

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） ・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 ・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） ・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 ・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36作成期

決算日

第210期 2020年11月9日

第211期 2020年12月7日

第212期 2021年1月7日

第213期 2021年2月8日

第214期 2021年3月8日

第215期 2021年4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36作成期（第210期～第215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
第210期(2020年11月9日)	3,282	10	0.4	0.0200	99.4	—	128,748
第211期(2020年12月7日)	3,374	5	3.0	0.0200	99.0	—	130,600
第212期(2021年1月7日)	3,496	5	3.8	0.0100	98.2	—	131,760
第213期(2021年2月8日)	3,521	5	0.9	0.0100	98.2	—	130,191
第214期(2021年3月8日)	3,619	5	2.9	0.0124	98.0	—	130,777
第215期(2021年4月7日)	3,642	5	0.8	0.0100	97.3	—	129,548

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
		騰 落 率	騰 落 率			
第210期	(期 首) 2020年10月 7 日	円 3,279	% —	% 0.0900	% 99.1	% —
	10月末	3,220	△1.8	0.0550	98.8	—
	(期 末) 2020年11月 9 日	3,292	0.4	0.0200	99.4	—
第211期	(期 首) 2020年11月 9 日	3,282	—	0.0200	99.4	—
	11月末	3,361	2.4	0.0200	98.5	—
	(期 末) 2020年12月 7 日	3,379	3.0	0.0200	99.0	—
第212期	(期 首) 2020年12月 7 日	3,374	—	0.0200	99.0	—
	12月末	3,438	1.9	0.0150	97.6	—
	(期 末) 2021年 1 月 7 日	3,501	3.8	0.0100	98.2	—
第213期	(期 首) 2021年 1 月 7 日	3,496	—	0.0100	98.2	—
	1 月末	3,488	△0.2	0.0100	97.8	—
	(期 末) 2021年 2 月 8 日	3,526	0.9	0.0100	98.2	—
第214期	(期 首) 2021年 2 月 8 日	3,521	—	0.0100	98.2	—
	2 月末	3,618	2.8	0.0097	98.8	—
	(期 末) 2021年 3 月 8 日	3,624	2.9	0.0124	98.0	—
第215期	(期 首) 2021年 3 月 8 日	3,619	—	0.0124	98.0	—
	3 月末	3,654	1.0	0.0158	98.5	—
	(期 末) 2021年 4 月 7 日	3,647	0.8	0.0100	97.3	—

* 騰落率は期首比です。

* 期末基準価額は分配金込み

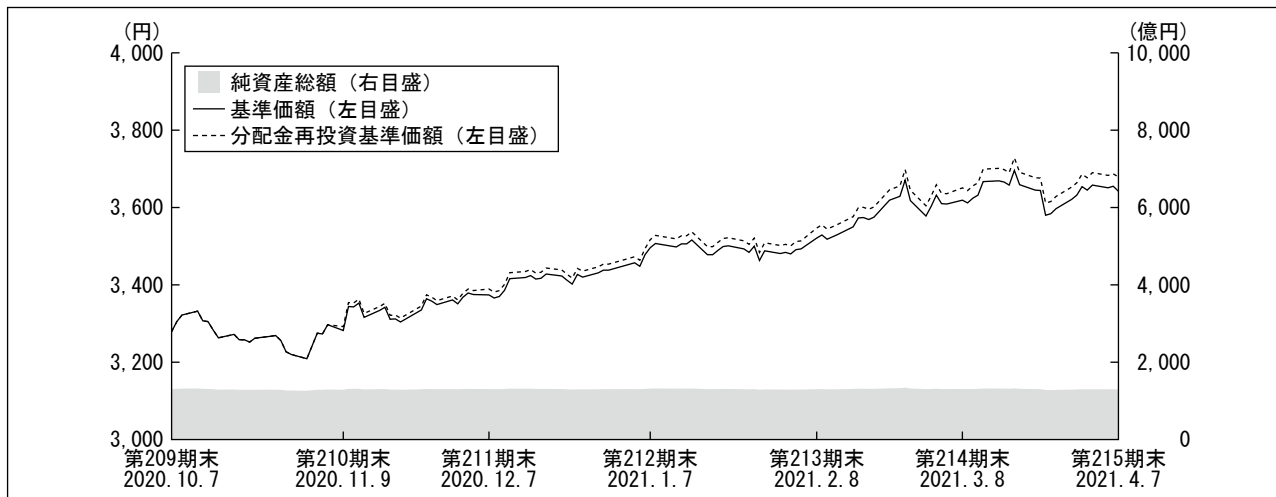
* 先物組入比率は、買建比率－売建比率

* 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210期首： 3,279円

第215期末： 3,642円（作成対象期間における期中分配金合計額 35円）

騰落率： +12.2%（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。グローバルに株式市場が上昇するリスクオン（リスク選好）相場となったことで、リスクセンチメント（投資家心理）に敏感な豪ドルは上昇しました。オーストラリアは新型コロナウイルスの感染者数の抑制に成功し、経済指標も一時の落ち込みから改善傾向となったこと、オーストラリア国債利回りの上昇も豪ドルの上昇に寄与しました。

（下落要因）

債券の利回りが上昇したことがマイナス要因となりました。オーストラリアの経済指標が堅調に推移したことや、欧米で新型コロナウイルスのワクチン接種が始まり、景気回復ペースの加速が意識され、米国を中心にグローバルに国債利回りが上昇したことでオーストラリア市場にも利回り上昇圧力となりました。

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、利回りが上昇（価格は下落）しました。新型コロナウイルスのワクチン接種に伴う世界的な景気回復への期待を背景に、特に2021年1月以降に利回りが大きく上昇しました。

オーストラリアでは、新型コロナウイルスの感染者数が抑制され、他国対比で経済指標が堅調に推移し、作成期初から利回りは上昇基調となりました。RBA（オーストラリア準備銀行）は11月に政策金利および3年国債利回り誘導目標を0.25%から0.10%に引き下げ、短中期債は堅調に推移したものの長期債利回りは上昇しました。2021年年初以降は、新型コロナウイルスのワクチンへの期待感に加え、中央銀行による将来の緩和策の縮小が意識され始めたこと、11月の米大統領選挙でバイデン候補が勝利し米国議会も民主党が上下両院ともに過半数を得たことで、同党の掲げる大規模な財政政策の実現可能性が高まったことなどから利回りの上昇が加速しました。

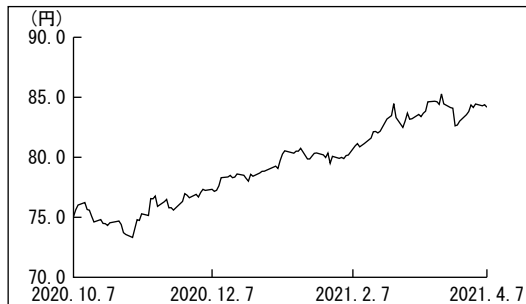
豪ドル円は、新型コロナウイルスのワクチンへの期待や想定よりも堅調な経済指標が続いたことで株式市場は上昇し円安圧力となったほか、オーストラリア市場の利回り上昇が豪ドル高圧力となり、豪ドル円は上昇しました。

【ポートフォリオ】

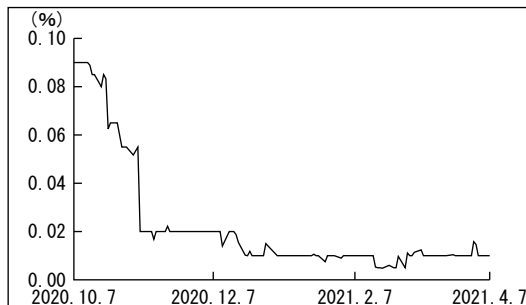
■短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

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97.3%としました。

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）

■短期豪ドル債マザーファンド

当作成期の騰落率は、+12.7%となりました。

当作成期は、デュレーション*を長めに維持しました。新型コロナウイルスのワクチンへの期待から株式市場が堅調に推移するなかで社債市場も堅調となり、ポートフォリオの社債比率を高めとするなかで、クレジットリスクとのバランスを考慮しデュレーションは長めに維持しました。また当ファンドの主力である短中期債の利回りは、RBAの3年国債誘導利回り为目标とするイールドカーブ（利回り曲線）コントロール政策を背景に底堅く推移したことも、デュレーションを維持した要因となりました。その結果、デュレーションは作成期初から0.9年台を維持し、社債比率も60%前後を維持しました。

*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。

【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210期10円、第211期～第215期の各期において5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）

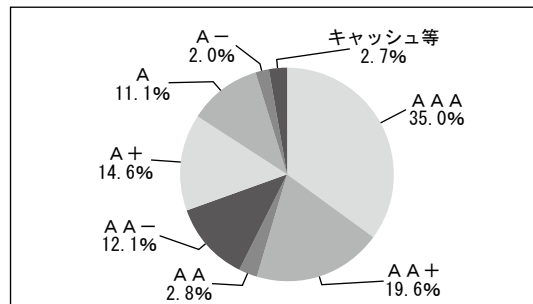
項目	第210期	第211期	第212期	第213期	第214期	第215期
	2020年10月8日 ～2020年11月9日	2020年11月10日 ～2020年12月7日	2020年12月8日 ～2021年1月7日	2021年1月8日 ～2021年2月8日	2021年2月9日 ～2021年3月8日	2021年3月9日 ～2021年4月7日
当期分配金 (円)	10	5	5	5	5	5
(対基準価額比率) (%)	0.30	0.15	0.14	0.14	0.14	0.14
当期の収益 (円)	3	3	4	1	3	3
当期の収益以外 (円)	6	1	1	4	1	1
翌期繰越分配対象額 (円)	127	126	125	124	123	121

※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。

格付別資産構成

（2021年4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

今後もワクチン接種が進むことで経済指標にはさらに改善が見られ、中央銀行による強力な金融緩和策の縮小観測が強まると考えられることから、中期的な利回り上昇圧力は続くと考えられます。オーストラリア市場においても、堅調な経済指標とRBAの姿勢が注目されます。一方、金融市場は景気回復の加速につながる材料をいったん織り込んだと見られ、債券市場では足元で急激な利回り上昇に一巡感が出ていることから、デュレーションは長めを基本としつつ機動的なオペレーションを検討します。また、景気回復に対する期待を背景に当面の社債市場は底堅く推移すると見られ、社債比率は高めを維持する見込みです。

1万口当りの費用明細

項目	第210期～第215期		項目の概要
	2020年10月8日～2021年4月7日		
	金額	比率	
信託報酬	17円	0.494%	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3,463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	0.016	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）	（1）	（0.015）	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	18	0.510	

* 「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。

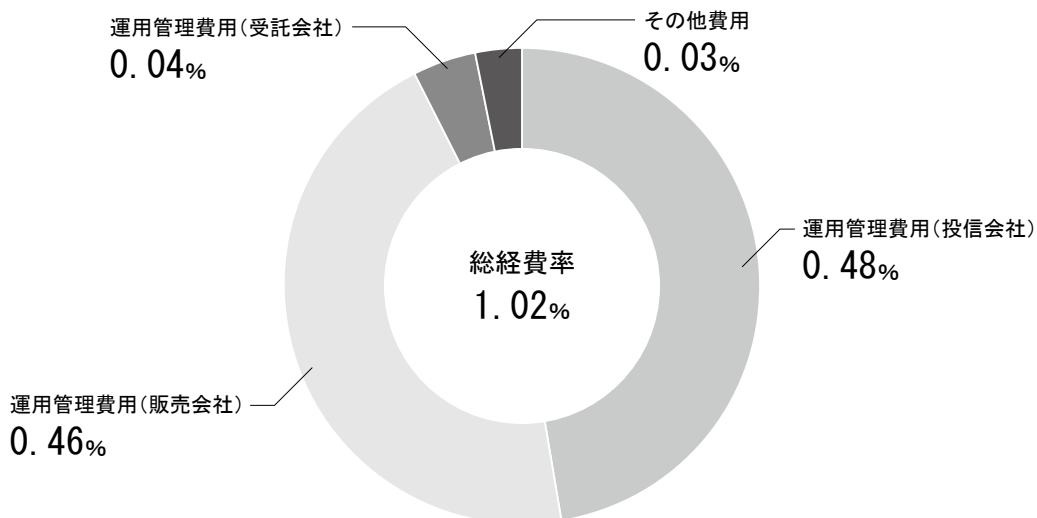
* 作成期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む。）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

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10月8日から2021年4月7日まで）

決 算 期	第 210 期 ～ 第 215 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	—	—	7,063,428	16,408,510

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10月8日から2021年4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 210 期 ~			第 215 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 116,007	百万円 3,113	% 2.7	百万円 132,998	百万円 3,113	% 2.3

*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 210 期 ~ 第 215 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 1,959

■利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<短期豪ドル債マザーファンド>

種類	第 210 期 ~ 第 215 期	
	買付額	売付額
公社債		百万円 1,971

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、SMB C日興証券株式会社です。

組入資産の明細

2021年4月7日現在

■親投資信託残高

	第 209 期 末	第 215 期 末
	口数	口数 評価額
短期豪ドル債マザーファンド	千口 59,799,368	千口 52,735,940 千円 129,535,290

*短期豪ドル債マザーファンド全体の受益権口数は、53,844,424千口です。

短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

投資信託財産の構成

2021年4月7日現在

項 目	第 215 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
短期豪ドル債マザーファンド	129,535,290	99.8
コール・ローン等、その他	298,475	0.2
投資信託財産総額	129,833,765	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=84.17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（129,016,049千円）の投資信託財産総額（132,565,470千円）に対する比率 97.3%

資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	(2020年11月9日)	(2020年12月7日)	(2021年1月7日)	(2021年2月8日)	(2021年3月8日)	(2021年4月7日) 現在
	第 210 期末	第 211 期末	第 212 期末	第 213 期末	第 214 期末	第 215 期末
(A) 資 産	129,458,371,168円	131,101,816,924円	132,250,476,091円	130,702,010,736円	131,310,633,432円	129,833,765,641円
コール・ローン等	8,992,374	8,871,654	13,426,698	10,082,039	13,140,345	12,757,859
短期豪ドル債マザーファンド(評価額)	128,807,476,426	130,682,974,115	131,847,498,973	130,285,302,812	130,910,439,150	129,535,290,298
未 収 入 金	641,902,368	409,971,155	389,550,420	406,625,885	387,053,937	285,717,484
(B) 負 債	709,743,393	501,287,632	490,474,705	510,323,324	533,117,783	285,349,432
未 払 収 益 分 配 金	392,330,211	193,551,612	188,459,953	184,868,138	180,669,875	177,869,583
未 払 解 約 金	201,578,885	208,478,612	191,564,354	211,171,580	251,695,240	-
未 払 信 託 報 酬	115,583,695	98,794,174	109,751,750	113,341,950	99,598,380	106,097,741
そ の 他 未 払 費 用	250,602	463,234	698,648	941,656	1,154,288	1,382,108
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	128,748,627,775	130,600,529,292	131,760,001,386	130,191,687,412	130,777,515,649	129,548,416,209
元 本	392,330,211,832	387,103,224,037	376,919,907,100	369,736,276,589	361,339,750,311	355,739,167,574
次 期 繰 越 損 益 金	△263,581,584,057	△256,502,694,745	△245,159,905,714	△239,544,589,177	△230,562,234,662	△226,190,751,365
(D) 受 益 権 総 口 数	392,330,211,832口	387,103,224,037口	376,919,907,100口	369,736,276,589口	361,339,750,311口	355,739,167,574口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D)	3,282円	3,374円	3,496円	3,521円	3,619円	3,642円

*元本状況

期首元本額 397,123,727,988円 392,330,211,832円 387,103,224,037円 376,919,907,100円 369,736,276,589円 361,339,750,311円

期中追加設定元本額 293,913,030円 265,774,738円 231,210,829円 251,351,459円 194,056,840円 322,541,341円

期中一部解約元本額 5,087,429,186円 5,492,762,533円 10,414,527,766円 7,434,981,970円 8,590,583,118円 5,923,124,078円

*元本の欠損 263,581,584,057円 256,502,694,745円 245,159,905,714円 239,544,589,177円 230,562,234,662円 226,190,751,365円

短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

損益の状況

項 目	自2020年10月8日 至2020年11月9日	自2020年11月10日 至2020年12月7日	自2020年12月8日 至2021年1月7日	自2021年1月8日 至2021年2月8日	自2021年2月9日 至2021年3月8日	自2021年3月9日 至2021年4月7日
	第 210 期	第 211 期	第 212 期	第 213 期	第 214 期	第 215 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 393円	△ 456円	△ 367円	△ 370円	△ 369円	△ 440円
受 取 利 息	3	26	34	10	1	15
支 払 利 息	△ 396	△ 482	△ 401	△ 380	△ 370	△ 455
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	602,541,205	3,859,115,003	4,892,914,275	1,241,350,033	3,822,166,881	1,081,852,685
売 買 益	614,493,062	3,891,931,412	4,937,947,572	1,247,125,637	3,874,162,512	1,099,059,667
売 買 損	△ 11,951,857	△ 32,816,409	△ 45,033,297	△ 5,775,604	△ 51,995,631	△ 17,206,982
(C) 信 託 報 酬 等	△ 115,834,297	△ 99,006,806	△ 109,987,164	△ 113,584,958	△ 99,811,012	△ 106,325,561
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	486,706,515	3,760,107,741	4,782,926,744	1,127,764,705	3,722,355,500	975,526,684
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 57,868,935,303	△ 56,733,994,742	△ 51,699,907,546	△ 46,139,686,707	△ 44,002,580,256	△ 39,797,964,562
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△205,807,025,058	△203,335,256,132	△198,054,464,959	△194,347,799,037	△190,101,340,031	△187,190,443,904
(配 当 等 相 当 額)	(5,226,759,104)	(4,924,955,722)	(4,757,779,646)	(4,630,194,798)	(4,380,632,984)	(4,312,833,810)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△211,033,784,162)	(△208,260,211,854)	(△202,812,244,605)	(△198,977,993,835)	(△194,481,973,015)	(△191,503,277,714)
(G) 計 (D+E+F)	△263,189,253,846	△256,309,143,133	△244,971,445,761	△239,359,721,039	△230,381,564,787	△226,012,881,782
(H) 収 益 分 配 金	△ 392,330,211	△ 193,551,612	△ 188,459,953	△ 184,868,138	△ 180,669,875	△ 177,869,583
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△263,581,584,057	△256,502,694,745	△245,159,905,714	△239,544,589,177	△230,562,234,662	△226,190,751,365
追 加 信 託 差 損 益 金	△206,042,423,185	△203,373,966,454	△198,092,156,949	△194,495,693,547	△190,101,340,031	△187,190,443,904
(配 当 等 相 当 額)	(4,991,449,115)	(4,886,317,689)	(4,720,151,365)	(4,482,364,664)	(4,380,674,051)	(4,312,933,815)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△211,033,872,300)	(△208,260,284,143)	(△202,812,308,314)	(△198,978,058,211)	(△194,482,014,082)	(△191,503,377,719)
分 配 準 備 積 立 金	11,314,271	3,488,539	6,638,961	114,182,365	65,047,726	17,785,061
繰 越 損 益 金	△ 57,550,475,143	△ 53,132,216,830	△ 47,074,387,726	△ 45,163,077,995	△ 40,525,942,357	△ 39,018,092,522

*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。

<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 210 期	第 211 期	第 212 期	第 213 期	第 214 期	第 215 期
(A) 配 当 等 収 益 (費用控除後)	144,719,842円	147,173,882円	154,012,205円	144,647,934円	134,187,260円	131,672,690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	5,226,847,242	4,925,028,011	4,757,843,355	4,630,259,174	4,380,674,051	4,312,933,815
(D) 分 配 準 備 積 立 金	23,526,513	11,155,947	3,394,719	6,508,059	111,530,341	63,981,954
分配可能額 (A+B+C+D)	5,395,093,597	5,083,357,840	4,915,250,279	4,781,415,167	4,626,391,652	4,508,588,459
(1 万 口 当 り 分 配 可 能 額)	(137.51)	(131.32)	(130.41)	(129.32)	(128.03)	(126.74)
収 益 分 配 金	392,330,211	193,551,612	188,459,953	184,868,138	180,669,875	177,869,583
(1 万 口 当 り 収 益 分 配 金)	(10)	(5)	(5)	(5)	(5)	(5)

短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

分配金のお知らせ

決算期	第 210 期	第 211 期	第 212 期	第 213 期	第 214 期	第 215 期
1 万口当り分配金（税込み）	10円	5円	5円	5円	5円	5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：2021年4月7日

(第36期：2020年10月8日～2021年4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
第36期 (2021年4月7日)	24,563	12.7	0.0100	97.3	—	132,256

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10月7日	21,791	—	0.0900	99.0	—
10月末	21,412	△ 1.7	0.0550	98.6	—
11月末	22,435	3.0	0.0200	98.4	—
12月末	23,002	5.6	0.0150	97.6	—
2021年1月末	23,388	7.3	0.0100	97.6	—
2月末	24,310	11.6	0.0097	98.6	—
3月末	24,610	12.9	0.0158	98.4	—
(期末) 2021年4月7日	24,563	12.7	0.0100	97.3	—

*騰落率は期首比です。

*先物組入比率は、買建比率-売建比率

運用経過

【基準価額等の推移】

期首：21,791円
期末：24,563円
騰落率：+12.7%

【基準価額の主な変動要因】

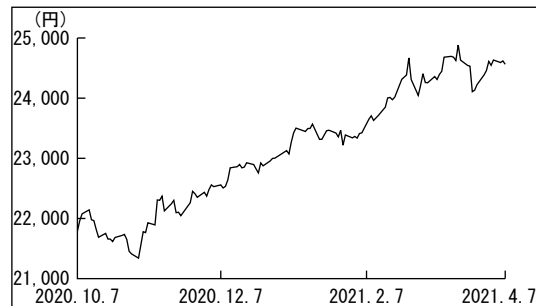
(上昇要因)

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。グローバルに株式市場が上昇するリスクオン（リスク選好）相場となったことで、リスクセンチメント（投資家心理）に敏感な豪ドルは上昇しました。オーストラリアは新型コロナウイルスの感染者数の抑制に成功し、経済指標も一時の落ち込みから改善傾向となったこと、オーストラリア国債利回りの上昇も豪ドルの上昇に寄与しました。

(下落要因)

債券の利回りが上昇したことがマイナス要因となりました。オーストラリアの経済指標が堅調に推移したことや、欧米で新型コロナウイルスのワクチン接種が始まり、景気回復ペースの加速が意識され、米国を中心にグローバルに国債利回りが上昇したことでオーストラリア市場にも利回り上昇圧力となりました。

基準価額の推移



短期豪ドル債マザーファンド

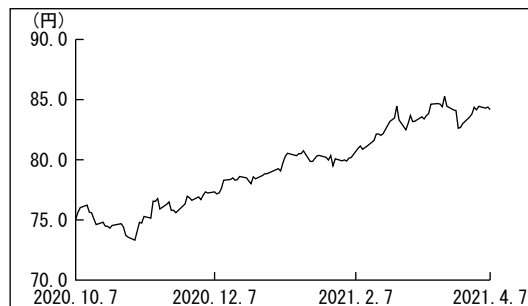
【投資環境】

当期のオーストラリア債券市場は、利回りが上昇（価格は下落）しました。新型コロナウイルスのワクチン接種に伴う世界的な景気回復への期待を背景に、特に2021年1月以降に利回りが大きく上昇しました。

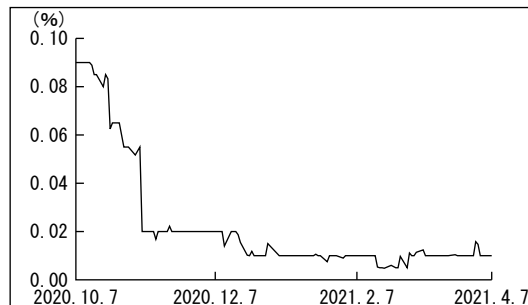
オーストラリアでは、新型コロナウイルスの感染者数が抑制され、他国対比で経済指標が堅調に推移し、期初から利回りは上昇基調となりました。RBA（オーストラリア準備銀行）は11月に政策金利および3年国債利回り誘導目標を0.25%から0.10%に引き下げ、短中期債は堅調に推移したものの長期債利回りは上昇しました。2021年年初以降は、新型コロナウイルスのワクチンへの期待感に加え、中央銀行による将来の緩和策の縮小が意識され始めたこと、11月の米大統領選挙でバイデン候補が勝利し米国議会も民主党が上下両院ともに過半数を得たことで、同党の掲げる大規模な財政政策の実現可能性が高まったことなどから利回りの上昇が加速しました。

豪ドル円は、新型コロナウイルスのワクチンへの期待や想定よりも堅調な経済指標が続いたことで株式市場は上昇し円安圧力となったほか、オーストラリア市場の利回り上昇が豪ドル高圧力となり、豪ドル円は上昇しました。

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】

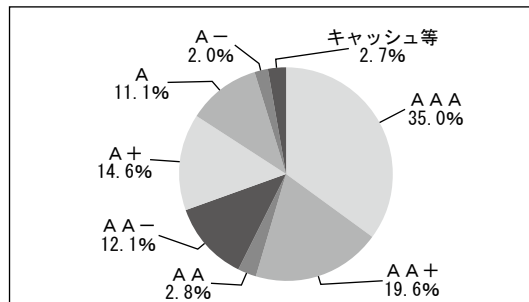
当期の騰落率は、+12.7%となりました。

当期は、デュレーション*を長めに維持しました。新型コロナウイルスのワクチンへの期待から株式市場が堅調に推移するなかで社債市場も堅調となり、ポートフォリオの社債比率を高めとするなかで、クレジットリスクとのバランスを考慮しデュレーションは長めに維持しました。また当ファンドの主力である短中期債の利回りは、RBAの3年国債誘導利回り为目标とするイールドカーブ（利回り曲線）コントロール政策を背景に底堅く推移したことも、デュレーションを維持した要因となりました。その結果、デュレーションは期初から0.9年台を維持し、社債比率も60%前後を維持しました。

*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。

格付別資産構成

(2021年4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。

今後の運用方針

今後もワクチン接種が進むことで経済指標にはさらに改善が見られ、中央銀行による強力な金融緩和策の縮小観測が強まると考えられることから、中期的な利回り上昇圧力は続くと考えられます。オーストラリア市場においても、堅調な経済指標とRBAの姿勢が注目されます。一方、金融市場は景気回復の加速につながる材料をいったん織り込んだと見られ、債券市場では足元で急激な利回り上昇に一巡感が出ていることから、デュレーションは長めを基本としつつ機動的なオペレーションを検討します。また、景気回復に対する期待を背景に当面の社債市場は底堅く推移すると見られ、社債比率は高めを維持する見込みです。

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2020年10月8日～2021年4月7日		
	金額	比率	
その他費用 (保管費用)	3円	0.015%	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	0.015	
期中の平均基準価額は23,193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。

短期豪ドル債マザーファンド

売買及び取引の状況

(2020年10月8日から2021年4月7日まで)

■公社債

			買付額	売付額
外国	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 4,205	千オーストラリア・ドル 28,555
		地方債証券	41,993	29,627 (25,000)
		特殊債証券	53,231	92,521 (70,000)
		社債証券	131,190	212,577

*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10月8日から2021年4月7日まで)

■公社債

買		当	期	売	
銘柄	柄	金額	銘柄	柄	金額
		千円			千円
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH FL 12/23/21		2,082,208	COMMONWEALTH BANK AUST FL 11/17/21		1,985,545
MACQUARIE BANK LTD FL 12/09/25		1,971,000	KOMMUNALBANKEN AS 6.5 04/12/21		1,984,403
MET LIFE GLOB FUNDING I FL 12/01/25		1,845,840	TREASURY CORP VICTORIA 2.25 10/29/21		1,962,916
TORONTO-DOMINION BANK FL 03/17/26		1,687,200	DBS GROUP HOLDINGS LTD FL 07/17/23		1,886,215
SVENSKA HANDELSBANKEN AB FL 03/04/26		1,666,200	ROYAL BANK OF CANADA/SYD FL 02/03/21		1,579,433
INT BK RECON & DEVELOP 0.5 05/18/26		1,535,708	RABOBANK NEDERLAND AU FL 03/04/21		1,544,445
KIWIBANK LTD FL 09/23/25		1,397,331	SVENSKA HANDELSBANKEN AB FL 05/31/22		1,527,445
TREASURY CORP VICTORIA 0.5 11/20/25		1,361,360	EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.7 11/15/24		1,302,772
MUFG BANK LTD SYDNEY FL 09/26/24		1,181,040	MUFG BANK LTD SYDNEY FL 08/29/22		1,258,097
INTL FINANCE CORP 0.75 05/24/28		765,800	INT BK RECON & DEVELOP 2.8 01/12/22		1,216,848

*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10月8日から2021年4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 116,007	百万円 3,113	% 2.7	百万円 132,998	百万円 3,113	% 2.3

■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 1,959

■利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当		期
	買	付	額
公 社 債			百万円 1,971

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、SMB C日興証券株式会社です。

組入資産の明細

2021年4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		組入比率	う ち BB格以下 組入比率	末		
		評 価 額				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 1,500,080	千オーストラリア・ドル 1,528,287	千円 128,635,978	% 97.3	% -	% 5.8	% 52.8	% 38.7
合 計	-	-	128,635,978	97.3	-	5.8	52.8	38.7

*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	2.2500	12,000	12,423	1,045,664	2022/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.2500	9,200	9,189	773,496	2024/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	国債証券	0.5000	10,000	9,829	827,340	2026/09/21
WESTERN AUST TREAS CORP	地方債証券	0.2600	30,000	30,070	2,531,008	2022/03/03
WESTERN AUST TREAS CORP	地方債証券	0.2666	30,000	30,155	2,538,154	2023/03/08
WESTERN AUST TREAS CORP	地方債証券	0.2527	17,000	17,131	1,441,922	2024/02/21
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH	地方債証券	0.3700	10,000	10,049	845,832	2023/06/16
SOUTH AUST GOVT FIN AUTH	地方債証券	0.0800	25,000	25,006	2,104,797	2021/12/23
NEW S WALES TREASURY CRP	地方債証券	1.0000	1,000	1,019	85,802	2024/02/08
NEW S WALES TREASURY CRP	地方債証券	1.2500	1,000	1,030	86,699	2025/03/20
NEW S WALES TREASURY CRP	地方債証券	0.4061	15,000	15,142	1,274,506	2023/10/09
TREASURY CORP VICTORIA	地方債証券	0.4151	30,000	30,477	2,565,299	2025/04/02
TREASURY CORP VICTORIA	地方債証券	0.5000	17,000	16,820	1,415,808	2025/11/20
QUEENSLAND TREASURY CORP	地方債証券	0.1548	25,000	25,029	2,106,754	2022/02/07
QUEENSLAND TREASURY CORP	地方債証券	0.2198	25,000	25,091	2,111,909	2023/02/06
QUEENSLAND TREASURY CORP	地方債証券	0.2537	21,000	21,208	1,785,157	2024/11/25
CORP ANDINA DE FOMENTO	特殊債券	3.4000	10,000	10,380	873,693	2023/10/26
CORP ANDINA DE FOMENTO	特殊債券	6.2500	5,000	5,541	466,432	2023/11/08
EXPORT DEVELOPMNT CANADA	特殊債券	2.4000	15,000	15,057	1,267,347	2021/06/07
EXPORT DEVELOPMNT CANADA	特殊債券	2.8000	15,000	15,801	1,330,045	2023/05/31
KFW	特殊債券	2.8000	10,000	10,488	882,825	2023/03/07
KFW	特殊債券	2.9000	20,000	20,639	1,737,235	2022/06/06
L-BANK BW FOERDERBANK	特殊債券	2.7000	22,000	23,097	1,944,104	2023/06/19
BNG BANK NV	特殊債券	0.7500	20,000	20,176	1,698,281	2023/11/13
EXPORT FIN & INS CORP	特殊債券	0.5150	19,000	19,115	1,608,921	2024/01/29
INT BK RECON & DEVELOP	特殊債券	2.8000	10,000	10,205	858,954	2022/01/12
INT BK RECON & DEVELOP	特殊債券	2.6000	10,000	10,353	871,454	2022/09/20
INT BK RECON & DEVELOP	特殊債券	2.2000	10,000	10,516	885,190	2024/02/27
INT BK RECON & DEVELOP	特殊債券	0.5000	20,000	19,459	1,637,880	2026/05/18
INTL FINANCE CORP	特殊債券	0.7500	10,000	9,443	794,867	2028/05/24
EUROPEAN INVESTMENT BANK	特殊債券	5.0000	5,000	5,333	448,916	2022/08/22
EUROPEAN INVESTMENT BANK	特殊債券	1.7000	5,000	5,201	437,835	2024/11/15
EUROPEAN INVESTMENT BANK	特殊債券	2.9000	10,000	10,925	919,565	2025/10/17
ASIAN DEVELOPMENT BANK	特殊債券	2.6500	10,000	10,425	877,472	2023/01/11
ASIAN DEVELOPMENT BANK	特殊債券	2.4500	10,000	10,567	889,424	2024/01/17
ASIAN DEVELOPMENT BANK	特殊債券	3.7500	10,000	11,192	942,072	2025/03/12
INTER-AMERICAN DEVEL BK	特殊債券	4.0000	10,000	10,783	907,680	2023/05/22
INTER-AMERICAN DEVEL BK	特殊債券	1.9500	10,000	10,454	879,972	2024/04/23
KOMMUNALBANKEN AS	特殊債券	4.5000	20,000	21,677	1,824,603	2023/04/17

短期豪ドル債マザーファンド

銘柄	当 期 末					
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア・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	
KIWIBANK LTD (※)	特殊債券	0.7307	30,510	30,895	2,600,460	2025/09/23
MET LIFE GLOB FUNDING I	社債券	0.5311	24,000	23,934	2,014,544	2025/12/01
JOHN DEERE FINANCIAL LTD	社債券	3.2500	14,500	15,034	1,265,426	2022/07/15
JPMORGAN CHASE & CO	社債券	1.1427	20,000	20,306	1,709,172	2024/11/22
ING BANK (AUSTRALIA) LTD (※)	社債券	0.6166	20,000	20,037	1,686,564	2021/09/07
ING BANK (AUSTRALIA) LTD (※)	社債券	3.0000	10,000	10,585	890,981	2023/09/07
BANK OF MONTREAL	社債券	1.0119	20,000	20,311	1,709,576	2024/07/17
BANK OF MONTREAL (※)	社債券	1.2119	20,000	20,396	1,716,731	2023/04/17
BANK OF NOVA S/AUSTRALIA	社債券	0.9566	15,000	15,150	1,275,238	2022/09/08
TORONTO-DOMINION BANK	社債券	1.0161	30,000	30,463	2,564,138	2024/07/10
TORONTO-DOMINION BANK (※)	社債券	1.2600	16,000	16,328	1,374,327	2023/04/14
TORONTO-DOMINION BANK	社債券	0.6849	20,000	19,990	1,682,575	2026/03/17
BPCE SA	社債券	1.1109	10,000	10,136	853,163	2023/04/26
BPCE SA	社債券	1.6377	18,000	18,670	1,571,511	2025/06/05
SOCIETE GENERALE SYDNEY	社債券	0.9400	14,000	14,157	1,191,660	2023/07/15
RABOBANK NEDERLAND/AU	社債券	0.8205	10,000	10,079	848,408	2022/09/22
ZURICH FIN AUSTRALIA LTD	社債券	3.4770	18,000	19,033	1,602,024	2023/05/31
UBS AG AUSTRALIA	社債券	0.9366	10,000	10,110	851,000	2023/03/08
UBS AG AUSTRALIA	社債券	0.8800	10,000	10,123	852,061	2025/07/30
SVENSKA HANDELSBANKEN AB	社債券	1.0102	9,000	9,143	769,627	2023/09/27
SVENSKA HANDELSBANKEN AB	社債券	0.4826	20,000	19,893	1,674,444	2026/03/04
BANCO SANTANDER SA	社債券	1.2800	10,000	10,067	847,406	2024/09/26
TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	社債券	0.7927	6,000	6,022	506,918	2021/11/22
TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	社債券	1.3000	6,000	6,090	512,620	2023/02/17
BK TOKYO-MIT UFJ SYDNEY	社債券	1.0105	10,000	10,125	852,297	2023/03/20
MUFG BANK LTD SYDNEY	社債券	0.7100	10,000	10,059	846,708	2022/08/29
MUFG BANK LTD SYDNEY	社債券	0.5100	14,000	14,014	1,179,570	2024/09/26
DBS BANK LTD (※)	社債券	0.5303	36,500	36,708	3,089,778	2022/10/25
UNITED OVERSEAS BANK/SYD	社債券	0.8203	18,000	18,094	1,522,983	2022/01/24
UNITED OVERSEAS BANK/SYD	社債券	0.6009	9,000	9,072	763,658	2025/10/27
OCBC/SYDNEY	社債券	0.6677	12,000	12,081	1,016,888	2022/12/05
NATIONAL AUSTRALIA BANK (※)	社債券	0.6840	25,000	25,241	2,124,598	2023/03/16
NATIONAL AUSTRALIA BANK	社債券	0.9493	10,000	10,206	859,097	2024/06/19
NATIONAL AUSTRALIA BANK	社債券	2.1500	4,700	4,928	414,821	2024/06/19
AUST & NZ BANKING GROUP	社債券	0.8000	20,000	20,336	1,711,748	2024/08/29
COMMONWEALTH BANK AUST	社債券	1.1461	10,000	10,247	862,523	2024/01/11
WESTPAC BANKING CORP (※)	社債券	0.7900	30,000	30,271	2,547,952	2022/08/31
WESTPAC BANKING CORP	社債券	1.1503	10,000	10,266	864,114	2024/04/24
SUNCORP-METWAY LTD (※)	社債券	1.1303	5,000	5,138	432,532	2025/04/24
SUNCORP-METWAY LTD	社債券	0.4602	9,000	8,982	756,045	2026/02/24
CIBC AUSTRALIA (※)	社債券	0.5100	19,000	19,086	1,606,538	2022/08/01
MACQUARIE BANK LTD	社債券	0.7805	10,000	10,064	847,154	2022/06/21

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		
MACQUARIE BANK LTD	社債券	0.8500	10,000	10,129	852,557	2025/02/12	
MACQUARIE BANK LTD	社債券	0.5188	10,000	9,957	838,105	2025/12/09	
TELSTRA CORP LTD	社債券	4.0000	10,000	10,527	886,066	2022/09/16	
TELSTRA CORP LTD	社債券	2.9000	8,000	8,006	673,905	2021/04/19	
CENTRAL NIPPON EXPRESSWY	社債券	1.0600	15,000	14,735	1,240,265	2025/08/01	
COCA-COLA CO/THE	社債券	3.2500	20,000	21,534	1,812,584	2024/06/11	
MC FINANCE AUSTRALIA P/L	社債券	4.2500	7,170	7,334	617,373	2021/12/01	
APPLE INC	社債券	3.7000	25,000	26,178	2,203,465	2022/08/28	
APPLE INC	社債券	3.3500	10,000	10,762	905,871	2024/01/10	
LLOYDS BANK PLC	社債券	0.9100	15,000	15,103	1,271,299	2022/08/12	
SUMITOMO MITSUI FINL GRP	社債券	1.3002	23,100	23,285	1,959,978	2022/03/29	
mitsubishi UFJ FIN GRP	社債券	1.2861	15,800	16,043	1,350,392	2024/10/01	
mitsubishi UFJ FIN GRP	社債券	2.0777	10,600	10,913	918,584	2024/10/01	
OPTUS FINANCE PTY LTD	社債券	3.2500	8,000	8,316	700,038	2022/08/23	
OPTUS FINANCE PTY LTD	社債券	3.2500	10,000	10,644	895,930	2023/09/06	
OPTUS FINANCE PTY LTD	社債券	1.6000	3,000	3,055	257,143	2025/07/01	
UNITED ENERGY DISTRIBUTI	社債券	0.9798	10,000	10,065	847,187	2023/02/07	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	社債券	1.6140	25,000	25,258	2,126,007	2028/03/16	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	社債券	1.9187	26,000	26,676	2,245,384	2031/04/08	
BANK OF QUEENSLAND LTD (※)	社債券	1.0800	6,000	6,136	516,544	2025/05/14	
CITIBANK NA	社債券	0.7627	15,000	15,081	1,269,393	2022/05/20	
CITIBANK NA SYDNEY	社債券	0.8900	10,000	10,138	853,365	2024/11/14	
合計	—	—	1,500,080	1,528,287	128,635,978	—	

*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

2021年4月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	128,635,978	97.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,929,492	3.0
投 資 信 託 財 産 総 額	132,565,470	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=84.17円

*当期末における外貨建資産（129,016,049千円）の投資信託財産総額（132,565,470千円）に対する比率 97.3%

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年4月7日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	144,117,730,171円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,538,525,811
公 社 債(評価額)	128,635,978,369
未 収 入 金	11,563,787,150
未 収 利 息	372,752,825
前 払 費 用	6,686,016
(B) 負 債	11,860,804,331
未 払 金	11,560,684,900
未 払 解 約 金	300,119,431
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	132,256,925,840
元 本	53,844,424,863
次 期 繰 越 損 益 金	78,412,500,977
(D) 受 益 権 総 口 数	53,844,424,863口
1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D)	24,563円

*元本状況

期首元本額	61,187,896,726円
期中追加設定元本額	13,024,926円
期中一部解約元本額	7,356,496,789円

*元本の内訳

短期豪ドル債オープン（毎月分配型）	52,735,940,357円
短期豪ドル債オープン（年2回決算型）	1,108,484,506円

損益の状況

自2020年10月8日
至2021年4月7日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,002,129,861円
受 取 利 息	1,002,501,598
支 払 利 息	△ 371,737
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	15,000,479,660
売 買 益	15,788,452,005
売 買 損	△ 787,972,345
(C) そ の 他 費 用	△ 20,043,729
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	15,982,565,792
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	72,145,611,509
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 9,731,632,263
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	15,955,939
(H) 計 (D+E+F+G)	78,412,500,977
次 期 繰 越 損 益 金(H)	78,412,500,977

*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。