

運用報告書(全体版)

当ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	追加型投信/海外/債券	
信託期間	無期限	
運用方針	主として日本を除く世界各国の公社債に投資し、信託財産の長期的な成長を目指して、運用を行います。	
主要投資対象	朝日Nvest グローバル ボンド オープン	朝日Nvest グローバル ボンド マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	朝日Nvest グローバル ボンド マザーファンド	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	朝日Nvest グローバル ボンド オープン	株式への実質投資割合は、純資産総額の20%以下とします。外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	朝日Nvest グローバル ボンド マザーファンド	株式への投資割合は、純資産総額の20%以下とします。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎決算時(2月24日、8月24日。休業日の場合は翌営業日)に、配当等収益および売買益などのうちから、基準価額水準等を勘案して、分配を行う方針です。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないこともあります。	

朝日Nvest グローバル ボンドオープン 愛称 [Avest-B]

第47期

(決算日 2023年8月24日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、ご投資いただいております「朝日Nvest グローバル ボンドオープン」は、2023年8月24日に第47期の決算を行いました。ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも、一層のお引立てを賜りますようお願い申し上げます。

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社
東京都杉並区和泉一丁目22番19号

<お問い合わせ先>

ホームページ： <https://www.alamco.co.jp/>

フリーダイヤル：0120-283-104

〔受付時間〕 営業日の午前9時～午後5時

○本報告書の表記について

・原則として、数量、額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。ただし、単位未満の数値については小数で表記する場合があります。－印は、組入れ、異動などの該当がないことを示します。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			参考指数		債組入比率	純資産額
	(分配落)	税金分配	み期騰落率	騰落	中率		
	円	円	%		%	%	百万円
43期(2021年8月24日)	9,927	35	0.8	18,488	1.6	95.4	2,723
44期(2022年2月24日)	9,341	10	△5.8	17,484	△5.4	98.0	2,561
45期(2022年8月24日)	8,521	10	△8.7	16,027	△8.3	96.7	2,348
46期(2023年2月24日)	8,056	10	△5.3	15,080	△5.9	95.0	2,232
47期(2023年8月24日)	7,813	10	△2.9	14,758	△2.1	102.0	2,167

(注) 基準価額および分配金は1万口当たりの値です。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みで計算しています。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、債券組入比率は実質比率で記載しています。

(注) 債券組入比率には新株予約権付社債(転換社債)を含んでいます。

(注) 参考指数は、FTSE世界国債インデックス(除く日本)をファンドの計理基準に適合するように調整した数値を表示しています。この数値はインデックス構成国の現地通貨ベースのリターン(前営業日)から対顧客電信売買相場の仲値の1ヵ月フォワードレート(当日)に基づくヘッジコストを控除した構成各国の円ヘッジベースのリターンを国別構成比で加重して算出しており、当ファンド設定日の前日を10,000として指数化しています(以下同じです。)

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数		債組入比率	券率
	騰落率	騰落率	騰落	騰落率		
(期首) 2023年2月24日	円	%		%		%
	8,056	—	15,080	—		95.0
2月末	8,015	△0.5	14,996	△0.6		96.3
3月末	8,117	0.8	15,264	1.2		95.8
4月末	8,085	0.4	15,198	0.8		96.4
5月末	8,003	△0.7	15,070	△0.1		100.9
6月末	7,965	△1.1	14,971	△0.7		99.8
7月末	7,919	△1.7	14,892	△1.2		98.5
(期末) 2023年8月24日	7,823	△2.9	14,758	△2.1		102.0

(注) 基準価額は1万口当たりの値です。

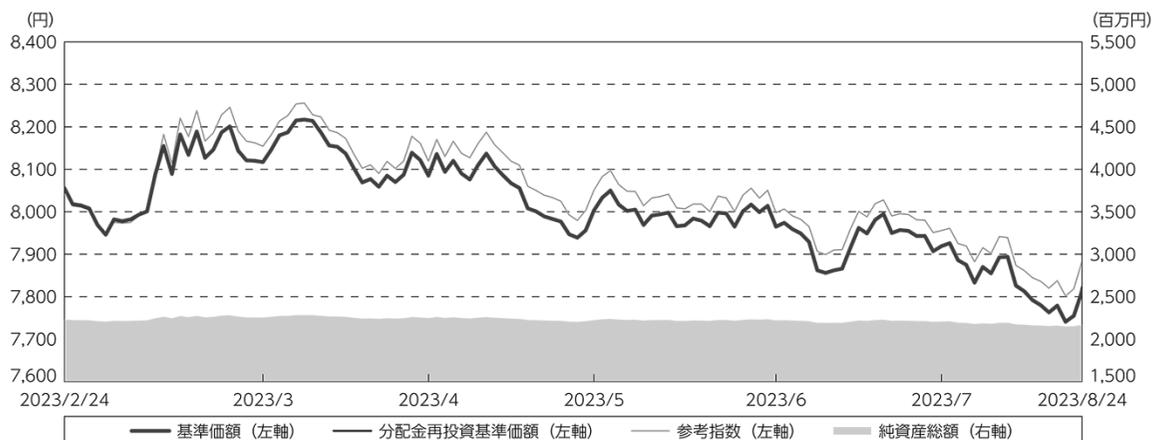
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比で計算しています。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、債券組入比率は実質比率で記載しています。

(注) 債券組入比率には新株予約権付社債(転換社債)を含んでいます。

◎運用経過(2023年2月25日～2023年8月24日)

○当期中の基準価額等の推移



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に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) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しています。

○基準価額の主な変動要因

主な上昇要因としては、期中において投資適格社債を含む保有債券の利息収入を安定的に確保したこと、および期の前半において銀行セクターに関する不安や景気後退観測を受けて主要国の国債利回りが全般的に低下したことが挙げられます。

主な下落要因としては、期の後半において根強いインフレ圧力への対応として各国の中央銀行による金融引き締め強化が市場で再び意識されたことから主要国の国債利回りが上昇基調へ転じたこと、および期中を通じて為替ヘッジコストがかかったことが挙げられます。

○投資環境

当期の前半については、米銀の経営破綻や欧州銀行の流動性危機に端を発した信用不安の高まりを受け、米国債利回りは低下基調で推移しました。雇用統計など好調な経済指標を受け国債利回りは一時上昇する局面があったものの、米国地銀の経営状況や景気後退リスクの高まりから同利回りは低下傾向を辿りました。ユーロ圏債券市場についても、米銀の経営破綻以降、欧州銀行セクターの健全性を巡る懸念が強まったことなどを背景に国債市場への資金流入が加速し、国債利回りは概ね低下傾向となりました。

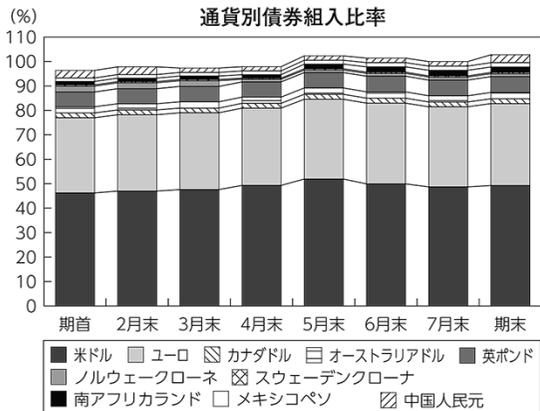
当期の後半については、米国において全般的に経済指標が良好であったことや株式市場が堅調に推移したことから、米国経済は景気後退入りを回避できるとの観測が強まりました。これを受けて、FRB(米連邦準備理事会)は金融引き締めスタンスを維持するとの見方が有力となり国債利回りは上昇傾向が強まりました。さらに2023年8月に入り、米財務省が利払い費の負担増などに対応するため国債を増発すると公表したことにより、今後の需給悪化が金利上昇圧力になるとの見方を背景に国債利回りはその水準を一段と切り上げました。ユーロ圏債券市場においては、ユーロ圏経済の成長鈍化が懸念される一方、高い伸びが続くインフレ状況などからECB(欧州中央銀行)による金融引き締めが再び意識され、徐々に国債利回りは上昇する展開となりました。なお、当期の社債市場については、期前半に金融セクター中心に社債のスプレッド(国債との利回り較差)が一時的に拡大した後、景気楽観的な見方が優勢となったことを受けてスプレッドは縮小傾向となり、期末は期初とほぼ同水準のスプレッドで終わりました。

○当ファンドのポートフォリオ

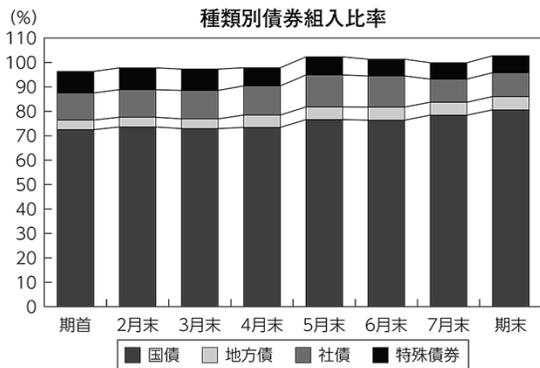
主要投資対象である朝日Nvest グローバル ボンドマザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券に投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行っています。マザーファンドは主として日本を除く世界各国の公社債に投資するとともに、外貨建資産の為替リスクを原則フルヘッジすることにより、信託財産の長期的成長を図ることを目的としています。



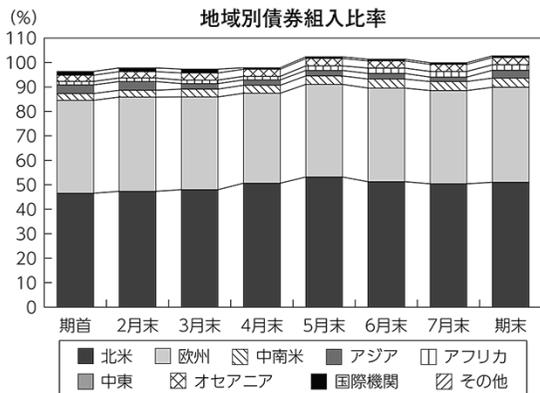
(注) 参考指数は、期首の基準価額をもとに指数化したものです。



(注) 純資産総額に対する比率です。



(注) 純資産総額に対する比率です。



(注) 純資産総額に対する比率です。

運用にあたっては、ルーミス・セイレス・アンド・カンパニー・エル・ピー(以下「ルーミス・セイレス社」といいます。)に外貨建資産の運用指図(為替ヘッジ取引の指図を含みます。)に関する権限を委託しています。

ポートフォリオ全体のデュレーション(金利変動に対する債券価格の変動率)は期首とほぼ同程度の水準を維持しました。

ポートフォリオの平均格付けは期首と同じAAを維持しました。また組入銘柄数は期首の103銘柄から期末は98銘柄となりました。

投資国(地域、国際機関を含みます。)数は、アラブ首長国連邦、香港の銘柄を売却する一方、コロンビア、デンマークの銘柄を組入れ、期末は期首と同じ23カ国となりました。通貨別の組入比率については、主にノルウェークローネの組入比率をやや引き下げ、米ドル、ユーロの組入比率をやや引き上げました。

当期の売買につきましては、主に社債等の比率を引き下げ、国債の比率を引き上げました。個別銘柄では、BOEING(アメリカ、航空機製造)、EQT(アメリカ、エネルギー)、CK HUTCHISON(香港、多国籍コングロマリット)などの銘柄を全売却する一方、OVINTIV(アメリカ、エネルギー)、BROADCOM(アメリカ、半導体・ソフト)、DANSKE BANK(デンマーク、銀行)などの銘柄を新規に組み入れました。

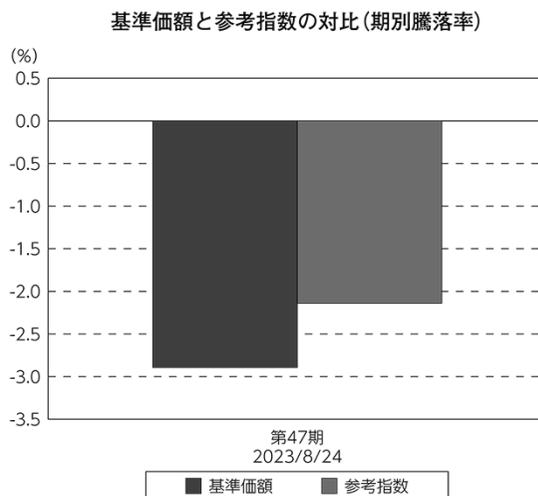
エマージング諸国の債券につきましては、主にアラブ首長国連邦、香港の銘柄を売却する一方、コロンビアの銘柄を組入れました。また南アフリカの組入比率を引き上げたことなどから組入比率は前期末からやや上昇しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークはありません。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数が2.1%下落したのに対し、基準価額は2.9%下落となり、参考指数を0.8%下回る結果となりました。ファンドから控除される信託報酬等のコストが主なマイナスの乖離要因となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込み(税込み)です。

○分配金

当期の分配金につきましては、収益分配方針に基づき、基準価額水準などを勘案して、1万口当たり10円とさせていただきます。

なお、収益分配にあらず信託財産内に留保した利益につきましては、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

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第47期
	2023年2月25日～ 2023年8月24日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0.128%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,316

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益および当期の収益以外は、小数点以下を切捨てて表示しているため、合計した額が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

マザーファンドへの投資により、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。マザーファンドは、引き続き、日本を除く世界各国の国債、地方債および社債等にグローバルな視点から幅広く投資機会を追求し、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行ってまいります。また、為替変動リスクの低減を図るため、為替は原則としてフルヘッジとします。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年2月25日～2023年8月24日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(31)	(0.382)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(24)	(0.300)	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、購入後の 情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.027)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	1	0.010	(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)	(0.007)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および 資金の送金・資産の移転等に要する費用です。
(監 査 費 用)	(0)	(0.003)	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です。
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	58	0.719	
期中の平均基準価額は、8,017円です。			

(注) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)は、追加・解約により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。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

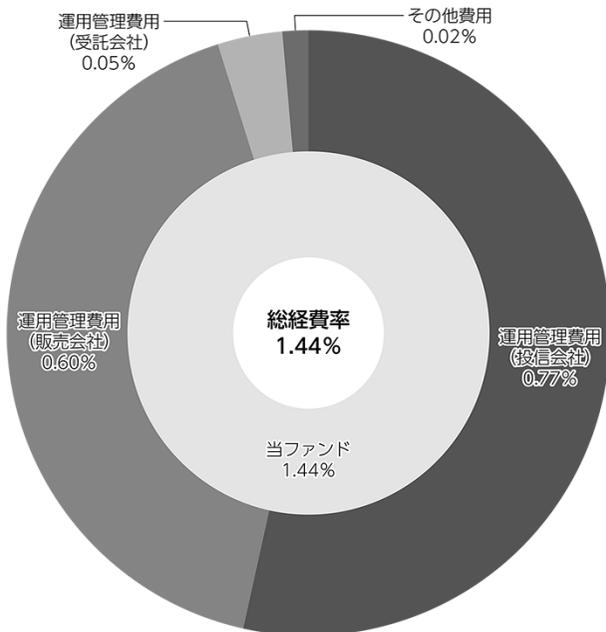
(注) その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます。)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(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除く。)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1.44%です。



(注) 当ファンドの費用は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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 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は異なります。

○売買及び取引の状況

(2023年2月25日～2023年8月24日)

該当事項はございません。

○利害関係人との取引状況等

(2023年2月25日～2023年8月24日)

該当事項はございません。

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

(2023年8月24日現在)

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
朝日Nvest グローバル ボンドマザーファンド		1,193,756	1,193,756	2,152,103

(注) 親投資信託の当期末の受益権口数は、3,508,935千口です。

○投資信託財産の構成

(2023年8月24日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
朝日Nvest グローバル ボンドマザーファンド	2,152,103	98.4
コール・ローン等、その他	35,958	1.6
投資信託財産総額	2,188,061	100.0

(注) 朝日Nvest グローバル ボンドマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(6,638,864千円)の投資信託財産総額(6,652,133千円)に対する比率は99.8%です。

(注) 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、当期末における邦貨換算レートは1オフショア人民元=19.8831円、1米ドル=144.86円、1カナダドル=107.10円、1メキシコペソ=8.6286円、1ユーロ=157.49円、1英ポンド=184.26円、1スウェーデンクローナ=13.28円、1ノルウェークローネ=13.68円、1オーストラリアドル=93.83円、1南アフリカランド=7.83円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年8月24日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	2,188,061,578	
コール・ローン等	35,957,773	
朝日Nvest グローバル ボンドマザーファンド(評価額)	2,152,103,805	
(B) 負債	20,070,172	
未払収益分配金	2,774,674	
未払解約金	1,437,349	
未払信託報酬	15,796,942	
未払利息	107	
その他未払費用	61,100	
(C) 純資産総額(A-B)	2,167,991,406	
元本	2,774,674,699	
次期繰越損益金	△ 606,683,293	
(D) 受益権総口数	2,774,674,699口	
1万口当たり基準価額(C/D)	7,813円	

(注) 期首元本額は2,770,801,243円、期中追加設定元本額は57,371,225円、期中一部解約元本額は53,497,769円です。

(注) 投資信託財産計算規則第55条の6第10号に規定する額は以下のとおりです。

元本の欠損(当期末)606,683,293円

○損益の状況 (2023年2月25日～2023年8月24日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	△ 16,313	
支払利息	△ 16,313	
(B) 有価証券売買損益	△ 48,523,110	
売買益	357,318	
売買損	△ 48,880,428	
(C) 信託報酬等	△ 15,862,025	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 64,401,448	
(E) 前期繰越損益金	△468,438,989	
(F) 追加信託差損益金	△ 71,068,182	
(配当等相当額)	(200,961,850)	
(売買損益相当額)	(△272,030,032)	
(G) 計(D+E+F)	△603,908,619	
(H) 収益分配金	△ 2,774,674	
次期繰越損益金(G+H)	△606,683,293	
追加信託差損益金	△ 71,068,182	
(配当等相当額)	(201,069,920)	
(売買損益相当額)	(△272,138,102)	
分配準備積立金	164,164,919	
繰越損益金	△699,780,030	

(注) (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) (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) (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) 信託財産の運用指図に係る権限の一部を委託するために要した費用として、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対して年1万分の40の率を乗じて得た金額を委託者報酬の中から支弁しています。

(注) 分配金の計算過程
 計算期間末における費用控除後の配当等収益(13,538,748円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(一円)、信託約款に規定する収益調整金(201,069,920円)および分配準備積立金(153,400,845円)より分配可能額は368,009,513円(10,000口当たり1,326円)であり、うち2,774,674円(10,000口当たり10円)を分配金額としています。

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	10円
----------------	-----

- ◇収益分配金のお支払いは、決算日から起算して5営業日までに開始します。
- ◇収益分配金を再投資する方のお手取り収益分配金は、決算日の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰入れて再投資しました。
- ◇課税上の取扱い
 - ・追加型株式投資信託の収益分配金には、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)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)とがあります。
 - ・収益分配金落ち後の基準価額が、当該受益者の個別元本と同額または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。収益分配金落ち後の基準価額が、当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。
 - ・受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にそ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、その後の当該受益者の個別元本となります。
 - ・個人の受益者の普通分配金については、20.315%(所得税および復興特別所得税15.315%、地方税5%)の税率による源泉徴収が行われ、原則として確定申告の必要はありません。なお、確定申告を行い、総合課税(配当控除の適用はありません。)または申告分離課税を選択することもできます。
 - ・法人の受益者の場合は、税率が異なります。

※上記は、決算日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。
※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

当ファンドの仕組みは次のとおりです。

運用方針	主として日本を除く世界各国の公社債に投資し、信託財産の長期的な成長を目指して、運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合は、純資産総額の20%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		参考指数		債組入比率	純資産総額
	騰落	中率	騰落	中率		
	円	%		%	%	百万円
43期(2021年8月24日)	22,206	1.5	18,488	1.6	96.5	8,730
44期(2022年2月24日)	21,064	△5.1	17,484	△5.4	99.5	8,207
45期(2022年8月24日)	19,351	△8.1	16,027	△8.3	97.9	6,856
46期(2023年2月24日)	18,438	△4.7	15,080	△5.9	96.3	6,523
47期(2023年8月24日)	18,028	△2.2	14,758	△2.1	102.7	6,326

(注) 基準価額は1万円当たりの値です。

(注) 債券組入比率には新株予約権付社債(転換社債)を含んでいます。

(注) 参考指数は、FTSE世界国債インデックス(除く日本)をファンドの計理基準に適合するように調整した数値を表示しています。この数値はインデックス構成国の現地通貨ベースのリターン(前営業日)から対顧客電信売買相場の仲値の1ヵ月フォワードレート(当日)に基づくヘッジコストを控除した構成各国の円ヘッジベースのリターンを国別構成比で加重して算出しており、当ファンド設定日の前日を10,000として指数化しています(以下同じです)。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数		債組入比率	券率
	騰落	率	騰落	率		
(期首) 2023年2月24日	円	%		%		%
	18,438	—	15,080	—	96.3	96.3
2月末	18,345	△0.5	14,996	△0.6	97.8	97.8
3月末	18,605	0.9	15,264	1.2	97.3	97.3
4月末	18,551	0.6	15,198	0.8	97.9	97.9
5月末	18,384	△0.3	15,070	△0.1	102.3	102.3
6月末	18,319	△0.6	14,971	△0.7	101.4	101.4
7月末	18,233	△1.1	14,892	△1.2	99.9	99.9
(期末) 2023年8月24日	18,028	△2.2	14,758	△2.1	102.7	102.7

(注) 基準価額は1万円当たりの値です。

(注) 騰落率は期首比で計算しています。

(注) 債券組入比率には新株予約権付社債(転換社債)を含んでいます。

○当期の運用経過、今後の運用方針
 前述の2～6ページをご覧ください。

○1万口当たりの費用明細

(2023年2月25日～2023年8月24日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 1	% 0.008	(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 ）	(1)	(0.007)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用です。
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	1	0.008	
期中の平均基準価額は、18,406円です。			

(注) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)は、追加・解約により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。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます。)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

○売買及び取引の状況

(2023年2月25日～2023年8月24日)

公社債

		買付額	売付額	
外	アメリカ	国債証券	千米ドル 8,498	千米ドル 6,982
		特殊債券	—	—
		社債券	1,033	(725)
	カナダ	国債証券	千カナダドル —	千カナダドル 68
		地方債証券	685	63
		特殊債券	—	611
		社債券	—	(9)
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	
	ドイツ	国債証券	454	1,191
		社債券	—	87
イタリア	国債証券	—	130	
フランス	国債証券	—	110	
	社債券	117	—	
スペイン	国債証券	—	79	
その他	社債券	440	78	
国	イギリス	国債証券	千英ポンド 174	千英ポンド 157
		社債券	—	112
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ —	千ノルウェークローネ 6,423
	オーストラリア	特殊債券	千オーストラリアドル —	千オーストラリアドル 80
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 5,404	千南アフリカランド —
	中国オフショア	国債証券	千オフショア人民元 5,145	千オフショア人民元 5,560

(注) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません。)

(注) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれていません。

○利害関係人との取引状況等

(2023年2月25日～2023年8月24日)

該当事項はございません。

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

(2023年8月24日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	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
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	25,522	21,510	3,116,077	49.3	0.7	24.2	21.8	3.2
カナダ	千カナダドル 1,326	千カナダドル 1,163	124,645	2.0	—	1.3	0.7	—
メキシコ	千メキシコペソ 13,399	千メキシコペソ 12,920	111,486	1.8	—	1.8	—	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	3,270	2,570	404,893	6.4	—	2.1	2.2	2.0
イタリア	2,840	2,851	449,150	7.1	—	7.1	—	—
フランス	2,925	2,490	392,226	6.2	—	6.2	—	—
オランダ	555	451	71,157	1.1	—	1.1	—	—
スペイン	2,345	2,278	358,845	5.7	—	3.9	1.7	—
ベルギー	500	473	74,608	1.2	—	—	—	1.2
ルクセンブルク	115	85	13,522	0.2	—	0.2	—	—
アイルランド	745	591	93,182	1.5	—	1.5	—	—
その他	1,755	1,655	260,774	4.1	—	1.9	—	2.2
イギリス	千英ポンド 2,430	千英ポンド 2,236	412,179	6.5	0.3	3.0	0.9	2.6
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 2,390	千スウェーデンクローナ 2,339	31,068	0.5	—	—	—	0.5
ノルウェー	千ノルウェークローネ 5,660	千ノルウェークローネ 5,613	76,790	1.2	—	—	—	1.2
オーストラリア	千オーストラリアドル 1,845	千オーストラリアドル 1,738	163,105	2.6	—	0.5	2.1	—
南アフリカ	千南アフリカランド 22,390	千南アフリカランド 18,106	141,776	2.2	2.2	2.2	—	—
中国オフショア	千オフショア人民元 9,920	千オフショア人民元 10,134	201,507	3.2	—	2.6	0.6	—
合 計	—	—	6,496,998	102.7	3.2	59.6	30.1	13.0

(注) 評価額(邦貨換算金額)は、期末の評価額(外貨建金額)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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額(邦貨換算金額)の割合です。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注) 無格付は最低格付とみなしてBB格以下に含めて計算しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	CHILE GOVT	4.95	380	362	52,469	2036/1/5
	COLOMBIA REP OF	7.5	200	196	28,428	2034/2/2
	POLAND GOVT	4.0	260	258	37,405	2024/1/22
	US TREASURY BOND	1.75	1,365	908	131,554	2041/8/15
	US TREASURY BOND	4.0	195	183	26,552	2042/11/15
	US TREASURY BOND	2.875	630	496	71,957	2043/5/15
	US TREASURY BOND	1.25	2,535	1,307	189,419	2050/5/15
	US TREASURY BOND	2.25	720	480	69,607	2052/2/15
	US TREASURY NOTE	0.25	1,260	1,155	167,386	2025/6/30
	US TREASURY NOTE	0.375	1,975	1,777	257,443	2026/1/31
	US TREASURY NOTE	2.75	3,965	3,728	540,109	2027/4/30
	US TREASURY NOTE	2.625	205	191	27,771	2027/5/31
	US TREASURY NOTE	2.75	1,015	951	137,889	2027/7/31
	US TREASURY NOTE	0.75	2,170	1,851	268,164	2028/1/31
	US TREASURY NOTE	2.75	3,860	3,439	498,307	2032/8/15
	US TREASURY NOTE	3.375	1,335	1,248	180,848	2033/5/15
特殊債券 (除く金融債)	FHMS K074 A2CMBS	3.6	720	680	98,591	2028/1/25
普通社債券	AKER BP ASA	4.0	160	139	20,246	2031/1/15
	AT&T INC	5.4	145	139	20,260	2034/2/15
	AT&T INC	3.65	140	94	13,759	2051/6/1
	BROADCOM INC	2.45	90	71	10,428	2031/2/15
	BROADCOM INC	3.419	45	37	5,365	2033/4/15
	CENTENE CORP	3.0	125	103	14,932	2030/10/15
	CENTENE CORP	2.5	80	62	9,119	2031/3/1
	CHARTER COMM OPT	3.7	95	58	8,422	2051/4/1
	CONTINENTAL RES	4.375	60	56	8,145	2028/1/15
	CONTINENTAL RES	5.75	135	128	18,543	2031/1/15
	CONTINENTAL RES	2.875	50	38	5,510	2032/4/1
	DEUTSCHE BANK NY	3.742	200	148	21,486	2033/1/7
	GLENCORE FUNDING LLC	2.5	140	112	16,347	2030/9/1
	GLENCORE FUNDING LLC	2.625	80	63	9,150	2031/9/23
	HCA INC	3.625	215	183	26,587	2032/3/15
	NAVTR 2021-1 AABS	2.771	228	198	28,788	2046/11/15
	OVINTIV INC	7.375	9	9	1,386	2031/11/1
	OVINTIV INC	6.25	25	24	3,584	2033/7/15
	OVINTIV INC	6.5	48	48	6,997	2034/8/15
	T-MOBILE USA INC	5.05	45	43	6,238	2033/7/15
	T-MOBILE USA INC	3.3	80	52	7,675	2051/2/15
	T-MOBILE USA INC	3.4	25	16	2,420	2052/10/15
	UNICREDIT SPA	5.459	205	176	25,603	2035/6/30
	UNTD AIR 16-1 B	3.65	306	284	41,165	2027/7/7
小	計				3,116,077	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
地方債証券	ONTARIO PROVINCE	4.05	525	513	55,042	2032/2/2
	ONTARIO PROVINCE	3.75	75	71	7,669	2032/6/2

銘	柄	当 期 末					
		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		
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	地方債証券	ONTARIO PROVINCE	1.9	310	185	19,853	2051/12/2
	普通社債券	CNHC 2021-1A A2ABS	1.001	31	30	3,280	2026/11/16
		CPPIB CAPITAL INC	3.0	385	362	38,799	2028/6/15
小	計					124,645	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	MEXICAN BONOS	8.5	13,399	12,920	111,486	2029/5/31
小	計					111,486	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP	1.0	690	664	104,623	2025/8/15
		DEUTSCHLAND REP	—	1,000	899	141,626	2027/11/15
		DEUTSCHLAND REP	—	395	337	53,170	2030/2/15
		DEUTSCHLAND REP	—	1,020	513	80,825	2050/8/15
	普通社債券	COMMERZBANK AG	0.625	165	156	24,647	2025/5/28
イタリア	国債証券	BTPS	5.25	1,825	1,979	311,821	2029/11/1
		BTPS	1.35	1,015	871	137,329	2030/4/1
フランス	国債証券	FRANCE O. A. T.	—	980	796	125,501	2030/11/25
		FRANCE O. A. T.	—	610	472	74,376	2032/5/25
		FRANCE O. A. T.	4.5	790	908	143,124	2041/4/25
		FRANCE O. A. T.	0.5	345	199	31,361	2044/6/25
	普通社債券	ELECTRICITE DE FRANCE SA	2.0	200	113	17,862	2049/12/9
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVT	2.75	175	170	26,863	2047/1/15
	普通社債券	HEIMSTADEN BOSTAD	1.625	180	111	17,599	2031/10/13
		RABOBANK	1.25	200	169	26,694	2032/5/31
スペイン	国債証券	SPAIN GOVT	1.3	505	476	75,032	2026/10/31
		SPAIN GOVT	6.0	435	494	77,927	2029/1/31
		SPAIN GOVT	1.95	200	183	28,894	2030/7/30
		SPAIN GOVT	4.2	510	535	84,263	2037/1/31
		SPAIN GOVT	2.7	175	139	21,980	2048/10/31
	地方債証券	COMUNIDAD MADRID	4.3	220	224	35,347	2026/9/15
	普通社債券	BANCO SANTANDER SA	0.1	300	224	35,399	2032/2/27
ベルギー	特殊債券 (除く金融債)	ING BELGIUM SA	0.625	500	473	74,608	2025/5/30
ルクセンブルク	普通社債券	LOGICOR FINANCING SARL	1.625	115	85	13,522	2030/1/17
アイルランド	国債証券	IRISH GOVT	—	745	591	93,182	2031/10/18
その他	国債証券	MEXICAN UTD STS	2.375	310	271	42,788	2030/2/11
	地方債証券	QUEBEC PROVINCE	0.875	935	898	141,480	2025/1/15
	普通社債券	CHANNEL LINK ENT	2.706	125	114	17,981	2050/6/30
		CREDIT SUISSE GROUP AG	2.875	130	114	18,015	2032/4/2
	DANSKE BANK A/S	4.75	255	257	40,508	2030/6/21	
小	計					2,118,361	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UK TREASURY	2.25	90	89	16,565	2023/9/7
		UK TREASURY	0.125	475	465	85,733	2024/1/31
		UK TREASURY	3.25	195	176	32,579	2033/1/31

銘	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス	国債証券	UK TREASURY	3.25	100	80	14,839	2044/1/22
		UK TREASURY	4.25	740	691	127,342	2055/12/7
	地方債証券	ONTARIO PROVINCE	0.25	370	312	57,665	2026/12/15
	特殊債券 (除く金融債)	ASIAN DEVELOPMENT BANK	1.125	260	239	44,204	2025/6/10
	普通社債券	INTESA SANPAOLO SPA NETWORK RAIL INFRA FIN	5.148 4.75	110 90	90 89	16,743 16,504	2030/6/10 2024/1/22
小	計				412,179		
スウェーデン	国債証券	SWEDEN GOVT	2.5	2,000	1,968	26,143	2025/5/12
		KOMMUNINVEST	1.0	390	370	4,925	2025/5/12
	小	計				31,068	
ノルウェー	地方債証券	CITY OF OSLO NORWAY	2.3	1,000	985	13,476	2024/3/14
		CITY OF OSLO NORWAY	2.35	1,000	971	13,294	2024/9/4
	特殊債券 (除く金融債)	KFW	1.25	3,660	3,656	50,018	2023/8/28
小	計				76,790		
オーストラリア	特殊債券 (除く金融債)	NEW SOUTH WALES TREASURY	3.0	355	322	30,275	2030/2/20
		QUEENSLAND TREASURY CORP	2.75	1,490	1,415	132,830	2027/8/20
小	計				163,105		
南アフリカ	国債証券	SOUTH AFRICA GOVT	7.0	22,390	18,106	141,776	2031/2/28
小	計				141,776		
中国オフショア	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.5	2,000	2,003	39,842	2026/9/27
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.69	2,910	2,935	58,372	2032/8/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.88	4,050	4,156	82,641	2033/2/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	3.32	960	1,038	20,650	2052/4/15
小	計				201,507		
合	計				6,496,998		

(注) 評価額(邦貨換算金額)は、期末の評価額(外貨建金額)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) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等によりデータを入手しています。

○投資信託財産の構成

(2023年8月24日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 6,496,998	% 97.7
コール・ローン等、その他	155,135	2.3
投資信託財産総額	6,652,133	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産(6,638,864千円)の投資信託財産総額(6,652,133千円)に対する比率は99.8%です。

(注) 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、当期末における邦貨換算レートは1オフショア人民元=19.8831円、1米ドル=144.86円、1カナダドル=107.10円、1メキシコペソ=8.6286円、1ユーロ=157.49円、1英ポンド=184.26円、1スウェーデンクローナ=13.28円、1ノルウェークローネ=13.68円、1オーストラリアドル=93.83円、1南アフリカランド=7.83円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年8月24日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	12,870,261,333
コール・ローン等	107,823,724
公社債(評価額)	6,496,998,276
未収入金	6,218,356,940
未収利息	42,492,594
前払費用	4,589,799
(B) 負債	6,544,247,624
未払金	6,544,247,379
未払利息	38
その他未払費用	207
(C) 純資産総額(A-B)	6,326,013,709
元本	3,508,935,483
次期繰越損益金	2,817,078,226
(D) 受益権総口数	3,508,935,483口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,028円

(注) 期首元本額は3,538,045,928円、期中追加設定元本額は8,493,922円、期中一部解約元本額は37,604,367円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、【元本の内訳】の通りです。

【元本の内訳】

ALAMCO 年金グローバル ボンドファンド(適格機関投資家専用)	2,315,179,212円
朝日Nvest グローバル ボンドオープン	1,193,756,271円

○損益の状況 (2023年2月25日～2023年8月24日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	91,311,981
受取利息	91,219,027
その他収益金	100,942
支払利息	△ 7,988
(B) 有価証券売買損益	△ 234,213,637
売買益	656,742,684
売買損	△ 890,956,321
(C) 保管費用等	△ 487,491
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 143,389,147
(E) 前期繰越損益金	2,985,356,928
(F) 追加信託差損益金	7,506,078
(G) 解約差損益金	△ 32,395,633
(H) 計(D+E+F+G)	2,817,078,226
次期繰越損益金(H)	2,817,078,226

(注) (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) (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) (G)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。