

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254期 | <決算日 | 2024年4月10日> |
| 第255期 | <決算日 | 2024年5月10日> |
| 第256期 | <決算日 | 2024年6月10日> |
| 第257期 | <決算日 | 2024年7月10日> |
| 第258期 | <決算日 | 2024年8月13日> |
| 第259期 | <決算日 | 2024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、2024
年9月10日に第259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

<https://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) 円 | 税込み 分配金 円 | 期中 騰落率 % | ポイント | 期中 騰落率 % | | | |
| 第40作成期 | 230期 (2022年4月11日) | 円 | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| | 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 |
| 第41作成期 | 236期 (2022年10月11日) | 7,782 | 5 | 0.3 | 530.85 | 0.3 | 97.3 | - | 2,858 |
| | 237期 (2022年11月10日) | 7,485 | 5 | △3.8 | 514.21 | △3.1 | 97.4 | - | 2,732 |
| | 238期 (2022年12月12日) | 7,582 | 5 | 1.4 | 525.16 | 2.1 | 97.4 | - | 2,749 |
| | 239期 (2023年1月10日) | 7,503 | 5 | △1.0 | 517.64 | △1.4 | 97.4 | - | 2,691 |
| | 240期 (2023年2月10日) | 7,229 | 5 | △3.6 | 500.23 | △3.4 | 97.7 | - | 2,591 |
| | 241期 (2023年3月10日) | 7,177 | 5 | △0.7 | 496.30 | △0.8 | 97.5 | - | 2,545 |
| 第42作成期 | 242期 (2023年4月10日) | 7,209 | 5 | 0.5 | 503.27 | 1.4 | 97.4 | - | 2,520 |
| | 243期 (2023年5月10日) | 7,363 | 5 | 2.2 | 509.45 | 1.2 | 97.4 | - | 2,564 |
| | 244期 (2023年6月12日) | 7,436 | 5 | 1.1 | 518.66 | 1.8 | 97.1 | - | 2,580 |
| | 245期 (2023年7月10日) | 7,503 | 5 | 1.0 | 527.52 | 1.7 | 97.3 | - | 2,582 |
| | 246期 (2023年8月10日) | 7,602 | 5 | 1.4 | 534.32 | 1.3 | 97.3 | - | 2,599 |
| | 247期 (2023年9月11日) | 7,621 | 5 | 1.6 | 545.41 | 2.1 | 97.1 | - | 2,549 |
| 第43作成期 | 248期 (2023年10月10日) | 7,682 | 5 | △0.4 | 549.49 | 0.7 | 97.7 | - | 2,516 |
| | 249期 (2023年11月10日) | 7,564 | 5 | △1.5 | 538.60 | △2.0 | 96.8 | - | 2,463 |
| | 250期 (2023年12月11日) | 7,780 | 5 | 2.9 | 558.57 | 3.7 | 96.5 | - | 2,526 |
| | 251期 (2024年1月10日) | 7,762 | 5 | △0.2 | 552.11 | △1.2 | 97.5 | - | 2,502 |
| | 252期 (2024年2月13日) | 7,891 | 5 | 1.7 | 562.48 | 1.9 | 97.5 | - | 2,533 |
| | 253期 (2024年3月11日) | 8,010 | 5 | 1.6 | 575.55 | 2.3 | 96.8 | - | 2,540 |
| 第44作成期 | 254期 (2024年4月10日) | 8,018 | 5 | 0.2 | 576.94 | 0.2 | 97.1 | - | 2,532 |
| | 255期 (2024年5月10日) | 8,162 | 5 | 1.9 | 587.47 | 1.8 | 96.8 | - | 2,557 |
| | 256期 (2024年6月10日) | 8,292 | 5 | 1.7 | 598.68 | 1.9 | 96.9 | - | 2,564 |
| | 257期 (2024年7月10日) | 8,346 | 5 | 0.7 | 605.00 | 1.1 | 97.1 | - | 2,567 |
| | 258期 (2024年8月13日) | 8,659 | 5 | 3.8 | 627.54 | 3.7 | 97.2 | - | 2,646 |
| | 259期 (2024年9月10日) | 8,128 | 5 | △6.1 | 591.12 | △5.8 | 97.1 | - | 2,451 |
| | | 8,057 | 5 | △0.8 | 580.99 | △1.7 | 97.0 | - | 2,421 |

(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254期 | (期 首) 2024年3月11日 | 円 8,018 | % - | ポイント 576.94 | % - | % 97.1 | % - |
| | 3 月 末 | 8,168 | 1.9 | 587.85 | 1.9 | 97.3 | - |
| | (期 末) 2024年4月10日 | 8,167 | 1.9 | 587.47 | 1.8 | 96.8 | - |
| 第255期 | (期 首) 2024年4月10日 | 8,162 | - | 587.47 | - | 96.8 | - |
| | 4 月 末 | 8,278 | 1.4 | 597.53 | 1.7 | 97.3 | - |
| | (期 末) 2024年5月10日 | 8,297 | 1.7 | 598.68 | 1.9 | 96.9 | - |
| 第256期 | (期 首) 2024年5月10日 | 8,292 | - | 598.68 | - | 96.9 | - |
| | 5 月 末 | 8,308 | 0.2 | 601.57 | 0.5 | 97.0 | - |
| | (期 末) 2024年6月10日 | 8,351 | 0.7 | 605.00 | 1.1 | 97.1 | - |
| 第257期 | (期 首) 2024年6月10日 | 8,346 | - | 605.00 | - | 97.1 | - |
| | 6 月 末 | 8,596 | 3.0 | 621.56 | 2.7 | 96.8 | - |
| | (期 末) 2024年7月10日 | 8,664 | 3.8 | 627.54 | 3.7 | 97.2 | - |
| 第258期 | (期 首) 2024年7月10日 | 8,659 | - | 627.54 | - | 97.2 | - |
| | 7 月 末 | 8,279 | △4.4 | 608.33 | △3.1 | 96.4 | - |
| | (期 末) 2024年8月13日 | 8,133 | △6.1 | 591.12 | △5.8 | 97.1 | - |
| 第259期 | (期 首) 2024年8月13日 | 8,128 | - | 591.12 | - | 97.1 | - |
| | 8 月 末 | 8,064 | △0.8 | 586.82 | △0.7 | 97.1 | - |
| | (期 末) 2024年9月10日 | 8,062 | △0.8 | 580.99 | △1.7 | 97.0 | - |

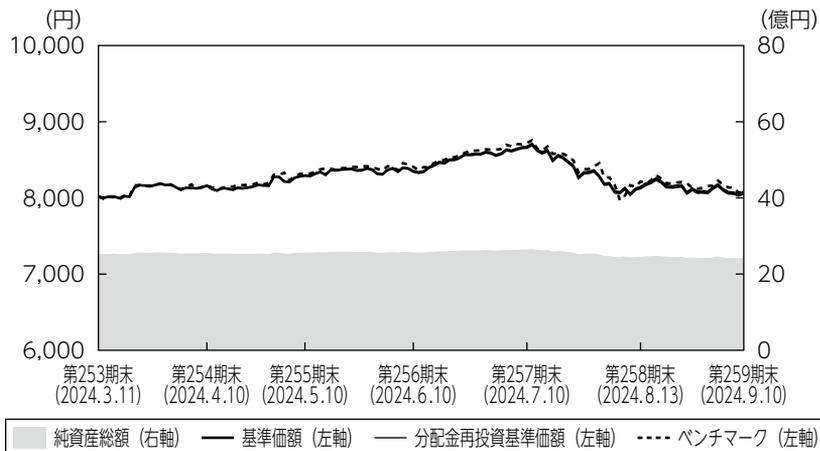
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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254期～第259期の運用経過（2024年3月12日から2024年9月10日まで）

基準価額等の推移



第254期首： 8,018円
第259期末： 8,057円
（既払分配金30円）
騰落率： 0.9%
（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

基準価額は上昇しました。主要な海外中央銀行における利下げサイクル進展見通しから、保有債券の利回りが低下（価格は上昇）したことが主なプラス要因となりました。ただ、日銀が金融緩和解除の動きを進め、主要通貨に対する円高が進んだことはマイナス要因となりました。

投資環境

債券市場では、主要国の国債利回りは低下しました。米国では、雇用市場の減速やインフレの鈍化を受け、F R B（米連邦準備理事会）が早期に利下げサイクルへ移行するという見方が強まったことが主な要因となりました。ユーロ圏などその他の主要国・地域においても、そうした米国国債利回り低下の影響を受けるとともに、その多くで作成期中に利下げサイクルの進展が見られ、利回り低下に繋がりました。

為替市場では、多くの主要通貨が対円で下落しました。日銀が金融政策正常化を進める一方で、他主要国の中央銀行における利下げサイクル進展見通しが強まり、先行きの内外金利差縮小が意識されました。また、そうした材料を受けて株式市場や為替市場が大きな変動に見舞われ、円キャリー（円売り外貨買い）取引の急速な巻き戻しが進んだことも円高を加速させました。

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。通貨配分については、ベンチマーク比率に対するユーロのアンダーウェイトを軸に、機動的な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

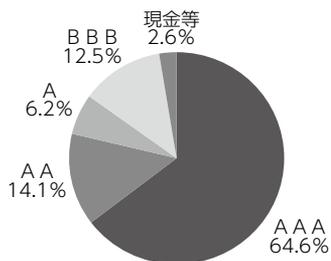
デュレーション[※]は、主要国の中央銀行における利下げサイクルへの移行を念頭に、ベンチマークに対する長期化戦略を継続しました。国別の投資配分については、ユーロ圏と英国の比率を拡大後縮小し、米国の比率を拡大しました。また、中国のアンダーウェイト（非保有）を継続しました。ユーロ圏内の国別配分については、イタリアなど周縁国のオーバーウェイトを縮小しました。

※金利変動に対する債券価格の変動性。

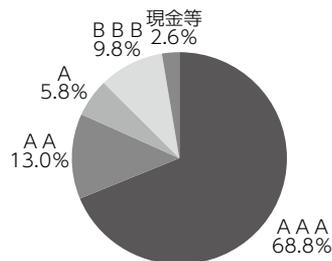
【グローバル・ボンド・ポート・マザーファンドの運用状況】 ※比率は純資産総額に対する割合です。

○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 | 50.7% | 46.7% | 4.0% |
| | カナダ | 1.9% | 2.0% | △0.1% |
| | 計 | 52.6% | 48.7% | 3.9% |
| 中南米 | メキシコ | 0.9% | 0.9% | △0.0% |
| | 計 | 0.9% | 0.9% | △0.0% |
| 欧州 | オーストリア | 0.0% | 1.2% | △1.2% |
| | ベルギー | 0.0% | 1.8% | △1.8% |
| | フィンランド | 0.0% | 0.5% | △0.5% |
| | フランス | 8.0% | 8.1% | △0.1% |
| | ドイツ | 10.9% | 6.3% | 4.6% |
| | アイルランド | 0.0% | 0.6% | △0.6% |
| | イタリア | 11.6% | 7.4% | 4.2% |
| | オランダ | 0.0% | 1.5% | △1.5% |
| | スペイン | 5.7% | 4.9% | 0.8% |
| | ユーロ計 | 36.2% | 32.3% | 3.9% |
| | デンマーク | 0.3% | 0.3% | △0.0% |
| | スウェーデン | 0.2% | 0.2% | 0.0% |
| | 英国 | 5.1% | 5.3% | △0.1% |
| | ポーランド | 0.5% | 0.6% | △0.1% |
| | ノルウェー | 0.2% | 0.2% | 0.0% |
| | 計 | 42.5% | 38.8% | 3.7% |
| アジア・ オセアニア | オーストラリア | 1.4% | 1.4% | △0.0% |
| | ニュージーランド | 0.0% | 0.3% | △0.3% |
| | 中国 | 0.0% | 8.7% | △8.7% |
| | シンガポール | 0.0% | 0.4% | △0.4% |
| | マレーシア | 0.0% | 0.5% | △0.5% |
| | 計 | 1.4% | 11.3% | △9.9% |
| 中東 | イスラエル | 0.0% | 0.3% | △0.3% |
| | 計 | 0.0% | 0.3% | △0.3% |
| | 現金など | 2.6% | - | - |
| | 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 | 54.4% | 46.8% | 7.6% |
| | カナダ | 2.0% | 2.0% | △0.0% |
| | 計 | 56.4% | 48.8% | 7.5% |
| 中南米 | メキシコ | 0.7% | 0.7% | △0.0% |
| | 計 | 0.7% | 0.7% | △0.0% |
| 欧州 | オーストリア | 0.0% | 1.2% | △1.2% |
| | ベルギー | 0.0% | 1.6% | △1.6% |
| | フィンランド | 0.0% | 0.5% | △0.5% |
| | フランス | 6.8% | 7.7% | △0.8% |
| | ドイツ | 11.4% | 6.0% | 5.3% |
| | アイルランド | 0.0% | 0.5% | △0.5% |
| | イタリア | 9.1% | 6.9% | 2.2% |
| | オランダ | 0.0% | 1.4% | △1.4% |
| | スペイン | 5.3% | 4.5% | 0.8% |
| | ユーロ計 | 32.6% | 30.2% | 2.5% |
| | デンマーク | 0.3% | 0.3% | △0.0% |
| | スウェーデン | 0.2% | 0.2% | 0.0% |
| | 英国 | 5.3% | 5.4% | △0.1% |
| | ポーランド | 0.5% | 0.5% | △0.1% |
| | ノルウェー | 0.2% | 0.2% | 0.0% |
| | 計 | 39.1% | 36.7% | 2.4% |
| アジア・ オセアニア | オーストラリア | 1.2% | 1.3% | △0.1% |
| | ニュージーランド | 0.0% | 0.3% | △0.3% |
| | 中国 | 0.0% | 10.9% | △10.9% |
| | シンガポール | 0.0% | 0.4% | △0.4% |
| | マレーシア | 0.0% | 0.5% | △0.5% |
| | 計 | 1.2% | 13.4% | △12.1% |
| 中東 | イスラエル | 0.0% | 0.3% | △0.3% |
| | 計 | 0.0% | 0.3% | △0.3% |
| | 現金など | 2.6% | - | - |
| | 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 | 50.5% | △7.7% | 42.8% | 6.8 | 6.0 | 0.8 |
| | カナダ・ドル | 1.9% | 0.0% | 1.9% | 7.4 | 6.7 | 0.7 |
| 中南米 | メキシコ・ペソ | 0.9% | 1.9% | 2.8% | 3.8 | 5.2 | △1.3 |
| 欧州 | イギリス・ポンド | 5.1% | 5.0% | 10.1% | 9.7 | 9.8 | △0.0 |
| | デンマーク・クローネ | 0.3% | △0.0% | 0.3% | 7.6 | 8.6 | △1.0 |
| | ノルウェー・クローネ | 0.2% | △0.0% | 0.2% | 3.8 | 5.1 | △1.3 |
| | ユーロ | 36.1% | △9.3% | 26.8% | 7.3 | 7.2 | 0.1 |
| | スウェーデン・クローナ | 0.2% | △0.0% | 0.2% | 5.4 | 5.3 | 0.1 |
| | ポーランド・ズロチ | 0.5% | 0.0% | 0.5% | 5.5 | 3.8 | 1.7 |
| アジア・オセアニア | オーストラリア・ドル | 1.3% | 2.5% | 3.9% | 8.4 | 6.6 | 1.8 |
| | ニュージーランド・ドル | 0.0% | 0.2% | 0.2% | — | 6.5 | — |
| | 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% | — | 7.3 | — |
| | 中国元 | 0.0% | 0.0% | 0.0% | — | 5.7 | — |
| | オフショア・人民元 | 0.0% | 6.5% | 6.5% | — | — | — |
| 中東 | イスラエル・シケル | 0.0% | 0.3% | 0.3% | — | 6.0 | — |
| | 現金等 | 2.9% | — | — | — | — | — |

(注1) 比率は純資産総額に対する実質的な割合です。

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

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

(注4) 現金等は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。



当作成期末

| | | 通貨別組入状況 | | | 修正デュレーション | | |
|-----------|-------------|---------|---------|-------|-----------|------------|------|
| | | 組入債券 | 為替予約・先物 | 計 | ファンド | 世界国債インデックス | 差 |
| 北米 | USドル | 54.2% | △8.1% | 46.1% | 6.8 | 6.1 | 0.7 |
| | カナダ・ドル | 2.0% | 0.0% | 2.0% | 7.0 | 6.8 | 0.2 |
| 中南米 | メキシコ・ペソ | 0.7% | △0.0% | 0.6% | 3.4 | 4.9 | △1.5 |
| 欧州 | イギリス・ポンド | 5.3% | 2.0% | 7.3% | 9.2 | 9.5 | △0.3 |
| | デンマーク・クローネ | 0.3% | △0.0% | 0.3% | 7.1 | 8.0 | △0.9 |
| | ノルウェー・クローネ | 0.2% | △0.0% | 0.1% | 3.3 | 5.4 | △2.1 |
| | ユーロ | 32.5% | △4.4% | 28.2% | 7.3 | 7.3 | 0.1 |
| | スウェーデン・クローナ | 0.2% | △0.1% | 0.1% | 5.0 | 5.8 | △0.9 |
| | ポーランド・ズロチ | 0.5% | 0.0% | 0.5% | 5.0 | 3.9 | 1.1 |
| アジア・オセアニア | オーストラリア・ドル | 1.2% | 0.0% | 1.3% | 8.2 | 6.5 | 1.7 |
| | ニュージーランド・ドル | 0.0% | 0.2% | 0.2% | — | 6.7 | — |
| | シンガポール・ドル | 0.0% | 0.4% | 0.4% | — | 8.3 | — |
| | マレーシア・リンギット | 0.0% | 0.0% | 0.0% | — | 7.3 | — |
| | 中国元 | 0.0% | 0.0% | 0.0% | — | 5.6 | — |
| | オフショア・人民元 | 0.0% | 9.6% | 9.6% | — | — | — |
| 中東 | イスラエル・シケル | 0.0% | 0.3% | 0.3% | — | 5.8 | — |
| | 現金等 | 3.0% | — | — | — | — | — |

(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。

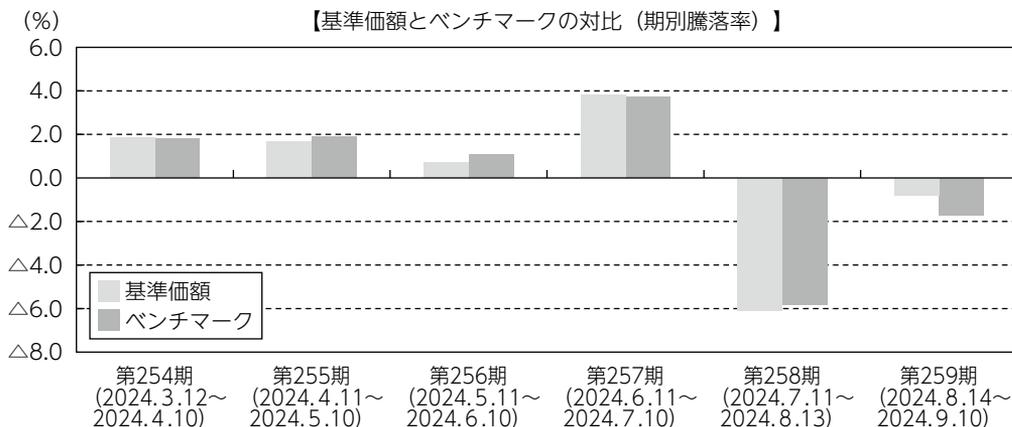
(注3) 世界国債インデックスとは、FTSE世界国債インデックス（除く日本）です。

(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0.7%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.2%上回りました。債券や為替のポジションによる正味の運用収益はベンチマークをわずかに下回りましたが、当ファンドとベンチマークそれぞれの基準時間の差異に基づく為替評価レートの差異が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254期 | 第255期 | 第256期 | 第257期 | 第258期 | 第259期 |
|------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2024年3月12日 ~2024年4月10日 | 2024年4月11日 ~2024年5月10日 | 2024年5月11日 ~2024年6月10日 | 2024年6月11日 ~2024年7月10日 | 2024年7月11日 ~2024年8月13日 | 2024年8月14日 ~2024年9月10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 | 0.06% | 0.06% | 0.06% | 0.06% | 0.06% | 0.06% |
| 当期の収益 | 5円 | 5円 | 5円 | 5円 | 5円 | 5円 |
| 当期の収益以外 | -円 | -円 | -円 | -円 | -円 | -円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 265円 | 276円 | 288円 | 301円 | 307円 | 311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

米国では、インフレの沈静化傾向が継続し、雇用市場に鈍化が見られ、先行きの利下げ進展が見通せる状況にあると考えているほか、欧州では軟調な経済状況から、利下げ織り込みがさらに進む可能性もあると見ています。こうしたことから、債券のデュレーションについては、対ベンチマークでの長期化を軸とした運営を継続します。国別配分では、米国などをオーバーウェイト、ユーロ圏内の国別配分では周縁国のオーバーウェイトを軸とする方針ですが、適宜見直しを行います。

■1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第254期～第259期 | | 項目の概要 |
|-----------|-------------------------|---------|---|
| | (2024年3月12日～2024年9月10日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 39円 | 0.469% | (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8,271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) | (19) | (0.234) | |
| (販売会社) | (17) | (0.207) | |
| (受託会社) | (2) | (0.027) | |
| (b) その他費用 | 5 | 0.059 | (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) | (0.016) | |
| (監査費用) | (0) | (0.001) | |
| (その他) | (3) | (0.042) | |
| 合計 | 44 | 0.527 | |

(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。

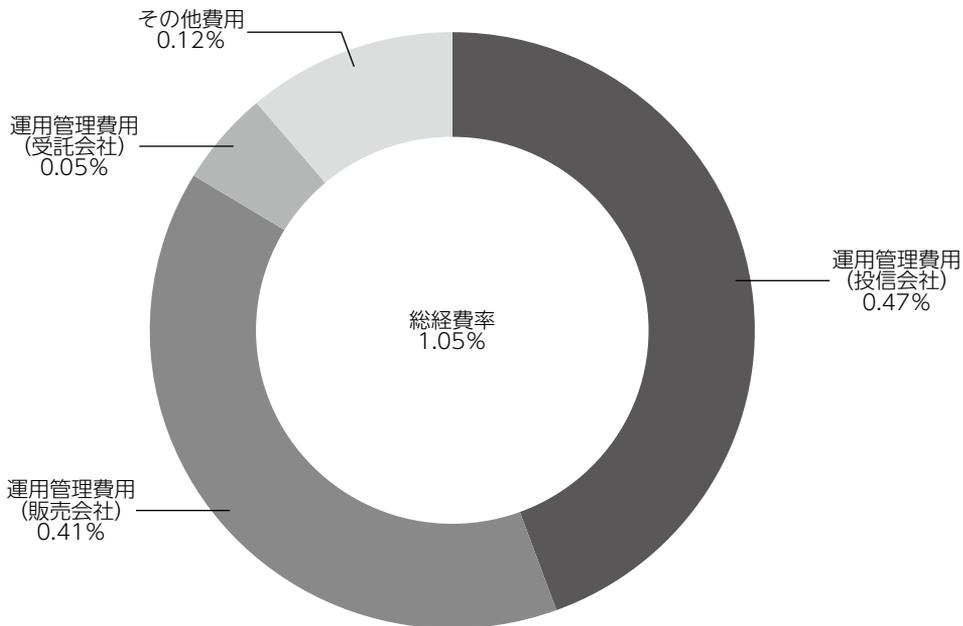
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.05%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（2024年3月12日から2024年9月10日まで）

| | 第 254 期 ~ 第 259 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□ 2,239 | 千円 6,726 | 千□ 54,418 | 千円 164,955 |

■利害関係人との取引状況等（2024年3月12日から2024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43作成期末 | 第 44 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□ 859,283 | 千□ 807,103 | 千円 2,411,465 |

<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（10,304,882,953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 | 2024 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 128,530 | 千アメリカ・ドル 116,671 | 千円 16,745,917 | % 54.4 | % - | % 40.0 | % 8.2 | % 6.2 |
| カ ナ ダ | 千カナダ・ドル 6,200 | 千カナダ・ドル 5,751 | 千円 608,419 | 2.0 | - | 1.0 | 0.9 | - |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 4,600 | 千オーストラリア・ドル 4,006 | 千円 382,398 | 1.2 | - | 1.2 | 0.1 | - |
| イ ギ リ ス | 千イギリス・ポンド 8,770 | 千イギリス・ポンド 8,769 | 千円 1,644,478 | 5.3 | - | 5.1 | 0.2 | - |
| デ ン マ ー ク | 千デンマーク・クローネ 4,300 | 千デンマーク・クローネ 3,740 | 千円 79,363 | 0.3 | - | 0.3 | - | - |
| ノ ル ウ ェ ー | 千ノルウェー・クローネ 4,200 | 千ノルウェー・クローネ 4,043 | 千円 53,490 | 0.2 | - | - | 0.2 | - |
| ス ウ ェ ー デ ン | 千スウェーデン・クローナ 4,700 | 千スウェーデン・クローナ 4,474 | 千円 61,889 | 0.2 | - | 0.2 | - | - |
| メ キ シ コ | 千メキシコ・ペソ 32,000 | 千メキシコ・ペソ 29,596 | 千円 213,467 | 0.7 | - | 0.3 | 0.3 | 0.1 |
| ポ ー ラ ン ド | 千ポーランド・ズロチ 4,000 | 千ポーランド・ズロチ 3,975 | 千円 147,209 | 0.5 | - | 0.3 | 0.2 | - |
| ユ ー ロ | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | | | | |
| フ ラ ン ス | 14,260 | 13,284 | 2,103,360 | 6.8 | - | 3.0 | 2.5 | 1.3 |
| ド イ ツ | 22,380 | 22,113 | 3,501,227 | 11.4 | - | 8.0 | 3.3 | 0.1 |
| ス ペ イ ン | 10,640 | 10,362 | 1,640,687 | 5.3 | - | 3.5 | 1.8 | - |
| イ タ リ ア | 16,990 | 17,711 | 2,804,335 | 9.1 | - | 6.6 | 1.8 | 0.7 |
| 合 計 | - | - | 千円 29,986,245 | 97.4 | - | 69.4 | 19.6 | 8.4 |

(注1) 邦貨換算金額は、2024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、2024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 | | 2024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 4.0 02/15/34 | 国債証券 | 4.0000 | 7,600 | 7,783 | 1,117,161 | 2034/02/15 | |
| US T N/B 2.0 02/15/50 | 国債証券 | 2.0000 | 10,540 | 7,021 | 1,007,729 | 2050/02/15 | |
| US T N/B 4.125 03/31/31 | 国債証券 | 4.1250 | 3,730 | 3,848 | 552,421 | 2031/03/31 | |
| US T N/B 1.125 05/15/40 | 国債証券 | 1.1250 | 12,000 | 8,032 | 1,152,837 | 2040/05/15 | |
| US T N/B 2.375 05/15/29 | 国債証券 | 2.3750 | 4,010 | 3,814 | 547,440 | 2029/05/15 | |
| US T N/B 1.625 05/15/31 | 国債証券 | 1.6250 | 12,040 | 10,648 | 1,528,356 | 2031/05/15 | |
| US T N/B 2.875 05/15/32 | 国債証券 | 2.8750 | 6,920 | 6,577 | 944,051 | 2032/05/15 | |
| US T N/B 3.375 05/15/33 | 国債証券 | 3.3750 | 16,520 | 16,167 | 2,320,590 | 2033/05/15 | |
| US T N/B 4.375 05/15/34 | 国債証券 | 4.3750 | 5,700 | 6,010 | 862,670 | 2034/05/15 | |
| US T N/B 2.0 08/15/25 | 国債証券 | 2.0000 | 2,700 | 2,646 | 379,869 | 2025/08/15 | |
| US T N/B 1.5 08/15/26 | 国債証券 | 1.5000 | 11,030 | 10,583 | 1,519,006 | 2026/08/15 | |
| US T N/B 0.625 08/15/30 | 国債証券 | 0.6250 | 12,400 | 10,476 | 1,503,698 | 2030/08/15 | |
| US T N/B 3.875 08/15/34 | 国債証券 | 3.8750 | 2,000 | 2,028 | 291,164 | 2034/08/15 | |
| US T N/B 2.25 11/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 14,360 | 13,810 | 1,982,270 | 2027/11/15 | |
| US T N/B 4.125 11/15/32 | 国債証券 | 4.1250 | 6,980 | 7,222 | 1,036,649 | 2032/11/15 | |
| 小計 | — | — | 128,530 | 116,671 | 16,745,917 | — | |
| (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 | 2,800 | 2,748 | 290,774 | 2029/06/01 | |
| CANADA 1.25 06/01/30 | 国債証券 | 1.2500 | 2,370 | 2,179 | 230,515 | 2030/06/01 | |
| CANADA 2.0 12/01/51 | 国債証券 | 2.0000 | 1,030 | 823 | 87,129 | 2051/12/01 | |
| 小計 | — | — | 6,200 | 5,751 | 608,419 | — | |
| (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 | |
| NEW S WALES TREASURY CRP 4.25 02/20/36 | 地方債証券 | 4.2500 | 700 | 663 | 63,356 | 2036/02/20 | |
| QUEENSLAND TREASURY CORP 4.2 02/20/47 | 地方債証券 | 4.2000 | 900 | 779 | 74,403 | 2047/02/20 | |
| NEW S WALES TREASURY CRP 2.0 03/08/33 | 地方債証券 | 2.0000 | 800 | 657 | 62,781 | 2033/03/08 | |
| QUEENSLAND 3.25 07/21/28 | 地方債証券 | 3.2500 | 300 | 293 | 28,010 | 2028/07/21 | |
| QUEENSLAND TREASURY CORP 1.75 08/21/31 | 特殊債 | 1.7500 | 1,900 | 1,611 | 153,847 | 2031/08/21 | |
| 小計 | — | — | 4,600 | 4,006 | 382,398 | — | |
| (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 | 1,440 | 1,235 | 231,765 | 2044/01/22 | |
| UK TREASURY 4.625 01/31/34 | 国債証券 | 4.6250 | 2,280 | 2,420 | 453,972 | 2034/01/31 | |
| UK TREASURY 0.5 01/31/29 | 国債証券 | 0.5000 | 360 | 315 | 59,077 | 2029/01/31 | |
| UK TREASURY 4.5 09/07/34 | 国債証券 | 4.5000 | 3,250 | 3,421 | 641,523 | 2034/09/07 | |
| UK TREASURY 0.875 10/22/29 | 国債証券 | 0.8750 | 450 | 393 | 73,872 | 2029/10/22 | |
| UK TREASURY 4.75 12/07/38 | 国債証券 | 4.7500 | 200 | 214 | 40,155 | 2038/12/07 | |
| UK TREASURY 4.25 12/07/55 | 国債証券 | 4.2500 | 790 | 768 | 144,111 | 2055/12/07 | |
| 小計 | — | — | 8,770 | 8,769 | 1,644,478 | — | |
| (デンマーク) | | | % | 千デンマーク・クローネ | 千デンマーク・クローネ | 千円 | |
| DENMARK 0.0 11/15/31 | 国債証券 | 0.0000 | 4,300 | 3,740 | 79,363 | 2031/11/15 | |
| 小計 | — | — | 4,300 | 3,740 | 79,363 | — | |
| (ノルウェー) | | | % | 千ノルウェー・クローネ | 千ノルウェー・クローネ | 千円 | |
| NORWAY 2.0 04/26/28 | 国債証券 | 2.0000 | 4,200 | 4,043 | 53,490 | 2028/04/26 | |
| 小計 | — | — | 4,200 | 4,043 | 53,490 | — | |

| 銘柄 | 2024 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 | |
| (スウェーデン) | | % | 千スウェーデン・クローナ | 千スウェーデン・クローナ | 千円 | |
| SWEDEN 0.75 11/12/29 | 国債証券 | 0.7500 | 4,700 | 4,474 | 61,889 | 2029/11/12 |
| 小計 | — | — | 4,700 | 4,474 | 61,889 | — |
| (メキシコ) | | % | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | 千円 | |
| MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26 | 国債証券 | 5.7500 | 6,000 | 5,655 | 40,791 | 2026/03/05 |
| MEXICAN BONDS 05/26/33 | 国債証券 | 7.5000 | 13,000 | 11,521 | 83,104 | 2033/05/26 |
| MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27 | 国債証券 | 7.5000 | 13,000 | 12,418 | 89,571 | 2027/06/03 |
| 小計 | — | — | 32,000 | 29,596 | 213,467 | — |
| (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 2.75 04/25/28 | 国債証券 | 2.7500 | 2,000 | 1,863 | 68,981 | 2028/04/25 |
| POLAND 6.0 10/25/33 | 国債証券 | 6.0000 | 2,000 | 2,112 | 78,228 | 2033/10/25 |
| 小計 | — | — | 4,000 | 3,975 | 147,209 | — |
| (ユーロ…フランス) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/26 | 国債証券 | 0.0000 | 2,720 | 2,623 | 415,312 | 2026/02/25 |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/34 | 国債証券 | 1.2500 | 300 | 260 | 41,199 | 2034/05/25 |
| FRANCE OAT 2.75 10/25/27 | 国債証券 | 2.7500 | 4,870 | 4,917 | 778,559 | 2027/10/25 |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/31 | 国債証券 | 0.0000 | 4,700 | 3,900 | 617,609 | 2031/11/25 |
| FRANCE OAT 2.0 11/25/32 | 国債証券 | 2.0000 | 1,670 | 1,583 | 250,680 | 2032/11/25 |
| 小計 | — | — | 14,260 | 13,284 | 2,103,360 | — |
| (ユーロ…ドイツ) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34 | 国債証券 | 2.2000 | 1,960 | 1,969 | 311,785 | 2034/02/15 |
| DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33 | 国債証券 | 2.3000 | 7,100 | 7,215 | 1,142,421 | 2033/02/15 |
| BUNDESUBL 0.0 04/16/27 | 国債証券 | 0.0000 | 1,500 | 1,422 | 225,228 | 2027/04/16 |
| BUNDESSCHAT 2.8 06/12/25 | 国債証券 | 2.8000 | 160 | 159 | 25,320 | 2025/06/12 |
| DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39 | 国債証券 | 4.2500 | 2,790 | 3,426 | 542,484 | 2039/07/04 |
| DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53 | 国債証券 | 1.8000 | 3,450 | 2,999 | 474,954 | 2053/08/15 |
| DEUTSCHLAND 08/15/29 | 国債証券 | 0.0000 | 5,420 | 4,920 | 779,033 | 2029/08/15 |
| 小計 | — | — | 22,380 | 22,113 | 3,501,227 | — |
| (ユーロ…スペイン) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| SPAIN 4.7 07/30/41 | 国債証券 | 4.7000 | 600 | 700 | 110,892 | 2041/07/30 |
| SPAIN 2.35 07/30/33 | 国債証券 | 2.3500 | 1,250 | 1,198 | 189,758 | 2033/07/30 |
| SPAIN 1.9 10/31/52 | 国債証券 | 1.9000 | 1,200 | 840 | 133,130 | 2052/10/31 |
| SPAIN 1.45 10/31/27 | 国債証券 | 1.4500 | 3,600 | 3,495 | 553,430 | 2027/10/31 |
| SPAIN 2.55 10/31/32 | 国債証券 | 2.5500 | 1,000 | 983 | 155,639 | 2032/10/31 |
| SPAIN 3.55 10/31/33 | 国債証券 | 3.5500 | 2,990 | 3,144 | 497,834 | 2033/10/31 |
| 小計 | — | — | 10,640 | 10,362 | 1,640,687 | — |
| (ユーロ…イタリア) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ITALY BTPS 4.2 03/01/34 | 国債証券 | 4.2000 | 2,780 | 2,940 | 465,510 | 2034/03/01 |
| ITALY BTPS 3.4 04/01/28 | 国債証券 | 3.4000 | 3,500 | 3,577 | 566,346 | 2028/04/01 |
| ITALY BTPS 3.8 04/15/26 | 国債証券 | 3.8000 | 1,360 | 1,383 | 219,005 | 2026/04/15 |
| ITALY BTPS 3.7 06/15/30 | 国債証券 | 3.7000 | 3,500 | 3,614 | 572,331 | 2030/06/15 |
| ITALY BTPS 4.45 09/01/43 | 国債証券 | 4.4500 | 1,800 | 1,892 | 299,642 | 2043/09/01 |
| ITALY BTPS 4.5 10/01/53 | 国債証券 | 4.5000 | 1,800 | 1,892 | 299,642 | 2053/10/01 |
| ITALY BTPS 4.35 11/01/33 | 国債証券 | 4.3500 | 2,250 | 2,411 | 381,856 | 2033/11/01 |
| 小計 | — | — | 16,990 | 17,711 | 2,804,335 | — |
| 合 計 | — | — | — | — | 29,986,245 | — |

■投資信託財産の構成

2024年9月10日現在

| 項 目 | 第 44 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 | 2,411,465 千円 | 99.1 % |
| コール・ローン等、その他 | 21,874 | 0.9 |
| 投資信託財産総額 | 2,433,339 | 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、2024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30,250,481千円、98.2%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、2024年9月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=143.53円、1カナダ・ドル=105.78円、1オーストラリア・ドル=95.45円、1イギリス・ポンド=187.52円、1デンマーク・クローネ=21.22円、1ノルウェー・クローネ=13.23円、1スウェーデン・クローナ=13.83円、1メキシコ・ペソ=7.212円、1ポーランド・ズロチ=37.026円、1ユーロ=158.33円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年4月10日)、(2024年5月10日)、(2024年6月10日)、(2024年7月10日)、(2024年8月13日)、(2024年9月10日)現在

| 項 目 | 第 254 期 末 | 第 255 期 末 | 第 256 期 末 | 第 257 期 末 | 第 258 期 末 | 第 259 期 末 |
|----------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (A) 資 産 | 3,597,086,948円 | 3,450,333,136円 | 3,901,860,869円 | 3,927,617,747円 | 3,855,407,224円 | 3,212,807,082円 |
| コール・ローン等 | 9,451,086 | 11,070,978 | 4,535,392 | 6,495,790 | 8,416,757 | 10,367,990 |
| グローバル・ボンド・ポート・マザーファンド(評価額) | 2,547,642,261 | 2,554,406,510 | 2,562,634,195 | 2,642,641,421 | 2,440,163,509 | 2,411,465,283 |
| 未 収 入 金 | 1,039,993,601 | 884,855,648 | 1,334,691,282 | 1,278,480,536 | 1,406,826,958 | 790,973,809 |
| (B) 負 債 | 1,039,294,572 | 885,669,642 | 1,334,491,141 | 1,280,648,141 | 1,403,515,567 | 791,685,647 |
| 未 払 金 | 1,035,569,462 | 882,099,486 | 1,329,607,992 | 1,277,104,320 | 1,389,029,075 | 788,423,380 |
| 未払収益分配金 | 1,566,947 | 1,546,454 | 1,538,024 | 1,528,394 | 1,508,359 | 1,502,537 |
| 未払解約金 | 194,048 | 64,663 | 1,291,660 | 20 | 10,754,049 | 18 |
| 未払信託報酬 | 1,956,557 | 1,951,502 | 2,045,563 | 2,007,650 | 2,215,527 | 1,752,940 |
| その他未払費用 | 7,558 | 7,537 | 7,902 | 7,757 | 8,557 | 6,772 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 2,557,792,376 | 2,564,663,494 | 2,567,369,728 | 2,646,969,606 | 2,451,891,657 | 2,421,121,435 |
| 元 本 | 3,133,895,964 | 3,092,909,232 | 3,076,048,207 | 3,056,788,442 | 3,016,718,947 | 3,005,075,476 |
| 次期繰越損益金 | △576,103,588 | △528,245,738 | △508,678,479 | △409,818,836 | △564,827,290 | △583,954,041 |
| (D) 受益権総口数 | 3,133,895,964口 | 3,092,909,232口 | 3,076,048,207口 | 3,056,788,442口 | 3,016,718,947口 | 3,005,075,476口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 8,162円 | 8,292円 | 8,346円 | 8,659円 | 8,128円 | 8,057円 |

(注) 第253期末における元本額は3,158,529,375円、当作成期間(第254期～第259期)中における追加設定元本額は424,265円、同解約元本額は153,878,164円です。

■損益の状況

〔自 2024年3月12日 至 2024年4月10日〕〔自 2024年4月11日 至 2024年5月10日〕〔自 2024年5月11日 至 2024年6月10日〕〔自 2024年6月11日 至 2024年7月10日〕〔自 2024年7月11日 至 2024年8月13日〕〔自 2024年8月14日 至 2024年9月10日〕

| 項 目 | 第 254 期 | 第 255 期 | 第 256 期 | 第 257 期 | 第 258 期 | 第 259 期 |
|---------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 317円 | 577円 | 475円 | 291円 | 869円 | 1,696円 |
| 受 取 利 息 | 328 | 577 | 475 | 291 | 869 | 1,696 |
| 支 払 利 息 | △11 | - | - | - | - | - |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 48,772,101 | 44,051,997 | 20,469,695 | 99,435,746 | △156,387,710 | △17,851,644 |
| 売 買 益 | 66,847,863 | 66,785,872 | 39,296,260 | 119,593,880 | 45,413,211 | 42,309,893 |
| 売 買 損 | △18,075,762 | △22,733,875 | △18,826,565 | △20,158,134 | △201,800,921 | △60,161,537 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △2,206,287 | △2,182,919 | △2,244,865 | △2,234,375 | △2,483,055 | △1,954,412 |
| (D) 当 期 繰 越 損 益 金 (A+B+C) | 46,566,131 | 41,869,655 | 18,225,305 | 97,201,662 | △158,869,896 | △19,804,360 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △335,052,645 | △286,252,792 | △244,585,007 | △226,463,682 | △129,072,906 | △288,328,460 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △286,050,127 | △282,316,147 | △280,780,753 | △279,028,422 | △275,376,129 | △274,318,684 |
| (配 当 等 相 当 額) | (37,012,700) | (36,529,820) | (36,331,521) | (36,105,722) | (35,633,818) | (35,497,442) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△323,062,827) | (△318,845,967) | (△317,112,274) | (△315,134,144) | (△311,009,947) | (△309,816,126) |
| (G) 合 計 (D+E+F) | △574,536,641 | △526,699,284 | △507,140,455 | △408,290,442 | △563,318,931 | △582,451,504 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △1,566,947 | △1,546,454 | △1,538,024 | △1,528,394 | △1,508,359 | △1,502,537 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G+H) | △576,103,588 | △528,245,738 | △508,678,479 | △409,818,836 | △564,827,290 | △583,954,041 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △286,050,127 | △282,316,147 | △280,780,753 | △279,028,422 | △275,376,129 | △274,318,684 |
| (配 当 等 相 当 額) | (37,012,740) | (36,529,890) | (36,331,569) | (36,105,814) | (35,633,888) | (35,497,489) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△323,062,867) | (△318,846,037) | (△317,112,322) | (△315,134,236) | (△311,010,017) | (△309,816,173) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 46,216,255 | 49,080,464 | 52,271,138 | 55,923,463 | 57,190,762 | 58,241,403 |
| 繰 越 損 益 金 | △336,269,716 | △295,010,055 | △280,168,864 | △186,713,877 | △346,641,923 | △367,876,760 |

(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 254 期 | 第 255 期 | 第 256 期 | 第 257 期 | 第 258 期 | 第 259 期 |
|-----------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 4,906,000円 | 5,016,251円 | 4,997,037円 | 5,509,634円 | 3,510,034円 | 2,775,006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 | 37,012,740 | 36,529,890 | 36,331,569 | 36,105,814 | 35,633,888 | 35,497,489 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 42,877,202 | 45,610,667 | 48,812,125 | 51,942,223 | 55,189,087 | 56,968,934 |
| (e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d) | 84,795,942 | 87,156,808 | 90,140,731 | 93,557,671 | 94,333,009 | 95,241,429 |
| (f) 1万口当たり当期分配対象額 | 270.58 | 281.80 | 293.04 | 306.07 | 312.70 | 316.94 |
| (g) 分 配 金 | 1,566,947 | 1,546,454 | 1,538,024 | 1,528,394 | 1,508,359 | 1,502,537 |
| (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 254 期 | 第 255 期 | 第 256 期 | 第 257 期 | 第 258 期 | 第 259 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53期 (決算日 2024年3月21日)

(計算期間 2023年9月21日～2024年3月21日)

グローバル・ボンド・ポート・マザーファンドの第53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 | | | |
| 49期 (2022年3月22日) | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| 50期 (2022年9月20日) | 26,085 | △1.5 | 502.80 | △0.8 | 98.5 | — | 28,432 |
| 51期 (2023年3月20日) | 27,226 | 4.4 | 529.19 | 5.2 | 98.5 | — | 28,661 |
| 52期 (2023年9月20日) | 26,107 | △4.1 | 504.30 | △4.7 | 98.7 | — | 27,216 |
| 53期 (2024年3月21日) | 27,856 | 6.7 | 546.31 | 8.3 | 97.6 | — | 27,496 |
| | 29,839 | 7.1 | 587.41 | 7.5 | 98.3 | — | 29,315 |

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

(注4) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

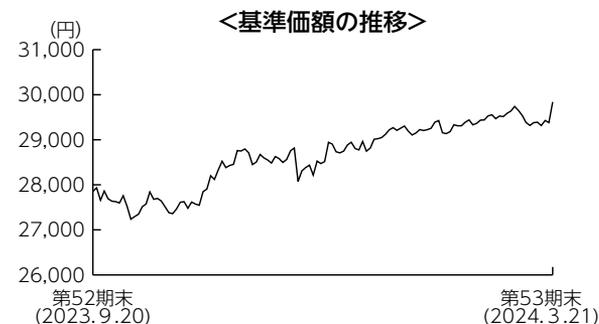
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | F T S E世界国債インデックス (除く日本、 円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク) | | 債券組入 率 | 債券先物 率 |
|--------------------------|-------------|--------|--|--------|-----------|-----------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2023 年 9 月 20 日 | 円 27,856 | % - | ポイント 546.31 | % - | % 97.6 | % - |
| 9 月 末 | 27,597 | △0.9 | 542.87 | △0.6 | 97.4 | - |
| 10 月 末 | 27,546 | △1.1 | 541.40 | △0.9 | 97.1 | - |
| 11 月 末 | 28,628 | 2.8 | 563.37 | 3.1 | 96.9 | - |
| 12 月 末 | 28,805 | 3.4 | 559.66 | 2.4 | 96.9 | - |
| 2024 年 1 月 末 | 29,224 | 4.9 | 573.73 | 5.0 | 97.4 | - |
| 2 月 末 | 29,526 | 6.0 | 580.86 | 6.3 | 97.2 | - |
| (期 末) 2024 年 3 月 21 日 | 29,839 | 7.1 | 587.41 | 7.5 | 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（2023年9月21日から2024年3月21日まで）

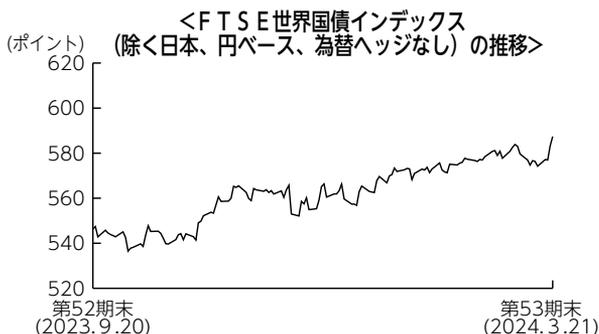


基準価額の推移

当期末の基準価額は29,839円となり、前期末比で7.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米国のF R B（米連邦準備理事会）や欧州のE C B（欧州中央銀行）をはじめとした主要国・地域の中央銀行が、一定のインフレ沈静などを背景に、それまでのタカ派的な姿勢を後退させ、多くの主要国の国債利回りが低下（価格は上昇）したこと、また、内外の金利差等を背景に多くの主要通貨に対して円安が進んだことが主なプラス要因となり、基準価額は上昇しました。



投資環境

債券市場では、主要国の国債利回りは低下しました。米国では、期初、前期からの利回り上昇（価格は下落）の流れを引き継ぎ、10年国債利回りは2023年10月に一時5.0%を上回る局面も見られましたが、その後は一定のインフレ沈静を背景にF R Bがタカ派的な姿勢を後退させたこと

で、利上げ停止や近い将来の利下げを織り込む動きが広がり、低下に転じました。ユーロ圏においても、E C Bの利上げ停止や近い将来の利下げを織り込む動きから国債利回りは低下しました。

為替市場では、米ドルが他主要通貨に対して軟調に推移しました。2023年11月以降、F R Bがタカ派的な姿勢を後退させ、利上げの停止や近い将来の利下げを織り込む動きが強まったことで、F R Bの高金利政策の長期化見通しを背景に進んでいた米ドル高が巻き戻された格好になりました。円は、内外金利差や日銀の緩和姿勢の維持を受けた円安要因と、日銀の金融政策修正に対する期待からくる円高要因の綱引きとなり、荒れた推移となりました。

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、ベンチマークに対する長期化戦略を継続し、2023年11月以降に主要国の利回り低下が進んだ局面では長期化幅を拡大しました。国別の投資配分については、ベンチマーク比率に対する米国のオーバーウェイト、中国のアンダーウェイト（非保有）を継続しました。

※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7.5%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.4%下回りました。中国の非保有などを主因に債券ポジションによる正味の運用収益が小幅にベンチマークを下回ったほか、ベンチマークとファンドの評価為替の差異などがマイナス要因となりました。

今後の運用方針

米国では、基調的なインフレの沈静化傾向が続いており、今後の利下げへの転換時期を探る段階にあると見ているほか、欧州景気は停滞状況にあり、利下げの織り込みがさらに進む可能性が高いと見ています。こうしたことから、債券のデュレーションについては、対ベンチマークでの長期化を軸とした運営を継続します。国別配分では、米国などをオーバーウェイト、ユーロ圏内の国別配分では、イタリアのオーバーウェイトを軸とした運営を実施する方針です。

■ 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 (2) | 0.006% (0.006) | (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 |
| 合 計 | 2 | 0.006 | |
| 期中の平均基準価額は28,646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 (2023年9月21日から2024年3月21日まで)

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|---|---|----|-------------|-------------|
| 外 | ア | メ | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル |
| | リ | カ | 22,733 | 21,982 |
| | | | | (-) |
| | オ | ース | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル |
| | ト | ラ | - | 290 |
| | | | (-) | |
| | イ | ギ | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド |
| | リ | ス | 3,177 | 1,451 |
| | | | | (1,380) |
| | デ | ン | 千デンマーク・クローネ | 千デンマーク・クローネ |
| | マ | ー | - | 1,224 |
| | ク | | | (-) |
| | メ | キ | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ |
| | シ | コ | 2,747 | 46,832 |
| | | | | (-) |
| 国 | ユ | | 千ユーロ | 千ユーロ |
| | | フ | 7,707 | 4,378 |
| | | ラ | | (-) |
| | | ン | | 7,496 |
| | | ス | | (-) |
| | ド | | 4,556 | |
| | | | | (-) |
| | ス | | 2,082 | |
| | | | | 579 |
| | | | | (-) |
| | イ | | 9,546 | |
| | | | | 7,430 |
| | | | | (-) |

(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 (2023年9月21日から2024年3月21日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|-------------|-----------------------|-----------------------|------------------|-----------|--------------------|-------------------|-----------|----------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うち B B 格 以下組入比率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 | | |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| ア メ リ カ | 千アメリカ・ドル 117,580 | 千アメリカ・ドル 99,411 | 千円 14,990,284 | % 51.1 | % - | % 33.7 | % 11.9 | % 5.5 |
| カ ナ ダ | 千カナダ・ドル 5,800 | 千カナダ・ドル 5,145 | 千円 575,836 | 2.0 | - | 2.0 | - | - |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 4,700 | 千オーストラリア・ドル 4,028 | 千円 401,640 | 1.4 | - | 1.3 | 0.1 | - |
| イ ギ リ ス | 千イギリス・ポンド 8,790 | 千イギリス・ポンド 7,857 | 千円 1,515,901 | 5.2 | - | 3.7 | 0.4 | 1.1 |
| デ ン マ ー ク | 千デンマーク・クローネ 4,300 | 千デンマーク・クローネ 3,596 | 千円 79,493 | 0.3 | - | 0.3 | - | - |
| ノ ル ウ ェ ー | 千ノルウェー・クローネ 4,200 | 千ノルウェー・クローネ 3,939 | 千円 56,333 | 0.2 | - | - | 0.2 | - |
| ス ウ ェ ー デ ン | 千スウェーデン・クローナ 4,700 | 千スウェーデン・クローナ 4,304 | 千円 62,539 | 0.2 | - | 0.2 | - | - |
| メ キ シ コ | 千メキシコ・ペソ 32,000 | 千メキシコ・ペソ 29,382 | 千円 265,695 | 0.9 | - | 0.4 | 0.4 | 0.2 |
| ポ ー ラ ン ド | 千ポーランド・ズロチ 4,000 | 千ポーランド・ズロチ 3,895 | 千円 148,918 | 0.5 | - | 0.3 | 0.2 | - |
| ユ ー ロ | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | | | | |
| フ ラ ン ス | 15,760 | 14,422 | 2,376,954 | 8.1 | - | 3.4 | 2.7 | 2.0 |
| ド イ ツ | 20,370 | 19,559 | 3,223,602 | 11.0 | - | 10.1 | 0.8 | 0.1 |
| ス ペ イ ン | 10,800 | 10,222 | 1,684,774 | 5.7 | - | 3.1 | 2.6 | - |
| イ タ リ ア | 20,160 | 20,853 | 3,436,852 | 11.7 | - | 8.8 | 2.9 | - |
| 合 計 | - | - | 千円 28,818,826 | 98.3 | - | 67.2 | 22.2 | 8.9 |

(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 | 12,940 | 7,954 | 1,199,430 | 2050/02/15 |
| US T N/B 1.125 05/15/40 | 国債証券 | 1.1250 | 12,000 | 7,376 | 1,112,300 | 2040/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/29 | 国債証券 | 2.3750 | 3,110 | 2,838 | 428,069 | 2029/05/15 |
| US T N/B 1.625 05/15/31 | 国債証券 | 1.6250 | 12,040 | 10,101 | 1,523,221 | 2031/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/32 | 国債証券 | 2.8750 | 3,720 | 3,361 | 506,904 | 2032/05/15 |
| US T N/B 3.375 05/15/33 | 国債証券 | 3.3750 | 18,400 | 17,141 | 2,584,816 | 2033/05/15 |
| US T N/B 2.0 08/15/25 | 国債証券 | 2.0000 | 11,200 | 10,775 | 1,624,790 | 2025/08/15 |
| US T N/B 1.5 08/15/26 | 国債証券 | 1.5000 | 9,330 | 8,696 | 1,311,274 | 2026/08/15 |
| US T N/B 0.625 08/15/30 | 国債証券 | 0.6250 | 12,400 | 9,890 | 1,491,344 | 2030/08/15 |
| US T N/B 2.25 11/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 15,460 | 14,375 | 2,167,664 | 2027/11/15 |
| US T N/B 4.125 11/15/32 | 国債証券 | 4.1250 | 6,980 | 6,900 | 1,040,467 | 2032/11/15 |
| 小 計 | — | — | 117,580 | 99,411 | 14,990,284 | — |
| (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 | 2,800 | 2,646 | 296,185 | 2029/06/01 |
| CANADA 1.25 06/01/30 | 国債証券 | 1.2500 | 1,970 | 1,730 | 193,640 | 2030/06/01 |
| CANADA 2.0 12/01/51 | 国債証券 | 2.0000 | 1,030 | 768 | 86,010 | 2051/12/01 |
| 小 計 | — | — | 5,800 | 5,145 | 575,836 | — |
| (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 | |
| NEW S WALES TREASURY CRP 4.25 02/20/36 | 地方債証券 | 4.2500 | 500 | 470 | 46,924 | 2036/02/20 |
| QUEENSLAND TREASURY CORP 4.2 02/20/47 | 地方債証券 | 4.2000 | 900 | 782 | 77,966 | 2047/02/20 |
| NEW S WALES TREASURY CRP 2.0 03/08/33 | 地方債証券 | 2.0000 | 800 | 646 | 64,495 | 2033/03/08 |
| QUEENSLAND 3.25 07/21/28 | 地方債証券 | 3.2500 | 300 | 291 | 29,010 | 2028/07/21 |
| QUEENSLAND TREASURY CORP 1.75 08/21/31 | 特殊債券 | 1.7500 | 2,200 | 1,838 | 183,243 | 2031/08/21 |
| 小 計 | — | — | 4,700 | 4,028 | 401,640 | — |
| (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 | 2,059 | 397,291 | 2044/01/22 |
| UK TREASURY 0.5 01/31/29 | 国債証券 | 0.5000 | 660 | 561 | 108,251 | 2029/01/31 |
| UK TREASURY 0.125 01/30/26 | 国債証券 | 0.1250 | 1,800 | 1,669 | 322,114 | 2026/01/30 |
| UK TREASURY 3.75 10/22/53 | 国債証券 | 3.7500 | 200 | 176 | 34,119 | 2053/10/22 |
| UK TREASURY 0.875 10/22/29 | 国債証券 | 0.8750 | 1,700 | 1,448 | 279,376 | 2029/10/22 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/38 | 国債証券 | 4.7500 | 200 | 210 | 40,575 | 2038/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/55 | 国債証券 | 4.2500 | 1,790 | 1,732 | 334,172 | 2055/12/07 |
| 小 計 | — | — | 8,790 | 7,857 | 1,515,901 | — |
| (デンマーク) | | % | 千デンマーク・クローネ | 千デンマーク・クローネ | 千円 | |
| DENMARK 0.0 11/15/31 | 国債証券 | 0.0000 | 4,300 | 3,596 | 79,493 | 2031/11/15 |
| 小 計 | — | — | 4,300 | 3,596 | 79,493 | — |
| (ノルウェー) | | % | 千ノルウェー・クローネ | 千ノルウェー・クローネ | 千円 | |
| NORWAY 2.0 04/26/28 | 国債証券 | 2.0000 | 4,200 | 3,939 | 56,333 | 2028/04/26 |
| 小 計 | — | — | 4,200 | 3,939 | 56,333 | — |
| (スウェーデン) | | % | 千スウェーデン・クローナ | 千スウェーデン・クローナ | 千円 | |
| SWEDEN 0.75 11/12/29 | 国債証券 | 0.7500 | 4,700 | 4,304 | 62,539 | 2029/11/12 |
| 小 計 | — | — | 4,700 | 4,304 | 62,539 | — |

| 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 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| (メキシコ) | | % | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | 千円 | | | |
| MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26 | 国債証券 | 5.7500 | 6,000 | 5,543 | 50,126 | | 2026/03/05 | |
| MEXICAN BONDS 05/26/33 | 国債証券 | 7.5000 | 13,000 | 11,576 | 104,684 | | 2033/05/26 | |
| MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27 | 国債証券 | 7.5000 | 13,000 | 12,262 | 110,884 | | 2027/06/03 | |
| 小計 | — | — | 32,000 | 29,382 | 265,695 | | — | |
| (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 2.75 04/25/28 | 国債証券 | 2.7500 | 2,000 | 1,820 | 69,588 | | 2028/04/25 | |
| POLAND 6.0 10/25/33 | 国債証券 | 6.0000 | 2,000 | 2,075 | 79,329 | | 2033/10/25 | |
| 小計 | — | — | 4,000 | 3,895 | 148,918 | | — | |
| (ユーロ…フランス) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | | |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/26 | 国債証券 | 0.0000 | 3,720 | 3,514 | 579,306 | | 2026/02/25 | |
| FRANCE OAT 2.75 10/25/27 | 国債証券 | 2.7500 | 4,870 | 4,869 | 802,509 | | 2027/10/25 | |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/31 | 国債証券 | 0.0000 | 5,500 | 4,470 | 736,712 | | 2031/11/25 | |
| FRANCE OAT 2.0 11/25/32 | 国債証券 | 2.0000 | 1,670 | 1,568 | 258,426 | | 2032/11/25 | |
| 小計 | — | — | 15,760 | 14,422 | 2,376,954 | | — | |
| (ユーロ…ドイツ) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | | |
| DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33 | 国債証券 | 2.3000 | 6,700 | 6,648 | 1,095,724 | | 2033/02/15 | |
| BUNDESUBL 0.0 04/16/27 | 国債証券 | 0.0000 | 1,500 | 1,386 | 228,523 | | 2027/04/16 | |
| BUNDESSCHAT 2.8 06/12/25 | 国債証券 | 2.8000 | 160 | 159 | 26,213 | | 2025/06/12 | |
| DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39 | 国債証券 | 4.2500 | 2,790 | 3,367 | 554,965 | | 2039/07/04 | |
| DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53 | 国債証券 | 1.8000 | 3,000 | 2,520 | 415,405 | | 2053/08/15 | |
| DEUTSCHLAND 08/15/29 | 国債証券 | 0.0000 | 6,220 | 5,477 | 902,769 | | 2029/08/15 | |
| 小計 | — | — | 20,370 | 19,559 | 3,223,602 | | — | |
| (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 | 1,000 | 977 | 161,053 | | 2026/04/30 | |
| SPAIN 4.7 07/30/41 | 国債証券 | 4.7000 | 600 | 684 | 112,779 | | 2041/07/30 | |
| SPAIN 2.35 07/30/33 | 国債証券 | 2.3500 | 1,250 | 1,166 | 192,312 | | 2033/07/30 | |
| SPAIN 1.9 10/31/52 | 国債証券 | 1.9000 | 1,200 | 809 | 133,375 | | 2052/10/31 | |
| SPAIN 1.45 10/31/27 | 国債証券 | 1.4500 | 3,850 | 3,658 | 602,894 | | 2027/10/31 | |
| SPAIN 2.55 10/31/32 | 国債証券 | 2.5500 | 800 | 766 | 126,392 | | 2032/10/31 | |
| SPAIN 3.55 10/31/33 | 国債証券 | 3.5500 | 2,100 | 2,159 | 355,964 | | 2033/10/31 | |
| 小計 | — | — | 10,800 | 10,222 | 1,684,774 | | — | |
| (ユーロ…イタリア) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | | |
| ITALY BTPS 3.4 04/01/28 | 国債証券 | 3.4000 | 3,500 | 3,529 | 581,622 | | 2028/04/01 | |
| ITALY BTPS 3.8 04/15/26 | 国債証券 | 3.8000 | 1,660 | 1,677 | 276,540 | | 2026/04/15 | |
| ITALY BTPS 3.7 06/15/30 | 国債証券 | 3.7000 | 4,200 | 4,278 | 705,146 | | 2030/06/15 | |
| ITALY BTPS 4.45 09/01/43 | 国債証券 | 4.4500 | 1,800 | 1,875 | 309,028 | | 2043/09/01 | |
| ITALY BTPS 4.5 10/01/53 | 国債証券 | 4.5000 | 1,800 | 1,881 | 310,126 | | 2053/10/01 | |
| ITALY BTPS 4.35 11/01/33 | 国債証券 | 4.3500 | 7,200 | 7,611 | 1,254,388 | | 2033/11/01 | |
| 小計 | — | — | 20,160 | 20,853 | 3,436,852 | | — | |
| 合計 | — | — | — | — | 28,818,826 | | — | |

■投資信託財産の構成

2024年3月21日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 28,818,826 | 97.2 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 822,791 | 2.8 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 29,641,618 | 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、29,056,364千円、98.0%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、2024年3月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=150.79円、1カナダ・ドル=111.92円、1オーストラリア・ドル=99.69円、1イギリス・ポンド=192.92円、1デンマーク・クローネ=22.10円、1ノルウェー・クローネ=14.30円、1スウェーデン・クローナ=14.53円、1メキシコ・ペソ=9.042円、1ポーランド・ズロチ=38.226円、1ユーロ=164.81円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年3月21日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 29,641,618,531円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 595,058,409 |
| 公 社 債(評価額) | 28,818,826,615 |
| 未 収 利 息 | 210,599,404 |
| 前 払 費 用 | 17,134,103 |
| (B) 負 債 | 326,036,000 |
| 未 払 解 約 金 | 326,036,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 29,315,582,531 |
| 元 本 | 9,824,544,672 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 19,491,037,859 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 9,824,544,672口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 29,839円 |

(注1) 期首元本額 9,870,970,458円
追加設定元本額 942,848,801円
一部解約元本額 989,274,587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) 3,281,706,063円
グローバル・ボンド・ポート (Dコース) 4,477,938,111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) 1,171,209,511円
D I A Mグローバル・ボンド・ポート毎月決算コース2 854,107,263円
D I A Mグローバル・ボンド・ポートVA (ヘッジなし) 39,583,724円
期末元本合計 9,824,544,672円

■損益の状況

当期 自2023年9月21日 至2024年3月21日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 358,621,481円 |
| 受 取 利 息 | 358,665,907 |
| 支 払 利 息 | △44,426 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 1,607,956,673 |
| 売 買 益 | 1,702,670,852 |
| 売 買 損 | △94,714,179 |
| (C) そ の 他 費 用 | △1,689,264 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 1,964,888,890 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 17,625,495,683 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | △1,867,481,913 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 1,768,135,199 |
| (H) 合 計(D+E+F+G) | 19,491,037,859 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 19,491,037,859 |

(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。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

- 新NISA制度の成長投資枠の要件に沿った表記に改めるため、デリバティブの使用目的を明確化しました。
(2023年12月21日)