

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
設定日	2003年4月18日
信託期間	無期限
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、豪ドル建ての高格付けの公社債および短期金融商品に投資を行うことにより、安定した利息収益の確保を目指して運用を行います。
主要運用対象	短期豪ドル債オープン（毎月分配型） <ul style="list-style-type: none">短期豪ドル債マザーファンドを主要投資対象とします。 短期豪ドル債マザーファンド <ul style="list-style-type: none">高格付けの豪ドル建ての公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。
投資制限	短期豪ドル債オープン（毎月分配型） <ul style="list-style-type: none">株式（転換社債からの転換等に限る）への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 短期豪ドル債マザーファンド <ul style="list-style-type: none">株式（転換社債からの転換等に限る）への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。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	毎月7日（休業日の場合は、翌営業日）の決算日に、分配金額は経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益も含みます。）等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には分配を行わないことがあります。 *分配金自動再投資型の場合、分配金は税金を差し引いた後自動的に無手数料で再投資されます。

運用報告書（全体版）

第35作成期

決算日

第204期 2020年5月7日

第205期 2020年6月8日

第206期 2020年7月7日

第207期 2020年8月7日

第208期 2020年9月7日

第209期 2020年10月7日

短期豪ドル債オープン （毎月分配型）

受益者の皆様へ

毎々、格別のお引き立てにあずかり厚くお礼申し上げます。

さて「短期豪ドル債オープン（毎月分配型）」は、上記の通り決算を行いました。

ここに、第35作成期（第204期～第209期）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。

- 口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
- 運用報告書についてのお問い合わせ
コールセンター 0120-88-2976
受付時間：午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

<https://www.smd-am.co.jp>

短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			BBSW AUD 1Month (参考指数)	公社債 組入比率	債券先物 組入比率	純資産額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
第180期(2018年5月7日)	3,826	20	△ 0.0	1.8850	98.0	—	230,016
第181期(2018年6月7日)	3,923	20	3.1	1.8873	93.1	—	232,185
第182期(2018年7月9日)	3,808	20	△ 2.4	1.9800	93.3	—	222,540
第183期(2018年8月7日)	3,789	20	0.0	1.8882	96.1	—	218,449
第184期(2018年9月7日)	3,648	20	△ 3.2	1.8550	97.2	—	207,414
第185期(2018年10月9日)	3,656	20	0.8	1.8641	97.7	—	204,855
第186期(2018年11月7日)	3,734	20	2.7	1.8650	98.0	—	207,021
第187期(2018年12月7日)	3,696	20	△ 0.5	1.8900	94.9	—	201,328
第188期(2019年1月7日)	3,489	20	△ 5.1	2.0100	95.5	—	187,617
第189期(2019年2月7日)	3,527	10	1.4	2.0095	99.5	—	187,497
第190期(2019年3月7日)	3,543	10	0.7	1.8530	97.6	—	183,220
第191期(2019年4月8日)	3,573	10	1.1	1.7400	98.0	—	180,426
第192期(2019年5月7日)	3,497	10	△ 1.8	1.5700	96.8	—	174,435
第193期(2019年6月7日)	3,419	10	△ 1.9	1.3750	97.0	—	168,538
第194期(2019年7月8日)	3,422	10	0.4	1.1250	98.2	—	165,992
第195期(2019年8月7日)	3,247	10	△ 4.8	1.0250	97.1	—	155,099
第196期(2019年9月9日)	3,291	10	1.7	1.0552	97.1	—	155,347
第197期(2019年10月7日)	3,243	10	△ 1.2	0.8997	96.0	—	150,835
第198期(2019年11月7日)	3,349	10	3.6	0.9300	95.4	—	152,871
第199期(2019年12月9日)	3,315	10	△ 0.7	0.8300	93.2	—	148,707
第200期(2020年1月7日)	3,347	10	1.3	0.8725	98.1	—	147,547
第201期(2020年2月7日)	3,281	10	△ 1.7	0.8150	98.5	—	142,517
第202期(2020年3月9日)	2,995	10	△ 8.4	0.5831	96.2	—	128,282
第203期(2020年4月7日)	2,929	10	△ 1.9	0.2400	96.9	—	123,991
第204期(2020年5月7日)	2,992	10	2.5	0.0950	95.9	—	125,879
第205期(2020年6月8日)	3,361	10	12.7	0.0850	98.3	—	140,450
第206期(2020年7月7日)	3,294	10	△ 1.7	0.0900	95.9	—	135,936
第207期(2020年8月7日)	3,352	10	2.1	0.0900	99.2	—	136,101
第208期(2020年9月7日)	3,395	10	1.6	0.0900	97.8	—	136,269
第209期(2020年10月7日)	3,279	10	△ 3.1	0.0900	99.1	—	130,226

BBSW AUD 1Monthは、オーストラリア金融市場協会（AFMA）が算出している銀行間取引金利です。

* 基準価額の騰落率は分配金込み

* 先物組入比率は、買建比率－売建比率

* 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質組入比率を記載しています。

短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		BBSW AUD 1Month (参考指数)	公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 組 入 比 率
		円	騰 落 率			
第204期	(期 首) 2020年 4月 7日	2,929	—	0.2400	96.9	—
	4月末	3,080	5.2	0.1050	94.5	—
	(期 末) 2020年 5月 7日	3,002	2.5	0.0950	95.9	—
第205期	(期 首) 2020年 5月 7日	2,992	—	0.0950	95.9	—
	5月末	3,144	5.1	0.0900	97.8	—
	(期 末) 2020年 6月 8日	3,371	12.7	0.0850	98.3	—
第206期	(期 首) 2020年 6月 8日	3,361	—	0.0850	98.3	—
	6月末	3,252	△ 3.2	0.0900	97.6	—
	(期 末) 2020年 7月 7日	3,304	△ 1.7	0.0900	95.9	—
第207期	(期 首) 2020年 7月 7日	3,294	—	0.0900	95.9	—
	7月末	3,318	0.7	0.0900	98.1	—
	(期 末) 2020年 8月 7日	3,362	2.1	0.0900	99.2	—
第208期	(期 首) 2020年 8月 7日	3,352	—	0.0900	99.2	—
	8月末	3,405	1.6	0.0950	97.1	—
	(期 末) 2020年 9月 7日	3,405	1.6	0.0900	97.8	—
第209期	(期 首) 2020年 9月 7日	3,395	—	0.0900	97.8	—
	9月末	3,307	△ 2.6	0.0900	99.0	—
	(期 末) 2020年10月 7日	3,289	△ 3.1	0.0900	99.1	—

* 騰落率は期首比です。

* 期末基準価額は分配金込み

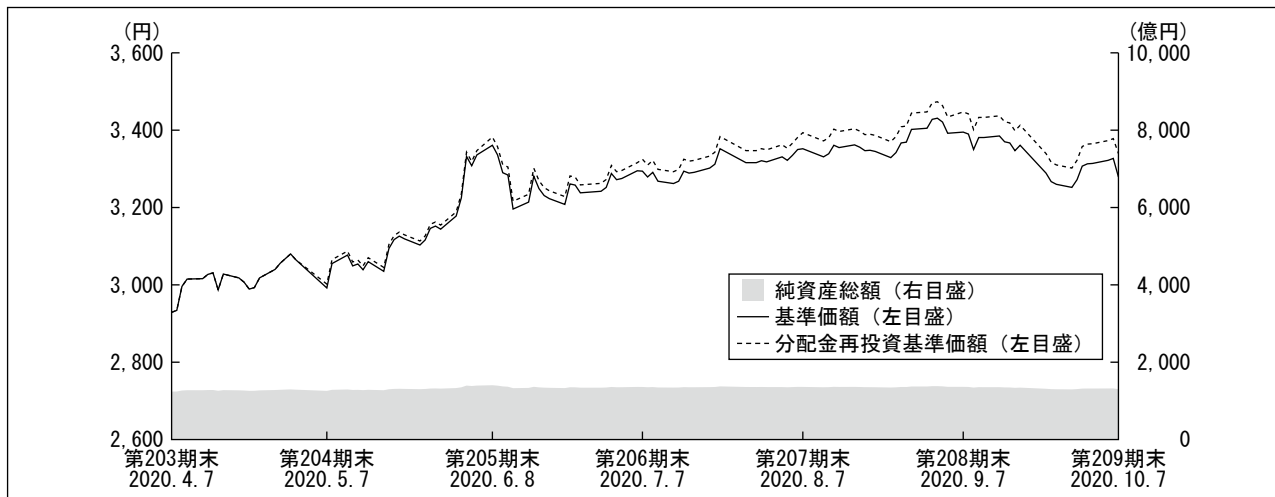
* 先物組入比率は、買建比率－売建比率

* 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質組入比率を記載しています。

短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

運用経過

【基準価額等の推移】



*当ファンドにはベンチマークはありません。

*分配金再投資基準価額は、作成期首の基準価額を基準に算出しております。

*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はありません。

*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。従って、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。

第204期首： 2,929円

第209期末： 3,279円（作成対象期間における期中分配金合計額 60円）

騰落率： +14.0%（分配金再投資ベース）

【基準価額の主な変動要因】

当ファンドは、短期豪ドル債マザーファンドへの投資を通じて、豪ドル建ての高格付けの公社債および短期金融商品へ投資を行いました。

（上昇要因）

豪ドル円の上昇が、主な基準価額の上昇要因となりました。当作成期、各国政府の積極的な財政政策や各国中央銀行の金融緩和策を背景にリスクセンチメント（リスクに対する市場心理）が急回復し、豪ドル円は上昇基調をたどりました。また、作成期末にかけてはRBA（オーストラリア準備銀行）の追加金融緩和期待が高まり、債券利回りの低下（価格は上昇）も上昇要因となりました。

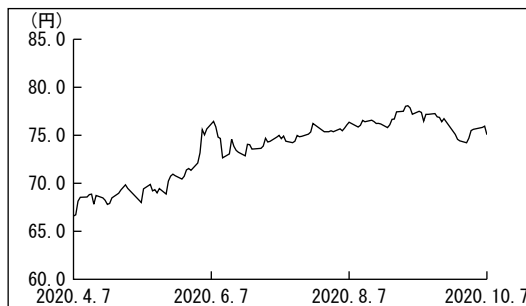
短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

【投資環境】

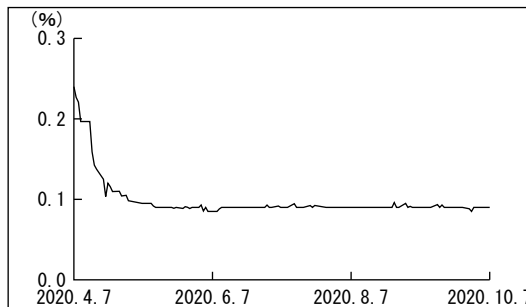
当作成期のオーストラリア債券市場は、RBAが3年国債の利回り目標を導入する中で、短中期債は横ばいで推移した後、作成期末にかけては追加金融緩和への期待が高まったことから、利回りが低下（価格は上昇）しました。長期債の利回りは、株式市場の上昇やオーストラリアでの感染第二波および一部地域での再ロックダウン（都市封鎖）への懸念などを材料に上下しましたが、作成期首対比では小幅に低下して終わりました。

豪ドル円は4月以降、上昇基調をたどりました。各国の積極的な財政政策や新型コロナの感染拡大が減速したことなどから、グローバルに株式市場は上昇基調となり、円安が続きました。オーストラリアの経済指標が他国対比堅調だったことや、特にリスクセンチメントに敏感なことから、豪ドルは他通貨対比でとりわけアウトパフォームし、作成中の豪ドル円は大幅に上昇しました。

為替レート（豪ドル／円）の推移



BBSW AUD 1Monthの推移



短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

【ポートフォリオ】

■短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

主要投資対象である短期豪ドル債マザーファンドを作成期を通じて高位に組み入れ、作成期末の実質的な公社債組入比率は99.1%としました。

■短期豪ドル債マザーファンド

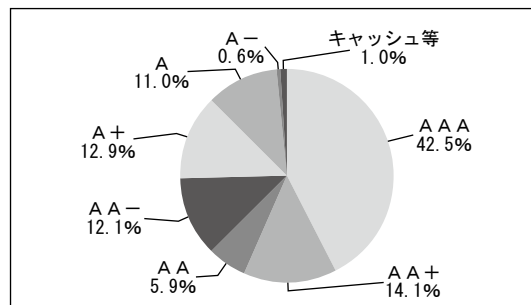
当作成期の騰落率は、+14.6%となりました。

当作成期は、新型コロナウイルスの景気への影響が不透明な中、RBAの強力な金融緩和およびハト派的な姿勢が継続し、特に当ファンドで主に組み入れている短中期債の利回り上昇余地は大きくないとの見通しの下、デュレーション*を長めに維持しました。社債の組入比率は高めを維持しつつ、機動的に入れ替えを行いました。

作成期首時点のデュレーションは0.9年近辺と、すでにデュレーション制約の上限付近としており、作成期中もデュレーションを0.9年台と上限付近で維持しました。社債については、4月以降に市場が落ち着きを取り戻す中で買い戻しが進みました。割安に発行された新発債を組み入れ、買い戻しが進んだ銘柄を売却することで、社債の組入比率を高めに維持しました。

格付別資産構成

(2020年10月7日現在)



*純資産総額に対する評価額の割合

*グラフの格付表記はS&Pの格付記号で表示しています。

*デュレーションとは、「投資元本の平均的回収期間」を表す指標で、単位は「年」で表示されます。また、「金利の変動に対する債券価格の変動性」の指標としても利用され、一般的にこの値が長い（大きい）ほど、金利の変動に対する債券価格の変動が大きくなります。

【ベンチマークとの差異】

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。BBSW AUD 1Monthを参考指数としているため、当ファンドの基準価額の騰落率との対比をしておりません。

【分配金】

分配金は、分配可能額、基準価額水準等を勘案し、第204期～第209期の各期において10円とさせていただきます。（1万口当り税込み）

なお、留保益につきましては、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

(1万口当り・税引前)

項目	第204期	第205期	第206期	第207期	第208期	第209期
	2020年4月8日 ～2020年5月7日	2020年5月8日 ～2020年6月8日	2020年6月9日 ～2020年7月7日	2020年7月8日 ～2020年8月7日	2020年8月8日 ～2020年9月7日	2020年9月8日 ～2020年10月7日
当期分配金 (円)	10	10	10	10	10	10
(対基準価額比率) (%)	0.33	0.30	0.30	0.30	0.29	0.30
当期の収益 (円)	4	5	1	4	4	1
当期の収益以外 (円)	6	4	9	5	6	8
翌期繰越分配対象額 (円)	166	161	153	147	142	133

※円未満を切り捨てしているため、「当期分配金」は「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計額と一致しない場合があります。

※当期分配金の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、ファンドの収益率とは異なります。

短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

今後の運用方針

■短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

引き続き、運用の基本方針に基づき、マザーファンドへの投資を通じて、豪ドル建ての高格付けの公社債および短期金融商品に投資を行うことにより、安定した利息収益の確保を目指して運用を行います。

■短期豪ドル債マザーファンド

新型コロナウイルスの感染拡大には一服感が出ており、これまでに発表された経済指標は想定ほど悪化しなかったものの、欧米では新規感染者数が増加しつつあることや、オーストラリアでは失業保険の期限切れによる今後の経済への影響が懸念され、不透明な要因がくすぶっています。こうした状況下でRBAに対しては早期の追加緩和期待が高まっており、当面は債券利回りの上昇リスクは限定的と予想しています。また、社債市場の買い戻しの動きは一巡感が見られるものの、RBAの追加緩和や、国債利回りの低下が進むことによる投資家の利回り需要から、社債市場も堅調に推移すると見えています。

今後の運用方針については、デュレーションは長めに維持しつつ、市場環境および経済指標を見極め、調整を行う方針です。社債については、組入比率を高め維持することを基本とし、新発債などの割安な銘柄への入れ替えを適宜検討します。

1万口当りの費用明細

項目	第204期～第209期		項目の概要
	2020年4月8日～2020年10月7日		
	金額	比率	
信託報酬	16円	0.495%	信託報酬＝作成期中の平均基準価額×信託報酬率 作成期中の平均基準価額は3,251円です。
（投信会社）	（8）	（0.242）	ファンドの運用等の対価
（販売会社）	（8）	（0.231）	購入後の情報提供、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等の対価
（受託会社）	（1）	（0.022）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
その他費用	1	0.015	その他費用＝作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数
（保管費用）	（0）	（0.014）	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）	（0）	（0.001）	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（その他）	（0）	（0.000）	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	17	0.511	

* 「比率」欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

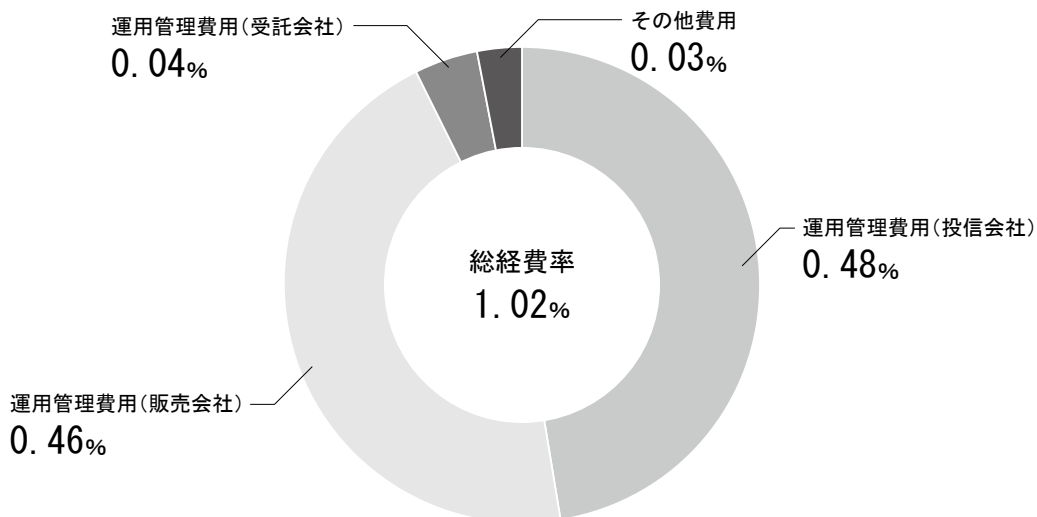
* 作成期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む。）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

なお、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受益証券が支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

* 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

参考情報 総経費率（年率換算）



*各費用は、前掲「1万口当りの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、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。

*各比率は、年率換算した値（小数点以下第2位未満を四捨五入）です。

*上記の前提条件で算出しているため、「1万口当りの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、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。

当作成期中の運用・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。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率換算）は1.02%です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

（2020年4月8日から2020年10月7日まで）

決 算 期	第 204 期 ～ 第 209 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
短 期 豪 ドル 債 マ ザ ー フ ァ ン ド	303,737	636,297	5,985,238	12,796,038

短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

利害関係人との取引状況等

（2020年4月8日から2020年10月7日まで）

■利害関係人との取引状況

<短期豪ドル債オープン（毎月分配型）>

当作成期における利害関係人との取引はありません。

<短期豪ドル債マザーファンド>

区分	第 204 期 ~			第 209 期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
為替	百万円 278,359	百万円 4,498	% 1.6	百万円 290,216	百万円 4,498	% 1.6

*平均保有割合97.8%

*平均保有割合とは親投資信託残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合

■利害関係人の発行する有価証券等

<短期豪ドル債マザーファンド>

種類	第 204 期 ~ 第 209 期		
	買付額	売付額	作成期末保有額
債券	百万円 -	百万円 -	百万円 1,743

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あり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、株式会社三井住友銀行、株式会社三井住友フィナンシャルグループです。

組入資産の明細

2020年10月7日現在

■親投資信託残高

	第 203 期 末	第 209 期 末
	口数	口数 評価額
短期豪ドル債マザーファンド	65,480,869 千口	59,799,368 千口 130,308,803 千円

*短期豪ドル債マザーファンド全体の受益権口数は、61,187,896千口です。

投資信託財産の構成

2020年10月7日現在

項目	第 209 期 末	
	評価額	比率
短期豪ドル債マザーファンド	130,308,803 千円	99.5 %
コール・ローン等、その他	617,228	0.5
投資信託財産総額	130,926,032	100.0

*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。

1 オーストラリア・ドル=75.06円

*短期豪ドル債マザーファンド

当期末における外貨建資産（131,687,802千円）の投資信託財産総額（135,944,493千円）に対する比率 96.9%

短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	(2020年5月7日)	(2020年6月8日)	(2020年7月7日)	(2020年8月7日)	(2020年9月7日)	(2020年10月7日) 現在
	第204期末	第205期末	第206期末	第207期末	第208期末	第209期末
(A) 資産	126,469,010,272円	141,192,478,269円	136,577,552,213円	136,895,561,676円	137,047,657,865円	130,926,032,684円
コール・ローン等	-	-	-	-	2,803,653	5,457,256
短期豪ドル債 マザーファンド(評価額)	126,438,636,183	141,136,071,942	136,519,982,262	136,832,391,336	136,436,994,432	130,308,803,817
未収入金	30,374,089	56,406,327	57,569,951	63,170,340	607,859,780	611,771,611
(B) 負債	589,088,299	742,382,215	641,411,140	794,388,677	778,449,506	699,954,034
未払収益分配金	420,705,107	417,873,650	412,723,988	405,985,562	401,324,742	397,123,727
未払解約金	64,344,864	209,875,825	121,832,963	273,332,041	261,485,594	193,114,534
未払信託報酬	103,810,508	114,161,912	106,163,135	114,144,606	114,477,288	108,326,054
その他未払費用	227,820	470,828	691,054	926,468	1,161,882	1,389,719
(C) 純資産総額(A-B)	125,879,921,973	140,450,096,054	135,936,141,073	136,101,172,999	136,269,208,359	130,226,078,650
元本	420,705,107,412	417,873,650,157	412,723,988,443	405,985,562,742	401,324,742,600	397,123,727,988
次期繰越損益金	△294,825,185,439	△277,423,554,103	△276,787,847,370	△269,884,389,743	△265,055,534,241	△266,897,649,338
(D) 受益権総口数	420,705,107,412口	417,873,650,157口	412,723,988,443口	405,985,562,742口	401,324,742,600口	397,123,727,988口
1万口当り基準価額(C/D)	2,992円	3,361円	3,294円	3,352円	3,395円	3,279円

*元本状況

期首元本額	423,263,275,862円	420,705,107,412円	417,873,650,157円	412,723,988,443円	405,985,562,742円	401,324,742,600円
期中追加設定元本額	365,316,159円	425,190,978円	384,601,921円	567,255,168円	320,093,837円	346,306,796円
期中一部解約元本額	2,923,484,609円	3,256,648,233円	5,534,263,635円	7,305,680,869円	4,980,913,979円	4,547,321,408円

*元本の欠損

294,825,185,439円	277,423,554,103円	276,787,847,370円	269,884,389,743円	265,055,534,241円	266,897,649,338円
------------------	------------------	------------------	------------------	------------------	------------------

損益の状況

項目	自2020年4月8日 至2020年5月7日	自2020年5月8日 至2020年6月7日	自2020年6月9日 至2020年7月7日	自2020年7月8日 至2020年8月7日	自2020年8月8日 至2020年9月7日	自2020年9月8日 至2020年10月7日
----	--------------------------	--------------------------	--------------------------	--------------------------	--------------------------	---------------------------

項目	第204期	第205期	第206期	第207期	第208期	第209期
(A) 配当等収益	-円	-円	-円	-円	△ 137円	△ 860円
受取利息	-	-	-	-	9	15
支払利息	-	-	-	-	△ 146	△ 875
(B) 有価証券売買損益	3,160,797,225	15,946,426,109	△ 2,262,194,628	2,904,537,178	2,246,258,198	△ 4,109,784,300
売買利益	3,184,999,842	16,002,228,086	49,774,433	2,921,286,018	2,259,727,046	25,858,246
売買損益	△ 24,202,617	△ 55,801,977	△ 2,311,969,061	△ 16,748,840	△ 13,468,848	△ 4,135,642,546
(C) 信託報酬等	△ 104,038,328	△ 114,404,920	△ 106,383,361	△ 114,380,020	△ 114,712,702	△ 108,553,891
(D) 当期損益金(A+B+C)	3,056,758,897	15,832,021,189	△ 2,368,577,989	2,790,157,158	2,131,545,359	△ 4,218,339,051
(E) 前期繰越損益金	△ 78,728,879,121	△ 75,253,766,505	△ 58,882,631,276	△ 60,208,609,409	△ 56,914,927,436	△ 54,321,730,299
(F) 追加信託差損益金 (配当等相当額)	△ 218,732,360,108	△ 217,583,935,137	△ 215,123,914,117	△ 212,059,951,930	△ 209,870,827,422	△ 207,960,456,261
(配当等相当額)	(7,202,467,345)	(6,903,450,172)	(6,653,418,106)	(6,179,576,392)	(5,908,175,763)	(5,608,190,783)
(売買損益相当額)	(△225,934,827,453)	(△224,487,385,309)	(△221,777,332,223)	(△218,239,528,322)	(△215,779,003,185)	(△213,568,647,044)
(G) 計(D+E+F)	△ 294,404,480,332	△ 277,005,680,453	△ 276,375,123,382	△ 269,478,404,181	△ 264,654,209,499	△ 266,500,525,611
(H) 収益分配金	△ 420,705,107	△ 417,873,650	△ 412,723,988	△ 405,985,562	△ 401,324,742	△ 397,123,727
次期繰越損益金(G+H)	△ 294,825,185,439	△ 277,423,554,103	△ 276,787,847,370	△ 269,884,389,743	△ 265,055,534,241	△ 266,897,649,338
追加信託差損益金	△ 218,984,783,172	△ 217,751,084,597	△ 215,495,365,706	△ 212,262,944,711	△ 210,111,622,267	△ 208,278,155,243
(配当等相当額)	(6,950,184,251)	(6,736,433,779)	(6,282,088,120)	(5,976,775,263)	(5,667,486,423)	(5,290,604,465)
(売買損益相当額)	(△225,934,967,423)	(△224,487,518,376)	(△221,777,453,826)	(△218,239,719,974)	(△215,779,108,690)	(△213,568,759,708)
分配準備積立金	41,474,861	3,077,937	40,871,376	20,252,849	37,727,419	23,831,651
繰越損益金	△ 75,881,877,128	△ 59,675,547,443	△ 61,333,353,040	△ 57,641,697,881	△ 54,981,639,393	△ 58,643,325,746

*有価証券売買損益には、期末の評価換えによるものを含みます。

*信託報酬等には、消費税等相当額を含めて表示しております。

*追加信託差損益金とは、追加信託金と元本の差額をいい、元本を下回る額は損失として、上回る額は利益として処理されます。

短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

<分配金の計算過程>

信託約款に基づき計算した収益分配可能額及び収益分配金の計算過程は以下のとおりです。

決 算 期	第 204 期	第 205 期	第 206 期	第 207 期	第 208 期	第 209 期
(A) 配当等収益（費用控除後）	203,737,395円	212,648,081円	79,106,578円	183,097,007円	178,252,794円	65,956,203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	0	0	0	0	0
(C) 収益調整金	7,202,607,315	6,903,583,239	6,653,539,709	6,179,768,044	5,908,281,268	5,608,303,447
(D) 分配準備積立金	6,019,509	41,154,046	3,037,197	40,148,623	20,004,522	37,300,193
分配可能額（A+B+C+D）	7,412,364,219	7,157,385,366	6,735,683,484	6,403,013,674	6,106,538,584	5,711,559,843
（1万口当り分配可能額）	（ 176.19）	（ 171.28）	（ 163.2）	（ 157.72）	（ 152.16）	（ 143.82）
収益分配金	420,705,107	417,873,650	412,723,988	405,985,562	401,324,742	397,123,727
（1万口当り収益分配金）	（ 10）	（ 10）	（ 10）	（ 10）	（ 10）	（ 10）

分配金のお知らせ

決 算 期	第 204 期	第 205 期	第 206 期	第 207 期	第 208 期	第 209 期
1万口当り分配金（税込み）	10円	10円	10円	10円	10円	10円

■分配金のお支払いについて

分配金のお支払いは各決算日から起算して5営業日までに開始いたします。

■課税上のお取扱いについて

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税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、申告分離課税または総合課税を選択することもできます。

※法人の受益者の場合、税率が異なります。

※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。

※税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

※課税上のお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。

お知らせ

該当事項はございません。

※各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しております。

短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

資産、負債、元本及び基準価額の状況の見方

(A) 資産	ファンドが保有する全ての資産の金額
コール・ローン等	コール・ローン、金銭信託等の短期金融資産
短期豪ドル債マザーファンド(評価額)	ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の時価評価額
未収入金	入金が予定されている組入有価証券の売却代金等
(B) 負債	支払い予定の金額の合計額
未払収益分配金	支払い予定の収益分配金
未払解約金	支払い予定の解約金
未払信託報酬	支払い予定の信託報酬費用
その他未払費用	支払い予定の監査費用やファンドの運営にかかる費用
(C) 純資産総額(A - B)	ファンド全体の純資産額
元本	ファンドの元本残高
次期繰越損益金	純資産総額と元本の差額（翌期に繰り越す損益金の合計額）
(D) 受益権総口数	受益者が所有する受益権口数の合計
1万口当り基準価額(C / D)	1万口当りのファンドの時価

損益の状況の見方

(A) 配当等収益	受取利息、支払利息等の合計
受取利息	コール・ローン等の運用の利息
支払利息	金銭信託で発生するマイナス利息
(B) 有価証券売買損益	有価証券の売買損益と期末の評価損益の合計
売買益	売買益と期末評価益の合計
売買損	売買損と期末評価損の合計
(C) 信託報酬等	ファンドの経費（消費税等相当額を含む）
(D) 当期損益金(A + B + C)	当期における収支合計
(E) 前期繰越損益金	前期分の繰越損益金から当期中の解約分相当の取り崩し分を控除した金額
(F) 追加信託差損益金	受益者がファンドに払い込んだ金額とファンドの元本との差額
（配当等相当額）	配当等に相当する額
（売買損益相当額）	売買損益に相当する額
(G) 計(D + E + F)	期中の収支の総合計
(H) 収益分配金	受益者に支払われる分配金
次期繰越損益金(G + H)	翌期に繰り越す損益金の合計
追加信託差損益金	翌期に繰り越す追加信託差損益金
（配当等相当額）	配当等に相当する額
（売買損益相当額）	売買損益に相当する額
分配準備積立金	分配金を支払うための準備積立金
繰越損益金	繰越損益の合計金額

短期豪ドル債マザーファンド

運用報告書

決算日：2020年10月7日

(第35期：2020年4月8日～2020年10月7日)

当ファンドは、上記の通り決算を行いました。ここに、期中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	主に豪ドル建ての高格付けの公社債および短期金融商品に投資を行うことにより、安定した利息収益の確保を目指して運用を行います。
主要運用対象	豪ドル建ての高格付けの公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。
投資制限	<ul style="list-style-type: none">・ 株式（転換社債からの転換等に限る）への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

<https://www.smd-am.co.jp>

短期豪ドル債マザーファンド

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		BBSW AUD 1Month (参考指数)	公社債 組入比率	債券先物 組入比率	純資産額
	円	騰落率				
第31期 (2018年10月9日)	21,991	△ 1.4	1.8641	97.0	—	209,580
第32期 (2019年4月8日)	22,145	0.7	1.7400	97.6	—	184,447
第33期 (2019年10月7日)	20,563	△ 7.1	0.8997	95.6	—	154,571
第34期 (2020年4月7日)	19,022	△ 7.5	0.2400	96.5	—	127,354
第35期 (2020年10月7日)	21,791	14.6	0.0900	99.0	—	133,333

BBSW AUD 1Monthは、オーストラリア金融市場協会 (AFMA) が算出している銀行間取引金利です。

*先物組入比率は、買建比率-売建比率

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		BBSW AUD 1Month (参考指数)	公社債 組入比率	債券先物 組入比率
	円	騰落率			
(期首) 2020年4月7日	19,022	—	0.2400	96.5	—
4月末	20,015	5.2	0.1050	94.4	—
5月末	20,512	7.8	0.0900	97.7	—
6月末	21,300	12.0	0.0900	97.5	—
7月末	21,811	14.7	0.0900	98.0	—
8月末	22,469	18.1	0.0950	97.0	—
9月末	21,907	15.2	0.0900	98.8	—
(期末) 2020年10月7日	21,791	14.6	0.0900	99.0	—

*騰落率は期首比です。

*先物組入比率は、買建比率-売建比率

短期豪ドル債マザーファンド

運用経過

【基準価額等の推移】

期首：19,022円

期末：21,791円

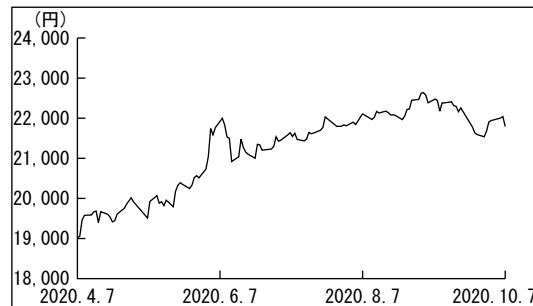
騰落率：+14.6%

【基準価額の主な変動要因】

(上昇要因)

豪ドル円の上昇が、主な基準価額の上昇要因となりました。当期、各国政府の積極的な財政政策や各国中央銀行の金融緩和策を背景にリスクセンチメント（リスクに対する市場心理）が急回復し、豪ドル円は上昇基調をたどりました。また、期末にかけてはRBA（オーストラリア準備銀行）の追加金融緩和期待が高まり、債券利回りの低下（価格は上昇）も上昇要因となりました。

基準価額の推移



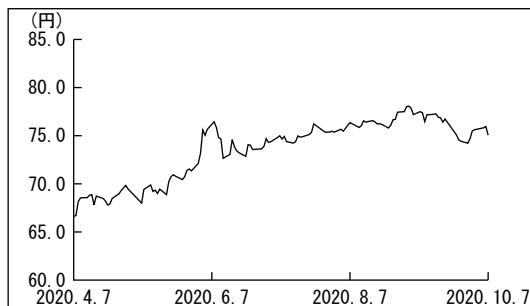
短期豪ドル債マザーファンド

【投資環境】

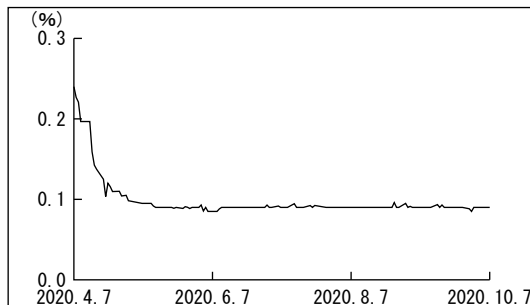
当期のオーストラリア債券市場は、RBAが3年国債の利回り目標を導入する中で、短中期債は横ばいで推移した後、期末にかけては追加金融緩和への期待が高まったことから、利回りが低下（価格は上昇）しました。長期債の利回りは、株式市場の上昇やオーストラリアでの感染第二波および一部地域での再ロックダウン（都市封鎖）への懸念などを材料に上下しましたが、期首対比では小幅に低下して終わりました。

豪ドル円は4月以降、上昇基調をたどりました。各国の積極的な財政政策や新型コロナの感染拡大が減速したことなどから、グローバルに株式市場は上昇基調となり、円安が続きました。オーストラリアの経済指標が他国対比堅調だったことや、特にリスクセンチメントに敏感なことから、豪ドルは他通貨対比でとりわけアウトパフォームし、期中の豪ドル円は大幅に上昇しました。

為替レート（豪ドル／円）の推移



BBSW AUD 1Monthの推移



短期豪ドル債マザーファンド

【ポートフォリオ】

当期の騰落率は、+14.6%となりました。

当期は、新型コロナウイルスの景気への影響が不透明な中、RBAの強力な金融緩和およびハト派的な姿勢が継続し、特に当ファンドで主に組み入れている短中期債の利回り上昇余地は大きくないとの見通しの下、デュレーション*を長めに維持しました。社債の組入比率は高めに維持しつつ、機動的に入れ替えを行いました。

期首時点のデュレーションは0.9年近辺と、すでにデュレーション制約の上限付近としており、期中もデュレーションを0.9年台と上限付近で維持しました。社債については、4月以降に市場が落ち着きを取り戻す中で買い戻しが進みました。割安に発行された新発債を組み入れ、買い戻しが進んだ銘柄を売却することで、社債の組入比率を高めに維持しました。

*デュレーションとは、「投資元本の平均的な回収期間」を表す指標で、単位は「年」で表示されます。また、「金利の変動に対する債券価格の変動性」の指標としても利用され、一般的にこの値が長い（大きい）ほど、金利の変動に対する債券価格の変動が大きくなります。

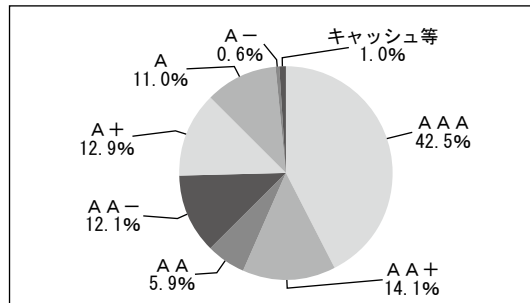
今後の運用方針

新型コロナウイルスの感染拡大には一服感が出ており、これまでに発表された経済指標は想定ほど悪化しなかったものの、欧米では新規感染者数が増加しつつあることや、オーストラリアでは失業保険の期限切れによる今後の経済への影響が懸念され、不透明な要因がくすぶっています。こうした状況下でRBAに対しては早期の追加緩和期待が高まっており、当面は債券利回りの上昇リスクは限定的と予想しています。また、社債市場の買い戻しの動きは一巡感が見られるものの、RBAの追加緩和や、国債利回りの低下が進むことによる投資家の利回り需要から、社債市場も堅調に推移すると見えています。

今後の運用方針については、デュレーションは長めに維持しつつ、市場環境および経済指標を見極め、調整を行う方針です。社債については、組入比率を高めに維持することを基本とし、新発債などの割安な銘柄への入れ替えを適宜検討します。

格付別資産構成

(2020年10月7日現在)



*純資産総額に対する評価額の割合

*グラフの格付表記はS&Pの格付記号で表示しています。

短期豪ドル債マザーファンド

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2020年4月8日～2020年10月7日		
	金額	比率	
その他費用 (保管費用)	3円 (3)	0.014% (0.014)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	3	0.014	
期中の平均基準価額は21,336円です。			

*「比率」欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

*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。

*円未満は四捨五入しています。

売買及び取引の状況

(2020年4月8日から2020年10月7日まで)

■公社債

外 国	オーストラリア	買付額		売付額	
		金額	比率	金額	比率
		千オーストラリア・ドル		千オーストラリア・ドル	
	国債証券	44,786		39,925	
	地方債証券	25,000		45,147 (30,000)	
	特殊債証券	59,881		76,873	
	社債証券	187,992		176,016 (50,000)	

*金額は受渡し代金（経過利子分は含まれていません。）

*（ ）内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

*社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれていません。

主要な売買銘柄

(2020年4月8日から2020年10月7日まで)

■公社債

買付		当期		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円		千円
DBS GROUP HOLDINGS LTD FL 04/08/31	1,951,560	KFW 6 08/20/20			3,746,684
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH FL 06/16/23	1,847,000	UBS AG AUSTRALIA FL 08/10/20			1,884,551
DBS GROUP HOLDINGS LTD FL 07/17/23	1,733,510	AUSTRALIAN GOVERNMENT 1.75 11/21/20			1,504,559
AUSTRALIAN GOVERNMENT 0.25 11/21/24	1,728,609	AUSTRALIAN GOVERNMENT 0.25 11/21/24			1,498,415
KFW 2.9 06/06/22	1,546,914	INT BK RECON & DEVELOP 2.8 01/13/21			1,174,577
AUSTRALIAN GOVERNMENT 0.5 09/21/26	1,512,472	NEW S WALES TREASURY CRP FL 10/09/23			1,170,486
UBS AG AUSTRALIA FL 07/30/25	1,507,400	SOUTH AUST GOVT FIN AUTH FL 06/16/23			1,133,851
EXPORT FIN & INS CORP 0.515 01/29/24	1,432,030	QUEENSLAND TREASURY CORP FL 02/06/23			1,130,572
BNG BANK NV 0.75 11/13/23	1,422,947	CTBC AUSTRALIA FL 01/25/21			1,126,890
BANK OF MONTREAL FL 04/17/23	1,396,800	AUST & NZ BANKING GROUP FL 01/16/25			1,113,942

*金額は受渡し代金（経過利子分は含まれていません。）

短期豪ドル債マザーファンド

利害関係人との取引状況等

(2020年4月8日から2020年10月7日まで)

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
為 替	百万円 278,359	百万円 4,498	% 1.6	百万円 290,216	百万円 4,498	% 1.6

■利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
債 券	百万円 —	百万円 —	百万円 1,743

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あり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、株式会社三井住友銀行、株式会社三井住友フィナンシャルグループです。

組入資産の明細

2020年10月7日現在

■公社債

A 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	額 面 金 額	当 期			組入比率	う ち BB格以下 組入比率	末		
		評 価 額		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 1,723,370	千オーストラリア・ドル 1,758,692	千円 132,007,465	% 99.0	% —	% 4.6	% 54.8	% 39.5	
合 計	—	—	132,007,465	99.0	—	4.6	54.8	39.5	

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合

*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。

短期豪ドル債マザーファンド

B 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債

銘柄	種類	当 期 利 率	当 期 額 面 金 額	末 期 評 価 額		償還年月日
				額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア・ドル…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	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.0000	10,000	10,227	767,638	2021/12/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	2.2500	20,000	20,877	1,567,072	2022/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	5,000	5,001	375,435	2024/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	20,000	20,046	1,504,667	2026/09/21
WESTERN AUST TREAS CORP	地方債証券	0.3200	30,000	30,042	2,254,952	2022/03/03
WESTERN AUST TREAS CORP	地方債証券	0.3205	30,000	30,079	2,257,744	2023/03/08
WESTERN AUST TREAS CORP	地方債証券	0.3385	17,000	17,057	1,280,307	2024/02/21
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH	地方債証券	0.5300	25,000	25,015	1,877,663	2020/12/16
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH	地方債証券	0.4700	10,000	10,031	752,986	2023/06/16
NEW S WALES TREASURY CRP	地方債証券	1.0000	5,000	5,116	384,044	2024/02/08
NEW S WALES TREASURY CRP	地方債証券	1.2500	1,000	1,037	77,898	2025/03/20
NEW S WALES TREASURY CRP	地方債証券	0.4912	15,000	15,116	1,134,648	2023/10/09
TREASURY CORP VICTORIA	地方債証券	2.2500	25,000	25,559	1,918,496	2021/10/29
TREASURY CORP VICTORIA	地方債証券	0.4700	30,000	30,200	2,266,819	2025/04/02
QUEENSLAND TREASURY CORP	地方債証券	0.2450	25,000	25,025	1,878,376	2022/02/07
QUEENSLAND TREASURY CORP	地方債証券	0.3100	25,000	25,058	1,880,853	2023/02/06
QUEENSLAND TREASURY CORP	地方債証券	0.3318	21,000	21,056	1,580,468	2024/11/25
CORP ANDINA DE FOMENTO	特殊債券	4.0000	25,000	25,304	1,899,374	2021/03/31
CORP ANDINA DE FOMENTO	特殊債券	3.4000	10,000	10,446	784,091	2023/10/26
EXPORT DEVELOPMNT CANADA	特殊債券	2.4000	15,000	15,221	1,142,518	2021/06/07
EXPORT DEVELOPMNT CANADA	特殊債券	2.8000	15,000	15,970	1,198,723	2023/05/31
KFW	特殊債券	2.8000	10,000	10,596	795,350	2023/03/07
KFW	特殊債券	2.9000	20,000	20,887	1,567,793	2022/06/06
L-BANK BW FOERDERBANK	特殊債券	2.2500	25,000	25,173	1,889,504	2021/02/17
L-BANK BW FOERDERBANK	特殊債券	2.7000	22,000	23,290	1,748,153	2023/06/19
BNG BANK NV	特殊債券	0.7500	20,000	20,152	1,512,609	2023/11/13
EXPORT FIN & INS CORP	特殊債券	0.5150	19,000	19,113	1,434,625	2024/01/29
INT BK RECON & DEVELOP	特殊債券	2.8000	15,000	15,103	1,133,702	2021/01/13
INT BK RECON & DEVELOP	特殊債券	2.8000	25,000	25,811	1,937,373	2022/01/12
INT BK RECON & DEVELOP	特殊債券	2.6000	10,000	10,459	785,052	2022/09/20
INT BK RECON & DEVELOP	特殊債券	2.2000	20,000	21,211	1,592,097	2024/02/27
EUROPEAN INVESTMENT BANK	特殊債券	5.0000	5,000	5,445	408,773	2022/08/22
EUROPEAN INVESTMENT BANK	特殊債券	1.7000	20,000	21,005	1,576,650	2024/11/15
EUROPEAN INVESTMENT BANK	特殊債券	2.9000	10,000	11,163	837,909	2025/10/17
COUNCIL OF EUROPE	特殊債券	6.0000	20,000	20,000	1,501,200	2020/10/08
ASIAN DEVELOPMENT BANK	特殊債券	2.7500	10,000	10,321	774,731	2022/01/19
ASIAN DEVELOPMENT BANK	特殊債券	2.6500	10,000	10,523	789,886	2023/01/11
ASIAN DEVELOPMENT BANK	特殊債券	2.4500	10,000	10,663	800,409	2024/01/17
ASIAN DEVELOPMENT BANK	特殊債券	3.7500	10,000	11,425	857,598	2025/03/12

短期豪ドル債マザーファンド

銘柄	種類	当		期			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・ドル…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		
INTER-AMERICAN DEVEL BK	特殊債券	4.0000	10,000	10,956	822,424	2023/05/22	
INTER-AMERICAN DEVEL BK	特殊債券	1.9500	10,000	10,538	791,049	2024/04/23	
KOMMUNALBANKEN AS	特殊債券	6.5000	25,000	25,799	1,936,510	2021/04/12	
KOMMUNALBANKEN AS	特殊債券	4.5000	20,000	22,054	1,655,373	2023/04/17	
KIWIBANK LTD (※)	特殊債券	0.7900	13,000	13,037	978,619	2025/09/23	
JOHN DEERE FINANCIAL LTD	社債券	3.2500	14,500	15,151	1,137,237	2022/07/15	
JPMORGAN CHASE & CO	社債券	1.2396	20,000	20,104	1,509,066	2024/11/22	
ING BANK (AUSTRALIA) LTD (※)	社債券	0.6700	20,000	20,056	1,505,433	2021/09/07	
ING BANK (AUSTRALIA) LTD	社債券	3.0000	10,000	10,673	801,152	2023/09/07	
BANK OF MONTREAL	社債券	1.0104	10,000	10,105	758,496	2022/10/06	
BANK OF MONTREAL	社債券	1.1000	20,000	20,059	1,505,643	2024/07/17	
BANK OF MONTREAL (※)	社債券	1.3000	20,000	20,371	1,529,077	2023/04/17	
BANK OF NOVA S/AUSTRALIA	社債券	1.0105	15,000	15,151	1,137,282	2022/09/08	
ROYAL BANK OF CANADA/SYD	社債券	1.3800	20,000	20,070	1,506,454	2021/02/03	
TORONTO-DOMINION BANK	社債券	1.1000	30,000	30,121	2,260,919	2024/07/10	
TORONTO-DOMINION BANK (※)	社債券	1.3541	16,000	16,307	1,224,042	2023/04/14	
BPCE SA	社債券	1.2021	20,000	20,206	1,516,707	2023/04/26	
BPCE SA	社債券	1.6900	18,000	18,548	1,392,220	2025/06/05	
SOCIETE GENERALE SYDNEY	社債券	1.0325	14,000	14,118	1,059,761	2023/07/15	
RABOBANK NEDERLAND AU	社債券	1.5900	20,000	20,104	1,509,051	2021/03/04	
RABOBANK NEDERLAND/AU	社債券	0.8800	10,000	10,081	756,732	2022/09/22	
ZURICH FIN AUSTRALIA LTD	社債券	3.4770	18,000	19,164	1,438,454	2023/05/31	
CREDIT SUISSE/SYDNEY	社債券	1.2450	13,000	13,179	989,265	2023/05/26	
UBS AG AUSTRALIA	社債券	0.9905	10,000	10,081	756,702	2023/03/08	
UBS AG AUSTRALIA	社債券	1.1485	12,000	12,139	911,168	2022/11/21	
UBS AG AUSTRALIA	社債券	0.9700	20,000	20,084	1,507,565	2025/07/30	
SVENSKA HANDELSBANKEN AB	社債券	1.0600	9,000	9,105	683,464	2023/09/27	
SVENSKA HANDELSBANKEN AB	社債券	0.7900	18,000	18,073	1,356,605	2022/05/31	
BANCO SANTANDER SA	社債券	1.3300	10,000	9,911	743,949	2024/09/26	
TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	社債券	0.8896	6,000	6,014	451,427	2021/11/22	
BK TOKYO-MIT UFJ SYDNEY	社債券	1.0700	10,000	10,104	758,421	2023/03/20	
MUFG BANK LTD SYDNEY	社債券	0.7700	25,000	25,084	1,882,842	2022/08/29	
DBS BANK LTD (※)	社債券	0.6221	36,500	36,618	2,748,621	2022/10/25	
UNITED OVERSEAS BANK/SYD	社債券	0.9108	18,000	18,116	1,359,807	2022/01/24	
OCBC/SYDNEY	社債券	0.7200	12,000	12,064	905,547	2022/12/05	
NATIONAL AUSTRALIA BANK (※)	社債券	0.7400	25,000	25,230	1,893,801	2023/03/16	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	社債券	1.0100	10,000	10,183	764,343	2024/06/19	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	社債券	2.1500	4,700	4,971	373,165	2024/06/19	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	社債券	0.9021	10,000	10,116	759,351	2023/02/10	
AUST & NZ BANKING GROUP	社債券	0.8600	20,000	20,269	1,521,421	2024/08/29	
COMMONWEALTH BANK AUST (※)	社債券	0.9500	25,000	25,194	1,891,080	2021/11/17	
COMMONWEALTH BANK AUST	社債券	1.2356	10,000	10,245	769,057	2024/01/11	

短期豪ドル債マザーファンド

銘柄	当			期		末	償還年月日
	種類	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・ドル…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		
WESTPAC BANKING CORP (※)	社債券	0.8500	30,000	30,305	2,274,745	2022/08/31	
WESTPAC BANKING CORP	社債券	1.2408	10,000	10,252	769,567	2024/04/24	
SUNCORP-METWAY LTD (※)	社債券	1.2208	5,000	5,122	384,509	2025/04/24	
CIBC AUSTRALIA (※)	社債券	0.6000	19,000	19,048	1,429,748	2022/08/01	
CIBC AUSTRALIA	社債券	0.5021	10,000	10,007	751,185	2021/01/25	
MACQUARIE BANK LTD	社債券	0.8400	10,000	10,069	755,816	2022/06/21	
MACQUARIE BANK LTD	社債券	0.9400	10,000	10,098	757,985	2025/02/12	
TELSTRA CORP LTD	社債券	4.0000	10,000	10,618	797,017	2022/09/16	
TELSTRA CORP LTD	社債券	2.9000	8,000	8,100	608,028	2021/04/19	
CENTRAL NIPPON EXPRESSWY	社債券	1.0600	15,000	15,036	1,128,602	2025/08/01	
COCA-COLA CO/THE	社債券	3.2500	20,000	21,628	1,623,442	2024/06/11	
MC FINANCE AUSTRALIA P/L	社債券	4.2500	7,170	7,450	559,212	2021/12/01	
APPLE INC	社債券	3.7000	25,000	26,554	1,993,199	2022/08/28	
APPLE INC	社債券	3.3500	10,000	10,870	815,969	2024/01/10	
LLOYDS BANK PLC	社債券	1.0000	15,000	15,063	1,130,651	2022/08/12	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	社債券	1.3600	23,100	23,221	1,743,006	2022/03/29	
mitsubishi UFJ FIN GRP	社債券	1.3429	14,800	14,737	1,106,166	2024/10/01	
MITSUBISHI UFJ FIN GRP	社債券	2.0777	7,600	7,749	581,642	2024/10/01	
OPTUS FINANCE PTY LTD	社債券	3.2500	8,000	8,366	627,987	2022/08/23	
OPTUS FINANCE PTY LTD	社債券	3.2500	10,000	10,679	801,565	2023/09/06	
OPTUS FINANCE PTY LTD	社債券	1.6000	3,000	3,077	230,987	2025/07/01	
UNITED ENERGY DISTRIBUTI	社債券	1.0700	10,000	9,979	749,046	2023/02/07	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	社債券	1.6700	25,000	24,946	1,872,465	2028/03/16	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	社債券	0.7700	23,000	23,031	1,728,745	2023/07/17	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	社債券	5.0000	26,000	26,047	1,955,131	2031/04/08	
BANK OF QUEENSLAND LTD (※)	社債券	1.1700	6,000	6,116	459,092	2025/05/14	
CITIBANK NA	社債券	0.8500	15,000	15,053	1,129,885	2022/05/20	
CITIBANK NA SYDNEY	社債券	0.9800	10,000	10,052	754,533	2024/11/14	
合計	—	—	1,723,370	1,758,692	132,007,465	—	

* 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。

(※) カバードボンド（住宅ローン債権担保付社債）

短期豪ドル債マザーファンド

投資信託財産の構成

2020年10月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	132,007,465	97.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,937,028	2.9
投 資 信 託 財 産 総 額	135,944,493	100.0

*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。

1 オーストラリア・ドル=75.06円

*当期末における外貨建資産(131,687,802千円)の投資信託財産総額(135,944,493千円)に対する比率 96.9%

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2020年10月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	145,149,865,512円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,300,877,291
公 社 債(評価額)	132,007,465,175
未 収 入 金	10,339,034,397
未 収 利 息	500,023,553
前 払 費 用	2,465,096
(B) 負 債	11,816,357,277
未 払 金	11,185,335,450
未 払 解 約 金	631,018,968
そ の 他 未 払 費 用	2,859
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	133,333,508,235
元 本	61,187,896,726
次 期 繰 越 損 益 金	72,145,611,509
(D) 受 益 権 総 口 数	61,187,896,726口
1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D)	21,791円

*元本状況

期首元本額 66,950,309,282円

期中追加設定元本額 352,638,390円

期中一部解約元本額 6,115,050,946円

*元本の内訳

短期豪ドル債オープン(毎月分配型) 59,799,368,463円

短期豪ドル債オープン(年2回決算型) 1,388,528,263円

損益の状況

自2020年4月8日
至2020年10月7日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,204,579,276円
受 取 利 息	1,205,649,829
支 払 利 息	△ 1,070,553
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	17,126,960,004
売 買 益	17,590,323,299
売 買 損	△ 463,363,295
(C) そ の 他 費 用	△ 19,720,420
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	18,311,818,860
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	60,403,725,845
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 6,958,320,957
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	388,387,761
(H) 計 (D+E+F+G)	72,145,611,509
次 期 繰 越 損 益 金(H)	72,145,611,509

*有価証券売買損益には、期末の評価換えによるものを含みます。

*解約差損益金とは、一部解約時の解約金額と元本の差額をいい、元本を下回る額は利益として、上回る額は損失として処理されます。

*追加信託差損益金とは、追加信託金と元本の差額をいい、元本を下回る額は損失として、上回る額は利益として処理されます。

お知らせ

該当事項はございません。

※各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しております。