

メキシコ債券オープン (資産成長型)

【愛称：アミーゴ】

【運用報告書(全体版)】

(2021年5月25日から2021年11月22日まで)

第 17 期

決算日 2021年11月22日

■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	2013年8月23日から2027年5月24日まで
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、利息収益の確保と信託財産の中長期的な成長を図ることを目的と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。 メキシコ債券マザーファンド メキシコペソ建ての債券
当ファンドの運用方法	■メキシコペソ建ての債券を主要投資対象とします。 ■実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 ■メキシコの国債・政府機関債および国際機関債を中心に投資します。
組入制限	当ファンド ■株式への実質投資は行いません。 ■外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 メキシコ債券マザーファンド ■株式への投資は行いません。 ■外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	■年2回（原則として毎年5月および11月の22日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。 ■分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ■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。 ※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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;">ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。 (基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)</div>

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。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、利息収益の確保と信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。当期についても、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)

メキシコ債券オープン（資産成長型）【愛称：アミーゴ】

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			(参考指数) FTSEメキシコ国債 インデックス (円換算)		公 社 債 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率			
	円	円	%		%	%	百万円
13期 (2019年11月22日)	10,007	0	5.0	109.46	6.1	94.5	8,550
14期 (2020年5月22日)	9,015	0	△ 9.9	99.40	△ 9.2	94.2	6,253
15期 (2020年11月24日)	10,360	0	14.9	115.37	16.1	93.9	5,534
16期 (2021年5月24日)	10,551	0	1.8	118.51	2.7	95.7	4,318
17期 (2021年11月22日)	10,447	0	△ 1.0	118.68	0.1	97.0	3,622

※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。

※参考指数は、当報告書作成時に知りえた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

※参考指数は市場の動きを示す目的で記載しており、当ファンドが当該参考指数を意識して運用しているわけではありません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(参考指数) FTSEメキシコ国債 インデックス (円換算)		公 社 債 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2021年5月24日	円	%		%	%
5月末	10,551	—	118.51	—	95.7
6月末	10,717	1.6	120.67	1.8	96.3
7月末	10,791	2.3	121.92	2.9	97.4
8月末	10,643	0.9	120.36	1.6	97.6
9月末	10,592	0.4	119.85	1.1	97.1
10月末	10,421	△ 1.2	118.11	△ 0.3	93.0
(期 末) 2021年11月22日	10,584	0.3	120.10	1.3	91.9
	10,447	△ 1.0	118.68	0.1	97.0

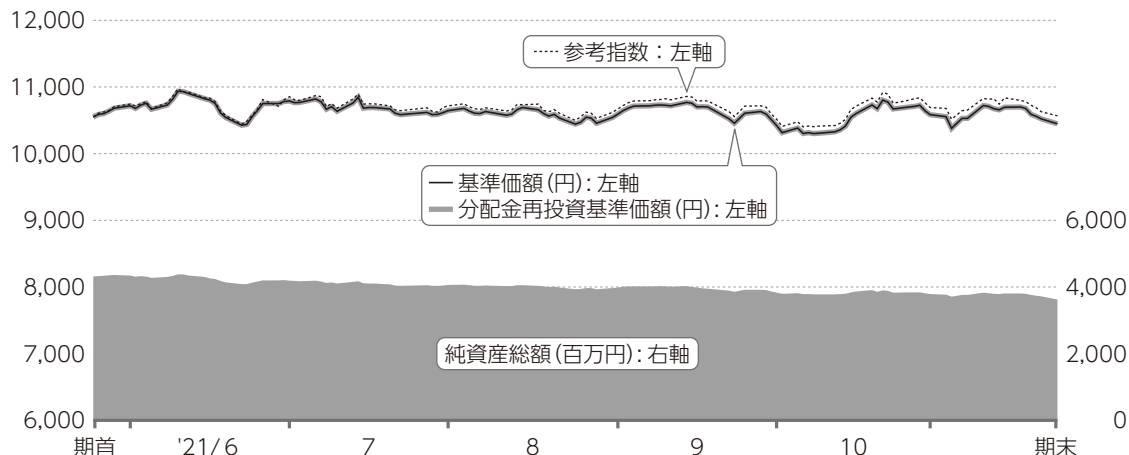
※騰落率は期首比です。

※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（2021年5月25日から2021年11月22日まで）

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額および参考指数は、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。

期首	10,551円
期末	10,447円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	-1.0% (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)

※当ファンドの参考指数は、FTSEメキシコ国債インデックス(円換算)です。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

基準価額の主な変動要因(2021年5月25日から2021年11月22日まで)

当ファンドは、メキシコ債券マザーファンドへの投資を通じて、メキシコペソ建てのメキシコの国債・政府機関債および国際機関債を中心に投資を行いました。

上昇要因

- 債券からインカムゲインを得たこと

下落要因

- 債券のキャピタルロスを計上したこと

投資環境について（2021年5月25日から2021年11月22日まで）

メキシコ債券相場は下落し、メキシコペソ円相場は横ばいとなりました。

債券市場

債券市場は、メキシコ国内のインフレ指標が上昇する中、メキシコ銀行(中央銀行)による利上げを受けて下落(金利は上昇)しました。

為替市場

メキシコペソ円相場は、先進国の中央銀行による将来の金融緩和策の縮小などを背景とした海外金利の先高観から円安圧力が高まった一方、米国の早期利上げ観測などを嫌気した新興国通貨売りからメキシコペソ安となり、概ね横ばいとなりました。

ポートフォリオについて（2021年5月25日から2021年11月22日まで）

当ファンド

主要投資対象であるメキシコ債券マザーファンドを期間を通じて高位に組み入れました。

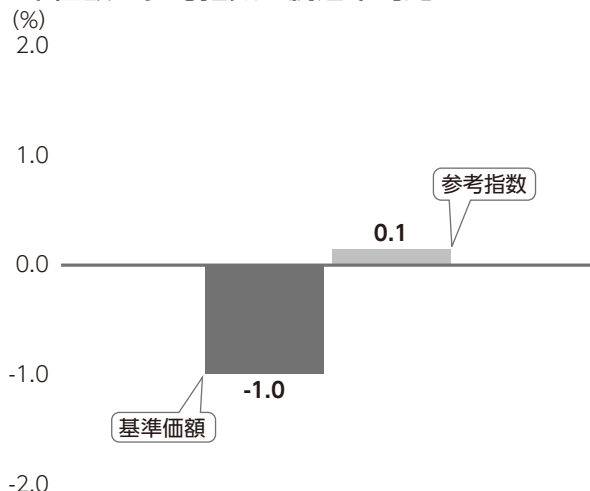
メキシコ債券マザーファンド

流動性が高いメキシコ国債の組み入れを高位とし、市場動向に応じてデュレーション*を機動的に調整しました。

*デュレーションとは、「投資元本の平均的な回収期間」を表す指標で、単位は「年」で表示されます。また、「金利の変動に対する債券価格の変動性」の指標としても利用され、一般的にこの値が長い(大きい)ほど、金利の変動に対する債券価格の変動が大きくなります。

ベンチマークとの差異について（2021年5月25日から2021年11月22日まで）

基準価額と参考指数の騰落率対比



当ファンドは運用の指標となるベンチマークはありませんが、参考指数としてFTSEメキシコ国債インデックス(円換算)を設けています。

左のグラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

※基準価額は分配金再投資ベース

分配金について（2021年5月25日から2021年11月22日まで）

(単位：円、1万口当たり、税引前)

項目	第17期
当期分配金	0
(対基準価額比率)	(0.00%)
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	5,439

期間の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りいたしました。

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、運用の基本方針に従い、マザーファンドへの投資を通じて、メキシコペソ建てのメキシコの国債・政府機関債および国際機関債を中心に投資することにより、利息収益の確保と信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。

メキシコ債券マザーファンド

先進国では将来の金融緩和策の縮小が意識されやすい環境となる中、メキシコにおいては、足元でインフレ指標が中央銀行の目標を大きく上回る上昇を見せ、メキシコ銀行は今後も利上げを継続するものと見込んでいます。一方、債券市場は中央銀行の利上げを先取りの織り込んでいる側面があり、金利水準の観点などからメキシコ金利の上昇余地が限られる可能性も想定されます。こうした状況下、当ファンドについては、メキシコ金利の上昇トレンドの継続性などを勘案しながら、デュレーションや残存構成の機動的な調整を実施する方針です。

3 お知らせ

約款変更について

- 信託期間の延長に伴う約款変更を行いました。

(適用日：2021年8月25日)

メキシコ債券オープン（資産成長型）【愛称：アミーゴ】

1万口当たりの費用明細（2021年5月25日から2021年11月22日まで）

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	72円	0.676%	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) 期中の平均基準価額は10,630円です。
（投信会社）	(35)	(0.327)	投信会社:ファンド運用の指図等の対価
（販売会社）	(35)	(0.327)	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）	(2)	(0.022)	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 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）	(-)	(-)	
(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 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）	(-)	(-)	
(d) その他費用	1	0.012	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）	(1)	(0.006)	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金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	(1)	(0.005)	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
合計	73	0.687	

※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。

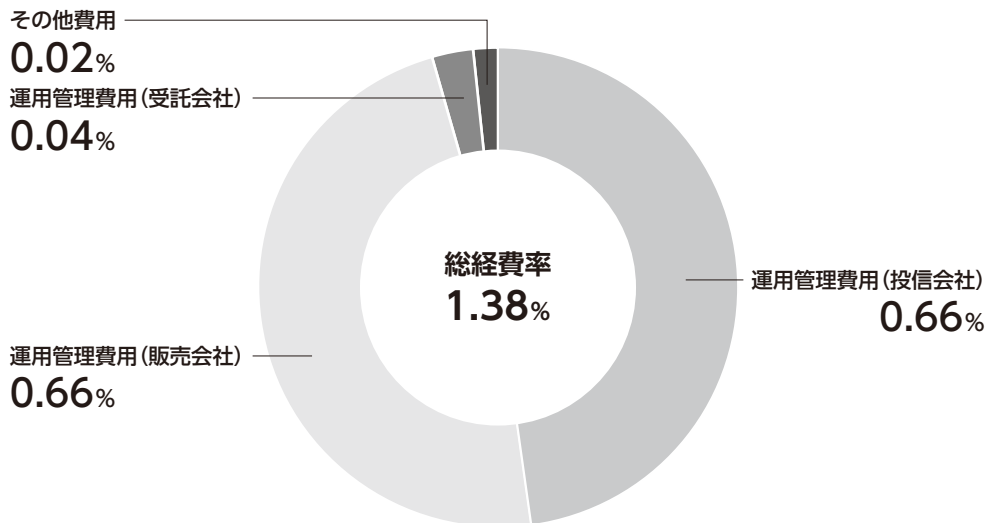
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※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1.38%です。

メキシコ債券オープン（資産成長型）【愛称：アミーゴ】

■ 当期中の売買及び取引の状況（2021年5月25日から2021年11月22日まで）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
メキシコ債券マザーファンド	千口 7,880	千円 13,748	千口 370,804	千円 652,268

■ 利害関係人との取引状況等（2021年5月25日から2021年11月22日まで）

当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 (2021年5月25日から2021年11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11月22日現在）

親投資信託残高

種 類	期 首（前期末）		期 末	
	口 数	金 額	口 数	評 価 額
メキシコ債券マザーファンド	千口 2,496,491	千円 2,133,566	千口 3,692,350	千円 3,692,350

※メキシコ債券マザーファンドの期末の受益権総口数は14,248,584,014口です。

■ 投資信託財産の構成

(2021年11月22日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
メキシコ債券マザーファンド	千円 3,692,350	% 99.1
コール・ローン等、その他	35,296	0.9
投資信託財産総額	3,727,647	100.0

※メキシコ債券マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産（24,629,644千円）の投資信託財産総額（24,954,571千円）に対する比率は98.7%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メキシコ・ペソ=5.473円です。

メキシコ債券オープン（資産成長型）【愛称：アミーゴ】

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年11月22日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	3,727,647,627円
コール・ローン等	791,198
メキシコ債券マザーファンド(評価額)	3,692,350,781
未 収 入 金	34,505,648
(B) 負 債	105,578,460
未 払 解 約 金	78,089,623
未 払 信 託 報 酬	27,269,013
そ の 他 未 払 費 用	219,824
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	3,622,069,167
元 本	3,467,212,925
次 期 繰 越 損 益 金	154,856,242
(D) 受 益 権 総 口 数	3,467,212,925口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	10,447円

※当期における期首元本額4,092,686,087円、期中追加設定元本額37,987,215円、期中一部解約元本額663,460,377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。

■ 分配金のお知らせ

1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	当	期

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。

■ 損益の状況

(自2021年5月25日 至2021年11月22日)

項 目	当	期
(A) 配 当 等 収 益	△	191円
受 取 利 息		12
支 払 利 息	△	203
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△	8,967,522
売 買 益 損		10,345,776
売 買 損 益	△	19,313,298
(C) 信 託 報 酬 等	△	27,488,837
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△	36,456,550
(E) 前 期 繰 越 損 益 金		407,525,119
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△	216,212,327
(配 当 等 相 当 額)		(1,164,509,090)
(売 買 損 益 相 当 額)		(△1,380,721,417)
(G) 合 計 (D + E + F)		154,856,242
次 期 繰 越 損 益 金 (G)		154,856,242
追 加 信 託 差 損 益 金	△	216,212,327
(配 当 等 相 当 額)		(1,164,678,445)
(売 買 損 益 相 当 額)		(△1,380,890,772)
分 配 準 備 積 立 金		721,474,342
繰 越 損 益 金	△	350,405,773

※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。

※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。

	当	期
(a) 経費控除後の配当等収益		107,186,796円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益		0
(c) 収益調整金		1,164,678,445
(d) 分配準備積立金		614,287,546
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)		1,886,152,787
1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額		5,439.97
(f) 分配金		0
1 万 口 当 た り 分 配 金		0

メキシコ債券マザーファンド

運用報告書

決算日：2021年5月24日

(第9期：2020年5月23日～2021年5月24日)

当ファンドは、上記の通り決算を行いました。ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	親投資信託
信託期間	無期限
運用方針	主にメキシコの債券に投資することにより、利息収益の確保と中長期的な信託財産の成長を目指します。
主要運用対象	メキシコペソ建ての債券を主要投資対象とします。
投資制限	<ul style="list-style-type: none">・株式への投資は行いません。・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。



三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1

<https://www.smd-am.co.jp>

メキシコ債券マザーファンド

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSEメキシコ国債 インデックス (円換算)		公社債 組入比率	債券先物 組入比率	純資産 総額
	円	%	(参考指数)	%			
第5期 (2017年5月22日)	14,034	△ 0.3	14,066	△ 0.0	95.3	—	百万円 56,620
第6期 (2018年5月22日)	13,780	△ 1.8	13,855	△ 1.5	95.7	—	60,059
第7期 (2019年5月22日)	15,228	10.5	15,315	10.5	87.8	—	50,494
第8期 (2020年5月22日)	14,611	△ 4.1	14,757	△ 3.6	93.4	—	35,803
第9期 (2021年5月24日)	17,354	18.8	17,594	19.2	95.4	—	28,955

FTSEメキシコ国債インデックス (円換算) とは、FTSEメキシコ国債インデックス (メキシコベース) を委託者が円換算し、設定日を10,000として指数化したものです。

FTSEメキシコ国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

*先物組入比率は、買建比率－売建比率

当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額		FTSEメキシコ国債 インデックス (円換算)		公社債 組入比率	債券先物 組入比率
	円	%	(参考指数)	%		
(期首) 2020年5月22日	14,611	—	14,757	—	93.4	—
5月末	14,972	2.5	15,106	2.4	93.6	—
6月末	14,736	0.9	14,890	0.9	95.0	—
7月末	15,219	4.2	15,382	4.2	96.7	—
8月末	15,426	5.6	15,611	5.8	96.1	—
9月末	15,157	3.7	15,344	4.0	95.5	—
10月末	15,679	7.3	15,891	7.7	93.7	—
11月末	16,895	15.6	17,089	15.8	94.2	—
12月末	17,323	18.6	17,513	18.7	96.9	—
2021年1月末	17,240	18.0	17,434	18.1	96.3	—
2月末	16,588	13.5	16,742	13.5	95.5	—
3月末	16,993	16.3	17,156	16.3	95.6	—
4月末	17,248	18.0	17,493	18.5	95.9	—
(期末) 2021年5月24日	17,354	18.8	17,594	19.2	95.4	—

*騰落率は期首比です。

*先物組入比率は、買建比率－売建比率

運用経過

【基準価額等の推移】

期首：14,611円

期末：17,354円

騰落率：+18.8%

【基準価額の主な変動要因】

(上昇要因)

メキシコペソの対円での上昇や、債券から得られるインカムゲインが要因となりました。

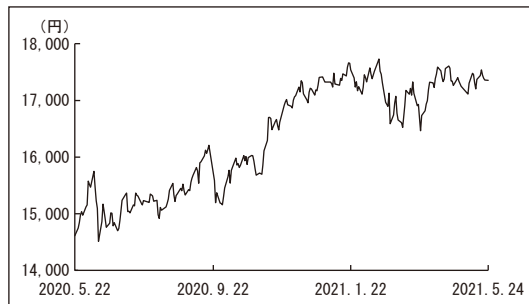
【投資環境】

当期、メキシコ債券相場、メキシコペソ円相場はともに上昇しました。

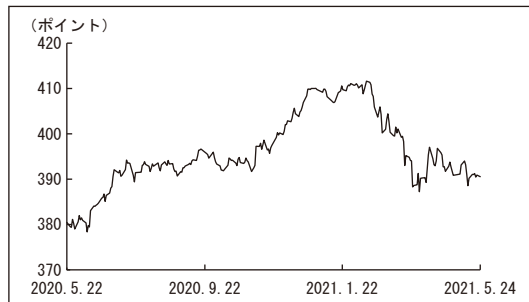
期前半は、新型コロナウイルスの感染者数の動向を意識しながらも、先進国の強力な金融緩和策がサポートとなるなか、メキシコ銀行（中央銀行）の利下げも後押しとなり、メキシコ債券利回りは低下（債券価格は上昇）基調をたどりました。期後半も、米大統領選挙におけるバイデン陣営の勝利を受けた米国との関係改善への期待や、新型コロナウイルスのワクチン開発に対する期待などを背景にセンチメント（市場心理）が上向くなか、メキシコ債券利回りの低下が続きましたが、2021年2月以降は、米国における経済活動の再開や金融緩和策の正常化観測が浮上し、米国金利が大きく上昇したことを警戒し、メキシコ債券利回りも上昇（債券価格は下落）に転じる展開となりました。また、メキシコ国内においては、インフレ指標が市場予想を上回って上昇したことで、利下げ期待が後退し、利上げ観測が高まったことも債券利回りの上昇に寄与しました。

為替市場では、先進国の金融緩和策がサポートとなり、米国株式市場が堅調に推移するなか、良好なセンチメントに支えられ、メキシコペソ円は対円で上昇基調をたどりました。

基準価額の推移



FTSEメキシコ国債インデックス
(メキシコペソベース)の推移



為替レート (メキシコペソ/円)の推移



メキシコ債券マザーファンド

【ポートフォリオ】

当期の騰落率は、+18.8%となりました。

デュレーション*は、期前半は、新型コロナウイルスの感染拡大による経済面への悪影響などを背景に中央銀行の緩和的な姿勢が維持されるとの見方を背景に長めのポジションとしました。期後半は、2020年11月から2021年2月にかけて、米国との関係改善への期待などを背景にセンチメントが上向き、メキシコ債券への資金流入が期待されたため、デュレーションを長めのポジションとしましたが、2月以降は、米国金利の上昇が加速し、警戒感が高まるなか、メキシコ債券利回りの上昇のリスクが高まったため、デュレーションを短めとするなど、機動的にポジションを調整しました。

*デュレーションとは、「投資元本の平均的な回収期間」を表す指標で、単位は「年」で表示されます。また、「金利の変動に対する債券価格の変動性」の指標としても利用され、一般的にこの値が長い（大きい）ほど、金利の変動に対する債券価格の変動が大きくなります。

【ベンチマークとの差異】

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

基準価額の騰落率は、参考指数であるFTSEメキシコ国債インデックス（円換算）の騰落率+19.2%を0.4%下回りました。

今後の運用方針

先進国では金融政策の正常化が意識されやすい環境となるなか、メキシコにおいては、足元でインフレ指標が市場予想を上回る上昇を見せ、利上げ期待が高まる状況となっており、金融政策の方向性に潮目の変化が出てきている兆しが見られます。こうした状況のなか、当ファンドについては、メキシコ銀行が利上げに転じる展開も十分に考慮し、デュレーションや残存構成の機動的な調整を実施する方針です。

債券種別構成

(2021年5月24日現在)

種別	比率
国債	95.4%
キャッシュ等	4.6%

*純資産総額に対する評価額の割合

メキシコ債券マザーファンド

1万口当りの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2020年5月23日～2021年5月24日		
	金額	比率	
その他費用 (保管費用)	2円 (2)	0.011% (0.010)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	2	0.011	

期中の平均基準価額は16,123円です。

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

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

* 円未満は四捨五入しています。

売買及び取引の状況

(2020年5月23日から2021年5月24日まで)

■公社債

			買付額	売付額
外国	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 3,291,761	千メキシコ・ペソ 5,100,391

* 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれていません。）

利害関係人との取引状況等

(2020年5月23日から2021年5月24日まで)

該当事項はございません。

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

メキシコ債券マザーファンド

組入資産の明細

2021年5月24日現在

■ 公社債

A 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
メキシコ	千メキシコ・ペソ 4,776,000	千メキシコ・ペソ 5,047,338	千円 27,611,971	% 95.4	% —	% 46.3	% 27.5	% 21.6
合 計	—	—	27,611,971	95.4	—	46.3	27.5	21.6

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合

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

B 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債

銘 柄	当 期 末						償還年月日
	種 類	利 率	額面金額	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(メキシコ・ペソ…メキシコ)		%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円		
MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	8.0000	384,000	406,713	2,224,967	2023/12/07	
MEXICAN FIXED RATE BONDS	国債証券	10.0000	318,000	359,289	1,965,527	2024/12/05	
MEX BONOS DE DESARROLLO	国債証券	7.5000	356,000	374,690	2,049,779	2027/06/03	
MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	10.0000	120,000	149,702	818,961	2036/11/20	
MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	450,000	501,862	2,745,488	2029/05/31	
MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.5000	331,500	361,729	1,978,877	2038/11/18	
MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	320,000	340,723	1,863,960	2031/05/29	
MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	6.5000	395,500	401,847	2,198,348	2022/06/09	
MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	268,000	269,790	1,475,914	2042/11/13	
MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	7.7500	142,000	149,597	818,385	2034/11/23	
MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	5.7500	358,000	350,829	1,919,246	2026/03/05	
MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	293,000	300,125	1,641,867	2047/11/07	
MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	8.0000	320,000	340,336	1,861,842	2024/09/05	
MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	6.7500	720,000	740,102	4,048,804	2023/03/09	
合 計	—	—	4,776,000	5,047,338	27,611,971	—	

*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。

メキシコ債券マザーファンド

投資信託財産の構成

2021年5月24日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	27,611,971	88.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,575,627	11.5
投 資 信 託 財 産 総 額	31,187,598	100.0

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

1メキシコ・ペソ=5.47円

*当期末における外貨建資産（28,803,134千円）の投資信託財産総額（31,187,598千円）に対する比率 92.4%

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2021年5月24日) 現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	31,825,928,325円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	472,690,799
公 社 債 (評 価 額)	27,611,971,311
未 収 入 金	2,951,435,815
未 収 利 息	604,205,344
前 払 費 用	185,625,056
(B) 負 債	2,870,713,537
未 払 金	2,641,580,843
未 払 解 約 金	229,132,694
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	28,955,214,788
元 本	16,685,444,957
次 期 繰 越 損 益 金	12,269,769,831
(D) 受 益 権 総 口 数	16,685,444,957口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D)	17,354円

*元本状況

期首元本額 24,504,009,264円

期中追加設定元本額 510,408,644円

期中一部解約元本額 8,328,972,951円

*元本の内訳

メキシコ債券オープン（毎月分配型） 14,188,953,145円

メキシコ債券オープン（資産成長型） 2,496,491,812円

損益の状況

自2020年5月23日
至2021年5月24日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,457,555,470円
受 取 利 息	2,457,826,806
支 払 利 息	△ 271,336
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,426,410,418
売 買 益 損	4,943,723,081
売 買 損 益	△ 1,517,312,663
(C) そ の 他 費 用	3,470,003
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	5,880,495,885
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	11,299,714,604
(F) 解 約 差 損 益 金	△ 5,186,756,625
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	276,315,967
(H) 計 (D + E + F + G)	12,269,769,831
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	12,269,769,831

*有価証券売買損益には、期末の評価換えによるものを含みます。

*解約差損益金とは、一部解約時の解約金額と元本の差額をいい、元本を下回る額は利益として、上回る額は損失として処理されます。

*追加信託差損益金とは、追加信託金と元本の差額をいい、元本を下回る額は損失として、上回る額は利益として処理されます。

お知らせ

該当事項はございません。

※各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しております。