

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230期	<決算日	2022年4月11日>
第231期	<決算日	2022年5月10日>
第232期	<決算日	2022年6月10日>
第233期	<決算日	2022年7月11日>
第234期	<決算日	2022年8月10日>
第235期	<決算日	2022年9月12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、2022
年9月12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。

<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 AM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36作成期	206期 (2020年4月10日)	円	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
	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
第38作成期	218期 (2021年4月12日)	7,689	10	0.6	500.51	1.3	98.2	-	3,361
	219期 (2021年5月10日)	7,718	10	0.5	502.47	0.4	98.0	-	3,356
	220期 (2021年6月10日)	7,751	10	0.6	502.97	0.1	97.8	-	3,355
	221期 (2021年7月12日)	7,836	10	1.2	511.66	1.7	98.1	-	3,344
	222期 (2021年8月10日)	7,788	10	△0.5	510.18	△0.3	98.3	-	3,273
	223期 (2021年9月10日)	7,787	10	0.1	512.99	0.6	98.6	-	3,246
第39作成期	224期 (2021年10月11日)	7,740	10	△0.5	511.38	△0.3	98.2	-	3,191
	225期 (2021年11月10日)	7,658	10	△0.9	506.78	△0.9	98.1	-	3,127
	226期 (2021年12月10日)	7,821	10	2.3	519.26	2.5	98.0	-	3,169
	227期 (2022年1月11日)	7,732	10	△1.0	513.38	△1.1	98.0	-	3,116
	228期 (2022年2月10日)	7,676	10	△0.6	511.33	△0.4	98.4	-	3,067
	229期 (2022年3月10日)	7,523	10	△1.9	505.89	△1.1	98.3	-	2,982
第40作成期	230期 (2022年4月11日)	7,386	10	△1.7	497.73	△1.6	97.8	-	2,924
	231期 (2022年5月10日)	7,541	5	2.2	510.65	2.6	97.3	-	2,892
	232期 (2022年6月10日)	7,496	5	△0.5	512.15	0.3	96.9	-	2,869
	233期 (2022年7月11日)	7,671	5	2.4	523.82	2.3	96.6	-	2,898
	234期 (2022年8月10日)	7,638	5	△0.4	520.57	△0.6	97.4	-	2,870
	235期 (2022年9月12日)	7,763	5	1.7	529.08	1.6	97.5	-	2,906
		7,782	5	0.3	530.85	0.3	97.3	-	2,858

(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	騰 落 率	騰 落 率		
第230期	(期 首) 2022年3月10日	円 7,386	% -	ポイント 497.73	% -	% 97.8	% -
	3 月 末	7,591	2.8	514.01	3.3	97.5	-
	(期 末) 2022年4月11日	7,546	2.2	510.65	2.6	97.3	-
第231期	(期 首) 2022年4月11日	7,541	-	510.65	-	97.3	-
	4 月 末	7,600	0.8	514.17	0.7	97.2	-
	(期 末) 2022年5月10日	7,501	△0.5	512.15	0.3	96.9	-
第232期	(期 首) 2022年5月10日	7,496	-	512.15	-	96.9	-
	5 月 末	7,555	0.8	512.00	△0.0	96.8	-
	(期 末) 2022年6月10日	7,676	2.4	523.82	2.3	96.6	-
第233期	(期 首) 2022年6月10日	7,671	-	523.82	-	96.6	-
	6 月 末	7,710	0.5	527.33	0.7	98.0	-
	(期 末) 2022年7月11日	7,643	△0.4	520.57	△0.6	97.4	-
第234期	(期 首) 2022年7月11日	7,638	-	520.57	-	97.4	-
	7 月 末	7,786	1.9	528.62	1.5	97.6	-
	(期 末) 2022年8月10日	7,768	1.7	529.08	1.6	97.5	-
第235期	(期 首) 2022年8月10日	7,763	-	529.08	-	97.5	-
	8 月 末	7,655	△1.4	523.32	△1.1	97.0	-
	(期 末) 2022年9月12日	7,787	0.3	530.85	0.3	97.3	-

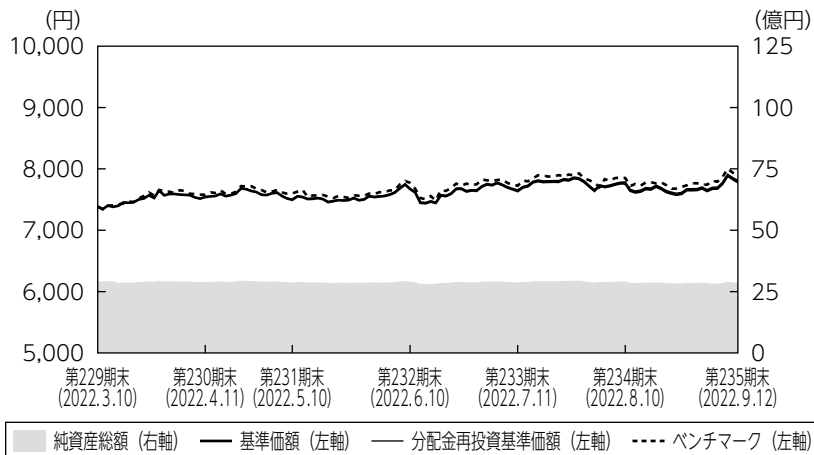
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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（2022年3月11日から2022年9月12日まで）

基準価額等の推移



第230期首： 7,386円
第235期末： 7,782円
(既払分配金30円)
騰落率： 5.8%
(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

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、投資国の国債利回りが上昇（価格は下落）したことは基準価額のマイナス要因となった一方、日本銀行が緩和的な金融政策を堅持し、内外の金融政策格差の拡大から主要通貨に対して大きく円安が進行したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

投資環境

債券市場では、ほぼ全ての投資国の国債利回りが上昇（価格は下落）しました。新型コロナウイルス禍からの回復下における労働力不足や物流の供給制約、ロシアによるウクライナ侵攻を受けたエネルギーや穀物資源需給のタイト化などを受けて世界的な高インフレ環境が続いた中、ほぼ全ての投資国において金融引き締め動きが加速したことが主な要因となりました。

為替市場では、米ドルをはじめ多くの通貨に対して円安が大幅に進行しました。日本銀行が緩和的な金融政策を堅持する中、海外の主要な中央銀行の金融緩和引き締めの流れを受け、内外の金融政策格差が強く意識されたことが主な円安要因となりました。主要通貨では米ドルの選好が進みました。主要先進国の中での利回り水準の高さや、欧州や中国などその他の主要経済圏の景気への悲観的な見通しなどが主な要因となりました。

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。為替戦略については、米国の金融引き締め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、ECB（欧州中央銀行）の相対的な金融引き締めの遅れや、欧州経済の先行き不安からユーロのアンダーウェイトを中心とした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

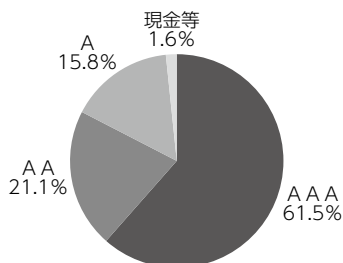
デュレーション[※]は、中長期的な長期国債利回りの低下見通しに基づき、米国を中心にベンチマーク対比での長期化戦略を継続しましたが、短中期的な債券市場の不透明感増大を受け次第に長期化幅を縮小しました。国別の投資配分については、スペインのベンチマーク比率に対するオーバーウェイトを縮小し、ドイツおよびベルギーの投資比率を引き上げました。また、英国のオーバーウェイトを解消しました。

※金利変動に対する債券価格の変動性。

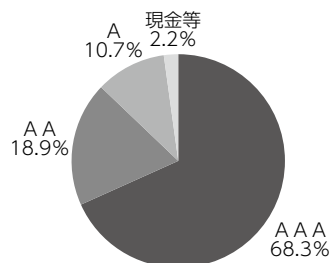
【グローバル・ボンド・ポート・マザーファンドの運用状況】 ※比率は純資産総額に対する割合です。

○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	49.7%	1.7%	
	カナダ	3.0%	1.0%	
	計	52.7%	2.6%	
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%	△1.4%	
	ベルギー	3.2%	0.9%	
	フィンランド	0.0%	△0.6%	
	フランス	10.0%	0.1%	
	ドイツ	6.9%	△0.3%	
	アイルランド	0.0%	△0.8%	
	イタリア	0.0%	△8.7%	
	オランダ	0.0%	△1.9%	
	スペイン	13.7%	8.0%	
	ユーロ計	33.7%	38.2%	△4.4%
	デンマーク	0.0%	△0.4%	
	スウェーデン	0.0%	△0.3%	
アジア・ オセアニア	オーストラリア	2.5%	1.0%	
	中国	0.0%	△1.2%	
	シンガポール	0.0%	△0.4%	
	マレーシア	0.0%	△0.5%	
	計	2.5%	3.7%	△1.2%
	中東	イスラエル	0.0%	△0.4%
	計	0.0%	△0.4%	
	現金など	1.6%	-	
	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	56.6%	4.8%	
	カナダ	3.1%	2.1%	
	計	59.7%	5.7%	
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%	△1.2%	
	ベルギー	5.6%	1.9%	
	フィンランド	0.0%	0.5%	
	フランス	8.2%	8.7%	
	ドイツ	7.7%	6.4%	
	アイルランド	0.0%	0.7%	
	イタリア	0.0%	7.5%	
	オランダ	0.0%	1.6%	
	スペイン	8.6%	5.1%	
	ユーロ計	30.2%	33.5%	△3.4%
	デンマーク	0.0%	0.4%	
	スウェーデン	0.0%	0.3%	
アジア・ オセアニア	オーストラリア	1.5%	1.6%	
	中国	0.0%	2.9%	
	シンガポール	0.0%	0.4%	
	マレーシア	0.0%	0.5%	
	計	1.5%	5.5%	
	中東	イスラエル	0.0%	0.4%
	計	0.0%	0.4%	
	現金など	2.2%	-	
	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	49.4%	△0.9%	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%	1.4%	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・リングギット	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・シェケル	0.0%	0.4%	0.4%	—	6.4	—
現金等		2.2%	—	—	—	—	—

(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	56.2%	5.6%	61.9%	7.3	6.3	1.0
	カナダ・ドル	3.1%	△1.0%	2.1%	7.6	7.1	0.5
中南米	メキシコ・ペソ	0.0%	0.0%	0.0%	—	4.9	—
欧州	イギリス・ポンド	4.4%	△3.6%	0.8%	10.8	11.5	△0.8
	デンマーク・クローネ	0.0%	0.4%	0.4%	—	8.5	—
	ノルウェー・クローネ	0.0%	0.2%	0.2%	—	4.7	—
	ユーロ	30.0%	△4.9%	25.1%	7.0	7.6	△0.5
	スウェーデン・クローナ	0.0%	0.3%	0.3%	—	5.4	—
	ポーランド・ズロチ	2.1%	△0.9%	1.2%	1.0	3.8	△2.7
アジア・オセアニア	オーストラリア・ドル	1.5%	0.0%	1.5%	10.3	7.1	3.2
	シンガポール・ドル	0.0%	0.4%	0.4%	—	7.8	—
	マレーシア・リングギット	0.0%	0.0%	0.0%	—	7.3	—
	中国元	0.0%	0.0%	0.0%	—	5.7	—
	オフショア・人民元	0.0%	2.9%	2.9%	—	—	—
中東	イスラエル・シェケル	0.0%	0.4%	0.4%	—	6.4	—
現金等		2.7%	—	—	—	—	—

(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。

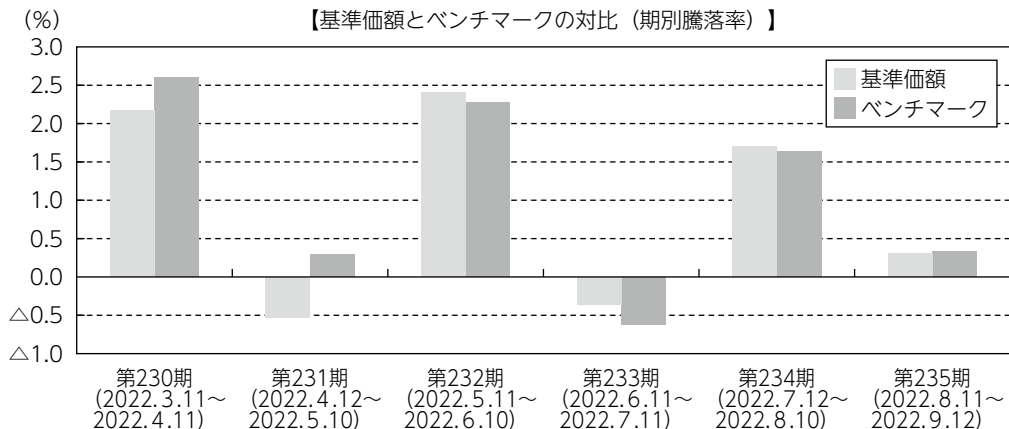
(注3) 世界国債インデックスとは、FTSE世界国債インデックス（除く日本）です。

(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6.7%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.9%下回りました。組入各国の国債利回りの上昇が進む中で、米国や英国を中心にデュレーションを長期化していたことが主な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米ドルのオーバーウェイトやユーロのアンダ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230期	第231期	第232期	第233期	第234期	第235期
	2022年3月11日 ~2022年4月11日	2022年4月12日 ~2022年5月10日	2022年5月11日 ~2022年6月10日	2022年6月11日 ~2022年7月11日	2022年7月12日 ~2022年8月10日	2022年8月11日 ~2022年9月12日
当期分配金（税引前）	5円	5円	5円	5円	5円	5円
対基準価額比率	0.07%	0.07%	0.07%	0.07%	0.06%	0.06%
当期の収益	5円	4円	5円	5円	5円	5円
当期の収益以外	-円	0円	-円	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	124円	124円	130円	131円	137円	143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

金融市場の焦点は、インフレからFRBの積極的な引き締めを受けた景気後退リスクへと移りつつあることから、今後は金融市場が先導する形で国債利回りが低下（価格は上昇）へと転じると考えます。このことからデュレーションについては、米国を中心に、ベンチマーク対比では長期化することを軸とした運営を継続します。国別では、ユーロ圏をアンダーウェイトとする一方、米国などをオーバーウェイトとする運営を維持します。

■1万口当たりの費用明細

項目	第230期～第235期		項目の概要
	(2022年3月11日～2022年9月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	36円	0.476%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は7,618円です。 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
(投信会社)	(18)	(0.238)	
(販売会社)	(16)	(0.210)	
(受託会社)	(2)	(0.028)	
(b) その他費用	4	0.048	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(1)	(0.012)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(3)	(0.034)	
合計	40	0.524	

(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。

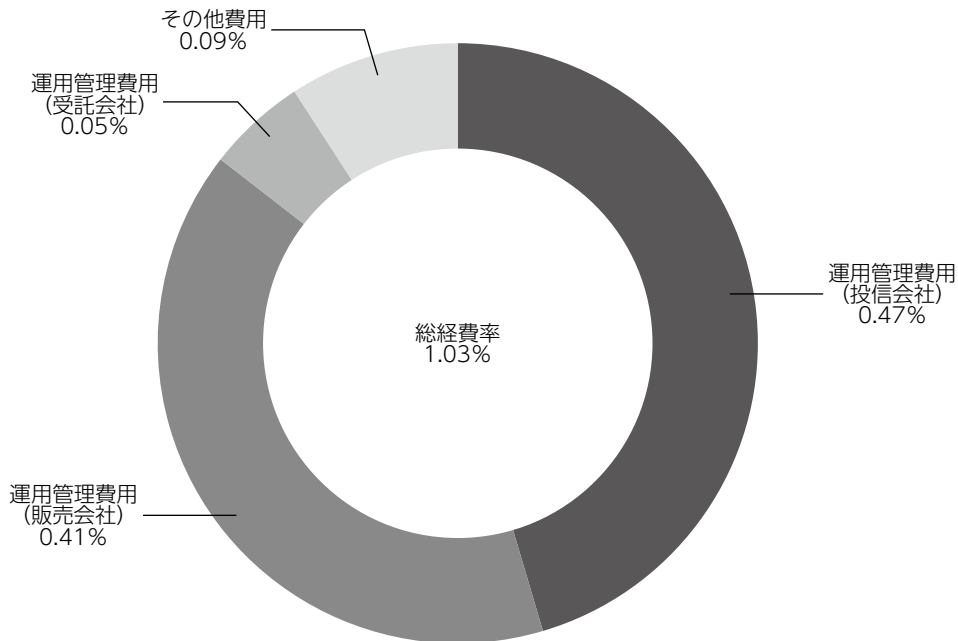
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.03%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（2022年3月11日から2022年9月12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□ 8,586	千円 22,590	千□ 98,281	千円 260,334

■利害関係人との取引状況等（2022年3月11日から2022年9月12日まで）

【D1AMグローバル・ボンド・ポート 毎月決算コース2における利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	第 230 期 ~ 第 235 期					
	区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D
金 銭 信 託						

【グローバル・ボンド・ポート・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	第 230 期 ~ 第 235 期					
	区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D
金 銭 信 託						

平均保有割合 10.1%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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あり、当作成期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行です。

■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	評 価 額	□ 数	評 価 額
グローバル・ボンド・ポート・マザーファンド	千□ 1,126,191	千円 2,842,488	千□ 1,036,496	千円 2,842,488

<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（10,609,304,057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 9 月 12 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 131,610	千アメリカ・ドル 115,231	千円 16,457,351	% 56.6	% -	% 36.2	% 19.6	% 0.8
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 9,170	千カナダ・ドル 8,190	千円 898,700	3.1	-	3.1	-	-
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 5,690	千オーストラリア・ドル 4,553	千円 445,081	1.5	-	1.5	-	-
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 7,860	千イギリス・ポンド 7,734	千円 1,282,882	4.4	-	3.2	-	1.2
ポ ー ラ ン ド	千ポーランド・ズロチ 20,140	千ポーランド・ズロチ 19,578	千円 600,304	2.1	-	-	-	2.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
ベルギー	11,328	11,410	1,641,129	5.6	-	3.1	1.0	1.6
フランス	17,820	16,565	2,382,559	8.2	-	6.8	-	1.4
ドイツ	14,705	15,597	2,243,346	7.7	-	4.5	0.5	2.7
スペイン	17,295	17,453	2,510,398	8.6	-	6.5	2.1	-
合 計	-	-	千円 28,461,754	97.8	-	65.0	23.1	9.7

(注1) 邦貨換算金額は、2022年9月12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9月12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9月12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	18,040	13,176	1,881,831	2050/02/15	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	10,300	6,845	977,670	2040/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	7,210	6,751	964,247	2029/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	33,580	29,319	4,187,416	2031/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	2.8750	870	837	119,589	2032/05/15	
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	16,560	15,822	2,259,778	2025/08/15	
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	16,400	15,171	2,166,762	2026/08/15	
US T N/B 0.125 10/15/23	国債証券	0.1250	1,640	1,579	225,596	2023/10/15	
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	9,100	8,854	1,264,530	2024/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	17,910	16,873	2,409,927	2027/11/15	
小計	—	—	131,610	115,231	16,457,351	—	
(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	3,400	3,220	353,403	2029/06/01	
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	5,140	4,478	491,375	2030/06/01	
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	630	491	53,921	2051/12/01	
小計	—	—	9,170	8,190	898,700	—	
(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	1,990	1,264	123,560	2051/06/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,500	1,462	142,959	2027/11/21	
QUEENSLAND TREASURY CORP 1.75 08/21/31	特殊債券	1.7500	2,200	1,826	178,561	2031/08/21	
小計	—	—	5,690	4,553	445,081	—	
(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	2,440	2,316	384,275	2044/01/22	
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	2,130	2,044	339,082	2024/01/31	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	1,500	1,296	214,979	2029/10/22	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	200	231	38,443	2038/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	1,590	1,845	306,102	2055/12/07	
小計	—	—	7,860	7,734	1,282,882	—	
(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	20,140	19,578	600,304	2023/10/25	
小計	—	—	20,140	19,578	600,304	—	
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	500	575	82,783	2032/03/28	
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	1,100	871	125,294	2050/06/22	
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	3,100	3,166	455,375	2024/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	4,628	4,862	699,386	2034/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	1,000	980	141,004	2025/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	1,000	954	137,284	2027/06/22	
小計	—	—	11,328	11,410	1,641,129	—	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	2,950	2,893	416,223	2024/03/25	

銘柄	2022 年 9 月 12 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 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,550	1,365	196,398	2048/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	850	774	111,440	2029/05/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	5,670	5,930	853,023	2027/10/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	6,800	5,600	805,474	2031/11/25
小 計	—	—	17,820	16,565	2,382,559	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BUNDESobl 0.0 04/16/27	国債証券	0.0000	1,000	935	134,609	2027/04/16
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	4,090	5,496	790,527	2039/07/04
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	4,020	3,621	520,819	2029/08/15
BUNDESSCHAT 0.0 09/15/23	国債証券	0.0000	5,595	5,543	797,389	2023/09/15
小 計	—	—	14,705	15,597	2,243,346	—
(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	1,700	1,699	244,417	2026/04/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	2,520	3,068	441,326	2041/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	6,050	5,759	828,403	2033/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	2,055	2,104	302,676	2024/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	470	474	68,301	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	4,500	4,347	625,273	2027/10/31
小 計	—	—	17,295	17,453	2,510,398	—
合 計	—	—	—	—	28,461,754	—

■投資信託財産の構成

2022年9月12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 2,842,488	% 98.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	53,243	1.8
投 資 信 託 財 産 総 額	2,895,732	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9月12日現在、グローバル・ボンド・ポート・マザーファンドは28,632,624千円、98.3%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、2022年9月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=142.82円、1カナダ・ドル=109.72円、1オーストラリア・ドル=97.75円、1イギリス・ポンド=165.87円、1ポーランド・ズロチ=30.661円、1ユーロ=143.83円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年4月11日)、(2022年5月10日)、(2022年6月10日)、(2022年7月11日)、(2022年8月10日)、(2022年9月12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	4,040,493,743円	4,182,273,233円	4,297,961,460円	4,223,577,973円	4,078,353,689円	4,159,471,699円
コール・ローン等	14,142,991	8,977,360	9,698,581	8,946,834	9,454,721	10,794,334
グローバル・ボンド・ ポート・マザーファンド(評価額)	2,880,417,644	2,856,795,613	2,887,294,455	2,860,797,049	2,898,070,034	2,842,488,868
未 収 入 金	1,145,933,108	1,316,500,260	1,400,968,424	1,353,834,090	1,170,828,934	1,306,188,497
(B) 負 債	1,147,666,651	1,313,144,319	1,399,173,105	1,353,092,355	1,171,537,683	1,301,077,621
未 払 金	1,142,993,603	1,308,321,135	1,387,948,392	1,347,965,850	1,163,642,653	1,294,950,309
未 払 収 益 分 配 金	1,918,170	1,913,662	1,889,550	1,879,169	1,872,162	1,836,446
未 払 解 約 金	369,229	740,717	7,046,689	954,747	3,775,308	1,864,358
未 払 信 託 報 酬	2,376,469	2,160,455	2,279,667	2,283,769	2,238,912	2,417,165
そ の 他 未 払 費 用	9,180	8,350	8,807	8,820	8,648	9,343
(C) 純資産総額(A-B)	2,892,827,092	2,869,128,914	2,898,788,355	2,870,485,618	2,906,816,006	2,858,394,078
元 本	3,836,340,188	3,827,324,194	3,779,100,267	3,758,339,736	3,744,324,347	3,672,892,363
次 期 繰 越 損 益 金	△943,513,096	△958,195,280	△880,311,912	△887,854,118	△837,508,341	△814,498,285
(D) 受 益 権 総 口 数	3,836,340,188口	3,827,324,194口	3,779,100,267口	3,758,339,736口	3,744,324,347口	3,672,892,363口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,541円	7,496円	7,671円	7,638円	7,763円	7,782円

(注) 第229期末における元本額は3,960,052,079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1,049,556円、同解約元本額は288,209,272円です。

■損益の状況

〔自 2022年3月11日 至 2022年4月11日〕〔自 2022年4月12日 至 2022年5月10日〕〔自 2022年5月11日 至 2022年6月10日〕〔自 2022年6月11日 至 2022年7月11日〕〔自 2022年7月12日 至 2022年8月10日〕〔自 2022年8月11日 至 2022年9月12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	△35円	△119円	△194円	△272円	△81円	△298円
受 取 利 息	—	—	—	25	5	2
支 払 利 息	△35	△119	△194	△297	△86	△300
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	63,858,579	△12,656,437	70,192,096	△7,996,570	51,357,850	11,485,539
売 買 益	107,235,512	56,062,848	103,262,613	43,711,380	80,076,156	60,072,313
売 買 損	△43,376,933	△68,719,285	△33,070,517	△51,707,950	△28,718,306	△48,586,774
(C) 信 託 報 酬 等	△2,551,589	△2,330,505	△2,492,256	△2,501,269	△2,452,128	△2,612,745
(D) 当 期 繰 越 損 益 金 (A+B+C)	61,306,955	△14,987,061	67,699,646	△10,498,111	48,905,641	8,872,496
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△653,772,695	△592,959,624	△602,148,922	△533,371,632	△543,690,654	△487,154,067
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△349,129,186	△348,334,933	△343,973,086	△342,105,206	△340,851,166	△334,380,268
(配 当 等 相 当 額)	(45,268,213)	(45,162,002)	(44,593,187)	(44,348,507)	(44,183,443)	(43,341,097)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△394,397,399)	(△393,496,935)	(△388,566,273)	(△386,453,713)	(△385,034,609)	(△377,721,365)
(G) 合 計 (D+E+F)	△941,594,926	△956,281,618	△878,422,362	△885,974,949	△835,636,179	△812,661,839
(H) 収 益 分 配 金	△1,918,170	△1,913,662	△1,889,550	△1,879,169	△1,872,162	△1,836,446
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△943,513,096	△958,195,280	△880,311,912	△887,854,118	△837,508,341	△814,498,285
追 加 信 託 差 損 益 金	△349,129,186	△348,334,933	△343,973,086	△342,105,206	△340,851,166	△334,380,268
(配 当 等 相 当 額)	(45,268,282)	(45,162,103)	(44,593,302)	(44,348,605)	(44,183,541)	(43,341,260)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△394,397,468)	(△393,497,036)	(△388,566,388)	(△386,453,811)	(△385,034,707)	(△377,721,528)
分 配 準 備 積 立 金	2,338,492	2,307,819	4,765,972	5,055,194	7,426,292	9,313,629
繰 越 損 益 金	△596,722,402	△612,168,166	△541,104,798	△550,804,106	△504,083,467	△489,431,646

(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	4,256,662円	1,888,593円	4,376,885円	2,194,758円	4,262,326円	3,865,879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	45,268,282	45,162,103	44,593,302	44,348,605	44,183,541	43,341,260
(d) 分 配 準 備 積 立 金	0	2,332,888	2,278,637	4,739,605	5,036,128	7,284,196
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	49,524,944	49,383,584	51,248,824	51,282,968	53,481,995	54,491,335
(f) 1万口当たり当期分配対象額	129.09	129.03	135.61	136.45	142.83	148.36
(g) 分 配 金	1,918,170	1,913,662	1,889,550	1,879,169	1,872,162	1,836,446
(h) 1万口当たり分配金	5	5	5	5	5	5

■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 万口当たり分配金	5円	5円	5円	5円	5円	5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49期 (決算日 2022年3月22日)

(計算期間 2021年9月22日～2022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49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			
45期 (2020年3月23日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
48期 (2021年9月21日)	25,869	0.5	498.38	1.7	98.5	-	28,731
49期 (2021年9月21日)	26,478	2.4	506.63	1.7	98.5	-	29,241
49期 (2022年3月22日)	26,085	△1.5	502.80	△0.8	98.5	-	28,432

(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 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)。

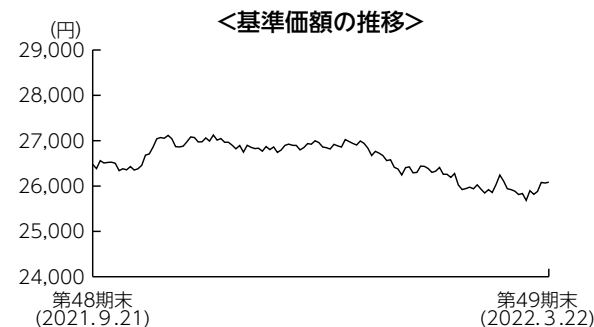
■当期中の基準価額と市況の推移

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 比	債券先物率 比
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021 年 9 月 21 日	円 26,478	% -	ポイント 506.63	% -	% 98.5	% -
9 月 末	26,502	0.1	508.95	0.5	98.2	-
10 月 末	27,069	2.2	518.32	2.3	98.4	-
11 月 末	26,804	1.2	512.77	1.2	98.0	-
12 月 末	26,940	1.7	516.73	2.0	97.2	-
2022 年 1 月 末	26,435	△0.2	507.46	0.2	98.3	-
2 月 末	25,858	△2.3	500.36	△1.2	98.6	-
(期 末) 2022 年 3 月 22 日	26,085	△1.5	502.80	△0.8	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9月22日から2022年3月22日まで）

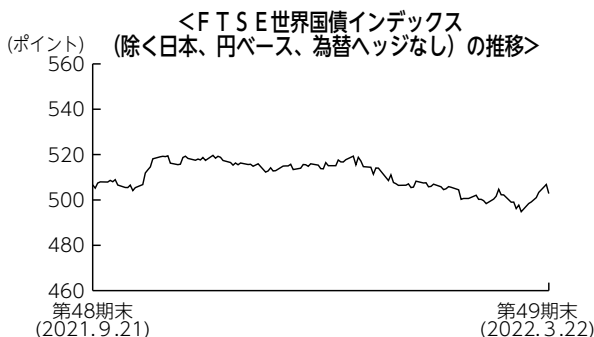


基準価額の推移

当期末の基準価額は26,085円となり、前期末比で1.5%下落しました。

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押し進め、内外の金融政策格差拡大から、ほぼ全ての組入通貨に対する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タイト化を受けて各国のインフレ率が騰勢を強めたことで、主要国の金融当局が金融緩和姿勢から縮小姿勢に転換したことが主な要因となりました。期末にかけては、F R Bが2018年以来となる利上げを実施したほか、欧州でもE C B（欧州中央銀行）が量的緩和縮小ペースの加速を決定

するなど、主要中央銀行における金融緩和縮小の動きが進みました。

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、ほぼ全ての主要通貨に対する円安が進行しました。金融緩和縮小プロセスで先行する米ドルや、資源価格の大幅上昇の影響を受けたオーストラリアドルなどの資源国通貨は大きく上昇した一方、ウクライナへのロシアの軍事侵攻を背景に、紛争地域との地理的な近さや、経済制裁等を通じた対ロシア関係悪化による影響の大きさが嫌気されたユーロやポーランドズロチなどの上昇幅は限定的でした。

ポートフォリオについて

デュレーション^{*}は、中長期的な長期国債利回りの低下見通しに基づき、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、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。

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0.8%下落しました。

当ファンドはベンチマークを0.7%下回りました。組入各国の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。

今後の運用方針

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って、FRB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26,571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9月22日から2022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 20,243	千アメリカ・ドル 21,552 (-)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 162	千カナダ・ドル 205 (-)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 868	千オーストラリア・ドル 940 (-)
		特殊債券	-	597 (-)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 8,853	千イギリス・ポンド 9,544 (-)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 22,950	千ポーランド・ズロチ 22,843 (-)
国	ユーロ	ベルギー	千ユーロ -	千ユーロ 704 (-)
		フランス	7,941	1,778 (-)
		ドイツ	10,718	5,261 (-)
		スペイン	2,872	12,329 (-)

(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9月22日から2022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 124,970	千アメリカ・ドル 117,861	千円 14,148,043	% 49.8	% -	% 25.4	% 16.1	% 8.3
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 9,460	千カナダ・ドル 9,077	千円 864,657	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 8,336	千円 738,188	2.6	-	2.6	-	-
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 10,930	千イギリス・ポンド 13,417	千円 2,115,433	7.4	-	5.6	-	1.9
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 22,185	千円 622,437	2.2	-	-	-	2.2
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
ベルギー	5,728	6,847	902,694	3.2	-	3.2	-	-
フランス	19,760	21,160	2,789,572	9.8	-	9.8	-	-
ドイツ	11,495	14,180	1,869,388	6.6	-	5.2	-	1.4
スペイン	26,095	29,911	3,943,201	13.9	-	8.8	5.0	-
合 計	-	-	千円 27,993,618	98.5	-	63.6	21.1	13.7

(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		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	24,980	22,140	2,657,742	2050/02/15
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	8,500	6,645	797,778	2040/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	6,910	6,922	830,966	2029/05/15
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	17,260	16,295	1,956,155	2031/05/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	16,560	16,362	1,964,101	2025/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	17,100	16,470	1,977,151	2026/08/15
US T N/B 0.125 10/15/23	国債証券	0.1250	20,200	19,619	2,355,094	2023/10/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	5,200	5,194	623,525	2024/11/15
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	8,260	8,209	985,526	2027/11/15
小計	—	—	124,970	117,861	14,148,043	—
(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	4,328	412,275	2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	5,140	4,749	452,382	2030/06/01
小計	—	—	9,460	9,077	864,657	—
(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	2,564	227,051	2051/06/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	3,700	3,776	334,433	2027/11/21
QUEENSLAND TREASURY CORP 1.75 08/21/31	特殊債券	1.7500	2,200	1,995	176,703	2031/08/21
小計	—	—	9,390	8,336	738,188	—
(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	4,038	636,632	2044/01/22
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	3,430	3,354	528,881	2024/01/31
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	970	929	146,597	2029/10/22
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	1,200	1,706	269,008	2038/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	2,090	3,389	534,313	2055/12/07
小計	—	—	10,930	13,417	2,115,433	—
(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	22,185	622,437	2023/10/25
小計	—	—	22,600	22,185	622,437	—
(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	1,161	153,065	2050/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	4,628	5,686	749,629	2034/06/22
小計	—	—	5,728	6,847	902,694	—
(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	4,422	582,961	2048/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	9,450	9,419	1,241,715	2029/05/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	6,460	7,319	964,896	2027/10/25
小計	—	—	19,760	21,160	2,789,572	—
(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	7,231	953,323	2039/07/04
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	4,020	3,942	519,756	2029/08/15

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…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	2,985	3,006	396,308	2023/09/15
小	計	—	—	11,495	14,180	1,869,388	—
(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	8,155	1,075,185	2026/04/30
SPAIN 4.7 07/30/41		国債証券	4.7000	4,920	7,334	966,959	2041/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33		国債証券	2.3500	6,050	6,627	873,739	2033/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24		国債証券	2.7500	2,055	2,200	290,038	2024/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25		国債証券	2.1500	470	500	65,952	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27		国債証券	1.4500	4,900	5,092	671,326	2027/10/31
小	計	—	—	26,095	29,911	3,943,201	—
合	計	—	—	—	—	27,993,618	—

■投資信託財産の構成

2022年3月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	27,993,618	97.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	783,834	2.7
投 資 信 託 財 産 総 額	28,777,453	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、28,523,638千円、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、2022年3月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=120.04円、1カナダ・ドル=95.25円、1オーストラリア・ドル=88.55円、1イギリス・ポンド=157.66円、1ポーランド・ズロチ=28.056円、1ユーロ=131.83円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年3月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	29,112,611,213円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	256,212,119
公 社 債(評価額)	27,993,618,811
未 収 入 金	671,566,092
未 収 利 息	162,706,810
前 払 費 用	28,507,381
(B) 負 債	679,847,061
未 払 金	337,234,061
未 払 解 約 金	342,613,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	28,432,764,152
元 本	10,899,939,696
次 期 繰 越 損 益 金	17,532,824,456
(D) 受 益 権 総 口 数	10,899,939,696口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	26,085円

(注1) 期首元本額 11,043,962,911円

追加設定元本額 832,768,278円

一部解約元本額 976,791,493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) 3,595,456,536円

グローバル・ボンド・ポート (Dコース) 4,685,640,614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) 1,467,363,636円

DIAMグローバル・ボンド・ポート毎月決算コース2 1,095,309,819円

DIAMグローバル・ボンド・ポートVA (ヘッジなし) 56,169,091円

期末元本合計 10,899,939,696円

■損益の状況

当期 自2021年9月22日 至2022年3月22日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	245,304,443円
受 取 利 息	245,338,387
支 払 利 息	△33,944
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△679,506,535
売 買 益	1,940,753,790
売 買 損	△2,620,260,325
(C) そ の 他 費 用	△2,078,704
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△436,280,796
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	18,197,953,037
(F) 解 約 差 損 益 金	△1,612,815,507
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,383,967,722
(H) 合 計(D+E+F+G)	17,532,824,456
次 期 繰 越 損 益 金(H)	17,532,824,456

(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まず。

(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。