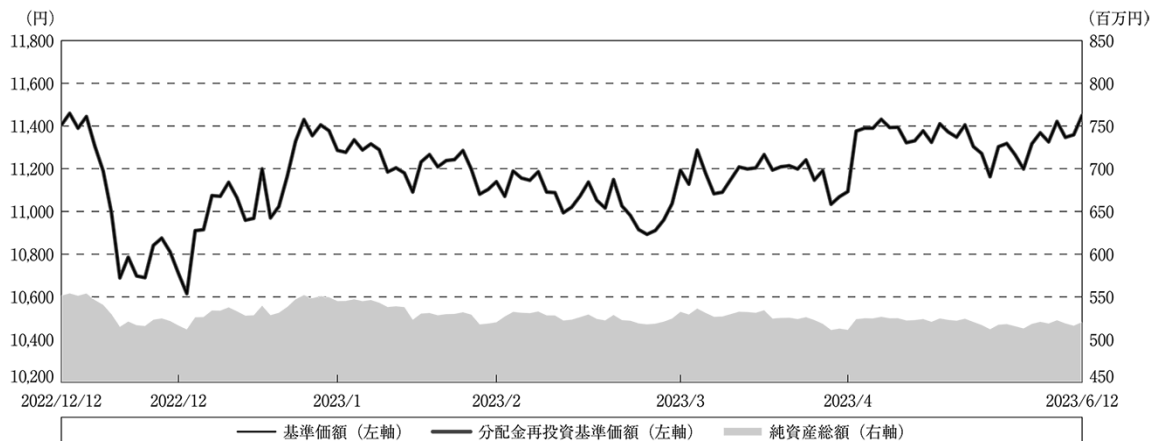
(注) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(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

(2022年12月13日～2023年6月12日)



期 首：11,404円

期 末：11,450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(2022年12月12日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

## ○基準価額の主な変動要因

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、利回りが上昇（価格は下落）しました。

期の前半は、オーストラリア準備銀行（RBA）が利上げを継続するとともに、RBA理事会後の声明がタカ派的と受け止められたことから、利回りは上昇しました。その後は、米連邦準備制度理事会（FRB）が利上げペースを緩めるとの期待から、米国債券利回りが低下基調となる中、オーストラリア債券の利回りも低下（価格は上昇）しました。

期の半ばは、根強いRBAの利上げ観測を背景に、利回りは上昇に転じました。ただその後は、欧米の金融システムに対する不安が台頭したことから、投資家のリスク回避姿勢が強まる中、オーストラリア国債の利回りは低下しました。

期の後半は、欧米の金融システムに対する過度な懸念が後退し、投資家心理が改善したことから利回りは上昇しました。その後も、根強いインフレに対する懸念をRBAが表明し、追加利上げを決定したことから、利回りの上昇が続きました。

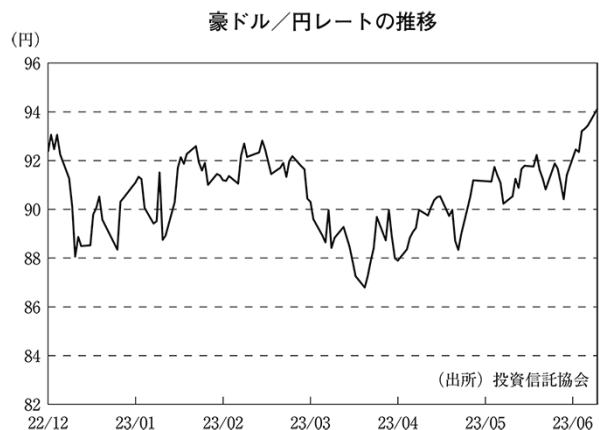
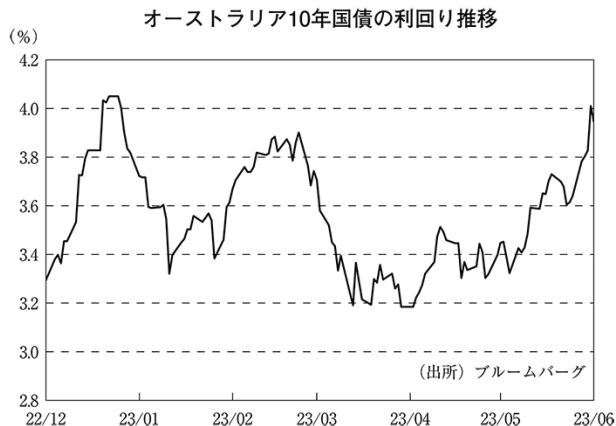
社債セクターについては、国債利回りが上昇する中、社債利回りも上昇しました。社債スプレッド（国債に対する上乘せ利回り）については、縮小しました。

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、日銀が大規模な金融緩和策を修正するとの思惑が浮上し、円が他の主要通貨に対して急騰する中、豪ドル売り・円買いが先行しました。しかしその後は、日銀が金融緩和策の修正を見送ったことから、豪ドルは円に対して底堅く推移しました。

期の半ばは、欧米の金融システムに対する不安が台頭する中、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・円買いが強まりました。

期の後半は、海外における銀行システムの混乱に対する過度な懸念が後退したことから、豪ドルは反発しました。円が主要通貨に対して下落基調で推移したことも、豪ドル高・円安の要因となりました。



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「フランクリン・templton・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、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

(2022年12月13日～2023年6月12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20期
	2022年12月13日～ 2023年6月12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	3,997

(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

(2022年12月13日～2023年6月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 76	% 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 ）	(37)	(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	0.029	(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	79	0.717	
期中の平均基準価額は、11,114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。

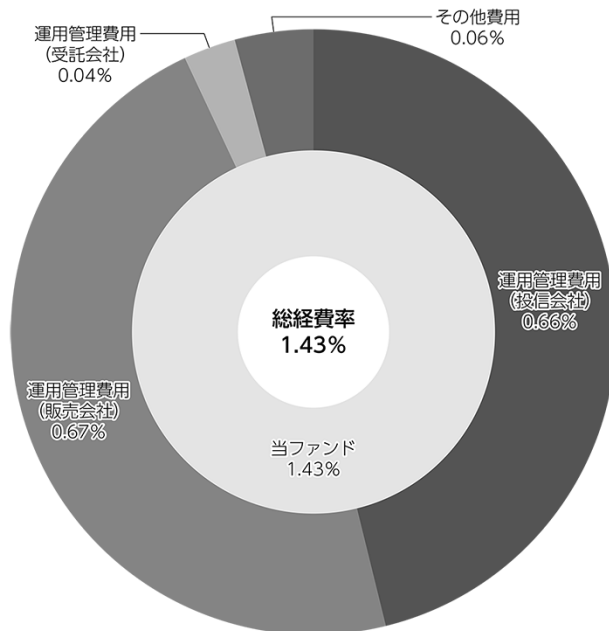
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

(2022年12月13日～2023年6月12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
フランクリン・テンプルトン・豪ドル債券マザーファンド	千口 9,472	千円 25,844	千口 22,798	千円 62,610

(注) 単位未満は切捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年12月13日～2023年6月12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

(2022年12月13日～2023年6月12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

(2022年12月13日～2023年6月12日)

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2023年6月12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
フランクリン・テンプルトン・豪ドル債券マザーファンド	千口 199,637	千口 186,311	千円 524,225

(注) 単位未満は切捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。



## ○投資信託財産の構成

(2023年6月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
フランクリン・templton・豪ドル債券マザーファンド	千円 524,225	% 99.4
コール・ローン等、その他	3,347	0.6
投資信託財産総額	527,572	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(注) フランクリン・templton・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(44,507,373千円)の投資信託財産総額(45,196,895千円)に対する比率は98.5%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12日における邦貨換算レートは1オーストラリアドル=94.09円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年6月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	527,572,311
フランクリン・テンブルトン・豪ドル債券マザーファンド(評価額)	524,225,095
未収入金	3,347,216
(B) 負債	7,095,989
未払解約金	3,347,216
未払信託報酬	3,617,400
その他未払費用	131,373
(C) 純資産総額(A－B)	520,476,322
元本	454,569,321
次期繰越損益金	65,907,001
(D) 受益権総口数	454,569,321口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,450円

<注記事項>

元本の状況

期首元本額

483,457,437円

期中追加設定元本額

23,190,533円

期中一部解約元本額

52,078,649円

○損益の状況 (2022年12月13日～2023年6月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	6,403,350
売買益	7,196,599
売買損	△ 793,249
(B) 信託報酬等	△ 3,748,773
(C) 当期繰越損益金(A+B)	2,654,577
(D) 前期繰越損益金	39,592,972
(E) 追加信託差損益金	23,659,452
(配当等相当額)	( 115,249,422)
(売買損益相当額)	(△ 91,589,970)
(F) 計(C+D+E)	65,907,001
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	65,907,001
追加信託差損益金	23,659,452
(配当等相当額)	( 115,280,159)
(売買損益相当額)	(△ 91,620,707)
分配準備積立金	66,454,492
繰越損益金	△ 24,206,943

(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96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)	4,474,913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	115,280,159
(D) 分 配 準 備 積 立 金	61,979,579
分 配 対 象 収 益 額(A+B+C+D)	181,734,651
(1万口当たり収益分配対象額)	( 3,997)
収 益 分 配 金	0
(1万口当たり収益分配金)	( 0)

# フランクリン・templton・豪ドル債券マザーファンド

## 運用状況のご報告

第40期 決算日 2023年6月12日

(計算期間：2022年12月13日～2023年6月12日)

－ 受益者のみなさまへ －

法令・諸規則に基づき、「フランクリン・templton・豪ドル債券マザーファンド」の第40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"><li>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。</li><li>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。</li><li>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。</li><li>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。</li><li>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。</li></ol>
主 要 運 用 対 象	主として豪ドル建の国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券及び資産担保証券等を主要投資対象とします。
組 入 制 限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準	価額		債組入比率	債券率	債先物比率	債券率	純総資産額
		騰落	中率					
36期(2021年6月10日)	円		%	%		%		百万円
	27,831		7.8	98.0		△0.6		56,883
37期(2021年12月10日)	26,303		△5.5	97.6		0.4		47,851
38期(2022年6月10日)	27,853		5.9	97.4		0.4		46,092
39期(2022年12月12日)	27,831		△0.1	97.8		0.5		46,917
40期(2023年6月12日)	28,137		1.1	97.5		0.7		44,978

(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	債券率	債先物比率	債券率
		騰落	率				
(期首)	円		%		%		%
2022年12月12日	27,831		—		97.8		0.5
12月末	26,157		△6.0		97.1		0.6
2023年1月末	27,595		△0.8		98.0		△1.1
2月末	27,268		△2.0		98.3		△0.1
3月末	27,431		△1.4		98.3		△4.4
4月末	27,217		△2.2		98.3		△1.2
5月末	27,673		△0.6		98.0		0.6
(期末)							
2023年6月12日	28,137		1.1		97.5		0.7

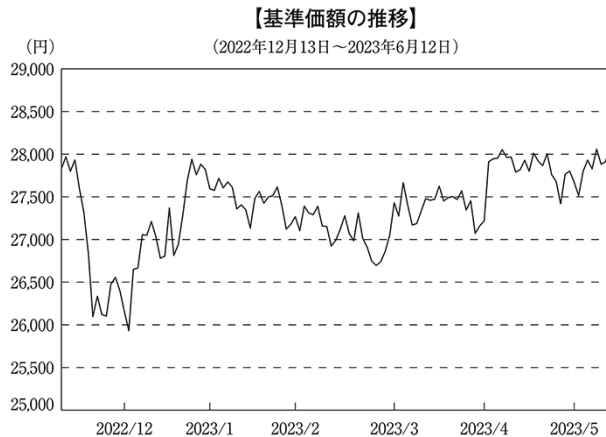
(注) 騰落率は期首比です。

(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

(2022年12月13日～2023年6月12日)



### ○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、利回りが上昇（価格は下落）しました。

期の前半は、オーストラリア準備銀行（RBA）が利上げを継続するとともに、RBA理事会後の声明がタカ派的と受け止められたことから、利回りは上昇しました。その後は、米連邦準備制度理事会（FRB）が利上げペースを緩めるとの期待から、米国債券利回りが低下基調となる中、オーストラリア債券の利回りも低下（価格は上昇）しました。

期の半ばは、根強いRBAの利上げ観測を背景に、利回りは上昇に転じました。ただその後は、欧米の金融システムに対する不安が台頭したことから、投資家のリスク回避姿勢が強まる中、オーストラリア国債の利回りは低下しました。

期の後半は、欧米の金融システムに対する過度な懸念が後退し、投資家心理が改善したことから利回りは上昇しました。その後も、根強いインフレに対する懸念をRBAが表明し、追加利上げを決定したことから、利回りの上昇が続きました。

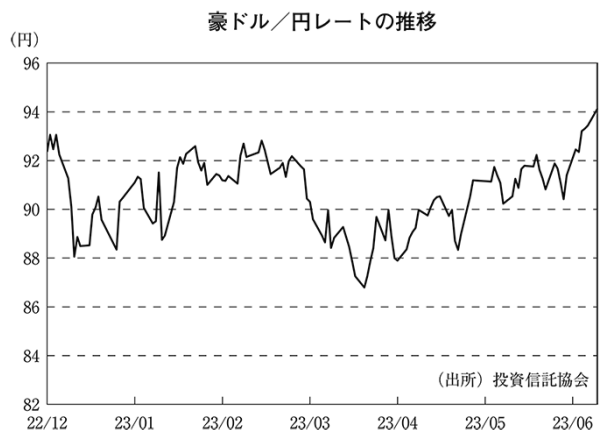
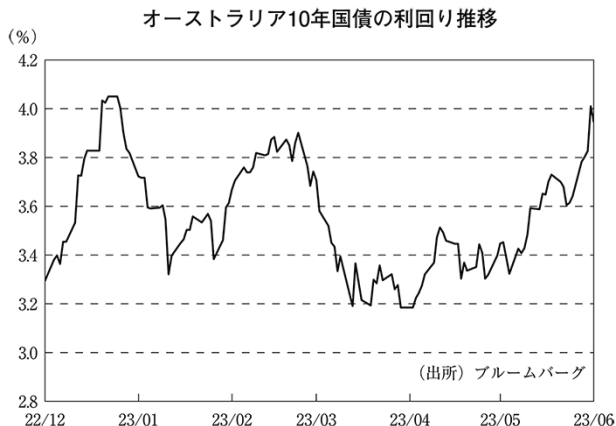
社債セクターについては、国債利回りが上昇する中、社債利回りも上昇しました。社債スプレッド（国債に対する上乘せ利回り）については、縮小しました。

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、日銀が大規模な金融緩和策を修正するとの思惑が浮上し、円が他の主要通貨に対して急騰する中、豪ドル売り・円買いが先行しました。しかしその後は、日銀が金融緩和策の修正を見送ったことから、豪ドルは円に対して底堅く推移しました。

期の半ばは、欧米の金融システムに対する不安が台頭する中、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・円買いが強まりました。

期の後半は、海外における銀行システムの混乱に対する過度な懸念が後退したことから、豪ドルは反発しました。円が主要通貨に対して下落基調で推移したことも、豪ドル高・円安の要因となりました。



## 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、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

(2022年12月13日～2023年6月12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、27,223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

(2022年12月13日～2023年6月12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	4,601	17,018
		地方債証券	9,602	10,634
		特殊債券	509	2,490
		社債券(投資法人債券を含む)	13,252	16,747 (1,000)

(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 10,630	百万円 10,123	百万円 9,623	百万円 9,232

(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

(2022年12月13日～2023年6月12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

(2023年6月12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	千オーストラリアドル	千円	%	%	%	%	%
	511,477	466,195	43,864,344	97.5	—	47.4	32.9	17.2
合 計	511,477	466,195	43,864,344	97.5	—	47.4	32.9	17.2

(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	当 期 末						償還年月日
	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	2.75	5,400	5,064	476,541	2029/11/21	
	AUSTRALIAN GOVT	2.5	520	477	44,895	2030/5/21	
	AUSTRALIAN GOVT	1.0	4,200	3,413	321,197	2030/12/21	
	AUSTRALIAN GOVT	1.5	1,500	1,253	117,931	2031/6/21	
	AUSTRALIAN GOVT	1.0	5,000	3,959	372,526	2031/11/21	
	AUSTRALIAN GOVT	1.25	7,900	6,315	594,199	2032/5/21	
	AUSTRALIAN GOVT	1.75	6,700	5,552	522,392	2032/11/21	
	AUSTRALIAN GOVT	4.5	9,410	9,836	925,490	2033/4/21	
	AUSTRALIAN GOVT	3.75	2,000	1,961	184,566	2034/5/21	
	AUSTRALIAN GOVT	2.75	10,700	9,411	885,484	2035/6/21	
	AUSTRALIAN GOVT	3.75	8,900	8,556	805,091	2037/4/21	
	AUSTRALIAN GOVT	3.25	9,390	8,338	784,596	2039/6/21	
	AUSTRALIAN GOVT	2.75	8,900	7,223	679,636	2041/5/21	
	AUSTRALIAN GOVT	3.0	8,150	6,585	619,663	2047/3/21	
	AUSTRALIAN GOVT	1.75	7,560	4,445	418,308	2051/6/21	
地方債証券	AUCKLAND COUNCIL	3.5	500	480	45,252	2026/3/9	
	AUCKLAND COUNCIL	2.9	700	636	59,930	2027/9/16	
	AUST CAPITAL TERRITORY	3.0	2,000	1,894	178,225	2028/4/18	
	AUST CAPITAL TERRITORY	2.25	1,000	893	84,091	2029/5/22	
	BRITISH COLUMBIA PROV OF	4.25	3,500	3,475	326,976	2024/11/27	

銘柄	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	3.5	1,000	970	91,280	2026/2/4
	MANITOBA PROVANCE	3.75	500	486	45,753	2026/6/9
	MANITOBA PROVANCE	3.5	1,500	1,407	132,465	2028/8/22
	NEW S WALES TREAS CORP	3.0	3,000	2,879	270,902	2027/5/20
	NEW S WALES TREAS CORP	3.0	2,500	2,376	223,578	2028/3/20
	NEW S WALES TREAS CORP	3.0	4,840	4,478	421,347	2030/2/20
	NEW S WALES TREASURY	3.0	6,500	6,092	573,266	2029/4/20
	NEW S WALES TREASURY	2.0	9,900	8,333	784,052	2031/3/20
	NEW S WALES TREASURY	1.5	2,500	1,957	184,206	2032/2/20
	NEW S WALES TREASURY	2.0	3,000	2,380	223,942	2033/3/8
	NEW S WALES TREASURY	1.75	500	373	35,147	2034/3/20
	NEW S WALES TREASURY	4.75	2,000	1,989	187,203	2035/2/20
	NORTHERN TERRITORY TREAS	2.75	1,000	950	89,385	2027/4/21
	NORTHERN TERRITORY TREAS	3.5	2,000	1,936	182,235	2028/4/21
	NORTHERN TERRITORY TREAS	2.0	1,000	878	82,703	2029/5/21
	NORTHERN TERRITORY TREAS	3.75	4,000	3,670	345,321	2033/4/21
	NORTHERN TERRITORY TREAS	4.5	500	475	44,751	2035/3/21
	PROVINCE OF QUEBEC	3.7	1,000	972	91,523	2026/5/20
	QUEBEC PROVINCE	4.2	3,000	2,976	280,068	2025/3/10
	QUEENSLAND TREASURY	3.25	4,200	4,096	385,398	2026/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	2.75	4,000	3,794	357,015	2027/8/20
	QUEENSLAND TREASURY	3.25	7,100	6,813	641,054	2028/7/21
	QUEENSLAND TREASURY	2.5	4,200	3,848	362,102	2029/3/6
	QUEENSLAND TREASURY	3.25	3,100	2,941	276,733	2029/8/21
	QUEENSLAND TREASURY	1.75	4,700	3,858	363,041	2031/8/21
	QUEENSLAND TREASURY	1.5	2,200	1,710	160,936	2032/8/20
	QUEENSLAND TREASURY	6.5	2,500	2,881	271,154	2033/3/14
	QUEENSLAND TREASURY	1.75	400	299	28,137	2034/7/20
	SOUTH AUST GOVT FIN	3.0	4,500	4,355	409,795	2026/7/20
	SOUTH AUST GOVT FIN	3.0	1,200	1,137	107,063	2028/5/24
	SOUTH AUST GOVT FIN	2.75	2,500	2,267	213,363	2030/5/24
	SOUTH AUST GOVT FIN	1.75	1,000	797	75,056	2032/5/24
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3.25	1,500	1,463	137,736	2026/2/19
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3.25	2,000	1,919	180,596	2028/1/24
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	4.0	550	520	48,933	2034/1/20
	TREASURY CORP VICTORIA	5.5	3,400	3,541	333,203	2026/11/17
	TREASURY CORP VICTORIA	3.0	9,700	9,134	859,488	2028/10/20
	TREASURY CORP VICTORIA	2.5	5,500	4,952	465,966	2029/10/22
	TREASURY CORP VICTORIA	4.75	1,600	1,631	153,547	2030/11/20
	TREASURY CORP VICTORIA	1.5	3,900	3,190	300,194	2030/11/20
	TREASURY CORP VICTORIA	1.5	3,000	2,382	224,144	2031/9/10
	TREASURY CORP VICTORIA	4.25	900	874	82,277	2032/12/20
	TREASURY CORP VICTORIA	2.25	4,300	3,439	323,621	2033/9/15
	TREASURY CORP VICTORIA	2.25	2,800	2,160	203,253	2034/11/20
	TREASURY CORP VICTORIA	2.0	2,700	1,975	185,901	2035/9/17
	WESTERN AUST TREAS CORP	3.0	1,000	966	90,949	2026/10/21
	WESTERN AUST TREAS CORP	3.0	1,500	1,435	135,096	2027/10/21
	WESTERN AUST TREAS CORP	3.25	1,820	1,748	164,537	2028/7/20

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	
地方債証券	WESTERN AUST TREAS CORP	2.75	700	645	60,756	2029/7/24
	WESTERN AUST TREAS CORP	1.75	600	491	46,206	2031/10/22
	WESTERN AUST TREAS CORP	2.0	1,900	1,465	137,870	2034/10/24
特殊債券 (除く金融債)	ASIAN DEVELOPMENT BANK	3.4	3,000	2,882	271,176	2027/9/10
	ASIAN DEVELOPMENT BANK	3.3	500	473	44,526	2028/8/8
	CORP ANDINA DE FOMENTO	6.25	1,000	1,002	94,334	2023/11/8
	CORP ANDINA DE FOMENTO	4.5	8,000	7,773	731,365	2025/6/5
	EUROPEAN INVESTMENT BANK	3.3	1,500	1,433	134,854	2028/2/3
	EUROPEAN INVESTMENT BANK	4.2	500	494	46,551	2028/8/21
	EUROPEAN INVESTMENT BANK	3.3	600	561	52,820	2029/5/25
	INTER-AMERICAN DEVEL BK	3.1	500	471	44,355	2028/2/22
	INTL FINANCE CORP	3.2	1,500	1,448	136,313	2026/7/22
	INTL FINANCE CORP	4.45	500	501	47,139	2027/5/14
	KFW	3.2	3,000	2,897	272,590	2026/9/11
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	4.75	2,500	2,523	237,436	2026/5/6
	NORDIC INVESTMENT BANK	3.3	1,000	955	89,933	2027/8/16
普通社債券 (含む投資法人債券)	AGI FINANCE PTY LTD	2.119	1,000	874	82,294	2027/6/24
	AGI FINANCE PTY LTD	1.8152	1,900	1,545	145,370	2028/11/23
	AIRSERVICES AUSTRALIA	5.4	500	514	48,391	2028/11/15
	AIRSERVICES AUSTRALIA	2.2	500	420	39,566	2030/5/15
	APPF COMMERCIAL FINAN	3.6	1,900	1,496	140,833	2031/11/11
	APPLE INC	3.6	1,000	970	91,311	2026/6/10
	AUST & NZ BANKING FRN	6.405	500	497	46,830	2034/9/20
	AUST & NZ BANKING GROUP	1.55	1,500	1,441	135,661	2024/8/29
	AUST & NZ BANKING GROUP	1.65	1,500	1,425	134,161	2025/1/16
	AUST & NZ BANKING GROUP	4.05	1,000	984	92,629	2025/5/12
	AUST & NZ BANKING GROUP	5.35	900	912	85,902	2027/11/4
	AUSTRALIAN CATHOLIC UNI	3.7	1,290	1,225	115,314	2027/8/3
	AUSTRALIAN GAS LIGHT	2.1486	1,900	1,620	152,489	2028/4/28
	AUSTRALIAN GAS LIGHT	2.82	1,000	785	73,911	2031/4/28
	AUSTRALIAN NATIONAL UNIV	3.98	1,000	983	92,533	2025/11/18
	BANCO SANTANDER SA	5.678	1,300	1,287	121,153	2028/3/9
	BANK OF QUEENSLAND	4.7	800	778	73,251	2027/1/27
	BENDIGO AND ADELAIDE BK	5.1	600	596	56,111	2028/6/16
	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN	3.5	2,000	1,922	180,844	2027/7/19
	BNG BANK NV	3.3	1,000	942	88,722	2028/7/17
	BNG BANK NV	3.3	2,000	1,864	175,459	2029/4/26
	BPCE SA	1.8	3,000	2,858	268,989	2024/9/11
	BPCE SA	2.0	2,500	2,326	218,945	2025/6/5
	BPCE SA	5.2018	1,000	985	92,685	2025/9/29
	BWP TRUST	3.3	2,100	1,989	187,168	2026/4/10
	BWP TRUST	2.2	1,250	1,071	100,861	2028/3/24
	CHARTER HALL EXCH FIN	2.317	1,200	929	87,438	2030/9/25
	CIBC AUSTRALIA	4.4	1,000	988	93,041	2025/7/15
	COCA-COLA CO	3.25	1,000	984	92,660	2024/6/11
	COM BK AUSTRALIA	4.75	1,500	1,497	140,880	2024/5/27
	COMMONWEALTH BANK AU FRN	6.86	800	815	76,721	2032/11/9
COMMONWEALTH BANK AUST	4.2	700	689	64,889	2025/8/18	

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)	COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	3,000	2,838	267,100	2026/11/17
		COMMONWEALTH BANK AUST	2.4	2,100	1,922	180,880	2027/1/14
		COMMONWEALTH BANK AUST	4.4	3,000	2,936	276,302	2027/8/18
		COMMONWEALTH BANK AUST	5.0	750	751	70,695	2028/1/13
		CPPIB CAPITAL INC	4.4	700	696	65,571	2026/1/16
		CPPIB CAPITAL INC	4.45	800	796	74,926	2027/9/1
		CREDIT AGRICOLE SA	5.3636	500	495	46,616	2028/6/1
		DBS BANK LTD	4.678	500	497	46,785	2026/2/24
		DEUTSCHE BAHN FIN GMBH	3.8	1,000	947	89,138	2027/9/27
		DEXUS FINANCE PTY LTD	4.75	1,500	1,478	139,122	2025/11/5
		DEXUS FINANCE PTY LTD	4.25	3,200	3,050	287,045	2027/5/11
		DEXUS FINANCE PTY LTD	2.5	1,600	1,299	122,307	2029/10/17
		DEXUS FINANCE PTY LTD	3.0	1,500	1,151	108,304	2032/2/3
		DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.75	1,000	989	93,065	2025/6/16
		DWPF FINANCE PTY LTD	1.9	1,700	1,399	131,680	2028/8/4
		DWPF FINANCE PTY LTD	2.6	2,430	1,752	164,877	2032/8/4
		EDITH COWAN UNIVERSITY	3.0	1,500	1,333	125,477	2029/4/11
		EDITH COWAN UNIVERSITY	2.741	600	460	43,358	2033/7/15
		ETSA UTILITIES FINANCE	3.5	4,500	4,412	415,169	2024/8/29
		FONTERRA COOPERATIVE GRO	5.5	2,500	2,508	236,005	2024/2/26
		FONTERRA COOPERATIVE GRO	4.0	2,500	2,384	224,402	2027/11/2
		GAIF BOND ISSUER P/L	2.584	3,100	2,748	258,559	2027/11/18
		GAIF BOND ISSUER P/L	1.9	1,600	1,305	122,801	2028/12/14
		GENERAL PROPERTY TRUST	2.849	600	453	42,657	2032/2/20
		GPT RE LTD	3.6725	2,900	2,846	267,840	2024/9/19
		GPT WHL OFFICE FD N01	4.52	1,950	1,882	177,111	2027/2/22
		GPT WHL OFFICE FD N01	3.222	2,300	1,807	170,096	2031/11/5
		HSBC LTD SYDNEY	5.1	500	499	47,037	2028/3/3
		ICPF FINANCE PTY LTD	4.25	2,500	2,298	216,279	2027/4/21
		ICPF FINANCE PTY LTD	2.725	2,900	2,266	213,245	2030/10/11
		ING BANK (AUSTRALIA) LTD	1.45	1,000	958	90,221	2024/8/20
		JOHN DEERE FINANCIAL LTD	1.75	3,000	2,877	270,702	2024/10/4
		JOHN DEERE FINANCIAL LTD	4.9	500	497	46,797	2025/7/28
		JP MORGAN CHASE & CO	4.5	3,000	2,922	275,015	2026/1/30
		KFW	2.0	2,000	1,840	173,165	2027/2/15
		KOMMUNALBANKEN AS	3.0	1,000	950	89,418	2026/12/9
		KOMMUNALBANKEN AS	4.35	1,000	990	93,241	2028/1/18
		KOMMUNALBANKEN AS	2.4	1,000	869	81,765	2029/11/21
		KOREA DEVELOPMENT BANK	1.5	2,000	1,911	179,862	2024/8/29
		KOREA EXPRESSWAY CORP	0.928	500	495	46,625	2023/9/2
		L-BANK BW FOERDERBANK	3.45	1,000	941	88,538	2028/4/11
		LANDWIRTSCH. RENTENBANK	3.2	1,000	930	87,513	2029/5/25
		LLOYDS BANKING GROUP PLC	5.802	500	494	46,532	2029/3/17
		MACQUARIE BANK LTD	1.75	1,500	1,444	135,907	2024/8/7
		MACQUARIE UNIVERSITY	3.5	2,000	1,830	172,270	2028/9/7
		MACQUARIE UNIVERSITY	2.25	2,700	2,210	207,965	2030/5/22
		METLIFE GLOB FUNDING I	4.0	3,767	3,536	332,724	2027/7/13
		MIRVAC GROUP FINANCE LTD	2.6	1,500	1,240	116,762	2029/9/18

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)					
	MIZUHO BANK LTD/SYDNEY	1.7	2,600	2,497	235,010	2024/8/7
	MONASH UNIVERSITY	4.05	600	566	53,328	2029/4/6
	MTR CORP CI LTD	3.3	1,000	923	86,862	2027/6/28
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	2.15	1,200	1,167	109,835	2024/6/19
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	5.0	2,900	2,903	273,163	2024/6/25
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	3.9	1,900	1,863	175,381	2025/5/30
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	2.9	1,300	1,209	113,826	2027/2/25
	NATIONWIDE BLDG SOCIETY	5.35	1,000	981	92,330	2028/3/15
	NATWEST MARKETS PLC	5.0546	500	492	46,311	2025/8/12
	NBN CO LTD	0.75	1,500	1,424	134,048	2024/9/9
	NBN CO LTD	1.0	3,300	2,991	281,476	2025/12/3
	NBN CO LTD	2.15	1,200	1,032	97,183	2028/6/2
	NBN CO LTD	2.2	2,500	1,962	184,672	2030/12/16
	NEDER FINANCIERINGS-MAAT	4.75	1,500	1,495	140,713	2024/9/11
	NEDER WATERSCHAPSBANK	3.15	1,000	959	90,283	2026/9/2
	NEDER WATERSCHAPSBANK	3.45	1,500	1,424	133,997	2028/7/17
	NEDER WATERSCHAPSBANK	3.3	1,500	1,394	131,247	2029/5/2
	OPTUS FINANCE PTY LTD	1.6	1,000	933	87,837	2025/7/1
	OPTUS FINANCE PTY LTD	2.6	2,000	1,744	164,102	2028/11/24
	OPTUS FINANCE PTY LTD	2.5	3,500	2,877	270,726	2030/7/1
	PACCAR FINANCIAL PTY LTD	0.75	700	673	63,375	2024/5/24
	PACCAR FINANCIAL PTY LTD	0.9	2,000	1,897	178,548	2024/9/24
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	3.75	3,500	3,479	327,390	2023/12/6
	QIC SHOPPING CENTRE FUND	2.0	1,800	1,678	157,894	2025/8/15
	RABOBANK NEDERLAND(AUST)	5.5	3,000	3,011	283,305	2024/4/11
	ROYAL BANK OF CANADA/SYD	3.75	1,300	1,270	119,577	2025/5/6
	SGSP AUSTRALIA ASSETS	3.75	3,100	3,035	285,614	2024/9/27
	SGSP AUSTRALIA ASSETS	1.843	2,700	2,212	208,181	2028/9/15
	SHINHAN BANK	1.183	2,700	2,458	231,351	2025/9/29
	SPARK FINANCE LTD	1.9	1,000	916	86,202	2026/6/5
	SPARK FINANCE LTD	4.0	2,000	1,906	179,337	2027/10/20
	SPARK FINANCE LTD	2.6	3,100	2,592	243,890	2030/3/18
	STOCKLAND TRUST MGMNT	3.3	1,900	1,873	176,230	2024/3/22
	STOCKLAND TRUST MGMNT	2.3	3,000	2,575	242,295	2028/3/24
	SUNCORP-METWAY LTD	1.85	1,000	963	90,690	2024/7/30
	SUNCORP-METWAY LTD	3.25	5,000	4,734	445,473	2026/8/24
	SUNCORP-METWAY LTD	4.8	1,900	1,867	175,683	2027/12/14
	SVENSKA HANDELSBANKEN AB	5.0	500	496	46,754	2028/3/2
	TELSTRA CORP LTD	4.0	3,000	2,910	273,847	2027/4/19
	TELSTRA CORP LTD	4.9	800	797	75,023	2028/3/8
	TORONTO-DOMINION BANK	2.05	2,700	2,610	245,639	2024/7/10
	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	0.85	1,000	947	89,159	2024/9/9
	TRANSPOWER NEW ZEALAND L	4.977	900	902	84,940	2028/11/29
	UBS AG AUSTRALIA	1.2	900	824	77,581	2025/7/30
	UBS AG AUSTRALIA	1.1	2,500	2,229	209,759	2026/2/26
	UNI OF TECHNOLOGY/SYDNEY	3.75	1,830	1,746	164,348	2027/7/20
	UNITED ENERGY DISTRIBUTI	3.85	2,400	2,359	221,981	2024/10/23
	UNITED ENERGY DISTRIBUTI	2.2	2,500	2,267	213,312	2026/10/29

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)					
	UNIVERSITY OF SYDNEY	3.75	2,500	2,449	230,518	2025/8/28
	UNIVERSITY OF WOLLONGONG	3.5	2,000	1,866	175,600	2027/12/8
	UNIVERSITY OF WOLLONGONG	1.746	1,000	832	78,307	2028/12/15
	VICINITY CENTRES	3.5	3,000	2,958	278,369	2024/4/26
	VICINITY CENTRES	4.0	1,370	1,298	122,166	2027/4/26
	VICINITY CENTRES TRUST	4.927	1,400	1,356	127,679	2028/6/2
	VICTORIA POWER NETWORKS	4.0	2,500	2,346	220,762	2027/8/18
	WESFARMERS LTD	1.941	900	769	72,403	2028/6/23
	WESTERN SYDNEY UNI	1.606	700	603	56,770	2027/12/8
	WESTPAC BANKING	2.25	500	485	45,641	2024/8/16
	WESTPAC BANKING	3.8	500	489	46,089	2025/5/20
	WESTPAC BANKING	3.9	700	685	64,497	2025/8/11
	WESTPAC BANKING	2.4	1,500	1,373	129,237	2027/1/25
	WESTPAC BANKING	4.8	500	495	46,660	2028/2/16
	WESTPAC BANKING CORP	2.7	600	577	54,350	2025/3/17
	WSO FINANCE PTY LTD	4.5	1,500	1,455	136,941	2027/3/31
	WSO FINANCE PTY LTD	4.5	2,000	1,929	181,570	2027/9/30
	WSO FINANCE PTY LTD	2.7	1,500	1,231	115,848	2030/6/28
合	計				43,864,344	

(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(10年)2023.6限月	1,021	—
		オーストラリア国債(10年)2023.9限月	2,044	—
国		オーストラリア国債(3年)2023.6限月	—	728
		オーストラリア国債(3年)2023.9限月	—	2,029

(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

(2023年6月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 43,864,344	% 97.1
コール・ローン等、その他	1,332,551	2.9
投資信託財産総額	45,196,895	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(44,507,373千円)の投資信託財産総額(45,196,895千円)に対する比率は98.5%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の仲値により邦貨換算したものです。なお、6月12日における邦貨換算レートは1オーストラリアドル=94.09円です。

## ○特定資産の価格等の調査

(2022年12月13日～2023年6月12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 (2023年6月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	45,177,938,755
コール・ローン等	856,841,412
公社債(評価額)	43,864,344,973
未収利息	326,702,230
前払費用	3,261,489
差入委託証拠金	126,788,651
(B) 負債	199,836,305
未払金	72,386,672
未払解約金	127,447,850
未払利息	1,783
(C) 純資産総額(A-B)	44,978,102,450
元本	15,985,351,069
次期繰越損益金	28,992,751,381
(D) 受益権総口数	15,985,351,069口
1万口当たり基準価額(C/D)	28,137円

<注記事項>

元本の状況

期首元本額

16,857,722,203円

期中追加設定元本額

419,642,976円

期中一部解約元本額

1,292,014,110円

期末における元本の内訳

    フランクリン・テンブルトン・オーストラリア毎月分配型ファンド

13,670,017,259円

    フランクリン・テンブルトン・オーストラリア債券ファンドFD(適格機関投資家専用)

1,534,144,906円

    フランクリン・テンブルトン・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)

566,081,579円

    フランクリン・テンブルトン・オーストラリア債券ファンド(年2回決算型)

186,311,652円

    フランクリン・テンブルトン・オーストラリア債券ファンドFC(適格機関投資家専用)

28,795,673円

○損益の状況 (2022年12月13日～2023年6月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	746,849,570
受取利息	745,773,716
その他収益金	1,225,107
支払利息	△ 149,253
(B) 有価証券売買損益	△ 221,858,876
売買益	843,619,244
売買損	△ 1,065,478,120
(C) 先物取引等取引損益	△ 71,416,323
取引益	129,243,744
取引損	△ 200,660,067
(D) 保管費用等	△ 1,980,862
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	451,593,509
(F) 前期繰越損益金	30,059,650,017
(G) 追加信託差損益金	737,476,995
(H) 解約差損益金	△ 2,255,969,140
(I) 計(E+F+G+H)	28,992,751,381
次期繰越損益金(I)	28,992,751,381

(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。