

受益者のみなさまへ

毎々、格別のお引き立てにあずかり、厚くお礼申し上げます。
さて、「フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)」と「フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Bコース(ダイワ投資一任専用)」は、第7期の決算を行いました。当ファンドは、主として世界各国の投資適格債券に投資し、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を目的に運用を行いました。ここに、運用状況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
(全体版)

第7期(決算日 2023年6月15日)
計算期間(2022年6月16日～2023年6月15日)

■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／内外／債券 | | | | |
| 信託期間 | 原則無期限です。 | | | | |
| 運用方針 | <ul style="list-style-type: none">●フィデリティ・外国債券・マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界各国の投資適格債券(除く日本円)を主要な投資対象とし、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を目的に運用を行います。●先進国を中心とした世界各国通貨建て(日本円を除く)の公社債(国債、政府機関債、社債等)に主として投資を行います。●FILインベストメンツ・インターナショナルおよびFIL(ルクセンブルグ)・エスエイに、運用の指図に関する権限を委託します。 | | | | |
| 主要運用対象 | <table><tr><td>ベビーフンド</td><td>フィデリティ・外国債券・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。</td></tr><tr><td>マザーファンド</td><td>世界各国の投資適格債券(除く日本円)を主要な投資対象とします。</td></tr></table> | ベビーフンド | フィデリティ・外国債券・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。 | マザーファンド | 世界各国の投資適格債券(除く日本円)を主要な投資対象とします。 |
| ベビーフンド | フィデリティ・外国債券・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。 | | | | |
| マザーファンド | 世界各国の投資適格債券(除く日本円)を主要な投資対象とします。 | | | | |
| 組入制限 | <table><tr><td>ベビーフンド</td><td>株式への実質的な直接投資は、原則として行ないません。ただし、転換社債の転換ならびに新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使等により取得したものを除きます。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</td></tr><tr><td>マザーファンド</td><td>公社債への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</td></tr></table> | ベビーフンド | 株式への実質的な直接投資は、原則として行ないません。ただし、転換社債の転換ならびに新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使等により取得したものを除きます。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 | マザーファンド | 公社債への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 |
| ベビーフンド | 株式への実質的な直接投資は、原則として行ないません。ただし、転換社債の転換ならびに新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使等により取得したものを除きます。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 | | | | |
| マザーファンド | 公社債への投資割合には制限を設けません。 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(原則毎年6月15日。同日が休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 <ul style="list-style-type: none">●分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。●収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。●留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 | | | | |

フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用)／ Bコース(ダイワ投資一任専用)

〈お問合せ先〉

フィデリティ投信株式会社 カスタマー・コミュニケーション部
東京都港区六本木七丁目7番7号 TRI-SEVEN ROPPONGI

 **0120-00-8051** (無料)

受付時間: 営業日の午前9時～午後5時

 <https://www.fidelity.co.jp/>

お客様の口座内容などに関するご照会は、お申し込みされた販売会社にお尋ねください。

フィデリティ投信株式会社



《フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Aコース（ダイワ投資一任専用）》

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 債組入比率 | 債先物比率 | 純資産額 |
|----------------|--------|----------|------------|-------|-------|--------|
| | (分配落) | 税金 分配 | 込金 期騰落率 | | | |
| | 円 | 円 | % | % | % | 百万円 |
| 3期(2019年6月17日) | 10,216 | 0 | 5.2 | 100.8 | 9.9 | 1,712 |
| 4期(2020年6月15日) | 11,045 | 0 | 8.1 | 97.2 | 3.2 | 3,498 |
| 5期(2021年6月15日) | 11,009 | 0 | △0.3 | 94.4 | — | 9,754 |
| 6期(2022年6月15日) | 9,578 | 0 | △13.0 | 94.8 | 0.5 | 11,238 |
| 7期(2023年6月15日) | 9,305 | 0 | △2.9 | 100.6 | 1.1 | 9,973 |

(注1) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークは設定しておりません。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債組入比率」「債先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債先物比率＝買建比率－売建比率。

■当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | 債組入比率 | 債先物比率 |
|--------------------|------------|--------|-----------|----------|
| | 騰落率 | 騰落率 | | |
| (期首) 2022年6月15日 | 円 9,578 | % — | % 94.8 | % 0.5 |
| 6月末 | 9,713 | 1.4 | 98.5 | 0.5 |
| 7月末 | 10,046 | 4.9 | 93.1 | 0.4 |
| 8月末 | 9,719 | 1.5 | 97.2 | 0.4 |
| 9月末 | 9,283 | △3.1 | 95.7 | 0.4 |
| 10月末 | 9,273 | △3.2 | 97.6 | 0.4 |
| 11月末 | 9,484 | △1.0 | 91.8 | 0.4 |
| 12月末 | 9,367 | △2.2 | 92.7 | 0.4 |
| 2023年1月末 | 9,551 | △0.3 | 93.2 | 0.2 |
| 2月末 | 9,340 | △2.5 | 98.0 | 0.2 |
| 3月末 | 9,452 | △1.3 | 93.0 | 0.2 |
| 4月末 | 9,438 | △1.5 | 94.7 | 0.2 |
| 5月末 | 9,344 | △2.4 | 96.8 | 1.1 |
| (期末) 2023年6月15日 | 9,305 | △2.9 | 100.6 | 1.1 |

(注) 騰落率は期首比です。

《フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Bコース（ダイワ投資一任専用）》

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純資産額 |
|----------------|-------------|----------|-----------|------------|----------|------------|
| | (分配落) | 税金 分配 | 込金 期騰落 | | | |
| 3期(2019年6月17日) | 円 11,374 | 円 0 | % 3.8 | % 100.3 | % 9.8 | 百万円 560 |
| 4期(2020年6月15日) | 12,338 | 0 | 8.5 | 97.2 | 3.2 | 930 |
| 5期(2021年6月15日) | 13,222 | 0 | 7.2 | 94.4 | — | 3,373 |
| 6期(2022年6月15日) | 13,348 | 0 | 1.0 | 92.2 | 0.5 | 6,360 |
| 7期(2023年6月15日) | 14,097 | 0 | 5.6 | 99.3 | 1.1 | 7,775 |

(注1) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマークは設定しておりません。
 (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＝買建比率－売建比率。

■当期中の基準価額と市況等の推移

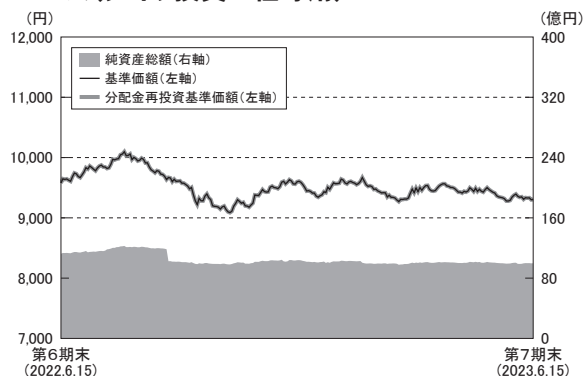
| 年月日 | 基準価額 | | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|--------------------|-------------|--------|-----------|----------|
| | 騰落率 | 騰落率 | | |
| (期首) 2022年6月15日 | 円 13,348 | % — | % 92.2 | % 0.5 |
| 6月末 | 13,722 | 2.8 | 94.5 | 0.5 |
| 7月末 | 13,924 | 4.3 | 93.8 | 0.4 |
| 8月末 | 13,767 | 3.1 | 92.5 | 0.4 |
| 9月末 | 13,582 | 1.8 | 93.7 | 0.3 |
| 10月末 | 13,949 | 4.5 | 95.2 | 0.4 |
| 11月末 | 13,618 | 2.0 | 95.6 | 0.4 |
| 12月末 | 13,067 | △2.1 | 93.8 | 0.4 |
| 2023年1月末 | 13,311 | △0.3 | 93.3 | 0.2 |
| 2月末 | 13,470 | 0.9 | 93.9 | 0.2 |
| 3月末 | 13,555 | 1.6 | 93.8 | 0.2 |
| 4月末 | 13,666 | 2.4 | 93.3 | 0.2 |
| 5月末 | 14,009 | 5.0 | 96.0 | 1.1 |
| (期末) 2023年6月15日 | 14,097 | 5.6 | 99.3 | 1.1 |

(注) 騰落率は期首比です。

■運用経過の説明

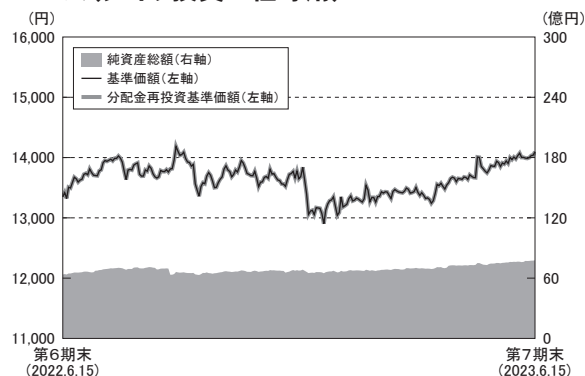
●基準価額等の推移

Aコース(ダイワ投資一任専用)



第7期首: 9,578円
第7期末: 9,305円(既払分配金0円)
騰落率: -2.9%(分配金再投資ベース)

Bコース(ダイワ投資一任専用)



第7期首: 13,348円
第7期末: 14,097円(既払分配金0円)
騰落率: 5.6%(分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、2022年6月15日の値をファンドの基準価額と同一になるように指数化しています。

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金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。
- * 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。従って、お客様の損益の状況を示すものではありません。

※当ファンドは、運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマーク及び参考指数は設定しておりません。

●基準価額の主な変動要因

Aコース(為替ヘッジ付き)

当期における当ファンドの騰落率は-2.9%でした。

米国、ユーロ圏(ドイツ)、英国などの長期金利の上昇は、ファンドの基準価額に対してマイナスに作用しました。社債の спреッド(上乗せ利回り)は、周期的に拡大縮小を繰り返しながらも、期を通してみると、小幅に縮小し、ファンドの基準価額に対してプラスに作用しました。

なお、Aコースは、為替ヘッジを行うため、為替相場の変動による影響は抑制されますが、為替ヘッジのためのコストがかかります。

Bコース(為替ヘッジなし)

当期における当ファンドの騰落率は+5.6%でした。

米国、ユーロ圏(ドイツ)、英国などの長期金利の上昇は、ファンドの基準価額に対してマイナスに作用しました。社債の спреッド(上乗せ利回り)は、周期的に拡大縮小を繰り返しながらも、期を通してみると、小幅に縮小し、ファンドの基準価額に対してプラスに作用しました。

なお、Bコースは、為替ヘッジを行っておりませんので、為替相場の変動が基準価額に反映されます。当期は、日本円が対米ドル、ユーロ、英ポンドで円安となったことから、為替市場動向は、基準価額に対してプラスに作用しました。

両コースともに、フィデリティ・外国債券・マザーファンド受益証券を組み入れることにより実質的な運用を当該マザーファンドにおいて行っています。

●投資環境

当期は、インフレ高進と各国・地域の金融当局による金融政策動向、地政学リスクおよび景況感の行方などに注目が集まりました。

米国債券市場では、インフレ抑制姿勢を強めていた米連邦準備制度理事会(FRB)の動向と、金融政策動向の景気への影響を織り込む投資家心理の変化が、周期的な長期金利動向につながりました。期初は、3月に引き続き、5月、6月、7月と連続で利上げが行われ、インフレ高進と引き締め加速が長期金利上昇圧力となりました。ウクライナ情勢の長期化や米中関係の緊張の高まりなどが、急速な利上げによる景気悪化懸念を強めるとの見方にもつながり、6月中旬から7月下旬には、一旦、長期金利が低下する局面がみられました。しかし、金融当局の利上げ継続姿勢が確認されたことにより、その後の金利上昇圧力となりました。10月後半になると、インフレ率上昇に鈍化の兆しが見え始めてきたことから、利上げ鈍化観測が強まり、長期金利は低下に転じました。米国の中長期的な景気減速懸念も材料視され始めました。2月になると、労働市場の堅調さなどにより米景気の底堅さが示されたことや、金融当局のインフレ抑制姿勢が再確認されたことなどが、再び金利上昇圧力となりました。しかしながら、3月に米欧金融機関の破綻や経営不安が金融システム不安につながり、金利低下が進みました。その後は、米国の追加利上げ観測などが金利上昇圧力となりました。期を通してみると、米10年国債利回りは上昇しました。

欧州債券市場では、ウクライナ情勢の長期化が不確実性とインフレ高進の蓋然性を高めました。7月には、6月に示唆していた水準を超える0.50%の利上げに動くなど、高止まりするインフレへの対処を強めました。その後も、地政学リスクの影響が大きいことなども考慮し、欧州中央銀行(ECB)は、インフレ抑制を優先する姿勢を強め、利上げを継続しました。12月になると、米国には遅れながらも、インフレ率上昇圧力の鈍化がみられ始め、景気減速懸念が強まり始めたものの、ECBの引き締め姿勢継続が、長期金利の上昇圧力につながりました。英国では、インフレ抑制対応から、2021年12月から利上げサイクルとなりました。エネルギー価格高騰の産業に与える影響が強く意識されたことや首相交代などによる政治的な混乱などにより、9月から10月にかけては、長期金利の大幅な上昇がみられました。その後は、他地域同様、インフレ抑制姿勢を維持している金融当局の金融政策と景況感との綱引きによる金利動向となりました。3月になると、米欧金融機関の破綻や経営不安が、金融システム不安の懸念を高め、欧州市場においても、リスク回避の動きが強まり、金利低下圧力となりました。その後は、英国などで追加利上げ観測が強まり、金利上昇圧力につながりました。期を通してみると、ドイツおよび英国の10年国債利回りは共に上昇しました。

投資適格社債市場は、ウクライナ情勢の悪化やインフレ高進に伴う金融引き締めの加速などから、投資適格社債のスプレッド(上乘せ利回り)は拡大する動きとなりました。7月に入ると、急速な金融引き締め加速観測の後退から、一旦、リスク資産が買い戻されたものの、8月後半に、米金融当局がインフレ抑制を最優先とする姿勢を明確にしたことから、スプレッドは再び拡大傾向となりました。10月後半になると、米国でインフレ率上昇に鈍化の兆しが見え始めてきたことなどが、投資家心理の改善につながり、スプレッドは縮小に転じました。米労働市場に堅調さが示されるなど、米国経済が総じて底堅さを示していたことも、リスク資産の買い戻しの動きを下支えしました。しかしながら、3月に米欧金融機関の破綻や経営不安が金融システム不安につながると、リスク回避の動きが急速に高まり、スプレッドの急拡大につながりました。その後は、落ち着きを取り戻し、期末に向けてスプレッドが縮小する動きとなりました。期を通してみると、投資適格社債のスプレッドは小幅に縮小しました。

●ポートフォリオ

当ファンドは、フィデリティ・外国債券・マザーファンド受益証券を組み入れることにより、実質的な運用を当該マザーファンドにおいて行っています。

フィデリティ・外国債券・マザーファンドは、主として世界各国の投資適格債券(除く日本円)に投資し、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を目的に運用を行います。

運用にあたっては、マクロ経済分析に加え、社内のクオンツ(計量分析)アナリスト、クレジット(信用分析)アナリストの調査・分析に基づいて、全体の資産配分や個別銘柄の選択を行います。

以下、当期の運用経過については、フィデリティ・外国債券・マザーファンドについて記載しています。

当期においては、世界経済はコロナ禍からの回復基調がみられる一方、インフレとそれに伴う金融引き締め動向が、経済に不確実性をもたらす要因にもなり、米国を除くグローバル経済環境は力強さに欠ける状況となりました。先行きに対する不確実性要因が徐々に強まるとの判断もあり、グローバル経済に対する見通しは、慎重姿勢を維持しました。期を通して、国債を選好し、社債への配分は市場の投資家心理の動向などを注視し、選択的に行いました。また、銘柄選択においては、新発債の妙味に注目しました。

●ベンチマークとの差異

当ファンドは、運用方針に対し、適切に比較できる指数がないためベンチマーク及び参考指数は設定しておりません。

■分配金

Aコース(ダイワ投資一任専用)

当期の分配金は、長期的な投資信託財産の成長を追求する観点から無分配とさせていただきます。また、収益分配に充てなかった利益につきましては投資信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

●分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり・税引前)

| 項目 | 第7期 | |
|-----------|-----------------------|--|
| | 2022年6月16日～2023年6月15日 | |
| 当期分配金 | 0 | |
| (対基準価額比率) | -% | |
| 当期の収益 | - | |
| 当期の収益以外 | - | |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,594 | |

Bコース(ダイワ投資一任専用)

当期の分配金は、長期的な投資信託財産の成長を追求する観点から無分配とさせていただきます。また、収益分配に充てなかった利益につきましては投資信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

●分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり・税引前)

| 項目 | 第7期 | |
|-----------|-----------------------|--|
| | 2022年6月16日～2023年6月15日 | |
| 当期分配金 | 0 | |
| (対基準価額比率) | -% | |
| 当期の収益 | - | |
| 当期の収益以外 | - | |
| 翌期繰越分配対象額 | 4,096 | |

* 「当期の収益」および「当期の収益以外」は円未満切捨てのため、合計額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

* 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)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

* 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」が当該決算期末日時点の基準価額を上回ることがありますが、実際には基準価額を超えて分配金が支払われることはありません。

■今後の運用方針

当ファンドにつきましては、引き続きフィデリティ・外国債券・マザーファンド受益証券を組み入れることにより、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。

米国債券市場では、堅調な労働市場を背景とした底堅い経済状況が続いているものの、企業景況感の悪化やインフレ圧力に鈍化の兆しがみられることから、市場では今後の利上げ停止時期に注目が集まっています。しかしながら、米連邦準備制度理事会(FRB)は、インフレ動向の不確実性などを考慮し利上げを続ける可能性もあり、中央銀行と市場の見通しの乖離から当面は長期金利の変動が大きくなる可能性があります。今後について、インフレ抑制が思うように進まないリスクや、一部の金融機関の経営不安などが先行きの不確実性要因となっており、そのような要因の影響および動向を注意深く見ていきます。

ユーロ圏では、高インフレなどを背景に、金融政策動向への注目が集まっています。欧州中央銀行(ECB)は、景気下振れを想定しながらも、インフレ抑制姿勢を強めています。英国も、継続的な利上げにより、インフレ抑制姿勢を維持しています。ウクライナ情勢の長期化は、エネルギー価格の上昇など欧州地域に直接的な影響を与えており、地域全般の大きな不確実性要因となっています。したがって、欧州地域では、金融政策と景気のバランスなど難しいかじ取りを強いられています。インフレ抑制が想定通り進まないリスクも残るため、動向を注意深く見ていく必要があります。

投資適格社債市場は、高い信用力を背景に、クレジット資産の中においては相対的な安定性を維持するものとみています。先進国の金融引き締め継続は、短期的な金利上昇圧力となる一方、中長期的には、利上げによる景気抑制圧力の影響などにより、景気減速リスクの高まりにつながるものとみています。地政学リスクなどによりインフレ抑制が想定通り進まないリスクが残る中、足元では金融システム不安も懸念されるため、企業ファンダメンタルズに与える影響などに注意を払います。金融当局と市場参加者の先行き見通しにばらつきがみられるなど難しい市場環境下、投資家心理の変化によるボラティリティにも配慮し、流動性の確保と相対価値を重視した機動的な投資機会を探る方針です。

《フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Aコース（ダイワ投資一任専用）》

■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用明細

| 項目 | 第7期 | | 項目の概要 |
|---------------------------|-----------------------|------------------|--|
| | 2022年6月16日～2023年6月15日 | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 53円 | 0.555% | (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9,521円です。 |
| （投信会社） | (39) | (0.412) | 委託した資金の運用の対価 |
| （販売会社） | (10) | (0.110) | 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及び事務手続き等の対価 |
| （受託会社） | (3) | (0.033) | 運用財産の保管・管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) 売買委託手数料 （先物・オプション） | 0 (0) | 0.000 (0.000) | (b) 売買委託手数料＝ $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (c) 有価証券取引税 | — | — | (c) 有価証券取引税＝ $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (d) その他費用 | 4 | 0.042 | (d) その他費用＝ $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ |
| （保管費用） | (1) | (0.011) | 保管費用は、有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等のために、海外における保管銀行等に支払う費用。また、信託事務の諸費用等が含まれます。 |
| （監査費用） | (1) | (0.015) | 監査費用は、ファンドの監査人等に対する報酬及び費用 |
| （その他） | (2) | (0.016) | その他には、法定書類等（有価証券届出書、目論見書、運用報告書等）の作成、印刷、提出等に係る費用や法律顧問、税務顧問に対する報酬及び費用等が含まれます。 |
| 合計 | 57 | 0.597 | |

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）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、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、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、このファンドに対応するものを含みます。

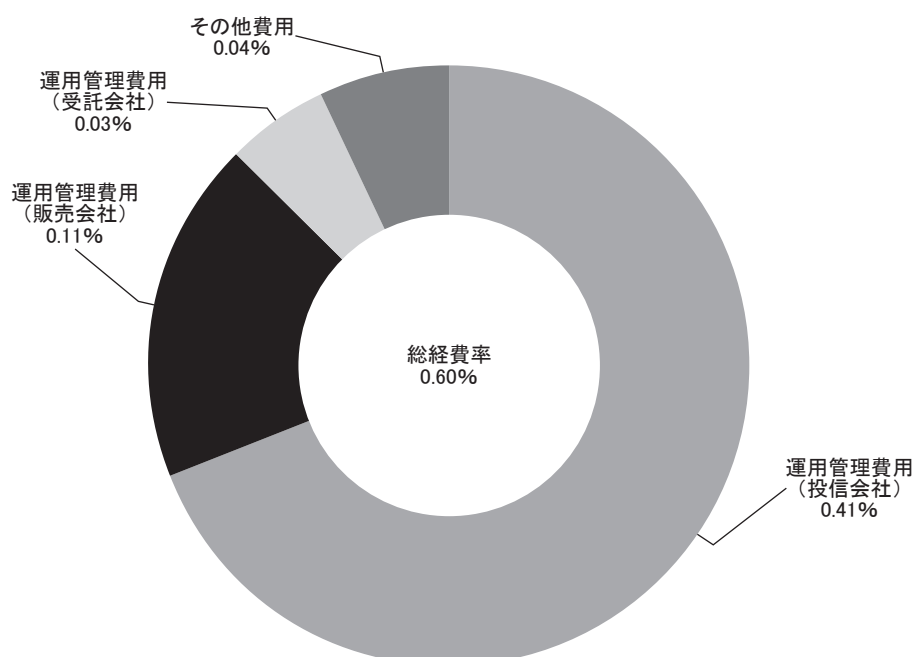
(注2) 「金額」欄は、各項目毎に円未満を四捨五入しています。

(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、売買委託手数料及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0.60%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、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3) その他費用には、保管費用、監査費用以外に法定書類等（有価証券届出書、目論見書、運用報告書等）の作成、印刷、提出等に係る費用や法律顧問、税務顧問に対する報酬及び費用等が含まれます。

(注4) 各比率は、年率換算した値です。

(注5) 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。

■売買及び取引の状況 (2022年6月16日から2023年6月15日まで)

●親投資信託受益証券の設定、解約の状況

| | 設 定 | | 解 約 | |
|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| フィデリティ・外国債券・マザーファンド | 千口 1,361,173 | 千円 3,868,477 | 千口 2,097,854 | 千円 5,960,182 |

(注) 金額の単位未満は切捨て。

●スワップ及び先渡取引状況

| 種 類 | 当 期 | |
|---------------|--------------|--------------|
| | 取 引 契 約 金 額 | |
| | 買 建 | 売 建 |
| 直物為替先渡取引(NDF) | 百万円 2,798 | 百万円 2,768 |

(注) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等 (2022年6月16日から2023年6月15日まで)

期中における当ファンドに係る利害関係人との取引はありません。

(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 (2023年6月15日現在)

●親投資信託残高

| 種 類 | 期首(前期末) | | |
|---------------------|-----------------|-----------------|------------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| フィデリティ・外国債券・マザーファンド | 千口 4,178,205 | 千口 3,441,525 | 千円 10,105,350 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

●スワップ及び先渡取引残高

| 種 類 | 取 引 契 約 残 高 | |
|---------------|-----------------|------------|
| | 当 期 末 想 定 元 本 額 | |
| | 買 建 | 売 建 |
| 直物為替先渡取引(NDF) | 百万円 - | 百万円 221 |

(注) 金額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

(2023年6月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| フィデリティ・外国債券・マザーファンド | 千円 10,105,350 | % 99.7 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 32,476 | 0.3 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 10,137,827 | 100.0 |

(注1) 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、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=140.39円、1カナダ・ドル=105.30円、1オーストラリア・ドル=95.37円、1香港・ドル=17.93円、1シンガポール・ドル=104.58円、1ニュージーランド・ドル=86.93円、1イギリス・ポンド=177.72円、1デンマーク・クローネ=20.42円、1ノルウェー・クローネ=13.16円、1スウェーデン・クローナ=13.09円、1メキシコ・ペソ=8.185円、100インドネシア・ルピア=0.95円、1チェコ・コルナ=6.395円、100韓国・ウォン=11.02円、1オフショア・人民元=19.553円、1マレーシア・リンギット=30.359円、1南アフリカ・ランド=7.66円、1ポーランド・ズロチ=34.16円、1ユーロ=152.15円です。

(注2) フィデリティ・外国債券・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(93,675,579千円)の投資信託財産総額(110,100,587千円)に対する比率は、85.1%です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■特定資産の価格等の調査について

調査を行った者の氏名又は名称

有限責任監査法人トーマツ

調査の結果及び方法の概要

調査依頼を行った取引は2022年6月16日から2023年6月15日までの間でノンデリバラブルフォワード(以下「NDF」という。)取引90件でした。これらのNDF取引について、「投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)」第11条第2項に基づいて比較可能なレートのほか、現地約定日、取引の相手方の名称、約定通貨、決済通貨、約定金額(約定通貨建)、約定金額(決済通貨建)、売買の別及び決済日に関して、有限責任監査法人トーマツに調査を委託し、日本公認会計士協会が公表した専門業務実務指針4460「投資信託及び投資法人における特定資産の価格等の調査に係る合意された手続業務に関する実務指針」に基づく調査結果として合意された手続実施結果報告書を入手しています。

なお、本調査は財務諸表監査の一部ではなく、また価格の妥当性や内部管理体制について保証を提供するものではありません。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年6月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 19,946,597,243 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 146 |
| フィデリティ・外国債券・マザーファンド(評価額) | 10,105,350,703 |
| 未 収 入 金 | 9,841,246,394 |
| (B) 負 債 | 9,973,053,334 |
| 未 払 金 | 9,943,685,885 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 27,872,197 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 1,495,252 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A-B) | 9,973,543,909 |
| 元 本 | 10,718,796,896 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △745,252,987 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 10,718,796,896口 |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D) | 9,305円 |

(注1) 当期における期首元本額11,733,712,751円、期中追加設定元本額3,066,692,091円、期中一部解約元本額4,081,607,946円です。

(注2) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

■損益の状況

当期 自2022年6月16日 至2023年6月15日

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------|-----------------|
| (A) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △225,424,851 |
| 売 買 益 | 2,515,955,019 |
| 売 買 損 | △2,741,379,870 |
| (B) 先 物 取 引 等 損 益 | 4,278,892 |
| 取 引 益 | 60,380,321 |
| 取 引 損 | △56,101,429 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △61,367,353 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A+B+C) | △282,513,312 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △1,001,368,167 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 538,628,492 |
| (配 当 等 相 当 額) | (1,249,798,822) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△711,170,330) |
| (G) 合 計 (D+E+F) | △745,252,987 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G) | △745,252,987 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 538,628,492 |
| (配 当 等 相 当 額) | (1,255,455,389) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△716,826,897) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 453,409,605 |
| 繰 越 損 益 金 | △1,737,291,084 |

(注1) (A)有価証券売買損益および(B)先物取引等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) 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、純資産総額に対して年0.23%以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

(注5) 分配金の計算過程は以下の通りです。

| | 当 期 |
|------------------------------|----------------|
| (a) 費用控除後の配当等収益 | 233,637,766円 |
| (b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 | 0円 |
| (c) 収益調整金 | 1,255,455,389円 |
| (d) 分配準備積立金 | 219,771,839円 |
| (e) 分配可能額(a+b+c+d) | 1,708,864,994円 |
| 1 万 口 当 たり 分 配 可 能 額 | 1,594.27円 |
| (f) 分配金額 | 0円 |
| 1 万 口 当 たり 分 配 金 額 (税 引 前) | 0円 |

<お知らせ>

●2022年9月1日付で当ファンドのマザーファンドの投資信託約款について、運用の指図に関する権限の委託先にFIL(ルクセンブルグ)・エスエイを追加いたしました。

《フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Bコース（ダイワ投資一任専用）》

■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用明細

| 項目 | 第7期 | | 項目の概要 |
|---------------------------|-----------------------|------------------|--|
| | 2022年6月16日～2023年6月15日 | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 76円 | 0.555% | (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13,639円です。 |
| （投信会社） | (56) | (0.412) | 委託した資金の運用の対価 |
| （販売会社） | (15) | (0.110) | 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及び事務手続き等の対価 |
| （受託会社） | (5) | (0.033) | 運用財産の保管・管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) 売買委託手数料 （先物・オプション） | 0 (0) | 0.000 (0.000) | (b) 売買委託手数料＝ $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (c) 有価証券取引税 | — | — | (c) 有価証券取引税＝ $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (d) その他費用 | 5 | 0.035 | (d) その他費用＝ $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ |
| （保管費用） | (2) | (0.012) | 保管費用は、有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等のために、海外における保管銀行等に支払う費用。また、信託事務の諸費用等が含まれます。 |
| （監査費用） | (1) | (0.006) | 監査費用は、ファンドの監査人等に対する報酬及び費用 |
| （その他） | (2) | (0.018) | その他には、法定書類等（有価証券届出書、目論見書、運用報告書等）の作成、印刷、提出等に係る費用や法律顧問、税務顧問に対する報酬及び費用等が含まれます。 |
| 合計 | 81 | 0.590 | |

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）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、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、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、このファンドに対応するものを含みます。

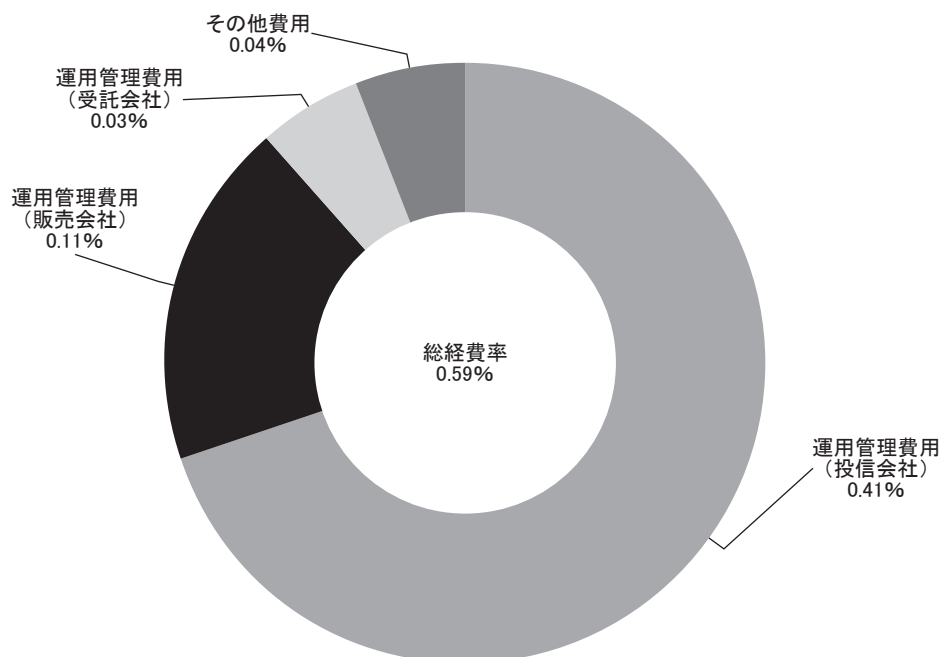
(注2) 「金額」欄は、各項目毎に円未満を四捨五入しています。

(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、売買委託手数料及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0.59%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、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3) その他費用には、保管費用、監査費用以外に法定書類等（有価証券届出書、目論見書、運用報告書等）の作成、印刷、提出等に係る費用や法律顧問、税務顧問に対する報酬及び費用等が含まれます。

(注4) 各比率は、年率換算した値です。

(注5) 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6月16日から2023年6月15日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|---------------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| フィデリティ・外国債券・マザーファンド | 千口 918,312 | 千円 2,603,417 | 千口 571,084 | 千円 1,620,407 |

(注) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等 (2022年6月16日から2023年6月15日まで)

期中における当ファンドに係る利害関係人との取引はありません。

(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 (2023年6月15日現在)

●親投資信託残高

| 種 類 | 期首 (前期末) | | 当 期 末 | |
|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 評 価 額 |
| フィデリティ・外国債券・マザーファンド | 千口 2,300,652 | 千円 7,774,970 | 千口 2,647,880 | 千円 7,774,970 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

(2023年6月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|---------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| フィデリティ・外国債券・マザーファンド | 千円 7,774,970 | % 99.7 |
| コール・ローン等、その他 | 22,195 | 0.3 |
| 投資信託財産総額 | 7,797,165 | 100.0 |

(注1) 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、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=140.39円、1カナダ・ドル=105.30円、1オーストラリア・ドル=95.37円、1香港・ドル=17.93円、1シンガポール・ドル=104.58円、1ニュージーランド・ドル=86.93円、1イギリス・ポンド=177.72円、1デンマーク・クローネ=20.42円、1ノルウェー・クローネ=13.16円、1スウェーデン・クローナ=13.09円、1メキシコ・ペソ=8.185円、100インドネシア・ルピア=0.95円、1チェコ・コルナ=6.395円、100韓国・ウォン=11.02円、1オフショア・人民元=19.553円、1マレーシア・リンギット=30.359円、1南アフリカ・ランド=7.66円、1ポーランド・ズロチ=34.16円、1ユーロ=152.15円です。

(注2) フィデリティ・外国債券・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建資産(93,675,579千円)の投資信託財産総額(110,100,587千円)に対する比率は、85.1%です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年6月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 7,797,165,768 円 |
| コール・ローン等 | 1,721,028 |
| フィデリティ・外国債券・マザーファンド(評価額) | 7,774,970,689 |
| 未 収 入 金 | 20,474,051 |
| (B) 負 債 | 21,970,510 |
| 未 払 解 約 金 | 1,721,028 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 19,492,327 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 757,155 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A-B) | 7,775,195,258 |
| 元 本 | 5,515,634,805 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 2,259,560,453 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 5,515,634,805口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 14.097円 |

(注1) 当期における期首元本額4,765,205,104円、期中追加設定元本額2,216,707,061円、期中一部解約元本額1,466,277,360円です。

(注2) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

■損益の状況

当期 自2022年6月16日 至2023年6月15日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|-----------------|
| (A) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 391,121,722 円 |
| 売 買 損 益 | 434,011,994 |
| 売 買 損 益 | △42,890,272 |
| (B) 信 託 報 酬 等 | △39,799,215 |
| (C) 当 期 損 益 金 (A+B) | 351,322,507 |
| (D) 前 期 繰 越 損 益 金 | 166,263,127 |
| (E) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 1,741,974,819 |
| (配 当 等 相 当 額) | (1,008,893,650) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (733,081,169) |
| (F) 合 計 (C+D+E) | 2,259,560,453 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (F) | 2,259,560,453 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 1,741,974,819 |
| (配 当 等 相 当 額) | (1,014,813,624) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (727,161,195) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 517,585,634 |

(注1) (A)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) (B)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せん。

(注3) (E)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) 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、純資産総額に対して年0.23%以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

(注5) 分配金の計算過程は以下の通りです。

| | 当 期 |
|------------------------------|----------------|
| (a) 費用控除後の配当等収益 | 183,196,554円 |
| (b) 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 | 160,836,449円 |
| (c) 収益調整金 | 1,741,974,819円 |
| (d) 分配準備積立金 | 173,552,631円 |
| (e) 分配可能額(a+b+c+d) | 2,259,560,453円 |
| 1万口当たり分配可能額 | 4,096.65円 |
| (f) 分配金額 | 0円 |
| 1万口当たり分配金額(税引前) | 0円 |

<お知らせ>

- 2022年9月1日付で当ファンドのマザーファンドの投資信託約款について、運用の指図に関する権限の委託先にFIL(ルクセンブルグ)・エスイを追加いたしました。

<補足情報>

■フィデリティ・外国債券・マザーファンドの組入資産の明細

下記は、2023年6月15日現在におけるフィデリティ・外国債券・マザーファンド全体(31,870,414,570口)の内容です。

(1) 公社債

外国(外貨建)公社債

| 銘柄 | 2023年6月15日現在 | | | | | | 償還年月日 |
|------------------------------------|--------------|--------|----------|----------|-----------|------------|-------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 債選年月日 | |
| | | | | 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 | | |
| USTN 4.5% 11/30/24 | 国債証券 | 4.5000 | 13,050 | 12,943 | 1,817,194 | 2024/11/30 | |
| USTN 4.5% 11/15/25 | 国債証券 | 4.5000 | 5,240 | 5,234 | 734,922 | 2025/11/15 | |
| USTN 4% 02/29/28 | 国債証券 | 4.0000 | 56,630 | 56,483 | 7,929,773 | 2028/02/29 | |
| USTN 4% 02/28/30 | 国債証券 | 4.0000 | 41,380 | 41,500 | 5,826,301 | 2030/02/28 | |
| USTN 4.125% 11/15/32 | 国債証券 | 4.1250 | 24,890 | 25,457 | 3,574,012 | 2032/11/15 | |
| USTN 3.5% 02/15/33 | 国債証券 | 3.5000 | 5,010 | 4,881 | 685,326 | 2033/02/15 | |
| USTN 3.375% 05/15/33 | 国債証券 | 3.3750 | 240 | 231 | 32,503 | 2033/05/15 | |
| USTB 3.375% 08/15/42 | 国債証券 | 3.3750 | 5,660 | 5,119 | 718,714 | 2042/08/15 | |
| USTB 3.875% 02/15/43 | 国債証券 | 3.8750 | 3,520 | 3,418 | 479,965 | 2043/02/15 | |
| USTB 1.875% 11/15/51 | 国債証券 | 1.8750 | 6,200 | 4,047 | 568,252 | 2051/11/15 | |
| USTB 3% 08/15/52 | 国債証券 | 3.0000 | 3,480 | 2,933 | 411,853 | 2052/08/15 | |
| USTB 4% 11/15/52 | 国債証券 | 4.0000 | 10,725 | 10,936 | 1,535,314 | 2052/11/15 | |
| USTB 3.625% 02/15/53 | 国債証券 | 3.6250 | 5,175 | 4,929 | 692,008 | 2053/02/15 | |
| EDF 5.7% 05/23/28 144A | 特殊債券 | 5.7000 | 425 | 425 | 59,715 | 2028/05/23 | |
| EDF 6.25% 05/23/33 144A | 特殊債券 | 6.2500 | 525 | 528 | 74,198 | 2033/05/23 | |
| UMBS 15YR 2.5% 07/38 #TBA | 特殊債券 | 2.5000 | 9,725 | 8,892 | 1,248,437 | 2038/07/01 | |
| UMBS 30YR 2.5% 07/53 #TBA | 特殊債券 | 2.5000 | 9,175 | 7,776 | 1,091,736 | 2053/07/01 | |
| GNII II 3.5% 07/53 #TBA | 特殊債券 | 3.5000 | 16,485 | 15,191 | 2,132,746 | 2053/07/01 | |
| UMBS 30YR 3% 07/53 #TBA | 特殊債券 | 3.0000 | 20,425 | 17,981 | 2,524,373 | 2053/07/01 | |
| UMBS 30YR 5% 07/53 #TBA | 特殊債券 | 5.0000 | 3,950 | 3,877 | 544,375 | 2053/07/01 | |
| GNII II 2.5% 07/53 #TBA | 特殊債券 | 2.5000 | 3,450 | 2,988 | 419,540 | 2053/07/01 | |
| UMBS 30YR 2% 07/53 #TBA | 特殊債券 | 2.0000 | 5,550 | 4,525 | 635,307 | 2053/07/01 | |
| GNII II 3% 07/53 #TBA | 特殊債券 | 3.0000 | 15,250 | 13,625 | 1,912,936 | 2053/07/01 | |
| ELECTRICI 9.125%/VAR PERP 144A | 特殊債券 | 9.1250 | 771 | 791 | 111,082 | 2049/12/31 | |
| BPCE 4.625% 07/11/24 RGS | 社債券 | 4.6250 | 450 | 439 | 61,635 | 2024/07/11 | |
| HCA INC 5.375% 02/01/25 | 社債券 | 5.3750 | 2,500 | 2,475 | 347,556 | 2025/02/01 | |
| NEXTERA ENE CA 6.051% 03/01/25 | 社債券 | 6.0510 | 1,740 | 1,747 | 245,314 | 2025/03/01 | |
| AIB GR 4.263%/VAR 4/10/25 144A | 社債券 | 4.2630 | 4,125 | 4,023 | 564,856 | 2025/04/10 | |
| JPMORGAN CHASE 0.824/VAR 6/25 | 社債券 | 0.8240 | 2,350 | 2,231 | 313,311 | 2025/06/01 | |
| GE HEALTHCARE 5.6% 11/15/25 | 社債券 | 5.6000 | 1,500 | 1,498 | 210,355 | 2025/11/15 | |
| SOCGEN 2.226/VAR 01/21/26 144A | 社債券 | 2.2260 | 2,535 | 2,354 | 330,485 | 2026/01/21 | |
| SOCGEN SOFR+105 01/21/26 RGS | 社債券 | 5.8785 | 1,000 | 985 | 138,317 | 2026/01/21 | |
| HCA INC 5.875% 02/15/26 | 社債券 | 5.8750 | 675 | 674 | 94,744 | 2026/02/15 | |
| MSTDW SOFR+95 02/18/26 | 社債券 | 6.0320 | 1,000 | 1,000 | 140,463 | 2026/02/18 | |
| DEERECAP FRN 5.145%/VAR 03/03/26 | 社債券 | 5.6820 | 3,150 | 3,135 | 440,150 | 2026/03/03 | |
| HYUNDAI CAP AMR 5.5% 3/26 REGS | 社債券 | 5.5000 | 500 | 497 | 69,829 | 2026/03/30 | |
| PNC FINAN 5.812/VAR 06/26 144A | 社債券 | 5.8120 | 1,080 | 1,076 | 151,098 | 2026/06/12 | |
| AIR LEASE CORP 1.875% 08/15/26 | 社債券 | 1.8750 | 2,868 | 2,527 | 354,788 | 2026/08/15 | |
| AERCAP IRELAND 2.45% 10/29/26 | 社債券 | 2.4500 | 4,050 | 3,596 | 504,938 | 2026/10/29 | |
| AIB 7.583%/VAR 10/14/26 144A | 社債券 | 7.5830 | 1,175 | 1,195 | 167,805 | 2026/10/14 | |
| ROYALBK SPRIX+59 11/02/26 | 社債券 | 5.6666 | 1,000 | 987 | 138,590 | 2026/11/02 | |
| ENERGY TRAN LP 4.2% 04/15/27 | 社債券 | 4.2000 | 1,275 | 1,212 | 170,210 | 2027/04/15 | |
| TRUIST FINAN 6.047%/VAR 6/8/27 | 社債券 | 6.0470 | 289 | 289 | 40,599 | 2027/06/08 | |
| BANK IRE 2.029/VAR 9/27 144A | 社債券 | 2.0290 | 1,475 | 1,275 | 179,097 | 2027/09/30 | |
| ENEL FIN AM 7.1% 10/14/27 144A | 社債券 | 7.1000 | 1,506 | 1,582 | 222,144 | 2027/10/14 | |
| DBSW SOFR+121.9 11/16/27 | 社債券 | 6.3115 | 2,050 | 1,891 | 265,535 | 2027/11/16 | |
| DEUTSCHE B 2.311%/VAR 11/16/27 | 社債券 | 2.3110 | 2,185 | 1,871 | 262,699 | 2027/11/16 | |
| GE HEALTHCARE 5.65% 11/15/27 | 社債券 | 5.6500 | 1,150 | 1,161 | 163,014 | 2027/11/15 | |
| AIR LEASE CORP 5.85% 12/15/27 | 社債券 | 5.8500 | 950 | 944 | 132,598 | 2027/12/15 | |
| SOCIETE GE 2.797%/VAR 1/19/28 144A | 社債券 | 2.7970 | 2,130 | 1,878 | 263,771 | 2028/01/19 | |
| NATIONWIDE B FRN 2/16/28 144A | 社債券 | 6.3825 | 4,925 | 4,800 | 673,983 | 2028/02/16 | |
| ENERGY TRAN LP 5.55% 02/15/28 | 社債券 | 5.5500 | 696 | 693 | 97,339 | 2028/02/15 | |
| AMGEN INC 5.15% 03/02/28 | 社債券 | 5.1500 | 1,541 | 1,539 | 216,109 | 2028/03/02 | |
| META PLATFORMS 4.6% 05/15/28 | 社債券 | 4.6000 | 2,650 | 2,619 | 367,710 | 2028/05/15 | |
| PFIZER 4.45% 05/19/28 | 社債券 | 4.4500 | 2,940 | 2,893 | 406,159 | 2028/05/19 | |
| HCA INC 5.2% 06/01/28 | 社債券 | 5.2000 | 1,075 | 1,056 | 148,323 | 2028/06/01 | |
| LKQ CORP 5.75% 06/15/28 144A | 社債券 | 5.7500 | 1,007 | 993 | 139,437 | 2028/06/15 | |
| BOA CORP 6.204%/VAR 11/10/28 | 社債券 | 6.2040 | 1,095 | 1,123 | 157,668 | 2028/11/10 | |
| US BANCORP DEL 4.653%/VAR 2/29 | 社債券 | 4.6530 | 1,781 | 1,699 | 238,522 | 2029/02/01 | |
| HCA INC 3.375% 03/15/29 144A | 社債券 | 3.3750 | 775 | 689 | 96,782 | 2029/03/15 | |
| HSBC HOLDINGS 6.161%/VAR 3/29 | 社債券 | 6.1610 | 868 | 877 | 123,166 | 2029/03/09 | |
| CAPITAL ONE FIN VAR 06/08/29 | 社債券 | 6.3120 | 1,031 | 1,018 | 143,026 | 2029/06/08 | |
| US BANCORP DEL VAR 06/12/29 | 社債券 | 5.7750 | 1,333 | 1,328 | 186,451 | 2029/06/12 | |
| GE HEALTHCARE 5.857% 03/15/30 | 社債券 | 5.8570 | 750 | 769 | 108,073 | 2030/03/15 | |

| 銘柄 | 2023年6月15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 | |
| | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| NEXTERA ENER CA 2.25% 06/01/30 | 社債券 | 2.2500 | 500 | 412 | 57,920 | 2030/06/01 |
| DUKE ENERGY FLD 8.125% 8/16/30 | 社債券 | 8.1250 | 402 | 449 | 63,081 | 2030/08/16 |
| MSCI INC 3.625% 09/01/30 144A | 社債券 | 3.6250 | 2,530 | 2,168 | 304,455 | 2030/09/01 |
| AIR LEASE CORP 3.125% 12/01/30 | 社債券 | 3.1250 | 350 | 289 | 40,630 | 2030/12/01 |
| COMM BK AUS 2.688% 3/31 144A | 社債券 | 2.6880 | 2,944 | 2,291 | 321,719 | 2031/03/11 |
| MSCI INC 3.625% 11/01/31 144A | 社債券 | 3.6250 | 554 | 461 | 64,841 | 2031/11/01 |
| AERCAP IRELAND 3.3% 01/30/32 | 社債券 | 3.3000 | 1,800 | 1,459 | 204,916 | 2032/01/30 |
| BOA CORP 2.651%/VAR 03/11/32 | 社債券 | 2.6510 | 790 | 647 | 90,876 | 2032/03/11 |
| HCA INC 3.625% 03/15/32 144A | 社債券 | 3.6250 | 580 | 501 | 70,409 | 2032/03/15 |
| BROADCOM 4.15% 4/15/32 144A | 社債券 | 4.1500 | 779 | 698 | 98,119 | 2032/04/15 |
| WELLTOWER INC 3.85% 06/15/32 | 社債券 | 3.8500 | 1,012 | 881 | 123,748 | 2032/06/15 |
| ASHTHEAD CAPI 5.5% 8/11/32 144A | 社債券 | 5.5000 | 952 | 905 | 127,076 | 2032/08/11 |
| ENEL FI INT 7.5% 10/14/32 144A | 社債券 | 7.5000 | 543 | 598 | 83,960 | 2032/10/14 |
| ANZ BKG GRP 6.742% 12/08/32 RE | 社債券 | 6.7420 | 1,162 | 1,193 | 167,588 | 2032/12/08 |
| ANZ BKG GRP 6.742% 12/32 144A | 社債券 | 6.7420 | 1,305 | 1,340 | 188,142 | 2032/12/08 |
| SOCGEN 3.337/VAR 1/21/33 144A | 社債券 | 3.3370 | 2,150 | 1,712 | 240,405 | 2033/01/21 |
| ORACLE CORP 4.9% 02/06/33 | 社債券 | 4.9000 | 1,071 | 1,025 | 144,035 | 2033/02/06 |
| BP CAP MARKETS 4.812% 02/13/33 | 社債券 | 4.8120 | 1,067 | 1,046 | 146,985 | 2033/02/13 |
| ASHTHEAD CAP 5.55% 5/30/33 144A | 社債券 | 5.5500 | 1,164 | 1,114 | 156,504 | 2033/05/30 |
| META PLATFORMS 4.95% 05/15/33 | 社債券 | 4.9500 | 2,475 | 2,456 | 344,880 | 2033/05/15 |
| PFIZER 4.75% 05/19/33 | 社債券 | 4.7500 | 1,428 | 1,417 | 199,061 | 2033/05/19 |
| RENAISANCERE 5.75% 06/05/33 | 社債券 | 5.7500 | 1,850 | 1,804 | 253,355 | 2033/06/05 |
| BARCLAYSPLC 7.437%/VAR 11/33 | 社債券 | 7.4370 | 2,500 | 2,700 | 379,074 | 2033/11/02 |
| DEUTSCHE BA 7.079%/VAR 2/10/34 | 社債券 | 7.0790 | 720 | 667 | 93,642 | 2034/02/10 |
| US BANCORP DEL SOFR+ 06/12/34 | 社債券 | 5.8360 | 1,000 | 1,000 | 140,395 | 2034/06/12 |
| BARCLAYSPL 3.564%/VAR 09/23/35 | 社債券 | 3.5640 | 725 | 571 | 80,196 | 2035/09/23 |
| WESTPAC B 2.668%/VAR 11/15/35 | 社債券 | 2.6680 | 1,350 | 1,031 | 144,872 | 2035/11/15 |
| ANZ B 2.57%/VAR 11/25/35 144A | 社債券 | 2.5700 | 1,116 | 848 | 119,129 | 2035/11/25 |
| BROADCOM 3.187% 11/15/36 RGS | 社債券 | 3.1870 | 450 | 332 | 46,746 | 2036/11/15 |
| BROADCOM 3.187% 11/15/36 144A | 社債券 | 3.1870 | 700 | 520 | 73,090 | 2036/11/15 |
| ABN A 3.324%/VAR 03/13/37 144A | 社債券 | 3.3240 | 800 | 606 | 85,161 | 2037/03/13 |
| GS GRP INC MTN 6.25% 2/01/41 | 社債券 | 6.2500 | 150 | 159 | 22,336 | 2041/02/01 |
| AERCAP LTD/TR 3.85% 10/29/41 | 社債券 | 3.8500 | 1,000 | 746 | 104,808 | 2041/10/29 |
| HCA INC 4.375% 03/15/42 144A | 社債券 | 4.3750 | 170 | 137 | 19,335 | 2042/03/15 |
| MAGALLANES INC 5.05% 03/15/42 | 社債券 | 5.0500 | 973 | 814 | 114,359 | 2042/03/15 |
| BARCLAYSPLC 3.33% 11/24/42 | 社債券 | 3.3300 | 1,184 | 826 | 116,084 | 2042/11/24 |
| ENERGY TRANSFER 6% 04/15/48 | 社債券 | 6.0000 | 800 | 743 | 104,385 | 2048/06/15 |
| ENERGY TRAN OP 6.25% 04/15/49 | 社債券 | 6.2500 | 425 | 407 | 57,246 | 2049/04/15 |
| WILLIS NORTH AM 3.875% 9/15/49 | 社債券 | 3.8750 | 4,300 | 3,086 | 433,265 | 2049/09/15 |
| AON CORP / AON 3.9% 02/28/52 | 社債券 | 3.9000 | 946 | 729 | 102,464 | 2052/02/28 |
| ENEL FIN 7.75% 10/14/52 144A | 社債券 | 7.7500 | 654 | 759 | 106,654 | 2052/10/14 |
| MARSHMCLEN 6.25% 11/01/52 | 社債券 | 6.2500 | 501 | 556 | 78,125 | 2052/11/01 |
| SOCGEN 7.367% 01/10/53 144A | 社債券 | 7.3670 | 1,400 | 1,375 | 193,041 | 2053/01/10 |
| ORACLE CORP 5.55% 02/06/53 | 社債券 | 5.5500 | 962 | 906 | 127,328 | 2053/02/06 |
| MARSHMCLEN 5.45% 03/15/53 | 社債券 | 5.4500 | 504 | 506 | 71,142 | 2053/03/15 |
| HCA INC 5.9% 06/01/53 | 社債券 | 5.9000 | 720 | 704 | 98,929 | 2053/06/01 |
| CCO LLC/CAPITL 6.834% 10/23/5 | 社債券 | 6.8340 | 1,382 | 1,282 | 179,987 | 2055/10/23 |
| MAGALLANES INC 5.391% 03/15/62 | 社債券 | 5.3910 | 960 | 768 | 107,959 | 2062/03/15 |
| UNITEDHEALTH GR 5.2% 04/15/63 | 社債券 | 5.2000 | 875 | 858 | 120,531 | 2063/04/15 |
| 小計 | | — | 388,781 | 367,905 | 51,650,276 | — |
| (カナダ) | | | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | | |
| CANADA GOVT .25% 04/01/24 | 国債証券 | 0.2500 | 6,455 | 6,221 | 655,167 | 2024/04/01 |
| CANADA GOVT 2.25% 6/1/25 | 国債証券 | 2.2500 | 3,420 | 3,280 | 345,425 | 2025/06/01 |
| CANADA GOVT .5% 12/01/30 | 国債証券 | 0.5000 | 11,800 | 9,517 | 1,002,245 | 2030/12/01 |
| CANADA GOVT 1.5% 12/01/31 | 国債証券 | 1.5000 | 4,800 | 4,117 | 433,525 | 2031/12/01 |
| CANADA GOVT 2% 12/01/51 | 国債証券 | 2.0000 | 2,150 | 1,636 | 172,336 | 2051/12/01 |
| 小計 | | — | 28,625 | 24,773 | 2,608,700 | — |
| (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 | | |
| AUSTRALIA GOVT 1.25% 05/21/32 | 国債証券 | 1.2500 | 6,700 | 5,335 | 508,812 | 2032/05/21 |
| AUSTRALIA GOVT 3.75% 5/34 RGS | 国債証券 | 3.7500 | 2,145 | 2,094 | 199,779 | 2034/05/21 |
| AUSTRALIA GOVT 3% 3/21/47 RGS | 国債証券 | 3.0000 | 2,300 | 1,850 | 176,522 | 2047/03/21 |
| AUSTRALIA GOVT 1.75% 06/51 RGS | 国債証券 | 1.7500 | 4,587 | 2,687 | 256,282 | 2051/06/21 |
| BARCLAYS 2.064%/VAR 5/27 RGS | 社債券 | 2.0640 | 1,750 | 1,538 | 146,687 | 2027/05/20 |
| BARCLAY 3.382%/VAR 5/20/32 RGS | 社債券 | 3.3820 | 1,250 | 939 | 89,595 | 2032/05/20 |
| 小計 | | — | 18,732 | 14,445 | 1,377,681 | — |
| (ニュージーランド) | | | 千ニュージーランド・ドル | 千ニュージーランド・ドル | | |
| NEW ZEALAND GOV .5% 05/15/24 | 国債証券 | 0.5000 | 11,000 | 10,523 | 914,844 | 2024/05/15 |
| NEW ZEALAND GOV .5% 05/15/26 | 国債証券 | 0.5000 | 8,750 | 7,761 | 674,685 | 2026/05/15 |
| NEW ZEALAND GOV .25% 05/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 4,850 | 3,949 | 343,334 | 2028/05/15 |
| 小計 | | — | 24,600 | 22,234 | 1,932,864 | — |

| 銘柄 | 2023年6月15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 | |
| (イギリス) | | % | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| UK GILT 1.25% 07/22/27 RGS | 国債証券 | 1.2500 | 9,130 | 7,996 | 1,421,139 | 2027/07/22 |
| UK GILT .875% 07/31/33 RGS | 国債証券 | 0.8750 | 17,995 | 12,854 | 2,284,446 | 2033/07/31 |
| UK GILT .625% 10/22/50 REGS | 国債証券 | 0.6250 | 2,700 | 1,057 | 187,998 | 2050/10/22 |
| UK GILT 1.25% 07/31/51 RGS | 国債証券 | 1.2500 | 1,425 | 686 | 122,069 | 2051/07/31 |
| UK GILT 1.75% 07/22/57 RGS | 国債証券 | 1.7500 | 3,925 | 2,094 | 372,157 | 2057/07/22 |
| DIRECT LINE IN 4% 06/05/32 RGS | 社債券 | 4.0000 | 3,200 | 2,341 | 416,103 | 2032/06/05 |
| MORGAN STA 5.789%/VAR 11/18/33 | 社債券 | 5.7890 | 1,300 | 1,252 | 222,635 | 2033/11/18 |
| HSBC HLD 8.201%/VAR 11/34 RGS | 社債券 | 8.2010 | 1,176 | 1,202 | 213,703 | 2034/11/16 |
| 小計 | | — | 40,851 | 29,486 | 5,240,253 | — |
| (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 | | |
| NORWAY GOVERNMENT BOND 2% 04/2 | 国債証券 | 2.0000 | 18,275 | 16,993 | 223,640 | 2028/04/26 |
| 小計 | | — | 18,275 | 16,993 | 223,640 | — |
| (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 | | |
| SWEDEN GOVT 1.375% 06/23/71 RE | 国債証券 | 1.3750 | 7,415 | 4,379 | 57,332 | 2071/06/23 |
| 小計 | | — | 7,415 | 4,379 | 57,332 | — |
| (メキシコ) | | | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | | |
| MEXICO UNITED 5.75% 03/05/26 | 国債証券 | 5.7500 | 86,850 | 78,781 | 644,851 | 2026/03/05 |
| MEXICO GOVT 7.75% 5/29/31 | 国債証券 | 7.7500 | 72,800 | 68,234 | 558,521 | 2031/05/29 |
| 小計 | | — | 159,650 | 147,016 | 1,203,372 | — |
| (インドネシア) | | | 千インドネシア・ルピア | 千インドネシア・ルピア | | |
| INDONESIA GOVT 7% 5/15/27 | 国債証券 | 7.0000 | 28,776,000 | 29,809,058 | 283,186 | 2027/05/15 |
| 小計 | | — | 28,776,000 | 29,809,058 | 283,186 | — |
| (チェコ) | | | 千チェコ・コルナ | 千チェコ・コルナ | | |
| CZECH REPUBLIC .25% 02/10/27 | 国債証券 | 0.2500 | 55,280 | 46,922 | 300,075 | 2027/02/10 |
| 小計 | | — | 55,280 | 46,922 | 300,075 | — |
| (韓国) | | | 千韓国・ウォン | 千韓国・ウォン | | |
| KOREA REPUBLIC OF 2.625% 06/10 | 国債証券 | 2.6250 | 2,320,200 | 2,217,577 | 244,377 | 2028/06/10 |
| KOREA GOVT 1.5% 12/10/30 | 国債証券 | 1.5000 | 15,016,960 | 12,925,097 | 1,424,345 | 2030/12/10 |
| 小計 | | — | 17,337,160 | 15,142,675 | 1,668,722 | — |
| (中国) | | | 千オフショア・人民元 | 千オフショア・人民元 | | |
| CHINA GOVT 1.99% 04/09/25 | 国債証券 | 1.9900 | 49,170 | 49,046 | 959,007 | 2025/04/09 |
| CHINA GOVT 3.27% 11/19/30 | 国債証券 | 3.2700 | 33,000 | 34,596 | 676,466 | 2030/11/19 |
| CHINA GOVT 3.02% 05/27/31 | 国債証券 | 3.0200 | 28,000 | 28,732 | 561,800 | 2031/05/27 |
| CHINA GOVT 2.89% 11/18/31 | 国債証券 | 2.8900 | 56,640 | 57,575 | 1,125,777 | 2031/11/18 |
| CHINA GOVT 2.8% 11/15/32 | 国債証券 | 2.8000 | 170,000 | 171,717 | 3,357,582 | 2032/11/15 |
| 小計 | | — | 336,810 | 341,668 | 6,680,634 | — |
| (ポーランド) | | | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | | |
| POLAND GOVT .25% 10/25/26 | 国債証券 | 0.2500 | 6,675 | 5,560 | 189,960 | 2026/10/25 |
| POLAND GOVT 1.25% 10/25/30 | 国債証券 | 1.2500 | 7,450 | 5,434 | 185,629 | 2030/10/25 |
| 小計 | | — | 14,125 | 10,994 | 375,589 | — |
| (ユーロ…アイルランド) | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | |
| AIB GROUP 2.25%/VAR 04/28 RGS | 社債券 | 2.2500 | 1,097 | 996 | 151,564 | 2028/04/04 |
| PTSB EUAMDB01+350 4/25/28 RGS | 社債券 | 6.6250 | 2,729 | 2,740 | 416,923 | 2028/04/25 |
| AIB GROUP PLC 4.625% 07/23/29 RGS | 社債券 | 4.6250 | 725 | 711 | 108,304 | 2029/07/23 |
| AIB GR 2.875%/VAR 05/30/31 RGS | 社債券 | 2.8750 | 765 | 693 | 105,570 | 2031/05/30 |
| BANKIR 1.375%/VAR 08/11/31 RGS | 社債券 | 1.3750 | 1,818 | 1,584 | 241,117 | 2031/08/11 |
| 小計 | | — | 7,134 | 6,726 | 1,023,480 | — |
| (ユーロ…オランダ) | | | | | | |
| ING GROEP NV 4.5%/VAR 5/29 RGS | 社債券 | 4.5000 | 2,000 | 1,988 | 302,492 | 2029/05/23 |
| ABN AMRO BANK 4.25% 02/21/30 R | 社債券 | 4.2500 | 1,500 | 1,488 | 226,456 | 2030/02/21 |
| DIGITAL DUTC 1.5% 03/15/30 RGS | 社債券 | 1.5000 | 540 | 420 | 63,969 | 2030/03/15 |
| DIGITAL DUT 1.25% 02/01/31 RGS | 社債券 | 1.2500 | 2,450 | 1,811 | 275,654 | 2031/02/01 |
| PROSUS NV 1.985% 07/13/33 RGS | 社債券 | 1.9850 | 1,475 | 999 | 152,144 | 2033/07/13 |
| ABN AMRO BANK 5.5% 9/21/33 RGS | 社債券 | 5.5000 | 1,300 | 1,296 | 197,211 | 2033/09/21 |
| ING GROEP 5.25%/VAR 11/33 RGS | 社債券 | 5.2500 | 1,400 | 1,472 | 223,969 | 2033/11/14 |
| GSK CONSUM 2.125% 03/29/34 RGS | 社債券 | 2.1250 | 540 | 448 | 68,288 | 2034/03/29 |
| ING GROEP 4.75%/VAR 05/34 RGS | 社債券 | 4.7500 | 1,600 | 1,600 | 243,556 | 2034/05/23 |
| ABN AMRO BK 4.5% 11/21/34 RGS | 社債券 | 4.5000 | 900 | 908 | 138,213 | 2034/11/21 |
| NN GROUP 6%/VAR 11/03/43 RGS | 社債券 | 6.0000 | 791 | 788 | 120,032 | 2043/11/03 |
| ASR NEDERLA 7%/VAR 12/7/43 RGS | 社債券 | 7.0000 | 971 | 1,005 | 152,946 | 2043/12/07 |
| VOLKSWA 4.375%/VAR PERP RGS | 社債券 | 4.3750 | 1,900 | 1,607 | 244,655 | 2049/12/31 |
| VWIF 3.748%/VAR PERP RGS | 社債券 | 3.7480 | 900 | 792 | 120,638 | 2049/12/31 |
| RABOBANK NEDERLAND 4.875% PERP RGS | 社債券 | 4.8750 | 1,200 | 1,020 | 155,344 | 2049/12/31 |
| 小計 | | — | 19,467 | 17,650 | 2,685,574 | — |
| (ユーロ…ルクセンブルグ) | | | | | | |
| BECTON DICKINS 1.213% 02/12/36 | 社債券 | 1.2130 | 1,500 | 1,069 | 162,792 | 2036/02/12 |
| 小計 | | — | 1,500 | 1,069 | 162,792 | — |
| (ユーロ…フランス) | | | | | | |
| EDF 4.625% 01/25/43 RGS | 特殊債券 | 4.6250 | 1,100 | 1,035 | 157,539 | 2043/01/25 |
| BNPSA 0.875%/VAR 07/11/30 RGS | 社債券 | 0.8750 | 2,400 | 1,937 | 294,779 | 2030/07/11 |

| 銘柄 | 2023年6月15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 | |
| | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| BPCE 1% 01/14/32 RGS | 社債券 | 1.0000 | 2,900 | 2,242 | 341,268 | 2032/01/14 |
| BPCE SA 4.75%/VAR 06/34 RGS | 社債券 | 4.7500 | 1,000 | 1,006 | 153,122 | 2034/06/14 |
| BPCE SA 5.125%/VAR 1/25/35 RGS | 社債券 | 5.1250 | 700 | 684 | 104,072 | 2035/01/25 |
| TOTALENERGI 3.25%/VAR PERP RGS | 社債券 | 3.2500 | 3,317 | 2,461 | 374,448 | 2049/12/31 |
| 小計 | | — | 11,417 | 9,367 | 1,425,230 | — |
| (ユーロ…ドイツ) | | | | | | |
| GERMANY GOVT 0% 12/15/23 RGS | 国債証券 | 0.0000 | 4,910 | 4,828 | 734,603 | 2023/12/15 |
| GERMANY GOVT 1.3% 10/15/27 RGS | 国債証券 | 1.3000 | 4,320 | 4,103 | 624,272 | 2027/10/15 |
| GERMANY GOVT 2.3% 02/15/33 RGS | 国債証券 | 2.3000 | 41,120 | 40,591 | 6,175,950 | 2033/02/15 |
| GERMANY GOVT 3.25% 7/04/42 | 国債証券 | 3.2500 | 2,640 | 2,878 | 437,923 | 2042/07/04 |
| GERMANY GOVT 0% 08/15/52 REGS | 国債証券 | 0.0000 | 5,576 | 2,705 | 411,621 | 2052/08/15 |
| GERMANY GOVT 1.8% 08/15/53 RGS | 国債証券 | 1.8000 | 1,050 | 878 | 133,736 | 2053/08/15 |
| BAYER AG 4.625% 5/26/33 RGS | 社債券 | 4.6250 | 769 | 782 | 119,052 | 2033/05/26 |
| 小計 | | — | 60,385 | 56,767 | 8,637,158 | — |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | | |
| CELLNEX CONV .75% 11/20/31 RGS | 新株予約権付社債 | 0.7500 | 300 | 234 | 35,747 | 2031/11/20 |
| BANCO 5.125%/VAR 11/10/28 RGS | 社債券 | 5.1250 | 2,100 | 2,115 | 321,946 | 2028/11/10 |
| BANCO DE SABADE 5.25% 02/07/29 RE | 社債券 | 5.2500 | 1,900 | 1,869 | 284,424 | 2029/02/07 |
| CELLNEX FINANCE 2% 02/15/33 RE | 社債券 | 2.0000 | 1,300 | 1,019 | 155,067 | 2033/02/15 |
| CAIXABANK SA VAR 02/23/33 REGS | 社債券 | 6.2500 | 800 | 807 | 122,879 | 2033/02/23 |
| CAIXABK 6.125%/VAR 05/30/34 RGS | 社債券 | 6.1250 | 2,100 | 2,091 | 318,243 | 2034/05/30 |
| 小計 | | — | 8,500 | 8,138 | 1,238,309 | — |
| (ユーロ…その他) | | | | | | |
| POLAND GOVT 4.25% 02/14/43 RGS | 国債証券 | 4.2500 | 1,175 | 1,142 | 173,859 | 2043/02/14 |
| EUROPEAN UNION 2.5% 10/04/52 R | 特殊債券 | 2.5000 | 2,552 | 2,101 | 319,758 | 2052/10/04 |
| CREDIT SUISSE 2.125% 10/13/26 RGS | 社債券 | 2.1250 | 1,854 | 1,730 | 263,276 | 2026/10/13 |
| UBS GR 0.25%/VAR 11/03/26 RGS | 社債券 | 0.2500 | 1,300 | 1,160 | 176,585 | 2026/11/03 |
| MSTDW 0.406%/VAR 10/29/27 | 社債券 | 0.4060 | 850 | 742 | 112,998 | 2027/10/29 |
| HSBC HOL 4.752%/VAR 3/10/28 RGS | 社債券 | 4.7520 | 2,177 | 2,195 | 334,016 | 2028/03/10 |
| UBS GROUP AG 4.625% 03/17/28 REGS | 社債券 | 4.6250 | 1,186 | 1,175 | 178,881 | 2028/03/17 |
| MSTDW 4.656%/VAR 3/2/29 | 社債券 | 4.6560 | 1,179 | 1,190 | 181,151 | 2029/03/02 |
| TORONTO 3.631% 12/13/29 RGS | 社債券 | 3.6310 | 1,905 | 1,832 | 278,840 | 2029/12/13 |
| WESTPAC BANK 3.799% 01/30 RGS | 社債券 | 3.7990 | 2,050 | 2,015 | 306,714 | 2030/01/17 |
| HSBC 4.7870%/VAR 03/10/32 RGS | 社債券 | 4.7870 | 947 | 957 | 145,750 | 2032/03/10 |
| UBS GROUP 4.75%/VAR 3/32 RGS | 社債券 | 4.7500 | 993 | 992 | 151,045 | 2032/03/17 |
| MSTDW 2.95%/VAR 05/07/32 | 社債券 | 2.9500 | 1,772 | 1,599 | 243,363 | 2032/05/07 |
| SWEDBANK 3.625%/VAR 08/32 RGS | 社債券 | 3.6250 | 667 | 612 | 93,231 | 2032/08/23 |
| HSBC HOLD 6.364%/VAR 11/32 RGS | 社債券 | 6.3640 | 1,702 | 1,744 | 265,397 | 2032/11/16 |
| ANZ BKG GR 5.101%/VAR 2/33 RGS | 社債券 | 5.1010 | 2,777 | 2,737 | 416,508 | 2033/02/03 |
| BOA CORP 2.824%/VAR 4/27/33 RGS | 社債券 | 2.8240 | 765 | 677 | 103,133 | 2033/04/27 |
| HSBC HOLD 4.856%/VAR 05/33 RGS | 社債券 | 4.8560 | 730 | 734 | 111,824 | 2033/05/23 |
| BARCLAYSPLC VAR 01/29/34 | 社債券 | 5.2620 | 1,020 | 1,038 | 158,082 | 2034/01/29 |
| HONEYWELL INTL 4.125% 11/02/34 | 社債券 | 4.1250 | 1,202 | 1,210 | 184,213 | 2034/11/02 |
| 小計 | | — | 28,803 | 27,595 | 4,198,633 | — |
| 合計 | | — | — | — | 92,973,510 | — |

(注1) 邦貨換算金額は、6月15日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) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | 2023年6月15日現在 | |
|---------------|--------------|-----|
| | 買建額 | 売建額 |
| 外国 | 百万円 | 百万円 |
| LONG GILT FUT | 1,228 | — |
| EURO BOBL FUT | — | 194 |

(注1) 邦貨換算金額は、6月15日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) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) スワップ及び先渡取引残高

| 種類 | 取引契約残高 | |
|---------------|--------------|--------------|
| | 当期末想定元本額 | |
| | 買建 | 売建 |
| 直物為替先渡取引(NDF) | 百万円 1,175 | 百万円 1,075 |

(注) 金額の単位未満は切捨て。

フィデリティ・外国債券・マザーファンド

運用報告書

《第21期》

決算日 2023年5月1日

(計算期間：2022年5月3日から2023年5月1日まで)

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | <ul style="list-style-type: none"> ●主として世界各国の投資適格債券(除く日本円)に幅広く分散投資を行います。 ●投資を行う投資適格債券の格付けは、Baa格(ムーディーズ社)またはBBB格(S&P社)以上とします。 ●公社債の組入れ比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 ●外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ●外国為替取引以外に係る運用にあたっては、FILインベストメンツ・インターナショナルおよびFIL(ルクセンブルグ)・エスエイに、運用の指図に関する権限を委託します。 ●資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。 |
| 主要運用対象 | 世界各国の投資適格債券(除く日本円)を主要な投資対象とします。 |
| 組入制限 | 公社債および外貨建資産への投資割合には制限を設けません。株式への直接投資は行いません。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク* | | 債組比 | 券入率 | 債先比 | 券物率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|-----|---------|-----|-------|------|-----|-----|--------|
| | 円 | % | 円 | % | | | | | |
| 17期(2019年5月7日) | 23,115 | 4.0 | 282.43 | 2.4 | 101.1 | 10.5 | | | 13,884 |
| 18期(2020年4月30日) | 24,498 | 6.0 | 291.98 | 3.4 | 103.1 | 4.4 | | | 16,597 |
| 19期(2021年4月30日) | 26,681 | 8.9 | 313.94 | 7.5 | 95.3 | △0.8 | | | 67,196 |
| 20期(2022年5月2日) | 27,982 | 4.9 | 327.63 | 4.4 | 93.7 | 0.5 | | | 71,162 |
| 21期(2023年5月1日) | 29,161 | 4.2 | 338.73 | 3.4 | 93.2 | 0.2 | | | 96,067 |

※ベンチマークとして、ブルームバーグ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(円ベース)を記載しています。

*「Bloomberg®」およびブルームバーグ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(円ベース)は、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited(以下「BISL」)をはじめとする関連会社(以下、総称して「ブルームバーグ」)のサービスマークであり、フィデリティ投信株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグはフィデリティ投信株式会社とは提携しておらず、また、当ファンドを承認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、当ファンドに関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません。

(注1) 債券先物比率=買建比率-売建比率。

(注2) 債券組入比率に海外CDを含んでいません。

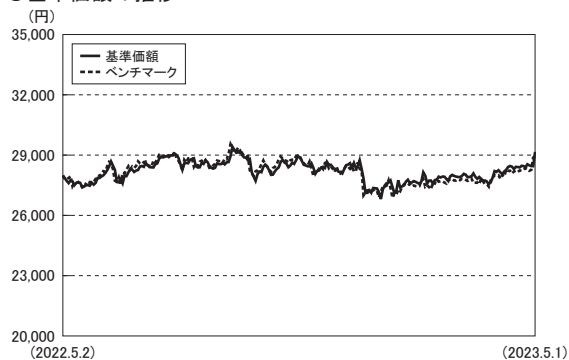
■当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組比 | 券入率 | 債先比 | 券物率 |
|-------------------|--------|------|--------|------|------|-----|-----|-----|
| | 円 | % | 円 | % | | | | |
| (期首) 2022年5月2日 | 27,982 | — | 327.63 | — | 93.7 | | | 0.5 |
| 5月末 | 27,859 | △0.4 | 326.07 | △0.5 | 93.3 | | | 0.5 |
| 6月末 | 28,428 | 1.6 | 334.76 | 2.2 | 94.5 | | | 0.5 |
| 7月末 | 28,859 | 3.1 | 336.23 | 2.6 | 93.7 | | | 0.4 |
| 8月末 | 28,549 | 2.0 | 334.93 | 2.2 | 92.3 | | | 0.4 |
| 9月末 | 28,181 | 0.7 | 331.79 | 1.3 | 93.5 | | | 0.3 |
| 10月末 | 28,954 | 3.5 | 339.31 | 3.6 | 94.9 | | | 0.4 |
| 11月末 | 28,283 | 1.1 | 332.99 | 1.6 | 95.4 | | | 0.4 |
| 12月末 | 27,150 | △3.0 | 314.94 | △3.9 | 93.8 | | | 0.4 |
| 2023年1月末 | 27,671 | △1.1 | 321.48 | △1.9 | 93.3 | | | 0.2 |
| 2月末 | 28,015 | 0.1 | 325.62 | △0.6 | 93.8 | | | 0.2 |
| 3月末 | 28,205 | 0.8 | 327.90 | 0.1 | 93.7 | | | 0.2 |
| 4月末 | 28,449 | 1.7 | 338.11 | 3.2 | 93.1 | | | 0.2 |
| (期末) 2023年5月1日 | 29,161 | 4.2 | 338.73 | 3.4 | 93.2 | | | 0.2 |

(注) 騰落率は期首比です。

■運用経過の説明

●基準価額の推移



(注)ベンチマークは、2022年5月2日の値をファンドの基準価額と同一になるように指数化しています。

●基準価額の主な変動要因

当期における当ファンドの騰落率は+4.2%でした。

米国、ユーロ圏(ドイツ)、英国などの長期金利の上昇は、ファンドの基準価額にマイナスに作用しました。また、社債のスプレッド(上乗せ利回り)は、期前半拡大し、期後半は縮小傾向が強まる局面もあったものの、期を通してみるとごく小幅に拡大し、ファンドの基準価額にマイナスに作用しました。また、当期は、期前半に、対米ドル、対ユーロ、英ポンドなどで円安が強まり、期後半は円高傾向となる局面もみられたものの、期を通してみると円安傾向となり、為替市場動向は、プラスに作用しました。全体としては、為替の影響が大きく、ファンドの騰落率はプラスとなりました。

■投資環境

当期は、インフレ高進と各国・地域の金融当局による金融政策動向、地政学リスクおよび景況感の行方などに注目が集まりました。米国債券市場では、インフレ抑制姿勢を強めていた米連邦準備制度理事会(FRB)の動向と、金融政策動向の景気への影響を織り込む投資家心理の変化が、周期的な長期金利動向につながりました。期初は、3月に引き続き、5月、6月、7月と連続で利上げが行われ、インフレ高進と引き締め加速が長期金利上昇圧力となりました。ウクライナ情勢の長期化や米中関係の緊張の高まりなどが、急速な利上げによる景気悪化懸念を強めるとの見方にもつながり、6月中旬から7月下旬には、一旦、長期金利が低下する局面がみられました。しかし、金融当局の利上げ継続姿勢が確認されたことにより、その後の金利上昇圧力となりました。10月後半になると、インフレ率上昇に鈍化の兆しが見え始めてきたことから、利上げ鈍化観測が強まり、長期金利は低下に転じました。米国の中長期的な景気減速懸念も材料視され始めました。2月になると、労働市場の堅調さなどにより米景気の底堅さが示されたことや、金融当局のインフレ抑制姿勢が再確認されたことなどが、再び金利上昇圧力となりました。しかしながら、3月に米欧金融機関の破綻や経営不安が金融システム不安につながり、金利低下が進みました。期を通してみると、米10年国債利回りは上昇しました。欧州債券市場では、ウクライナ情勢の長期化が不確実性とインフレ高進の蓋然性を高めました。7月には、6月に示唆していた水準を超える0.50%の利上げに動くなど、高止まりするインフレへの対処を強め

ました。その後も、地政学リスクの影響が大きいことなども考慮し、欧州中央銀行(ECB)は、インフレ抑制を優先する姿勢を強め、利上げを継続しました。12月になると、米国には遅れながらも、インフレ率上昇圧力の鈍化がみられ始め、景気減速懸念が強まり始めたものの、ECBの引き締め姿勢継続が、長期金利の上昇圧力につながりました。英国では、インフレ抑制対応から、2021年12月から利上げサイクルとなりました。エネルギー価格高騰の産業に与える影響が強く意識されたことや首相交代などによる政治的な混乱などにより、9月から10月にかけては、長期金利の大幅な上昇がみられました。その後は、他地域同様、インフレ抑制姿勢を維持している金融当局の金融政策と景況感との綱引きによる金利動向となりました。3月になると、米欧金融機関の破綻や経営不安が、金融システム不安の懸念を高め、欧州市場においても、リスク回避の動きが強まり、金利低下圧力となりました。期を通してみると、ドイツおよび英国の10年国債利回りは共に上昇しました。

投資適格社債市場は、ウクライナ情勢の悪化やインフレ高進に伴う金融引き締めの加速などから、投資適格社債のスプレッド(上乗せ利回り)は拡大する動きとなりました。7月に入ると、急速な金融引き締め加速観測の後退から、一旦、リスク資産が買い戻されたものの、8月後半に、米金融当局がインフレ抑制を最優先とする姿勢を明確にしたことから、スプレッドは再び拡大傾向となりました。10月後半になると、米国でインフレ率上昇に鈍化の兆しが見え始めてきたことなどが、投資家心理の改善につながり、スプレッドは縮小に転じました。米労働市場に堅調さが示されるなど、米国経済が総じて底堅さを示していたことも、リスク資産の買い戻しの動きを下支えしました。しかしながら、3月に米欧金融機関の破綻や経営不安が金融システム不安につながると、リスク回避の動きが急速に高まり、スプレッドの急拡大につながりました。期を通してみると、投資適格社債のスプレッドはごく小幅に拡大しました。

●ポートフォリオ

当ファンドは、主として世界各国の投資適格債券(除く日本円)に投資し、ブルームバーグ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(円ベース)を上回る運用成績を目指すことで、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を目的に運用を行います。

運用にあたっては、マクロ経済分析に加え、社内のクオンツ(計量分析)アナリスト、クレジット(信用分析)アナリストの調査・分析に基づいて、全体の資産配分や個別銘柄の選択を行います。

当期においては、世界経済はコロナ禍からの回復基調がみられる一方、インフレとそれに伴う金融引き締め動向が、経済に不確実性をもたらす要因にもなり、米国を除くグローバル経済環境は力強さに欠ける状況となりました。先行きに対する不確実性要因が徐々に強まるとの判断もあり、グローバル経済に対する見通しは、慎重姿勢を維持しました。期を通して、国債を嗜好し、社債への配分は市場の投資家心理の動向などを注視し、選択的に行いました。また、銘柄選択においては、新発債の妙味に注目しました。

●ベンチマークとの差異

当期の当ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率の+3.4%を上回りました。

インフレ高進や金融引き締めの景気への影響なども考慮し、中長期的には先行きの不透明感が強まるとの見方をしていました。よって、当期は、デュレーション長期化バイアスを規範としていた一方、短期的なモメンタムを背景とした市場動向を考慮して、ポートフォリオのデュレーションは、柔軟な調整を行いました。米国は、先行きの不確

実性を考慮し、長期化バイアスを維持しつつも、短期化も含めた対応を行いました。欧州地域においては、ドイツのデレションを長期化とする一方、その他の国を短期化とするなど、相対的な評価も加味し、柔軟なデレション、イールドカーブのポジション調整を行いました。このような対応は、前半は十分に効果を見いだせない局面もあったものの、後半には良好に作用した局面もあり、金利ポジションはプラス寄与となりました。クレジット資産に対しては、総じて慎重な見通しとしながらも、相対価値の観点から、社債の新発債などを中心に選択的な配分を行いました。前半は、クレジット市場が大幅な調整となったことから、クレジット市場への感応度を低減していたことはプラス寄与につながったものの、選択的な社債への配分などが銘柄選択要因として大きくマイナス寄与につながりました。後半は、市場の戻りを受け、選択的な社債への配分などがプラス寄与となり、前半のマイナス寄与を相殺し、期を通して、ごく小幅なマイナス寄与となりました。通貨要因もプラス寄与となり、超過収益に貢献しました。

■今後の運用方針

当ファンドにつきましては、引き続き、主として世界各国の投資適格債券(除く日本円)に投資し、ブルームバーグ・グローバル総合(日本円除く)インデックス(円ベース)を上回る運用成績を目指すことで、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を目的に運用を行います。

当ファンドにおける市場環境の見通しと投資方針は、以下の通りです。

米国債券市場では、堅調な労働市場を背景とした底堅い経済状況が続いているものの、企業景況感の悪化やインフレ圧力に鈍化の兆しがみられることから、市場では今後の利上げ停止時期に注目が集まっています。しかしながら、米連邦準備制度理事会(FRB)は、インフレ動向の不確実性を考慮し利上げを続ける可能性もあり、中央銀行と市場の見通しの乖離から当面は長期金利の変動が大きくなる可能性があります。今後について、インフレ抑制が思うように進まないリスクや、一部の金融機関の経営不安などが先行きの不確実性要因となっており、そのような要因の影響および動向を注意深く見ていきます。

ユーロ圏では、高インフレなどを背景に、金融政策動向への注目が集まっています。欧州中央銀行(ECB)は、景気下振れを想定しながらも、インフレ抑制姿勢を強めています。英国も、継続的な利上げにより、インフレ抑制姿勢を維持しています。ウクライナ情勢の長期化は、エネルギー価格の上昇など欧州地域に直接的な影響を与えており、地域全般の大きな不確実性要因となっています。したがって、欧州地域では、金融政策と景気のバランスなど難しいかじ取りを強いられています。インフレ抑制が想定通り進まないリスクも残るため、動向を注意深く見ていく必要があります。

投資適格社債市場は、高い信用力を背景に、クレジット資産の中においては相対的な安定性を維持するものとみています。先進国の金融引き締め継続は、短期的な金利上昇圧力となる一方、中長期的には、利上げによる景気抑制圧力の影響などにより、景気減速リスクの高まりにつながるものとみています。地政学リスクなどによりインフレ抑制が想定通り進まないリスクが残る中、足元では金融システム不安も懸念されるため、企業ファンダメンタルズに与える影響などに注意を払います。金融当局と市場参加者の先行き見通しにばらつきがみられるなど難しい市場環境下、投資家心理の変化によるボラティリティにも配慮し、流動性の確保と相対価値を重視した機動的な投資機会を探る方針です。

■1万円(元本10,000円)当たりの費用明細

(2022年5月3日～2023年5月1日)

| 項目 | 金額 |
|---------------------------|-----------|
| (a) 売買委託手数料 (先物・オプション) | 0円 (0) |
| (b) 有価証券取引税 | — |
| (c) その他費用 (保管費用) | 3 (3) |
| 合計 | 3 |

(注) 費用明細の項目の概要および注記については、前述の「1万円(元本10,000円)当たりの費用明細」をご参照ください。

■売買及び取引の状況(2022年5月3日から2023年5月1日まで)

(1) 新株予約権付社債(転換社債)

| 外国 | 買付額 | | 売付額 | |
|------|------|------|------------|------------|
| | 額 | 金額 | 額 | 金額 |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ |
| スペイン | — | — | 300 (—) | 255 (—) |

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は予約権行使による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

(2) 公社債

| 外国 | 買付額 | 売付額 |
|----------|--------------|----------------|
| アメリカ | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル |
| 国債証券 | 657,100 | 576,853 (—) |
| 特殊債券 | 535,799 | 518,158 (—) |
| 社債証券 | 140,121 | 131,256 (—) |
| カナダ | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル |
| 国債証券 | 5,306 | 8,842 (—) |
| 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 |
| 国債証券 | 4,525 | 681 (—) |
| ニュージーランド | 千ニュージーランド・ドル | 千ニュージーランド・ドル |
| 国債証券 | 3,468 | 679 (—) |
| イギリス | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド |
| 国債証券 | 31,656 | 18,462 (—) |
| 社債証券 | 9,558 | 11,099 (—) |
| 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 |
| 国債証券 | — | 70,214 (—) |
| メキシコ | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ |
| 国債証券 | 47,842 | 32,788 (—) |
| インドネシア | 千インドネシア・ルピア | 千インドネシア・ルピア |
| 国債証券 | — | — (825,000) |

| | | 買付額 | 売付額 |
|-------|---------|------------|---------------------|
| 外国 | | | |
| 中 | 国 | 千オフショア・人民元 | 千オフショア・人民元 |
| | 国債証券 | 352,519 | 245,523 (11,390) |
| | 特殊債券 | — | 43,328 (—) |
| ポーランド | | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ |
| | 国債証券 | 2,575 | 9,219 (—) |
| ユーロ | | 千ユーロ | 千ユーロ |
| | アイルランド | | |
| | 社債券 | 2,784 | 1,330 (—) |
| | オランダ | | |
| | 特殊債券 | 2,622 | 2,832 (—) |
| | 社債券 | 8,874 | 9,737 (—) |
| | ベルギー | | |
| | 社債券 | 997 | 1,016 (—) |
| | ルクセンブルグ | | |
| | 社債券 | 430 | 440 (—) |
| | フランス | | |
| | 特殊債券 | 2,184 | — (—) |
| | 社債券 | 10,479 | 4,855 (—) |
| | ドイツ | | |
| | 国債証券 | 132,166 | 117,322 (—) |
| | 社債券 | 3,806 | 6,596 (—) |

| | | 買付額 | 売付額 |
|-----|------|--------|---------------|
| 外国 | | | |
| ユーロ | | 千ユーロ | 千ユーロ |
| | スペイン | | |
| | 国債証券 | 3,321 | 3,383 (—) |
| | 社債券 | 8,386 | 7,741 (—) |
| | その他 | | |
| | 国債証券 | 1,520 | — (—) |
| | 特殊債券 | 6,957 | 3,716 (—) |
| | 社債券 | 42,634 | 27,392 (—) |

(注1) 金額は受渡し代金(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。
(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。
(注4) 単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|--------|-------|-------|-------|-----|
| | 新規買付額 | 決済額 | 新規売付額 | 決済額 |
| 外国 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 債券先物取引 | 1,473 | 1,438 | 382 | 200 |

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(4) スワップ及び先渡し取引状況

| 種 類 | 当 期 | |
|----------------|--------------|--------------|
| | 取 引 契 約 金 額 | |
| | 買 建 | 売 建 |
| 直物為替先渡し取引(NDF) | 百万円 6,459 | 百万円 6,088 |

(注) 単位未満は切捨て。

■当期中の主要な売買銘柄 (2022年5月3日から2023年5月1日まで)

●公社債

| 当 | | 期 | |
|--------------------------------|-----------|-------------------------------|-----------|
| 買 | 付 | 売 | 付 |
| 銘 | 柄 | 銘 | 柄 |
| 金 額 | | 金 額 | |
| | | 千円 | |
| USTN 4% 02/29/28 | 9,382,766 | USTN 3.875% 12/31/27 | 9,377,571 |
| USTN 3.875% 12/31/27 | 9,312,642 | GERMANY GOVT 0% 02/15/32 REGS | 8,402,656 |
| USTN 4.125% 09/30/27 | 8,499,895 | USTN 4.125% 09/30/27 | 8,361,910 |
| USTN 2.875% 05/15/32 | 8,123,890 | USTN 2.875% 05/15/32 | 8,009,933 |
| USTN 2.75% 07/31/27 | 7,507,025 | USTN 1.125% 10/31/26 | 7,245,831 |
| GERMANY GOVT 0% 02/15/32 REGS | 7,171,105 | USTN 2.75% 07/31/27 | 7,143,106 |
| USTN 4.125% 11/15/32 | 6,809,764 | USTN 1.875% 02/15/32 | 6,142,001 |
| USTN 2.75% 08/15/32 | 5,236,220 | USTN 2.75% 08/15/32 | 5,048,621 |
| USTN 4% 02/28/30 | 4,285,863 | USTN 4% 10/31/29 | 3,908,511 |
| GERMANY GOVT 1.3% 10/15/27 RGS | 4,083,946 | USTN 1.5% 01/31/27 | 3,799,590 |

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。
(注2) 現先取引によるものは含まれておりません。
(注3) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等 (2022年5月3日から2023年5月1日まで)

期中における当ファンドに係る利害関係人との取引はありません。

(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 (2023年5月1日現在)

(1) 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 366,414 | 千アメリカ・ドル 355,542 | 千円 48,652,426 | 50.6 | % 0.2 | % 29.6 | % 18.0 | % 3.1 |
| カ ナ ダ | 千カナダ・ドル 28,625 | 千カナダ・ドル 25,536 | 2,577,156 | 2.7 | — | 1.7 | 0.3 | 0.7 |
| オ ー ス ト ラ リ ア | 千オーストラリア・ドル 18,732 | 千オーストラリア・ドル 15,262 | 1,381,681 | 1.4 | — | 1.3 | 0.1 | — |
| ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド | 千ニューージーランド・ドル 26,200 | 千ニューージーランド・ドル 23,659 | 1,999,004 | 2.1 | — | 0.5 | 0.7 | 0.9 |
| イ ギ リ ス | 千イギリス・ポンド 39,634 | 千イギリス・ポンド 30,284 | 5,203,420 | 5.4 | — | 3.8 | 1.6 | — |
| ノ ル ウ ェ ー | 千ノルウェー・クローネ 18,275 | 千ノルウェー・クローネ 17,311 | 221,763 | 0.2 | — | — | 0.2 | — |
| ス ウ ェ ー デ ン | 千スウェーデン・クローナ 7,415 | 千スウェーデン・クローナ 4,604 | 61,334 | 0.1 | — | 0.1 | — | — |
| メ キ シ コ | 千メキシコ・ペソ 159,650 | 千メキシコ・ペソ 147,029 | 1,118,380 | 1.2 | — | 0.5 | 0.6 | — |
| イ ン ド ネ シ ア | 千インドネシア・ルピア 28,776,000 | 千インドネシア・ルピア 29,512,090 | 277,413 | 0.3 | — | — | 0.3 | — |
| チ ェ コ | 千チェコ・コルナ 55,280 | 千チェコ・コルナ 46,446 | 297,488 | 0.3 | — | — | 0.3 | — |
| 韓 国 | 千韓国・ウォン 17,337,160 | 千韓国・ウォン 15,384,131 | 1,570,719 | 1.6 | — | 1.6 | — | — |
| 中 国 | 千オフショア・人民元 341,810 | 千オフショア・人民元 343,096 | 6,759,788 | 7.0 | — | 6.0 | — | 1.1 |
| ポ ー ラ ン ド | 千ポーランド・ズロチ 14,125 | 千ポーランド・ズロチ 10,918 | 358,273 | 0.4 | — | 0.2 | 0.2 | — |
| ユ ー ロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ア イ ル ラ ン ド | 6,134 | 5,732 | 863,098 | 0.9 | 0.4 | 0.5 | 0.4 | — |
| オ ラ ン ダ | 14,387 | 12,816 | 1,929,507 | 2.0 | — | 1.9 | 0.1 | — |
| フ ラ ン ス | 16,817 | 14,701 | 2,213,324 | 2.3 | — | 2.3 | — | — |
| ド イ ツ | 64,937 | 55,907 | 8,416,897 | 8.8 | 0.1 | 6.7 | 1.1 | 0.9 |
| ス ペ イ ン | 6,300 | 5,771 | 868,944 | 0.9 | 0.6 | 0.9 | — | — |
| イ タ リ ア | 1,105 | 921 | 138,700 | 0.1 | — | 0.1 | — | — |
| そ の 他 | 32,050 | 30,806 | 4,637,922 | 4.8 | — | 3.6 | 1.3 | — |
| 合 計 | — | — | 89,547,247 | 93.2 | 1.2 | 61.1 | 25.4 | 6.7 |

(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、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注4) 評価については証券会社、価格情報会社等よりデータを入力しています。

(B) 個別銘柄開示
外国(外貨建)公社債

| 銘柄 | 種類 | 利率 | 当期 | | | | 償還年月日 |
|------------------------------------|------|--------|----------|----------|-----------|------------|-------|
| | | | 額面金額 | 評価額 | | 千円 | |
| | | | | 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 | | | |
| SAUDI ARABIA 4.875% 7/33 RGS | 国債証券 | 4.8750 | 1,600 | 1,644 | 225,089 | 2033/07/18 | |
| USTN 4.5% 11/30/24 | 国債証券 | 4.5000 | 13,050 | 13,081 | 1,790,012 | 2024/11/30 | |
| USTN 4.5% 11/15/25 | 国債証券 | 4.5000 | 9,760 | 9,907 | 1,355,738 | 2025/11/15 | |
| USTN 4% 02/29/28 | 国債証券 | 4.0000 | 68,750 | 70,264 | 9,615,002 | 2028/02/29 | |
| USTN 4% 02/28/30 | 国債証券 | 4.0000 | 31,260 | 32,222 | 4,409,283 | 2030/02/28 | |
| USTN 4.125% 11/15/32 | 国債証券 | 4.1250 | 27,890 | 29,436 | 4,028,128 | 2032/11/15 | |
| USTN 3.5% 02/15/33 | 国債証券 | 3.5000 | 7,050 | 7,091 | 970,442 | 2033/02/15 | |
| USTB 3.375% 08/15/42 | 国債証券 | 3.3750 | 5,660 | 5,330 | 729,367 | 2042/08/15 | |
| USTB 3.875% 02/15/43 | 国債証券 | 3.8750 | 2,600 | 2,627 | 359,562 | 2043/02/15 | |
| USTB 1.875% 11/15/51 | 国債証券 | 1.8750 | 8,000 | 5,450 | 745,854 | 2051/11/15 | |
| USTB 3% 08/15/52 | 国債証券 | 3.0000 | 3,480 | 3,056 | 418,311 | 2052/08/15 | |
| USTB 4% 11/15/52 | 国債証券 | 4.0000 | 10,495 | 11,142 | 1,524,759 | 2052/11/15 | |
| USTB 3.625% 02/15/53 | 国債証券 | 3.6250 | 3,425 | 3,396 | 464,721 | 2053/02/15 | |
| UMBS 15YR 2.5% 05/01/2038 #TBA | 特殊債券 | 2.5000 | 9,725 | 9,032 | 1,236,044 | 2038/05/01 | |
| UMBS 30YR 2.5% 05/01/2053 #TBA | 特殊債券 | 2.5000 | 9,175 | 7,941 | 1,086,691 | 2053/05/01 | |
| UMBS 30YR 3% 05/01/2053 #TBA | 特殊債券 | 3.0000 | 10,425 | 9,368 | 1,281,946 | 2053/05/01 | |
| GNII II 3.5% 05/01/2053 #TBA | 特殊債券 | 3.5000 | 3,850 | 3,613 | 494,523 | 2053/05/01 | |
| GNII II 2.5% 05/01/2053 #TBA | 特殊債券 | 2.5000 | 3,450 | 3,053 | 417,806 | 2053/05/01 | |
| UMBS 30YR 2% 05/01/2053 #TBA | 特殊債券 | 2.0000 | 5,550 | 4,613 | 631,257 | 2053/05/01 | |
| GNII II 3% 05/01/2053 #TBA | 特殊債券 | 3.0000 | 15,250 | 13,929 | 1,906,133 | 2053/05/01 | |
| BPCE 4.625% 07/11/24 RGS | 社債券 | 4.6250 | 450 | 439 | 60,084 | 2024/07/11 | |
| HCA INC 5.375% 02/01/25 | 社債券 | 5.3750 | 2,500 | 2,499 | 342,065 | 2025/02/01 | |
| NEXTERA ENE CA 6.051% 03/01/25 | 社債券 | 6.0510 | 1,740 | 1,768 | 242,058 | 2025/03/01 | |
| AIB GR 4.263%/VAR 4/10/25 144A | 社債券 | 4.2630 | 4,125 | 4,049 | 554,129 | 2025/04/10 | |
| JPMORGAN CHASE 0.824%/VAR 6/25 | 社債券 | 0.8240 | 2,350 | 2,232 | 305,521 | 2025/06/01 | |
| GE HEALTH 5.6% 11/15/25 144A | 社債券 | 5.6000 | 1,500 | 1,519 | 207,901 | 2025/11/15 | |
| SOCGEN 2.226%/VAR 01/21/26 144A | 社債券 | 2.2260 | 2,535 | 2,363 | 323,411 | 2026/01/21 | |
| SOCGEN SOFR+105 01/21/26 RGS | 社債券 | 5.8785 | 1,000 | 974 | 133,364 | 2026/01/21 | |
| HCA INC 5.875% 02/15/26 | 社債券 | 5.8750 | 675 | 685 | 93,804 | 2026/02/15 | |
| MSTDW SOFR+95 02/18/26 | 社債券 | 5.5242 | 1,000 | 993 | 135,920 | 2026/02/18 | |
| DEERECAP FRN 5.145%/VAR 03/03/26 | 社債券 | 5.1200 | 3,150 | 3,140 | 429,731 | 2026/03/03 | |
| KENVUE INC 5.35% 03/22/26 144A | 社債券 | 5.3500 | 800 | 821 | 112,387 | 2026/03/22 | |
| HYUNDAI CAP AMR 5.5% 3/26 REGS | 社債券 | 5.5000 | 500 | 501 | 68,624 | 2026/03/30 | |
| LENNAR CORP 5.25% 06/01/2026 | 社債券 | 5.2500 | 100 | 100 | 13,720 | 2026/06/01 | |
| AIR LEASE CORP 1.875% 08/15/26 | 社債券 | 1.8750 | 2,868 | 2,548 | 348,749 | 2026/08/15 | |
| AERCAP IRELAND 2.45% 10/29/26 | 社債券 | 2.4500 | 4,050 | 3,631 | 496,919 | 2026/10/29 | |
| AIB 7.583%/VAR 10/14/26 144A | 社債券 | 7.5830 | 1,175 | 1,212 | 165,891 | 2026/10/14 | |
| ROYALBK SPRIX+59 11/02/26 | 社債券 | 5.0221 | 1,000 | 978 | 133,896 | 2026/11/02 | |
| BOA CORP 3.559%/VAR 4/23/27 | 社債券 | 3.5590 | 575 | 548 | 75,039 | 2027/04/23 | |
| ENERGY TRAN LP 4.2% 04/15/27 | 社債券 | 4.2000 | 1,275 | 1,231 | 168,566 | 2027/04/15 | |
| BANK IRE 2.029%/VAR 9/27 144A | 社債券 | 2.0290 | 1,475 | 1,287 | 176,185 | 2027/09/30 | |
| ENEL FIN AM 7.1% 10/14/27 144A | 社債券 | 7.1000 | 1,506 | 1,615 | 221,046 | 2027/10/14 | |
| DBSW SOFR+121.9 11/16/27 | 社債券 | 5.7935 | 2,050 | 1,843 | 252,245 | 2027/11/16 | |
| DEUTSCHE B 2.311%/VAR 11/16/27 | 社債券 | 2.3110 | 2,185 | 1,891 | 258,792 | 2027/11/16 | |
| GE HEALTHCARE 5.65% 11/27 144A | 社債券 | 5.6500 | 1,150 | 1,187 | 162,505 | 2027/11/15 | |
| AIR LEASE CORP 5.85% 12/15/27 | 社債券 | 5.8500 | 950 | 961 | 131,544 | 2027/12/15 | |
| SOCIETE GE 2.797%/VAR 1/19/28 144A | 社債券 | 2.7970 | 2,130 | 1,903 | 260,483 | 2028/01/19 | |
| NATIONWIDE B FRN 2/16/28 144A | 社債券 | 5.8645 | 4,925 | 4,737 | 648,313 | 2028/02/16 | |
| JPMORGAN FRN SOFR+118 2/24/28 | 社債券 | 5.7551 | 2,650 | 2,640 | 361,320 | 2028/02/24 | |

| 銘柄 | 種類 | 当期 | | | | 期末 | | 償還年月日 |
|---------------------------------|-----|--------|----------|----------|---------|-------|------------|-------|
| | | 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 | | | |
| | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | | | |
| ENERGY TRAN LP 5.55% 02/15/28 | 社債券 | 5.5500 | 696 | 709 | 97,105 | | 2028/02/15 | |
| AMGEN INC 5.15% 03/02/28 | 社債券 | 5.1500 | 1,541 | 1,577 | 215,828 | | 2028/03/02 | |
| KENVUE INC 5.05% 03/22/28 144A | 社債券 | 5.0500 | 1,179 | 1,221 | 167,090 | | 2028/03/22 | |
| HYUNDAI CAP AMR 5.6% 3/28 REGS | 社債券 | 5.6000 | 848 | 855 | 117,016 | | 2028/03/30 | |
| BOA CORP 6.204%/VAR 11/10/28 | 社債券 | 6.2040 | 1,095 | 1,141 | 156,233 | | 2028/11/10 | |
| US BANCORP DEL 4.653%/VAR 2/29 | 社債券 | 4.6530 | 1,781 | 1,733 | 237,146 | | 2029/02/01 | |
| HCA INC 3.375% 03/15/29 144A | 社債券 | 3.3750 | 775 | 707 | 96,823 | | 2029/03/15 | |
| HSBC HOLDINGS 6.161%/VAR 3/29 | 社債券 | 6.1610 | 868 | 892 | 122,156 | | 2029/03/09 | |
| DCP MIDSTREAM 5.125% 05/15/29 | 社債券 | 5.1250 | 900 | 892 | 122,096 | | 2029/05/15 | |
| NEXTERA ENER CA 2.25% 06/01/30 | 社債券 | 2.2500 | 500 | 424 | 58,076 | | 2030/06/01 | |
| DUKE ENERGY FLD 8.125% 8/16/30 | 社債券 | 8.1250 | 402 | 455 | 62,348 | | 2030/08/16 | |
| MSCI INC 3.625% 09/01/30 144A | 社債券 | 3.6250 | 2,530 | 2,182 | 298,660 | | 2030/09/01 | |
| AIR LEASE CORP 3.125% 12/01/30 | 社債券 | 3.1250 | 350 | 298 | 40,802 | | 2030/12/01 | |
| COMM BK AUS 2.688% 3/31 144A | 社債券 | 2.6880 | 2,944 | 2,342 | 320,597 | | 2031/03/11 | |
| MSCI INC 3.625% 11/01/31 144A | 社債券 | 3.6250 | 554 | 470 | 64,448 | | 2031/11/01 | |
| AERCAP IRELAND 3.3% 01/30/32 | 社債券 | 3.3000 | 1,800 | 1,474 | 201,746 | | 2032/01/30 | |
| BOA CORP 2.651%/VAR 03/11/32 | 社債券 | 2.6510 | 790 | 658 | 90,094 | | 2032/03/11 | |
| HCA INC 3.625% 03/15/32 144A | 社債券 | 3.6250 | 580 | 513 | 70,308 | | 2032/03/15 | |
| BROADCOM 4.15% 4/15/32 144A | 社債券 | 4.1500 | 779 | 711 | 97,371 | | 2032/04/15 | |
| WELLTOWER INC 3.85% 06/15/32 | 社債券 | 3.8500 | 1,012 | 909 | 124,464 | | 2032/06/15 | |
| ENEL FI INT 7.5% 10/14/32 144A | 社債券 | 7.5000 | 1,113 | 1,245 | 170,408 | | 2032/10/14 | |
| ANZ BKG GRP 6.742% 12/08/32 RE | 社債券 | 6.7420 | 1,162 | 1,219 | 166,813 | | 2032/12/08 | |
| ANZ BKG GRP 6.742% 12/32 144A | 社債券 | 6.7420 | 1,305 | 1,368 | 187,315 | | 2032/12/08 | |
| SOCGEN 3.337%/VAR 1/21/33 144A | 社債券 | 3.3370 | 2,150 | 1,758 | 240,607 | | 2033/01/21 | |
| ORACLE CORP 4.9% 02/06/33 | 社債券 | 4.9000 | 1,071 | 1,055 | 144,388 | | 2033/02/06 | |
| BP CAP MARKETS 4.812% 02/13/33 | 社債券 | 4.8120 | 1,067 | 1,085 | 148,537 | | 2033/02/13 | |
| FISERV INC 5.6% 03/02/33 | 社債券 | 5.6000 | 782 | 815 | 111,584 | | 2033/03/02 | |
| MET LIFE GBL 5.15% 3/33 144A | 社債券 | 5.1500 | 235 | 238 | 32,649 | | 2033/03/28 | |
| ASHTHEAD CAP 5.55% 5/30/33 144A | 社債券 | 5.5500 | 1,164 | 1,155 | 158,063 | | 2033/05/30 | |
| HSBC HLD PLC SFRIX+ 08/11/33 | 社債券 | 5.4020 | 1,249 | 1,237 | 169,402 | | 2033/08/11 | |
| HSBC HLDGS 8.113%/VAR 11/3/33 | 社債券 | 8.1130 | 1,068 | 1,205 | 164,926 | | 2033/11/03 | |
| BARCLAYSPLC 7.437%/VAR 11/33 | 社債券 | 7.4370 | 2,500 | 2,753 | 376,747 | | 2033/11/02 | |
| DEUTSCHE BA 7.079%/VAR 2/10/34 | 社債券 | 7.0790 | 720 | 673 | 92,173 | | 2034/02/10 | |
| REPUBLIC SVCS 5% 04/01/34 | 社債券 | 5.0000 | 610 | 624 | 85,392 | | 2034/04/01 | |
| BARCLAYSPL 3.564%/VAR 09/23/35 | 社債券 | 3.5640 | 725 | 578 | 79,208 | | 2035/09/23 | |
| WESTPAC B 2.668%/VAR 11/15/35 | 社債券 | 2.6680 | 1,350 | 1,059 | 144,951 | | 2035/11/15 | |
| ANZ B 2.57%/VAR 11/25/35 144A | 社債券 | 2.5700 | 1,116 | 871 | 119,293 | | 2035/11/25 | |
| BROADCOM 3.187% 11/15/36 RGS | 社債券 | 3.1870 | 450 | 341 | 46,664 | | 2036/11/15 | |
| BROADCOM 3.187% 11/15/36 144A | 社債券 | 3.1870 | 700 | 532 | 72,894 | | 2036/11/15 | |
| ABN A 3.324%/VAR 03/13/37 144A | 社債券 | 3.3240 | 800 | 621 | 85,012 | | 2037/03/13 | |
| GS GRP INC MTN 6.25% 2/01/41 | 社債券 | 6.2500 | 150 | 165 | 22,657 | | 2041/02/01 | |
| AERCAP LTD/TR 3.85% 10/29/41 | 社債券 | 3.8500 | 1,000 | 751 | 102,773 | | 2041/10/29 | |
| HCA INC 4.375% 03/15/42 144A | 社債券 | 4.3750 | 170 | 142 | 19,520 | | 2042/03/15 | |
| MAGALLANES 5.05% 03/15/42 144A | 社債券 | 5.0500 | 973 | 804 | 110,124 | | 2042/03/15 | |
| BARCLAYSPLC 3.33% 11/24/42 | 社債券 | 3.3300 | 1,184 | 857 | 117,371 | | 2042/11/24 | |
| HSBC HOLDING 6.332%/VAR 3/9/44 | 社債券 | 6.3320 | 868 | 914 | 125,104 | | 2044/03/09 | |
| ENERGY TRANSFER 6% 04/15/48 | 社債券 | 6.0000 | 800 | 763 | 104,543 | | 2048/06/15 | |
| ENERGY TRAN OP 6.25% 04/15/49 | 社債券 | 6.2500 | 425 | 421 | 57,691 | | 2049/04/15 | |
| WILLIS NORTH AM 3.875% 9/15/49 | 社債券 | 3.8750 | 4,300 | 3,139 | 429,634 | | 2049/09/15 | |
| AON CORP / AON 3.9% 02/28/52 | 社債券 | 3.9000 | 946 | 761 | 104,232 | | 2052/02/28 | |
| ENEL FIN 7.75% 10/14/52 144A | 社債券 | 7.7500 | 654 | 764 | 104,623 | | 2052/10/14 | |

| 銘柄 | 種類 | 利率 | 当期 | | | 償還年月日 |
|--------------------------------|------|--------|--------------|--------------|------------|------------|
| | | | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| MARSHMCLEN 6.25% 11/01/52 | 社債券 | 6.2500 | 501 | 574 | 78,601 | 2052/11/01 |
| SOCGEN 7.367% 01/10/53 144A | 社債券 | 7.3670 | 1,400 | 1,372 | 187,870 | 2053/01/10 |
| ORACLE CORP 5.55% 02/06/53 | 社債券 | 5.5500 | 962 | 924 | 126,470 | 2053/02/06 |
| MARSHMCLEN 5.45% 03/15/53 | 社債券 | 5.4500 | 504 | 524 | 71,819 | 2053/03/15 |
| CCO LLC/CAPITL 6.834% 10/23/5 | 社債券 | 6.8340 | 1,382 | 1,311 | 179,452 | 2055/10/23 |
| ANHEUSER BUSCH INBEV WORLD INC | 社債券 | 5.8000 | 1,565 | 1,752 | 239,851 | 2059/01/23 |
| MAGALLANE 5.391% 03/15/62 144A | 社債券 | 5.3910 | 960 | 770 | 105,475 | 2062/03/15 |
| UNITEDHEALTH GR 6.05% 02/15/63 | 社債券 | 6.0500 | 700 | 804 | 110,148 | 2063/02/15 |
| UNITEDHEALTH GR 5.2% 04/15/63 | 社債券 | 5.2000 | 875 | 892 | 122,097 | 2063/04/15 |
| 小計 | | - | 366,414 | 355,542 | 48,652,426 | - |
| (カナダ) | | | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | | |
| CANADA GOVT .25% 04/01/24 | 国債証券 | 0.2500 | 6,455 | 6,222 | 627,928 | 2024/04/01 |
| CANADA GOVT 2.25% 6/1/25 | 国債証券 | 2.2500 | 3,420 | 3,329 | 336,058 | 2025/06/01 |
| CANADA GOVT .5% 12/01/30 | 国債証券 | 0.5000 | 11,800 | 9,919 | 1,001,081 | 2030/12/01 |
| CANADA GOVT 1.5% 12/01/31 | 国債証券 | 1.5000 | 4,800 | 4,307 | 434,743 | 2031/12/01 |
| CANADA GOVT 2% 12/01/51 | 国債証券 | 2.0000 | 2,150 | 1,757 | 177,344 | 2051/12/01 |
| 小計 | | - | 28,625 | 25,536 | 2,577,156 | - |
| (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 | | |
| AUSTRALIA GOVT 1.25% 05/21/32 | 国債証券 | 1.2500 | 6,700 | 5,615 | 508,392 | 2032/05/21 |
| AUSTRALIA GOVT 3.75% 5/34 RGS | 国債証券 | 3.7500 | 2,145 | 2,212 | 200,338 | 2034/05/21 |
| AUSTRALIA GOVT 3% 3/21/47 RGS | 国債証券 | 3.0000 | 2,300 | 1,991 | 180,276 | 2047/03/21 |
| AUSTRALIA GOVT 1.75% 06/51 RGS | 国債証券 | 1.7500 | 4,587 | 2,931 | 265,389 | 2051/06/21 |
| BARCLAYS 2.064%/VAR 5/27 RGS | 社債券 | 2.0640 | 1,750 | 1,554 | 140,710 | 2027/05/20 |
| BARCLAY 3.382%/VAR 5/20/32 RGS | 社債券 | 3.3820 | 1,250 | 956 | 86,573 | 2032/05/20 |
| 小計 | | - | 18,732 | 15,262 | 1,381,681 | - |
| (ニュージーランド) | | | 千ニュージーランド・ドル | 千ニュージーランド・ドル | | |
| NEW ZEALAND GOV .5% 05/15/24 | 国債証券 | 0.5000 | 11,000 | 10,485 | 885,894 | 2024/05/15 |
| NEW ZEALAND GOV .5% 05/15/26 | 国債証券 | 0.5000 | 8,750 | 7,830 | 661,566 | 2026/05/15 |
| NEW ZEALAND GOV .25% 05/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 6,450 | 5,344 | 451,543 | 2028/05/15 |
| 小計 | | - | 26,200 | 23,659 | 1,999,004 | - |
| (イギリス) | | | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | | |
| UK GILT 1.25% 07/22/27 RGS | 国債証券 | 1.2500 | 8,530 | 7,731 | 1,328,354 | 2027/07/22 |
| UK GILT .875% 07/31/33 RGS | 国債証券 | 0.8750 | 15,350 | 11,628 | 1,998,043 | 2033/07/31 |
| UK GILT .625% 10/22/50 REGS | 国債証券 | 0.6250 | 2,700 | 1,181 | 202,925 | 2050/10/22 |
| UK GILT 1.25% 07/31/51 RGS | 国債証券 | 1.2500 | 1,425 | 757 | 130,193 | 2051/07/31 |
| UK GILT 1.75% 07/22/57 RGS | 国債証券 | 1.7500 | 4,325 | 2,534 | 435,521 | 2057/07/22 |
| HSBC HLD PL 1.75%/VAR 07/24/27 | 社債券 | 1.7500 | 1,628 | 1,431 | 245,960 | 2027/07/24 |
| DIRECT LINE IN 4% 06/05/32 RGS | 社債券 | 4.0000 | 3,200 | 2,448 | 420,708 | 2032/06/05 |
| MORGAN STA 5.789%/VAR 11/18/33 | 社債券 | 5.7890 | 1,300 | 1,321 | 227,140 | 2033/11/18 |
| HSBC HLD 8.201%/VAR 11/34 RGS | 社債券 | 8.2010 | 1,176 | 1,248 | 214,573 | 2034/11/16 |
| 小計 | | - | 39,634 | 30,284 | 5,203,420 | - |
| (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 | | |
| NORWAY GOVERNMENT BOND 2% 04/2 | 国債証券 | 2.0000 | 18,275 | 17,311 | 221,763 | 2028/04/26 |
| 小計 | | - | 18,275 | 17,311 | 221,763 | - |
| (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 | | |
| SWEDEN GOVT 1.375% 06/23/71 RE | 国債証券 | 1.3750 | 7,415 | 4,604 | 61,334 | 2071/06/23 |
| 小計 | | - | 7,415 | 4,604 | 61,334 | - |
| (メキシコ) | | | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | | |
| MEXICO UNITED 5.75% 03/05/26 | 国債証券 | 5.7500 | 86,850 | 78,602 | 597,891 | 2026/03/05 |
| MEXICO GOVT 7.75% 5/29/31 | 国債証券 | 7.7500 | 72,800 | 68,426 | 520,489 | 2031/05/29 |
| 小計 | | - | 159,650 | 147,029 | 1,118,380 | - |

| 銘柄 | 種類 | 利率 | 当期 | | | 償還年月日 |
|--|---|--|---|---|---|--|
| | | | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (インドネシア) INDONESIA GOVT 7% 5/15/27 | 国債証券 | 7.0000 | 千インドネシア・ルピア 28,776,000 | 千インドネシア・ルピア 29,512,090 | 千円 277,413 | 2027/05/15 |
| 小計 | | - | 28,776,000 | 29,512,090 | 277,413 | - |
| (チェコ) CZECH REPUBLIC .25% 02/10/27 | 国債証券 | 0.2500 | 千チェコ・コルナ 55,280 | 千チェコ・コルナ 46,446 | 297,488 | 2027/02/10 |
| 小計 | | - | 55,280 | 46,446 | 297,488 | - |
| (韓国) KOREA REPUBLIC OF 2.625% 06/10 KOREA GOVT 1.5% 12/10/30 | 国債証券 国債証券 | 2.6250 1.5000 | 千韓国・ウォン 2,320,200 15,016,960 | 千韓国・ウォン 2,243,540 13,140,590 | 229,065 1,341,654 | 2028/06/10 2030/12/10 |
| 小計 | | - | 17,337,160 | 15,384,131 | 1,570,719 | - |
| (中国) CHINA GOVT 1.99% 04/09/25 CHINA GOVT 3.27% 11/19/30 CHINA GOVT 3.02% 05/27/31 CHINA GOVT 2.89% 11/18/31 CHINA GOVT 2.8% 11/15/32 | 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 | 1.9900 3.2700 3.0200 2.8900 2.8000 | 千オフショア・人民元 52,170 33,000 30,000 56,640 170,000 | 千オフショア・人民元 51,747 34,300 30,507 56,963 169,578 | 1,019,543 675,792 601,058 1,122,310 3,341,084 | 2025/04/09 2030/11/19 2031/05/27 2031/11/18 2032/11/15 |
| 小計 | | - | 341,810 | 343,096 | 6,759,788 | - |
| (ポーランド) POLAND GOVT .25% 10/25/26 POLAND GOVT 1.25% 10/25/30 | 国債証券 国債証券 | 0.2500 1.2500 | 千ポーランド・ズロチ 6,675 7,450 | 千ポーランド・ズロチ 5,512 5,406 | 180,864 177,408 | 2026/10/25 2030/10/25 |
| 小計 | | - | 14,125 | 10,918 | 358,273 | - |
| (ユーロ…アイルランド) AIB GROUP 2.25%/VAR 04/28 RGS PTSB EUAMDB01+350 4/25/28 RGS AIB GROUP PLC 4.625% 07/23/29 RGS AIB GR 2.875%/VAR 05/30/31 RGS BANKIR 1.375%/VAR 08/11/31 RGS | 社債券 社債券 社債券 社債券 社債券 | 2.2500 6.6250 4.6250 2.8750 1.3750 | 千ユーロ 1,097 1,729 725 765 1,818 | 千ユーロ 1,001 1,751 716 694 1,569 | 150,761 263,640 107,929 104,522 236,244 | 2028/04/04 2028/04/25 2029/07/23 2031/05/30 2031/08/11 |
| 小計 | | - | 6,134 | 5,732 | 863,098 | - |
| (ユーロ…オランダ) ING GROEP 4.875%/VAR 11/27 RGS ABN AMRO BANK 4.25% 02/21/30 R DIGITAL DUT 1.25% 02/01/31 RGS PROSUS NV 1.985% 07/13/33 RGS ING GROEP 5.25%/VAR 11/33 RGS ABN AMRO BK 4.5% 11/21/34 RGS NN GROUP 6%/VAR 11/03/43 RGS ASR NEDERLA 7%/VAR 12/7/43 RGS VOLKSWA 4.375%/VAR PERP RGS VWIF 3.748%/VAR PERP RGS RABOBANK NEDERLAND 4.875% PERP RGS | 社債券 社債券 社債券 社債券 社債券 社債券 社債券 社債券 社債券 社債券 社債券 | 4.8750 4.2500 1.2500 1.9850 5.2500 4.5000 6.0000 7.0000 4.3750 3.7480 4.8750 | 900 1,500 2,450 1,475 1,400 900 791 971 1,900 900 1,200 | 920 1,498 1,836 1,015 1,475 902 791 1,016 1,564 778 1,014 | 138,595 225,608 276,532 152,944 222,164 135,833 119,173 153,081 235,609 117,203 152,762 | 2027/11/14 2030/02/21 2031/02/01 2033/07/13 2033/11/14 2034/11/21 2043/11/03 2043/12/07 2049/12/31 2049/12/31 2049/12/31 |
| 小計 | | - | 14,387 | 12,816 | 1,929,507 | - |
| (ユーロ…フランス) EDF 4.25% 01/25/32 RGS EDF 4.625% 01/25/43 RGS BNPSA 0.875%/VAR 07/11/30 RGS BPCE 1% 01/14/32 RGS BPCE 4.5% 01/13/33 RGS BFCM PARIS 5.125% 01/13/33 RGS CREDIT AGR 3.875% 11/28/34 RGS BPCE SA 5.125%/VAR 1/25/35 RGS TOTALENERGI 3.25%/VAR PERP RGS ORANGE EUSA5+ PERP REGS | 特殊債券 特殊債券 社債券 社債券 社債券 社債券 社債券 社債券 社債券 社債券 | 4.2500 4.6250 0.8750 1.0000 4.5000 5.1250 3.8750 5.1250 3.2500 5.3750 | 1,100 1,100 2,400 2,900 1,400 1,700 1,500 700 3,317 700 | 1,088 1,038 1,953 2,247 1,405 1,672 1,491 679 2,430 695 | 163,809 156,301 294,103 338,352 211,526 251,822 224,546 102,267 365,871 104,722 | 2032/01/25 2043/01/25 2030/07/11 2032/01/14 2033/01/13 2033/01/13 2034/11/28 2035/01/25 2049/12/31 2049/12/31 |
| 小計 | | - | 16,817 | 14,701 | 2,213,324 | - |

| 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 | |
| GERMANY GOVT 0% 12/15/23 RGS | 国債証券 | 0.0000 | 5,960 | 5,853 | 881,306 | 2023/12/15 |
| GERMANY GOVT 1.3% 10/15/27 RGS | 国債証券 | 1.3000 | 7,560 | 7,234 | 1,089,092 | 2027/10/15 |
| GERMANY GOVT 0% 02/15/32 REGS | 国債証券 | 0.0000 | 27,440 | 22,547 | 3,394,600 | 2032/02/15 |
| GERMANY GOVT 1.7% 08/15/32 RGS | 国債証券 | 1.7000 | 13,860 | 13,194 | 1,986,367 | 2032/08/15 |
| GERMANY GOVT 3.25% 7/04/42 | 国債証券 | 3.2500 | 2,330 | 2,601 | 391,707 | 2042/07/04 |
| GERMANY GOVT 0% 08/15/52 REGS | 国債証券 | 0.0000 | 6,576 | 3,334 | 501,948 | 2052/08/15 |
| RWEAG 4.125% 02/13/35 RGS | 社債証券 | 4.1250 | 511 | 501 | 75,536 | 2035/02/13 |
| BAYER AG 5.375%/VAR 3/82 RGS | 社債証券 | 5.3750 | 700 | 639 | 96,338 | 2082/03/25 |
| 小計 | | — | 64,937 | 55,907 | 8,416,897 | — |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | | |
| CELLNEX CONV .75% 11/20/31 RGS | 新株予約権付社債 | 0.7500 | 300 | 239 | 36,053 | 2031/11/20 |
| BANCO 5.125%/VAR 11/10/28 RGS | 社債証券 | 5.1250 | 1,100 | 1,113 | 167,701 | 2028/11/10 |
| CELLNEX FINANCE 1.25% 01/15/29 | 社債証券 | 1.2500 | 900 | 755 | 113,742 | 2029/01/15 |
| BANCO DE SABADE 5.25% 02/07/29 RE | 社債証券 | 5.2500 | 1,900 | 1,826 | 274,977 | 2029/02/07 |
| CELLNEX FINANCE 2% 02/15/33 RE | 社債証券 | 2.0000 | 1,300 | 1,022 | 153,910 | 2033/02/15 |
| CAIXABANK SA VAR 02/23/33 REGS | 社債証券 | 6.2500 | 800 | 814 | 122,558 | 2033/02/23 |
| 小計 | | — | 6,300 | 5,771 | 868,944 | — |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | | |
| TERNA 2.375%/VAR PERP RGS | 社債証券 | 2.3750 | 1,105 | 921 | 138,700 | 2049/12/31 |
| 小計 | | — | 1,105 | 921 | 138,700 | — |
| (ユーロ…その他) | | | | | | |
| POLAND GOVT 4.25% 02/14/43 RGS | 国債証券 | 4.2500 | 1,525 | 1,472 | 221,674 | 2043/02/14 |
| EUROPEAN UNION 2.5% 10/04/52 R | 特殊債券 | 2.5000 | 2,552 | 2,134 | 321,305 | 2052/10/04 |
| EUROPEAN UNION 3% 03/04/53 RGS | 特殊債券 | 3.0000 | 970 | 896 | 135,000 | 2053/03/04 |
| MITSUB 3.273%/VAR 09/19/25 RGS | 社債証券 | 3.2730 | 1,153 | 1,135 | 170,968 | 2025/09/19 |
| CREDIT SUISSE 2.125% 10/13/26 RGS | 社債証券 | 2.1250 | 1,854 | 1,696 | 255,352 | 2026/10/13 |
| TORONTO 2.551% 8/03/27 RGS | 社債証券 | 2.5510 | 1,237 | 1,166 | 175,650 | 2027/08/03 |
| MSTDW 0.406%/VAR 10/29/27 | 社債証券 | 0.4060 | 850 | 744 | 112,072 | 2027/10/29 |
| HSBC HOL 4.752%/VAR 3/10/28 RGS | 社債証券 | 4.7520 | 2,177 | 2,209 | 332,624 | 2028/03/10 |
| UBS GROUP AG 4.625% 03/17/28 REGS | 社債証券 | 4.6250 | 1,186 | 1,183 | 178,175 | 2028/03/17 |
| MSTDW 4.656%/VAR 3/2/29 | 社債証券 | 4.6560 | 1,179 | 1,199 | 180,611 | 2029/03/02 |
| WESTPAC BANK 3.799% 01/30 RGS | 社債証券 | 3.7990 | 2,450 | 2,433 | 366,361 | 2030/01/17 |
| BOA CO 0.694%/VAR 03/22/31 RGS | 社債証券 | 0.6940 | 640 | 506 | 76,245 | 2031/03/22 |
| HSBC 4.7870%/VAR 03/10/32 RGS | 社債証券 | 4.7870 | 1,672 | 1,697 | 255,520 | 2032/03/10 |
| UBS GROUP 4.75%/VAR 3/32 RGS | 社債証券 | 4.7500 | 993 | 989 | 148,963 | 2032/03/17 |
| MSTDW 2.95%/VAR 05/07/32 | 社債証券 | 2.9500 | 1,772 | 1,604 | 241,495 | 2032/05/07 |
| SWEDBANK 3.625%/VAR 08/32 RGS | 社債証券 | 3.6250 | 667 | 619 | 93,315 | 2032/08/23 |
| HSBC HOLD 6.364%/VAR 11/32 RGS | 社債証券 | 6.3640 | 1,702 | 1,745 | 262,721 | 2032/11/16 |
| ANZ BKG GR 5.101%/VAR 2/33 RGS | 社債証券 | 5.1010 | 2,777 | 2,738 | 412,266 | 2033/02/03 |
| TEMASEK FIN 3.5% 02/15/33 RGS | 社債証券 | 3.5000 | 1,707 | 1,706 | 256,932 | 2033/02/15 |
| BOA CORP 2.824%/VAR 4/27/33 RGS | 社債証券 | 2.8240 | 765 | 674 | 101,615 | 2033/04/27 |
| BARCLAYSPLC VAR 01/29/34 | 社債証券 | 5.2620 | 1,020 | 1,025 | 154,387 | 2034/01/29 |
| HONEYWELL INTL 4.125% 11/02/34 | 社債証券 | 4.1250 | 1,202 | 1,226 | 184,661 | 2034/11/02 |
| 小計 | | — | 32,050 | 30,806 | 4,637,922 | — |
| 合計 | | — | — | — | 89,547,247 | — |

(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) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | 当 期 末 | |
|---------------|-------|-------|
| | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 外国 | 百万円 | 百万円 |
| LONG GILT FUT | 400 | — |
| EURO BOBL FUT | — | 195 |

(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) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) スワップ及び先渡取引残高

| 種 類 | 取 引 契 約 残 高 | |
|----------------|-----------------|------------|
| | 当 期 末 想 定 元 本 額 | |
| | 買 建 | 売 建 |
| 直物為替先渡取引 (NDF) | 百万円 736 | 百万円 156 |

(注) 金額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

(2023年5月1日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-----------------|--------------|----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 新株予約権付社債 (転換社債) | 千円 36,053 | % 0.0 |
| 公 社 債 | 89,511,194 | 85.9 |
| コーポレートローン等、その他 | 14,638,521 | 14.1 |
| 投資信託財産総額 | 104,185,769 | 100.0 |

(注1) 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、5月1日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.84円、1カナダ・ドル=100.92円、1オーストラリア・ドル=90.53円、1香港・ドル=17.43円、1シンガポール・ドル=102.46円、1ニュージーランド・ドル=84.49円、1イギリス・ポンド=171.82円、1デンマーク・クローネ=20.20円、1ノルウェー・クローネ=12.81円、1スウェーデン・クローナ=13.32円、1メキシコ・ペソ=7.606円、100インドネシア・ルピア=0.94円、1チェコ・コルナ=6.405円、100韓国・ウォン=10.21円、1オーストラリア・人民元=19.702円、1マレーシア・リンギット=30.65円、1南アフリカ・ランド=7.47円、1ポーランド・ズロチ=32.812円、1ユーロ=150.55円です。

(注2) 当期末における外貨建資産 (96,006,822千円) の投資信託財産総額 (104,185,769千円) に対する比率は、92.1%です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■特定資産の価格等の調査について

調査を行った者の氏名又は名称

有限責任監査法人トーマツ

調査の結果及び方法の概要

調査依頼を行った取引は2022年5月3日から2023年5月1日までの間でノンデリバラブルフォワード(以下「NDF」という。)取引53件でした。これらのNDF取引について、「投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)」第11条第2項に基づいて比較可能なレートのほか、現地約定日、取引の相手方の名称、約定通貨、決済通貨、約定金額(約定通貨建)、約定金額(決済通貨建)、売買の別及び決済日に関して、有限責任監査法人トーマツに調査を委託し、日本公認会計士協会が公表した専門業務実務指針4460「投資信託及び投資法人における特定資産の価格等の調査に係る合意された手続業務に関する実務指針」に基づく調査結果として合意された手続実施結果報告書を入手しています。

なお、本調査は財務諸表監査の一部ではなく、また価格の妥当性や内部管理体制について保証を提供するものではありません。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2023年5月1日現在)

| 項目 | 当期末 |
|----------------|-----------------|
| (A) 資産 | 129,619,036,748 |
| コース・ローン等 | 12,821,252,896 |
| 公社債(評価額) | 89,547,247,894 |
| 未収入金 | 26,368,398,432 |
| 未収利息 | 606,270,377 |
| 前払費用 | 232,171,454 |
| 差入委託証拠金 | 43,695,695 |
| (B) 負債 | 33,551,157,152 |
| 未払金 | 33,419,789,017 |
| 未払解約金 | 131,353,563 |
| その他未払費用 | 14,572 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 96,067,879,596 |
| 元本 | 32,943,890,039 |
| 次期繰越損益金 | 63,123,989,557 |
| (D) 受益権総口数 | 32,943,890,039口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 29,161円 |

(注1) 当ファンドの期首元本額、期中追加設定元本額、期中一部解約元本額は以下の通りです。

| | |
|-----------|-----------------|
| 期首元本額 | 25,431,428,877円 |
| 期中追加設定元本額 | 15,576,592,294円 |
| 期中一部解約元本額 | 8,064,131,132円 |

(注2) 当ファンドの当期末元本額の内訳は以下の通りです。

| | |
|---|-----------------|
| フィデリティ・グローバル・ボンド・ファンド(除く日本円、適格機関投資家専用) | 211,686,143円 |
| フィデリティ・グローバル・ボンド・ファンド(除く日本円、為替ヘッジあり、非課税適格機関投資家専用) | 897,277,769円 |
| フィデリティ・インスティテューショナル・グローバル・ボンド・ファンド(除く日本円、為替ヘッジあり、適格機関投資家転売制限付き) | 893,555,318円 |
| フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Aコース(ダイワ投資一任専用) | 3,611,117,918円 |
| フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド Bコース(ダイワ投資一任専用) | 2,577,707,339円 |
| フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用) | 2,150,094,961円 |
| フィデリティ外国債券アクティブ・ファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用) | 13,717,440,361円 |
| フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用) | 5,180,256,829円 |
| フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(SMA専用) | —円 |
| フィデリティ・インスティテューショナル・グローバル・ボンド・ファンド(除く日本円、為替ヘッジなし、適格機関投資家転売制限付き) | 1,744,291,351円 |
| フィデリティ・インスティテューショナル・グローバル・バランス・プラス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家転売制限付き) | 1,960,462,050円 |

(注3) 上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

■損益の状況

当期 自2022年5月3日 至2023年5月1日

| 項目 | 当期 |
|--------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益 | 2,314,127,165 |
| 受取利息 | 2,313,321,767 |
| その他収益 | 805,398 |
| (B) 有価証券売買損益 | 1,418,049,193 |
| 売却益 | 11,244,170,000 |
| 売却損 | △9,826,120,807 |
| (C) 先物取引等損益 | △53,804,007 |
| 取引益 | 128,309,644 |
| 取引損 | △182,113,651 |
| (D) 信託報酬等 | △10,174,338 |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 3,668,198,013 |
| (F) 前期繰越損益金 | 45,731,084,920 |
| (G) 解約差損益金 | △14,685,622,290 |
| (H) 追加信託差損益金 | 28,410,328,914 |
| (I) 合計(E+F+G+H) | 63,123,989,557 |
| 次期繰越損益金(I) | 63,123,989,557 |

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (D)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せん。

(注3) (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。

(注4) (H)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＞

●2022年9月1日付で当ファンドの投資信託約款について、運用の指図に関する権限の委託先にFIL(ルクセンブルグ)・エスエイを追加いたしました。