

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218期	<決算日	2021年4月12日>
第219期	<決算日	2021年5月10日>
第220期	<決算日	2021年6月10日>
第221期	<決算日	2021年7月12日>
第222期	<決算日	2021年8月10日>
第223期	<決算日	2021年9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9月10日に第223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/>

DIAM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			FTSE世界国債インデックス		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	除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし (ベンチマーク)	期中 騰落率			
第34作成期	194期 (2019年4月10日)	円	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
	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10月10日)	7,475	10	0.1	465.39	0.3	97.9	-	3,743
	201期 (2019年11月11日)	7,454	10	△0.1	465.70	0.1	97.7	-	3,704
	202期 (2019年12月10日)	7,460	10	0.2	467.04	0.3	97.8	-	3,638
	203期 (2020年1月10日)	7,521	10	1.0	471.04	0.9	97.9	-	3,632
	204期 (2020年2月10日)	7,601	10	1.2	477.87	1.5	97.7	-	3,624
第36作成期	205期 (2020年3月10日)	7,608	10	0.2	474.94	△0.6	96.8	-	3,616
	206期 (2020年4月10日)	7,587	10	△0.1	479.59	1.0	97.4	-	3,575
	207期 (2020年5月11日)	7,486	10	△1.2	471.78	△1.6	97.0	-	3,519
	208期 (2020年6月10日)	7,673	10	2.6	485.95	3.0	97.9	-	3,577
	209期 (2020年7月10日)	7,710	10	0.6	490.33	0.9	98.0	-	3,564
	210期 (2020年8月11日)	7,830	10	1.7	497.05	1.4	98.0	-	3,604
第37作成期	211期 (2020年9月10日)	7,788	10	△0.4	496.26	△0.2	97.9	-	3,542
	212期 (2020年10月12日)	7,736	10	△0.5	495.37	△0.2	97.8	-	3,489
	213期 (2020年11月10日)	7,647	10	△1.0	492.35	△0.6	98.3	-	3,425
	214期 (2020年12月10日)	7,719	10	1.1	496.29	0.8	98.0	-	3,436
	215期 (2021年1月12日)	7,686	10	△0.3	495.26	△0.2	97.9	-	3,398
	216期 (2021年2月10日)	7,654	10	△0.3	494.17	△0.2	98.3	-	3,366
第38作成期	217期 (2021年3月10日)	7,689	10	0.6	500.51	1.3	98.2	-	3,361
	218期 (2021年4月12日)	7,718	10	0.5	502.47	0.4	98.0	-	3,356
	219期 (2021年5月10日)	7,751	10	0.6	502.97	0.1	97.8	-	3,355
	220期 (2021年6月10日)	7,836	10	1.2	511.66	1.7	98.1	-	3,344
	221期 (2021年7月12日)	7,788	10	△0.5	510.18	△0.3	98.3	-	3,273
	222期 (2021年8月10日)	7,787	10	0.1	512.99	0.6	98.6	-	3,246
	223期 (2021年9月10日)	7,740	10	△0.5	511.38	△0.3	98.2	-	3,191

(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5) FTSE世界国債インデックスは、FTSE 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。FTSE 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、FTSE 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FTSE 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	騰 落 率	騰 落 率		
第218期	(期 首) 2021年3月10日	円 7,689	% -	ポイント 500.51	% -	% 98.2	% -
	3 月 末	7,723	0.4	501.12	0.1	97.7	-
	(期 末) 2021年4月12日	7,728	0.5	502.47	0.4	98.0	-
第219期	(期 首) 2021年4月12日	7,718	-	502.47	-	98.0	-
	4 月 末	7,730	0.2	502.93	0.1	97.5	-
	(期 末) 2021年5月10日	7,761	0.6	502.97	0.1	97.8	-
第220期	(期 首) 2021年5月10日	7,751	-	502.97	-	97.8	-
	5 月 末	7,812	0.8	510.44	1.5	98.3	-
	(期 末) 2021年6月10日	7,846	1.2	511.66	1.7	98.1	-
第221期	(期 首) 2021年6月10日	7,836	-	511.66	-	98.1	-
	6 月 末	7,777	△0.8	508.66	△0.6	98.0	-
	(期 末) 2021年7月12日	7,798	△0.5	510.18	△0.3	98.3	-
第222期	(期 首) 2021年7月12日	7,788	-	510.18	-	98.3	-
	7 月 末	7,799	0.1	513.08	0.6	98.0	-
	(期 末) 2021年8月10日	7,797	0.1	512.99	0.6	98.6	-
第223期	(期 首) 2021年8月10日	7,787	-	512.99	-	98.6	-
	8 月 末	7,767	△0.3	512.29	△0.1	98.5	-
	(期 末) 2021年9月10日	7,750	△0.5	511.38	△0.3	98.2	-

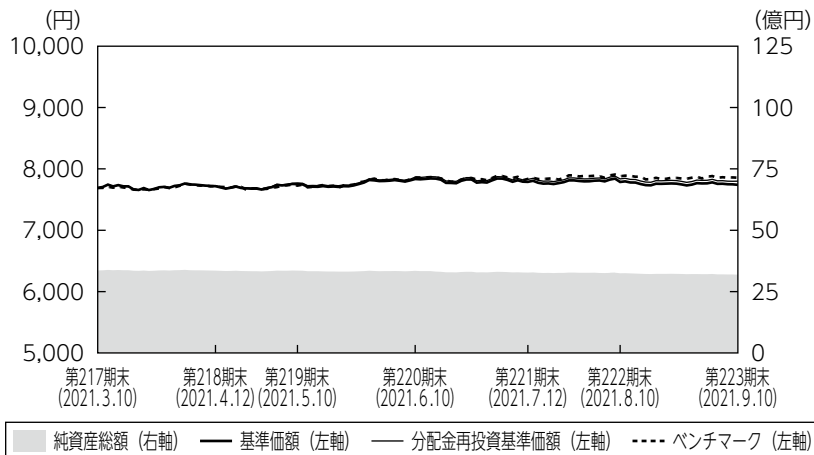
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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218期～第223期の運用経過（2021年3月11日から2021年9月10日まで）

基準価額等の推移



第218期首： 7,689円
 第223期末： 7,740円
 （既払分配金60円）
 騰落率： 1.4%
 （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に対する過度な期待のはく落により、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、当作成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、市場の過度の金利上昇期待をはく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。

為替市場では主要通貨に対する円安が小幅に進みました。主要先進国における新型コロナウイルスワクチン接種の広がりを受けて経済活動の正常化が進み、世界経済の先行きに楽観的な見方が広がったことや、経済再開に伴うインフレ圧力の増大を受けて、米国はじめ世界の主要中央銀行における金融緩和縮小観測が強まったことなどが主な円安要因となりました。

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。通貨戦略については、金融緩和に伴う米ドル需給の緩和的な状況から、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軸にポジション運営を実施しました。ただし、米ドル高材料が強く意識されると判断した局面においては、機動的に米ドルをオーバーウェイトとする運営も実施しました。

●グローバル・ボンド・ポート・マザーファンド

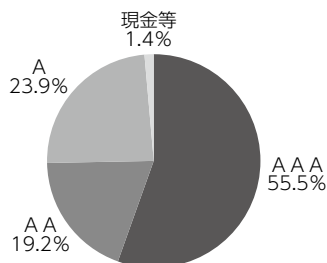
銘柄選択では、ユーロ圏のデュレーション^{*}長期化幅を縮小し、英国はデュレーション長期化を解消しました。一方、中長期的な長期金利の低下見通しに基づき、短期的な長期金利の反発局面を捉えて米国の長期化幅を拡大しました。国別の投資配分については、ユーロ圏の配分を引き下げ、英国の配分を引き上げました。

^{*}金利変動に対する債券価格の変動性。

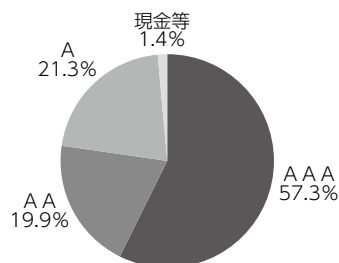
【グローバル・ボンド・ポート・マザーファンドの運用状況】 ※比率は純資産総額に対する割合です。

○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	43.3%	2.8%	
	カナダ	2.0%	1.0%	
	計	45.2%	3.8%	
中南米	メキシコ	0.8%	△0.8%	
	計	0.8%	△0.8%	
欧州	オーストリア	1.6%	△1.6%	
	ベルギー	2.6%	1.6%	
	フィンランド	0.7%	△0.7%	
	フランス	10.7%	△3.1%	
	ドイツ	7.7%	△3.7%	
	アイルランド	0.9%	△0.9%	
	イタリア	9.8%	△9.8%	
	オランダ	1.9%	△1.9%	
	スペイン	6.1%	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	50.3%	△4.0%	
アジア・ オセアニア	オーストラリア	2.3%	1.0%	
	シンガポール	0.4%	△0.4%	
	マレーシア	0.5%	△0.5%	
	計	3.2%	0.0%	
中東	イスラエル	0.4%	△0.4%	
	計	0.4%	△0.4%	
	現金など	-	-	
	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	48.2%	2.4%	
	カナダ	2.0%	1.0%	
	計	47.7%	3.4%	
中南米	メキシコ	0.0%	△0.7%	
	計	0.0%	△0.7%	
欧州	オーストリア	0.0%	△1.5%	
	ベルギー	3.7%	2.4%	
	フィンランド	0.0%	0.6%	
	フランス	7.3%	10.3%	
	ドイツ	4.2%	7.5%	
	アイルランド	0.0%	0.8%	
	イタリア	0.0%	9.5%	
	オランダ	0.0%	1.9%	
	スペイン	18.8%	6.0%	
	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%
	英国	8.2%	6.3%	1.9%
ポーランド	2.5%	0.6%	1.9%	
ノルウェー	0.0%	0.2%	△0.2%	
	計	44.7%	7.9%	
アジア・ オセアニア	オーストラリア	2.8%	1.9%	
	シンガポール	0.0%	0.5%	
	マレーシア	0.0%	0.5%	
	計	2.8%	2.8%	
中東	イスラエル	0.0%	0.5%	
	計	0.0%	0.5%	
	現金など	1.4%	0.0%	
	合計	100.0%	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%	△13.2%	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。



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	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	1.8%	—	—	—	—	—

(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。

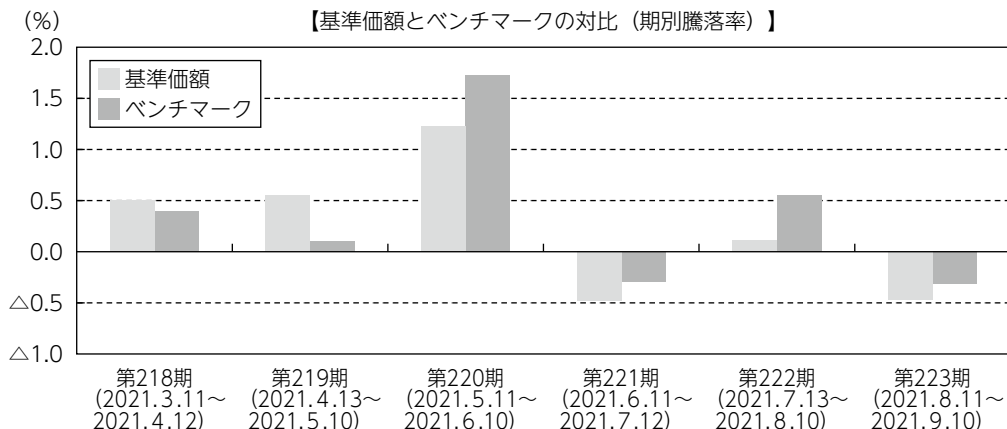
(注3) 世界国債インデックスとは、FTSE世界国債インデックス（除く日本）です。

(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2.2%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.7%下回りました。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債券部分のプラス寄与の主因となりました。一方、通貨配分については、ベンチマーク比率に対するカナダドルやノルウェークローネなどのオーバーウェイトを主因に、マイナスとなりました。



(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（1万口当たり）

項目	第218期	第219期	第220期	第221期	第222期	第223期
	2021年3月11日 ~2021年4月12日	2021年4月13日 ~2021年5月10日	2021年5月11日 ~2021年6月10日	2021年6月11日 ~2021年7月12日	2021年7月13日 ~2021年8月10日	2021年8月11日 ~2021年9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	10円	8円	10円	4円	5円	3円
当期の収益以外	-円	1円	-円	6円	4円	6円
翌期繰越分配対象額	166円	165円	166円	160円	155円	149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

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には徐々に落すと見ています。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	第218期～第223期 (2021年3月11日 ～2021年9月10日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	37円	
(投信会社)	(18)	(0.236)	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)	(0.208)	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	2	0.026	(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)	(0.013)	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)	(1)	(0.012)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	39	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。

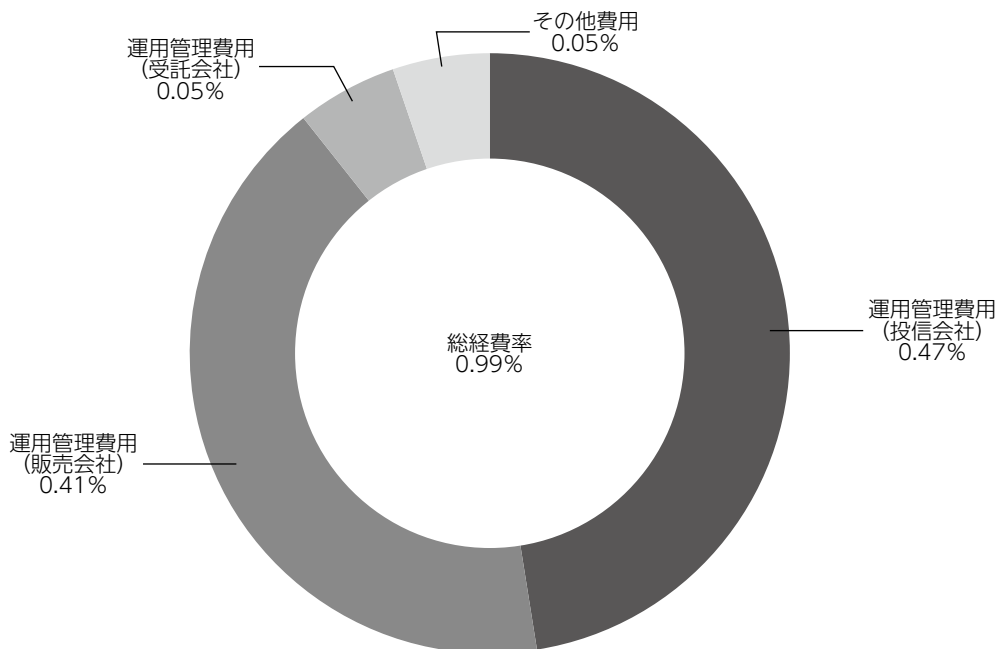
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.99%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（2021年3月11日から2021年9月10日まで）

	第 218 期 ~ 第 223 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□ 7,954	千円 20,898	千□ 106,512	千円 282,334

■利害関係人との取引状況等（2021年3月11日から2021年9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37作成期末	第 38 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□ 1,289,282	千□ 1,190,724	千円 3,177,925

<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（11,046,239,719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 9 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 126,660	千アメリカ・ドル 129,346	千円 14,199,618	% 48.2	% -	% 21.9	% 25.2	% 1.1
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 9,495	千カナダ・ドル 9,956	千円 863,153	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 10,214	千円 826,455	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 15,831	千円 2,405,555	8.2	-	6.2	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 25,754	千円 735,495	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	8,469	1,099,458	3.7	-	3.7	-	-
フランス	14,230	16,517	2,144,179	7.3	-	7.3	-	-
ドイツ	7,475	9,569	1,242,240	4.2	-	3.3	-	0.9
スペイン	34,970	42,685	5,541,021	18.8	-	11.5	7.3	-
合 計	-	-	千円 29,057,178	98.6	-	60.7	35.8	2.1

(注1) 邦貨換算金額は、2021年9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9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	2021年9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	23,130	23,638	2,595,054	2050/02/15	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	9,420	8,422	924,655	2040/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	9,410	10,266	1,127,051	2029/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	13,320	13,736	1,508,022	2031/05/15	
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	16,560	17,457	1,916,524	2025/08/15	
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	17,100	17,693	1,942,354	2026/08/15	
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	500	473	52,006	2030/08/15	
US T N/B 0.125 09/30/22	国債証券	0.1250	3,070	3,071	337,182	2022/09/30	
US T N/B 0.125 10/15/23	国債証券	0.1250	26,000	25,931	2,846,809	2023/10/15	
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	6,150	6,499	713,466	2024/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	2,000	2,154	236,490	2027/11/15	
小計	—	—	126,660	129,346	14,199,618	—	
(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	4,908	425,534	2029/06/01	
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	4,995	5,048	437,618	2030/06/01	
小計	—	—	9,495	9,956	863,153	—	
(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	217,465	2051/06/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	4,210	4,697	380,110	2027/11/21	
QUEENSLAND TREASURY CORP 1.75 08/21/31	特殊債券	1.7500	2,800	2,828	228,879	2031/08/21	
小計	—	—	9,960	10,214	826,455	—	
(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	1,636	248,611	2044/01/22	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	3,730	3,780	574,475	2025/06/07	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	2,295	2,478	376,634	2028/10/22	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	3,330	3,409	518,071	2029/10/22	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	300	480	73,015	2038/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	2,090	4,045	614,745	2055/12/07	
小計	—	—	12,885	15,831	2,405,555	—	
(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	14,286	407,994	2026/07/25	
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	12,040	11,467	327,501	2030/10/25	
小計	—	—	25,520	25,754	735,495	—	
(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	1,632	211,964	2050/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	4,728	6,487	842,175	2034/06/22	
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	340	349	45,318	2030/06/22	
小計	—	—	6,368	8,469	1,099,458	—	
(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	3,601	467,557	2048/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	6,600	7,002	908,994	2029/05/25	

銘柄	2021 年 9 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…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	5,913	767,628	2027/10/25
小 計	-	-	14,230	16,517	2,144,179	-
(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	4,411	572,703	2039/07/04
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	2,920	3,042	394,935	2029/08/15
BUNDESSCHAT 0.0 09/16/22	国債証券	0.0000	2,100	2,115	274,601	2022/09/16
小 計	-	-	7,475	9,569	1,242,240	-
(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	8,700	9,650	1,252,771	2026/04/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	5,040	8,583	1,114,265	2041/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	8,650	10,561	1,371,007	2033/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	4,680	5,168	670,920	2024/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	1,500	1,663	215,928	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	6,400	7,057	916,127	2027/10/31
小 計	-	-	34,970	42,685	5,541,021	-
合 計	-	-	-	-	29,057,178	-

■投資信託財産の構成

2021年9月10日現在

項 目	第 38 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 3,177,925	% 99.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	33,101	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	3,211,026	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9月10日現在、グローバル・ボンド・ポート・マザーファンドは29,393,588千円、99.3%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10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.78円、1カナダ・ドル=86.69円、1オーストラリア・ドル=80.91円、1イギリス・ポンド=151.95円、1ポーランド・ズロチ=28.558円、1ユーロ=129.81円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年4月12日)、(2021年5月10日)、(2021年6月10日)、(2021年7月12日)、(2021年8月10日)、(2021年9月10日)現在

項 目	第 218 期 末	第 219 期 末	第 220 期 末	第 221 期 末	第 222 期 末	第 223 期 末
(A) 資 産	4,740,147,050円	4,458,858,241円	5,965,115,358円	4,876,045,172円	4,930,408,277円	4,135,947,866円
コール・ローン等	18,709,043	17,315,674	18,717,013	18,452,797	10,564,173	17,686,785
グローバル・ボンド・ポート・マザーファンド(評価額)	3,346,238,530	3,336,485,860	3,334,580,365	3,265,013,903	3,239,733,392	3,177,925,632
未 収 入 金	1,375,199,477	1,105,056,707	2,611,817,980	1,592,578,472	1,680,110,712	940,335,449
(B) 負 債	1,383,479,562	1,102,875,468	2,620,279,460	1,602,089,250	1,683,429,686	944,906,433
未 払 金	1,376,273,740	1,095,242,260	2,612,235,224	1,592,281,988	1,676,824,734	935,240,640
未 払 収 益 分 配 金	4,349,343	4,329,973	4,268,346	4,203,968	4,169,759	4,123,050
未 払 解 約 金	4	895,275	1,120,068	2,886,506	7	2,976,209
未 払 信 託 報 酬	2,845,474	2,398,687	2,645,598	2,706,332	2,425,811	2,556,657
そ の 他 未 払 費 用	11,001	9,273	10,224	10,456	9,375	9,877
(C) 純資産総額(A-B)	3,356,667,488	3,355,982,773	3,344,835,898	3,273,955,922	3,246,978,591	3,191,041,433
元 本	4,349,343,464	4,329,973,762	4,268,346,889	4,203,968,629	4,169,759,975	4,123,050,558
次 期 繰 越 損 益 金	△992,675,976	△973,990,989	△923,510,991	△930,012,707	△922,781,384	△932,009,125
(D) 受 益 権 総 口 数	4,349,343,464□	4,329,973,762□	4,268,346,889□	4,203,968,629□	4,169,759,975□	4,123,050,558□
1万口当たり基準価額(C/D)	7,718円	7,751円	7,836円	7,788円	7,787円	7,740円

(注) 第217期末における元本額は4,372,309,128円、当作成期間(第218期～第223期)中における追加設定元本額は2,639,159円、同解約元本額は251,897,729円です。

■損益の状況

〔自 2021年3月11日 至 2021年4月12日〕〔自 2021年4月13日 至 2021年5月10日〕〔自 2021年5月11日 至 2021年6月10日〕〔自 2021年6月11日 至 2021年7月12日〕〔自 2021年7月13日 至 2021年8月10日〕〔自 2021年8月11日 至 2021年9月10日〕

項 目	第 218 期	第 219 期	第 220 期	第 221 期	第 222 期	第 223 期
(A) 配 当 等 収 益	△146円	△110円	△169円	△234円	△364円	△263円
受 取 利 息	—	—	—	—	5	9
支 払 利 息	△146	△110	△169	△234	△369	△272
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	19,842,648	21,002,236	43,637,003	△13,354,585	6,427,153	△12,735,050
売 買 益	41,102,788	28,850,115	62,616,695	24,165,455	29,707,757	12,941,148
売 買 損	△21,260,140	△7,847,879	△18,979,692	△37,520,040	△23,280,604	△25,676,198
(C) 信 託 報 酬 等	△2,883,932	△2,407,960	△2,745,560	△2,869,908	△2,593,482	△2,706,166
(D) 当 期 繰 越 損 益 金 (A+B+C)	16,958,570	18,594,166	40,891,274	△16,224,727	3,833,307	△15,441,479
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△625,945,898	△610,589,115	△587,646,196	△542,645,079	△558,477,232	△552,537,019
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△379,339,305	△377,666,067	△372,487,723	△366,938,933	△363,967,700	△359,907,577
(配 当 等 相 当 額)	(67,116,963)	(66,818,327)	(65,868,959)	(64,877,122)	(64,349,482)	(63,628,690)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△446,456,268)	(△444,484,394)	(△438,356,682)	(△431,816,055)	(△428,317,182)	(△423,536,267)
(G) 合 計 (D+E+F)	△988,326,633	△969,661,016	△919,242,645	△925,808,739	△918,611,625	△927,886,075
(H) 収 益 分 配 金	△4,349,343	△4,329,973	△4,268,346	△4,203,968	△4,169,759	△4,123,050
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△992,675,976	△973,990,989	△923,510,991	△930,012,707	△922,781,384	△932,009,125
追 加 信 託 差 損 益 金	△379,339,305	△377,666,067	△372,487,723	△366,938,933	△363,967,700	△361,950,249
(配 当 等 相 当 額)	(67,117,091)	(66,818,392)	(65,870,007)	(64,877,351)	(64,349,538)	(61,586,093)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△446,456,396)	(△444,484,459)	(△438,357,730)	(△431,816,284)	(△428,317,238)	(△423,536,342)
分 配 準 備 積 立 金	5,474,804	4,941,374	5,034,899	2,436,494	577,205	—
繰 越 損 益 金	△618,811,475	△601,266,296	△556,058,167	△565,510,268	△559,390,889	△570,058,876

(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 218 期	第 219 期	第 220 期	第 221 期	第 222 期	第 223 期
(a) 経費控除後の配当等収益	4,483,741円	3,821,068円	4,433,786円	1,682,119円	2,330,357円	1,509,657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	67,117,091	66,818,392	65,870,007	64,877,351	64,349,538	63,628,765
(d) 分 配 準 備 積 立 金	5,340,406	5,450,279	4,869,459	4,958,343	2,416,607	570,721
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	76,941,238	76,089,739	75,173,252	71,517,813	69,096,502	65,709,143
(f) 1万口当たり当期分配対象額	176.90	175.73	176.12	170.12	165.71	159.37
(g) 分 配 金	4,349,343	4,329,973	4,268,346	4,203,968	4,169,759	4,123,050
(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 218 期	第 219 期	第 220 期	第 221 期	第 222 期	第 223 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47期 (決算日 2021年3月22日)

(計算期間 2020年9月24日～2021年3月22日)

グローバル・ボンド・ポート・マザーファンドの第47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	純資産額
	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率			
43期 (2019年3月20日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
47期 (2021年3月22日)	25,740	3.5	490.25	2.4	98.3	-	28,951
	25,869	0.5	498.38	1.7	98.5	-	28,731

(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)。

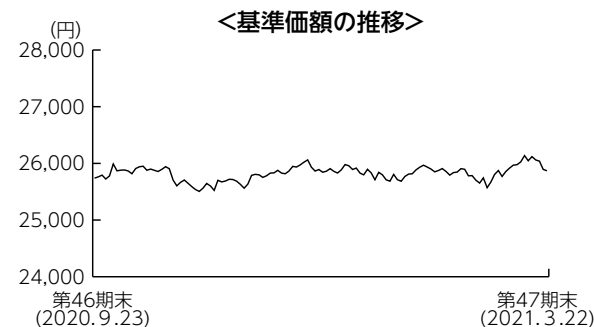
■当期中の基準価額と市況の推移

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 9 月 23 日	円 25,740	% -	ポイント 490.25	% -	% 98.3	% -
9 月 末	25,990	1.0	494.88	0.9	97.4	-
10 月 末	25,539	△0.8	488.04	△0.5	98.2	-
11 月 末	25,781	0.2	493.20	0.6	98.7	-
12 月 末	25,958	0.8	497.33	1.4	98.2	-
2021 年 1 月 末	25,933	0.7	496.21	1.2	98.2	-
2 月 末	25,572	△0.7	494.15	0.8	98.7	-
(期 末) 2021 年 3 月 22 日	25,869	0.5	498.38	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（2020年9月24日から2021年3月22日まで）

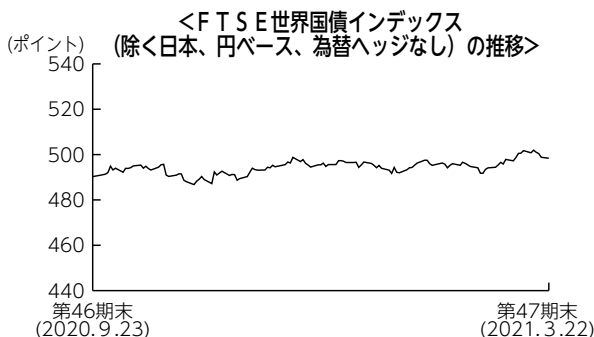


基準価額の推移

当期末の基準価額は25,869円となり、前期末比で0.5%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

為替市場において、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、基準価額の上昇要因となりました。一方で、新型コロナウイルスのワクチンの普及や米追加経済対策による景気回復に楽観的な見方から、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。こうした中、為替変動によるプラス寄与により、当期の基準価額は上昇しました。



投資環境

米国債利回りは一時的にもみ合う場面もありましたが、新型コロナウイルスのワクチンの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

イルスの感染拡大を受けて2020年は低下基調（価格は上昇）で推移しましたが、2021年に入ると米国債に連れて利回りが上昇に転じました。

為替市場では、多くの主要通貨に対する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の開発ならびに接種の進展などから、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

銘柄選択では、米国債の長短金利差拡大が大幅に進行した中、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、米国のデュレーション[※]長期化幅を拡大した一方、ユーロ圏とオーストラリアで縮小させました。国別の投資配分については、ユーロ圏の投資比率を引き下げ、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1.2%下回りました。世界的に国債利回りの上昇が進む中で、デュレーションを長期化していたこと等からマイナス寄与となりました。

今後の運用方針

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楽観的な見方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。

■ 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)	(2)	(0.007)	
合 計	(0)	(0.000)	
合 計	2	0.007	
期中の平均基準価額は25,823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 (2020年9月24日から2021年3月22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 91,049	千アメリカ・ドル 88,271 (-)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 633	千カナダ・ドル 495 (-)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 6,236	千オーストラリア・ドル 5,564 (-)
		地方債証券	-	995 (-)
		特殊債証券	-	694 (-)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 3,770	千イギリス・ポンド 582 (-)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 12,448	千ポーランド・ズロチ 12,302 (-)
国	ユーロ圏	ベルギー	千ユーロ -	千ユーロ 2,610 (-)
		フランス	1,151	920 (-)
		ドイツ	1,184	1,696 (-)
		スペイン	1,594	4,295 (-)

(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9月24日から2021年3月22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 120,375	千アメリカ・ドル 120,876	千円 13,164,609	% 45.8	% -	% 24.2	% 20.1	% 1.5
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 9,645	千カナダ・ドル 9,869	千円 858,654	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 11,282	千円 949,294	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 12,554	千円 1,891,861	6.6	-	6.6	-	-
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 26,420	千円 739,769	2.6	-	2.6	-	-
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
ベルギー	7,328	9,244	1,196,856	4.2	-	4.2	-	-
フ ラ ン ス	14,300	16,920	2,190,499	7.6	-	7.6	-	-
ド イ ツ	6,375	8,854	1,146,338	4.0	-	3.8	-	0.2
ス ペ イ ン	40,040	47,640	6,167,597	21.5	-	15.2	6.3	-
合 計	-	-	千円 28,305,480	98.5	-	69.4	27.4	1.7

(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	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				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	20,610	18,689	2,035,428	2050/02/15
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	8,300	6,721	732,060	2040/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	9,410	10,015	1,090,817	2029/05/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	25,000	26,384	2,873,564	2025/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	15,000	15,386	1,675,767	2026/08/15
US T N/B 0.125 09/30/22	国債証券	0.1250	4,055	4,054	441,612	2022/09/30
US T N/B 0.125 10/15/23	国債証券	0.1250	20,000	19,947	2,172,499	2023/10/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	6,300	6,693	729,016	2024/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	9,700	10,860	1,182,868	2028/11/15
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	2,000	2,120	230,974	2027/11/15
小 計	—	—	120,375	120,876	13,164,609	—
(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	5,022	436,983	2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	4,945	4,846	421,670	2030/06/01
小 計	—	—	9,645	9,869	858,654	—
(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	3,381	284,545	2023/04/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	4,715	5,182	436,035	2027/11/21
QUEENSLAND TREASURY CORP 1.75 08/21/31	特殊債券	1.7500	2,800	2,718	228,714	2031/08/21
小 計	—	—	10,555	11,282	949,294	—
(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	1,565	235,895	2044/01/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	2,610	2,797	421,596	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	3,330	3,356	505,787	2029/10/22
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	300	468	70,571	2038/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	2,400	4,366	658,010	2055/12/07
小 計	—	—	9,780	12,554	1,891,861	—
(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	15,768	441,513	2026/07/25
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	10,900	10,651	298,255	2030/10/25
小 計	—	—	25,400	26,420	739,769	—
(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	618	80,091	2050/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	4,728	6,485	839,597	2034/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	2,100	2,140	277,167	2030/06/22
小 計	—	—	7,328	9,244	1,196,856	—
(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	5,010	648,675	2048/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	5,200	5,499	711,968	2029/05/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	5,300	6,410	829,855	2027/10/25
小 計	—	—	14,300	16,920	2,190,499	—

銘	柄	当				期		末									
		種	類	利	率	額	面	金	額		償	還	年	月	日		
									外	貨						建	金
(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		5,427		702,641			2039/07/04			
DEUTSCHLAND	08/15/29	国	債	証	券	0.0000	2,920		3,023		391,392			2029/08/15			
BUNDESSCHAT	0.0 09/16/22	国	債	証	券	0.0000	400		404		52,303			2022/09/16			
小	計	—				—	6,375		8,854		1,146,338			—			
(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		2,153		278,786			2024/04/30			
SPAIN	1.95 04/30/26	国	債	証	券	1.9500	8,700		9,693		1,254,954			2026/04/30			
SPAIN	4.7 07/30/41	国	債	証	券	4.7000	3,790		6,395		827,941			2041/07/30			
SPAIN	2.35 07/30/33	国	債	証	券	2.3500	8,650		10,533		1,363,615			2033/07/30			
SPAIN	2.75 10/31/24	国	債	証	券	2.7500	9,100		10,148		1,313,797			2024/10/31			
SPAIN	2.15 10/31/25	国	債	証	券	2.1500	1,500		1,672		216,565			2025/10/31			
SPAIN	1.45 10/31/27	国	債	証	券	1.4500	6,400		7,044		911,935			2027/10/31			
小	計	—				—	40,040		47,640		6,167,597			—			
合	計	—				—	—		—		28,305,480			—			

■投資信託財産の構成

2021年3月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	28,305,480	98.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	445,374	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	28,750,855	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、28,504,858千円、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22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.91円、1カナダ・ドル=87.00円、1オーストラリア・ドル=84.14円、1イギリス・ポンド=150.69円、1ポーランド・ズロチ=28.00円、1ユーロ=129.46円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年3月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	28,750,855,364円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	246,105,814
公 社 債(評価額)	28,305,480,732
未 収 利 息	187,684,483
前 払 費 用	11,584,335
(B) 負 債	19,359,000
未 払 解 約 金	19,359,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	28,731,496,364
元 本	11,106,621,156
次 期 繰 越 損 益 金	17,624,875,208
(D) 受 益 権 総 口 数	11,106,621,156口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,869円

(注1) 期首元本額 11,247,755,546円
追加設定元本額 751,944,041円
一部解約元本額 893,078,431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) 3,346,215,453円
グローバル・ボンド・ポート (Dコース) 4,724,443,104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) 1,680,348,229円
D I A Mグローバル・ボンド・ポート毎月決算コース2 1,290,783,511円
D I A Mグローバル・ボンド・ポートVA (ヘッジなし) 64,830,859円
期末元本合計 11,106,621,156円

■損益の状況

当期 自2020年9月24日 至2021年3月22日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	249,874,389円
受 取 利 息	249,838,823
そ の 他 収 益 金	69,859
支 払 利 息	△34,293
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△102,653,473
売 買 益	1,526,583,436
売 買 損	△1,629,236,909
(C) そ の 他 費 用	△1,933,430
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	145,287,486
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	17,703,473,332
(F) 解 約 差 損 益 金	△1,413,931,569
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,190,045,959
(H) 合 計(D+E+F+G)	17,624,875,208
次 期 繰 越 損 益 金(H)	17,624,875,208

(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。