

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年6月15日提出
【発行者名】	三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松田 通
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目１２番１号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	オーストラリア好利回り３資産バランス＜為替ヘッジあり＞（年２回決算型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	(1)当初自己設定額 1,000万円を上限とします。 (2)継続申込額 1兆円を上限とします。 該当事項はありません。
【縦覧に供する場所】	

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2020年1月8日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について有価証券報告書の提出に伴う関係情報の更新等を行うため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部__は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書の更新後の内容を示します。

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンド状況 5 運用状況」、「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載します。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

当ファンドは、利子・配当収益の確保および値上がり益の獲得をめざして運用を行います。
信託金の限度額は、1,000億円です。

* 委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式 債券	MMF	インデックス型
	海外	不動産投信	MRF	
追加型	内外	その他資産 ()	ETF	特殊型 ()
		資産複合		

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象 地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式	年１回	グローバル	ファミ リーフ ァンド	あり (フルヘ ッジ)	日経２２５	ブル・ベア型
一般 大型株 中小型株	年２回 年４回 年６回	日本 北米 欧州	ファン ド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ()	(隔月) 年１２回 (毎月) 日々 その他 ()	アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージン グ			その他 ()	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型 その他 ()
不動産投信						

その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株 式、債券、不動 産投信））） 資産複合 （ ）						
---	--	--	--	--	--	--

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）でご覧いただけます。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。

特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。
-----	--

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

属性区分の定義

投資対象 資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（ＢＢＢ格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（ＢＢ格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信		信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産		信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合		信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年１回		信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年２回		信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年４回		信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年６回（隔月）		信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年１２回（毎月）		信託約款において、年１２回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々		信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他		上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象 地域	グローバル		信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本		信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経２２５	信託約款において、日経２２５に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	ＴＯＰＩＸ	信託約款において、ＴＯＰＩＸに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

〔ファンドの目的・特色〕

ファンドの目的

オーストラリアの債券、株式および不動産投資信託証券を実質的な主要投資対象とし、利子・配当収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。

ファンドの特色

特色1

オーストラリアの債券、株式および不動産投資信託証券（以下、「リート」といいます。）を実質的な主要投資対象とします。

※実際の運用は、債券については「AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド」、株式は「AMP オーストラリア高配当株式マザーファンド」、リートは「AMP オーストラリアREITマザーファンド」を通じて行います。

- 上記主要投資対象のほか、豪ドル預金または円預金等（コールローンを含みます。以下同じ。）を活用することがあります。

特色2

債券、株式およびリートへの資産配分比率は、原則として、40:40:20を維持することを基本とします（以下「基本資産配分比率」といいます。）。なお資産配分比率は、投資環境等に応じて見直すことがあります。

各マザーファンドの主要投資対象と基本資産配分比率

資産	マザーファンド	主要投資対象	基本資産配分比率
債券	AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド	オーストラリアの企業が発行する普通社債、劣後債および優先証券等	40%
株式	AMP オーストラリア高配当株式マザーファンド	オーストラリアの企業が発行する株式	40%
リート	AMP オーストラリアREITマザーファンド	オーストラリアのリート	20%

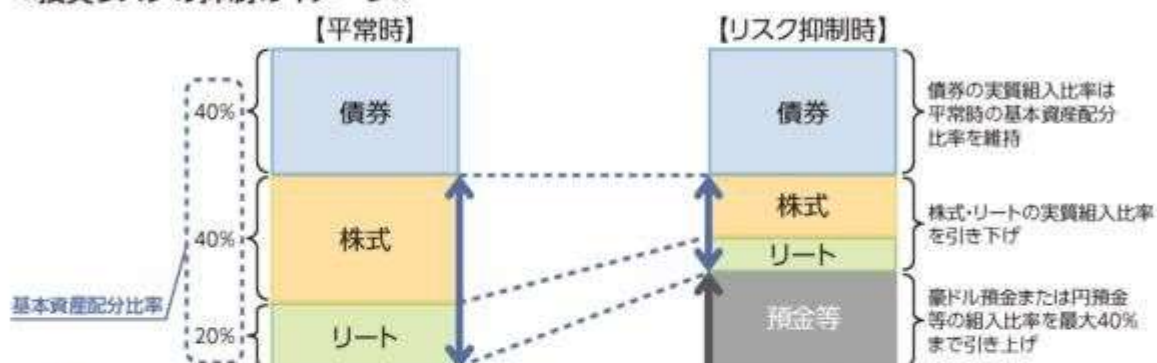
※各マザーファンドの詳細については、後述の「マザーファンドの特色」をご確認ください。

特色3

投資環境の大幅な悪化が予想される場合には、株式・リートの実質組入比率を引き下げ、豪ドル預金または円預金等の組入比率を引き上げ、投資リスクの抑制をはかります。

- 基準価額の変動リスクを抑制することを目的として、株式・リートの実質組入比率を引き下げ、為替ヘッジの影響や金利水準等を考慮し、豪ドル預金または円預金等の組入比率を最大40%まで引き上げます。
- AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドからの、主にバリュエーション（投資価値基準）、企業業績等の定量判断に加えて、定性判断（運用チームによるディスカッション等）を考慮した案に基づいて、委託会社が総合的に決定します。

《投資リスクの抑制のイメージ》



1 上記はイメージです。また、市場環境等によって上記のような運用ができない場合があります。

特色4

ファンドの運用にあたっては、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドの運用力を活用します。

- 各マザーファンドの運用にあたっては、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。
- 各マザーファンドへの投資比率は、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドからのアドバイスを受け、決定します。

AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッド

AMP CAPITAL

- オーストラリアを代表する総合金融グループであるAMPグループの一員で、オーストラリア最大規模の運用会社です。
- 債券・株式投資に加え、インフラ、不動産といった実物資産クラスへの豊富な投資経験を有しています。

1 運用の指図に関する権限の委託を受ける者、委託の内容、委託の有無等については、変更する場合があります。

1 投資助言者、投資助言の内容、投資助言の有無等については、変更する場合があります。

📄 委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)をご覧ください。

特色5

原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかります。

- 実質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、為替変動リスクの低減をはかります。

為替ヘッジの活用

為替予約取引を活用し為替ヘッジを行うことにより、為替ヘッジをしなかった場合と比較して安定した値動きが期待されます。ただし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。

なお、為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨の金利より低いときには、これらの金利差相当分のヘッジコストがかかります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

<投資リターンのイメージ>



！ 上記はファンドの投資リターンのイメージであり、ファンドの将来の運用状況・成果等を示唆・保証するものではありません。

特色6

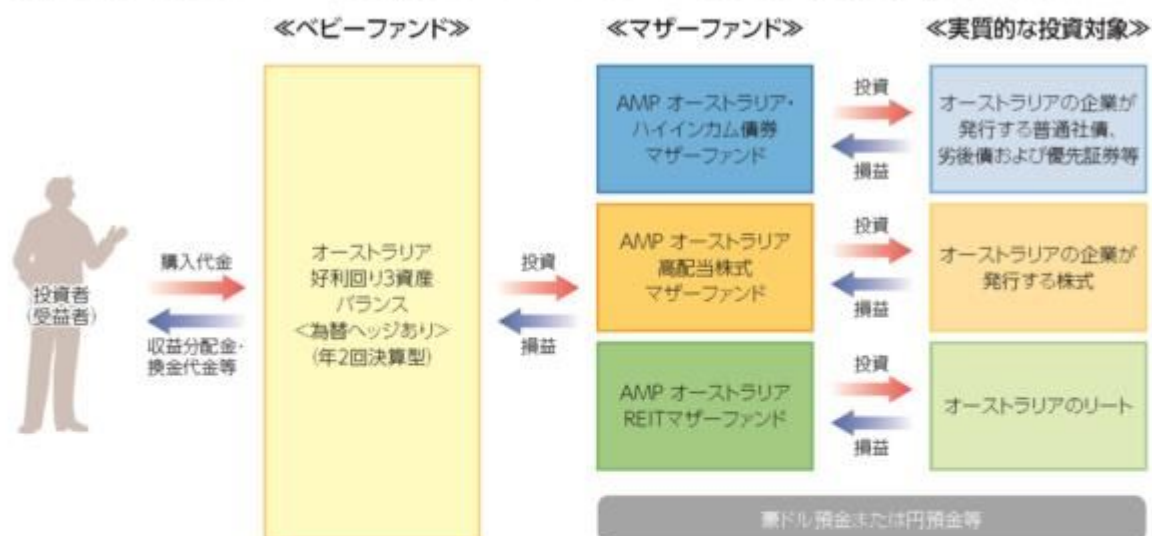
年2回の決算時(3月、9月の各15日(休業日の場合は翌営業日))に分配を行います。

- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。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。
将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ファンドの仕組み

ファミリーファンド方式により運用を行います。

ファミリーファンド方式とは、受益者から投資された資金をまとめた投資信託をベビーファンドとし、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資して、マザーファンドにおいて実質的な運用を行う仕組みです。



■主な投資制限

株式への投資	株式への実質投資割合に制限を設けません。
同一銘柄の株式への投資	同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
同一銘柄の不動産投資信託証券への投資	同一銘柄の不動産投資信託証券への実質投資割合は、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	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。

マザーファンドの特色

AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンドの特色

- オーストラリアの企業が発行する普通社債、劣後債および優先証券等が主要投資対象です。
・豪ドル以外の通貨建て債券等に投資した場合は、原則として、実質的に豪ドル建てとなるように外国為替予約取引等を行います。
- 債券等の運用にあたっては、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドに運用の指図に関する権限を委託します。
- 債券等への投資にあたっては、高水準のインカム収入を確保しつつ、マクロ要因分析、業種分析、個別企業の財務・業績分析等の信用リスク分析に基づき割安度を評価し、銘柄選定を行います。
- 原則として、為替ヘッジを行いません。



劣後債、優先証券とは

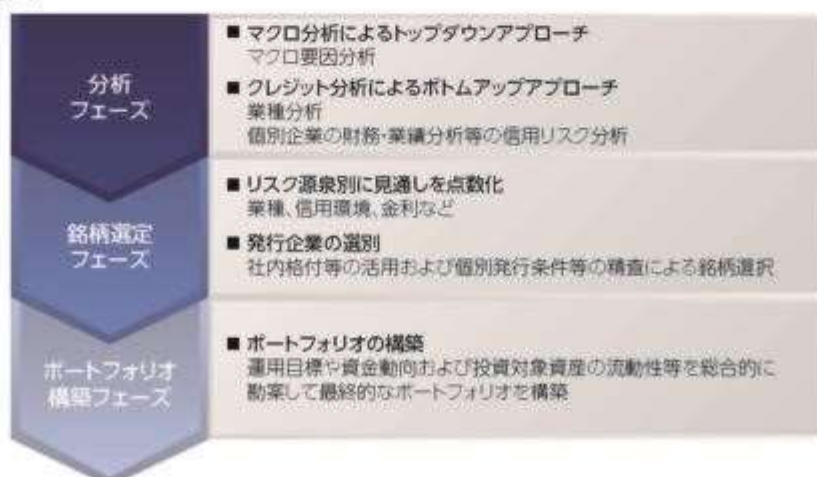
劣後債、優先証券(以下、「ハイブリッド証券」という場合があります。)は、債券と株式の両方の特性を有しており、上場または非上場となっています。ハイブリッド証券は一般に利息(配当)が定められており、満期時や繰上償還時に額面で償還される等、債券に似た性質を有しています。同一発行体が発行している普通社債とハイブリッド証券を比べると、ハイブリッド証券の方が普通社債よりも利回りが高く、また期待リターンも高くなります。その一方で、リスクは普通社債に比べてハイブリッド証券の方が高くなり、また弁済順位は普通社債に比べて低いという特徴もあります。また一部のハイブリッド証券については償還時に株式に転換されるものもあります。



❏ 弁済順位とは、発行体が経営破綻に陥った場合に、債権者等に対して残余財産を弁済する順位のことであり、弁済順位の高位のものから弁済されます。

❗ 上図はハイブリッド証券の特性を示したイメージ図であり、各証券の特性すべてを網羅するものではありません。

<運用プロセス>



❗ 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際に投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

❗ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

AMP オーストラリア高配当株式マザーファンドの特色

- オーストラリアの企業が発行する株式が主要投資対象です。
- 株式等への投資にあたっては、人口動態分析、マクロ経済分析等のトップダウン・アプローチと、個別銘柄の配当利回り、割安度、業績および経営の質等の分析によるボトムアップ・アプローチを併用し、銘柄選定を行います。
- 株式等の運用にあたっては、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドに運用の指図に関する権限を委託します。
- 原則として、為替ヘッジを行いません。

<運用プロセス>



- ❗ 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際に投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。
- ❗ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

AMP オーストラリアREITマザーファンドの特色

- オーストラリアの不動産投資信託証券*（リート）を主要投資対象とし、値上がり益の獲得および配当収益の確保をめざします。
*一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。
- 不動産投資信託証券への投資にあたっては、人口動態分析、マクロ経済分析等のトップダウン・アプローチと、個別銘柄の割安度や保有資産・業績の分析および資本構造や経営の質等の分析によるボトムアップ・アプローチを併用し、銘柄選定を行います。
- 不動産投資信託証券等の運用にあたっては、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドに運用の指図に関する権限を委託します。
- 原則として、為替ヘッジを行いません。

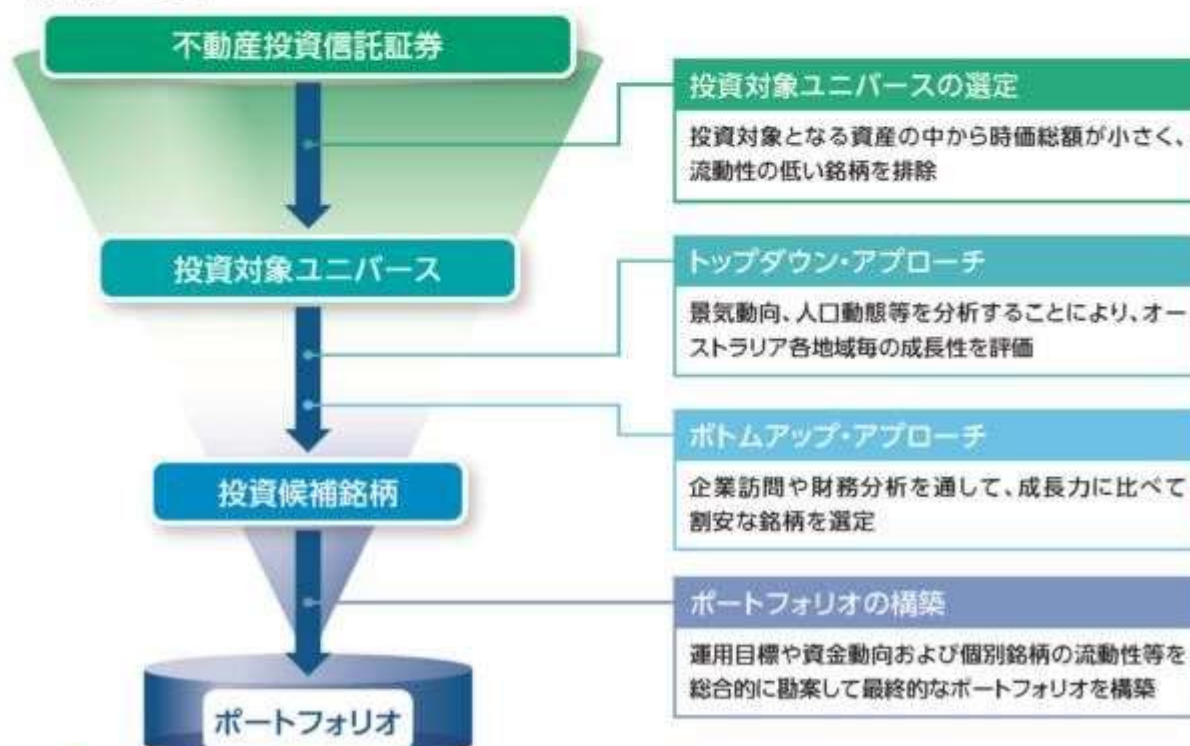


不動産投資信託証券（リート）とは

不動産投資法人の投資証券または不動産投資信託の受益証券をいいます。多数の投資家から資金を集めて不動産を所有、管理、運営し、そこから生じる賃貸料収入や売却益を投資家に分配する商品で、一般的にREIT（リート: Real Estate Investment Trust）と呼ばれています。分配金の原資は主に多数の物件からの賃貸料収入などです。



<運用プロセス>



- ❗ 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際に投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。
- ❗ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

< 訂正前 >

2020年1月24日

設定日、信託契約締結、運用開始（予定）

< 訂正後 >

2020年1月24日

設定日、信託契約締結、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。
委託会社と再委託先との契約 「信託財産の運用指図権限委託契約」	運用指図権限委託の内容およびこれに係る事務の内容、再委託先が受ける報酬等が定められています。

委託会社の概況（2019年10月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日
1985年8月1日
- ・資本金
2,000百万円
- ・沿革
1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ投信株式会社に変更
2015年7月 三菱ＵＦＪ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社に変更

・大株主の状況

株主名	住 所	所有株式数	所有比率
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目４番５号	211,581株	100.0%

< 訂正後 >

委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
--	----

委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。
委託会社と再委託先との契約 「信託財産の運用指図権限委託契約」	運用指図権限委託の内容およびこれに係る事務の内容、再委託先が受ける報酬等が定められています。

委託会社の概況（2020年3月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日
1985年8月1日
- ・資本金
2,000百万円
- ・沿革
 - 1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
 - 2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
 - 2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ投信株式会社に変更
 - 2015年7月 三菱ＵＦＪ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社に変更
- ・大株主の状況

株 主 名	住 所	所有株式数	所有比率
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目４番５号	211,581株	100.0%

３【投資リスク】

< 更新後 >

(１) 投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

**価格変動
リスク**

- ・債券の価格は、市場金利の変動の影響を受けて変動します。一般に市場金利が上がると、債券の価格は下落し、組入債券の価格の下落は基準価額の下落要因となります。市場金利の変動による債券価格の変動は、一般にその債券の残存期間が長いほど大きくなる傾向があります。
- ・株式の価格は、株式市場全体の動向のほか、発行企業の業績や業績に対する市場の見通しなどの影響を受けて変動します。組入株式の価格の下落は、基準価額の下落要因となります。
- ・リートの価格は、リート市場全体の動向のほか、保有不動産等の価値やそこから得られる収益の増減等により変動します。また、金利上昇時にはリートの配当（分配金）利回りの相対的な魅力が弱まるため、リートの価格が下落することがあります。組入リートの価格下落は、基準価額の下落要因となります。

**為替変動
リスク**

組入外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図りますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨の金利より低いときには、これらの金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

信用リスク

有価証券等の発行企業の経営、財務状況が悪化したり、市場においてその懸念が高まった場合には、有価証券等の価格が下落（債券の場合は利回りが上昇）すること、配当金が減額あるいは支払いが停止、または利払いや償還金の支払いが滞ること、倒産等によりその価値がなくなること等があります。

（金融機関の実質的な破たんに関するリスク）

金融機関の破たん処理等に関し、株主だけでなく債権者にも損失負担を求める措置（ベイル・イン）に関する法制度が導入される国・地域においては、監督当局により実質破たん状態にあると認定された金融機関について、劣後債や優先証券、普通社債等についても元本の一部もしくは全部の削減や、発行体の普通株式への転換等、損失吸収措置がとられる可能性があり、この場合にはファンドの基準価額が大きく下落する要因となります。

**流動性
リスク**

有価証券等を売買しようとする際に、その有価証券等の取引量が十分でない場合や規制等により取引が制限されている場合には、売買が成立しなかったり、十分な数量の売買が出来なかったり、ファンドの売買自体によって市場価格が動き、結果として不利な価格での取引となる場合があります。

また、ファンドが組み入れる劣後債および優先証券等は、一般の公社債と比べ市場規模が小さく、一般的に取引量も少ないため、流動性リスクも高い傾向にあります。

リート固有 のリスク

リートは、一般的に収入の大部分を出資者に分配するため、内部留保される資金額が限定されます。そこで新たな事業への投資にあたっては外部から資金を調達する場合があります。財務内容が良好でないと判断されたリートは、外部からの資金調達が困難となり、価格が下落することがあります。また、借入れにより外部資金調達を行っている場合、金利上昇時には借入金負担が大きくなることでリートの価格が下落したり配当金が減額あるいは停止されることがあるほか、金融市場の状況やリートの運営状況によっては借入金の借り換えが出来ず、運営が破たんすることがあります。また、リートのスポンサー、運用会社等による事業の運営管理手法等が、リートの収益力や財務内容の悪化を招きリートの価格形成等に影響を与えることがあります。

劣後債および優先証券等（以下、「ハイブリッド証券」といいます）への投資には次のような特徴があり、価格変動・信用・流動性の各リスクは普通社債への投資と比較して相対的に大きいものとなります。

（法的弁済順位の劣後）

一般的にハイブリッド証券の法的弁済順位は株式に優先し、普通社債に劣後します。したがって、発行体が経営破たん等に陥った場合、普通社債等の元金金が支払われてもハイブリッド証券は元金金の支払いを受けられないことがあります。また、発行体が経営不安、倒産、国有化などに陥った場合には、ハイブリッド証券の価値が大きく減少すること、または無くなることもあり、この場合にはファンドの基準価額が大幅に下落することがあります。さらに、ハイブリッド証券は、一般的に同一発行体の普通社債と比較して低い格付けが格付機関により付与されています。

（繰上償還の延期・前倒し）

一般的にハイブリッド証券には、繰上償還（コール）条項が付与されており、この繰上償還の実施は発行体が決定することとなっています。繰上償還されることを前提として取引されている証券もあり、これらの証券が市場で予想されていた期日に繰上償還が実施されない場合、あるいは実施されないと見込まれる場合、また市場で予想されていた期日以前に償還される場合には、当該証券の価格が大きく下落することがあります。

（利息・配当の繰り延べまたは停止）

利息または配当の支払い繰り延べ条項を有するハイブリッド証券は、発行体の財務状況や収益動向等の要因によって、利息または配当の支払いが繰り延べまたは停止される可能性があります。この場合、期待される利払いや配当が得られないこととなり、ハイブリッド証券の価格が下落する可能性があります。

（損失吸収条項）

金融機関が発行するハイブリッド証券の中には、監督当局により実質破たん状態にあると認定された場合等に元本の一部もしくは全部が削減される、または発行体の普通株式に転換されるなどの損失吸収条項が付与されているものがあります。損失吸収条項に該当した場合、ハイブリッド証券の価格が大きく下落することがあります。

（株式等への転換）

一部のハイブリッド証券には、発行体の判断で実質的に株式等に転換する条項が付与されている場合があります。これらの証券が転換される、もしくは転換されると見込まれる場合には、当該証券の価格が大きく下落することがあります。

（制度変更等）

将来、ハイブリッド証券にかかる税制の変更や、当該証券市場にとって不利益な制度上の重大な変更等があった場合には、税制上・財務上のメリットがなくなるか、もしくは著しく低下する等の事由により、投資成果に悪影響を及ぼす可能性があります。

ファンドは、格付けの低い投資適格未満の普通社債、劣後債および優先証券等に投資する場合があります。格付けの高い公社債への投資を行う場合に比べ、価格変動・信用・流動性の各リスクが大きくなる可能性があります。

留意事項

- ・ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・ファンドは、AMP オーストラリアREITマザーファンドを通じて、実質的にオーストラリアの不動産投資信託証券に投資を行います。オーストラリアの不動産投資信託証券の配当金に関しては、オーストラリアの税制が適用されます。

- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。

（２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。

また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

内部監査担当部署

委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

<流動性リスクに対する管理体制>

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立したリスク管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果はリスク管理に関する会議体等に報告されます。

* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

〔再委託先の管理体制〕

リスク管理およびコンプライアンスの機能は、運用部門から独立したコンプライアンスおよびオペレーション・リスク管理部門によって実施しております。同部門により、全てのファンドについて投資ガイドライン違反やリスク管理指標からの逸脱がないかどうかのチェックを行なっています。

また、このほかに、投資ガイドラインなどに関するチェックの機能としては、コンプライアンス・スクリーニング・システムにより売買執行前および執行後のモニタリングを行いチェックします。

〔委託会社における再委託先に対する確認体制〕

委託会社と再委託先の間で、再委託先がファンド運用コンセプトを維持し、適切に投資リスク管理が図られるよう運用指図権限委託契約として委託内容を定めています。また、委託会社は再委託先に対し定期的に書面による調査等を実施し、投資リスクに対する管理体制の確認を行っています。

また、再委託先からの定期的なデ・タ還元を受け、ファンドのリスクの運営状況の確認を行っているほか、委託会社自身でもモニタリングし、投資リスクを管理しています。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率はありません。

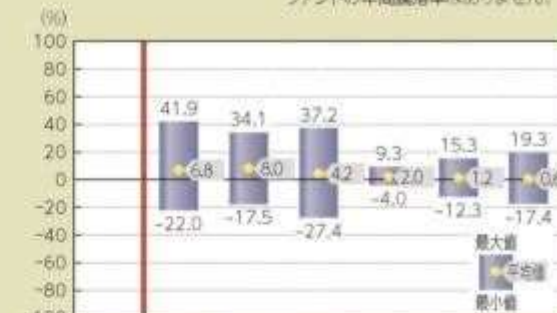
基準価額(分配金再投資)は、2020年1月末～2020年3月末です。



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2015年4月末～2020年3月末)

ファンドの年間騰落率はありません。



ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

(注)全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

●基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものととして計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。

●年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPI(国債)とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(総合)のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当該指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

１．収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

２．解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にそ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、その後の当該受益者の個別元本となります。

収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回って

いる場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にそ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、その後の当該受益者の個別元本となります。

上記は2019年10月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

< 訂正後 >

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

１．収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

２．解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限り、）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一

ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にそ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、その後の当該受益者の個別元本となります。

収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にそ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、その後の当該受益者の個別元本となります。

上記は2020年3月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【オーストラリア好利回り3資産バランス＜為替ヘッジあり＞（年2回決算型）】

（1）【投資状況】

令和 2年 3月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	21,674,184	86.17
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	3,477,824	13.83
純資産総額		25,152,008	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

令和 2年 3月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド	9,129,773	1.1066	10,103,159	1.1052	10,090,225	40.12
日本	親投資信託受益証券	AMP オーストラリア高配当株式マザーファンド	11,897,297	0.7344	8,737,375	0.6808	8,099,679	32.20
日本	親投資信託受益証券	AMP オーストラリアREITマザーファンド	4,889,532	0.9178	4,487,613	0.7126	3,484,280	13.85

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 3月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	86.17
合計	86.17

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（ 3 ）【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和2年3月末日、同日前 1 年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 （1万口当たりの純資産価額）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末日（令和 2年 3月16日）	27,270,613	27,316,767	8,863	8,878
令和 2年 1月末日	9,986,073	—	9,986	—
2月末日	14,005,007	—	9,797	—
3月末日	25,152,008	—	8,172	—

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	15円

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	11.22

（注）「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額）を控除した額を当該基準価額（分配落の額）で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	30,769,682	—	30,769,682

（参考）

A M P オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド

投資状況

令和 2年 3月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
社債券	オーストラリア	5,375,551,057	75.13
	アメリカ	1,048,498,659	14.65
	小計	6,424,049,716	89.79
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	730,704,675	10.21
純資産総額		7,154,754,391	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

令和 2年 3月31日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
債券先物取引	買建	オーストラリア	1,768,910,866	24.72
	売建	アメリカ	461,775,897	6.45
	売建	オーストラリア	1,214,627,495	16.98

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

令和 2年 3月31日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	社債券	VAR BHP BILLITON 751019	2,820,000	11,253.34	317,344,427	10,699.02	301,712,445	6.250000	2075/10/19	4.22
オーストラリア	社債券	4.5 DOWNER GROUP 220311	4,400,000	7,001.96	308,086,643	6,845.93	301,221,240	4.500000	2022/3/11	4.21
オーストラリア	社債券	VAR WESTPAC BAN 270311	3,960,000	6,935.85	274,659,767	6,832.58	270,570,239	4.500000	2027/3/11	3.78
オーストラリア	社債券	VAR AUST & NZ B 270513	3,900,000	7,001.00	273,039,192	6,922.52	269,978,347	4.750000	2027/5/13	3.77
オーストラリア	社債券	3.85 UNITED ENERG 241023	2,600,000	7,268.91	188,991,911	7,112.65	184,929,108	3.850000	2024/10/23	2.58
オーストラリア	社債券	7.5 QANTAS AIRWAY 210611	2,500,000	7,261.30	181,532,708	6,984.27	174,606,955	7.500000	2021/6/11	2.44
オーストラリア	社債券	3.25 COMMONWEALT 220117	2,500,000	6,922.26	173,056,665	6,852.08	171,302,009	3.250000	2022/1/17	2.39
アメリカ	社債券	VAR AUSNET SERV 760317	1,500,000	11,448.91	171,733,740	11,041.27	165,619,088	5.750000	2076/3/17	2.31
オーストラリア	社債券	7.75 QANTAS AIRWA 220519	2,100,000	7,634.26	160,319,463	7,271.17	152,694,728	7.750000	2022/5/19	2.13
アメリカ	社債券	FRN BHP BILLITON 751019	1,200,000	12,744.62	152,935,534	11,557.80	138,693,605	6.750000	2075/10/19	1.94
オーストラリア	社債券	FRN WESTPAC BAN 290816	1,800,000	7,061.43	127,105,758	6,908.19	124,347,552	4.334000	2029/8/16	1.74
オーストラリア	社債券	FRN AUST & NZ B 290726	1,900,000	6,688.98	127,090,767	6,305.99	119,813,898	2.884100	2029/7/26	1.67
オーストラリア	社債券	4.5 SCENTRE MGMT 210908	1,700,000	6,952.00	118,184,121	6,813.87	115,835,831	4.500000	2021/9/8	1.62
オーストラリア	社債券	4 TELSTRA COR 220916	1,650,000	7,106.65	117,259,852	6,955.24	114,761,616	4.000000	2022/9/16	1.60
オーストラリア	社債券	3.9 LONSDALE FINA 251015	1,600,000	7,317.61	117,081,776	7,079.93	113,278,968	3.900000	2025/10/15	1.58
オーストラリア	社債券	3.25 MACQUARIE B 221215	1,600,000	6,824.44	109,191,064	6,800.74	108,811,993	3.250000	2022/12/15	1.52
オーストラリア	社債券	3.9 SHOPPING CT 240607	1,500,000	7,093.31	106,399,781	7,023.64	105,354,670	3.900000	2024/6/7	1.47
オーストラリア	社債券	3.2 COMMONWEALT 230816	1,500,000	7,081.54	106,223,152	6,992.61	104,889,182	3.200000	2023/8/16	1.47
オーストラリア	社債券	3 NATIONAL A 230316	1,500,000	7,023.35	105,350,269	6,983.51	104,752,792	3.000000	2023/3/16	1.46
オーストラリア	社債券	3.25 COMMONWEALT 230425	1,500,000	7,064.36	105,965,402	6,976.22	104,643,397	3.250000	2023/4/25	1.46
オーストラリア	社債券	FRN SUNCORP-MET 281205	1,600,000	6,698.77	107,180,342	6,525.89	104,414,376	2.707000	2028/12/5	1.46
オーストラリア	社債券	4.3 INCITEC PIVOT 260318	1,400,000	7,240.56	101,367,910	6,960.30	97,444,229	4.300000	2026/3/18	1.36
アメリカ	社債券	3.65 WOODSIDE FI 250305	925,000	11,340.65	104,901,030	10,193.19	94,287,045	3.650000	2025/3/5	1.32
オーストラリア	社債券	FRN NATIONAL A 290517	1,500,000	6,698.45	100,476,792	6,245.83	93,687,490	3.056600	2029/5/17	1.31
アメリカ	社債券	4.2 NEWCREST FINA 221001	800,000	11,440.82	91,526,639	11,441.78	91,534,301	4.200000	2022/10/1	1.28
オーストラリア	社債券	4 CALTEX AUSTRALI 250417	1,300,000	7,281.29	94,656,803	7,007.97	91,103,620	4.000000	2025/4/17	1.27
オーストラリア	社債券	4.5 WSO FINANCE P 270331	1,200,000	7,737.77	92,853,322	7,393.46	88,721,558	4.500000	2027/3/31	1.24
オーストラリア	社債券	3.9 BRISBANE AIRP 250424	1,250,000	7,320.87	91,510,915	7,061.75	88,271,927	3.900000	2025/4/24	1.23
オーストラリア	社債券	3.5 ETSA UTILITIE 240829	1,200,000	7,158.10	85,897,226	7,037.26	84,447,127	3.500000	2024/8/29	1.18
オーストラリア	社債券	5 NATIONAL AUSTRA 240311	1,000,000	7,667.84	76,678,491	7,565.66	75,656,627	5.000000	2024/3/11	1.06

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 3月31日現在

種類	投資比率（％）
社債券	89.79
合計	89.79

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

令和 2年 3月31日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	NOTE5Y 2006	売建	24	アメリカドル	2,991,132.24	325,524,922	3,009,750	327,551,093	4.58
	アメリカ	シカゴ商品取引所	NOTE10Y 2006	売建	1	アメリカドル	132,536.87	14,423,987	138,828.13	15,108,665	0.21
	アメリカ	シカゴ商品取引所	ULTR10Y 2006	売建	7	アメリカドル	1,030,295.7	112,127,081	1,094,515.66	119,116,139	1.66
	オーストラリア	シドニー先物取引所	AUST10Y 2006	買建	178	オーストラリアドル	26,972,912.29	1,782,639,773	26,765,181.82	1,768,910,866	24.72
	オーストラリア	シドニー先物取引所	AUST3Y 2006	売建	157	オーストラリアドル	18,301,096.66	1,209,519,478	18,378,385.46	1,214,627,495	16.98

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

A M P オーストラリア高配当株式マザーファンド

投資状況

令和 2年 3月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国 / 地域	時価合計	投資比率（％）
株式	オーストラリア	3,701,584,956	97.12
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	109,833,138	2.88
純資産総額		3,811,418,094	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

令和 2年 3月31日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
オーストラリア	株式	CSL LTD	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	14,616	20,610.82	301,247,853	20,665.02	302,039,950	7.92
オーストラリア	株式	AURIZON HOLDINGS LTD	運輸	807,918	293.43	237,075,135	319.21	257,899,302	6.77
オーストラリア	株式	WESTPAC BANKING CORP	銀行	230,949	1,188.95	274,588,916	1,068.01	246,656,858	6.47
オーストラリア	株式	BHP GROUP LTD	素材	102,085	1,775.17	181,218,985	1,995.91	203,753,289	5.35
オーストラリア	株式	TELSTRA CORP LTD	電気通信サービス	765,358	218.75	167,428,109	214.79	164,393,158	4.31
オーストラリア	株式	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	銀行	35,884	4,369.87	156,808,444	4,226.45	151,662,129	3.98
オーストラリア	株式	AUST AND NZ BANKING GROUP	銀行	133,417	1,234.56	164,711,452	1,108.99	147,958,146	3.88
オーストラリア	株式	SYDNEY AIRPORT	運輸	341,862	361.51	123,587,317	393.23	134,432,274	3.53
オーストラリア	株式	QBE INSURANCE GROUP LTD	保険	235,417	700.55	164,922,321	568.37	133,804,902	3.51
オーストラリア	株式	VIRGIN MONEY UK PLC - CDI	銀行	1,491,442	144.07	214,881,296	85.25	127,154,528	3.34
オーストラリア	株式	TPG TELECOM LTD	電気通信サービス	258,187	507.57	131,048,286	469.23	121,151,410	3.18
オーストラリア	株式	AGL ENERGY LTD	公益事業	96,942	1,129.47	109,493,866	1,122.20	108,789,107	2.85
オーストラリア	株式	CROWN RESORTS LTD	消費者サービス	222,571	535.98	119,295,808	475.84	105,909,965	2.78
オーストラリア	株式	EVOLUTION MINING LTD	素材	365,718	250.48	91,605,447	276.91	101,273,568	2.66
オーストラリア	株式	ORIGIN ENERGY LTD	エネルギー	343,263	383.98	131,807,122	292.77	100,500,095	2.64
オーストラリア	株式	ARISTOCRAT LEISURE LTD	消費者サービス	69,190	1,813.50	125,476,730	1,426.88	98,726,042	2.59
オーストラリア	株式	JANUS HENDERSON GROUP-CDI	各種金融	61,003	1,607.30	98,050,658	1,587.48	96,841,152	2.54
オーストラリア	株式	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	銀行	83,772	1,207.46	101,151,699	1,077.92	90,300,176	2.37
オーストラリア	株式	ESTIA HEALTH LTD	ヘルスケア機器・サービス	1,015,878	92.52	93,995,128	87.56	88,959,675	2.33
オーストラリア	株式	SERVICE STREAM LTD	資本財	624,427	117.64	73,457,717	120.61	75,314,794	1.98
オーストラリア	株式	APA GROUP	公益事業	105,168	634.46	66,725,310	687.99	72,355,258	1.90
オーストラリア	株式	BAPCOR LTD	小売	285,631	317.23	90,611,294	251.14	71,733,941	1.88
オーストラリア	株式	AUB GROUP LTD	保険	101,216	803.65	81,342,684	633.14	64,084,121	1.68
オーストラリア	株式	OIL SEARCH LTD	エネルギー	405,964	225.36	91,490,849	153.98	62,514,275	1.64
オーストラリア	株式	ALUMINA LTD	素材	588,221	106.40	62,589,597	103.76	61,034,576	1.60

オーストラリア	株式	MINERAL RESOURCES LTD	素材	58,429	911.38	53,251,086	986.72	57,653,279	1.51
オーストラリア	株式	COLES GROUP LTD	食品・生活必需品小売り	50,262	1,062.06	53,381,576	1,111.63	55,872,938	1.47
オーストラリア	株式	REGIS HEALTHCARE LTD	ヘルスケア機器・サービス	584,031	76.66	44,774,386	95.50	55,774,989	1.46
オーストラリア	株式	COCHLEAR LTD	ヘルスケア機器・サービス	5,402	9,252.59	49,982,545	9,252.59	49,982,545	1.31
オーストラリア	株式	METCASH LTD	食品・生活必需品小売り	212,689	163.90	34,860,407	216.11	45,965,134	1.21

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 3月31日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	4.28
	素材	13.46
	資本財	1.98
	商業・専門サービス	1.04
	運輸	10.29
	消費者サービス	5.37
	メディア・娯楽	0.53
	小売	3.86
	食品・生活必需品小売り	2.67
	ヘルスケア機器・サービス	5.11
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.92
	銀行	20.04
	各種金融	2.54
	保険	5.19
	電気通信サービス	7.49
	公益事業	5.35
	小計	97.12
合計		97.12

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

AMP オーストラリアＲＥＩＴマザーファンド

投資状況

令和 2年 3月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
投資証券	オーストラリア	1,726,598,448	93.62
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	117,603,444	6.38
純資産総額		1,844,201,892	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

令和 2年 3月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	600,776	884.94	531,653,777	788.45	473,684,060	25.69
オーストラリア	投資証券	DEXUS	436,518	738.88	322,537,127	594.81	259,645,272	14.08
オーストラリア	投資証券	MIRVAC GROUP	1,328,490	169.85	225,645,753	132.17	175,599,808	9.52
オーストラリア	投資証券	GPT GROUP	567,243	318.55	180,697,413	235.28	133,461,160	7.24
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,121,683	161.25	180,882,152	97.48	109,344,743	5.93
オーストラリア	投資証券	CHARTER HALL GROUP	221,588	602.74	133,560,128	434.87	96,362,461	5.23
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	561,729	244.75	137,488,443	152.66	85,757,987	4.65
オーストラリア	投資証券	CHARTER HALL LONG WALE REIT	272,615	306.65	83,599,462	278.89	76,032,269	4.12
オーストラリア	投資証券	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	471,087	175.79	82,816,812	151.34	71,297,180	3.87
オーストラリア	投資証券	CHARTER HALL RETAIL REIT	213,037	272.91	58,140,804	201.57	42,942,827	2.33
オーストラリア	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	245,670	189.67	46,598,268	148.70	36,531,743	1.98
オーストラリア	投資証券	NATIONAL STORAGE REIT	344,987	128.87	44,460,373	104.42	36,024,302	1.95
オーストラリア	投資証券	INGENIA COMMUNITIES GROUP	155,516	270.30	42,037,234	209.50	32,581,426	1.77
オーストラリア	投資証券	BWP TRUST	146,376	212.14	31,053,507	218.09	31,924,166	1.73
オーストラリア	投資証券	VIVA ENERGY REIT	151,636	146.45	22,208,096	153.98	23,350,382	1.27

オーストラリア	投資証券	INVESTEC AUSTRALIA PROPERTY	330,972	81.94	27,121,089	68.40	22,639,527	1.23
オーストラリア	投資証券	CENTURIA OFFICE REIT	187,152	148.04	27,706,282	103.76	19,419,135	1.05

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 3月31日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	93.62
合計	93.62

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

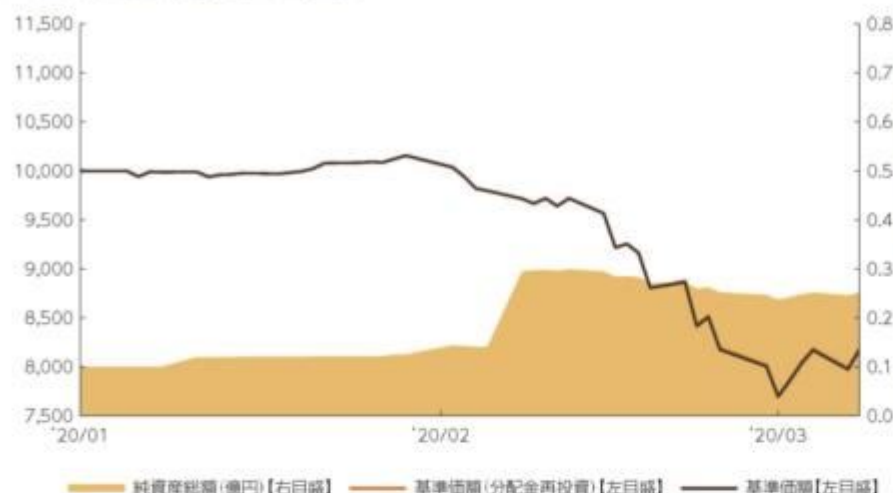
参考情報



運用実績

2020年3月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2020年1月24日(設定日)～2020年3月31日



■基準価額・純資産

基準価額	8,172円
純資産総額	0.2億円

■分配の推移

2020年3月	15円
設定来累計	15円

●分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

資産別構成	比率
外国株式	31.3%
外国債券	36.0%
外国リート	13.0%
コールローン他 (負債控除後)	19.7%
合計	100.0%

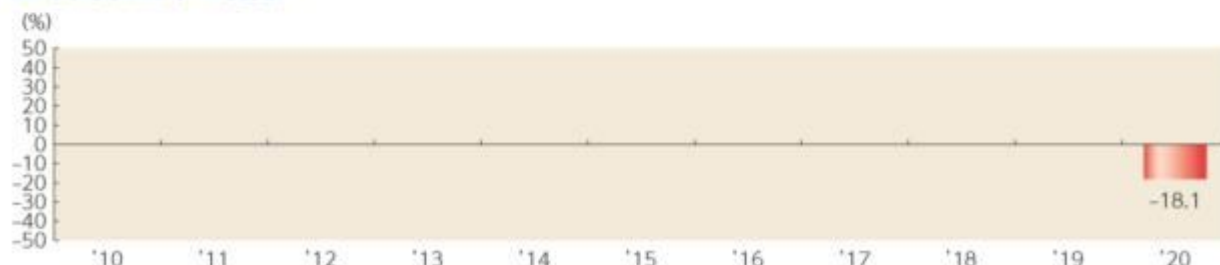
組入通貨	比率
1円	98.1%
その他	1.8%

組入上位銘柄	種類	業種／種別	国・地域	比率
CSL LTD	株式	医薬品・バイオテクノ・ライフ	オーストラリア	2.6%
AURIZON HOLDINGS LTD	株式	運輸	オーストラリア	2.2%
WESTPAC BANKING CORP	株式	銀行	オーストラリア	2.1%
BHP GROUP LTD	株式	素材	オーストラリア	1.7%
VAR BHP BILLITON 751019	債券	社債	アメリカ	1.7%
4.5 DOWNER GROUP 220311	債券	社債	オーストラリア	1.7%
VAR WESTPAC BAN 270311	債券	社債	オーストラリア	1.5%
GOODMAN GROUP	リート	ー	オーストラリア	3.6%
DEXUS	リート	ー	オーストラリア	2.0%
MIRVAC GROUP	リート	ー	オーストラリア	1.3%

その他資産の状況	比率
債券先物取引（買建）	9.9%
債券先物取引（売建）	-9.4%

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
- 外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- 2020年は設定日から3月31日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- 2 当ファンドの第1計算期間は、約款の規定に従い、令和2年1月24日から令和2年3月16日までとしております。
- 3 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（令和2年1月24日から令和2年3月16日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【オーストラリア好利回り3資産バランス＜為替ヘッジあり＞（年2回決算型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）	
第1期 [令和2年3月16日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	476,489
親投資信託受益証券	24,097,674
未収入金	2,935,471
流動資産合計	27,509,634
資産合計	27,509,634
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	153,777
未払収益分配金	46,154
未払受託者報酬	1,041
未払委託者報酬	37,966
未払利息	1
その他未払費用	82
流動負債合計	239,021
負債合計	239,021
純資産の部	
元本等	
元本	30,769,682
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,499,069
（分配準備積立金）	182,882
元本等合計	27,270,613
純資産合計	27,270,613
負債純資産合計	27,509,634

（2）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 令和 2年 1月24日 至 令和 2年 3月16日
営業収益	
有価証券売買等損益	5,534,327
為替差損益	2,429,003
営業収益合計	3,105,324
営業費用	
支払利息	12
受託者報酬	1,041
委託者報酬	37,966
その他費用	82
営業費用合計	39,101
営業利益又は営業損失（ ）	3,144,425
経常利益又は経常損失（ ）	3,144,425
当期純利益又は当期純損失（ ）	3,144,425
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	308,490
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	308,490
分配金	46,154
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,499,069

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	第1期 [令和 2年 3月16日現在]
1. 期首元本額	10,000,000円
期中追加設定元本額	20,769,682円
期中一部解約元本額	—円
2. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	3,499,069円
3. 受益権の総数	30,769,682口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第1期

自 令和 2年 1月24日

至 令和 2年 3月16日

1.運用に係る権限を委託するための費用

「AMP オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド」の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、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の44以内の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。

「AMP オーストラリア高配当株式マザーファンド」の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、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の44以内の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。

「AMP オーストラリアREITマザーファンド」の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、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の44以内の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。

2.分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	229,036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	B	—円
収益調整金額	C	116,240円
分配準備積立金額	D	—円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	345,276円
当ファンドの期末残存口数	F	30,769,682口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	112円
1万口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	46,154円

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第1期 自 令和 2年 1月24日 至 令和 2年 3月16日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。
------------------	--

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第1期 [令和 2年 3月16日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 [令和 2年 3月16日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	5,138,266
合計	5,138,266

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

第1期 [令和 2年 3月16日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建 オーストラリアドル	22,648,864	—	22,802,641	153,777
合計		22,648,864	—	22,802,641	153,777

（注）時価の算定方法

- 1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- （イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- （ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	第1期 [令和 2年 3月16日現在]
1口当たり純資産額	0.8863円
(1万口当たり純資産額)	(8,863円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	A M P オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド	9,535,523	10,569,173	
	A M P オーストラリアＲＥＩＴマザーファンド	4,356,922	4,206,172	
	A M P オーストラリア高配当株式マザーファンド	12,594,339	9,322,329	
合 計		26,486,784	24,097,674	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

（参考）

当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

A M P オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 2年 3月16日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	5,902,239
コール・ローン	110,300,132
社債券	6,993,118,786
派生商品評価勘定	44,075,655
未収入金	380,933,965
未収利息	84,858,237
前払費用	2,325,457
差入委託証拠金	193,884,584
流動資産合計	7,815,399,055
資産合計	7,815,399,055
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	162,673,507
未払解約金	75,890,000
未払利息	233
流動負債合計	238,563,740
負債合計	238,563,740
純資産の部	
元本等	
元本	6,836,005,689
剰余金	

[令和 2年 3月16日現在]

剰余金又は欠損金（ ）	740,829,626
元本等合計	7,576,835,315
純資産合計	7,576,835,315
負債純資産合計	7,815,399,055

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。 為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 2年 3月16日現在]
1. 期首	令和 2年 1月24日
期首元本額	7,625,327,693円
期中追加設定元本額	105,458,118円
期中一部解約元本額	894,780,122円
元本の内訳	
オーストラリア好利回り3資産バランス（年2回決算型）	4,590,936,366円
オーストラリア好利回り3資産バランス＜為替ヘッジあり＞（年2回決算型）	9,535,523円
三菱ＵＦＪ／ＡＭＰ オーストラリア・ハイインカム債券ファンド（毎月決算型）	2,235,533,800円
合計	6,836,005,689円
2. 受益権の総数	6,836,005,689口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 2年 1月24日 至 令和 2年 3月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

区分	自 令和 2年 1月24日 至 令和 2年 3月16日
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 当ファンドは、ファンドの運用の指図に関する権限を再委託しております。この場合、再委託先で投資リスクに対する管理体制を構築しているほか、当該再委託先のリスクの管理体制や管理状況の確認を委託会社で行っております。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 2年 3月16日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[令和 2年 3月16日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
社債券		129,499,395
合計		129,499,395

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

債券関連

[令和 2年 3月16日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,844,691,390	—	1,802,415,573	42,275,817
	売建	1,749,118,935	—	1,753,003,141	3,884,206
合計		3,593,810,325	—	3,555,418,714	46,160,023

（注）時価の算定方法

- 1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

[令和 2年 3月16日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	オーストラリアドル	1,091,127,417	—	977,145,163	113,982,254
	売建				
	アメリカドル	1,091,127,417	—	1,049,906,392	41,221,025
	オーストラリアドル	64,797,600	—	64,474,200	323,400
合計		2,247,052,434	—	2,091,525,755	72,437,829

（注）時価の算定方法

- 1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- （イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- （ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

２ 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 2年 3月16日現在]
1口当たり純資産額	1.1084円
(1万口当たり純資産額)	(11,084円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
アメリカドル	社債券	3.65 WOODSIDE FI 250305	925,000.00	927,685.18	
		4.2 NEWCREST FINA 221001	800,000.00	845,978.24	
		4.45 NEWCREST FIN 211115	500,000.00	525,646.85	
		4.6 WOODSIDE FINA 210510	200,000.00	204,072.70	
		4.75 PACIFIC NATI 280322	600,000.00	658,104.00	
		4.875 MACQUARIE B 250610	650,000.00	687,830.81	
		6 GOODMAN US FIN 220322	300,000.00	326,625.60	
		FRN BHP BILLITON 751019	1,200,000.00	1,324,734.00	
		VAR AUSNET SERV 760317	1,500,000.00	1,548,842.40	
		VAR BHP BILLITON 751019	2,820,000.00	2,804,504.10	
アメリカドル合計			9,495,000.00	9,854,023.88 (1,053,493,693)	
	社債券	1.7 MACQUARIE B 250212	900,000.00	893,223.19	

オーストラリアドル

1.85 SUNCORP-MET 240730	1,000,000.00	1,005,548.80	
2.2 COLES GROUP T 261106	500,000.00	503,851.05	
2.25 MACQUARIE UN 300522	500,000.00	510,096.10	
2.25 WESTPAC BAN 240816	600,000.00	612,374.76	
2.45 LONSDALE FIN 261120	500,000.00	496,337.93	
2.525 GPT WHL OFF 260112	500,000.00	508,542.50	
2.65 ORIGIN ENERG 271111	500,000.00	504,188.25	
2.85 WOOLWORTHS G 240423	500,000.00	522,680.20	
2.95 QANTAS AIRWA 291127	500,000.00	470,740.01	
3 DEXUS FINANCE P 320203	700,000.00	700,264.11	
3 NATIONAL A 230316	1,500,000.00	1,573,704.75	
3 SUNCORP-MET 230913	500,000.00	526,449.50	
3.1 AUST & NZ B 230118	700,000.00	732,688.39	
3.1 AUST & NZ B 240208	1,000,000.00	1,055,547.90	
3.2 COMMONWEALT 230816	2,000,000.00	2,110,785.20	
3.2 WESTPAC BAN 230306	1,500,000.00	1,576,147.95	
3.25 COMMONWEALT 220117	4,500,000.00	4,662,523.80	
3.25 COMMONWEALT 230425	2,000,000.00	2,106,607.20	
3.25 MACQUARIE B 221215	1,600,000.00	1,641,760.32	
3.35 AUST & NZ B 230509	500,000.00	528,231.90	
3.4 CONNECTEAST F 260325	750,000.00	795,059.85	
3.5 BENDIGO AND 230125	1,000,000.00	1,052,197.40	
3.5 ETSA UTILITIE 240829	1,200,000.00	1,281,386.88	
3.5 UNITED ENER 230912	500,000.00	524,768.35	
3.591 GPT WHL OFF 231107	600,000.00	633,110.46	
3.642 ENERGY PART 241211	500,000.00	534,228.45	
3.6725 GPT WHL OF 240919	600,000.00	641,007.30	
3.7 ASCIANO FIN 290924	860,000.00	872,424.07	
3.7 AUSTRALIAN CA 270803	500,000.00	560,792.25	
3.7 DOWNER GROUP 260429	500,000.00	511,753.40	
3.75 AUSGRID FINA 241030	1,000,000.00	1,085,253.30	
3.75 AUSTRALIAN P 240522	500,000.00	527,965.35	
3.75 SGSP AUSTRAL 240927	500,000.00	544,311.00	
3.75 TRANSURBAN Q 231012	600,000.00	635,453.58	
3.85 UNITED ENERG 241023	2,600,000.00	2,824,116.88	
3.9 BRISBANE AIRP 250424	1,250,000.00	1,363,718.37	
3.9 LONSDALE FINA 251015	1,600,000.00	1,730,458.24	
3.9 SHOPPING CT 240607	1,500,000.00	1,585,352.70	
4 AURIZON NETWORK 240621	1,000,000.00	1,064,185.00	
4 CALTEX AUSTRALI 250417	1,300,000.00	1,377,704.38	
4 TELSTRA COR 220916	1,650,000.00	1,750,214.07	
4.2 AUSNET SERV 280821	500,000.00	578,857.90	
	1,000,000.00	1,106,954.40	

	4.225 DBNGP FINAN 250528			
	4.25 DEXUS WHOLES 220616	700,000.00	725,841.06	
	4.3 INCITEC PIVOT 260318	1,400,000.00	1,492,955.80	
	4.4 AUSNET SERV 270816	700,000.00	813,565.55	
	4.5 AUST GAS NETW 211217	900,000.00	946,362.69	
	4.5 DOWNER GROUP 220311	4,400,000.00	4,564,416.56	
	4.5 SCENTRE MGMT 210908	1,700,000.00	1,760,361.90	
	4.5 WSO FINANCE P 270331	1,200,000.00	1,359,227.88	
	4.75 QANTAS AIRWA 261012	500,000.00	548,653.40	
	5 AGL ENERGY LTD 211105	1,100,000.00	1,141,705.95	
	5 AUST & NZ BANKI 230816	700,000.00	786,301.53	
	5 NATIONAL AUSTRA 240311	1,000,000.00	1,136,513.90	
	5.25 PACIFIC NATI 250519	1,000,000.00	1,116,421.10	
	5.75 MIRVAC GR 200918	1,000,000.00	1,021,232.10	
	6 BRISBANE AIRPOR 201021	1,100,000.00	1,128,735.41	
	7.5 QANTAS AIRWAY 210611	2,500,000.00	2,663,211.75	
	7.75 APT PIPELINE 200722	1,000,000.00	1,021,406.70	
	7.75 QANTAS AIRWA 220519	2,100,000.00	2,336,043.15	
	8.25 STOCKLAND TR 201125	500,000.00	523,058.60	
	FRN AUST & NZ B 290726	1,900,000.00	1,888,885.53	
	FRN CROWN LTD PLA 700423	413,300.00	375,644.23	
	FRN NATIONAL A 260921	500,000.00	507,472.85	
	FRN NATIONAL A 290517	1,500,000.00	1,499,543.40	
	FRN NATIONAL A 311118	550,000.00	550,968.38	
	FRN SUNCORP-MET 281205	1,600,000.00	1,603,161.44	
	FRN WESTPAC BAN 280614	900,000.00	957,471.93	
	FRN WESTPAC BAN 290816	1,800,000.00	1,896,561.18	
	FRN WESTPAC BAN 290827	900,000.00	894,758.64	
	VAR AUST & NZ B 270513	3,900,000.00	4,064,519.94	
	VAR WESTPAC BAN 270311	3,960,000.00	4,119,288.62	
オーストラリアドル合計		85,933,300.00	90,267,858.56 (5,939,625,093)	
合計			6,993,118,786 (6,993,118,786)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	社債券 10銘柄	100.00%	15.06%

オーストラリアドル	社債券	73銘柄	100.00%	84.94%
-----------	-----	------	---------	--------

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

A M P オーストラリア高配当株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
[令和 2年 3月16日現在]	
資産の部	
流動資産	
預金	258,457,761
コール・ローン	142,265,219
株式	3,957,154,621
派生商品評価勘定	15,124,339
未収入金	1,180,823,749
未収配当金	72,939,007
流動資産合計	5,626,764,696
資産合計	5,626,764,696
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	824,880
未払金	481,385,128
未払解約金	941,890,000
未払利息	301
流動負債合計	1,424,100,309
負債合計	1,424,100,309
純資産の部	
元本等	
元本	5,677,519,584
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,474,855,197
元本等合計	4,202,664,387
純資産合計	4,202,664,387
負債純資産合計	5,626,764,696

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
２．デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。
----------------------------	--

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 2年 3月16日現在]
1. 期首	令和 2年 1月24日
期首元本額	6,143,654,134円
期中追加設定元本額	920,402,884円
期中一部解約元本額	1,386,537,434円
元本の内訳	
オーストラリア好利回り3資産バランス（年2回決算型）	5,664,925,245円
オーストラリア好利回り3資産バランス＜為替ヘッジあり＞（年2回決算型）	12,594,339円
合計	5,677,519,584円
2. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	1,474,855,197円
3. 受益権の総数	5,677,519,584口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 2年 1月24日 至 令和 2年 3月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

区分	自 令和 2年 1月24日 至 令和 2年 3月16日
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 当ファンドは、ファンドの運用の指図に関する権限を再委託しております。この場合、再委託先で投資リスクに対する管理体制を構築しているほか、当該再委託先のリスクの管理体制や管理状況の確認を委託会社で行っております。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 2年 3月16日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[令和 2年 3月16日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	781,066,474
合計	781,066,474

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[令和 2年 3月16日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	オーストラリアドル	97,733,550	—	96,908,670	824,880
	売建				
	オーストラリアドル	922,171,069	—	907,046,730	15,124,339
合計		1,019,904,619	—	1,003,955,400	14,299,459

（注）時価の算定方法

- 1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- （イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- （ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 2年 3月16日現在]
1口当たり純資産額	0.7402円
(1万口当たり純資産額)	(7,402円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	OIL SEARCH LTD	398,903	3.48	1,388,182.44	

オーストラリア ドル	ORIGIN ENERGY LTD	337,293	5.89	1,986,655.77	
	ALUMINA LTD	577,990	1.62	939,233.75	
	BHP GROUP LTD	100,311	26.72	2,680,309.92	
	EVOLUTION MINING LTD	359,357	3.79	1,361,963.03	
	ORORA LTD	263,306	2.57	676,696.42	
	RIO TINTO LTD	20,750	81.08	1,682,410.00	
	SOUTH32 LTD	351,091	1.93	679,361.08	
	GWA GROUP LTD	202,794	3.15	638,801.10	
	SERVICE STREAM LTD	281,396	1.84	517,768.64	
	DOWNER EDI LTD	205,887	4.18	860,607.66	
	AURIZON HOLDINGS LTD	793,866	4.47	3,548,581.02	
	QANTAS AIRWAYS LTD	165,972	3.18	527,790.96	
	SYDNEY AIRPORT	195,927	5.81	1,138,335.87	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	67,987	27.91	1,897,517.17	
	CROWN RESORTS LTD	218,701	8.20	1,793,348.20	
	SOUTHERN CROSS MEDIA GROUP L	829,044	0.52	431,102.88	
	ACCENT GROUP LTD	881,563	1.09	960,903.67	
	BAPCOR LTD	218,030	5.31	1,157,739.30	
	JB HI-FI LTD	6,095	33.53	204,365.35	
	COLES GROUP LTD	49,389	16.05	792,693.45	
	ESTIA HEALTH LTD	998,208	1.42	1,422,446.40	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,430	62.50	526,875.00	
	REGIS HEALTHCARE LTD	573,872	1.17	674,299.60	
	CSL LTD	14,363	313.83	4,507,540.29	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	131,098	18.80	2,464,642.40	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,031	6.74	128,268.94	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	35,261	66.36	2,339,919.96	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	82,316	18.41	1,515,437.56	
	VIRGIN MONEY UK PLC - CDI	1,465,498	2.23	3,268,060.54	
	WESTPAC BANKING CORP	226,933	18.12	4,112,025.96	
	JANUS HENDERSON GROUP-CDI	59,943	24.36	1,460,211.48	
	AUB GROUP LTD	204,604	12.22	2,500,260.88	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	231,324	10.72	2,479,793.28	
	TELSTRA CORP LTD	752,046	3.32	2,496,792.72	
	TPG TELECOM LTD	176,628	8.15	1,439,518.20	
	AGL ENERGY LTD	95,257	17.17	1,635,562.69	
	APA GROUP	103,340	9.65	997,231.00	
	SPARK INFRASTRUCTURE GROUP	170,879	1.79	305,873.41	
オーストラリアドル 小計		11,874,683		60,139,127.99	(3,957,154,621)
合 計		11,874,683		3,957,154,621	(3,957,154,621)

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
オーストラリアドル	株式 39銘柄	100.00%	100.00%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

A M P オーストラリア R E I T マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 2年 3月16日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	125,290,372
コール・ローン	26,779,208
投資証券	2,120,161,457
派生商品評価勘定	7,774,081
未収入金	393,232,621
未収配当金	399,459
流動資産合計	2,673,637,198
資産合計	2,673,637,198
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,623
未払解約金	510,510,000
未払利息	56
流動負債合計	510,520,679
負債合計	510,520,679
純資産の部	
元本等	
元本	2,240,529,188
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	77,412,669
元本等合計	2,163,116,519

[令和 2年 3月16日現在]

純資産合計	2,163,116,519
負債純資産合計	2,673,637,198

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 2年 3月16日現在]
1. 期首	令和 2年 1月24日
期首元本額	2,933,747,863円
期中追加設定元本額	104,051,855円
期中一部解約元本額	797,270,530円
元本の内訳	
オーストラリア好利回り3資産バランス（年2回決算型）	1,951,741,304円
オーストラリア好利回り3資産バランス＜為替ヘッジあり＞（年2回決算型）	4,356,922円
三菱ＵＦＪ／ＡＭＰ オーストラリアＲＥＩＴファンド＜為替ヘッジなし＞（毎月決算型）	284,430,962円
合計	2,240,529,188円
2. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	77,412,669円
3. 受益権の総数	2,240,529,188口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 2年 1月24日 至 令和 2年 3月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

区分	自 令和 2年 1月24日 至 令和 2年 3月16日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 当ファンドは、ファンドの運用の指図に関する権限を再委託しております。この場合、再委託先で投資リスクに対する管理体制を構築しているほか、当該再委託先のリスクの管理体制や管理状況の確認を委託会社で行っております。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 2年 3月16日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	[令和 2年 3月16日現在]
--	-------------------

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	236,286,243
合計	236,286,243

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[令和 2年 3月16日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	オーストラリアドル	9,994,255	—	9,983,632	10,623
	売建				
	オーストラリアドル	502,317,511	—	494,543,430	7,774,081
合計		512,311,766	—	504,527,062	7,763,458

（注）時価の算定方法

- 1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

（イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

（ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 2年 3月16日現在]
1口当たり純資産額	0.9654円
(1万口当たり純資産額)	(9,654円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
オーストラリアドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	240,852	734,598.60	
		BWP TRUST	78,382	271,201.72	
		CENTURIA OFFICE REIT	169,357	423,392.50	
		CHARTER HALL GROUP	213,966	2,073,330.54	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	267,838	1,282,944.02	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	167,190	727,276.50	
		DEXUS	390,861	4,530,078.99	
		GOODMAN GROUP	551,017	7,581,993.92	
		GPT GROUP	535,503	2,741,775.36	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	152,842	664,862.70	
		INVESTEC AUSTRALIA PROPERTY	293,576	369,905.76	
		MIRVAC GROUP	1,431,059	3,863,859.30	
		NATIONAL STORAGE REIT	397,729	815,344.45	
		SCENTRE GROUP	1,095,066	2,847,171.60	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	426,586	1,156,048.06	
		STOCKLAND	537,064	2,137,514.72	
オーストラリアドル合計			6,948,888	32,221,298.74 (2,120,161,457)	
合計				2,120,161,457 (2,120,161,457)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
オーストラリアドル	投資証券 16銘柄	100.00%	100.00%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

2【ファンドの現況】

【オーストラリア好利回り3資産バランス＜為替ヘッジあり＞（年2回決算型）】

【純資産額計算書】

令和 2年 3月31日現在

（単位：円）

資産総額	26,779,805
負債総額	1,627,797
純資産総額（ - ）	25,152,008
発行済口数	30,779,313口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.8172
（10,000口当たり）	（8,172）

（参考）

A M P オーストラリア・ハイインカム債券マザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 3月31日現在

（単位：円）

資産総額	7,183,452,488
負債総額	28,698,097
純資産総額（ - ）	7,154,754,391
発行済口数	6,473,802,842口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.1052
（10,000口当たり）	（11,052）

A M P オーストラリア高配当株式マザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 3月31日現在

（単位：円）

資産総額	3,933,397,742
負債総額	121,979,648
純資産総額（ - ）	3,811,418,094
発行済口数	5,598,390,785口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.6808
（10,000口当たり）	（6,808）

AMP オーストラリアREITマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 3月31日現在

（単位：円）

資産総額	1,903,926,022
負債総額	59,724,130
純資産総額（ - ）	1,844,201,892
発行済口数	2,588,124,189口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.7126
（10,000口当たり）	（7,126）

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

< 更新後 >

（１）資本金の額等

2020年3月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近５年間における資本金の額の増減はありません。

（２）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席する株主総会にてその議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

投資行動のモニタリング１

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング２

運用部から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに関係する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

< 更新後 >

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

2020年 3月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	872	12,674,222
追加型公社債投資信託	16	1,269,684
単位型株式投資信託	64	355,316
単位型公社債投資信託	14	74,863
合 計	966	14,374,084

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

< 更新後 >

(1) 受託会社

名称：三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（2019年9月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (2019年9月末現在)	事業の内容
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。

(3) 再委託先

名称：AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッド

資本金の額：70百万豪ドル（2019年6月末現在）

事業の内容：投資運用業務を営んでいます。

3【資本関係】

< 訂正前 >

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2019年10月末現在）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581株）を所有しています。

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が３％以上のものを記載しています。

<訂正後>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2020年3月末現在）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581株）を所有しています。

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が３％以上のものを記載しています。

独立監査人の監査報告書

令和２年４月22日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
取締役会 御中

P w C あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているオーストラリア好利回り３資産バランス＜為替ヘッジあり＞（年２回決算型）の令和２年１月24日から令和２年３月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、オーストラリア好利回り３資産バランス＜為替ヘッジあり＞（年２回決算型）の令和２年３月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。