

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

|            |   |
|------------|---|
| 商品分類       | 追加型投信／海外／債券   |
| 信託期間       | 無期限（設定日：2003年4月18日）   |
| 運用方針       | 主としてマザーファンドへの投資を通じて、オーストラリア・ドル（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、安定的な利息収益の確保を目指して運用を行います。   |
| 主要投資対象     | 当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。<br><b>短期豪ドル債マザーファンド</b><br>豪ドル通貨建ての高格付けの公社債および短期金融商品   |
| 当ファンドの運用方法 | ■主として短期豪ドル債マザーファンドへの投資を通じて、高格付けの豪ドル建ての公社債および短期金融商品へ実質的に投資することにより、安定した利息収益の確保を目指します。<br>■投資する有価証券は、原則として取得時において、長期格付けでA格以上、短期格付けでA1/P1以上の格付けを取得しているものとします。<br>■原則として為替ヘッジは行いません。   |
| 組入制限       | 当ファンド<br>■株式への実質投資割合は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使により取得したものに限り、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。<br>■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。<br><b>短期豪ドル債マザーファンド</b><br>■株式への投資割合は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使により取得したものに限り、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。<br>■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）に決算を行い、分配を行います。<br>■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みません。）等の範囲内とします。<br>■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。<br>※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、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。  |

# 短期豪ドル債オープン （毎月分配型）

【運用報告書（全体版）】

第41作成期（2023年4月8日から2023年10月10日まで）

第 240 期 / 第 241 期 / 第 242 期  
決算日2023年5月8日 決算日2023年6月7日 決算日2023年7月7日

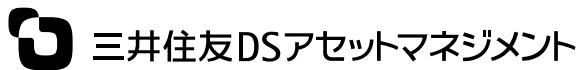
第 243 期 / 第 244 期 / 第 245 期  
決算日2023年8月7日 決算日2023年9月7日 決算日2023年10月10日

## 受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドは主としてマザーファンドへの投資を通じて、オーストラリア・ドル（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、安定的な利息収益の確保を目指して運用を行います。当作成期についても、運用方針に沿った運用を行いました。

今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。



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>

■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。

■当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）

## 短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

### ■ 最近30期の運用実績

| 決算期                | 基準価額  |             |                            | (参考指数)<br>BBSW AUD 1Month | 公社債<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|--------------------|-------|-------------|----------------------------|---------------------------|-------------|-----------|
|                    | (分配落) | 税<br>分<br>配 | 進<br>金<br>騰<br>落<br>中<br>率 |                           |             |           |
|                    | 円     | 円           | %                          |                           | %           | 百万円       |
| 216期 (2021年5月7日)   | 3,668 | 5           | 0.9                        | 0.0100                    | 98.0        | 128,608   |
| 217期 (2021年6月7日)   | 3,659 | 5           | △0.1                       | 0.0100                    | 98.5        | 126,294   |
| 218期 (2021年7月7日)   | 3,563 | 5           | △2.5                       | 0.0100                    | 96.8        | 121,122   |
| 219期 (2021年8月10日)  | 3,483 | 5           | △2.1                       | 0.0050                    | 97.6        | 116,987   |
| 220期 (2021年9月7日)   | 3,515 | 5           | 1.1                        | 0.0100                    | 99.0        | 116,603   |
| 221期 (2021年10月7日)  | 3,477 | 5           | △0.9                       | 0.0100                    | 97.8        | 113,956   |
| 222期 (2021年11月8日)  | 3,577 | 5           | 3.0                        | 0.0150                    | 98.4        | 114,267   |
| 223期 (2021年12月7日)  | 3,397 | 5           | △4.9                       | 0.0150                    | 94.4        | 107,134   |
| 224期 (2022年1月7日)   | 3,521 | 5           | 3.8                        | 0.0150                    | 91.7        | 109,511   |
| 225期 (2022年2月7日)   | 3,444 | 5           | △2.0                       | 0.0181                    | 97.4        | 105,779   |
| 226期 (2022年3月7日)   | 3,576 | 5           | 4.0                        | 0.0156                    | 98.5        | 108,785   |
| 227期 (2022年4月7日)   | 3,862 | 5           | 8.1                        | 0.0200                    | 98.1        | 114,257   |
| 228期 (2022年5月9日)   | 3,788 | 5           | △1.8                       | 0.2750                    | 98.1        | 109,377   |
| 229期 (2022年6月7日)   | 3,916 | 5           | 3.5                        | 0.6100                    | 97.9        | 111,714   |
| 230期 (2022年7月7日)   | 3,793 | 5           | △3.0                       | 1.3400                    | 98.0        | 106,314   |
| 231期 (2022年8月8日)   | 3,853 | 5           | 1.7                        | 1.7933                    | 98.6        | 106,542   |
| 232期 (2022年9月7日)   | 3,954 | 5           | 2.8                        | 2.1832                    | 98.3        | 107,954   |
| 233期 (2022年10月7日)  | 3,821 | 5           | △3.2                       | 2.6386                    | 98.3        | 102,757   |
| 234期 (2022年11月7日)  | 3,878 | 5           | 1.6                        | 2.8400                    | 98.3        | 103,086   |
| 235期 (2022年12月7日)  | 3,786 | 5           | △2.2                       | 2.9610                    | 97.7        | 99,629    |
| 236期 (2023年1月10日)  | 3,753 | 5           | △0.7                       | 3.0300                    | 98.0        | 97,879    |
| 237期 (2023年2月7日)   | 3,785 | 5           | 1.0                        | 3.2250                    | 95.6        | 97,690    |
| 238期 (2023年3月7日)   | 3,795 | 5           | 0.4                        | 3.4650                    | 97.6        | 97,113    |
| 239期 (2023年4月7日)   | 3,657 | 5           | △3.5                       | 3.5932                    | 95.1        | 92,903    |
| 240期 (2023年5月8日)   | 3,794 | 5           | 3.9                        | 3.8150                    | 96.0        | 95,618    |
| 241期 (2023年6月7日)   | 3,872 | 5           | 2.2                        | 3.8850                    | 96.1        | 96,243    |
| 242期 (2023年7月7日)   | 3,961 | 5           | 2.4                        | 4.0763                    | 97.8        | 96,544    |
| 243期 (2023年8月7日)   | 3,889 | 5           | △1.7                       | 4.0550                    | 98.4        | 93,619    |
| 244期 (2023年9月7日)   | 3,947 | 5           | 1.6                        | 4.0550                    | 98.3        | 93,807    |
| 245期 (2023年10月10日) | 3,995 | 5           | 1.3                        | 4.0513                    | 98.2        | 93,660    |

※基準価額の騰落率は分配金込み。

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

※外国の指数は基準価額への反映を考慮した日付の値を使用しています。

## 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   |        | (参 考 指 数)<br>BBSW AUD 1Month | 公 社 債 率<br>組 入 比 |
|-------|------------------------|-------|-------|--------|------------------------------|------------------|
|       |                        |       | 騰 落 率 | 率      |                              |                  |
| 第240期 | (期 首)<br>2023年 4 月 7 日 | 円     | 3,657 | %<br>— | 3.5932                       | %<br>95.1        |
|       | 4 月末                   | 3,706 | 1.3   | 3.6058 | 96.7                         |                  |
|       | (期 末)<br>2023年 5 月 8 日 | 3,799 | 3.9   | 3.8150 | 96.0                         |                  |
| 第241期 | (期 首)<br>2023年 5 月 8 日 | 3,794 | —     | 3.8150 | 96.0                         |                  |
|       | 5 月末                   | 3,791 | △0.1  | 3.8253 | 98.9                         |                  |
|       | (期 末)<br>2023年 6 月 7 日 | 3,877 | 2.2   | 3.8850 | 96.1                         |                  |
| 第242期 | (期 首)<br>2023年 6 月 7 日 | 3,872 | —     | 3.8850 | 96.1                         |                  |
|       | 6 月末                   | 3,982 | 2.8   | 4.1168 | 97.3                         |                  |
|       | (期 末)<br>2023年 7 月 7 日 | 3,966 | 2.4   | 4.0763 | 97.8                         |                  |
| 第243期 | (期 首)<br>2023年 7 月 7 日 | 3,961 | —     | 4.0763 | 97.8                         |                  |
|       | 7 月末                   | 3,919 | △1.1  | 4.1124 | 98.1                         |                  |
|       | (期 末)<br>2023年 8 月 7 日 | 3,894 | △1.7  | 4.0550 | 98.4                         |                  |
| 第244期 | (期 首)<br>2023年 8 月 7 日 | 3,889 | —     | 4.0550 | 98.4                         |                  |
|       | 8 月末                   | 3,968 | 2.0   | 4.0550 | 97.7                         |                  |
|       | (期 末)<br>2023年 9 月 7 日 | 3,952 | 1.6   | 4.0550 | 98.3                         |                  |
| 第245期 | (期 首)<br>2023年 9 月 7 日 | 3,947 | —     | 4.0550 | 98.3                         |                  |
|       | 9 月末                   | 4,020 | 1.8   | 4.0550 | 97.8                         |                  |
|       | (期 末)<br>2023年10月10日   | 4,000 | 1.3   | 4.0513 | 98.2                         |                  |

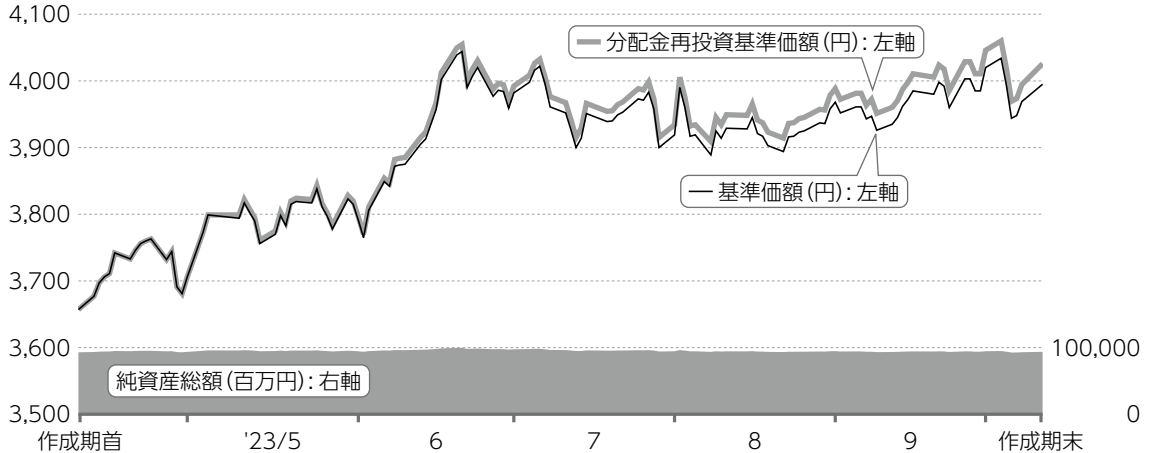
※期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

# 1 運用経過

基準価額等の推移について（2023年4月8日から2023年10月10日まで）

## 基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額は、作成期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

|      |                               |
|------|-------------------------------|
| 作成期首 | 3,657円                        |
| 作成期末 | 3,995円<br>(当作成期既払分配金30円(税引前)) |
| 騰落率  | +10.1%<br>(分配金再投資ベース)         |

## 分配金再投資基準価額について

分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を分配時に再投資したと仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆さま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などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

※当ファンドはBBSW AUD 1Monthを参考指数としているため、基準価額等の推移のグラフに併記しておりません。

## 短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

### 基準価額の主な変動要因（2023年4月8日から2023年10月10日まで）

主として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実質的に投資することにより、安定した利息収益の確保を目指して運用を行いました。

#### 上昇要因

- 実質的に保有した債券からインカムゲインを得たこと
- 日銀のハト派（景気を重視する立場）的な姿勢などを背景に円安が進展し豪ドル高・円安となったこと

#### 下落要因

- 金利が上昇し、実質的に保有した債券のキャピタル要因がマイナスに寄与したこと

### 投資環境について（2023年4月8日から2023年10月10日まで）

運用期間におけるオーストラリアの債券市場は下落しました。また、為替市場では豪ドルに対して円安となりました。

#### 債券市場

運用期間を通じて、オーストラリアの債券市場は下落しました。当運用期間前半は、RBA（オーストラリア準備銀行）が利上げを継続したことや、前運用期間後半に発生した米国地銀の経営破綻を受けた金融不安への警戒感が後退したことなどから、金利は上昇しました。その後は、RBAが利上げを見送り経済指標を注視する姿勢を示したことなどから短期の金利については概ね横ばい圏で推移した一方で、長期の金利に

ついては米国における堅調な景気などを背景にグローバルに金利が上昇する中で上昇する動きとなりました。

#### 為替市場

運用期間の豪ドル円は、豪ドル高・円安となりました。RBAが運用期間前半に利上げを行い、その後も政策金利の水準を維持した一方で、日銀はハト派的な姿勢を継続したことなどから豪ドル高・円安が進展しました。

### ポートフォリオについて（2023年4月8日から2023年10月10日まで）

#### 当ファンド

主要投資対象である「短期豪ドル債マザーファンド」を運用期間を通じて高位に組み入れました。

#### 短期豪ドル債マザーファンド

ポートフォリオのデュレーション\*は、運用期間の初めは長めの水準で維持しました。オーストラリアにおいてインフレ率の高止まりに対する警戒感が高まる局面では、いったんデュレーションを引き下げました。その後、オーストラリアの経済指標の軟調さや中央銀行が利上げを停止し経済指標を

## 短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

注視する姿勢を示したことなどを考慮し、デュレーションを引き上げました。

社債比率は、高めを維持しました。利回り向上のため社債比率は高めを維持しつつ、新発債を組み入れ、残存が短くなり利回りが低下した銘柄を売却する入替えでポートフォリオの利回り上昇を図りました。

\*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。

### ベンチマークとの差異について(2023年4月8日から2023年10月10日まで)

当ファンドは運用の指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。

### 分配金について(2023年4月8日から2023年10月10日まで)

期間の1万口当たりの分配金(税引前)は、基準価額水準等を勘案し、以下の通りといたしました。

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いたします。

(単位：円、1万口当たり、税引前)

| 項目        | 第240期   | 第241期   | 第242期   | 第243期   | 第244期   | 第245期   |
|-----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 当期分配金     | 5       | 5       | 5       | 5       | 5       | 5       |
| (対基準価額比率) | (0.13%) | (0.13%) | (0.13%) | (0.13%) | (0.13%) | (0.13%) |
| 当期の収益     | 5       | 5       | 5       | 5       | 5       | 5       |
| 当期の収益以外   | -       | -       | -       | -       | -       | -       |
| 翌期繰越分配対象額 | 122     | 129     | 138     | 144     | 154     | 165     |

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。  
 ※「対基準価額比率」は、「当期分配金」(税引前)の期末基準価額(分配金(税引前)込み)に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

## 2 今後の運用方針

### 当ファンド

引き続き、運用の基本方針に基づき、「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に投資することにより、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

RBAは2023年10月の理事会で政策金利を据え置きました。RBAは足元では政策金利の据え置きを続けており、声明文では景気やインフレの動向次第で追加利上げを行う姿勢は維持しているものの、追加の利上げが行われる確率は高くないと考えています。オーストラリアにおけるタイトな労働市場を背景とした賃金上昇圧力などに対する警戒感は根強く残るものの、一方でインフレ指標には減速感が見られていることや、今までの累積的な利上げの影響が今後顕在化してくると考えられることなどから、オーストラリアの債券市場における金利上昇余地は小さいと考えており、デュレーションは長めの水準を基本とします。また、社債市場は、経済が底堅く推移する中で割安な銘柄を中心に堅調な推移を予想しており、社債比率は高めを維持する方針です。

## 3 お知らせ

### 約款変更について

該当事項はございません。



## 短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

### 1万口当たりの費用明細（2023年4月8日から2023年10月10日まで）

| 項目                 | 金額         | 比率            | 項目の概要   |
|--------------------|------------|---------------|---|
| <b>(a) 信託報酬</b>    | <b>20円</b> | <b>0.502%</b> | <b>信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数／年日数)</b><br><b>期中の平均基準価額は3,894円です。</b>    |
| （投信会社）             | (10)       | (0.246)       | 投信会社:ファンド運用の指図等の対価  |
| （販売会社）             | (9)        | (0.235)       | 販売会社:交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価                          |
| （受託会社）             | (1)        | (0.021)       | 受託会社:ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価                                    |
| <b>(b) 売買委託手数料</b> | <b>－</b>   | <b>－</b>      | <b>売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数</b><br>売買委託手数料:有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （株式）               | (－)        | (－)           |   |
| （先物・オプション）         | (－)        | (－)           |   |
| （投資信託証券）           | (－)        | (－)           |   |
| <b>(c) 有価証券取引税</b> | <b>－</b>   | <b>－</b>      | <b>有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数</b><br>有価証券取引税:有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| （株式）               | (－)        | (－)           |   |
| （公社債）              | (－)        | (－)           |   |
| （投資信託証券）           | (－)        | (－)           |   |
| <b>(d) その他費用</b>   | <b>1</b>   | <b>0.016</b>  | <b>その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数</b>  |
| （保管費用）             | (1)        | (0.015)       | 保管費用:海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用                      |
| （監査費用）             | (0)        | (0.000)       | 監査費用:監査法人に支払うファンドの監査費用  |
| （その他）              | (0)        | (0.000)       | その他:信託事務の処理等に要するその他費用   |
| <b>合計</b>          | <b>20</b>  | <b>0.518</b>  |   |

※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

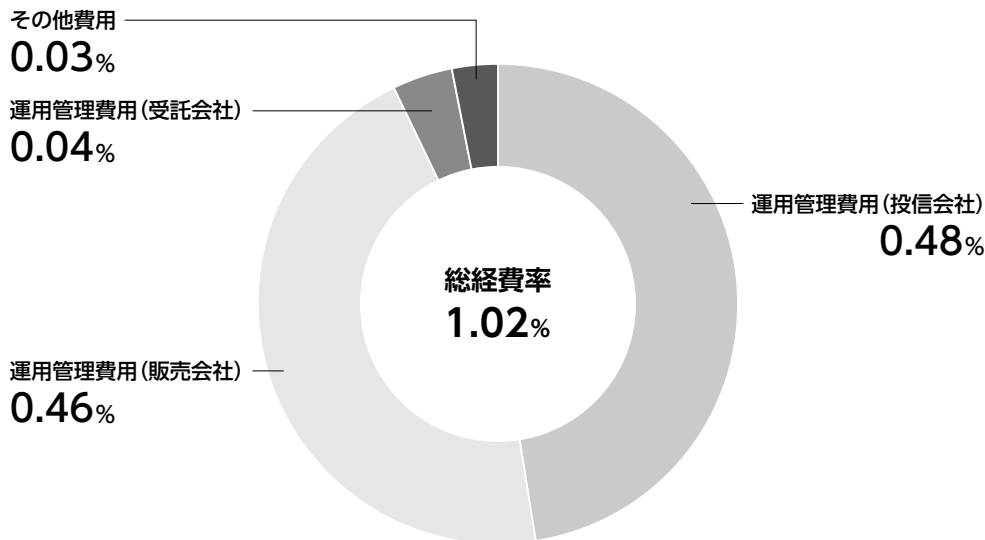
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。



## 参考情報 総経費率（年率換算）



※各費用は、前掲「1万口当たりの費用明細」において用いた簡便法により算出したもので、原則として、募集手数料、売買委託手数料およ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、「1万口当たりの費用明細」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、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率換算)は1.02%です。

## 短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

### ■ 当作成期中の売買及び取引の状況（2023年4月8日から2023年10月10日まで）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

|               | 当 作 成 期      |               |                 |                 |
|---------------|--------------|---------------|-----------------|-----------------|
|               | 設 定          |               | 解 約             |                 |
|               | 口 数          | 金 額           | 口 数             | 金 額             |
| 短期豪ドル債マザーファンド | 千口<br>46,663 | 千円<br>132,314 | 千口<br>3,197,620 | 千円<br>8,940,612 |

### ■ 利害関係人との取引状況等（2023年4月8日から2023年10月10日まで）

#### (1) 利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

#### (2) 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   | 当 作 成 期  |          |            |
|-------|----------|----------|------------|
|       | 買 付 額    | 売 付 額    | 作成期末保有額    |
| 公 社 債 | 百万円<br>- | 百万円<br>- | 百万円<br>553 |

利害関係人とは、投資信託およ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です。

### ■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

（2023年4月8日から2023年10月10日まで）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

### ■ 組入れ資産の明細（2023年10月10日現在）

親投資信託残高

| 種 類           | 作 成 期 首          |                  |                  | 作 成 期 末          |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
|               | 口 数              | 口 数              | 評 価 額            | 口 数              | 口 数              | 評 価 額            |
| 短期豪ドル債マザーファンド | 千口<br>35,722,902 | 千口<br>32,571,946 | 千円<br>93,680,174 | 千口<br>35,722,902 | 千口<br>32,571,946 | 千円<br>93,680,174 |

※短期豪ドル債マザーファンドの作成期末の受益権総口数は33,194,353,654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

（2023年10月10日現在）

| 項 目           | 作 成 期 末          |           |
|---------------|------------------|-----------|
|               | 評 価 額            | 比 率       |
| 短期豪ドル債マザーファンド | 千円<br>93,680,174 | %<br>99.7 |
| コール・ローン等、その他  | 282,733          | 0.3       |
| 投資信託財産総額      | 93,962,907       | 100.0     |

※短期豪ドル債マザーファンドにおいて、作成期末における外貨建資産（94,952,392千円）の投資信託財産総額（95,718,194千円）に対する比率は99.2%です。

※外貨建資産は、作成期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、作成期末における邦貨換算レートは、1オーストラリア・ドル=95.42円です。

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2023年5月8日）（2023年6月7日）（2023年7月7日）（2023年8月7日）（2023年9月7日）（2023年10月10日）

| 項 目                   | 第 240 期 末               | 第 241 期 末               | 第 242 期 末               | 第 243 期 末               | 第 244 期 末               | 第 245 期 末               |
|-----------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>(A) 資 産</b>        | <b>95,965,288,855円</b>  | <b>96,516,790,509円</b>  | <b>96,932,508,576円</b>  | <b>93,942,711,607円</b>  | <b>94,121,624,952円</b>  | <b>93,962,907,429円</b>  |
| コール・ローン等              | 41,702,278              | 41,253,029              | 44,326,985              | 41,839,154              | 42,985,168              | 43,066,923              |
| 短期豪ドル債マザーファンド(評価額)    | 95,662,484,706          | 96,256,171,035          | 96,614,777,252          | 93,644,276,556          | 93,835,719,888          | 93,680,174,011          |
| 未 収 入 金               | 261,101,871             | 219,366,445             | 273,404,339             | 256,595,897             | 242,919,896             | 239,666,495             |
| <b>(B) 負 債</b>        | <b>346,569,528</b>      | <b>273,120,585</b>      | <b>388,392,509</b>      | <b>322,775,659</b>      | <b>314,064,511</b>      | <b>302,120,394</b>      |
| 未払収益分配金               | 126,020,426             | 124,279,973             | 121,860,790             | 120,360,790             | 118,837,623             | 117,228,698             |
| 未払解約金                 | 141,030,882             | 71,232,955              | 186,540,262             | 121,475,159             | 115,177,588             | 99,740,158              |
| 未払信託報酬                | 79,283,358              | 77,145,582              | 79,302,142              | 80,015,565              | 78,890,326              | 83,742,787              |
| その他未払費用               | 234,862                 | 462,075                 | 689,315                 | 924,145                 | 1,158,974               | 1,408,751               |
| <b>(C) 純資産総額(A-B)</b> | <b>95,618,719,327</b>   | <b>96,243,669,924</b>   | <b>96,544,116,067</b>   | <b>93,619,935,948</b>   | <b>93,807,560,441</b>   | <b>93,660,787,035</b>   |
| 元 本                   | 252,040,852,143         | 248,559,947,264         | 243,721,581,299         | 240,721,581,678         | 237,675,247,662         | 234,457,396,292         |
| 次期繰越損益金               | △156,422,132,816        | △152,316,277,340        | △147,177,465,232        | △147,101,645,730        | △143,867,687,221        | △140,796,609,257        |
| <b>(D) 受益権総口数</b>     | <b>252,040,852,143口</b> | <b>248,559,947,264口</b> | <b>243,721,581,299口</b> | <b>240,721,581,678口</b> | <b>237,675,247,662口</b> | <b>234,457,396,292口</b> |
| 1万口当たり基準価額(C/D)       | 3,794円                  | 3,872円                  | 3,961円                  | 3,889円                  | 3,947円                  | 3,985円                  |

※当作成期における作成期首元本額254,037,541,193円、作成期中追加設定元本額1,193,632,194円、作成期中一部解約元本額20,773,777,095円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額（元本の欠損）となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

## 短期豪ドル債オープン（毎月分配型）

### ■ 損益の状況

〔自2023年4月8日〕〔自2023年5月9日〕〔自2023年6月8日〕〔自2023年7月8日〕〔自2023年8月8日〕〔自2023年9月8日〕  
〔至2023年5月8日〕〔至2023年6月7日〕〔至2023年7月7日〕〔至2023年8月7日〕〔至2023年9月7日〕〔至2023年10月10日〕

| 項 目                       | 第 240 期            | 第 241 期            | 第 242 期            | 第 243 期            | 第 244 期            | 第 245 期            |
|---------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| (A) 配 当 等 収 益             | △ 1,371円           | △ 2,311円           | △ 3,057円           | △ 2,360円           | △ 2,961円           | △ 2,528円           |
| 受 取 利 息                   | 1                  | 14                 | 156                | 59                 | 184                | 116                |
| 支 払 利 息                   | △ 1,372            | △ 2,325            | △ 3,213            | △ 2,419            | △ 3,145            | △ 2,644            |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益       | 3,650,537,413      | 2,146,727,634      | 2,367,303,809      | △ 1,535,145,140    | 1,570,140,717      | 1,324,293,106      |
| 売 買 益                     | 3,667,734,780      | 2,153,587,153      | 2,424,023,664      | 10,592,090         | 1,585,247,411      | 1,334,635,982      |
| 売 買 損                     | △ 17,197,367       | △ 6,859,519        | △ 56,719,855       | △ 1,545,737,230    | △ 15,106,694       | △ 10,342,876       |
| (C) 信 託 報 酬 等             | △ 79,518,205       | △ 77,372,873       | △ 79,529,485       | △ 80,250,495       | △ 79,125,310       | △ 83,992,820       |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 3,571,017,837      | 2,069,352,450      | 2,287,771,267      | △ 1,615,397,995    | 1,491,012,446      | 1,240,297,758      |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金         | △ 25,793,764,443   | △ 22,020,461,548   | △ 19,637,240,040   | △ 17,249,846,150   | △ 18,737,703,861   | △ 17,123,522,164   |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金       | △ 134,073,365,784  | △ 132,240,888,269  | △ 129,706,135,669  | △ 128,116,040,795  | △ 126,502,158,183  | △ 124,796,156,153  |
| (配当等相当額)                  | ( 2,090,818,849)   | ( 2,062,892,902)   | ( 2,025,686,776)   | ( 2,001,854,172)   | ( 1,977,210,050)   | ( 1,951,222,135)   |
| (売買損益相当額)                 | (△136,164,184,633) | (△134,303,781,171) | (△131,731,822,445) | (△130,117,894,967) | (△128,479,368,233) | (△126,747,378,288) |
| (G) 合 計 (D + E + F)       | △ 156,296,112,390  | △ 152,191,997,367  | △ 147,055,604,442  | △ 146,981,284,940  | △ 143,748,849,598  | △ 140,679,380,559  |
| (H) 収 益 分 配 金             | △ 126,020,426      | △ 124,279,973      | △ 121,860,790      | △ 120,360,790      | △ 118,837,623      | △ 117,228,698      |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)     | △ 156,422,132,816  | △ 152,316,277,340  | △ 147,177,465,232  | △ 147,101,645,730  | △ 143,867,687,221  | △ 140,796,609,257  |
| 追 加 信 託 差 損 益 金           | △ 134,073,365,784  | △ 132,240,888,269  | △ 129,706,135,669  | △ 128,116,040,795  | △ 126,502,158,183  | △ 124,796,156,153  |
| (配当等相当額)                  | ( 2,090,896,372)   | ( 2,063,105,214)   | ( 2,026,301,919)   | ( 2,001,945,824)   | ( 1,977,319,331)   | ( 1,951,322,691)   |
| (売買損益相当額)                 | (△136,164,262,156) | (△134,303,993,483) | (△131,732,437,588) | (△130,117,986,619) | (△128,479,477,514) | (△126,747,478,844) |
| 分 配 準 備 積 立 金             | 994,408,743        | 1,162,265,326      | 1,344,914,077      | 1,487,437,846      | 1,696,064,687      | 1,919,752,945      |
| 繰 越 損 益 金                 | △ 23,343,175,775   | △ 21,237,654,397   | △ 18,816,243,640   | △ 20,473,042,781   | △ 19,061,593,725   | △ 17,920,206,049   |

※有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※分配金の計算過程は以下の通りです。

|                       | 第 240 期       | 第 241 期       | 第 242 期       | 第 243 期       | 第 244 期       | 第 245 期       |
|-----------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益       | 308,102,500円  | 306,744,514円  | 329,876,193円  | 279,933,988円  | 346,886,415円  | 364,553,397円  |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益   | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             | 0             |
| (c) 収益調整金             | 2,090,896,372 | 2,063,105,214 | 2,026,301,919 | 2,001,945,824 | 1,977,319,331 | 1,951,322,691 |
| (d) 分配準備積立金           | 812,326,669   | 979,800,785   | 1,136,898,674 | 1,327,864,648 | 1,468,015,895 | 1,672,428,246 |
| (e) 当期分配対象額 (a+b+c+d) | 3,211,325,541 | 3,349,650,513 | 3,493,076,786 | 3,609,744,460 | 3,792,221,641 | 3,988,304,334 |
| 1万口当たり当期分配対象額         | 127.41        | 134.76        | 143.32        | 149.96        | 159.55        | 170.11        |
| (f) 分配金               | 126,020,426   | 124,279,973   | 121,860,790   | 120,360,790   | 118,837,623   | 117,228,698   |
| 1万口当たり分配金             | 5             | 5             | 5             | 5             | 5             | 5             |

### ■ 分配金のお知らせ

| 1万口当たり分配金（税引前） | 第240期 | 第241期 | 第242期 | 第243期 | 第244期 | 第245期 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
|                | 5円    | 5円    | 5円    | 5円    | 5円    | 5円    |

※分配金は、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「普通分配金」となり課税されます。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が「元本払戻金（特別分配金）」となり非課税、残りの部分が「普通分配金」となります。

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

# 短期豪ドル債マザーファンド

第41期（2023年4月8日から2023年10月10日まで）

|      |   |
|------|---|
| 信託期間 | 無期限（設定日：2003年4月18日）   |
| 運用方針 | <ul style="list-style-type: none"> <li>■ オーストラリア・ドル（豪ドル）通貨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を目指して運用します。</li> <li>■ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</li> </ul> |

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

## ■ 最近5期の運用実績

| 決 算 期            | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | (参考指数)<br>BBSW AUD 1Month | 公 社 債 率 | 純 資 産 額 |
|------------------|---------|-------|---------------------------|---------|---------|
|                  |         |       |                           |         |         |
| 37期（2021年10月7日）  | 円       | △ 3.2 | 0.0100                    | %       | 百万円     |
| 38期（2022年4月7日）   | 23,767  | 12.6  | 0.0200                    | 97.8    | 116,266 |
| 39期（2022年10月7日）  | 26,756  | 0.2   | 2.6386                    | 98.0    | 116,554 |
| 40期（2023年4月7日）   | 26,812  | △ 3.0 | 3.5932                    | 98.2    | 104,826 |
| 41期（2023年10月10日） | 25,998  | 10.6  | 4.0513                    | 95.1    | 94,633  |
|                  | 28,761  |       |                           | 98.1    | 95,469  |

※外国の指数は基準価額への反映を考慮した日付の値を使用しています。

## ■ 当期中の基準価額と市況等の推移

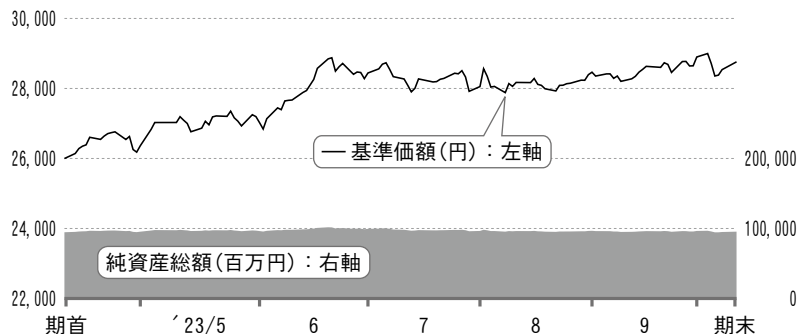
| 年 月 日                | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | (参考指数)<br>BBSW AUD 1Month | 公 社 債 率 |
|----------------------|---------|-------|---------------------------|---------|
|                      |         |       |                           |         |
| (期 首)<br>2023年4月7日   | 円       | %     |                           | %       |
|                      | 25,998  | —     | 3.5932                    | 95.1    |
| 4月末                  | 26,364  | 1.4   | 3.6058                    | 96.6    |
| 5月末                  | 27,023  | 3.9   | 3.8253                    | 98.9    |
| 6月末                  | 28,442  | 9.4   | 4.1168                    | 97.3    |
| 7月末                  | 28,054  | 7.9   | 4.1124                    | 98.0    |
| 8月末                  | 28,465  | 9.5   | 4.0550                    | 97.7    |
| 9月末                  | 28,899  | 11.2  | 4.0550                    | 97.7    |
| (期 末)<br>2023年10月10日 |         |       |                           |         |
|                      | 28,761  | 10.6  | 4.0513                    | 98.1    |

※騰落率は期首比です。

# 1 運用経過

## ▶ 基準価額等の推移について（2023年4月8日から2023年10月10日まで）

### 基準価額等の推移



|     |         |
|-----|---------|
| 期首  | 25,998円 |
| 期末  | 28,761円 |
| 騰落率 | +10.6%  |

※当ファンドはBBSW AUD 1Monthを参考指数としているため、基準価額等の推移のグラフに併記していません。

## ▶ 基準価額の主な変動要因（2023年4月8日から2023年10月10日まで）

オーストラリア・ドル（豪ドル）通貨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、安定した利息収益の確保を目指して運用を行いました。

|      |  |
|------|--|
| 上昇要因 | <ul style="list-style-type: none"> <li>・保有した債券からインカムゲインを得たこと</li> <li>・日銀のハト派（景気を重視する立場）的な姿勢などを背景に円安が進展し豪ドル高・円安となったこと</li> </ul> |
| 下落要因 | <ul style="list-style-type: none"> <li>・金利が上昇し、保有した債券のキャピタル要因がマイナス寄与したこと</li> </ul>  |

### ▶ 投資環境について（2023年4月8日から2023年10月10日まで）

運用期間におけるオーストラリアの債券市場は下落しました。また、為替市場では豪ドルに対して円安となりました。

#### 債券市場

運用期間を通じて、オーストラリアの債券市場は下落しました。当運用期間前半は、RBA（オーストラリア準備銀行）が利上げを継続したことや、前運用期間後半に発生した米国地銀の経営破綻を受けた金融不安への警戒感が後退したことなどから、金利は上昇しました。その後は、RBAが利上げを見送り経済指標を注視する姿勢を示したことなどから短期の金利については概ね横ばい圏で推移した一方で、長期の金利については米国における堅調な景気などを背景にグローバルに金利が上昇する中で上昇する動きとなりました。

#### 為替市場

運用期間の豪ドル円は、豪ドル高・円安となりました。RBAが運用期間前半に利上げを行い、その後も政策金利の水準を維持した一方で、日銀はハト派的な姿勢を継続したことなどから豪ドル高・円安が進展しました。

### ▶ ポートフォリオについて（2023年4月8日から2023年10月10日まで）

ポートフォリオのデュレーション\*は、運用期間の初めは長めの水準で維持しました。オーストラリアにおいてインフレ率の高止まりに対する警戒感が高まる局面では、いったんデュレーションを引き下げました。その後、オーストラリアの経済指標の軟調さや中央銀行が利上げを停止し経済指標を注視する姿勢を示したことなどを考慮し、デュレーションを引き上げました。

社債比率は、高めを維持しました。利回り向上のため社債比率は高めを維持しつつ、新発債を組み入れ、残存が短くなり利回りが低下した銘柄を売却する入替えてポートフォリオの利回り上昇を図りました。

\*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。



---

▶ **ベンチマークとの差異について（2023年4月8日から2023年10月10日まで）**

---

当ファンドは運用の指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。

## **2 今後の運用方針**

RBAは2023年10月の理事会で政策金利を据え置きました。RBAは足元では政策金利の据え置きを続けており、声明文では景気やインフレの動向次第で追加利上げを行う姿勢は維持しているものの、追加の利上げが行われる確率は高くないと考えています。オーストラリアにおけるタイトな労働市場を背景とした賃金上昇圧力などに対する警戒感は根強く残るものの、一方でインフレ指標には減速感が見られていることや、今までの累積的な利上げの影響が今後顕在化してくると考えられることなどから、オーストラリアの債券市場における金利上昇余地は小さいと考えており、デュレーションは長めの水準を基本とします。また、社債市場は、経済が底堅く推移する中で割安な銘柄を中心に堅調な推移を予想しており、社債比率は高めを維持する方針です。

## 短期豪ドル債マザーファンド

### ■ 1万口当たりの費用明細 (2023年4月8日から2023年10月10日まで)

| 項目                  | 金額        | 比率                | 項目の概要  |
|---------------------|-----------|-------------------|--|
| (a) その他費用<br>(保管費用) | 4円<br>(4) | 0.015%<br>(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<br>保管費用：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送入金・資産の移転等に要する費用<br>その他：信託事務の処理等に要するその他費用 |
| (その他)               | (0)       | (0.000)           |  |
| 合計                  | 4         | 0.015             |  |

期中の平均基準価額は27,877円です。

※期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当た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。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

### ■ 当期中の売買及び取引の状況 (2023年4月8日から2023年10月10日まで)

#### 公社債

|    |         | 買付額                   | 売付額                               |
|----|---------|-----------------------|-----------------------------------|
| 外国 | オーストラリア | 千オーストラリア・ドル<br>23,798 | 千オーストラリア・ドル<br>14,062<br>(47,000) |
|    |         | 社債券<br>111,927        | 72,494<br>(42,000)                |

※金額は受渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

※（ ）内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

※社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

### ■ 利害関係人との取引状況等 (2023年4月8日から2023年10月10日まで)

#### (1) 利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引等はありません。

#### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種類  | 買付額      | 売付額      | 期末保有額      |
|-----|----------|----------|------------|
| 公社債 | 百万円<br>— | 百万円<br>— | 百万円<br>553 |

利害関係人とは、投資信託およ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、当期中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です。

### ■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

(2023年4月8日から2023年10月10日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

## 短期豪ドル債マザーファンド

### ■ 組入れ資産の明細 (2023年10月10日現在)

公社債

A 債券種類別開示

外国 (外貨建) 公社債

| 区 分     | 期                      |                        |                  |           | 末                  |                   |           |           |
|---------|------------------------|------------------------|------------------|-----------|--------------------|-------------------|-----------|-----------|
|         | 額 面 金 額                | 評 価 額                  |                  | 組 入 比 率   | うちBB格以下<br>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<br>990,710 | 千オーストラリア・ドル<br>981,903 | 千円<br>93,693,231 | %<br>98.1 | %<br>-             | %<br>8.6          | %<br>58.0 | %<br>31.5 |
| 合 計     | -                      | -                      | 93,693,231       | 98.1      | -                  | 8.6               | 58.0      | 31.5      |

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本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。

※組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

B 個別銘柄開示

外国 (外貨建) 公社債

| 区 分     | 銘 柄                      | 種 類     | 期      |                       |                      |               | 末          |  |
|---------|--------------------------|---------|--------|-----------------------|----------------------|---------------|------------|--|
|         |                          |         | 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 | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 国 債 証 券 | 0.2500 | 千オーストラリア・ドル<br>10,000 | 千オーストラリア・ドル<br>9,581 | 千円<br>914,295 | 2024/11/21 |  |
|         | CORP ANDINA DE FOMENTO   | 特 殊 債 券 | 3.4000 | 10,000                | 9,992                | 953,436       | 2023/10/26 |  |
|         | CORP ANDINA DE FOMENTO   | 特 殊 債 券 | 6.2500 | 5,000                 | 5,002                | 477,357       | 2023/11/08 |  |
|         | EXPORT DEVELOPMNT CANADA | 特 殊 債 券 | 4.5000 | 10,000                | 9,916                | 946,261       | 2028/09/06 |  |
|         | WESTERN AUST TREAS CORP  | 特 殊 債 券 | 4.3843 | 17,000                | 17,018               | 1,623,875     | 2024/02/21 |  |
|         | SOUTH AUST GOVT FIN AUTH | 特 殊 債 券 | 4.2400 | 10,000                | 9,994                | 953,656       | 2025/06/10 |  |
|         | SOUTH AUST GOVT FIN AUTH | 特 殊 債 券 | 4.3800 | 10,000                | 9,999                | 954,142       | 2027/06/15 |  |
|         | NEW S WALES TREASURY CRP | 特 殊 債 券 | 4.3250 | 10,000                | 10,041               | 958,188       | 2028/05/26 |  |
|         | TREASURY CORP VICTORIA   | 特 殊 債 券 | 4.5371 | 10,000                | 10,052               | 959,209       | 2025/04/02 |  |
|         | QUEENSLAND TREASURY CORP | 特 殊 債 券 | 4.3883 | 10,000                | 10,013               | 955,450       | 2027/04/15 |  |
|         | EXPORT FIN & INS CORP    | 特 殊 債 券 | 0.5150 | 19,000                | 18,790               | 1,793,019     | 2024/01/29 |  |
|         | INTL FINANCE CORP        | 特 殊 債 券 | 3.1500 | 10,000                | 9,165                | 874,600       | 2029/06/26 |  |
|         | INTL FINANCE CORP        | 特 殊 債 券 | 3.6000 | 10,000                | 9,804                | 935,545       | 2026/02/24 |  |
|         | ASIAN DEVELOPMENT BANK   | 特 殊 債 券 | 3.9000 | 10,000                | 9,874                | 942,243       | 2026/02/17 |  |
|         | INTER-AMERICAN DEVEL BK  | 特 殊 債 券 | 1.9500 | 10,000                | 9,877                | 942,530       | 2024/04/23 |  |
|         | KIWI BANK LTD            | 特 殊 債 券 | 4.8388 | 30,510                | 30,447               | 2,905,296     | 2025/09/23 |  |
|         | CPPIB CAPITAL INC        | 特 殊 債 券 | 4.4500 | 8,000                 | 7,918                | 755,611       | 2027/09/01 |  |
|         | NATIONL HOUSING FIN INVT | 特 殊 債 券 | 4.3371 | 14,000                | 14,035               | 1,339,286     | 2031/07/01 |  |
|         | SWEDISH EXPORT CREDIT    | 特 殊 債 券 | 4.3000 | 5,000                 | 4,856                | 463,450       | 2028/05/30 |  |
|         | AIRSERVICES AUSTRALIA    | 特 殊 債 券 | 5.4000 | 10,000                | 10,240               | 977,100       | 2028/11/15 |  |
|         | MET LIFE GLOB FUNDING I  | 社 債 券   | 4.6335 | 24,000                | 23,697               | 2,261,179     | 2025/12/01 |  |
|         | JPMORGAN CHASE & CO      | 社 債 券   | 5.2720 | 20,000                | 20,001               | 1,908,495     | 2024/11/22 |  |
|         | BANK OF MONTREAL         | 社 債 券   | 5.2983 | 20,000                | 20,051               | 1,913,266     | 2024/07/17 |  |

## 短期豪ドル債マザーファンド

| 区 分 | 銘 柄                      | 種 類   | 期 末    |         |           |             |            |
|-----|--------------------------|-------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
|     |                          |       | 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 |            |
|     | BANK OF MONTREAL/TORONTO | 社 債 券 | 5.1569 | 9,000   | 9,040     | 862,653     | 2025/10/31 |
|     | BANK OF NOVA SCOTIA      | 社 債 券 | 5.1670 | 20,000  | 19,768    | 1,886,319   | 2027/01/20 |
|     | BANK OF NOVA SCOTIA/TOR  | 社 債 券 | 5.1759 | 5,000   | 5,023     | 479,332     | 2025/10/27 |
|     | ROYAL BANK OF CANADA/SYD | 社 債 券 | 4.5000 | 14,000  | 13,706    | 1,307,839   | 2027/07/13 |
|     | ROYAL BANK OF CANADA/SYD | 社 債 券 | 4.8700 | 18,000  | 17,995    | 1,717,096   | 2026/06/30 |
|     | TORONTO-DOMINION BANK    | 社 債 券 | 4.7694 | 30,000  | 29,686    | 2,832,685   | 2026/03/17 |
|     | CREDIT AGRICOLE SA       | 社 債 券 | 5.7335 | 9,000   | 9,083     | 866,766     | 2028/06/01 |
|     | BPCE SA                  | 社 債 券 | 5.0770 | 20,000  | 19,747    | 1,884,315   | 2026/04/20 |
|     | BPCE SA                  | 社 債 券 | 5.2018 | 10,000  | 9,944     | 948,904     | 2025/09/29 |
|     | SOCIETE GENERALE SYDNEY  | 社 債 券 | 5.1250 | 20,000  | 19,772    | 1,886,663   | 2027/03/03 |
|     | BNP PARIBAS              | 社 債 券 | 5.8335 | 10,000  | 10,061    | 960,077     | 2029/06/01 |
|     | RABOBANK UA/AU           | 社 債 券 | 5.4650 | 7,500   | 7,562     | 721,639     | 2028/01/19 |
|     | NATIONWIDE BLDG SOCIETY  | 社 債 券 | 5.3500 | 14,000  | 13,786    | 1,315,534   | 2028/03/15 |
|     | SVENSKA HANDELSBANKEN AB | 社 債 券 | 5.0000 | 7,000   | 6,917     | 660,051     | 2028/03/02 |
|     | BANCO SANTANDER SA       | 社 債 券 | 5.1483 | 19,000  | 18,662    | 1,780,781   | 2026/07/15 |
|     | BANCO SANTANDER SA       | 社 債 券 | 5.6780 | 14,000  | 13,889    | 1,325,379   | 2028/03/09 |
|     | TOYOTA FINANCE AUSTRALIA | 社 債 券 | 4.5570 | 10,000  | 9,975     | 951,881     | 2024/09/09 |
|     | MUFG BANK LTD SYDNEY     | 社 債 券 | 4.6156 | 14,000  | 13,989    | 1,334,864   | 2024/09/26 |
|     | DBS BANK LTD             | 社 債 券 | 4.8356 | 7,000   | 6,994     | 667,425     | 2026/06/26 |
|     | OCBC/SYDNEY              | 社 債 券 | 4.9891 | 8,000   | 8,008     | 764,138     | 2025/04/14 |
|     | NATIONAL AUSTRALIA BANK  | 社 債 券 | 4.5472 | 7,000   | 6,934     | 661,728     | 2026/08/24 |
|     | NATIONAL AUSTRALIA BANK  | 社 債 券 | 4.8570 | 16,000  | 15,950    | 1,522,017   | 2027/02/25 |
|     | NATIONAL AUSTRALIA BANK  | 社 債 券 | 5.3370 | 12,000  | 12,141    | 1,158,562   | 2027/11/25 |
|     | AUST & NZ BANKING GROUP  | 社 債 券 | 5.3899 | 13,000  | 13,161    | 1,255,866   | 2027/11/04 |
|     | COMMONWEALTH BANK AUST   | 社 債 券 | 4.9891 | 24,000  | 23,928    | 2,283,255   | 2027/01/14 |
|     | COMMONWEALTH BANK AUST   | 社 債 券 | 4.9000 | 7,000   | 6,918     | 660,178     | 2028/08/17 |
|     | WESTPAC BANKING CORP     | 社 債 券 | 5.0546 | 23,000  | 22,925    | 2,187,527   | 2027/01/25 |
|     | WESTPAC BANKING CORP     | 社 債 券 | 5.3979 | 9,000   | 9,118     | 870,124     | 2027/11/11 |
|     | SUNCORP-METWAY LTD       | 社 債 券 | 5.1346 | 19,000  | 18,881    | 1,801,667   | 2027/01/25 |
|     | SUNCORP-METWAY LTD       | 社 債 券 | 5.1783 | 4,000   | 4,011     | 382,775     | 2025/10/17 |
|     | SUNCORP-METWAY LTD       | 社 債 券 | 5.3725 | 5,500   | 5,538     | 528,504     | 2027/12/14 |
|     | SUNCORP-METWAY LTD       | 社 債 券 | 4.5000 | 7,000   | 6,891     | 657,540     | 2026/05/18 |
|     | CIBC SYDNEY              | 社 債 券 | 4.4925 | 18,000  | 17,785    | 1,697,121   | 2026/09/14 |
|     | CIBC SYDNEY              | 社 債 券 | 5.1579 | 13,000  | 13,015    | 1,241,985   | 2026/04/21 |
|     | MACQUARIE BANK LTD       | 社 債 券 | 5.0080 | 10,000  | 10,023    | 956,451     | 2025/02/12 |
|     | MACQUARIE BANK LTD       | 社 債 券 | 4.6070 | 10,000  | 9,940     | 948,532     | 2025/12/09 |
|     | MACQUARIE BANK LTD       | 社 債 券 | 4.9725 | 8,000   | 7,998     | 763,199     | 2026/09/14 |
|     | CENTRAL NIPPON EXPRESSWY | 社 債 券 | 1.0600 | 15,000  | 13,858    | 1,322,406   | 2025/08/01 |
|     | APPLE INC                | 社 債 券 | 3.3500 | 10,000  | 9,973     | 951,642     | 2024/01/10 |
|     | SUMITOMO MITSUI SYD      | 社 債 券 | 4.9943 | 5,800   | 5,802     | 553,685     | 2026/02/20 |
|     | MITSUBISHI UFJ FIN GRP   | 社 債 券 | 5.4071 | 15,800  | 15,836    | 1,511,163   | 2024/10/01 |

## 短期豪ドル債マザーファンド

| 区 分 | 銘 柄                      | 種 類   | 期 末    |         |           |             |            |
|-----|--------------------------|-------|--------|---------|-----------|-------------|------------|
|     |                          |       | 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 |            |
|     | MITSUBISHI UFJ FIN GRP   | 社 債 券 | 2.0777 | 10,600  | 10,265    | 979,490     | 2024/10/01 |
|     | OPTUS FINANCE PTY LTD    | 社 債 券 | 1.6000 | 3,000   | 2,839     | 270,939     | 2025/07/01 |
|     | OPTUS FINANCE PTY LTD    | 社 債 券 | 2.6000 | 17,000  | 14,912    | 1,422,989   | 2028/11/24 |
|     | HSBC LTD/SYDNEY          | 社 債 券 | 5.2370 | 20,000  | 20,097    | 1,917,712   | 2027/08/25 |
|     | DBS GROUP HOLDINGS LTD   | 社 債 券 | 6.0394 | 26,000  | 25,999    | 2,480,895   | 2031/04/08 |
|     | BANK OF QUEENSLAND LTD   | 社 債 券 | 5.3780 | 12,000  | 12,038    | 1,148,749   | 2028/05/09 |
|     | CITIBANK NA SYDNEY       | 社 債 券 | 5.0480 | 10,000  | 10,022    | 956,356     | 2024/11/14 |
|     | VICTORIA POWER NETWORKS  | 社 債 券 | 5.1579 | 25,000  | 24,760    | 2,362,623   | 2026/04/21 |
|     | MERCEDES-BENZ AUSTRALIA  | 社 債 券 | 4.6500 | 15,000  | 14,892    | 1,421,051   | 2026/06/05 |
|     | ING BANK (AUSTRALIA) LTD | 社 債 券 | 4.0000 | 20,000  | 19,725    | 1,882,235   | 2025/05/26 |
|     | TRANSPower NEW ZEALAND   | 社 債 券 | 4.9770 | 2,000   | 2,006     | 191,477     | 2028/11/29 |
|     | PACCAR FINANCIAL PTY LTD | 社 債 券 | 4.0500 | 20,000  | 19,712    | 1,880,919   | 2025/06/02 |
|     | 小 計                      |       | —      | 990,710 | 981,903   | 93,693,231  | —          |
|     | 合 計                      |       | —      | —       | —         | 93,693,231  | —          |

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本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

(2023年10月10日現在)

| 項 目                     | 期 末        |       |
|-------------------------|------------|-------|
|                         | 評 価 額      | 比 率   |
| 公 社 債                   | 千円         | %     |
|                         | 93,693,231 | 97.9  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 2,024,963  | 2.1   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 95,718,194 | 100.0 |

※期末における外貨建資産（94,952,392千円）の投資信託財産総額（95,718,194千円）に対する比率は99.2%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは、1 オーストラリア・ドル=95.42円です。

## 短期豪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

(2023年10月10日現在)

| 項 目             | 期 末             |
|-----------------|-----------------|
| (A) 資 産         | 95,718,194,794円 |
| コール・ローン等        | 1,329,678,231   |
| 公社債(評価額)        | 93,693,231,159  |
| 未収利息            | 692,661,354     |
| 前払費用            | 2,624,050       |
| (B) 負 債         | 248,973,129     |
| 未払解約金           | 248,970,652     |
| その他未払費用         | 2,477           |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 95,469,221,665  |
| 元 本             | 33,194,353,654  |
| 次期繰越損益金         | 62,274,868,011  |
| (D) 受益権総口数      | 33,194,353,654口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 28,761円         |

※当期における期首元本額36,400,613,264円、期中追加設定元本額54,039,194円、期中一部解約元本額3,260,298,804円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※期末における元本の内訳は以下の通りです。

|                    |                 |
|--------------------|-----------------|
| 短期豪ドル債オープン(毎月分配型)  | 32,571,946,042円 |
| 短期豪ドル債オープン(年2回決算型) | 622,407,612円    |

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

### ■ お知らせ

<約款変更について>

該当事項はございません。

### ■ 損益の状況

(自2023年4月8日 至2023年10月10日)

| 項 目                  | 当 期             |
|----------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益        | 2,173,085,562円  |
| 受 取 利 息              | 2,173,253,313   |
| 支 払 利 息              | △ 167,751       |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益  | 7,641,773,863   |
| 売 買 益                | 8,149,221,869   |
| 売 買 損                | △ 507,448,006   |
| (C) そ の 他 費 用 等      | △ 14,750,310    |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 9,800,109,115   |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金    | 58,232,728,682  |
| (F) 解 約 差 損 益 金      | △ 5,856,221,671 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金  | 98,251,885      |
| (H) 合 計(D+E+F+G)     | 62,274,868,011  |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H)     | 62,274,868,011  |

※有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。