

運用報告書 (全体版)

グローバル・ボンド・ポート 毎月決算コース (為替ヘッジなし)

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	2002年7月19日から無期限です。	
運用方針	信託財産の成長をはかることを目標に運用を行います。	
主要投資対象	グローバル・ボンド・ポート 毎月決算コース (為替ヘッジなし)	グローバル・ボンド・ポート・マザー ファンド受益証券を主要投資対象とし ます。
	グローバル・ボンド・ポート・マザーファンド	わが国を除く世界主要国の公社債を主 要投資対象とします。
運用方法	「FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし)」を運用にあたってのベンチマークと し、インデックスを上回る成果の実現をめざします。 実質外貨建資産については、対円での為替ヘッジは行いま せん。	
組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使およ び社債権者割当等により取得するものに限ります。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。	
分配方針	決算日 (原則として毎月10日。休業日の場合は翌営業 日。)に、原則として利子等収益の範囲内で安定的に分配 を行います。また、毎年6月および12月の決算時には、原 則として利子等収益に売買益 (評価益を含みます。)等 を加えた額から分配を行います。分配金額につきましては、 基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断に より決定します。但し、分配対象額が少額の場合には、分 配を行わない場合があります。	

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された
販売会社にお問い合わせください。

第230期	<決算日	2021年10月11日>
第231期	<決算日	2021年11月10日>
第232期	<決算日	2021年12月10日>
第233期	<決算日	2022年1月11日>
第234期	<決算日	2022年2月10日>
第235期	<決算日	2022年3月10日>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼
申し上げます。

さて、「グローバル・ボンド・ポート
毎月決算コース (為替ヘッジなし)」
は、2022年3月10日に第235期の決算
を行いました。ここに、運用経過等をご
報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう
お願い申し上げます。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

グローバル・ボンド・ポート 毎月決算コース (為替ヘッジなし)

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			F T S E 世界国債 インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし ベンチマーク)		債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
		(分配)	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率			
第36作成期	206期 (2019年10月10日)	円	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
	207期 (2019年11月11日)	8,047	10	0.1	465.39	0.3	98.0	-	4,756
	208期 (2019年12月10日)	8,025	10	△0.1	465.70	0.1	97.7	-	4,707
	209期 (2020年1月10日)	8,032	10	0.2	467.04	0.3	97.8	-	4,675
	210期 (2020年2月10日)	8,098	10	0.9	471.04	0.9	97.9	-	4,682
	211期 (2020年3月10日)	8,186	10	1.2	477.87	1.5	97.7	-	4,697
第37作成期	212期 (2020年4月10日)	8,195	10	0.2	474.94	△0.6	96.8	-	4,673
	213期 (2020年5月11日)	8,173	10	△0.1	479.59	1.0	97.4	-	4,641
	214期 (2020年6月10日)	8,065	10	△1.2	471.78	△1.6	97.0	-	4,565
	215期 (2020年7月10日)	8,267	10	2.6	485.95	3.0	97.9	-	4,669
	216期 (2020年8月11日)	8,307	10	0.6	490.33	0.9	97.9	-	4,647
	217期 (2020年9月10日)	8,438	10	1.7	497.05	1.4	98.0	-	4,693
第38作成期	218期 (2020年10月12日)	8,393	10	△0.4	496.26	△0.2	97.9	-	4,653
	219期 (2020年11月10日)	8,338	10	△0.5	495.37	△0.2	97.8	-	4,607
	220期 (2020年12月10日)	8,242	10	△1.0	492.35	△0.6	98.3	-	4,518
	221期 (2021年1月12日)	8,321	10	1.1	496.29	0.8	98.0	-	4,530
	222期 (2021年2月10日)	8,287	10	△0.3	495.26	△0.2	97.9	-	4,476
	223期 (2021年3月10日)	8,253	10	△0.3	494.17	△0.2	98.3	-	4,427
第39作成期	224期 (2021年4月12日)	8,291	10	0.6	500.51	1.3	98.2	-	4,391
	225期 (2021年5月10日)	8,323	10	0.5	502.47	0.4	98.0	-	4,334
	226期 (2021年6月10日)	8,359	10	0.6	502.97	0.1	97.8	-	4,340
	227期 (2021年7月12日)	8,453	10	1.2	511.66	1.7	98.2	-	4,348
	228期 (2021年8月10日)	8,401	10	△0.5	510.18	△0.3	98.4	-	4,279
	229期 (2021年9月10日)	8,401	10	0.1	512.99	0.6	98.6	-	4,262
第40作成期	230期 (2021年10月11日)	8,351	10	△0.5	511.38	△0.3	98.1	-	4,179
	231期 (2021年11月10日)	8,264	10	△0.9	506.78	△0.9	98.1	-	4,095
	232期 (2021年12月10日)	8,440	10	2.3	519.26	2.5	97.9	-	4,146
	233期 (2022年1月11日)	8,345	10	△1.0	513.38	△1.1	98.0	-	4,064
	234期 (2022年2月10日)	8,286	10	△0.6	511.33	△0.4	98.4	-	4,007
	235期 (2022年3月10日)	8,122	10	△1.9	505.89	△1.1	98.3	-	3,908
		7,974	10	△1.7	497.73	△1.6	97.9	-	3,814

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) ベンチマークはF T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジなし) です (以下同じ)。

(注5) F T S E 世界国債インデックスは、F T S E Fixed Income L L Cにより運営されている債券インデックスです。F T S E Fixed Income L L Cは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、F T S E Fixed Income L L Cは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はF T S E Fixed Income L L Cに帰属します (以下同じ)。

(注6) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■過去6ヶ月間の基準価額と市況の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
			騰 落 率		騰 落 率		
第230期	(期 首) 2021年 9 月 10 日	円 8,351	% -	ポイント 511.38	% -	% 98.1	% -
	9 月 末	8,296	△0.7	508.95	△0.5	97.9	-
	(期 末) 2021年 10 月 11 日	8,274	△0.9	506.78	△0.9	98.1	-
第231期	(期 首) 2021年 10 月 11 日	8,264	-	506.78	-	98.1	-
	10 月 末	8,459	2.4	518.32	2.3	97.9	-
	(期 末) 2021年 11 月 10 日	8,450	2.3	519.26	2.5	97.9	-
第232期	(期 首) 2021年 11 月 10 日	8,440	-	519.26	-	97.9	-
	11 月 末	8,359	△1.0	512.77	△1.2	97.7	-
	(期 末) 2021年 12 月 10 日	8,355	△1.0	513.38	△1.1	98.0	-
第233期	(期 首) 2021年 12 月 10 日	8,345	-	513.38	-	98.0	-
	12 月 末	8,385	0.5	516.73	0.7	96.9	-
	(期 末) 2022年 1 月 11 日	8,296	△0.6	511.33	△0.4	98.4	-
第234期	(期 首) 2022年 1 月 11 日	8,286	-	511.33	-	98.4	-
	1 月 末	8,183	△1.2	507.46	△0.8	98.3	-
	(期 末) 2022年 2 月 10 日	8,132	△1.9	505.89	△1.1	98.3	-
第235期	(期 首) 2022年 2 月 10 日	8,122	-	505.89	-	98.3	-
	2 月 末	7,985	△1.7	500.36	△1.1	98.2	-
	(期 末) 2022年 3 月 10 日	7,984	△1.7	497.73	△1.6	97.9	-

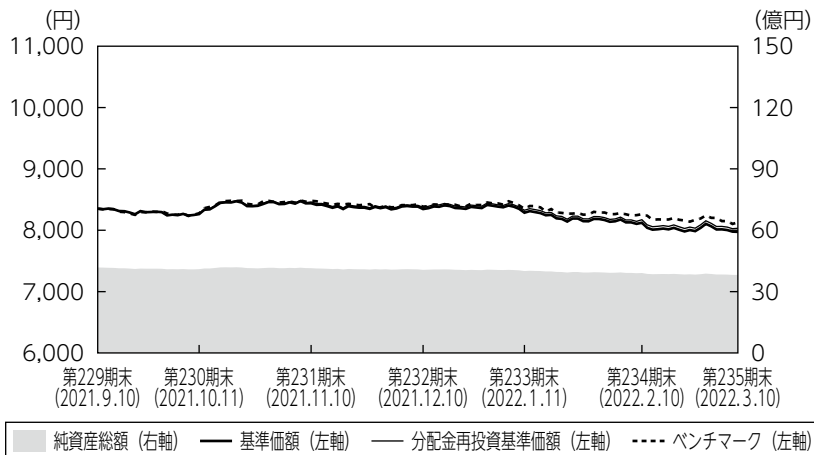
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■第230期～第235期の運用経過（2021年9月11日から2022年3月10日まで）

基準価額等の推移



第230期首： 8,351円
 第235期末： 7,974円
 （既払分配金60円）
 騰落率： △3.8%
 （分配金再投資ベース）

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客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により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

F R B（米連邦準備理事会）をはじめとした海外の主要な中央銀行が金融緩和政策の解除を推し進め、内外の金融政策格差拡大から対米ドルなどでの円安が進行したことは基準価額の上昇要因となりました。しかし、そうした金融緩和縮小の動きなどから米国はじめ、各国の国債利回りが大きく上昇（価格は下落）したことが要因となり、基準価額は下落しました。

投資環境

組入各国の国債利回りは上昇しました。新型コロナウイルス禍からの回復途上における世界的な供給のタイト化が強まる中、各国のインフレ率が騰勢を強めたことで、米国をはじめとした各国の金融当局がそれまで続けてきた金融緩和姿勢から縮小姿勢に転換したことが影響しました。作成期末にかけては、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻を受けて市場のリスク選好が後退し、「質への逃避」の動きから債券が買われ、やや上昇幅を縮小しました。

為替市場では、海外の主要な中央銀行の金融緩和縮小の流れを受け、米ドルをはじめ多くの通貨に対する円安が進行しました。一方、作成期末にかけては、金融緩和縮小による先行きの景気後退懸念や、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻を受けた市場のリスク選好後退から、その幅を縮小しました。ウクライナとの地理的な近さや、対ロシア制裁による経済への悪影響の大きさが嫌気されたことで、ユーロやポーランドズロチなどは下落し、期を通じて見ても円高となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

グローバル・ボンド・ポート・マザーファンドの組入比率を高位に維持することを基本に運用しました。また、為替予約取引を用いて、機動的に為替リスクを調整する運用を行いました。為替戦略については、米国の金融緩和縮小の動きの進展から、ベンチマーク比率に対する米ドルのオーバーウェイトを中心とした運営を実施しました。また、資源価格の上昇が進む中で、オーストラリアドル等、資源国通貨のベンチマーク比率に対するオーバーウェイトも実施しました。

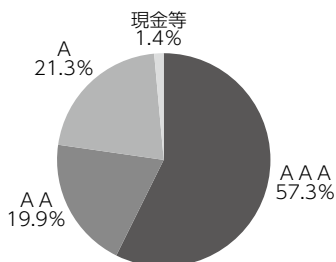
●グローバル・ボンド・ポート・マザーファンド

中長期的な長期国債利回りの低下見通しに基づき、デュレーション*は、米国、英国を中心にベンチマーク対比長期化を維持しましたが、作成期末にかけて米国の長期化幅を縮小しました。国別の投資配分については、スペインのベンチマーク比率に対するオーバーウェイトを縮小し、ドイツおよびフランスの投資比率を引き上げました。

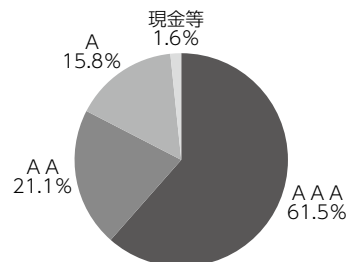
*金利変動に対する債券価格の変動性。

【グローバル・ボンド・ポート・マザーファンドの運用状況】 ※比率は純資産総額に対する割合です。

○格付別構成比
前作成期末



当作成期末



(注) 格付については、海外格付機関 (S & P および Moody's) による上位のものを採用しています。また、+・-等の符号は省略し、S & P の表記方法にあわせて表示しています。

○国別構成比
前作成期末

	ファンド	世界国債 インデックス	差	
北米	米国	45.8%	2.4%	
	カナダ	2.0%	1.0%	
	計	47.7%	3.4%	
中南米	メキシコ	0.7%	△0.7%	
	計	0.7%	△0.7%	
欧州	オーストリア	1.5%	△1.5%	
	ベルギー	2.4%	1.3%	
	フィンランド	0.6%	△0.6%	
	フランス	10.3%	△3.0%	
	ドイツ	7.5%	△3.3%	
	アイルランド	0.8%	△0.8%	
	イタリア	9.5%	△9.5%	
	オランダ	1.9%	△1.9%	
	スペイン	6.0%	12.8%	
	ユーロ計	34.0%	40.4%	△6.4%
	デンマーク	0.0%	0.5%	△0.5%
	スウェーデン	0.0%	0.3%	△0.3%
アジア・ オセアニア	オーストラリア	1.9%	0.9%	
	シンガポール	0.5%	△0.5%	
	マレーシア	0.5%	△0.5%	
	計	2.8%	0.0%	
	イスラエル	0.5%	△0.5%	
中東	イスラエル	0.5%	△0.5%	
	計	0.5%	△0.5%	
現金など	1.4%	0.0%	-	
合計	100.0%	100.0%	-	

当作成期末

	ファンド	世界国債 インデックス	差	
北米	米国	48.0%	1.7%	
	カナダ	2.0%	1.0%	
	計	50.0%	2.6%	
中南米	メキシコ	0.7%	△0.7%	
	計	0.7%	△0.7%	
欧州	オーストリア	1.4%	△1.4%	
	ベルギー	2.2%	0.9%	
	フィンランド	0.6%	△0.6%	
	フランス	10.0%	9.8%	0.1%
	ドイツ	6.9%	7.2%	△0.3%
	アイルランド	0.0%	0.8%	△0.8%
	イタリア	0.0%	8.7%	△8.7%
	オランダ	0.0%	1.9%	△1.9%
	スペイン	13.7%	5.7%	8.0%
	ユーロ計	33.7%	38.2%	△4.4%
	デンマーク	0.0%	0.4%	△0.4%
	スウェーデン	0.0%	0.3%	△0.3%
アジア・ オセアニア	英国	5.5%	1.8%	
	ポーランド	2.1%	0.5%	1.6%
	ノルウェー	0.0%	0.3%	△0.3%
	計	43.2%	45.1%	△1.9%
	オーストラリア	2.5%	1.6%	1.0%
中東	中国	1.2%	△1.2%	
	シンガポール	0.0%	0.4%	△0.4%
	マレーシア	0.0%	0.5%	△0.5%
	計	2.5%	3.7%	△1.2%
中東	イスラエル	0.4%	△0.4%	
	計	0.4%	△0.4%	
現金など	1.64%	-	-	
合計	100.0%	100.0%	-	



(注) 世界国債インデックスとは、F T S E 世界国債インデックス (除く日本) です。

【当ファンドの通貨別構成比】

前作成期末

		通貨別組入状況			修正デュレーション		
		組入債券	為替予約・先物	計	ファンド	世界国債インデックス	差
北米	USドル	48.0%	2.7%	50.7%	8.3	7.0	1.3
	カナダ・ドル	2.9%	△2.5%	0.4%	7.5	7.2	0.4
中南米	メキシコ・ペソ	0.0%	0.0%	0.0%	—	5.4	—
欧州	イギリス・ポンド	8.1%	△2.0%	6.1%	11.5	13.7	△2.2
	デンマーク・クローネ	0.0%	0.5%	0.5%	—	9.2	—
	ノルウェー・クローネ	0.0%	0.2%	0.2%	—	4.8	—
	ユーロ	33.9%	2.1%	35.9%	9.1	8.7	0.4
	スウェーデン・クローナ	0.0%	0.3%	0.3%	—	6.6	—
	ポーランド・ズロチ	2.5%	△1.2%	1.2%	6.3	4.3	2.0
アジア・オセアニア	オーストラリア・ドル	2.8%	△1.0%	1.8%	11.0	7.6	3.3
	シンガポール・ドル	0.0%	0.4%	0.4%	—	7.6	—
	マレーシア・リンギット	0.0%	0.0%	0.0%	—	7.2	—
中東	イスラエル・シケル	0.0%	0.5%	0.5%	—	6.9	—
現金等		1.9%	—	—	—	—	—

(注1) 比率は純資産総額に対する実質的な割合です。

(注2) 修正デュレーションとは、債券価格の金利変動に対する感応度をあらわす一つの指標です。

(注3) 世界国債インデックスとは、FTSE世界国債インデックス（除く日本）です。

(注4) 現金等は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。



当作成期末

		通貨別組入状況			修正デュレーション		
		組入債券	為替予約・先物	計	ファンド	世界国債インデックス	差
北米	USドル	49.4%	△1.0%	48.5%	8.2	6.9	1.3
	カナダ・ドル	3.0%	△1.0%	2.0%	7.2	7.5	△0.3
中南米	メキシコ・ペソ	0.0%	0.0%	0.0%	—	5.1	—
欧州	イギリス・ポンド	7.3%	△1.9%	5.4%	13.0	13.5	△0.5
	デンマーク・クローネ	0.0%	0.4%	0.4%	—	9.9	—
	ノルウェー・クローネ	0.0%	0.2%	0.2%	—	4.5	—
	ユーロ	33.6%	0.1%	33.7%	8.9	8.3	0.6
	スウェーデン・クローナ	0.0%	0.3%	0.3%	—	6.1	—
	ポーランド・ズロチ	2.1%	△1.0%	1.1%	1.5	4.1	△2.5
アジア・オセアニア	オーストラリア・ドル	2.5%	△1.1%	1.5%	11.1	7.5	3.6
	シンガポール・ドル	0.0%	4.5%	4.5%	—	8.1	—
	マレーシア・リンギット	0.0%	0.0%	0.0%	—	7.0	—
	中国元	0.0%	0.0%	0.0%	—	5.5	—
中東	イスラエル・シケル	0.0%	0.4%	0.4%	—	6.4	—
現金等		2.1%	—	—	—	—	—

(注1) 比率は純資産総額に対する実質的な割合です。

(注2) 修正デュレーションとは、債券価格の金利変動に対する感応度をあらわす一つの指標です。

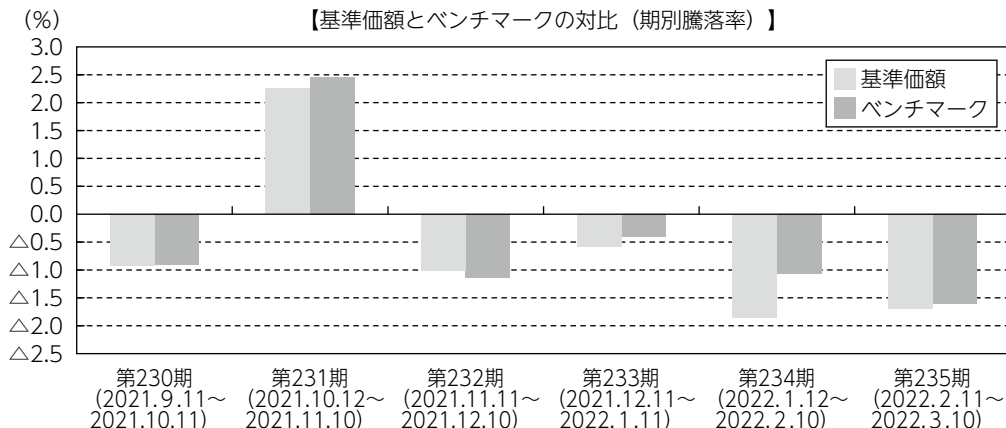
(注3) 世界国債インデックスとは、FTSE世界国債インデックス（除く日本）です。

(注4) 現金等は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前作成期末比で2.7%下落しました。

当ファンドはベンチマークを1.1%下回りました。組入各国の国債利回りの上昇が進む中で、デフレーションを長期化していたことや、ユーロ圏内においてスペインをオーバーウェイトしていたこと等が債券部分のマイナス要因となりました。通貨配分については、ベンチマーク比率に対するオーストラリアドルのオーバーウェイトなどがマイナス要因となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当作成期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1口当たり）

項目	第230期	第231期	第232期	第233期	第234期	第235期
	2021年9月11日 ~2021年10月11日	2021年10月12日 ~2021年11月10日	2021年11月11日 ~2021年12月10日	2021年12月11日 ~2022年1月11日	2022年1月12日 ~2022年2月10日	2022年2月11日 ~2022年3月10日
当期分配金（税引前）	10円	10円	10円	10円	10円	10円
対基準価額比率	0.12%	0.12%	0.12%	0.12%	0.12%	0.13%
当期の収益	3円	10円	3円	4円	4円	4円
当期の収益以外	6円	-円	6円	5円	5円	5円
翌期繰越分配対象額	284円	284円	278円	273円	267円	261円

(注1) 「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「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、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

グローバル・ボンド・ポート・マザーファンドを高位に組入れることにより、債券部分の実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。また、為替予約取引を用いて、機動的に通貨配分比率を調整する方針です。

●グローバル・ボンド・ポート・マザーファンド

新型コロナウイルス禍からの回復局面にあっても、先進国が従来抱えていた構造的な低成長などの問題が解決していない状況下にあつて、F R Bのインフレ抑制を最優先とする政策姿勢は、景気減速懸念を高め、実際には引き締め途上での方針転換を余儀なくされると予想します。このことから、米国を中心にベンチマークに対するデュレーション長期化を基本とし、リスク量の調整を行う方針です。

■ 1口当たりの費用明細

項目	第230期～第235期 (2021年9月11日 ～2022年3月10日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	38円	
(投信会社)	(19)	(0.232)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(17)	(0.205)	販売会社分は、購入後の情報提供、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等の対価
(受託会社)	(2)	(0.027)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	3	0.034	(b) 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)	(0.011)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(2)	(0.021)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	41	0.497	

(注1) 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・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

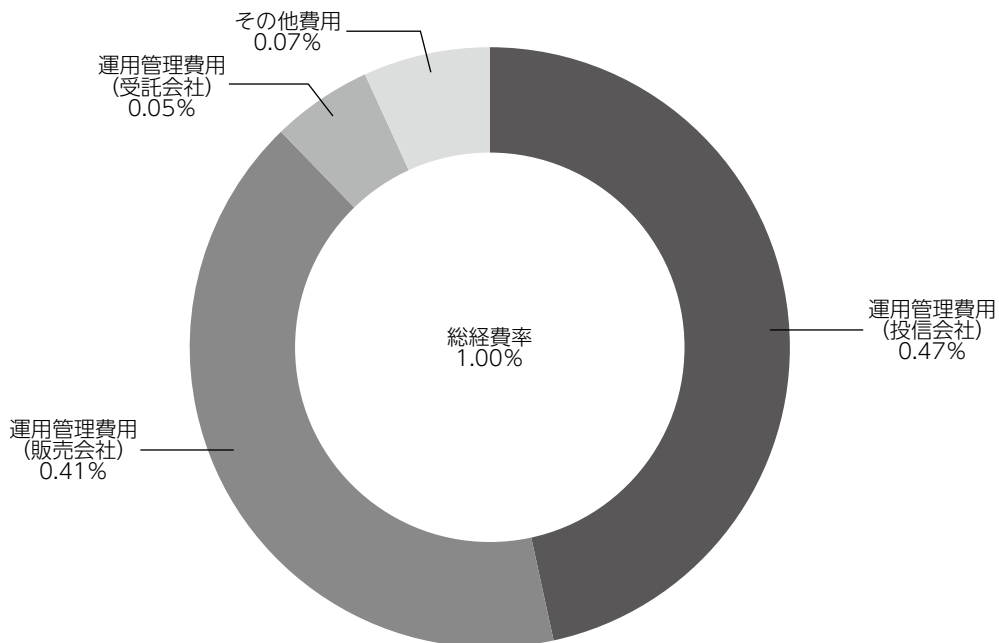
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1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。

(参考情報)

◆総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額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）は1.00%です。



(注1) 1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2) 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3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 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異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2021年9月11日から2022年3月10日まで）

	第 230 期 ~ 第 235 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
グローバル・ボンド・ポート・マザーファンド	千□ 9,977	千円 26,653	千□ 100,465	千円 267,516

■利害関係人との取引状況等（2021年9月11日から2022年3月10日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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

親投資信託残高

	第39作成期末	第 40 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
グローバル・ボンド・ポート・マザーファンド	千□ 1,559,484	千□ 1,468,996	千円 3,795,153

<補足情報>

■グローバル・ボンド・ポート・マザーファンドの組入資産の明細

下記は、グローバル・ボンド・ポート・マザーファンド（11,047,957,698口）の内容です。

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	2022 年 3 月 10 日 現 在							
	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
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 126,300	千アメリカ・ドル 122,250	千円 14,182,319	% 49.7	% -	% 25.4	% 15.7	% 8.6
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 9,460	千カナダ・ドル 9,399	千円 851,115	3.0	-	3.0	-	-
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 9,390	千オーストラリア・ドル 8,542	千円 724,351	2.5	-	2.5	-	-
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 10,930	千イギリス・ポンド 13,681	千円 2,091,203	7.3	-	5.5	-	1.8
ポ ー ラ ン ド	千ポーランド・ズロチ 22,600	千ポーランド・ズロチ 22,219	千円 596,527	2.1	-	-	-	2.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
ベルギー	5,728	7,026	901,193	3.2	-	3.2	-	-
フランス	20,260	22,222	2,850,301	10.0	-	10.0	-	-
ドイツ	12,295	15,345	1,968,240	6.9	-	5.2	-	1.7
スペイン	26,095	30,477	3,909,045	13.7	-	8.8	4.9	-
合 計	-	-	千円 28,074,298	98.4	-	63.6	20.7	14.2

(注1) 邦貨換算金額は、2022年3月10日現在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2) 組入比率は、2022年3月10日現在のマザーファンド純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄		2022年3月10日現在					
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	24,980	23,225	2,694,395	2050/02/15	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	8,500	6,934	804,429	2040/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	6,910	7,118	825,865	2029/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	17,260	16,824	1,951,804	2031/05/15	
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	16,560	16,627	1,928,930	2025/08/15	
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	17,100	16,814	1,950,604	2026/08/15	
US T N/B 0.125 10/15/23	国債証券	0.1250	21,530	21,042	2,441,106	2023/10/15	
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	5,200	5,259	610,132	2024/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	8,260	8,404	975,049	2027/11/15	
小計	—	—	126,300	122,250	14,182,319	—	
(カナダ)			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	4,320	4,471	404,867	2029/06/01	
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	5,140	4,928	446,247	2030/06/01	
小計	—	—	9,460	9,399	851,115	—	
(オーストラリア)			%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	3,490	2,685	227,737	2051/06/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	3,700	3,825	324,326	2027/11/21	
QUEENSLAND TREASURY CORP 1.75 08/21/31	特殊債券	1.7500	2,200	2,031	172,286	2031/08/21	
小計	—	—	9,390	8,542	724,351	—	
(イギリス)			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	3,240	4,150	634,447	2044/01/22	
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	3,430	3,345	511,433	2024/01/31	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	970	935	142,961	2029/10/22	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	1,200	1,741	266,162	2038/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	2,090	3,508	536,198	2055/12/07	
小計	—	—	10,930	13,681	2,091,203	—	
(ポーランド)			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	22,600	22,219	596,527	2023/10/25	
小計	—	—	22,600	22,219	596,527	—	
(ユーロ…ベルギー)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	1,100	1,203	154,354	2050/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	4,628	5,822	746,838	2034/06/22	
小計	—	—	5,728	7,026	901,193	—	
(ユーロ…フランス)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	3,850	4,623	592,954	2048/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	9,450	9,591	1,230,245	2029/05/25	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	6,960	8,007	1,027,101	2027/10/25	
小計	—	—	20,260	22,222	2,850,301	—	
(ユーロ…ドイツ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	4,490	7,508	963,039	2039/07/04	
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	4,020	4,017	515,286	2029/08/15	

銘	柄	2022 年 3 月 10 日 現 在					
		種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…ドイツ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BUNDESSCHAT 0.0 09/15/23		国債証券	0.0000	3,785	3,819	489,914	2023/09/15
小	計	—	—	12,295	15,345	1,968,240	—
(ユーロ…スペイン)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 1.95 04/30/26		国債証券	1.9500	7,700	8,236	1,056,446	2026/04/30
SPAIN 4.7 07/30/41		国債証券	4.7000	4,920	7,564	970,258	2041/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33		国債証券	2.3500	6,050	6,794	871,417	2033/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24		国債証券	2.7500	2,055	2,212	283,819	2024/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25		国債証券	2.1500	470	504	64,715	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27		国債証券	1.4500	4,900	5,164	662,388	2027/10/31
小	計	—	—	26,095	30,477	3,909,045	—
合	計	—	—	—	—	28,074,298	—

■投資信託財産の構成

2022年3月10日現在

項 目	第 40 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
グローバル・ボンド・ポート・マザーファンド	千円 3,795,153	% 98.5
コール・ローン等、その他	55,865	1.5
投資信託財産総額	3,851,018	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2022年3月10日現在、グローバル・ボンド・ポート・マザーファンドは28,245,917千円、98.8%です。

(注3) 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。なお、2022年3月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=116.01円、1カナダ・ドル=90.55円、1オーストラリア・ドル=84.79円、1イギリス・ポンド=152.85円、1ポーランド・ズロチ=26.847円、1ユーロ=128.26円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年10月11日)、(2021年11月10日)、(2021年12月10日)、(2022年1月11日)、(2022年2月10日)、(2022年3月10日)現在

項 目	第 230 期末	第 231 期末	第 232 期末	第 233 期末	第 234 期末	第 235 期末
(A) 資 産	5,369,100,475円	5,230,881,627円	5,297,598,159円	5,216,267,038円	5,360,352,251円	6,220,251,411円
コール・ローン等	21,578,135	22,850,961	21,962,511	23,991,086	36,965,592	23,147,892
グローバル・ボンド・ポート・マザーファンド(評価額)	4,081,086,346	4,125,147,086	4,047,387,658	3,992,480,515	3,892,192,279	3,795,153,390
未 収 入 金	1,266,435,994	1,082,883,580	1,228,247,990	1,199,795,437	1,431,194,380	2,401,950,129
(B) 負 債	1,273,350,916	1,084,110,548	1,233,424,025	1,209,161,366	1,452,109,133	2,405,578,568
未 払 金	1,262,804,712	1,070,918,633	1,218,781,246	1,200,982,981	1,442,107,809	2,397,373,602
未払収益分配金	4,956,400	4,913,030	4,870,250	4,836,050	4,812,030	4,783,720
未 払 解 約 金	2,302,440	5,072,422	6,611,010	-	2,139,048	644,841
未 払 信 託 報 酬	3,274,701	3,194,113	3,149,344	3,329,464	3,038,496	2,765,711
その他未払費用	12,663	12,350	12,175	12,871	11,750	10,694
(C) 純資産総額(A-B)	4,095,749,559	4,146,771,079	4,064,174,134	4,007,105,672	3,908,243,118	3,814,672,843
元 本	4,956,400,000	4,913,030,000	4,870,250,000	4,836,050,000	4,812,030,000	4,783,720,000
次期繰越損益金	△860,650,441	△766,258,921	△806,075,866	△828,944,328	△903,786,882	△969,047,157
(D) 受益権総口数	495,640口	491,303口	487,025口	483,605口	481,203口	478,372口
1口当たり基準価額(C/D)	8,264円	8,440円	8,345円	8,286円	8,122円	7,974円

(注) 第229期末における元本額は5,005,140,000円、当作成期間(第230期～第235期)中における追加設定元本額は80,000円、同解約元本額は221,500,000円です。

■損益の状況

〔自 2021年 9月11日 至 2021年10月11日〕〔自 2021年10月12日 至 2021年11月10日〕〔自 2021年11月11日 至 2021年12月10日〕〔自 2021年12月11日 至 2022年 1月11日〕〔自 2022年 1月12日 至 2022年 2月10日〕〔自 2022年 2月11日 至 2022年 3月10日〕

項 目	第 230 期	第 231 期	第 232 期	第 233 期	第 234 期	第 235 期
(A) 配 当 等 収 益	△136円	△269円	△391円	△160円	△207円	△186円
受 取 利 息	3	-	-	20	1	6
支 払 利 息	△139	△269	△391	△180	△208	△192
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△34,730,725	95,110,888	△38,276,454	△20,228,427	△70,888,067	△62,836,590
売 買 益	21,605,295	135,500,754	30,756,382	10,524,705	20,535,160	37,840,268
売 買 損	△56,336,020	△40,389,866	△69,032,836	△30,753,132	△91,423,227	△100,676,858
(C) 信 託 報 酬 等	△3,473,676	△3,337,225	△3,341,746	△3,464,435	△3,259,470	△2,957,100
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△38,204,537	91,773,394	△41,618,591	△23,693,022	△74,147,744	△65,793,876
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△463,858,366	△502,581,692	△412,098,957	△455,363,684	△481,489,346	△557,151,786
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△353,631,138	△350,537,593	△347,488,068	△345,051,572	△343,337,762	△341,317,775
(配 当 等 相 当 額)	(65,714,290)	(65,139,421)	(64,572,688)	(64,119,828)	(63,801,382)	(63,426,014)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△419,345,428)	(△415,677,014)	(△412,060,756)	(△409,171,400)	(△407,139,144)	(△404,743,789)
(G) 合 計 (D + E + F)	△855,694,041	△761,345,891	△801,205,616	△824,108,278	△898,974,852	△964,263,437
(H) 収 益 分 配 金	△4,956,400	△4,913,030	△4,870,250	△4,836,050	△4,812,030	△4,783,720
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△860,650,441	△766,258,921	△806,075,866	△828,944,328	△903,786,882	△969,047,157
追 加 信 託 差 損 益 金	△353,631,138	△350,537,593	△347,488,068	△345,051,572	△343,337,762	△341,317,775
(配 当 等 相 当 額)	(65,714,290)	(65,139,425)	(64,572,698)	(64,119,854)	(63,801,382)	(63,426,014)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△419,345,428)	(△415,677,018)	(△412,060,766)	(△409,171,426)	(△407,139,144)	(△404,743,789)
分 配 準 備 積 立 金	75,251,005	74,815,939	71,131,073	68,115,620	65,104,668	61,903,455
繰 越 損 益 金	△582,270,308	△490,537,267	△529,718,871	△552,008,376	△625,553,788	△689,632,837

(注 1) (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 2) (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 3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注 4) 分配金の計算過程

項 目	第 230 期	第 231 期	第 232 期	第 233 期	第 234 期	第 235 期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,920,457円	5,136,589円	1,837,291円	2,320,687円	2,139,396円	1,965,543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	65,714,290	65,139,425	64,572,698	64,119,854	63,801,382	63,426,014
(d) 分 配 準 備 積 立 金	78,286,948	74,592,380	74,164,032	70,630,983	67,777,302	64,721,632
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	145,921,695	144,868,394	140,574,021	137,071,524	133,718,080	130,113,189
(f) 1口当たり当期分配対象額	294.41	294.87	288.64	283.44	277.88	271.99
(g) 分 配 金	4,956,400	4,913,030	4,870,250	4,836,050	4,812,030	4,783,720
(h) 1口当たり分配金	10	10	10	10	10	10

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 230 期	第 231 期	第 232 期	第 233 期	第 234 期	第 235 期
1口当たり分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10円

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

グローバル・ボンド・ポート・マザーファンド 運用報告書

第48期 (決算日 2021年9月21日)

(計算期間 2021年3月23日～2021年9月21日)

グローバル・ボンド・ポート・マザーファンドの第48期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。

信託期間	1997年10月16日から無期限です。
運用方針	信託財産の成長をはかることを目標に運用を行います。
主要投資対象	わが国を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資には、制限を設けません。 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
44期 (2019年9月20日)	24,591	2.6	466.14	1.9	98.7	-	27,725
45期 (2020年3月23日)	24,864	1.1	478.68	2.7	97.7	-	27,477
46期 (2020年9月23日)	25,740	3.5	490.25	2.4	98.3	-	28,951
47期 (2021年3月22日)	25,869	0.5	498.38	1.7	98.5	-	28,731
48期 (2021年9月21日)	26,478	2.4	506.63	1.7	98.5	-	29,241

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) ベンチマークはFTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジなし) です (以下同じ)。

(注3) FTSE世界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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します (以下同じ)。

(注4) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

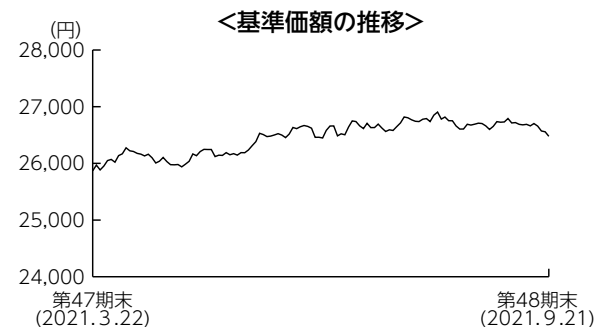
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス (除く日本、 円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 率	債券先物 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021 年 3 月 22 日	円 25,869	% -	ポイント 498.38	% -	% 98.5	% -
3 月 末	26,137	1.0	501.12	0.5	97.8	-
4 月 末	26,135	1.0	502.93	0.9	98.2	-
5 月 末	26,508	2.5	510.44	2.4	98.5	-
6 月 末	26,505	2.5	508.66	2.1	98.0	-
7 月 末	26,737	3.4	513.08	2.9	98.0	-
8 月 末	26,736	3.4	512.29	2.8	98.6	-
(期 末) 2021 年 9 月 21 日	26,478	2.4	506.63	1.7	98.5	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2021年3月23日から2021年9月21日まで）

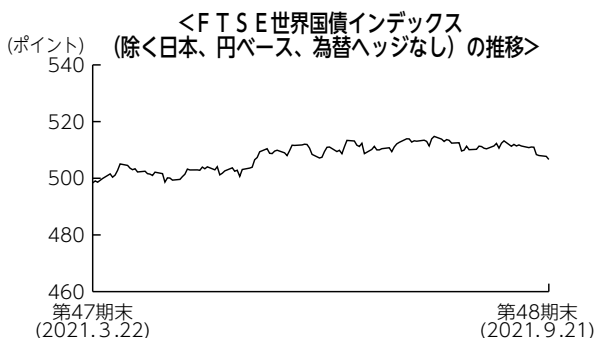


基準価額の推移

当期末の基準価額は26,478円となり、前期末比で2.4%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチン普及や米追加経済対策による景気回復に対する過度な期待の剥落により、債券市場で米国債などの主要国の国債利回りが低下（価格は上昇）したことが基準価額の上昇要因となりました。為替市場においては、円は米ドルをはじめとした主要通貨に対して概ねレンジ圏内での推移となったことから、基準価額への寄与は限定的でした。こうした中、国債利回り低下のプラス寄与により、当期の基準価額は上昇しました。



投資環境

米国債利回りは、新型コロナウイルスに対するワクチンの普及や追加経済対策を背景とした景気回復期待の高まりなどから、2021年3月末にかけて上昇（価格は下落）しました。しかしその後は、市場の過度な金利上昇期待を剥落させつつ徐々にレンジを切り下げ、利回りは低下に転じま

した。ドイツ国債利回りは、遅れていたワクチン接種が欧州でも進展する中、5月にかけて上昇しましたが、その後はECB（欧州中央銀行）の金融緩和長期化観測や新型コロナウイルスの感染再拡大により低下に転じました。

為替市場はまちまちの動きとなりました。主要先進国において新型コロナウイルスワクチン接種が進んだことや、米金融当局における金融緩和縮小観測が強まったことなどを受け、対米ドルでは小幅に円安が進行しました。一方、新型コロナウイルス変異株による感染が世界各国で再拡大したことや、中国大手不動産開発会社の信用問題などを背景に、期末にかけて投資家のリスク選好が悪化したことなどを受け、その他多くの組入通貨に対しては円高が進行しました。

ポートフォリオについて

銘柄選択では、ユーロ圏のデュレーション*長期化幅を縮小し、英国はデュレーション長期化を解消しました。一方、中長期的な長期金利の低下見通しに基づき、短期的な長期金利の反発局面を捉えて米国の長期化幅を拡大しました。国別の投資配分については、ユーロ圏の配分を引き下げ、英国の配分を引き上げました。

*金利変動に対する債券価格の変動性。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.7%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.7%上回りました。米国を中心に国債利回りの低下が進む中で、デュレーションを長期化していたこと等がプラス寄与となりました。

今後の運用方針

F R B (米連邦準備理事会) は経済活動の段階的再開とインフレ見通し上昇を背景に、金融政策正常化への道筋を模索していますが、新型コロナウイルス変異株の感染拡大を受けて、緩和的金融政策姿勢は今後も継続すると予想され、市場における長期金利先高感徐々に剥落すると見ています。このことから銘柄選択については、米国を中心にデュレーション長期化を基本とし、リスク量の調整を行う方針です。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	2円	0.007%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	2	0.007	
期中の平均基準価額は26,461円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 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。

■売買及び取引の状況 (2021年3月23日から2021年9月21日まで)

公社債

			買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 28,865	千アメリカ・ドル 24,405 (-)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 49	千カナダ・ドル 216 (-)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 2,398	千オーストラリア・ドル 3,925 (-)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 4,431	千イギリス・ポンド 1,551 (-)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 1,571	千ポーランド・ズロチ 1,544 (-)
国	ユ ー ロ	ベルギー	千ユーロ 957	千ユーロ 1,788 (-)
		フランス	2,114	2,529 (-)
		ドイツ	2,048	1,393 (-)
		スペイン	2,085	7,051 (-)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、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 (2021年3月23日から2021年9月21日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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

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 B B 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
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 126,660	千アメリカ・ドル 129,597	千円 14,200,042	% 48.6	% -	% 22.1	% 25.3	% 1.2
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 9,495	千カナダ・ドル 9,929	千円 849,855	2.9	-	2.9	-	-
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 9,960	千オーストラリア・ドル 10,225	千円 812,805	2.8	-	2.8	-	-
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 12,885	千イギリス・ポンド 15,721	千円 2,351,554	8.0	-	6.1	1.9	-
ポ ー ラ ン ド	千ポーランド・ズロチ 25,520	千ポーランド・ズロチ 25,718	千円 717,306	2.5	-	1.1	1.4	-
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
ベルギー	6,368	8,388	1,077,796	3.7	-	3.7	-	-
フ ラ ン ス	14,230	16,424	2,110,176	7.2	-	7.2	-	-
ド イ ツ	7,475	9,515	1,222,572	4.2	-	3.3	-	0.9
ス ペ イ ン	34,970	42,568	5,469,209	18.7	-	11.5	7.2	-
合 計	-	-	千円 28,811,321	98.5	-	60.6	35.8	2.1

(注1) 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2) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	当期						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		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	23,130	23,923	2,621,274	2050/02/15	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	9,420	8,470	928,128	2040/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	9,410	10,249	1,123,043	2029/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	13,320	13,730	1,504,453	2031/05/15	
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	16,560	17,420	1,908,817	2025/08/15	
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	17,100	17,669	1,936,004	2026/08/15	
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	500	473	51,900	2030/08/15	
US T N/B 0.125 09/30/22	国債証券	0.1250	3,070	3,071	336,544	2022/09/30	
US T N/B 0.125 10/15/23	国債証券	0.1250	26,000	25,944	2,842,699	2023/10/15	
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	6,150	6,494	711,601	2024/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	2,000	2,150	235,575	2027/11/15	
小計	—	—	126,660	129,597	14,200,042	—	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	4,500	4,895	418,969	2029/06/01	
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	4,995	5,034	430,886	2030/06/01	
小計	—	—	9,495	9,929	849,855	—	
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円		
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	2,950	2,687	213,601	2051/06/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	4,210	4,703	373,857	2027/11/21	
QUEENSLAND TREASURY CORP 1.75 08/21/31	特殊債券	1.7500	2,800	2,834	225,345	2031/08/21	
小計	—	—	9,960	10,225	812,805	—	
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	1,140	1,618	242,023	2044/01/22	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	3,730	3,772	564,335	2025/06/07	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	2,295	2,466	368,933	2028/10/22	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	3,330	3,389	506,974	2029/10/22	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	300	476	71,264	2038/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	2,090	3,998	598,024	2055/12/07	
小計	—	—	12,885	15,721	2,351,554	—	
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円		
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	13,480	14,267	397,928	2026/07/25	
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	12,040	11,451	319,378	2030/10/25	
小計	—	—	25,520	25,718	717,306	—	
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	1,300	1,607	206,588	2050/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	4,728	6,433	826,520	2034/06/22	
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	340	347	44,687	2030/06/22	
小計	—	—	6,368	8,388	1,077,796	—	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	2,700	3,552	456,371	2048/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	6,600	6,975	896,188	2029/05/25	

銘 柄	当			期		末
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	4,930	5,896	757,617	2027/10/25
小 計	—	—	14,230	16,424	2,110,176	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	2,455	4,369	561,444	2039/07/04
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	2,920	3,030	389,382	2029/08/15
BUNDESSCHAT 0.0 09/16/22	国債証券	0.0000	2,100	2,115	271,745	2022/09/16
小 計	—	—	7,475	9,515	1,222,572	—
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	8,700	9,637	1,238,166	2026/04/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	5,040	8,538	1,097,070	2041/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	8,650	10,527	1,352,515	2033/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	4,680	5,162	663,232	2024/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	1,500	1,661	213,458	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	6,400	7,042	904,767	2027/10/31
小 計	—	—	34,970	42,568	5,469,209	—
合 計	—	—	—	—	28,811,321	—

■投資信託財産の構成

2021年9月21日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	28,811,321	98.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	459,708	1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	29,271,029	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、28,950,247千円、98.9%です。

(注3) 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。なお、2021年9月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.57円、1カナダ・ドル=85.59円、1オーストラリア・ドル=79.49円、1イギリス・ポンド=149.58円、1ポーランド・ズロチ=27.89円、1ユーロ=128.48円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年9月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	29,271,029,948円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	320,892,390
公 社 債(評価額)	28,811,321,438
未 収 利 息	133,336,381
前 払 費 用	5,479,739
(B) 負 債	29,114,000
未 払 解 約 金	29,114,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	29,241,915,948
元 本	11,043,962,911
次 期 繰 越 損 益 金	18,197,953,037
(D) 受 益 権 総 口 数	11,043,962,911口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	26,478円

(注1) 期首元本額 11,106,621,156円
追加設定元本額 853,839,924円
一部解約元本額 916,498,169円

(注2) 期末における元本の内訳
グローバル・ボンド・ポート (Cコース) 3,557,129,689円
グローバル・ボンド・ポート (Dコース) 4,686,243,847円
グローバル・ボンド・ポート毎月決算コース (為替ヘッジなし) 1,550,324,959円
D I A Mグローバル・ボンド・ポート毎月決算コース2 1,187,256,185円
D I A Mグローバル・ボンド・ポートVA (ヘッジなし) 63,008,231円
期末元本合計 11,043,962,911円

■損益の状況

当期 自2021年3月23日 至2021年9月21日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	235,484,331円
受 取 利 息	235,518,492
支 払 利 息	△34,161
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	445,989,874
売 買 益	682,924,836
売 買 損	△236,934,962
(C) そ の 他 費 用	△2,061,621
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	679,412,584
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	17,624,875,208
(F) 解 約 差 損 益 金	△1,508,525,831
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,402,191,076
(H) 合 計(D+E+F+G)	18,197,953,037
次 期 繰 越 損 益 金(H)	18,197,953,037

(注1) (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2) (F)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。

(注3) (G)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。