

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	2014年4月4日
信託期間	2014年4月4日～2024年4月8日（約10年）
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、ニュージーランド・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、安定的な利息収益の確保と中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	短期NZドル債オープン（資産成長型） ・短期NZドル債マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 短期NZドル債マザーファンド ・ニュージーランド・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	短期NZドル債オープン（資産成長型） ・株式への実質投資は行いません。 ・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NZドル債マザーファンド ・株式への投資は行いません。 ・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	毎年3月、9月の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14期

決算日 2021年3月8日

短期NZドル債オープン （資産成長型）

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NZドル債オープン（資産成長型）」は、去る2021年3月8日に第14期の決算を行いました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

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NZドル債オープン（資産成長型）

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			Bloomberg NZ Bond Government 0-3 Year (円換算)		公社債組入比率	債券先物組入比率	純資産額	
	(分配落)	税分配	込金	期騰落	中率				(参考指数)
第10期 (2019年3月7日)	円 9,632	円 0	円 0	% 5.4	% 5.1	% 96.6	% -	百万円 33	
第11期 (2019年9月9日)	8,998	0	△	6.6	△	7.5	91.4	-	30
第12期 (2020年3月9日)	8,482	0	△	5.7	△	5.5	97.8	-	27
第13期 (2020年9月7日)	9,536	0		12.4		11.2	96.9	-	29
第14期 (2021年3月8日)	10,090	0		5.8		8.7	96.5	-	27

Bloomberg NZ Bond Government 0-3 Year (円換算) とは、Bloomberg NZ Bond Government 0-3 Year (ニュージーランドドルベース) を委託者が円換算し、設定日を10,000として指数化したものです。

*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。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		Bloomberg NZ Bond Government 0-3 Year (円換算)		公社債組入比率	債券先物組入比率
		騰落率	(参考指数)	騰落率		
(期首) 2020年9月7日	円 9,536	% -	9,662	% -	% 96.9	% -
9月末	9,327	△2.2	9,462	△2.1	96.9	-
10月末	9,250	△3.0	9,388	△2.8	97.0	-
11月末	9,684	1.6	9,873	2.2	95.8	-
12月末	9,799	2.8	10,011	3.6	95.1	-
2021年1月末	9,869	3.5	10,113	4.7	96.6	-
2月末	10,124	6.2	10,514	8.8	95.1	-
(期末) 2021年3月8日	10,090	5.8	10,505	8.7	96.5	-

*騰落率は期首比です。

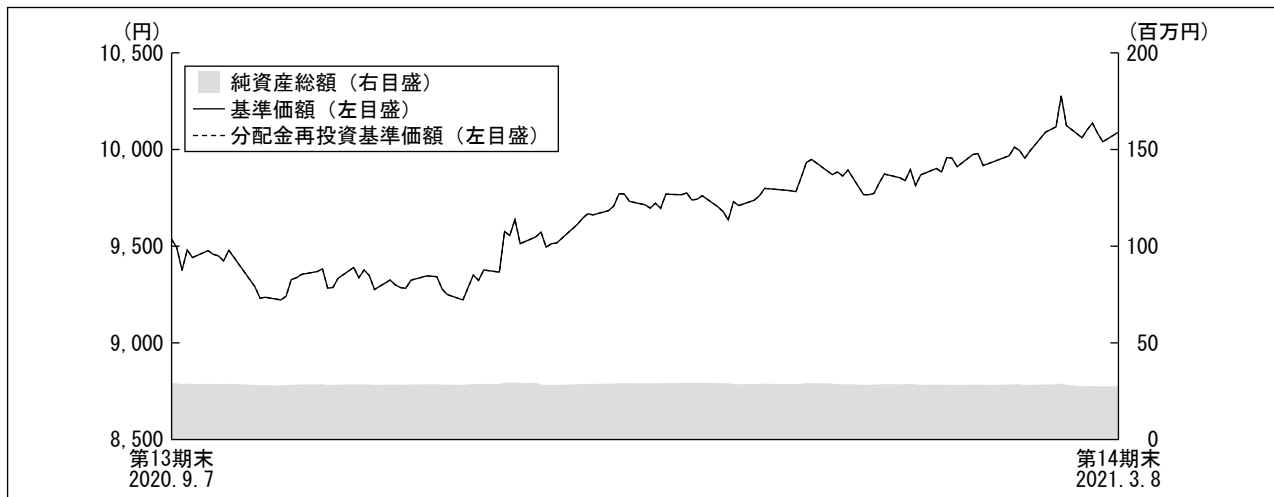
*先物組入比率は、買建比率-売建比率

*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NZドル債オープン（資産成長型）

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、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14期首：9,536円

第14期末：10,090円（既払分配金 0円）

騰落率：+5.8%（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NZドル債マザーファンドへの投資を通じて、ニュージーランド・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）

NZドル円の上昇が基準価額の主な上昇要因となりました。2020年11月の米大統領選挙でバイデン候補が勝利し、米国発のリスクオン（リスク選好）となったことや、期末にかけては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への期待感が高まったことがNZドル円の上昇要因となりました。また、ニュージーランドは新型コロナウイルスの感染者数が抑制され、相対的に景気が底堅かったこともNZドルの上昇材料となりました。

（下落要因）

債券市場で利回りが上昇したことがマイナス要因となりました。ニュージーランドの景気が底堅く、RBNZ（ニュージーランド準備銀行）によるさらなる利下げなど追加緩和期待が後退したことが、利回りの上昇要因となりました。

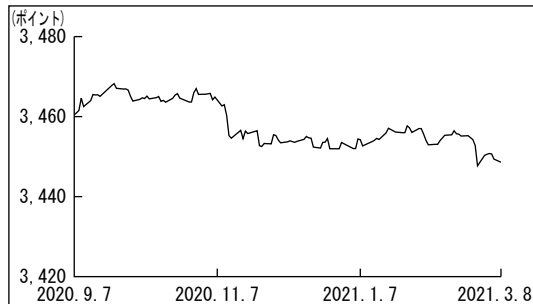
短期NZドル債オープン（資産成長型）

【投資環境】

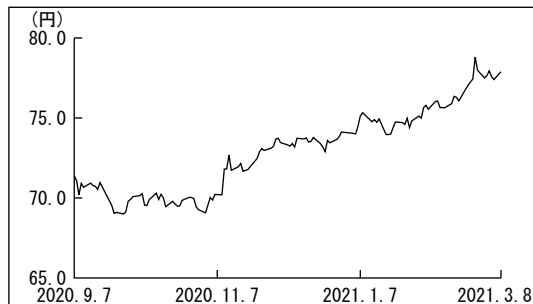
当期のニュージーランド債券市場は、利回りが上昇しました。期初は、新型コロナウイルスや2020年11月に控える米大統領選挙をめぐる不透明感から、利回りは低下して始まりました。その後、米大統領選挙では事前の予想通りバイデン候補が勝利し、米民主党が目指す大型の景気支援策への期待が高まったことでリスクオン相場となり、世界的に債券利回りが上昇する展開となりました。期の後半には、新型コロナウイルスのワクチンの有効性が確認され、世界中でワクチン接種が始まるなかで、景気回復の加速や中央銀行の金融緩和縮小が意識され、利回りは上昇基調をたどりました。

NZドル円は、大幅に上昇しました。ニュージーランドは新型コロナウイルスの感染者数が抑制され、他国と比べ経済指標が堅調だったこと、ニュージーランド国債の利回り上昇が他国対比で大きかったことなどからNZドルは上昇しました。

Bloomberg NZ Bond Government 0-3 Yearの推移



為替レート（ニュージーランドドル／円）の推移



短期N Zドル債オープン（資産成長型）

【ポートフォリオ】

■短期N Zドル債オープン（資産成長型）

主要投資対象である短期N Zドル債マザーファンドを期を通じて高位に組み入れ、期末の実質的な公社債組入比率は96.5%としました。

■短期N Zドル債マザーファンド

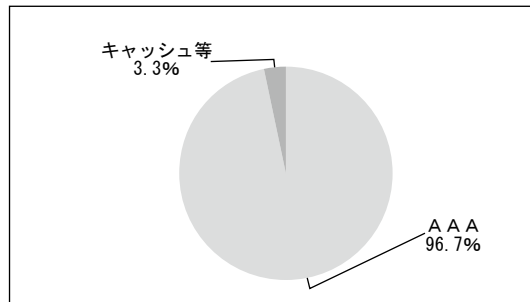
当期の騰落率は、+6.4%となりました。

期初、新型コロナウイルスをめぐる不透明感からデュレーション*は長めとしました。その後、米国の大型経済対策に対する期待感や、新型コロナワクチンへの期待などから中央銀行による金融緩和の縮小が意識されたことなどにより世界的に利回り上昇圧力が強まったことから、デュレーションを引き下げました。ニュージーランドでは、RBNZによる追加利下げ観測が後退したことも、デュレーションを引き下げる背景となりました。

*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3月8日現在)



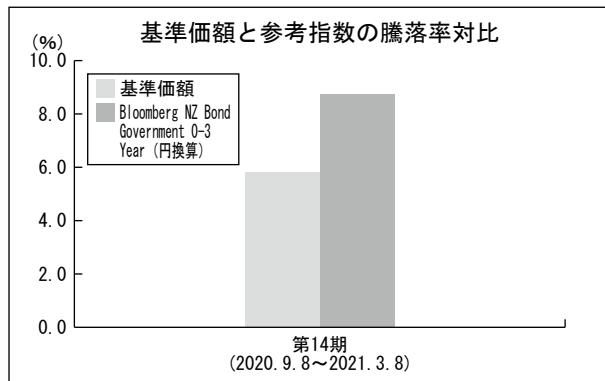
*純資産総額に対する評価額の割合

*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NZドル債オープン（資産成長型）

【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。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



【分配金】

分配金につきましては、分配可能額、基準価額水準等を勘案し、見送りとさせて頂きました。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14期	
	2020年9月8日 ~2021年3月8日	
当期分配金 (円)	0	
(対基準価額比率) (%)	0.00	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	2,151	

※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NZドル債オープン（資産成長型）

今後の運用方針

■短期NZドル債オープン（資産成長型）

引き続き、運用の基本方針に従い、マザーファンドへの投資を通じてニュージーランド・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、安定的な利息収益の確保と中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

■短期NZドル債マザーファンド

足元では新型コロナウイルスのワクチン接種が進み、経済の正常化や景気回復加速への期待が高まっていることで、世界的に利回りが上昇しています。ワクチンの有効性も確認され、米国では追加経済対策の議論が進み、景気回復見通しへの目立った懸念材料がないなかで中央銀行の緩和策縮小に伴う市場への影響がリスク要因となっています。デュレーションは抑制した水準を基本としつつ、中央銀行の緩和策の縮小に伴いリスクオフ（リスク回避）となる局面があれば、機動的にデュレーションを引き上げることを検討する方針です。

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2020年9月8日～2021年3月8日		
	金額	比率	
信託報酬	60円	0.621%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,676円です。
（投信会社）	(29)	(0.303)	ファンドの運用等の対価
（販売会社）	(29)	(0.302)	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）	(2)	(0.016)	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	12	0.120	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(11)	(0.115)	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)	(0.005)	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	72	0.741	

* 「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。

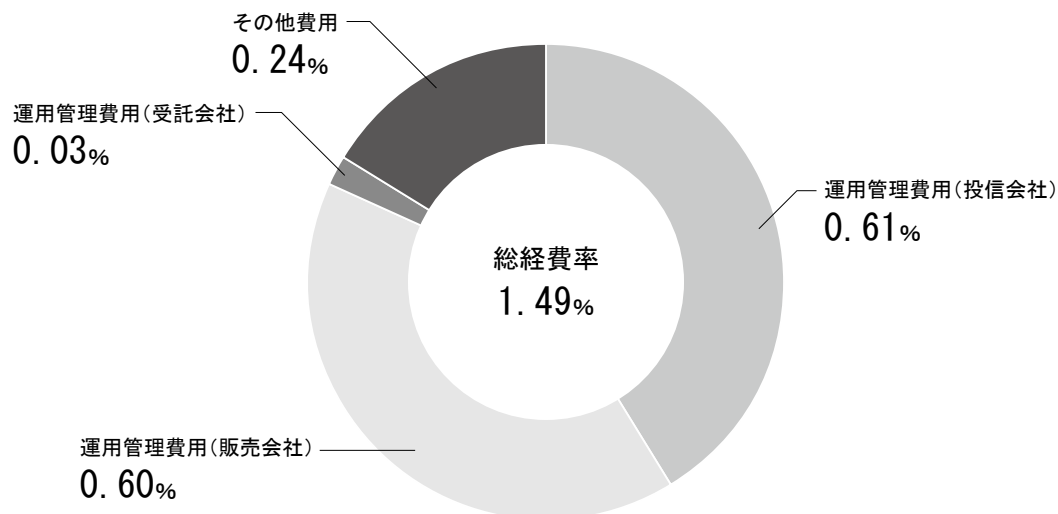
* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む。）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

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NZドル債オープン（資産成長型）

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。

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率換算）は1.49%です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

（2020年9月8日から2021年3月8日まで）

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
短期NZドル債マザーファンド	千口 1,216	千円 1,287	千口 4,359	千円 4,681

短期NZドル債オープン（資産成長型）

利害関係人との取引状況等

（2020年9月8日から2021年3月8日まで）

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

組入資産の明細

2021年3月8日現在

■親投資信託残高

	期首（前期末）	当 期		末
	口 数	口 数	評 価 額	評 価 額
短期NZドル債マザーファンド	千口 28,066	千口 24,922	千円 27,532	千円 27,532

*短期NZドル債マザーファンド全体の受益権口数は、192,843千口です。

投資信託財産の構成

2021年3月8日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
短期NZドル債マザーファンド	千円 27,532	% 99.2
コール・ローン等、その他	229	0.8
投資信託財産総額	27,761	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 ニュージーランド・ドル=77.89円

*短期NZドル債マザーファンド

当期末における外貨建資産（208,267千円）の投資信託財産総額（214,959千円）に対する比率 96.9%

短期N Zドル債オープン（資産成長型）

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年3月8日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	27,761,589円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	50,371
短期N Zドル債マザーファンド(評価額)	27,532,232
未 収 入 金	178,986
(B) 負 債	178,955
未 払 解 約 金	200
未 払 信 託 報 酬	177,299
そ の 他 未 払 費 用	1,456
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	27,582,634
元 本	27,337,046
次 期 繰 越 損 益 金	245,588
(D) 受 益 権 総 口 数	27,337,046口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D)	10,090円

*元本状況

期首元本額	30,593,466円
期中追加設定元本額	1,708,324円
期中一部解約元本額	4,964,744円

損益の状況

自2020年9月8日
至2021年3月8日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,664,853円
売 買 益	1,802,626
売 買 損	△ 137,773
(B) 信 託 報 酬 等	△ 178,755
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	1,486,098
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 382,749
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 857,761
(配 当 等 相 当 額)	(1,653,539)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,511,300)
(F) 計 (C + D + E)	245,588
次 期 繰 越 損 益 金 (F)	245,588
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 857,761
(配 当 等 相 当 額)	(1,656,226)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,513,987)
分 配 準 備 積 立 金	4,226,214
繰 越 損 益 金	△3,122,865

*有価証券売買損益には、期末の評価換えによるものを含まず。

*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。

(A) 配 当 等 収 益 (費用控除後)	388,059円
(B) 有 価 証 券 売 買 等 損 益 (費用控除後、繰越欠損金補填後)	0
(C) 収 益 調 整 金	1,656,226
(D) 分 配 準 備 積 立 金	3,838,155
分 配 可 能 額 (A + B + C + D)	5,882,440
(1 万 口 当 り 分 配 可 能 額)	(2,151.82)
収 益 分 配 金	0
(1 万 口 当 り 収 益 分 配 金)	(0)

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NZドル債マザーファンド

運用報告書

決算日：2021年3月8日

(第14期：2020年9月8日～2021年3月8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	主にニュージーランド・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することにより、利息収益の確保と中長期的な信託財産の成長を目指します。
主要運用対象	ニュージーランド・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">・ 株式への投資は行いません。・ 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NZ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		Bloomberg NZ Bond Government 0-3 Year (円換算) (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	(参考指数)	騰落率			
第10期 (2019年3月7日)	10,289	6.1	9,939	5.1	95.9	—	百万円 329
第11期 (2019年9月9日)	9,675	△6.0	9,194	△7.5	90.8	—	291
第12期 (2020年3月9日)	9,175	△5.2	8,692	△5.5	97.1	—	247
第13期 (2020年9月7日)	10,378	13.1	9,662	11.2	97.0	—	247
第14期 (2021年3月8日)	11,047	6.4	10,505	8.7	96.7	—	213

Bloomberg NZ Bond Government 0-3 Year (円換算) とは、Bloomberg NZ Bond Government 0-3 Year (ニュージーランドドルベース) を委託者が円換算し、設定日を10,000として指数化したものです。

*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		Bloomberg NZ Bond Government 0-3 Year (円換算) (参考指数)		公社債組入比率	債券先物組入比率
	円	騰落率	(参考指数)	騰落率		
(期首) 2020年9月7日	10,378	—	9,662	—	97.0	—
9月末	10,159	△2.1	9,462	△2.1	97.0	—
10月末	10,085	△2.8	9,388	△2.8	97.0	—
11月末	10,569	1.8	9,873	2.2	95.7	—
12月末	10,702	3.1	10,011	3.6	94.9	—
2021年1月末	10,789	4.0	10,113	4.7	95.1	—
2月末	11,078	6.7	10,514	8.8	93.7	—
(期末) 2021年3月8日	11,047	6.4	10,505	8.7	96.7	—

*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：10,378円
期末：11,047円
騰落率：+6.4%

【基準価額の主な変動要因】

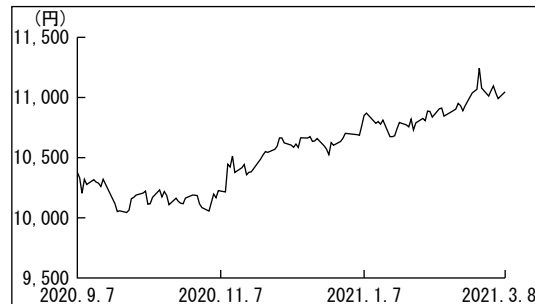
(上昇要因)

NZドル円の上昇が基準価額の主な上昇要因となりました。2020年11月の米大統領選挙でバイデン候補が勝利し、米国発のリスクオン（リスク選好）となったことや、期末にかけては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への期待感が高まったことがNZドル円の上昇要因となりました。また、ニュージーランドは新型コロナウイルスの感染者数が抑制され、相対的に景気が底堅かったこともNZドルの上昇材料となりました。

(下落要因)

債券市場で利回りが上昇したことがマイナス要因となりました。ニュージーランドの景気が底堅く、RBNZ（ニュージーランド準備銀行）によるさらなる利下げなど追加緩和期待が後退したことが、利回りの上昇要因となりました。

基準価額の推移



【投資環境】

当期のニュージーランド債券市場は、利回りが上昇しました。期初は、新型コロナウイルスや2020年11月に控える米大統領選挙をめぐる不透明感から、利回りは低下して始まりました。その後、米大統領選挙では事前の予想通りバイデン候補が勝利し、米民主党が目指す大型の景気支援策への期待が高まったことでリスクオン相場となり、世界的に債券利回りが上昇する展開となりました。期の後半には、新型コロナウイルスのワクチンの有効性が確認され、世界中でワクチン接種が始まるなかで、景気回復の加速や中央銀行の金融緩和縮小が意識され、利回りは上昇基調をたどりました。

NZドル円は、大幅に上昇しました。ニュージーランドは新型コロナウイルスの感染者数が抑制され、他国と比べ経済指標が堅調だったこと、ニュージーランド国債の利回り上昇が他国対比で大きかったことなどからNZドルは上昇しました。

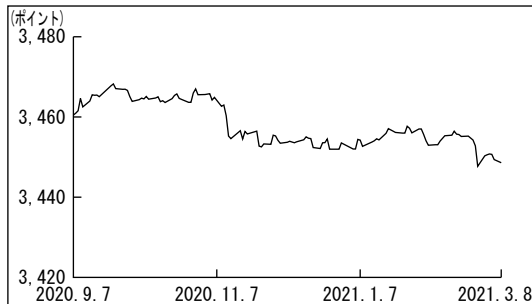
【ポートフォリオ】

当期の騰落率は、+6.4%となりました。

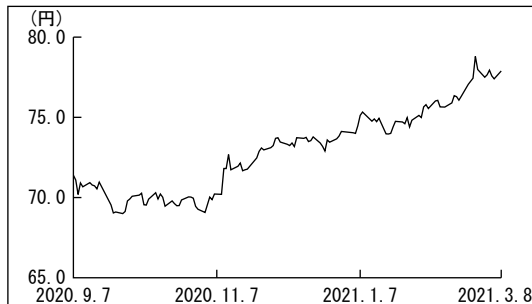
期初、新型コロナウイルスをめぐる不透明感からデュレーション*は長めとしました。その後、米国の大型経済対策に対する期待感や、新型コロナワクチンへの期待などから中央銀行による金融緩和の縮小が意識されたことなどにより世界的に利回り上昇圧力が強まったことから、デュレーションを引き下げました。ニュージーランドでは、RBNZによる追加利下げ観測が後退したことも、デュレーションを引き下げる背景となりました。

*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。

Bloomberg NZ Bond Government 0-3 Yearの推移

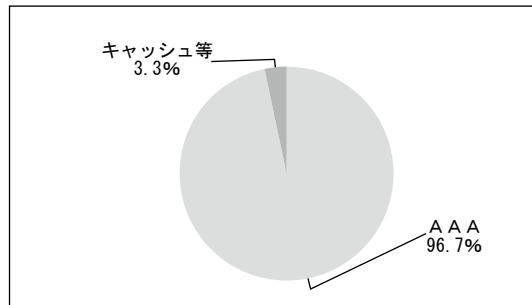


為替レート (ニュージーランドドル/円) の推移



格付別資産構成

(2021年3月8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NZドル債マザーファンド

【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。

基準価額の騰落率は、参考指数であるBloomberg NZ Bond Government 0-3 Year (円換算)の騰落率+8.7%を2.3%下回りました。

今後の運用方針

足元では新型コロナウイルスのワクチン接種が進み、経済の正常化や景気回復加速への期待が高まっていることで、世界的に利回りが上昇しています。ワクチンの有効性も確認され、米国では追加経済対策の議論が進み、景気回復見通しへの目立った懸念材料がないなかで中央銀行の緩和策縮小に伴う市場への影響がリスク要因となっています。デュレーションは抑制した水準を基本としつつ、中央銀行の緩和策の縮小に伴いリスクオフ（リスク回避）となる局面があれば、機動的にデュレーションを引き上げることを検討する方針です。

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2020年9月8日～2021年3月8日		
	金額	比率	
その他費用	12円	0.115%	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(12)	(0.115)	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
（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	12	0.115	
期中の平均基準価額は10,564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NZドル債マザーファンド

売買及び取引の状況

(2020年9月8日から2021年3月8日まで)

■公社債

			買付額	売付額
外国	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 110	千ニュージーランド・ドル 103
		地方債証券	—	100
		特殊債証券	—	402 (100)

*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。

主要な売買銘柄

(2020年9月8日から2021年3月8日まで)

■公社債

買		当	期	売	
銘柄	金額		銘柄	金額	
NEW ZEALAND GOVERNMENT 1.5 05/15/31	千円 7,740		INT BK RECON & DEVELOP 3.5 01/22/21	千円 29,180	
			NZ LOCAL GOVT FUND AGENC 1.5 04/15/26	7,855	
			NEW ZEALAND GOVERNMENT 6 05/15/21	7,232	

*金額は受渡し代金（経過利子分は含まれていません。）

利害関係人との取引状況等

(2020年9月8日から2021年3月8日まで)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

短期NZドル債マザーファンド

組入資産の明細

2021年3月8日現在

■ 公社債

A 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	う ち BB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			千 円	%	5 年 以 上
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 2,600	千ニュージーランド・ドル 2,644	千円 205,992	% 96.7	% —	% 29.7	% 19.1	% 47.9
合 計	—	—	205,992	96.7	—	29.7	19.1	47.9

*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。

B 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債

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		
(ニュージーランド・ドル…ニュージーランド)		%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円		
NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	6.0000	300	303	23,616	2021/05/15	
NEW ZEALAND GOVERNMENT	国債証券	1.5000	100	96	7,482	2031/05/15	
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC	地方債証券	6.0000	200	202	15,740	2021/05/15	
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC	地方債証券	1.5000	400	400	31,183	2026/04/15	
NZ LOCAL GOVT FUND AGENC	地方債証券	1.5000	100	95	7,423	2029/04/20	
NORDIC INVESTMENT BANK	特殊債券	3.1250	300	300	23,383	2021/03/18	
KOMMUNALBANKEN AS	特殊債券	5.1250	500	504	39,281	2021/05/14	
INT BK RECON & DEVELOP	特殊債券	2.5000	500	523	40,776	2024/01/24	
HOUSING NEW ZEALAND LTD	特殊債券	3.4200	200	219	17,105	2028/10/18	
合 計	—	—	2,600	2,644	205,992	—	

*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

投資信託財産の構成

2021年3月8日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 205,992	% 95.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,966	4.2
投 資 信 託 財 産 総 額	214,959	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 ニュージーランド・ドル=77.89円

*当期末における外貨建資産（208,267千円）の投資信託財産総額（214,959千円）に対する比率 96.9%

短期N Zドル債マザーファンド

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年3月8日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	224,344,021円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,668,887
公 社 債(評価額)	205,992,879
未 収 入 金	9,407,858
未 収 利 息	2,274,397
(B) 負 債	11,306,391
未 払 金	9,390,132
未 払 解 約 金	1,916,259
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	213,037,630
元 本	192,843,471
次 期 繰 越 損 益 金	20,194,159
(D) 受 益 権 総 口 数	192,843,471口
1 万 口 当 り 基 準 価 額(C/D)	11,047円

*元本状況

期首元本額	238,326,614円
期中追加設定元本額	6,626,528円
期中一部解約元本額	52,109,671円

*元本の内訳

短期N Zドル債オープン (毎月分配型)	167,920,657円
短期N Zドル債オープン (資産成長型)	24,922,814円

損益の状況

自2020年9月8日
至2021年3月8日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,900,116円
受 取 利 息	3,901,292
支 払 利 息	△ 1,176
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	10,363,433
売 買 益	21,188,484
売 買 損	△10,825,051
(C) そ の 他 費 用	△ 262,355
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	14,001,194
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	9,011,178
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 3,236,633
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	418,420
(H) 計 (D+E+F+G)	20,194,159
次 期 繰 越 損 益 金(H)	20,194,159

*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。