

# グローバル 高金利通貨ファンド

【愛称:プレミアムエイト】

【運用報告書(全体版)】

第27作成期 (2020年12月23日から2021年6月22日まで)

第 157 期 / 第 158 期 / 第 159 期  
決算日2021年1月22日 決算日2021年2月22日 決算日2021年3月22日

第 160 期 / 第 161 期 / 第 162 期  
決算日2021年4月22日 決算日2021年5月24日 決算日2021年6月22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。

当ファンドは世界各国の現地通貨建て短期ソブリン債券等を主要投資対象として、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指した運用を行います。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。

## ■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／内外／債券                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 信託期間       | 無期限（設定日：2008年1月7日）                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 運用方針       | 世界各国の現地通貨建て短期ソブリン債券等を主要投資対象として、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指した運用を行います。                                                                                                                                                                                                                                                |
| 主要投資対象     | 世界各国の現地通貨建て短期ソブリン債券等                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 当ファンドの運用方法 | <ul style="list-style-type: none"><li>■世界各国から相対的に高金利の8通貨を選定し、当該通貨建ての債券に分散投資を行います。</li><li>■OECD加盟国、これに準ずる国（経済規模や債券の発行量・流動性を考慮）およびFTSE世界国債インデックス採用国の中から、取得時において主要格付機関の自国通貨建長期債務格付けがBBB格（投資適格）相当以上の国（通貨）を投資対象とします。</li><li>■外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。</li><li>■投資対象とする債券は、主として高格付けの短期ソブリン債券とします。</li></ul> |
| 組入制限       | <ul style="list-style-type: none"><li>■株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li><li>■外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li></ul>                                                                                                                                                                                               |
| 分配方針       | <ul style="list-style-type: none"><li>■毎月22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。</li><li>■分配対象額の範囲は、経費控除後の、繰越分を含めた利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。</li><li>■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。</li></ul> <p>※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。</p>                                          |

 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）

## グローバル高金利通貨ファンド【愛称：プレミアムエイト】

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    |            |              | 債券組入<br>比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|-------------------|------------|------------|--------------|-------------|--------------|
|                   | (分配)       | 税 込<br>分配金 | 期 中<br>騰 落 率 |             |              |
| 133期(2019年1月22日)  | 円<br>5,276 | 円<br>15    | %<br>1.5     | %<br>97.9   | 百万円<br>994   |
| 134期(2019年2月22日)  | 5,317      | 15         | 1.1          | 98.3        | 993          |
| 135期(2019年3月22日)  | 5,332      | 15         | 0.6          | 97.9        | 983          |
| 136期(2019年4月22日)  | 5,375      | 15         | 1.1          | 97.6        | 988          |
| 137期(2019年5月22日)  | 5,208      | 15         | △ 2.8        | 97.4        | 956          |
| 138期(2019年6月24日)  | 5,132      | 15         | △ 1.2        | 98.0        | 938          |
| 139期(2019年7月22日)  | 5,184      | 15         | 1.3          | 98.5        | 942          |
| 140期(2019年8月22日)  | 4,941      | 15         | △ 4.4        | 98.1        | 895          |
| 141期(2019年9月24日)  | 4,982      | 15         | 1.1          | 97.8        | 899          |
| 142期(2019年10月23日) | 5,076      | 15         | 2.2          | 97.6        | 910          |
| 143期(2019年11月22日) | 5,055      | 15         | △ 0.1        | 97.9        | 901          |
| 144期(2019年12月23日) | 5,156      | 15         | 2.3          | 96.6        | 902          |
| 145期(2020年1月22日)  | 5,177      | 15         | 0.7          | 98.2        | 892          |
| 146期(2020年2月25日)  | 5,083      | 15         | △ 1.5        | 98.0        | 872          |
| 147期(2020年3月23日)  | 4,545      | 15         | △10.3        | 97.3        | 778          |
| 148期(2020年4月22日)  | 4,516      | 15         | △ 0.3        | 97.1        | 766          |
| 149期(2020年5月22日)  | 4,658      | 15         | 3.5          | 85.1        | 789          |
| 150期(2020年6月22日)  | 4,712      | 15         | 1.5          | 98.2        | 794          |
| 151期(2020年7月22日)  | 4,835      | 15         | 2.9          | 97.7        | 812          |
| 152期(2020年8月24日)  | 4,815      | 15         | △ 0.1        | 97.5        | 807          |
| 153期(2020年9月23日)  | 4,747      | 15         | △ 1.1        | 98.0        | 791          |
| 154期(2020年10月22日) | 4,742      | 15         | 0.2          | 97.7        | 784          |
| 155期(2020年11月24日) | 4,832      | 15         | 2.2          | 97.7        | 797          |
| 156期(2020年12月22日) | 4,852      | 15         | 0.7          | 96.0        | 786          |
| 157期(2021年1月22日)  | 4,904      | 15         | 1.4          | 97.3        | 781          |
| 158期(2021年2月22日)  | 4,977      | 15         | 1.8          | 97.9        | 781          |
| 159期(2021年3月22日)  | 5,038      | 10         | 1.4          | 97.7        | 785          |
| 160期(2021年4月22日)  | 5,063      | 10         | 0.7          | 97.1        | 787          |
| 161期(2021年5月24日)  | 5,115      | 10         | 1.2          | 97.1        | 784          |
| 162期(2021年6月22日)  | 5,046      | 10         | △ 1.2        | 97.4        | 772          |

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

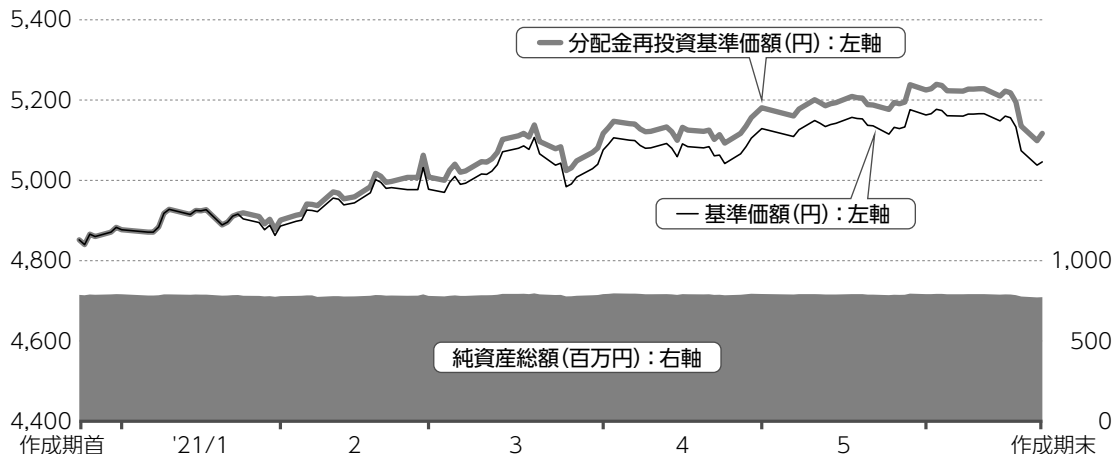
| 決算期   | 年 月 日                | 基 準 価 額    |        | 債 券 組 入<br>比 率 |
|-------|----------------------|------------|--------|----------------|
|       |                      |            | 騰 落 率  |                |
| 第157期 | (期 首)<br>2020年12月22日 | 円<br>4,852 | %<br>— | %<br>96.0      |
|       | 12月末                 | 4,877      | 0.5    | 96.5           |
|       | (期 末)<br>2021年1月22日  | 4,919      | 1.4    | 97.3           |
| 第158期 | (期 首)<br>2021年1月22日  | 4,904      | —      | 97.3           |
|       | 1月末                  | 4,886      | △0.4   | 98.0           |
|       | (期 末)<br>2021年2月22日  | 4,992      | 1.8    | 97.9           |
| 第159期 | (期 首)<br>2021年2月22日  | 4,977      | —      | 97.9           |
|       | 2月末                  | 4,978      | 0.0    | 97.2           |
|       | (期 末)<br>2021年3月22日  | 5,048      | 1.4    | 97.7           |
| 第160期 | (期 首)<br>2021年3月22日  | 5,038      | —      | 97.7           |
|       | 3月末                  | 5,076      | 0.8    | 96.8           |
|       | (期 末)<br>2021年4月22日  | 5,073      | 0.7    | 97.1           |
| 第161期 | (期 首)<br>2021年4月22日  | 5,063      | —      | 97.1           |
|       | 4月末                  | 5,129      | 1.3    | 97.7           |
|       | (期 末)<br>2021年5月24日  | 5,125      | 1.2    | 97.1           |
| 第162期 | (期 首)<br>2021年5月24日  | 5,115      | —      | 97.1           |
|       | 5月末                  | 5,163      | 0.9    | 97.2           |
|       | (期 末)<br>2021年6月22日  | 5,056      | △1.2   | 97.4           |

※期末基準価額は分配金込み、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(2020年12月23日から2021年6月22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 | 4,852円                        |
| 作成期末 | 5,116円<br>(当作成期分配金70円(税引前)込み) |
| 騰落率  | +5.5%<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)

※当ファンドの運用方針に対し適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

### 基準価額の主な変動要因(2020年12月23日から2021年6月22日まで)

当ファンドは、OECD(経済協力開発機構)加盟国およびこれに準ずる国ならびにFTSE世界国債インデックス採用国の中から、取得時において主要格付機関の自国通貨建長期債務格付けがBBB格(投資適格)相当以上の国の現地通貨建て短期ソブリン債券(政府や政府機関、国際機関などが発行する債券)等を主要投資対象とし、相対的に金利の高い国に投資しました。外貨建資産については対円での為替ヘッジを行っていません。

#### 上昇要因

- 良好な投資家心理を背景に、全ての投資国通貨が対円で上昇したこと

#### 下落要因

- ワクチン接種の進捗に伴う景気回復期待などを背景に、殆どの投資国の短期金利が上昇(債券価格は下落)したこと

投資環境について(2020年12月23日から2021年6月22日まで)

投資国の短期債券市場では、殆どの投資国の短期金利が上昇しました。為替市場では、全ての投資通貨が対円で上昇しました。

### 債券市場

先進国債券市場の短期金利は、多くの国で新型コロナワクチン接種の進展などによる景気回復期待の高まりとともに、各国中央銀行によるこれまでの大規模な金融緩和から段階的な金融正常化に向かうとの思惑から、作成期末にかけて殆どの国の短期金利が上昇しました。一方で、強力な緩和策の継続方針を示しているオーストラリアの短期金利は低位での横ばい推移となりました。

新興国債券市場についても、金融政策の正常化観測が強まったメキシコ、ポーランドの短期金利は上昇しました。

当作成期の市場の動きを米国2年国債利回りで見ると、作成期首0.12%から作成期末0.25%へと上昇しました。オーストラリアを除く、カナダ、ノルウェーなど他の先進国でも短期金利は上昇しました。

メキシコ2年国債利回りは作成期首4.36%から作成期末5.16%へと上昇しました。ポーランドの短期金利も上昇しました。

### 為替市場

為替市場では、ワクチン普及への期待によるグローバルな株価上昇や資源価格の上昇などによるリスク選好の動きから、全ての投資国通貨が、対円で上昇基調となりました。

当作成期の米ドル・円は、作成期首103円34銭から作成期末110円28銭と6円94銭の米ドル高・円安となりました。メキシコペソは作成期首5円16銭から作成期末5円37銭と0円21銭のメキシコペソ高・円安となりました。

ポートフォリオについて(2020年12月23日から2021年6月22日まで)

●組入国(通貨)別配分

組入国(通貨)への均等分散投資を維持しました。組入国(通貨)については、作成期初はノルウェー、ニュージーランド、カナダ、ポーランド、シンガポール、アメリカ、オーストラリア、メキシコの8カ国(通貨)の組入でスタートしました。当作成期中は、金利水準・市場動向や流動性等を勘案し、作成期末までこれらの組入国(通貨)を維持しました。

●種別配分

債券種別は、国債を中心に組み入れましたが、格付けの制限からメキシコでは、国際機関債を組み入れました。

●格付け別配分

組入債券の格付けは取得時における主要格付機関の信用格付けがA格相当以上とし、ポートフォリオ全体の平均格付けについてもAA格相当以上としました。

●残存期間別配分

組入債券の年限は、概ね3年以内に償還を迎える短期債券への投資を継続しました。

ベンチマークとの差異について(2020年12月23日から2021年6月22日まで)

ベンチマークおよび参考指数を設けていませんので、この項目に記載する事項はありません。

分配金について(2020年12月23日から2021年6月22日まで)

当作成期の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、第157期、第158期をそれぞれ15円、第159期から第162期は、基準価額が下落傾向で推移したことや市況動向等を勘案した結果、今後も継続的な分配を行うことを目指し、それぞれ10円といたしました。

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。

## グローバル高金利通貨ファンド【愛称：プレミアムエイト】

(単位：円、1万口当たり、税引前)

| 項目        | 第157期    | 第158期    | 第159期    | 第160期    | 第161期    | 第162期    |
|-----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| 当期分配金     | 15       | 15       | 10       | 10       | 10       | 10       |
| (対基準価額比率) | (0.305%) | (0.300%) | (0.198%) | (0.197%) | (0.195%) | (0.198%) |
| 当期の収益     | 11       | 10       | 10       | 10       | 10       | 7        |
| 当期の収益以外   | 3        | 4        | -        | -        | -        | 2        |
| 翌期繰越分配対象額 | 606      | 602      | 603      | 604      | 607      | 605      |

※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

米国では、ワクチン接種の進展や経済対策による景気の回復を背景に、金融緩和政策の縮小が意識されていく中で、短期金利は緩やかに水準を切り上げる動きを予想します。ユーロ圏では、ワクチンの普及やEU(欧州連合)復興基金による景気の回復に伴い、長期金利には上昇圧力がかかりやすいと想定されますが、ECB(欧州中央銀行)による大規模な金融緩和政策が継続することから、短期金利は低位での動きを予想します。

為替相場は、リスク回避やポジション調整等を背景とした円買いの動きが、一時的に強まる可能性はありますが、ワクチン普及への期待に加えて、日銀の金融緩和政策が長期にわたって維持される見通しであることや、日本からの根強い対外証券投資による資金フローなどが中期的に円安要因として働き、相

対的に金利水準の高い通貨は円に対して底堅く推移していくものと見込んでいます。

新興国については、ワクチン普及への期待感や高利回り資産への投資需要が通貨や債券相場の上昇要因になると予想します。

以上の見通しを背景に、今後の運用方針は引き続き相対的に高金利の8通貨を選定し、当該通貨建ての債券に分散投資を行い、安定した収益の確保を目指して機動的なファンド運営を行います。

## 3 お知らせ

### 約款変更について

該当事項はございません。



## グローバル高金利通貨ファンド【愛称：プレミアムエイト】

### 1万口当たりの費用明細 (2020年12月23日から2021年6月22日まで)

| 項目          | 金額        | 比率           | 項目の概要                                                         |
|-------------|-----------|--------------|---------------------------------------------------------------|
| (a) 信託報酬    | 26円       | 0.521%       | 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)<br><b>期中の平均基準価額は5,018円です。</b> |
| （投信会社）      | (12)      | (0.247)      | 投信会社：ファンド運用の指図等の対価                                            |
| （販売会社）      | (12)      | (0.247)      | 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)       | (0.027)      | 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) 売買委託手数料 | -         | -            | 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                                 |
| （株式）        | (-)       | (-)          | 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                               |
| （投資信託証券）    | (-)       | (-)          |                                                               |
| （先物・オプション）  | (-)       | (-)          |                                                               |
| (c) 有価証券取引税 | -         | -            | 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                                 |
| （株式）        | (-)       | (-)          | 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                                |
| （公社債）       | (-)       | (-)          |                                                               |
| （投資信託証券）    | (-)       | (-)          |                                                               |
| (d) その他費用   | 3         | 0.055        | 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）      | (3)       | (0.053)      | 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)       | (0.002)      | 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>29</b> | <b>0.576</b> |                                                               |

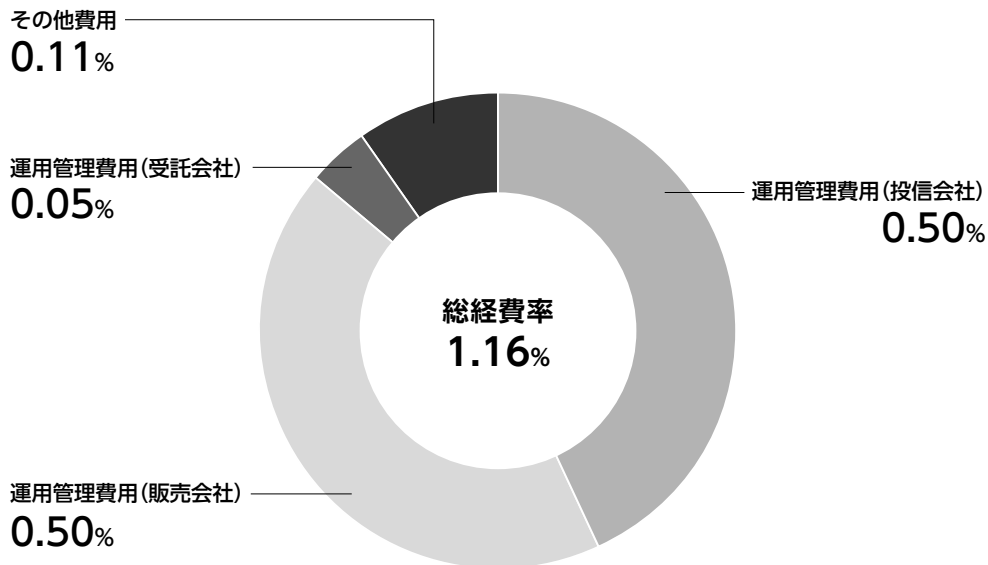
※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※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。



## 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1.16%です。

## グローバル高金利通貨ファンド【愛称：プレミアムエイト】

### ■ 当作成期中の売買及び取引の状況 (2020年12月23日から2021年6月22日まで)

公社債

|   |                 |         | 当 作 成 期              |                      |
|---|-----------------|---------|----------------------|----------------------|
|   |                 |         | 買 付 額                | 売 付 額                |
| 外 | ア メ リ カ         | 国 債 証 券 | 千米ドル<br>859          | 千米ドル<br>907          |
|   | カ ナ ダ           | 国 債 証 券 | 千カナダドル<br>1,155      | 千カナダドル<br>1,236      |
|   | メ キ シ コ         | 特 殊 債 券 | 千メキシコペソ<br>1,259     | 千メキシコペソ<br>-         |
|   | ノ ル ウ ェ ー       | 国 債 証 券 | 千ノルウェークローネ<br>7,548  | 千ノルウェークローネ<br>8,246  |
|   | ポ ー ラ ン ド       | 国 債 証 券 | 千ポーランドズロチ<br>3,308   | 千ポーランドズロチ<br>3,420   |
|   | オ ー ス ト ラ リ ア   | 国 債 証 券 | 千オーストラリアドル<br>-      | 千オーストラリアドル<br>93     |
| 国 | ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド | 国 債 証 券 | 千ニュージーランドドル<br>1,239 | 千ニュージーランドドル<br>1,312 |
|   | シ ン ガ ポ ー ル     | 国 債 証 券 | 千シンガポールドル<br>1,180   | 千シンガポールドル<br>1,257   |

※金額は受渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

### ■ 利害関係人との取引状況等 (2020年12月23日から2021年6月22日まで)

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。

※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。

### ■ 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 (2020年12月23日から2021年6月22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 (2021年6月22日現在)

公社債

A 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

| 区 分     | 作 成 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      |
| ア メ リ カ | 千米ドル<br>860 | 千米ドル<br>858 | 千円<br>94,640 | %<br>12.3 | %<br>-          | %<br>-    | %<br>- | %<br>12.3 |

## グローバル高金利通貨ファンド【愛称：プレミアムエイト】

| 区 分       | 作 成 期 末              |                      |         |      |                 |           |      |      |
|-----------|----------------------|----------------------|---------|------|-----------------|-----------|------|------|
|           | 額 面 金 額              | 評 価 額                |         | 組入比率 | うち88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 |
| カ ナ ダ     | 千カナダドル<br>1,040      | 千カナダドル<br>1,073      | 95,634  | 12.4 | —               | —         | 12.4 | —    |
| メ キ シ コ   | 千メキシコペソ<br>17,900    | 千メキシコペソ<br>18,317    | 98,412  | 12.7 | —               | —         | —    | 12.7 |
| ノ ル ウ ェ ー | 千ノルウェークローネ<br>6,900  | 千ノルウェークローネ<br>7,083  | 90,946  | 11.8 | —               | —         | —    | 11.8 |
| ポ ー ラ ン ド | 千ポーランドズロチ<br>3,000   | 千ポーランドズロチ<br>3,248   | 94,176  | 12.2 | —               | —         | 12.2 | —    |
| オーストラリア   | 千オーストラリアドル<br>1,090  | 千オーストラリアドル<br>1,123  | 93,214  | 12.1 | —               | —         | —    | 12.1 |
| ニュージーランド  | 千ニュージーランドドル<br>1,090 | 千ニュージーランドドル<br>1,188 | 91,441  | 11.8 | —               | —         | —    | 11.8 |
| シンガポール    | 千シンガポールドル<br>1,090   | 千シンガポールドル<br>1,140   | 93,524  | 12.1 | —               | —         | 12.1 | —    |
| 合 計       | —                    | —                    | 751,991 | 97.4 | —               | —         | 36.7 | 60.7 |

※邦貨換算金額は、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。

※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

| 種 類                    | 銘 柄                   | 作 成 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       |            |  |
| (アメリカ) 国債証券            | US TREASURY N/B 0.125 | %<br>0.125 | 千米ドル<br>860          | 千米ドル<br>858          | 千円<br>94,640 | 2023/5/15  |  |
| (カナダ) 国債証券             | CANADA-GOV'T 2        | 2.0        | 千カナダドル<br>1,040      | 千カナダドル<br>1,073      | 95,634       | 2023/9/1   |  |
| (メキシコ) 特殊債券<br>(除く金融債) | INT BK RECON&DEV 7    | 7.0        | 千メキシコペソ<br>17,900    | 千メキシコペソ<br>18,317    | 98,412       | 2023/1/24  |  |
| (ノルウェー) 国債証券           | NORWEGIAN GOV'T 2     | 2.0        | 千ノルウェークローネ<br>6,900  | 千ノルウェークローネ<br>7,083  | 90,946       | 2023/5/24  |  |
| (ポーランド) 国債証券           | POLAND GOVT BOND 4    | 4.0        | 千ポーランドズロチ<br>3,000   | 千ポーランドズロチ<br>3,248   | 94,176       | 2023/10/25 |  |
| (オーストラリア) 国債証券         | AUSTRALIAN GOVT. 2.25 | 2.25       | 千オーストラリアドル<br>1,090  | 千オーストラリアドル<br>1,123  | 93,214       | 2022/11/21 |  |
| (ニュージーランド) 国債証券        | NEW ZEALAND GVT 5.5   | 5.5        | 千ニュージーランドドル<br>1,090 | 千ニュージーランドドル<br>1,188 | 91,441       | 2023/4/15  |  |
| (シンガポール) 国債証券          | SINGAPORE GOV'T 2.75  | 2.75       | 千シンガポールドル<br>1,090   | 千シンガポールドル<br>1,140   | 93,524       | 2023/7/1   |  |
| 合 計                    |                       | —          | —                    | —                    | 751,991      | —          |  |

※邦貨換算金額は、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。

## グローバル高金利通貨ファンド【愛称：プレミアムエイト】

### ■ 投資信託財産の構成

(2021年6月22日現在)

| 項 目                     | 作 成 期 末 |       |
|-------------------------|---------|-------|
|                         | 評 価 額   | 比 率   |
|                         | 千円      | %     |
| 公 社 債                   | 751,991 | 97.1  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 22,626  | 2.9   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 774,617 | 100.0 |

※作成期末における外貨建資産(766,127千円)の投資信託財産総額(774,617千円)に対する比率は98.9%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米ドル=110.28円、1カナダドル=89.05円、1メキシコペソ=5.3727円、1ノルウェークローネ=12.84円、1ポーランドズロチ=28.9884円、1オーストラリアドル=82.95円、1ニュージーランドドル=76.95円、1シンガポールドル=81.99円です。

### ■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年1月22日) (2021年2月22日) (2021年3月22日) (2021年4月22日) (2021年5月24日) (2021年6月22日)

| 項 目                   | 第157期末                | 第158期末                | 第159期末                | 第160期末                | 第161期末                | 第162期末                |
|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| <b>(A) 資 産</b>        | <b>787,389,081円</b>   | <b>785,025,020円</b>   | <b>788,018,316円</b>   | <b>789,593,497円</b>   | <b>787,815,066円</b>   | <b>774,617,138円</b>   |
| コール・ローン等              | 6,697,955             | 12,842,866            | 11,949,167            | 17,195,089            | 16,963,255            | 14,755,834            |
| 公社債(評価額)              | 760,867,129           | 765,424,289           | 768,102,800           | 764,699,784           | 762,214,443           | 751,991,122           |
| 未収入金                  | 8,116,452             | —                     | —                     | —                     | —                     | —                     |
| 未収利息                  | 5,628,029             | 6,104,086             | 4,233,001             | 3,858,881             | 4,804,996             | 6,109,096             |
| 前払費用                  | 5,533,165             | 45,540                | 3,063,503             | 3,113,913             | 3,044,717             | 1,635,377             |
| その他未収収益               | 546,351               | 608,239               | 669,845               | 725,830               | 787,655               | 125,709               |
| <b>(B) 負 債</b>        | <b>5,742,866</b>      | <b>3,349,854</b>      | <b>2,192,600</b>      | <b>2,273,640</b>      | <b>2,825,785</b>      | <b>2,188,270</b>      |
| 未払収益分配金               | 2,391,018             | 2,355,809             | 1,559,745             | 1,554,997             | 1,534,533             | 1,530,791             |
| 未払解約金                 | 2,649,476             | 299,036               | 101                   | 15,301                | 564,354               | 10                    |
| 未払信託報酬                | 699,397               | 692,090               | 630,101               | 700,273               | 723,817               | 654,672               |
| 未払利息                  | 22                    | 15                    | 9                     | 6                     | 13                    | 22                    |
| その他未払費用               | 2,953                 | 2,904                 | 2,644                 | 3,063                 | 3,068                 | 2,775                 |
| <b>(C) 純資産総額(A-B)</b> | <b>781,646,215</b>    | <b>781,675,166</b>    | <b>785,825,716</b>    | <b>787,319,857</b>    | <b>784,989,281</b>    | <b>772,428,868</b>    |
| 元 本                   | 1,594,012,105         | 1,570,539,456         | 1,559,745,395         | 1,554,997,537         | 1,534,533,932         | 1,530,791,355         |
| 次期繰越損益金               | △ 812,365,890         | △ 788,864,290         | △ 773,919,679         | △ 767,677,680         | △ 749,544,651         | △ 758,362,487         |
| <b>(D) 受益権総口数</b>     | <b>1,594,012,105口</b> | <b>1,570,539,456口</b> | <b>1,559,745,395口</b> | <b>1,554,997,537口</b> | <b>1,534,533,932口</b> | <b>1,530,791,355口</b> |
| 1万口当たり基準価額(C/D)       | <b>4,904円</b>         | <b>4,977円</b>         | <b>5,038円</b>         | <b>5,063円</b>         | <b>5,115円</b>         | <b>5,046円</b>         |

※当作成期における作成期首元本額1,621,016,786円、作成期中追加設定元本額4,049,902円、作成期中一部解約元本額94,275,333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。

## グローバル高金利通貨ファンド【愛称：プレミアムエイト】

### ■ 損益の状況

(自2020年12月23日 至2021年1月22日) (自2021年1月23日 至2021年2月22日) (自2021年2月23日 至2021年3月22日) (自2021年3月23日 至2021年4月22日) (自2021年4月23日 至2021年5月24日) (自2021年5月25日 至2021年6月22日)

| 項 目                       | 第157期          | 第158期          | 第159期          | 第160期          | 第161期          | 第162期          |
|---------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (A) 配 当 等 取 益             | 1,945,190円     | 1,808,864円     | 1,797,257円     | 2,028,703円     | 2,060,474円     | 1,838,695円     |
| 受 取 利 息                   | 1,906,375      | 1,758,816      | 1,739,663      | 1,975,132      | 2,008,352      | 1,777,018      |
| そ の 他 取 益 金               | 39,287         | 50,378         | 57,920         | 53,945         | 52,461         | 61,894         |
| 支 払 利 息                   | △ 472          | △ 330          | △ 326          | △ 374          | △ 339          | △ 217          |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益       | 9,407,033      | 12,871,107     | 9,917,627      | 4,292,755      | 8,304,740      | △ 10,297,230   |
| 売 買 益                     | 12,012,304     | 16,156,201     | 15,254,525     | 9,152,020      | 10,743,732     | 1,380,027      |
| 売 買 損                     | △ 2,605,271    | △ 3,285,094    | △ 5,336,898    | △ 4,859,265    | △ 2,438,992    | △ 11,677,257   |
| (C) 信 託 報 酬 等             | △ 777,992      | △ 785,066      | △ 632,745      | △ 880,488      | △ 801,111      | △ 657,450      |
| (D) 当 期 繰 越 損 益 金 (A+B+C) | 10,574,231     | 13,894,905     | 11,082,139     | 5,440,970      | 9,564,103      | △ 9,115,985    |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金         | △453,273,434   | △438,378,926   | △423,644,008   | △412,615,025   | △403,242,188   | △394,115,161   |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金       | △367,275,669   | △362,024,460   | △359,798,065   | △358,948,628   | △354,332,033   | △353,600,550   |
| (配当等相当額)                  | ( 4,207,225)   | ( 4,178,069)   | ( 4,205,046)   | ( 4,245,934)   | ( 4,213,868)   | ( 4,233,829)   |
| (売買損益相当額)                 | (△371,482,894) | (△366,202,529) | (△364,003,111) | (△363,194,562) | (△358,545,901) | (△357,834,379) |
| (G) 計 ( D + E + F )       | △809,974,872   | △786,508,481   | △772,359,934   | △766,122,683   | △748,010,118   | △756,831,696   |
| (H) 取 益 分 配 金             | △ 2,391,018    | △ 2,355,809    | △ 1,559,745    | △ 1,554,997    | △ 1,534,533    | △ 1,530,791    |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)       | △812,365,890   | △788,864,290   | △773,919,679   | △767,677,680   | △749,544,651   | △758,362,487   |
| 追 加 信 託 差 損 益 金           | △367,275,669   | △362,024,460   | △359,798,065   | △358,948,628   | △354,332,033   | △353,600,550   |
| (配当等相当額)                  | ( 4,207,225)   | ( 4,178,069)   | ( 4,205,046)   | ( 4,245,934)   | ( 4,213,868)   | ( 4,233,829)   |
| (売買損益相当額)                 | (△371,482,894) | (△366,202,529) | (△364,003,111) | (△363,194,562) | (△358,545,901) | (△357,834,379) |
| 分 配 準 備 積 立 金             | 92,530,781     | 90,491,890     | 89,954,808     | 89,818,706     | 88,979,643     | 88,383,010     |
| 繰 越 損 益 金                 | △537,621,002   | △517,331,720   | △504,076,422   | △498,547,758   | △484,192,261   | △493,144,947   |

※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。

※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。

※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157期      | 第158期      | 第159期      | 第160期      | 第161期      | 第162期      |
|----------------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| (a) 費用控除後の配当等取益                  | 1,811,920円 | 1,712,144円 | 1,700,194円 | 1,746,154円 | 1,901,213円 | 1,181,245円 |
| (b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の<br>有価証券売買等損益 | —          | —          | —          | —          | —          | —          |
| (c) 収益調整金                        | 4,207,225  | 4,178,069  | 4,205,046  | 4,245,934  | 4,213,868  | 4,233,829  |
| (d) 分配準備積立金                      | 93,109,879 | 91,135,555 | 89,814,359 | 89,627,549 | 88,612,963 | 88,732,556 |
| (e) 分配可能額(a+b+c+d)               | 99,129,024 | 97,025,768 | 95,719,599 | 95,619,637 | 94,728,044 | 94,147,630 |
| 1万口当たり分配可能額                      | 621        | 617        | 613        | 614        | 617        | 615        |
| (f) 分配金額                         | 2,391,018  | 2,355,809  | 1,559,745  | 1,554,997  | 1,534,533  | 1,530,791  |
| 1万口当たり分配金額(税引前)                  | 15         | 15         | 10         | 10         | 10         | 10         |

### ■ 分配金のお知らせ

| 1万口当たり分配金(税引前) | 第157期 | 第158期 | 第159期 | 第160期 | 第161期 | 第162期 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
|                | 15円   | 15円   | 10円   | 10円   | 10円   | 10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。