

*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(2017年6月2日設定)
運用方針	豪ドル建ての国債、州政府債および国際機関債等に分散投資を行い、安定した収益の確保および信託財産の成長をめざして運用を行います。ブルームバーグオーストラリア債券(Govt)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-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A-格相当以上の格付を取得しているものに限ります。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。ただし、市況動向等により、対円での為替ヘッジを行う場合があります。
主要運用対象	豪ドル建ての国債、州政府債および国際機関債を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時(原則毎年1月17日。ただし、休業日の場合は翌営業日)に収益分配方針に基づいて収益分配金を決定します。ただし、委託会社の判断で分配を行わないことがあります。

UBS オーストラリア債券オープン (年1回決算型)

第4期 運用報告書(全体版)
決算日 2021年1月18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、「UBSオーストラリア債券オープン(年1回決算型)」は、去る1月18日に第4期の決算を行いましたので、期中の運用状況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。

UBSアセット・マネジメント株式会社

東京都千代田区大手町1-5-1

大手町ファーストスクエア イーストタワー

<お問い合わせ先>

投信営業部

03-5293-3700

<受付時間>

営業日の午前9時~午後5時、土、日、祝日除く

<http://www.ubs.com/japanfunds>

© UBS 2021. キーシンボル及びUBSの各標章は、UBSの登録又は未登録商標です。UBSは全ての権利を留保します。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	ベンチマーク		債券組入 率	債券先物 率	純資産 総額
(設定日) 2017年6月2日	円 10,000	円 -	% -	10,000	% -	% -	% -	百万円 1,300
1期 (2018年1月17日)	10,613	0	6.1	10,694	6.9	95.1	1.0	1,865
2期 (2019年1月17日)	9,814	0	△7.5	9,991	△6.6	92.5	△2.5	1,596
3期 (2020年1月17日)	10,277	0	4.7	10,554	5.6	94.5	11.1	1,473
4期 (2021年1月18日)	11,015	0	7.2	11,394	8.0	96.0	2.0	1,074

(注1) 基準価額および分配金は1万口当たり。

(注2) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注3) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注4) 債券先物比率は買建比率-売建比率。

(注5) ベンチマーク：ブルームバーグオーストラリア債券 (Govt) インデックス (円換算ベース)

ブルームバーグオーストラリア債券 (Govt) インデックスは、オーストラリアの債券市場の値動きを表す代表的な指数であり、オーストラリアの国債および州政府債から構成されています。ブルームバーグオーストラリア債券 (Govt) インデックス (円換算ベース) は、当インデックスを当社が円換算したものです。ベンチマークは設定日を10,000として指数化したものです。

当期中の基準価額等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入 率	債券先物 率
		騰落率		騰落率		
(期首) 2020年 1月17日	円 10,277	% -	10,554	% -	% 94.5	% 11.1
1月末	10,043	△ 2.3	10,301	△ 2.4	93.1	13.3
2月末	9,928	△ 3.4	10,192	△ 3.4	94.7	11.7
3月末	9,119	△11.3	9,369	△11.2	94.5	12.5
4月末	9,594	△ 6.6	9,875	△ 6.4	96.8	22.2
5月末	9,857	△ 4.1	10,134	△ 4.0	97.9	15.1
6月末	10,217	△ 0.6	10,513	△ 0.4	94.5	15.0
7月末	10,432	1.5	10,738	1.7	98.8	8.4
8月末	10,663	3.8	11,033	4.5	96.7	11.6
9月末	10,534	2.5	10,855	2.9	96.3	4.0
10月末	10,285	0.1	10,622	0.6	95.3	3.5
11月末	10,700	4.1	11,051	4.7	95.8	3.3
12月末	10,927	6.3	11,301	7.1	94.4	3.0
(期末) 2021年 1月18日	11,015	7.2	11,394	8.0	96.0	2.0

(注1) 基準価額は1万口当たり。

(注2) 騰落率は期首比です。

(注3) 債券先物比率は買建比率-売建比率。

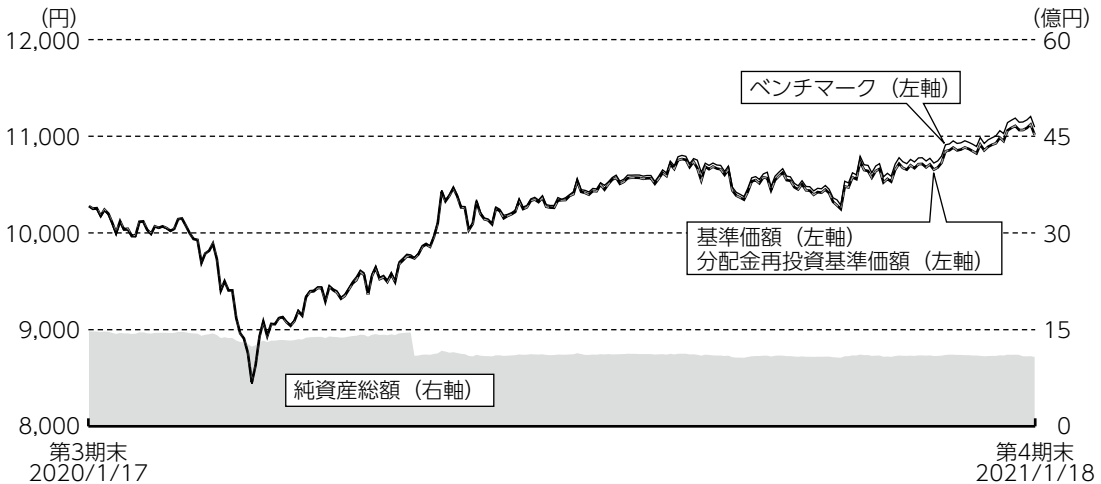
(注4) ベンチマーク：ブルームバーグオーストラリア債券 (Govt) インデックス (円換算ベース)

ブルームバーグオーストラリア債券 (Govt) インデックスは、オーストラリアの債券市場の値動きを表す代表的な指数であり、オーストラリアの国債および州政府債から構成されています。ブルームバーグオーストラリア債券 (Govt) インデックス (円換算ベース) は、当インデックスを当社が円換算したものです。ベンチマークは設定日を10,000として指数化したものです。

運用経過

基準価額等の推移について

(2020年1月17日～2021年1月18日)



第4期首：10,277円

第4期末：11,015円 (既払分配金 0円)

騰落率： 7.2% (分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、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。
- (注2) 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、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

当期の基準価額は738円値上がりしました。なお、基準価額の騰落率は+7.2%となりました。

ベンチマークについて

ベンチマークとは、ファンドの運用を行うに当たり、運用目標の基準あるいはパフォーマンスを評価するための基準です。なお、当ファンドのベンチマークは「ブルームバーグオーストラリア債券 (Govt) インデックス」を委託会社において円換算した「ブルームバーグオーストラリア債券 (Govt) インデックス (円換算ベース)」です。

※「ブルームバーグオーストラリア債券 (Govt) インデックス」は、オーストラリア債券市場の値動きを表す代表的な指数であり、オーストラリア国債、州政府債により構成されています。「ブルームバーグオーストラリア債券 (Govt) インデックス」は、ブルームバーグが算出し、公表する指数であり、同指数に対する知的財産権その他一切の権利はブルームバーグに帰属します。

基準価額の主な変動要因

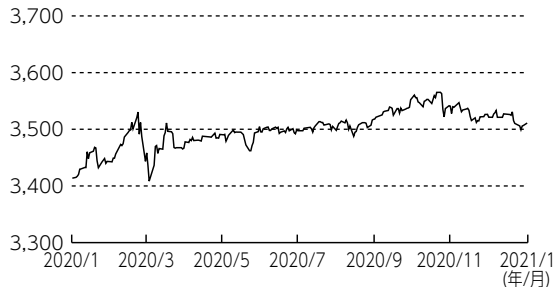
当ファンドの基準価額は、組入債券の価格上昇と利子収入に加え、為替相場の変動（豪ドル高・円安）もプラスに作用した結果、上昇しました。

投資環境について

当期の豪州債券市場は上昇しました。期の序盤、新型コロナウイルスの感染拡大への懸念から、豪州債券を含め世界各地で市場の値動きが大きく不安定化しました。しかし2020年3月後半に入ると、世界各国による協調的な危機対応の効果により市場は落ち着きを取り戻しました。その後、新型コロナウイルスの感染再拡大に対する懸念、米中対立の深刻化、11月の米大統領選への警戒感などからリスク回避の動きが強まりやすい環境下、豪州準備銀行（RBA）による金融緩和策にも下支えされて、豪州債券市場は概ね上昇傾向で推移しました。11月以降は、米国の政治リスク後退と景気刺激策への期待や、新型コロナウイルスワクチンの開発および普及への期待などを背景に世界的にやや金利が上昇傾向（債券価格は低下傾向）となり、豪州債券市場も幾分反落しました。

為替市場では、豪ドルが対円で上昇しました。期の序盤、新型コロナウイルスに対する懸念から金融市場が大きく動揺する中、豪ドルは対円で急落しました。しかし3月後半には、投資家心理の改善を受けて豪ドルは持ち直し、その後も豪州政府による景気対策への評価や経済活動の再開期待などに後押しされて、豪ドルが上昇基調で推移しました。9月に入ると、RBAによる追加緩和観測に加え、新型コロナウイルスの感染再拡大や米大統領選への警戒感などからリスク回避の動きが強まり、豪ドルは下落に転じました。しかし11月以降は、米国の政治リスク後退、資源相場の堅調な動き、国内経済の改善期待などから、再び豪ドル高が進みました。

ブルームバーグオーストラリア債券（Govt）
インデックス／豪ドルベースの推移



豪ドル／円レートの推移



※リフィニティブのデータを元に当社作成。

※基準日は1998年6月30日＝1,000です。なお、当ファンドのベンチマークは当インデックスを円換算したものです。

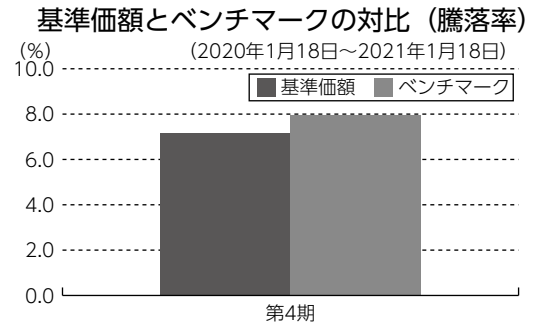
ポートフォリオについて

当ファンドは、運用の基本方針に基づき高格付けの豪ドル建ての債券に分散投資し、安定した収益の確保および信託財産の成長を目指して運用を行いました。

組入れについては、国債に加え、一般的に国債に比べて利回り水準が魅力的な州政府債、政府保証債や国際機関債などに分散投資を行いました。信用リスクにおいては、保有債券の平均格付けは期を通じてAAA格を維持しました。デュレーションについては、RBAによる金融緩和政策の強化・継続を背景に、期中概ね市場対比でやや長めの水準を維持しました。期末にかけては、米国の景気刺激策やワクチン接種への期待、それによる世界的な金利上昇懸念も勘案して、市場と同程度としました。

ベンチマークとの差異について

当期中の騰落率は、基準価額の+7.2%に対してベンチマークが+8.0%となり、基準価額の騰落率はベンチマークの騰落率を0.8%下回りました。基準価額の騰落率がベンチマークの騰落率を下回った主な要因は、信託報酬の負担などによるものです。



(注) 基準価額の騰落率は分配金再投資ベース

分配金について

当期は、市況動向等を勘案し、分配は行いませんでした。なお、分配にあてなかった利益につきましては、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

分配原資の内訳 (1万口当たり・税引前)

項目	第4期
	2020年1月18日~2021年1月18日
当期分配金	-円
(対基準価額比率)	(- %)
当期の収益	-円
当期の収益以外	-円
翌期繰越分配対象額	1,355円

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は、「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 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3) 「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

投資環境の見通し

世界各地で経済指標の持ち直しが見られる中、経済の先行きに対する市場の見方および中央銀行の見通しは改善しています。ただし、新型コロナウイルスの感染は未だ収束せず、経済の回復状況には地域・業種により差がある点に、引き続き留意が必要と考えます。豪州では、RBAは引き続き雇用市場の動向を最も重視していると思われれます。豪州経済が新型コロナウイルス禍の落ち込みから回復に向かう中で、雇用創出に向けた財政政策をサポートするため、RBAは非常に緩和的な金融政策を長期にわたり維持すると予想されます。RBAは2020年11月に決定した債券購入プログラムの完了後も、追加的な量的緩和策を実施する方針を示しています。こうした流動性の供給は、債券市場を下支えするとともに、最近の豪ドル高傾向を抑制する役割を果たすと見込まれます。債券市場においては、政策金利が0%に近い水準にあることから、利回りを求める投資家からの社債需要が継続すると予想されます。

今後の運用方針

このような見通しのもと、引き続き金利水準や市場心理等を考慮しながら、状況に応じてデュレーション調整を機動的に行ってまいります。

1万口当たりの費用明細

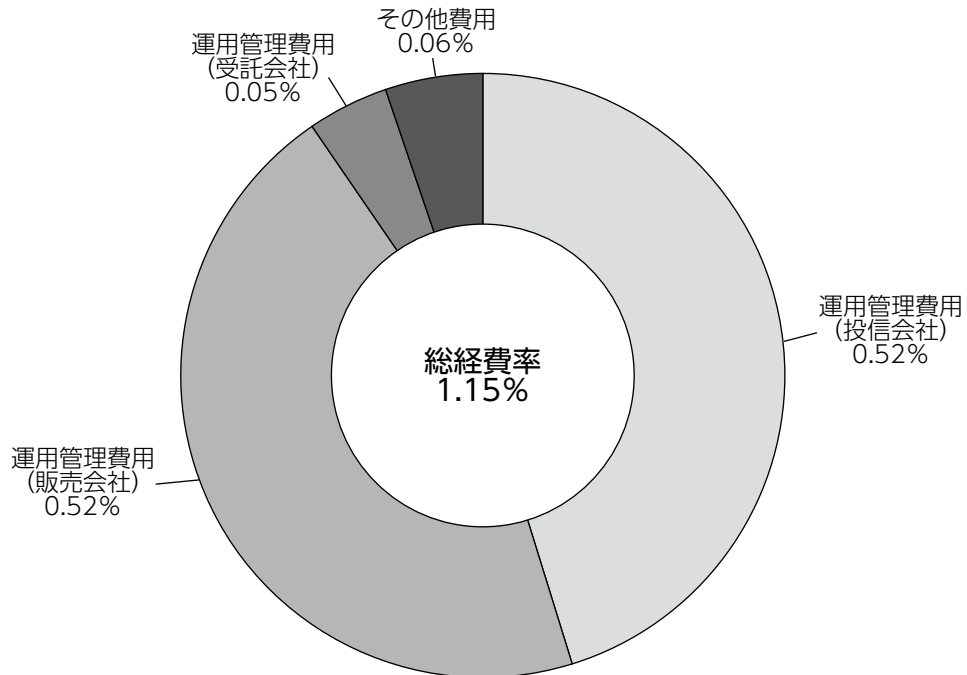
項目	当期 2020/1/18~2021/1/18		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	112円	1.103%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ※期中の平均基準価額（月末値の平均）は10,191円です。
（投信会社）	（ 53）	（0.524）	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	（ 53）	（0.524）	運用報告書等各種書類の交付、口座内でのファンドに係る管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	（ 6）	（0.055）	運用財産の管理、運用指図実行等の対価
売買委託手数料	0	0.002	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
（先物・オプション）	（ 0）	（0.002）	先物・オプション取引所取引の際に売買仲介人に支払う手数料
その他費用	6	0.057	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）	（ 3）	（0.033）	海外保管銀行等に支払う海外資産等の保管・送金・受渡等に係る費用
（監査費用）	（ 2）	（0.020）	監査法人等に支払うファンド監査に係る費用
（その他）	（ 0）	（0.004）	受益権の管理事務に関連する費用等
合計	118	1.162	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加、解約によって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) 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



(注1) 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2) 各比率は、年率換算した値です。

(注3) 上記の費用は、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。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及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1.15%です。

売買及び取引の状況（自 2020年1月18日 至 2021年1月18日）

(1) 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	2,478	4,842
	地方債証券	4,151	5,171 (500)
	特殊債証券	500	2,022

(注1) 金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) () 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。

(2) 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	百万円	百万円	百万円	百万円
債券先物取引				
AUST 3YR BOND FUTURES	371	424	44	44
AUST 10YR BOND FUTURES	573	672	-	-

(注1) 単位未満は切り捨て。

(注2) 外国証券の取引金額は、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。

主要な売買銘柄 (自 2020年1月18日 至 2021年1月18日)

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
AUSTRALIAN GOVT. 5.75% 21/5/15(オーストラリア)	73,340	WEST AUST T CORP 2.75% 22/10/20(オーストラリア)	92,456
WEST AUST T CORP 2.75% 29/7/24(オーストラリア)	59,831	AUSTRALIAN GOVT. 5.75% 21/5/15(オーストラリア)	76,314
AUSTRALIAN CPTL 4% 24/5/22(オーストラリア)	45,001	AUSTRALIAN GOVT. 3.25% 25/4/21(オーストラリア)	73,126
WEST AUST T CORP 3% 26/10/21(オーストラリア)	42,726	TREAS CORP VICT 5.5% 26/11/17(オーストラリア)	49,963
TREAS CORP VICT 1.5% 30/11/20(オーストラリア)	39,931	NSWTC-I/L 2.5% 35/11/20(オーストラリア)	48,846
TREAS CORP VICT 1.25% 27/11/19(オーストラリア)	39,490	AUSTRALIAN GOVT. 4.25% 26/4/21(オーストラリア)	45,050
NEW S WALES TREA 3% 30/2/20(オーストラリア)	38,312	EXPORT FIN & INS 0.515% 24/1/29(オーストラリア)	39,687
EXPORT FIN & INS 0.515% 24/1/29(オーストラリア)	37,685	QUEENSLAND TREAS 5.5% 21/6/21(オーストラリア)	39,344
TREAS CORP VICT 1% 23/11/20(オーストラリア)	35,416	INT BK RECON&DEV 2.8% 21/1/13(オーストラリア)	38,629
AUSTRALIAN GOVT. 1% 30/12/21(オーストラリア)	30,042	WEST AUST T CORP 2.75% 29/7/24(オーストラリア)	37,376

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

(注3) 外国証券の売買金額は、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。

利害関係人等との取引状況等 (自 2020年1月18日 至 2021年1月18日)

(1) 期中の利害関係人等との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人等 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人等 との取引状況D	D C
公社債	百万円 515	百万円 7	% 1.4	百万円 878	百万円 172	% 19.6
債券先物取引	994	994	100.0	1,143	1,143	100.0

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

(2) 利害関係人等である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種類	買付額
公社債	百万円 67

(3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人等への支払比率

項目	当 期
売買委託手数料総額(A)	25千円
うち利害関係人への支払額(B)	25千円
(B) / (A)	100.0%

※利害関係人等とは、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等であり、当ファンドに係る利害関係人等とはユービーエス・エイ・ジー(銀行)です。

組入資産明細表 (2021年1月18日現在)

(1) 外国 (外貨建) 公社債

①種類別開示

区 分	当 期				末			
	額 面 金 額	外貨建評価額	邦貨建評価額	組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入れ比率		
						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 11,500	千オーストラリア・ドル 12,917	千円 1,031,594	% 96.0	% -	% 68.6	% 14.7	% 12.6
合 計	11,500	12,917	1,031,594	96.0	-	68.6	14.7	12.6

(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) 単位未満は切り捨て。

(注4) -印は組み入れなし。

(注5) 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。

②個別銘柄開示

銘 柄 名		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. 0.5%	0.5	200	200	15,979	2026/ 9/21
	AUSTRALIAN GOVT. 1%	1.0	400	398	31,799	2030/12/21
	AUSTRALIAN GOVT. 1.25%	1.25	200	201	16,100	2032/ 5/21
	AUSTRALIAN GOVT. 1.75%	1.75	200	183	14,652	2051/ 6/21
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25%	2.25	300	332	26,559	2028/ 5/21
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75%	2.75	400	456	36,418	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75%	2.75	300	346	27,676	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVT. 3%	3.0	300	359	28,692	2047/ 3/21
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25%	3.25	200	238	19,038	2029/ 4/21
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25%	3.25	200	248	19,807	2039/ 6/21
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75%	3.75	100	131	10,474	2037/ 4/21
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25%	4.25	400	479	38,325	2026/ 4/21
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5%	4.5	500	687	54,926	2033/ 4/21
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75%	4.75	600	754	60,284	2027/ 4/21
地 方 債 証 券	AUSTRALIAN CPTL 4%	4.0	500	563	45,029	2024/ 5/22
	NEW S WALES TREA 3%	3.0	500	573	45,836	2028/ 3/20
	NEW S WALES TREA 3%	3.0	500	579	46,256	2030/ 2/20
	QUEENSLAND TREAS 3%	3.0	200	217	17,381	2024/ 3/22
	QUEENSLAND TREAS 3.25%	3.25	200	229	18,291	2026/ 7/21
	QUEENSLAND TREAS 4.25%	4.25	300	330	26,416	2023/ 7/21
	QUEENSLAND TREAS 4.75%	4.75	200	238	19,083	2025/ 7/21
	QUEENSLAND TREAS 6%	6.0	400	435	34,780	2022/ 7/21
	QUEENSLAND TREAS 6.5%	6.5	100	155	12,395	2033/ 3/14

銘柄名		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	TASMANIAN PUBFIN 4.25%	4.25	500	523	41,817	2022/ 3/ 8
	TREAS CORP VICT 1%	1.0	500	511	40,831	2023/11/20
	TREAS CORP VICT 1.25%	1.25	500	513	40,983	2027/11/19
	TREAS CORP VICT 1.5%	1.5	500	508	40,584	2030/11/20
	TREAS CORP VICT 5.5%	5.5	100	120	9,593	2024/12/17
	TREAS CORP VICT 6%	6.0	200	220	17,614	2022/10/17
	WEST AUST T CORP 2.75%	2.75	500	571	45,641	2029/ 7/24
	WEST AUST T CORP 3%	3.0	500	568	45,403	2026/10/21
特殊債券 (除く金融債)	EXPORT DEV CAN 2.7%	2.7	500	522	41,697	2022/10/24
	NATIONAL HOUSING 1.52%	1.52	500	516	41,220	2030/ 5/27
合計		-	-	-	1,031,594	-

(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り捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外国	債券先物取引	百万円	百万円
		9	-
	AUST 10YR BOND FUTURES	11	-

(注1) 単位未満は切り捨て。

(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。

(注3) -印は組み入れなし。

投資信託財産の構成

(2021年1月18日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 1,031,594	% 95.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	52,760	4.9
投 資 信 託 財 産 総 額	1,084,354	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産 (1,067,360千円) の投資信託財産総額 (1,084,354千円) に対する比率は98.4%です。

(注3) 外貨建資産は、当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、当期末における邦貨換算レートは、1オーストラリア・ドル=79.86円です。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年1月18日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,084,346,470円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	43,793,223
公 社 債(評価額)	1,031,594,424
未 収 利 息	8,028,905
前 払 費 用	244,052
差 入 委 託 証 拠 金	685,866
(B) 負 債	9,628,991
未 払 金	11,014
未 払 解 約 金	3,387,264
未 払 信 託 報 酬	6,115,288
未 払 利 息	47
そ の 他 未 払 費 用	115,378
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,074,717,479
元 本	975,717,400
次 期 繰 越 損 益 金	99,000,079
(D) 受 益 権 総 口 数	975,717,400口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,015円

〈注記事項〉

期首元本額 1,434,032,507円

期中追加設定元本額 179,719,842円

期中一部解約元本額 638,034,949円

1口当たり純資産額 1.1015円

損益の状況

(自2020年1月18日 至2021年1月18日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	31,659,545円
受 取 利 息	32,138,453
そ の 他 収 益	△ 476,454
支 払 利 息	△ 2,454
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	49,782,203
売 買 益 損	68,232,025
売 買 損 益	△18,449,822
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	4,052,453
取 引 益 損	7,211,505
取 引 損 益	△ 3,159,052
(D) 信 託 報 酬 等	△14,016,425
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	71,477,776
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	17,822,350
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	9,699,953
(配 当 等 相 当 額)	(42,983,069)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△33,283,116)
(H) 計 算 (E+F+G)	99,000,079
(I) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(H+I)	99,000,079
追 加 信 託 差 損 益 金	9,699,953
(配 当 等 相 当 額)	(42,983,069)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△33,283,116)
分 配 準 備 積 立 金	89,300,126

(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(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3) 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4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(26,469,263円)、費用控除後の有価証券等損益額(1,402,935円)、信託約款に規定する収益調整金(42,983,069円)および分配準備積立金(61,427,928円)より分配対象収益は132,283,195円(10,000口当たり1,355円)ですが、分配を行っておりません。