

運用報告書 (全体版)

DIAMグローバル・ボンド・ポート 毎月決算コース2

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	2003年1月29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	DIAM グローバル・ ボンド・ポート 毎月決算コース2	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、利子等収益および売買益 (評価益を含みま す。) から、原則として利子等収益の範囲内で分配を行 います。但し、分配金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。	

愛称：ぶんぱいくん

第212期	<決算日	2020年10月12日>
第213期	<決算日	2020年11月10日>
第214期	<決算日	2020年12月10日>
第215期	<決算日	2021年1月12日>
第216期	<決算日	2021年2月10日>
第217期	<決算日	2021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、「DIAMグローバル・ボンド・
ポート 毎月決算コース2」は、2021
年3月10日に第217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。

<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。

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/

D I A M グローバル・ボンド・ポート 毎月決算コース2

■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 <small>(除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)</small>		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	除日本、円ベース、 為替ヘッジなし (ベンチマーク)	期中 騰落率			
第33作成期	188期 (2018年10月10日)	円	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
	189期 (2018年11月12日)	7,312	15	0.3	447.22	0.1	98.1	-	4,399
	190期 (2018年12月10日)	7,298	10	△0.1	449.62	0.5	97.8	-	4,339
	191期 (2019年1月10日)	7,311	10	0.3	452.43	0.6	98.0	-	4,224
	192期 (2019年2月12日)	7,114	10	△2.6	439.62	△2.8	98.0	-	4,050
	193期 (2019年3月11日)	7,250	10	2.1	448.30	2.0	97.7	-	4,082
第34作成期	194期 (2019年4月10日)	7,294	10	0.7	453.26	1.1	98.2	-	4,047
	195期 (2019年5月10日)	7,384	10	1.4	458.32	1.1	97.5	-	4,034
	196期 (2019年6月10日)	7,288	10	△1.2	451.80	△1.4	97.3	-	3,880
	197期 (2019年7月10日)	7,397	10	1.6	457.07	1.2	97.7	-	3,900
	198期 (2019年8月13日)	7,456	10	0.9	461.85	1.0	98.0	-	3,902
	199期 (2019年9月10日)	7,361	10	△1.1	455.73	△1.3	98.0	-	3,787
第35作成期	200期 (2019年10月10日)	7,476	10	1.7	464.22	1.9	97.5	-	3,790
	201期 (2019年11月11日)	7,475	10	0.1	465.39	0.3	97.9	-	3,743
	202期 (2019年12月10日)	7,454	10	△0.1	465.70	0.1	97.7	-	3,704
	203期 (2020年1月10日)	7,460	10	0.2	467.04	0.3	97.8	-	3,638
	204期 (2020年2月10日)	7,521	10	1.0	471.04	0.9	97.9	-	3,632
	205期 (2020年3月10日)	7,601	10	1.2	477.87	1.5	97.7	-	3,624
第36作成期	206期 (2020年4月10日)	7,608	10	0.2	474.94	△0.6	96.8	-	3,616
	207期 (2020年5月11日)	7,587	10	△0.1	479.59	1.0	97.4	-	3,575
	208期 (2020年6月10日)	7,486	10	△1.2	471.78	△1.6	97.0	-	3,519
	209期 (2020年7月10日)	7,673	10	2.6	485.95	3.0	97.9	-	3,577
	210期 (2020年8月11日)	7,710	10	0.6	490.33	0.9	98.0	-	3,564
	211期 (2020年9月10日)	7,830	10	1.7	497.05	1.4	98.0	-	3,604
第37作成期	212期 (2020年10月12日)	7,788	10	△0.4	496.26	△0.2	97.9	-	3,542
	213期 (2020年11月10日)	7,736	10	△0.5	495.37	△0.2	97.8	-	3,489
	214期 (2020年12月10日)	7,647	10	△1.0	492.35	△0.6	98.3	-	3,425
	215期 (2021年1月12日)	7,719	10	1.1	496.29	0.8	98.0	-	3,436
	216期 (2021年2月10日)	7,686	10	△0.3	495.26	△0.2	97.9	-	3,398
	217期 (2021年3月10日)	7,654	10	△0.3	494.17	△0.2	98.3	-	3,366
		7,689	10	0.6	500.51	1.3	98.2	-	3,361

(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212期	(期 首) 2020年 9 月 10 日	円 7,788	% -	ポイント 496.26	% -	% 97.9	% -
	9 月 末	7,759	△0.4	494.88	△0.3	97.4	-
	(期 末) 2020年 10 月 12 日	7,746	△0.5	495.37	△0.2	97.8	-
第213期	(期 首) 2020年 10 月 12 日	7,736	-	495.37	-	97.8	-
	10 月 末	7,601	△1.7	488.04	△1.5	98.1	-
	(期 末) 2020年 11 月 10 日	7,657	△1.0	492.35	△0.6	98.3	-
第214期	(期 首) 2020年 11 月 10 日	7,647	-	492.35	-	98.3	-
	11 月 末	7,683	0.5	493.20	0.2	98.2	-
	(期 末) 2020年 12 月 10 日	7,729	1.1	496.29	0.8	98.0	-
第215期	(期 首) 2020年 12 月 10 日	7,719	-	496.29	-	98.0	-
	12 月 末	7,740	0.3	497.33	0.2	97.7	-
	(期 末) 2021年 1 月 12 日	7,696	△0.3	495.26	△0.2	97.9	-
第216期	(期 首) 2021年 1 月 12 日	7,686	-	495.26	-	97.9	-
	1 月 末	7,702	0.2	496.21	0.2	98.2	-
	(期 末) 2021年 2 月 10 日	7,664	△0.3	494.17	△0.2	98.3	-
第217期	(期 首) 2021年 2 月 10 日	7,654	-	494.17	-	98.3	-
	2 月 末	7,594	△0.8	494.15	△0.0	98.2	-
	(期 末) 2021年 3 月 10 日	7,699	0.6	500.51	1.3	98.2	-

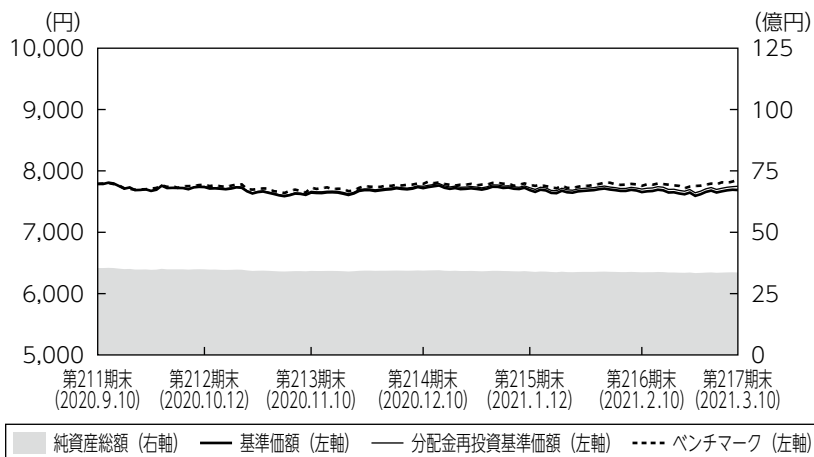
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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212期～第217期の運用経過（2020年9月11日から2021年3月10日まで）

基準価額等の推移



第212期首： 7,788円
 第217期末： 7,689円
 （既払分配金60円）
 騰落率： $\Delta 0.5\%$
 （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す。
- (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

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への期待が高まり、債券市場で米国債などの主要国の国債利回りが大きく上昇（価格は下落）したことが基準価額の下落要因となりました。一方で為替市場においては、比較的良好な投資家のリスク選好が維持されたこと等から、米ドルやユーロなどの主要通貨が対円で上昇し、このことは基準価額の上昇要因となりました。こうした中、国債利回り上昇のマイナス寄与により、当作成期の基準価額は下落しました。

投資環境

外国債券市場では、米国債利回りは一時的にもみ合う局面がありましたが、新型コロナウイルスのワクチン開発が進展したことや、米国大統領選挙の結果を受けて大規模な経済対策による景気回復期待が高まったことなどを背景に期を通じて上昇基調が続きました。ドイツ国債利回りは、欧州での新型コロナウイルス感染拡大を受け、前作成期末から2020年末までは低下基調で推移しましたが、2021年に入ると米国債に連れて利回りは上昇に転じました。

為替市場では、多くの主要通貨に対して円安が進行しました。世界の主要中央銀行による大規模金融緩和、新型コロナウイルスのワクチン開発ならびに接種の進展などから、比較的良好な投資家のリスク選好が維持されたことが寄与しました。また、2021年以降は、米バイデン新政権による大規模財政支出見通しから米国債利回りが大きく上昇し、内外金利差が拡大したことも円安要因として寄与しました。

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。通貨戦略については、巨額の経常赤字を抱える米ドルは中長期的に減価圧力を受け続けるとの想定の下、ベンチマーク比率に対する米ドルのアンダーウェイトを中心としたポジション運営を実施しました。

●グローバル・ボンド・ポート・マザーファンド

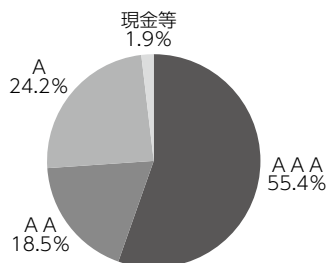
銘柄選択では、米国債の長短金利差拡大がかなり進行した中、新型コロナウイルス感染再拡大や米国大統領選挙後の政策不確実性を受けた景気鈍化懸念に鑑み、米国のデフレーション^{*}の長期化幅を拡大した一方、ユーロ圏とオーストラリアでは縮小しました。国別の投資配分については、ユーロ圏の配分を引き下げ、英国の配分を引き上げました。

^{*}金利変動に対する債券価格の変動性。

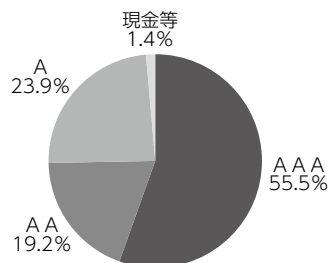
【グローバル・ボンド・ポート・マザーファンドの運用状況】 ※比率は純資産総額に対する割合です。

○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	46.0%	2.4%	
	カナダ	2.9%	0.9%	
	計	48.8%	3.4%	
中南米	メキシコ	0.0%	△0.8%	
	計	0.0%	△0.8%	
欧州	オーストリア	0.0%	△1.6%	
	ベルギー	5.3%	2.7%	
	フィンランド	0.0%	△0.6%	
	フランス	7.3%	△3.3%	
	ドイツ	4.1%	△3.6%	
	アイルランド	0.0%	△0.8%	
	イタリア	0.0%	△9.4%	
	オランダ	0.0%	△1.9%	
	スペイン	21.6%	15.5%	
	ユーロ計	38.3%	41.5%	△3.3%
		デンマーク	0.0%	△0.5%
	スウェーデン	0.0%	△0.3%	
	英国	5.0%	△1.6%	
	ポーランド	2.6%	2.0%	
	ノルウェー	0.0%	△0.2%	
	計	45.9%	△4.0%	
アジア・ オセアニア	オーストラリア	3.4%	0.9%	
	シンガポール	0.0%	△0.5%	
	マレーシア	0.0%	△0.5%	
	計	3.4%	0.0%	
中東	イスラエル	0.0%	△0.4%	
	計	0.0%	△0.4%	
	現金など	1.87%	-	
	合計	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	46.0%	2.8%	
	カナダ	3.0%	1.0%	
	計	49.0%	3.8%	
中南米	メキシコ	0.0%	△0.8%	
	計	0.0%	△0.8%	
欧州	オーストリア	0.0%	△1.6%	
	ベルギー	4.2%	1.6%	
	フィンランド	0.0%	△0.7%	
	フランス	7.6%	△3.1%	
	ドイツ	4.0%	△3.7%	
	アイルランド	0.0%	△0.9%	
	イタリア	0.0%	△9.8%	
	オランダ	0.0%	△1.9%	
	スペイン	21.3%	15.2%	
	ユーロ計	37.1%	41.9%	△4.8%
		デンマーク	0.0%	△0.5%
	スウェーデン	0.0%	△0.3%	
	英国	6.7%	0.0%	
	ポーランド	2.6%	1.9%	
	ノルウェー	0.0%	△0.3%	
	計	46.3%	△4.0%	
アジア・ オセアニア	オーストラリア	3.3%	1.0%	
	シンガポール	0.0%	△0.4%	
	マレーシア	0.0%	△0.5%	
	計	3.3%	0.0%	
中東	イスラエル	0.0%	△0.4%	
	計	0.0%	△0.4%	
	現金など	1.40%	-	
	合計	100.0%	-	

(注) 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。

【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	45.8%	△13.1%	32.8%	7.8	7.1	0.8
	カナダ・ドル	2.9%	△1.0%	1.9%	8.5	7.3	1.2
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	5.0%	△0.6%	4.4%	17.0	13.9	3.1
	デンマーク・クローネ	0.0%	0.5%	0.5%	—	8.5	—
	ノルウェー・クローネ	0.0%	2.2%	2.2%	—	5.4	—
	ユーロ	38.2%	12.9%	51.1%	8.9	8.5	0.4
	スウェーデン・クローナ	0.0%	0.3%	0.3%	—	6.2	—
	ポーランド・ズロチ	2.6%	△1.3%	1.3%	5.5	4.4	1.1
アジア・オセアニア	オーストラリア・ドル	3.4%	△0.8%	2.5%	8.3	7.2	1.1
	シンガポール・ドル	0.0%	0.4%	0.4%	—	7.7	—
	マレーシア・リンギット	0.0%	0.0%	0.0%	—	7.0	—
中東	イスラエル・シケル	0.0%	0.4%	0.4%	—	7.2	—
	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。



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	45.8%	△13.2%	32.6%	8.0	6.7	1.2
	カナダ・ドル	2.9%	5.0%	8.0%	8.0	6.8	1.2
中南米	メキシコ・ペソ	0.0%	0.0%	0.0%	—	5.3	—
欧州	イギリス・ポンド	6.7%	0.1%	6.7%	14.3	13.0	1.4
	デンマーク・クローネ	0.0%	0.5%	0.5%	—	9.6	—
	ノルウェー・クローネ	0.0%	0.2%	0.2%	—	5.1	—
	ユーロ	36.9%	6.2%	43.1%	9.1	8.6	0.5
	スウェーデン・クローナ	0.0%	0.3%	0.3%	—	5.7	—
	ポーランド・ズロチ	2.6%	△1.2%	1.3%	6.6	4.2	2.4
アジア・オセアニア	オーストラリア・ドル	3.3%	1.0%	4.3%	5.6	7.2	△1.5
	シンガポール・ドル	0.0%	0.4%	0.4%	—	7.9	—
	マレーシア・リンギット	0.0%	0.0%	0.0%	—	7.0	—
中東	イスラエル・シケル	0.0%	0.5%	0.5%	—	6.9	—
	現金等	1.8%	—	—	—	—	—

(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。

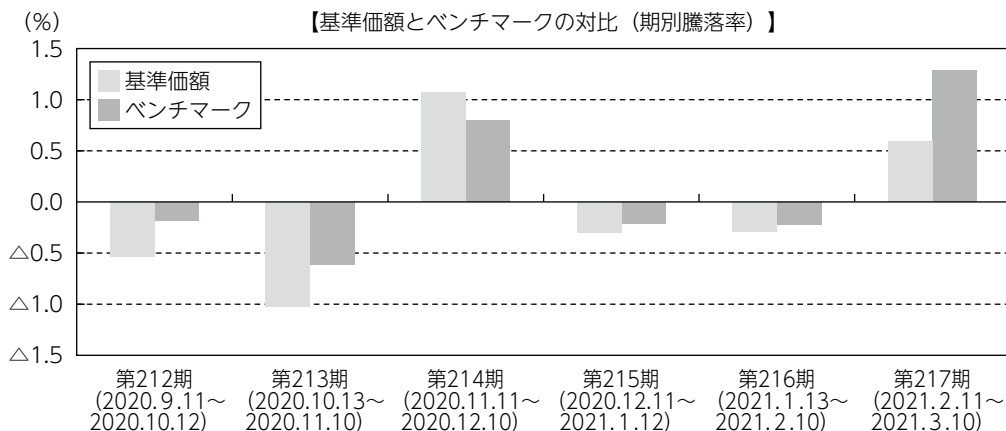
(注3) 世界国債インデックスとは、FTSE世界国債インデックス（除く日本）です。

(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0.9%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを1.4%下回りました。世界的に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等が債券部分のマイナス寄与の主因となりました。通貨配分については、米ドルに対するオーストラリアドルやカナダドルのオーバーウェイトを主因にプラスに寄与しました。



(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（1万口当たり）

項目	第212期	第213期	第214期	第215期	第216期	第217期
	2020年9月11日 ~2020年10月12日	2020年10月13日 ~2020年11月10日	2020年11月11日 ~2020年12月10日	2020年12月11日 ~2021年1月12日	2021年1月13日 ~2021年2月10日	2021年2月11日 ~2021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	0.13%	0.13%	0.13%	0.13%	0.13%	0.13%
当期の収益	5円	4円	9円	4円	4円	8円
当期の収益以外	4円	5円	0円	5円	5円	1円
翌期繰越分配対象額	184円	179円	179円	173円	167円	166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のワクチン普及や米追加経済対策による景気回復への期待が強まっているものの、世界経済は構造的に下押し圧力がかかりやすく、インフレ率も抑制された環境下、中長期的には金利低下が進むと予想します。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。為替戦略については、中長期的な観点から基本戦略として米ドルをアンダーウェイトとし、需給動向を勘案しながら機動的にポジションを構築します。

■1万口当たりの費用明細

項目	第212期～第217期 (2020年9月11日 ～2021年3月10日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	36円	
(投信会社)	(18)	(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)	(16)	(0.204)	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	1	0.013	(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)	(0.002)	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)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	37	0.476	

(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。

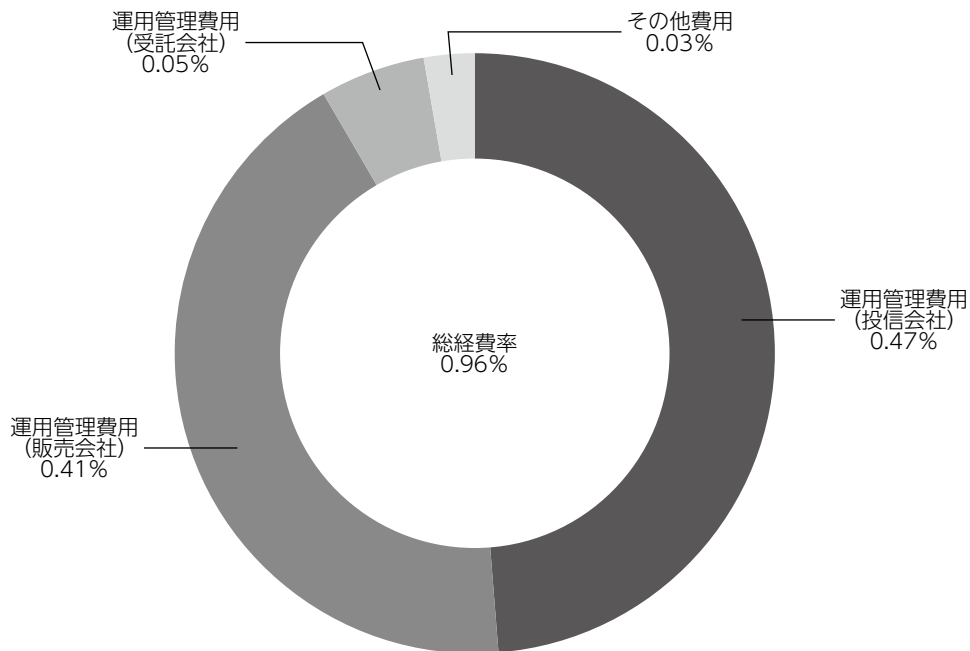
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

(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0.96%です。



(注1) 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（2020年9月11日から2021年3月10日まで）

	第 212 期 ~ 第 217 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□ 12,340	千円 31,841	千□ 80,548	千円 208,079

■利害関係人との取引状況等（2020年9月11日から2021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36作成期末	第 37 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□ 1,357,490	千□ 1,289,282	千円 3,349,040

<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（11,104,091,355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	2021 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 120,375	千アメリカ・ドル 122,263	千円 13,274,134	% 46.0	% -	% 24.5	% 20.0	% 1.5
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 9,645	千カナダ・ドル 9,947	千円 853,823	3.0	-	3.0	-	-
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 10,555	千オーストラリア・ドル 11,297	千円 945,293	3.3	-	2.3	1.0	-
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 9,780	千イギリス・ポンド 12,771	千円 1,925,878	6.7	-	6.7	-	-
ポ ー ラ ン ド	千ポーランド・ズロチ 25,400	千ポーランド・ズロチ 26,345	千円 743,988	2.6	-	2.6	-	-
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
ベルギー	7,328	9,292	1,200,070	4.2	-	4.2	-	-
フランス	14,300	17,004	2,195,981	7.6	-	7.6	-	-
ドイツ	6,375	8,894	1,148,655	4.0	-	3.8	-	0.2
スペイン	40,040	47,647	6,153,243	21.3	-	15.1	6.3	-
合 計	-	-	千円 28,441,069	98.6	-	69.7	27.2	1.7

(注1) 邦貨換算金額は、2021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、2021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	種 類	2021 年 3 月 10 日 現 在					
		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	20,610	19,505	2,117,704	2050/02/15	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	8,300	6,953	754,908	2040/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	9,410	10,137	1,100,581	2029/05/15	
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	25,000	26,431	2,869,683	2025/08/15	
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	15,000	15,446	1,677,024	2026/08/15	
US T N/B 0.125 09/30/22	国債証券	0.1250	4,055	4,053	440,130	2022/09/30	
US T N/B 0.125 10/15/23	国債証券	0.1250	20,000	19,919	2,162,663	2023/10/15	
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	6,300	6,696	727,061	2024/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	9,700	10,981	1,192,257	2028/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	2,000	2,137	232,119	2027/11/15	
小 計	—	—	120,375	122,263	13,274,134	—	
(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	4,700	5,058	434,164	2029/06/01	
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	4,945	4,889	419,658	2030/06/01	
小 計	—	—	9,645	9,947	853,823	—	
(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 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	3,040	3,385	283,262	2023/04/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	4,715	5,191	434,388	2027/11/21	
QUEENSLAND TREASURY CORP 1.75 08/21/31	特殊債券	1.7500	2,800	2,720	227,642	2031/08/21	
小 計	—	—	10,555	11,297	945,293	—	
(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	1,602	241,630	2044/01/22	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	2,610	2,816	424,800	2028/10/22	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	3,330	3,387	510,859	2029/10/22	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	300	476	71,927	2038/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	2,400	4,487	676,659	2055/12/07	
小 計	—	—	9,780	12,771	1,925,878	—	
(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	14,500	15,752	444,861	2026/07/25	
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	10,900	10,592	299,126	2030/10/25	
小 計	—	—	25,400	26,345	743,988	—	
(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	500	631	81,615	2050/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	4,728	6,513	841,104	2034/06/22	
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	2,100	2,147	277,350	2030/06/22	
小 計	—	—	7,328	9,292	1,200,070	—	
(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	3,800	5,093	657,834	2048/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	5,200	5,500	710,349	2029/05/25	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	5,300	6,410	827,798	2027/10/25	
小 計	—	—	14,300	17,004	2,195,981	—	

銘 柄	2021 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	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国 債 証 券	4.2500	3,055	5,467	706,128	2039/07/04
DEUTSCHLAND 08/15/29	国 債 証 券	0.0000	2,920	3,022	390,355	2029/08/15
BUNDESSCHAT 0.0 09/16/22	国 債 証 券	0.0000	400	403	52,171	2022/09/16
小 計	—	—	6,375	8,894	1,148,655	—
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 3.8 04/30/24	国 債 証 券	3.8000	1,900	2,154	278,195	2024/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国 債 証 券	1.9500	8,700	9,680	1,250,091	2026/04/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国 債 証 券	4.7000	3,790	6,429	830,255	2041/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国 債 証 券	2.3500	8,650	10,535	1,360,580	2033/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国 債 証 券	2.7500	9,100	10,145	1,310,240	2024/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国 債 証 券	2.1500	1,500	1,670	215,780	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国 債 証 券	1.4500	6,400	7,031	908,100	2027/10/31
小 計	—	—	40,040	47,647	6,153,243	—
合 計	—	—	—	—	28,441,069	—

■投資信託財産の構成

2021年3月10日現在

項 目	第 37 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 3,349,040	% 99.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	33,109	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	3,382,150	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、2021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28,623,508千円、99.1％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3月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.57円、1カナダ・ドル=85.83円、1オーストラリア・ドル=83.67円、1イギリス・ポンド=150.80円、1ポーランド・ズロチ=28.24円、1ユーロ=129.14円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年10月12日)、(2020年11月10日)、(2020年12月10日)、(2021年1月12日)、(2021年2月10日)、(2021年3月10日)現在

項 目	第 212 期 末	第 213 期 末	第 214 期 末	第 215 期 末	第 216 期 末	第 217 期 末
(A) 資 産	4,900,691,496円	4,835,048,196円	4,731,605,552円	4,803,650,257円	5,028,551,543円	4,859,602,635円
コール・ローン等	18,906,378	18,523,505	18,754,690	18,521,388	28,198,346	17,705,834
グローバル・ボンド・ポート・マザーファンド(評価額)	3,476,815,362	3,414,385,912	3,414,046,271	3,382,072,050	3,351,887,189	3,349,040,697
未 収 入 金	1,404,969,756	1,402,138,779	1,298,804,591	1,403,056,819	1,648,466,008	1,492,856,104
(B) 負 債	1,411,200,959	1,409,904,933	1,295,109,453	1,405,091,923	1,661,857,147	1,497,887,254
未 払 金	1,402,728,262	1,402,863,090	1,284,480,857	1,397,763,067	1,654,934,962	1,487,719,921
未 払 収 益 分 配 金	4,510,773	4,479,190	4,452,076	4,421,572	4,398,399	4,372,309
未 払 解 約 金	1,081,047	4	3,533,083	775	4	3,376,528
未 払 信 託 報 酬	2,869,680	2,552,786	2,633,259	2,895,319	2,514,067	2,409,185
そ の 他 未 払 費 用	11,197	9,863	10,178	11,190	9,715	9,311
(C) 純資産総額(A-B)	3,489,490,537	3,425,143,263	3,436,496,099	3,398,558,334	3,366,694,396	3,361,715,381
元 本	4,510,773,619	4,479,190,982	4,452,076,468	4,421,572,914	4,398,399,702	4,372,309,128
次 期 繰 越 損 益 金	△1,021,283,082	△1,054,047,719	△1,015,580,369	△1,023,014,580	△1,031,705,306	△1,010,593,747
(D) 受 益 権 総 口 数	4,510,773,619口	4,479,190,982口	4,452,076,468口	4,421,572,914口	4,398,399,702口	4,372,309,128口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,736円	7,647円	7,719円	7,686円	7,654円	7,689円

(注) 第211期末における元本額は4,549,083,685円、当作成期間(第212期～第217期)中における追加設定元本額は1,317,335円、同解約元本額は178,091,892円です。

■損益の状況

〔自 2020年 9月11日 至 2020年10月12日〕〔自 2020年10月13日 至 2020年11月10日〕〔自 2020年11月11日 至 2020年12月10日〕〔自 2020年12月11日 至 2021年 1月12日〕〔自 2021年 1月13日 至 2021年 2月10日〕〔自 2021年 2月11日 至 2021年 3月10日〕

項 目	第 212 期	第 213 期	第 214 期	第 215 期	第 216 期	第 217 期
(A) 配 当 等 収 益	△423円	△240円	△319円	△241円	△115円	△134円
受 取 利 息	-	-	3	4	1	-
支 払 利 息	△423	△240	△322	△245	△116	△134
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△16,083,452	△32,872,962	39,229,830	△7,037,993	△7,103,795	21,809,131
売 買 益	10,834,072	15,759,783	60,487,353	21,667,087	16,187,746	42,722,804
売 買 損	△26,917,524	△48,632,745	△21,257,523	△28,705,080	△23,291,541	△20,913,673
(C) 信 託 報 酬 等	△2,907,217	△2,562,649	△2,695,574	△2,932,419	△2,549,852	△2,445,011
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△18,991,092	△35,435,851	36,533,937	△9,970,653	△9,653,762	19,363,986
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△604,587,847	△623,678,757	△659,487,604	△623,062,099	△634,100,793	△644,295,094
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△393,193,370	△390,453,921	△388,174,626	△385,560,256	△383,552,352	△381,290,330
(配 当 等 相 当 額)	(69,604,044)	(69,117,035)	(68,700,227)	(68,230,527)	(67,873,317)	(67,470,875)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△462,797,414)	(△459,570,956)	(△456,874,853)	(△453,790,783)	(△451,425,669)	(△448,761,205)
(G) 合 計 (D + E + F)	△1,016,772,309	△1,049,568,529	△1,011,128,293	△1,018,593,008	△1,027,306,907	△1,006,221,438
(H) 収 益 分 配 金	△4,510,773	△4,479,190	△4,452,076	△4,421,572	△4,398,399	△4,372,309
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△1,021,283,082	△1,054,047,719	△1,015,580,369	△1,023,014,580	△1,031,705,306	△1,010,593,747
追 加 信 託 差 損 益 金	△393,193,370	△390,453,921	△388,174,626	△385,560,256	△383,552,352	△381,290,330
(配 当 等 相 当 額)	(69,604,095)	(69,117,094)	(68,700,449)	(68,230,738)	(67,873,364)	(67,470,923)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△462,797,465)	(△459,571,015)	(△456,875,075)	(△453,790,994)	(△451,425,716)	(△448,761,253)
分 配 準 備 積 立 金	13,758,340	11,384,494	11,028,225	8,530,541	5,885,177	5,369,051
繰 越 損 益 金	△641,848,052	△674,978,292	△638,433,968	△645,984,865	△654,038,131	△634,672,468

(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 212 期	第 213 期	第 214 期	第 215 期	第 216 期	第 217 期
(a) 経費控除後の配当等収益	2,689,548円	2,201,966円	4,166,252円	2,000,238円	1,797,912円	3,891,212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	69,604,095	69,117,094	68,700,449	68,230,738	67,873,364	67,470,923
(d) 分 配 準 備 積 立 金	15,579,565	13,661,718	11,314,049	10,951,875	8,485,664	5,850,148
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	87,873,208	84,980,778	84,180,750	81,182,851	78,156,940	77,212,283
(f) 1万口当たり当期分配対象額	194.81	189.72	189.08	183.61	177.69	176.59
(g) 分 配 金	4,510,773	4,479,190	4,452,076	4,421,572	4,398,399	4,372,309
(h) 1万口当たり分配金	10	10	10	10	10	10

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 212 期	第 213 期	第 214 期	第 215 期	第 216 期	第 217 期
1 万口当たり分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

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46期（決算日 2020年9月23日）

（計算期間 2020年3月24日～2020年9月23日）

グローバル・ボンド・ポート・マザーファンドの第46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)		債券組入率	債券先物率	純資産額
	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率			
42期 (2018年9月20日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
43期 (2019年3月20日)	23,529	2.1	451.50	2.4	98.4	-	27,482
44期 (2019年9月20日)	23,978	1.9	457.32	1.3	98.3	-	27,155
45期 (2020年3月23日)	24,591	2.6	466.14	1.9	98.7	-	27,725
46期 (2020年9月23日)	24,864	1.1	478.68	2.7	97.7	-	27,477
	25,740	3.5	490.25	2.4	98.3	-	28,951

(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

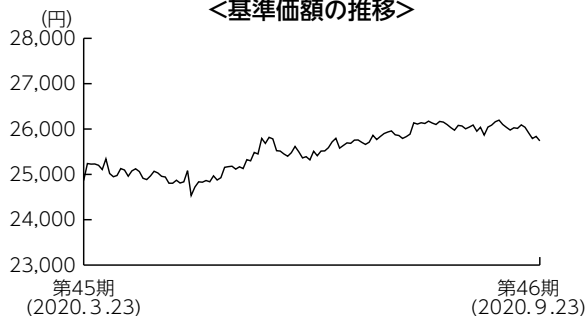
年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス (除く日本、 円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020 年 3 月 23 日	円 24,864	% -	ポイント 478.68	% -	% 97.7	% -
3 月 末	25,342	1.9	480.58	0.4	97.9	-
4 月 末	24,835	△0.1	472.88	△1.2	97.4	-
5 月 末	25,299	1.7	481.05	0.5	98.2	-
6 月 末	25,717	3.4	488.81	2.1	98.5	-
7 月 末	25,887	4.1	494.14	3.2	98.3	-
8 月 末	25,866	4.0	492.65	2.9	98.2	-
(期 末) 2020 年 9 月 23 日	25,740	3.5	490.25	2.4	98.3	-

(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（2020年3月24日から2020年9月23日まで）

<基準価額の推移>



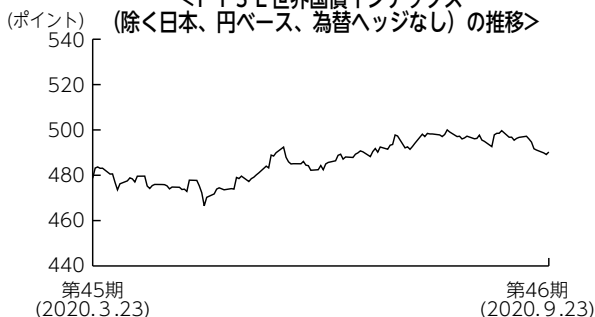
基準価額の推移

当期末の基準価額は25,740円となり、前期末に比べ3.5%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感染拡大を背景として世界が景気後退に陥る中、各国の金融当局が金融緩和策を打ち出した結果、債券市場で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。

<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)の推移>



投資環境

米国債利回りは、F R B（米連邦準備理事会）の金融緩和策を受けて低下しましたが、その後は経済活動の段階的な再開や国債発行による需給悪化懸念などから横ばい圏で推移しました。ドイツ国債利回りも、米国債と同様に期初に低下した後は横ばい圏での推移となり、イタリア国債はE C B（欧州中央銀行）の量的緩和拡大や欧州復興基金への期待などから利回りは低下しました。

為替市場は、まちまちの動きとなりました。新型コロナウイルス感染拡大の一巡に伴い漸進的に経済活動

再開が進んだことなどを背景に、投資家心理の改善が見られ、円への逃避需要が低下したことから、期を通じて見ると米ドルを除く多くの主要通貨に対して円安が進行しました。一方で、米国内の新型コロナウイルス感染第二波に対する懸念や、F R Bの大規模金融緩和策による潤沢な米ドル供給、対外金利差縮小を受けて米ドルは軟調に推移し、対円でも下落しました。

ポートフォリオについて

世界経済の減速を見込み、米国を中心にポートフォリオのデュレーション*を長期化し、ユーロ圏では期待収益率の高いスペイン等の周辺国をベンチマークに対してオーバーウェイトとする戦略を基本にリスク量を調整しました。また国別の投資配分については、金融緩和余地の乏しいユーロ圏などの投資比率をアンダーウェイトとし、米国や豪州、カナダ、ポーランドなどをオーバーウェイトとしました。

*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2.4%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを1.1%上回りました。世界的に国債利回りが低下する中で、デフレーションを長期化していたこと等が債券部分のプラス寄与の主因となりました。

今後の運用方針

新型コロナウイルス対応からの経済活動の回復は一服し、一部の国では感染再拡大の兆候も見られます。また米中間の緊張も先行き不透明感を強めており、当面はF R Bが緩和的な金融政策を継続すると見えています。銘柄選択については、米国での金融緩和長期化とともに金利低下が進むことを想定し、デフレーションの長期化を軸に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	
	金 額	比 率
(a) その他費用	1円	0.006%
（保管費用）	(1)	(0.006)
（その他）	(0)	(0.000)
合 計	1	0.006

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。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(25,532円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2020年3月24日から2020年9月23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 35,134	千アメリカ・ドル 41,348 (-)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 10,458	千カナダ・ドル -
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 3,432	千オーストラリア・ドル 3,464 (-)
		地方債証券	-	11,787 (-)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 10,110	千イギリス・ポンド 3,632 (-)
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ -	千メキシコ・ペソ 238,269 (-)
ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 27,322	千ポーランド・ズロチ 1,091 (-)	
国	ユ ー ロ 圏	アイルランド	千ユーロ -	千ユーロ 1,007 (-)
		ベルギー	国債証券 8,762	2,000 (-)
		フランス	国債証券 -	549 (-)
		ドイツ	国債証券 10,754	3,475 (-)
		スペイン	国債証券 1,866	5,295 (-)

(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 (2020年3月24日から2020年9月23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 113,089	千アメリカ・ドル 127,405	千円 13,395,434	% 46.3	% -	% 33.0	% 13.3	% -	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 9,494	千カナダ・ドル 10,556	千円 833,828	2.9	-	2.9	-	-	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 11,900	千オーストラリア・ドル 13,052	千円 980,148	3.4	-	2.7	-	0.7	
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 7,015	千イギリス・ポンド 10,590	千円 1,416,771	4.9	-	4.9	-	-	
ポ ー ラ ン ド	千ポーランド・ズロチ 24,250	千ポーランド・ズロチ 26,526	千円 726,564	2.5	-	2.5	-	-	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
ベルギー	9,798	12,248	1,504,661	5.2	-	4.2	1.0	-	
フランス	14,249	17,364	2,133,115	7.4	-	7.4	-	-	
ドイツ	7,151	9,702	1,191,857	4.1	-	4.1	-	-	
スペイン	42,737	51,128	6,280,581	21.7	-	14.6	7.1	-	
合 計	-	-	千円 28,462,963	98.3	-	76.3	21.4	0.7	

(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	6,000	6,863	721,621	2050/02/15	
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	6,760	7,307	768,272	2030/02/15	
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	692	719	75,655	2025/02/28	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	3,000	2,972	312,487	2040/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	30,437	35,085	3,688,918	2029/05/15	
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	33,000	35,786	3,762,640	2025/08/15	
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	19,700	23,778	2,500,073	2028/11/15	
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	13,500	14,892	1,565,764	2029/11/15	
小計	—	—	113,089	127,405	13,395,434	—	
(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	5,000	5,756	454,729	2029/06/01	
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	4,494	4,799	379,098	2030/06/01	
小計	—	—	9,494	10,556	833,828	—	
(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 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	1,150	1,477	110,928	2047/03/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	3,800	4,366	327,915	2027/11/21	
AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	国債証券	2.0000	2,450	2,506	188,188	2021/12/21	
TREASURY CORP VICTORIA 2.25 11/20/34	地方債証券	2.2500	1,000	1,067	80,161	2034/11/20	
QUEENSLAND TREASURY CORP 1.75 08/21/31	特殊債証券	1.7500	3,500	3,635	272,954	2031/08/21	
小計	—	—	11,900	13,052	980,148	—	
(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	1,758	235,199	2044/01/22	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	3,275	3,486	466,428	2029/10/22	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	300	516	69,078	2038/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	2,300	4,829	646,065	2055/12/07	
小計	—	—	7,015	10,590	1,416,771	—	
(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	24,250	26,526	726,564	2026/07/25	
小計	—	—	24,250	26,526	726,564	—	
(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	500	682	83,888	2050/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	4,728	6,751	829,309	2034/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	2,270	2,425	297,913	2025/06/22	
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	2,300	2,389	293,550	2030/06/22	
小計	—	—	9,798	12,248	1,504,661	—	
(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	3,000	4,305	528,833	2048/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	5,200	5,594	687,278	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	6,049	7,465	917,003	2027/10/25
小計	—	—	14,249	17,364	2,133,115	—
(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	2,621	4,934	606,160	2039/07/04
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	4,530	4,767	585,696	2029/08/15
小計	—	—	7,151	9,702	1,191,857	—
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	5,637	6,500	798,487	2024/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	8,700	9,777	1,201,035	2026/04/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	3,200	5,609	689,053	2041/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	8,200	10,186	1,251,253	2033/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	9,100	10,279	1,262,702	2024/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	1,500	1,688	207,387	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	6,400	7,087	870,663	2027/10/31
小計	—	—	42,737	51,128	6,280,581	—
合計	—	—	—	—	28,462,963	—

■投資信託財産の構成

2020年9月23日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 28,462,963	% 98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	505,587	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	28,968,550	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、28,650,122千円、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、2020年9月23日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.14円、1カナダ・ドル=78.99円、1オーストラリア・ドル=75.09円、1イギリス・ポンド=133.78円、1ポーランド・ズロチ=27.39円、1ユーロ=122.84円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年9月23日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	28,968,550,878円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	319,829,465
公 社 債(評価額)	28,462,963,109
未 収 利 息	183,381,383
前 払 費 用	2,376,921
(B) 負 債	17,322,000
未 払 解 約 金	17,322,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	28,951,228,878
元 本	11,247,755,546
次 期 繰 越 損 益 金	17,703,473,332
(D) 受 益 権 総 口 数	11,247,755,546口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,740円

(注1) 期首元本額 11,051,092,894円
追加設定元本額 987,869,389円
一部解約元本額 791,206,737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) 3,304,956,374円
グローバル・ボンド・ポート (Dコース) 4,730,777,626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) 1,782,084,316円
D I AMグローバル・ボンド・ポート毎月決算コース2 1,350,325,772円
D I AMグローバル・ボンド・ポートVA (ヘッジなし) 79,611,458円
期末元本合計 11,247,755,546円

■損益の状況

当期 自2020年3月24日 至2020年9月23日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	270,727,570円
受 取 利 息	270,824,145
支 払 利 息	△96,575
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	721,522,474
売 買 益	1,518,185,294
売 買 損	△796,662,820
(C) そ の 他 費 用	△1,632,459
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	990,617,585
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	16,425,928,399
(F) 解 約 差 損 益 金	△1,232,611,263
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,519,538,611
(H) 合 計(D+E+F+G)	17,703,473,332
次 期 繰 越 損 益 金(H)	17,703,473,332

(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。