

【償還】

運用報告書(全体版)

大阪・兵庫応援外国債券オープン (愛称 まごころ応援団)

第115期(決算日 2021年2月22日) 第118期(決算日 2021年5月20日)
第116期(決算日 2021年3月22日) 第119期(決算日 2021年6月21日)
第117期(決算日 2021年4月20日) 第120期(償還日 2021年7月20日)

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。
皆様の「大阪・兵庫応援外国債券オープン(愛称 まごころ応援団)」は、2021年7月20日をもちまして信託約款の規定に基づき、償還となりました。ここに設定以来の運用経過及び償還内容のご報告をいたしますとともに、皆様のご愛顧に対し改めてお礼申し上げます。
今後とも、弊社ファンドに対しまして、一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

岡三アセットマネジメント

〒104-0031 東京都中央区京橋2-2-1

お問い合わせは弊社営業部 セールスサポートグループへ
フリーダイヤル ☎ 0120-048-214 (営業日の9:00~17:00)

[ホームページ]

<https://www.okasan-am.jp>

※アクセスにかかる通信料はお客様のご負担となります。

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	2011年7月28日から2021年7月20日までです。	
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、実質的にアジア・オセアニア地域の債券に投資し、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要投資対象	当ファンド	アジア・ニュージーランド債券マザーファンドおよびLM・オーストラリア債券ファンド(適格機関投資家専用)を主要投資対象とします。
	アジア・ニュージーランド債券マザーファンド	アジア諸国・ニュージーランドの現地通貨建ソブリン債等を主要投資対象とします。
	LM・オーストラリア債券ファンド(適格機関投資家専用)	豪ドル建の公社債を主要投資対象とします。
投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行いません。	
分配方針	毎月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として、以下の方針に基づき、収益分配を行います。 分配対象収益の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 繰越分を含めた配当等収益には、マザーファンドの配当等収益のうち、投資信託財産に帰属すべき配当等収益を含むものとします。 分配金額は、委託会社が分配可能額、基準価額水準等を勘案のうえ決定します。分配可能額が少額の場合や基準価額水準によっては、収益分配を行わないことがあります。	

○設定以来の運用実績

決算期	基 準 (分配落)	価 額			アジア・ニュージ ランド債券マザー ファンド組入比率	LM・オーストラリア 債券ファンド(適格機関 投資家専用)組入比率	純 資 産 額
		税 分	込 配	期 騰 落			
(設定日)	円 銭		円		%	%	百万円
2011年7月28日	10,000		—		—	—	134
1期(2011年8月22日)	9,549		—	△ 4.5	17.1	76.9	159
2期(2011年9月20日)	9,386		—	△ 1.7	17.3	73.7	215
3期(2011年10月20日)	9,410		—	0.3	15.5	77.3	241
4期(2011年11月21日)	9,173		100	△ 1.5	15.8	74.0	541
5期(2011年12月20日)	9,183		100	1.2	17.9	72.4	853
6期(2012年1月20日)	9,374		100	3.2	17.2	79.4	1,124
7期(2012年2月20日)	9,850		100	6.1	16.5	79.4	1,364
8期(2012年3月21日)	9,951		100	2.0	16.5	80.0	1,505
9期(2012年4月20日)	9,639		100	△ 2.1	17.3	77.7	1,531
10期(2012年5月21日)	9,076		100	△ 4.8	16.9	79.4	1,538
11期(2012年6月20日)	9,228		100	2.8	17.2	79.7	1,702
12期(2012年7月20日)	9,342		100	2.3	16.4	79.2	1,916
13期(2012年8月20日)	9,258		100	0.2	17.3	79.4	2,011
14期(2012年9月20日)	9,160		100	0.0	16.8	80.1	2,076
15期(2012年10月22日)	9,131		100	0.8	16.8	80.0	2,206
16期(2012年11月20日)	9,344		100	3.4	17.8	78.8	2,380
17期(2012年12月20日)	9,590		100	3.7	16.6	80.7	2,540
18期(2013年1月21日)	10,159		100	7.0	18.3	79.5	2,770
19期(2013年2月20日)	10,311		100	2.5	18.0	78.7	2,893
20期(2013年3月21日)	10,448		100	2.3	18.1	80.1	2,941
21期(2013年4月22日)	10,821		100	4.5	17.7	80.0	3,065
22期(2013年5月20日)	10,652		100	△ 0.6	17.4	80.0	3,001
23期(2013年6月20日)	9,396		100	△10.9	17.5	80.1	2,663
24期(2013年7月22日)	9,497		100	2.1	17.4	80.5	2,723
25期(2013年8月20日)	9,030		100	△ 3.9	17.3	80.7	2,613
26期(2013年9月20日)	9,387		100	5.1	16.8	80.1	2,751
27期(2013年10月21日)	9,335		100	0.5	16.6	81.0	2,786
28期(2013年11月20日)	9,237		100	0.0	16.8	81.5	2,764
29期(2013年12月20日)	9,030		100	△ 1.2	16.9	81.0	2,719
30期(2014年1月20日)	8,889		100	△ 0.5	17.2	80.7	2,683
31期(2014年2月20日)	8,857		100	0.8	16.6	80.9	2,654
32期(2014年3月20日)	8,837		100	0.9	17.2	80.5	2,639

大阪・兵庫応援外国債券オープン（愛称 まごころ応援団）

決算期	基準価額 (分配落)	税分		期騰落	中率	アジア・ニュージーランド債券マザーファンド組入比率	LM・オーストラリア債券ファンド（適格機関投資家専用）組入比率	純資産総額
		込	み					
	円 銭	円	金		%	%	%	百万円
33期(2014年4月21日)	9,081		100		3.9	16.7	81.4	2,691
34期(2014年5月20日)	8,966		100	△	0.2	17.0	81.1	2,646
35期(2014年6月20日)	8,996		100		1.4	16.6	81.2	2,660
36期(2014年7月22日)	8,923		100		0.3	17.1	80.3	2,657
37期(2014年8月20日)	8,895		100		0.8	16.9	81.1	2,653
38期(2014年9月22日)	8,899		100		1.2	17.0	80.6	2,651
39期(2014年10月20日)	8,598		100	△	2.3	17.1	80.6	2,559
40期(2014年11月20日)	9,218		100		8.4	17.3	81.0	2,697
41期(2014年12月22日)	8,903		100	△	2.3	16.6	80.9	2,513
42期(2015年1月20日)	8,819		100		0.2	16.6	80.9	2,448
43期(2015年2月20日)	8,475		100	△	2.8	16.7	81.4	2,307
44期(2015年3月20日)	8,408		100		0.4	17.0	80.8	2,261
45期(2015年4月20日)	8,372		100		0.8	16.5	81.5	2,188
46期(2015年5月20日)	8,310		100		0.5	16.6	81.7	2,144
47期(2015年6月22日)	8,174		100	△	0.4	16.9	81.7	2,002
48期(2015年7月21日)	7,818		100	△	3.1	17.2	81.3	1,844
49期(2015年8月20日)	7,697		100	△	0.3	17.0	81.6	1,740
50期(2015年9月24日)	7,026		100	△	7.4	16.3	80.1	1,486
51期(2015年10月20日)	7,204		100		4.0	17.1	81.6	1,519
52期(2015年11月20日)	7,155		100		0.7	15.8	82.2	1,456
53期(2015年12月21日)	6,978		100	△	1.1	16.5	81.9	1,392
54期(2016年1月20日)	6,491		100	△	5.5	16.5	79.9	1,266
55期(2016年2月22日)	6,413		100		0.3	15.6	81.2	1,217
56期(2016年3月22日)	6,572		100		4.0	16.6	79.7	1,241
57期(2016年4月20日)	6,516		100		0.7	17.0	80.6	1,216
58期(2016年5月20日)	6,119		100	△	4.6	16.5	80.8	1,012
59期(2016年6月20日)	5,927		100	△	1.5	17.1	80.9	899
60期(2016年7月20日)	6,049		50		2.9	16.3	80.4	849
61期(2016年8月22日)	5,798		50	△	3.3	16.2	80.9	683
62期(2016年9月20日)	5,735		50	△	0.2	13.6	80.1	597
63期(2016年10月20日)	5,870		50		3.2	16.8	81.3	577
64期(2016年11月21日)	5,846		50		0.4	17.0	79.2	564
65期(2016年12月20日)	6,024		50		3.9	16.4	78.9	560
66期(2017年1月20日)	6,105		50		2.2	16.5	80.3	561
67期(2017年2月20日)	6,024		50	△	0.5	15.8	81.2	512

大阪・兵庫応援外国債券オープン（愛称 まごころ応援団）

決算期	基準価額 (分配落)	税分		期騰落		アジア・ニュージ ランド債券マザー ファンド組入比率	LM・オーストラリア 債券ファンド（適格機関 投資家専用）組入比率	純資産 総額	
		込	分	み	騰				中
	円 銭			金				百万円	
68期(2017年3月21日)	6,001			50		0.4	16.3	80.5	491
69期(2017年4月20日)	5,712			50	△	4.0	17.2	79.3	455
70期(2017年5月22日)	5,764			50		1.8	16.6	79.5	452
71期(2017年6月20日)	5,852			50		2.4	16.7	79.8	448
72期(2017年7月20日)	5,991			50		3.2	16.2	80.6	453
73期(2017年8月21日)	5,828			50	△	1.9	16.6	79.9	435
74期(2017年9月20日)	5,919			50		2.4	17.1	79.8	437
75期(2017年10月20日)	5,848			50	△	0.4	16.7	80.6	418
76期(2017年11月20日)	5,624			50	△	3.0	16.7	80.8	398
77期(2017年12月20日)	5,676			50		1.8	16.2	81.0	392
78期(2018年1月22日)	5,719			50		1.6	16.2	80.6	391
79期(2018年2月20日)	5,437			50	△	4.1	16.3	80.8	364
80期(2018年3月20日)	5,261			50	△	2.3	16.7	81.1	348
81期(2018年4月20日)	5,263			50		1.0	16.7	80.9	342
82期(2018年5月21日)	5,238			50		0.5	16.2	81.2	340
83期(2018年6月20日)	5,114			50	△	1.4	16.7	80.8	328
84期(2018年7月20日)	5,151			50		1.7	16.5	81.0	328
85期(2018年8月20日)	4,997			50	△	2.0	16.3	80.8	312
86期(2018年9月20日)	4,962			50		0.3	16.6	80.6	309
87期(2018年10月22日)	4,829			50	△	1.7	16.6	80.4	300
88期(2018年11月20日)	4,927			50		3.1	16.5	80.7	289
89期(2018年12月20日)	4,833			50	△	0.9	16.3	81.8	260
90期(2019年1月21日)	4,713			50	△	1.4	16.6	80.7	253
91期(2019年2月20日)	4,761			50		2.1	16.9	80.9	251
92期(2019年3月20日)	4,742			50		0.7	16.7	80.6	249
93期(2019年4月22日)	4,760			50		1.4	16.4	80.4	249
94期(2019年5月20日)	4,556			50	△	3.2	16.5	80.3	238
95期(2019年6月20日)	4,475			50	△	0.7	16.5	80.5	232
96期(2019年7月22日)	4,534			50		2.4	16.5	81.4	230
97期(2019年8月20日)	4,348			50	△	3.0	16.5	80.6	218
98期(2019年9月20日)	4,344			50		1.1	16.8	80.6	214
99期(2019年10月21日)	4,341			50		1.1	16.7	80.8	212
100期(2019年11月20日)	4,287			50	△	0.1	16.6	80.7	202
101期(2019年12月20日)	4,285			50		1.1	16.6	80.6	201
102期(2020年1月20日)	4,292			50		1.3	16.8	80.6	201

大阪・兵庫応援外国債券オープン（愛称 まごころ応援団）

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			アジア・ニュージーランド債券マザーファンド組入比率	LM・オーストラリア債券ファンド（適格機関投資家専用）組入比率	純資産総額
		税分	込配	み金 期騰落			
	円 銭		円		%	%	百万円
103期(2020年2月20日)	4,206		50	△ 0.8	16.8	80.7	196
104期(2020年3月23日)	3,535		50	△14.8	16.9	80.6	163
105期(2020年4月20日)	3,747		50	7.4	15.9	81.4	170
106期(2020年5月20日)	3,829		50	3.5	16.1	81.6	173
107期(2020年6月22日)	3,910		50	3.4	16.3	81.9	175
108期(2020年7月20日)	3,963		50	2.6	16.4	81.6	176
109期(2020年8月20日)	3,973		50	1.5	16.4	81.6	176
110期(2020年9月23日)	3,885		50	△ 1.0	17.0	81.1	170
111期(2020年10月20日)	3,835		50	0.0	17.3	80.8	167
112期(2020年11月20日)	3,838		50	1.4	16.6	82.0	147
113期(2020年12月21日)	3,898		50	2.9	16.8	81.4	147
114期(2021年1月20日)	3,904		50	1.4	17.2	81.2	144
115期(2021年2月22日)	3,934		50	2.0	16.2	82.1	137
116期(2021年3月22日)	3,861		50	△ 0.6	16.7	81.7	134
117期(2021年4月20日)	3,828		50	0.4	16.8	81.8	133
118期(2021年5月20日)	3,801		50	0.6	17.2	82.4	126
119期(2021年6月21日)	3,711		50	△ 1.1	17.8	80.6	122
(償還時)	(償還価額)						
120期(2021年7月20日)	3,724.30		—	0.4	—	—	92

(注) 基準価額および分配金（税引前）は1万口当たり、基準価額の騰落率は分配金（税引前）込み。

(注) 設定日の基準価額および純資産総額は当初設定元本。

(注) 当ファンドは、特定の指数を上回るまたは連動する成果を目指した運用を行っておりません。そのため、特定のベンチマークおよび参考指数は設けておりません。

(注) アジア・ニュージーランド債券マザーファンドとLM・オーストラリア債券ファンド（適格機関投資家専用）の組入比率は、当ファンドの純資産総額に対する比率です。

(注) 当ファンドは、投信信託約款の規定により、第4期（2011年11月21日）より分配を行っております。

○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	騰 落 率		アジア・ニュージ ランド債券マザー ファンド組入比率	LM・オーストラリア 債券ファンド（適格機関 投資家専用）組入比率
第115期	(期 首) 2021年1月20日	円 銭 3,904	% —	% —	% 17.2	% 81.2
	1月末	3,909	0.1	17.3	81.1	
	(期 末) 2021年2月22日	3,984	2.0	16.2	82.1	
第116期	(期 首) 2021年2月22日	3,934	—	16.2	82.1	
	2月末	3,871	△1.6	16.6	81.7	
	(期 末) 2021年3月22日	3,911	△0.6	16.7	81.7	
第117期	(期 首) 2021年3月22日	3,861	—	16.7	81.7	
	3月末	3,878	0.4	16.7	81.7	
	(期 末) 2021年4月20日	3,878	0.4	16.8	81.8	
第118期	(期 首) 2021年4月20日	3,828	—	16.8	81.8	
	4月末	3,863	0.9	17.1	81.8	
	(期 末) 2021年5月20日	3,851	0.6	17.2	82.4	
第119期	(期 首) 2021年5月20日	3,801	—	17.2	82.4	
	5月末	3,821	0.5	17.4	81.2	
	(期 末) 2021年6月21日	3,761	△1.1	17.8	80.6	
第120期	(期 首) 2021年6月21日	3,711	—	17.8	80.6	
	6月末	3,730	0.5	16.6	81.3	
	(償還時) 2021年7月20日	(償還価額) 3,724.30	0.4	—	—	

(注) 期末基準価額は1万円当たり分配金（税引前）込み、騰落率は期首比。

設定以来の運用経過

設定以来の基準価額等の推移

（2011年7月28日～2021年7月20日）



（注）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す。

（注）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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

（注）分配金再投資基準価額は、設定日（2011年7月28日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

設定以来の投資環境

（2011年7月28日～2021年7月20日）

（債券市場）

債券市場では、アジア・オセアニア地域の債券利回りが低下（価格は上昇）しました。オーストラリア債券市場は利回りが低下しました。米中の対立などを背景とした中国経済の減速や新型コロナウイルスの感染拡大を受けた世界経済の停滞が懸念され、世界的に債券利回りが低下した影響から、オーストラリアの債券利回りも低下しました。豪州準備銀行（中央銀行、RBA）が政策金利を段階的に引き下げたことも、利回りの低下要因となりました。

（為替市場）

為替市場では、アジア・オセアニア地域の通貨が対円でまちまちの動きとなりました。オーストラリアドルは対円で下落しました。米中对立の深刻化などを背景とした中国経済の減速や新型コロナウイルスの感染拡大を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったこと、RBAが段階的に政策金利を引き下げたことなどから、オーストラリアドル売り・円買いが優勢となりました。しかし償還日にかけては、新型コロナウイルスのワクチンの普及による経済活動正常化の動きが広がる中、オーストラリアドルは持ち直す動きとなりました。

設定以来の当ファンドのポートフォリオ

（2011年7月28日～2021年7月20日）

<大阪・兵庫応援外国債券オープン（愛称 まごころ応援団）>

「アジア・ニュージーランド債券マザーファンド」を20%程度、「LM・オーストラリア債券ファンド（適格機関投資家専用）」を80%程度組み入れて運用を行いました。

なお、2021年7月中旬には、償還に向けて、「アジア・ニュージーランド債券マザーファンド」と「LM・オーストラリア債券ファンド（適格機関投資家専用）」を売却し、短期金融市場で資金を運用しました。

○アジア・ニュージーランド債券マザーファンド

（債券組入比率）

高位の組入比率を維持しました。

（通貨別投資比率）

インドネシア、ニュージーランド、マレーシア、タイ、韓国等の通貨に投資を行い、相場動向に対応して、それぞれの投資比率を変化させることで、為替変動リスクのコントロールを図りました。設定以来、インドネシアルピアやニュージーランドドルの比率を相対的に高位で維持しました。

（国別投資比率および年限別投資配分）

インドネシア、ニュージーランド、マレーシア、タイ、韓国、インド（クレジット・リンク・ノート（CLN）[※]）の国債に投資を行いました。設定以来、インドネシア国債やニュージーランド国債の比率を相対的に高位で維持しました。年限別投資比率については中期ゾーンの債券への投資を比較的高めとしました。

※クレジット・リンク・ノート（CLN）は、現地通貨建ての新興国国債または新興国の政府機関債にパフォーマンスが概ね連動する債券で、発行体は信用格付業者等から原則としてA格以上の格付けを有している金融機関です。

○LM・オーストラリア債券ファンド（適格機関投資家専用）

（債券組入比率）

高位の組入比率を維持しました。

（債券別投資比率）

オーストラリアドル建ての国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券および資産担保証券等に投資しました。その中で、金融債、リート・セクター等を中心とした社債の投資比率を相対的に高めとしました。金融債の組み入れについては、カバードボンド（債権担保付社債の一種）や、大手金融機関が発行する流動性・信用力が相対的に高い債券を中心としました。また、ポートフォリオ全体の平均格付けは高位に保ちました。

設定以来の当ファンドのベンチマークとの差異

（2011年7月28日～2021年7月20日）

当ファンドはベンチマークおよび参考指数がないため、本項目は記載していません。

分配金

(2011年7月28日～2021年7月20日)

分配対象収益の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額としました。各期の分配金につきましては、1～4ページをご覧ください。当作成期間におきましては、第115期から第119期の決算期に、それぞれ1万口当たり50円（税引前）、合計250円（税引前）の分配を行いました。

なお、収益分配に充てなかった留保益については、運用の基本方針と同一の運用を行いました。

(単位：円、1万口当たり・税引前)

項 目	第115期	第116期	第117期	第118期	第119期
	2021年1月21日～ 2021年2月22日	2021年2月23日～ 2021年3月22日	2021年3月23日～ 2021年4月20日	2021年4月21日～ 2021年5月20日	2021年5月21日～ 2021年6月21日
当期分配金	50	50	50	50	50
(対基準価額比率)	1.255%	1.278%	1.289%	1.298%	1.329%
当期の収益	16	12	13	14	12
当期の収益以外	33	37	36	35	37
翌期繰越分配対象額	322	285	248	213	175

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2021年 1 月21日～2021年 7 月20日）

項 目	第115期～第120期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝作成期間中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(7)	(0.191)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(15)	(0.382)	交付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、購入後の 情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(1)	(0.022)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	0	0.011	(b) その他費用＝作成期間中のその他費用÷作成期間中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(0)	(0.005)	保管費用は、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)	(0.006)	監査費用は、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)	その他は、金銭信託支払手数料
合 計	23	0.606	
作成期間中の平均基準価額は、3,845円です。			

(注) 作成期間中の費用（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。

(注) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 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。

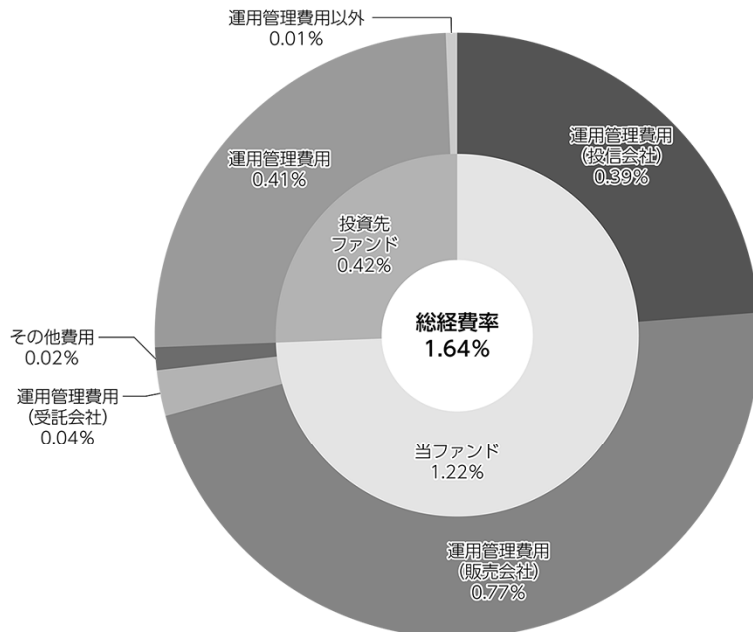
(注) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

○総経費率

作成期間中の運用・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。）を作成期間中の平均受益権口数に作成期間中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.64%です。



(単位: %)

総経費率(①+②+③)	1.64
①当ファンドの費用の比率	1.22
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.41
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.01

(注) 当ファンドの費用は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す。

(注) 各費用は、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。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、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。

○売買及び取引の状況

（2021年1月21日～2021年7月20日）

○売買及び取引の状況とは、ファンドが購入・売却した有価証券の数量および金額です。

投資信託証券

銘柄		第115期～第120期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	LM・オーストラリア債券ファンド（適格機関投資家専用）	—	—	265,078,015	117,099

（注）金額は受渡代金。

（注）単位未満は切捨て。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄		第115期～第120期			
		設定		解約	
		口数	金額	口数	金額
	アジア・ニュージーランド債券マザーファンド	—	—	15,546	25,477

（注）単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

（2021年1月21日～2021年7月20日）

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7月20日現在）

有価証券等の組入れはございません。

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄		第114期末	
		口数	口数
	LM・オーストラリア債券ファンド（適格機関投資家専用）		265,078,015
	合 計		265,078,015

（注）口数の単位未満は切捨て。

親投資信託残高

銘	柄	第114期末	
		口	数
アジア・ニュージーランド債券マザーファンド			千口 15,546

(注) 口数の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年7月20日現在)

項	目	償 還 時	
		評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他		千円 92,810	% 100.0
投資信託財産総額		92,810	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び償還（基準）価額の状況

項 目	第115期末	第116期末	第117期末	第118期末	第119期末	償 還 時
	2021年2月22日現在	2021年3月22日現在	2021年4月20日現在	2021年5月20日現在	2021年6月21日現在	2021年7月20日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	140,131,550	136,474,196	135,349,118	131,548,078	124,301,461	92,810,390
コール・ローン等	4,246,946	4,081,291	3,720,513	3,464,957	3,876,332	92,810,390
投資信託受益証券（評価額）	113,201,348	109,962,675	109,185,941	104,332,338	98,666,420	—
アジア・ニュージーランド債券ファンド（評価額）	22,383,256	22,430,230	22,442,664	21,750,783	21,758,709	—
未収入金	300,000	—	—	2,000,000	—	—
(B) 負債	2,191,417	1,869,936	1,873,075	4,854,908	1,910,947	99,353
未払収益分配金	1,752,980	1,743,125	1,743,325	1,666,449	1,649,106	—
未払解約金	283,547	—	—	3,056,805	127,429	—
未払信託報酬	153,205	125,435	128,345	130,224	132,959	98,140
未払利息	1	1	1	1	2	94
その他未払費用	1,684	1,375	1,404	1,429	1,451	1,119
(C) 純資産総額（A－B）	137,940,133	134,604,260	133,476,043	126,693,170	122,390,514	92,711,037
元本	350,596,132	348,625,025	348,665,188	333,289,882	329,821,365	248,935,137
次期繰越損益金	△212,655,999	△214,020,765	△215,189,145	△206,596,712	△207,430,851	—
償還差損金	—	—	—	—	—	△156,224,100
(D) 受益権総口数	350,596,132口	348,625,025口	348,665,188口	333,289,882口	329,821,365口	248,935,137口
1万口当たり基準価額（C/D）	3,934円	3,861円	3,828円	3,801円	3,711円	—
1万口当たり償還価額（C/D）	—	—	—	—	—	3,724円30銭

(注) 純資産総額が元本総額を下回っており、その差額は第115期212,655,999円、第116期214,020,765円、第117期215,189,145円、第118期206,596,712円、第119期207,430,851円、償還時156,224,100円です。

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、第115期0.3934円、第116期0.3861円、第117期0.3828円、第118期0.3801円、第119期0.3711円、償還時0.372430円です。

(注) 当ファンドの第115期首元本額は369,821,001円、第115～120期中追加設定元本額は180,549円、第115～120期中一部解約元本額は121,066,413円です。

○損益の状況

項 目	第115期	第116期	第117期	第118期	第119期	第120期
	2021年1月21日～ 2021年2月22日	2021年2月23日～ 2021年3月22日	2021年3月23日～ 2021年4月20日	2021年4月21日～ 2021年5月20日	2021年5月21日～ 2021年6月21日	2021年6月22日～ 2021年7月20日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	507,625	499,440	493,651	467,462	455,389	340,339
受取配当金	507,646	499,457	493,660	467,476	455,425	340,676
受取利息	1	—	—	—	—	—
支払利息	△ 22	△ 17	△ 9	△ 14	△ 36	△ 337
(B) 有価証券売買損益	2,458,242	△ 1,189,713	235,700	433,965	△ 1,656,275	91,413
売買益	2,473,358	50,304	235,700	466,230	28,371	339,306
売買損	△ 15,116	△ 1,240,017	—	△ 32,265	△ 1,684,646	△ 247,893
(C) 信託報酬等	△ 154,889	△ 126,810	△ 129,749	△ 131,654	△ 134,410	△ 99,261
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,810,978	△ 817,083	599,602	769,773	△ 1,335,296	332,491
(E) 前期繰越損益金	△165,732,528	△162,561,487	△163,830,036	△156,466,292	△154,536,332	△117,948,082
(F) 追加信託差損益金	△ 47,981,469	△ 48,899,070	△ 50,215,386	△ 49,233,744	△ 49,910,117	△ 38,608,509
(配当等相当額)	(12,479,947)	(11,239,844)	(9,949,332)	(8,297,148)	(7,027,456)	(4,367,903)
(売買損益相当額)	(△ 60,461,416)	(△ 60,138,914)	(△ 60,164,718)	(△ 57,530,892)	(△ 56,937,573)	(△ 42,976,412)
(G) 計(D+E+F)	△210,903,019	△212,277,640	△213,445,820	△204,930,263	△205,781,745	—
(H) 収益分配金	△ 1,752,980	△ 1,743,125	△ 1,743,325	△ 1,666,449	△ 1,649,106	—
次期繰越損益金(G+H)	△212,655,999	△214,020,765	△215,189,145	△206,596,712	△207,430,851	—
償還差損金(D+E+F)	—	—	—	—	—	△156,224,100
追加信託差損益金	△ 49,158,034	△ 50,190,729	△ 51,484,818	△ 50,429,527	△ 51,150,288	—
(配当等相当額)	(11,303,385)	(9,948,186)	(8,679,902)	(7,101,368)	(5,787,286)	(—)
(売買損益相当額)	(△ 60,461,419)	(△ 60,138,915)	(△ 60,164,720)	(△ 57,530,895)	(△ 56,937,574)	(—)
繰越損益金	△163,497,965	△163,830,036	△163,704,327	△156,167,185	△156,280,563	—

(注) 損益の状況の中で(B)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。

(注) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 収益分配金

決算期	第115期	第116期	第117期	第118期	第119期
(a) 配当等収益(費用控除後)	576,415円	451,466円	473,893円	470,666円	408,935円
(b) 有価証券等損益額(費用控除後、繰越欠損金補填後)	0円	0円	0円	0円	0円
(c) 信託約款に規定する収益調整金	12,479,950円	11,239,845円	9,949,334円	8,297,151円	7,027,457円
(d) 信託約款に規定する分配準備積立金	0円	0円	0円	0円	0円
分配対象収益(a+b+c+d)	13,056,365円	11,691,311円	10,423,227円	8,767,817円	7,436,392円
分配対象収益(1万口当たり)	372円	335円	298円	263円	225円
分配金額	1,752,980円	1,743,125円	1,743,325円	1,666,449円	1,649,106円
分配金額(1万口当たり)	50円	50円	50円	50円	50円

○分配金のお知らせ

	第115期	第116期	第117期	第118期	第119期
1万口当たり分配金（税引前）	50円	50円	50円	50円	50円
支払開始日	各決算日から起算して5営業日までの間に支払いを開始します。				
お支払場所	取得申込みを取扱った販売会社の本支店				

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2011年7月28日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2021年7月20日		資産総額	92,810,390円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	99,353円
受益権口数	134,367,507口	248,935,137口	114,567,630口	純資産総額	92,711,037円
元本額	134,367,507円	248,935,137円	114,567,630円	受益権口数	248,935,137口
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	167,033,022円	159,494,257円	9,549円	－円	－%
第2期	229,885,076	215,763,472	9,386	－	－
第3期	256,543,361	241,409,789	9,410	－	－
第4期	590,167,457	541,379,058	9,173	100	1.0
第5期	929,400,233	853,432,694	9,183	100	1.0
第6期	1,199,342,219	1,124,251,489	9,374	100	1.0
第7期	1,384,809,788	1,364,010,904	9,850	100	1.0
第8期	1,513,288,289	1,505,884,568	9,951	100	1.0
第9期	1,589,266,258	1,531,972,723	9,639	100	1.0
第10期	1,694,770,652	1,538,213,960	9,076	100	1.0
第11期	1,845,343,929	1,702,798,990	9,228	100	1.0
第12期	2,051,472,003	1,916,509,426	9,342	100	1.0
第13期	2,172,934,735	2,011,656,722	9,258	100	1.0
第14期	2,267,381,862	2,076,963,670	9,160	100	1.0
第15期	2,416,808,234	2,206,767,949	9,131	100	1.0
第16期	2,547,619,867	2,380,415,358	9,344	100	1.0
第17期	2,649,014,487	2,540,529,731	9,590	100	1.0
第18期	2,726,653,591	2,770,036,803	10,159	100	1.0
第19期	2,805,985,114	2,893,258,584	10,311	100	1.0
第20期	2,815,681,752	2,941,872,098	10,448	100	1.0
第21期	2,832,889,639	3,065,435,827	10,821	100	1.0
第22期	2,817,538,767	3,001,304,881	10,652	100	1.0
第23期	2,835,144,171	2,663,994,415	9,396	100	1.0

大阪・兵庫応援外国債券オープン（愛称 まごころ応援団）

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第24期	2,868,109,421円	2,723,861,169円	9,497円	100円	1.0%
第25期	2,893,988,532	2,613,242,592	9,030	100	1.0
第26期	2,930,777,150	2,751,060,276	9,387	100	1.0
第27期	2,984,866,095	2,786,498,022	9,335	100	1.0
第28期	2,993,461,614	2,764,928,626	9,237	100	1.0
第29期	3,011,941,046	2,719,732,045	9,030	100	1.0
第30期	3,019,400,280	2,683,931,449	8,889	100	1.0
第31期	2,996,914,286	2,654,399,502	8,857	100	1.0
第32期	2,986,634,482	2,639,376,018	8,837	100	1.0
第33期	2,964,105,151	2,691,716,292	9,081	100	1.0
第34期	2,951,534,554	2,646,298,426	8,966	100	1.0
第35期	2,957,817,402	2,660,928,851	8,996	100	1.0
第36期	2,978,348,481	2,657,479,894	8,923	100	1.0
第37期	2,982,923,939	2,653,361,661	8,895	100	1.0
第38期	2,979,519,987	2,651,329,044	8,899	100	1.0
第39期	2,976,926,506	2,559,674,868	8,598	100	1.0
第40期	2,926,632,329	2,697,786,249	9,218	100	1.0
第41期	2,823,574,096	2,513,770,069	8,903	100	1.0
第42期	2,776,550,102	2,448,561,898	8,819	100	1.0
第43期	2,722,198,964	2,307,028,164	8,475	100	1.0
第44期	2,689,881,383	2,261,620,793	8,408	100	1.0
第45期	2,614,230,710	2,188,697,258	8,372	100	1.0
第46期	2,580,895,416	2,144,760,541	8,310	100	1.0
第47期	2,449,867,013	2,002,450,168	8,174	100	1.0
第48期	2,358,879,916	1,844,273,034	7,818	100	1.0
第49期	2,261,539,222	1,740,673,552	7,697	100	1.0
第50期	2,115,579,343	1,486,342,575	7,026	100	1.0
第51期	2,108,533,878	1,519,077,469	7,204	100	1.0
第52期	2,036,402,768	1,456,961,148	7,155	100	1.0
第53期	1,995,085,100	1,392,114,679	6,978	100	1.0
第54期	1,951,208,869	1,266,453,479	6,491	100	1.0
第55期	1,899,268,978	1,217,995,217	6,413	100	1.0
第56期	1,889,143,575	1,241,477,697	6,572	100	1.0
第57期	1,867,070,945	1,216,523,273	6,516	100	1.0
第58期	1,655,377,455	1,012,989,869	6,119	100	1.0
第59期	1,517,071,526	899,242,230	5,927	100	1.0
第60期	1,404,225,100	849,442,281	6,049	50	0.5
第61期	1,178,882,319	683,548,031	5,798	50	0.5
第62期	1,041,905,990	597,503,822	5,735	50	0.5
第63期	983,424,217	577,222,662	5,870	50	0.5

大阪・兵庫応援外国債券オープン（愛称 まごころ応援団）

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1 万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第64期	966,320,994円	564,877,109円	5,846円	50円	0.5%
第65期	930,833,023	560,756,052	6,024	50	0.5
第66期	919,011,418	561,028,002	6,105	50	0.5
第67期	850,666,901	512,428,908	6,024	50	0.5
第68期	819,229,609	491,631,485	6,001	50	0.5
第69期	797,034,203	455,237,637	5,712	50	0.5
第70期	784,787,006	452,344,557	5,764	50	0.5
第71期	766,483,332	448,528,863	5,852	50	0.5
第72期	757,114,320	453,583,749	5,991	50	0.5
第73期	747,091,239	435,383,804	5,828	50	0.5
第74期	739,849,633	437,922,752	5,919	50	0.5
第75期	716,087,669	418,765,634	5,848	50	0.5
第76期	707,771,419	398,025,960	5,624	50	0.5
第77期	691,206,528	392,344,983	5,676	50	0.5
第78期	684,506,125	391,462,518	5,719	50	0.5
第79期	670,396,768	364,483,747	5,437	50	0.5
第80期	663,279,219	348,958,806	5,261	50	0.5
第81期	650,522,883	342,380,596	5,263	50	0.5
第82期	649,747,536	340,336,862	5,238	50	0.5
第83期	642,621,451	328,639,605	5,114	50	0.5
第84期	637,938,456	328,613,803	5,151	50	0.5
第85期	624,533,293	312,049,163	4,997	50	0.5
第86期	623,712,823	309,470,227	4,962	50	0.5
第87期	621,530,485	300,116,132	4,829	50	0.5
第88期	587,086,479	289,257,850	4,927	50	0.5
第89期	538,860,655	260,415,897	4,833	50	0.5
第90期	538,903,861	253,960,106	4,713	50	0.5
第91期	528,139,173	251,451,429	4,761	50	0.5
第92期	527,152,505	249,998,012	4,742	50	0.5
第93期	525,154,898	249,990,619	4,760	50	0.5
第94期	524,035,033	238,747,568	4,556	50	0.5
第95期	520,603,111	232,944,697	4,475	50	0.5
第96期	507,308,724	230,015,340	4,534	50	0.5
第97期	502,306,466	218,420,354	4,348	50	0.5
第98期	493,659,605	214,462,568	4,344	50	0.5
第99期	489,713,156	212,584,713	4,341	50	0.5
第100期	473,065,732	202,789,076	4,287	50	0.5
第101期	469,109,764	201,014,787	4,285	50	0.5
第102期	469,143,646	201,343,375	4,292	50	0.5
第103期	466,608,963	196,254,914	4,206	50	0.5

大阪・兵庫応援外国債券オープン（愛称 まごころ応援団）

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1 万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第104期	463,462,254円	163,856,763円	3,535円	50円	0.5%
第105期	454,000,089	170,094,532	3,747	50	0.5
第106期	454,042,606	173,842,326	3,829	50	0.5
第107期	448,820,292	175,472,426	3,910	50	0.5
第108期	445,708,029	176,639,248	3,963	50	0.5
第109期	443,609,493	176,239,230	3,973	50	0.5
第110期	438,031,059	170,154,051	3,885	50	0.5
第111期	437,105,238	167,635,695	3,835	50	0.5
第112期	385,337,297	147,910,531	3,838	50	0.5
第113期	378,251,132	147,436,865	3,898	50	0.5
第114期	369,821,001	144,389,567	3,904	50	0.5
第115期	350,596,132	137,940,133	3,934	50	0.5
第116期	348,625,025	134,604,260	3,861	50	0.5
第117期	348,665,188	133,476,043	3,828	50	0.5
第118期	333,289,882	126,693,170	3,801	50	0.5
第119期	329,821,365	122,390,514	3,711	50	0.5

○償還金のお知らせ

1 万口当たり償還金	3,724円30銭
------------	-----------

<お知らせ>

- ・作成対象期間中における寄附実績はありませんでした。
- ・償還時の寄附原資につきましては、今後、販売会社が大阪府・兵庫県の社会福祉協議会等への寄附に充当する予定です。
- ・LM・オーストラリア債券ファンド（適格機関投資家専用）の運用会社であるレグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社は、2021年4月1日付で商号をフランクリン・テンブルトン・ジャパン株式会社に変更いたしました。

マザーファンドの運用報告書につきましては、ベビーファンドの運用報告書と作成対象期間が異なる場合には、データ・コメント等に不一致が生じることがありますのでご了承ください。

アジア・ニュージーランド債券マザーファンド
 第11期 運用状況のご報告
 決算日：2020年11月20日

当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	アジア諸国・ニュージーランドの現地通貨建ソブリン債等を主要投資対象とし、安定した収益の確保を図ることを目的として運用を行います。
主要投資対象	アジア諸国・ニュージーランドの現地通貨建ソブリン債等を主要投資対象とします。
投資制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰 落	中 率			
	円		%	%	%	百万円
7期(2016年11月21日)	13,653		△2.9	91.7	—	9,299
8期(2017年11月20日)	14,591		6.9	90.7	—	8,993
9期(2018年11月20日)	14,621		0.2	93.1	—	6,411
10期(2019年11月20日)	15,228		4.2	96.4	—	4,555
11期(2020年11月20日)	15,761		3.5	96.0	—	3,898

(注) 基準価額は1万円当たり。

(注) 当ファンドは、特定の指数を上回るまたは連動する成果を目指した運用を行っておりません。そのため、特定のベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

(注) 債券先物比率＝買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

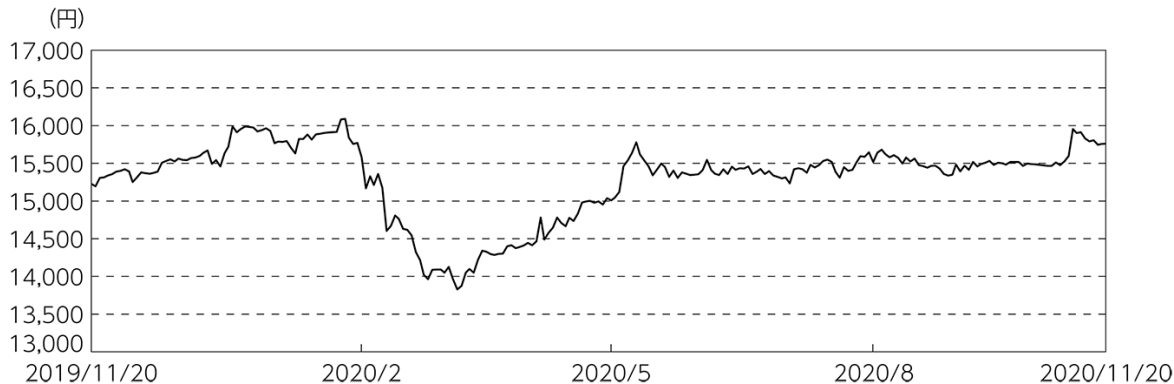
年	月	日	基 準	価 額		債 組	入 比	券 率	債 先	物 比	券 率
				騰	落						
	(期 首)		円					%			%
	2019年11月20日		15,228					96.4			—
	11月末		15,400					93.6			—
	12月末		15,671					96.5			—
	2020年1月末		15,793					97.5			—
	2月末		15,579					94.5			—
	3月末		14,127					96.4			—
	4月末		14,467					90.8			—
	5月末		15,008					90.4			—
	6月末		15,412					96.5			—
	7月末		15,234					94.8			—
	8月末		15,518					90.6			—
	9月末		15,484					90.2			—
	10月末		15,465					91.8			—
	(期 末)										
	2020年11月20日		15,761					96.0			—

(注) 騰落率は期首比。

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2019年11月21日～2020年11月20日)



○基準価額の主な変動要因

当ファンドにおける主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ニュージーランドドルが対円で上昇したことがプラスに寄与しました。
- ・投資国の債券利回りが低下し、保有債券の価格が上昇したことがプラスに寄与しました。

(主なマイナス要因)

- ・インドネシアルピアやマレーシアリングgit、タイバーツが対円で下落したことがマイナスに影響しました。

投資環境

(2019年11月21日～2020年11月20日)

(債券市場)

債券市場は、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界的な景気悪化を背景に、投資国の中央銀行が利下げを実施したことを受けて、投資国の債券利回りが低下しました。

(為替市場)

為替市場は、新型コロナウイルスの感染拡大を背景に、世界的に株価が急落するなど、投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、2020年3月にかけて、投資国の通貨が対円で急落する展開となりました。しかしその後、世界各国が大規模な金融緩和策や財政政策を実施すると、世界的に株価が反発するとともに、投資国の通貨は対円で戻り歩調を辿りました。

当ファンドのポートフォリオ

(2019年11月21日～2020年11月20日)

(債券組入比率)

当期間を通じて、高位の組入比率を維持しました。

(通貨別投資比率)

インドネシア、ニュージーランド、マレーシア、タイの通貨に投資を行いました。また、マレーシアリングットの比率を引き下げるとともに、ニュージーランドドルの比率を引き上げました。

(国別投資比率および年限別投資配分)

インドネシア、ニュージーランド、マレーシア、タイの国債に投資を行いました。また、マレーシア国債の比率を引き下げるとともに、ニュージーランド国債の比率を引き上げました。年限別投資比率については中期ゾーンの債券への投資を比較的高めとしました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2019年11月21日～2020年11月20日)

当ファンドはベンチマークおよび参考指数がないため、本項目は記載していません。

今後の運用方針**(投資環境)**

債券市場につきましては、新型コロナウイルスの感染拡大への懸念が残るものの、ワクチンの開発や普及に対する期待が高まりつつあることから、徐々に利回りが上昇すると予想されます。

為替市場については、新型コロナウイルスのワクチンの開発や普及が進展すると見込まれるため、世界的な景気回復期待の高まりとともに、投資国の通貨が対円で上昇すると考えます。

(運用方針)

各国の金利水準を重視し、為替市場や債券市場の見通し、市場流動性等を総合的に勘案して国別投資比率、デュレーションを決定する方針です。具体的には、ニュージーランド国債について、経済情勢等を勘案しながら比率を段階的に引き上げる方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2019年11月21日～2020年11月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 9	% 0.061	(a)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)	(9)	(0.060)	保管費用は、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)	その他は、金銭信託支払手数料等
合 計	9	0.061	
期中の平均基準価額は、15,263円です。			

(注) 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。

(注) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2019年11月21日～2020年11月20日)

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 6,860	千ニュージーランドドル 5,544 (1,000)
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリングgit -	千マレーシアリングgit 12,301 (5,000)
	インドネシア	国債証券	千インドネシアルピア 31,914,000	千インドネシアルピア 29,380,000 (30,000,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) 単位未満は切捨て。

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2019年11月21日～2020年11月20日)

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

(2020年11月20日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

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			5年以上	2年以上	2年未満
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 13,000	千ニュージーランドドル 15,336	千円 1,100,715	% 28.2	% —	% 22.3	% 4.1	% 1.9
マレーシア	千マレーシアリンギット 34,000	千マレーシアリンギット 36,002	913,741	23.4	—	10.6	6.2	6.6
タイ	千タイバーツ 80,000	千タイバーツ 83,540	285,708	7.3	—	3.7	—	3.6
インドネシア	千インドネシアルピア 179,000,000	千インドネシアルピア 194,720,030	1,440,928	37.0	—	6.0	15.3	15.6
合 計	—	—	3,741,093	96.0	—	42.6	25.6	27.7

(注) 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。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

アジア・ニュージーランド債券マザーファンド

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	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		
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		
	国債証券	NEW ZEALAND GVT 2.75	2.75	2,000	2,214	158,941	2025/4/15
		NEW ZEALAND GVT 3	3.0	8,000	9,517	683,078	2029/4/20
		NEW ZEALAND GVT 3.5	3.5	2,000	2,576	184,949	2033/4/14
		NEW ZEALAND GVT 6	6.0	1,000	1,027	73,745	2021/5/15
小	計					1,100,715	
マレーシア			千マレーシアリングギット	千マレーシアリングギット			
	国債証券	MALAYSIA GOVT 3.478	3.478	2,000	2,097	53,222	2024/6/14
		MALAYSIA GOVT 3.48	3.48	2,000	2,073	52,627	2023/3/15
		MALAYSIA GOVT 3.9	3.9	15,000	16,261	412,705	2026/11/30
		MALAYSIA GOVT 4.048	4.048	10,000	10,209	259,104	2021/9/30
		MALAYSIA GOVT 4.059	4.059	5,000	5,361	136,081	2024/9/30
小	計					913,741	
タイ			千タイバーツ	千タイバーツ			
	国債証券	THAILAND GOVT 1.875	1.875	40,000	40,833	139,650	2022/6/17
		THAILAND GOVT 2.125	2.125	40,000	42,706	146,057	2026/12/17
小	計					285,708	
インドネシア			千インドネシアルピア	千インドネシアルピア			
	国債証券	INDONESIA GOV' T 10.25	10.25	31,000,000	33,954,920	251,266	2022/7/15
		INDONESIA GOV' T 11.75	11.75	3,000,000	3,530,460	26,125	2023/8/15
		INDONESIA GOV' T 12.8	12.8	35,000,000	36,917,650	273,190	2021/6/15
		INDONESIA GOV' T 12.9	12.9	10,000,000	11,328,900	83,833	2022/6/15
		INDONESIA GOV' T 7	7.0	30,000,000	31,840,200	235,617	2030/9/15
		INDONESIA GOV' T 8.125	8.125	50,000,000	55,056,500	407,418	2024/5/15
		INDONESIA GOV' T 8.375	8.375	20,000,000	22,091,400	163,476	2024/3/15
小	計					1,440,928	
合	計					3,741,093	

(注) 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。

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2020年11月20日現在)

項目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 3,741,093	% 90.5
コール・ローン等、その他	393,374	9.5
投資信託財産総額	4,134,467	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(注) 当期末における外貨建純資産(3,804,573千円)の投資信託財産総額(4,134,467千円)に対する比率は92.0%です。

(注) 外貨建資産は、当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。なお、邦貨換算レートは1ニュージーランドドル=71.77円、1マレーシアリングギット=25.38円、1タイバーツ=3.42円、1インドネシアルピア=0.0074円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年11月20日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	4,134,467,750	
コール・ローン等	354,273,408	
公社債(評価額)	3,741,093,993	
未収利息	39,019,016	
前払費用	81,333	
(B) 負債	236,164,922	
未払金	236,163,600	
未払利息	78	
その他未払費用	1,244	
(C) 純資産総額(A-B)	3,898,302,828	
元本	2,473,318,728	
次期繰越損益金	1,424,984,100	
(D) 受益権総口数	2,473,318,728口	
1万口当たり基準価額(C/D)	15,761円	

- (注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1.5761円です。
- (注) 当ファンドの期首元本額は2,991,509,238円、期中追加設定元本額は18,296,850円、期中一部解約元本額は536,487,360円です。
- (注) 当親ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、以下の通りです。
- | | |
|------------------------------|----------------|
| アジア・オセアニア債券オープン(毎月決算型) | 2,121,916,569円 |
| 三重県応援・債券ファンド(毎月決算型) | 143,035,746円 |
| 水戸証券アジア・オセアニア債券オープン(寄附付) | 109,294,934円 |
| アジア・オセアニア債券オープン(1年決算型) | 37,422,578円 |
| <中京>アジア・オセアニア債券オープン(環境応援寄附付) | 36,657,028円 |
| 大阪・兵庫応援外国債券オープン | 15,546,528円 |
| 三重県応援・債券ファンド(1年決算型) | 9,445,345円 |

該当事項はございません。

○損益の状況 (2019年11月21日～2020年11月20日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	183,754,328	
受取利息	183,818,338	
支払利息	△ 64,010	
(B) 有価証券売買損益	△ 55,194,521	
売買益	125,857,751	
売買損	△ 181,052,272	
(C) その他費用等	△ 2,487,904	
(D) 当期損益金(A+B+C)	126,071,903	
(E) 前期繰越損益金	1,564,031,687	
(F) 追加信託差損益金	9,493,150	
(G) 解約差損益金	△ 274,612,640	
(H) 計(D+E+F+G)	1,424,984,100	
次期繰越損益金(H)	1,424,984,100	

- (注) 損益の状況の中で(B)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。
- (注) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
- (注) 損益の状況の中で(G)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。

<お知らせ>