

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成30年9月14日

【発行者名】 ブラックロック・ジャパン株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役会長 井澤 吉幸

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【事務連絡者氏名】 猪浦 純子

【電話番号】 03-6703-7940

【届出の対象とした募集内国投資信託
受益証券に係るファンドの名称】 ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー
(愛称：BR Win)

【届出の対象とした募集内国投資信託
受益証券の金額】 1兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

(注) 本書において文中および表中の数字は四捨五入された数値として表示されている場合があり、従って合計として表示された数字はかかる数値の総和と必ずしも一致するとは限りません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー

(ファンドの愛称を「BR Win」とします。以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。)

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

当初元本は、1口当り1円です。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるブラックロック・ジャパン株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

購入受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額につきましては、販売会社または下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号：03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(5)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額に3.24%（税抜3.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳細は販売会社にお問い合わせください。

（販売会社につきましては、「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。）

なお、購入時手数料には消費税に相当する金額および地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）が含まれています（以下同じ。）。

分配金の受取方法により、「一般コース」、「累積投資コース」の2つのコースがあります。「累積投資コース」を選択した投資者が、分配金を再投資する場合は、無手数料とします。

(6)【申込単位】

分配金の受取方法により、収益の分配時に分配金を受け取る「一般コース」と、分配金が税引き後、無手数料で再投資される「累積投資コース」の2つの申込方法があります。

- ・一般コース：1万口以上1万口単位
- ・累積投資コース：1万円以上1円単位

ただし、「累積投資コース」を選択した投資者が収益分配金を再投資する場合は1円単位とします。なお、販売会社により上記と異なる購入時の申込単位（以下「購入単位」といいます。）を別に定める場合があります。また、取扱いを行なうコースは、各販売会社により異なります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(7)【申込期間】

2018年9月15日から2019年3月15日まで

申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8)【申込取扱場所】

当ファンドの申込取扱場所（以下「販売会社」といいます。）については下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号：03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(9)【払込期日】

投資者は、販売会社が定める日までに、購入代金（購入受付日の翌営業日の基準価額に購入口数を乗じた金額に、購入時手数料を加算した金額をいいます。）を販売会社に支払うものとします。

振替受益権に係る各購入受付日の発行価額の総額は、販売会社によって追加信託が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10)【払込取扱場所】

上記「(8)申込取扱場所」で払い込みください。

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

(12)【その他】

購入代金の利息

購入代金には利息をつけません。

日本以外の地域における発行

行ないません。

購入不可日

ルクセンブルグの銀行の休業日、12月24日、その他投資対象ファンドの受付不可日のいずれかに該当する場合には、販売会社の営業日であっても購入は受け付けません。詳細は販売会社にお問い合わせください。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

投資信託振替制度とは、

- ・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。
- ・ファンドの設定、換金、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」（ファンドの愛称を「BR Win」とします。以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。）は、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行ないます。

当ファンドは、追加型証券投資信託であり、追加型投信／海外／債券に属しています。下記は、一般社団法人投資信託協会の「商品分類に関する指針」に基づき当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

<商品分類表>

単字型・追加型	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単字型投信 追加型投信	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産（ ） 資産複合

<属性区分表>

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 不動産投信 その他資産 (投資信託証券(債券)) 資産複合 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 (隔月) 年12回(毎月) 日々 その他	グローバル (日本を含む) 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東(中東) エマージング	ファミリー ファンド ファンド・オブ・ ファンズ	あり () なし

<各分類および区分の定義>

．商品分類

単位型投信・追加型投信の区分	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
投資対象地域による区分	海外	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資対象資産による区分	債券	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

．属性区分

投資対象資産による属性区分	その他資産（投資信託証券（債券））	目論見書又は投資信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいう。ただし、当ファンドは、投資信託証券を通じて主として債券に投資する。
決算頻度による属性区分	年12回（毎月）	目論見書又は投資信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいう。
投資対象地域による属性区分	グローバル（日本を含む）	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資形態による属性区分	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。
為替ヘッジによる属性区分	為替ヘッジなし	目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行なう旨の記載がないものをいう。なお、「為替ヘッジ」とは、対円での為替リスクに対するヘッジの有無をいう。

上記は、一般社団法人投資信託協会の定義を基に委託会社が作成したものを含まず。なお、上記以外の商品分類・属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

信託金の限度額は、5,000億円です。ただし、委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

ファンドの特色

- a. 主として、先進国の国債および投資適格債、先進国の高利回り社債（ハイ・イールド債）、エマージング諸国の債券等、世界の公社債を主要な投資対象とし、ブラックロック・グループの運用会社が運用する投資信託証券に投資します。副次的な投資対象として、一部を優先証券、転換社債、株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）に投資を行なう投資信託証券を含みます。

主要投資対象ファンドの投資対象

<p>先進国の 国債・政府機関債</p> <p>先進国の 政府または政府機関等により 発行される債券</p>	<p>エマージング諸国のソブリン債</p> <p>エマージング諸国の政府等により 発行される債券</p>	<p>先進国の地方債</p> <p>先進国の地方自治体により 発行される債券</p>
<p>資産担保証券 (ABS、MBS等)</p> <p>クレジットカード債権、 自動車ローン、住宅ローン債権等を 裏付けとして発行される債券</p>	<p>投資適格社債</p> <p>企業等により発行される 債券のうち信用格付けが高い (BBB格以上)とされる債券</p>	<p>ハイ・イールド債</p> <p>信用格付けが低く(BB格相当以下 もしくは格付けされていない)、 価格変動のリスクが大きい分、 高い利回りが期待される債券</p>

主要投資対象ファンドにおいては、各セクターへの投資割合に制限を設けません。したがって、資産担保証券についても投資適格・非投資適格にかかわらず相当割合の投資を行なうことができます。また、投資する資産担保証券の中には収益率向上のためデリバティブ取引等を活用するものも含まれます。資産担保証券への投資に伴う「期限前償還リスク」、「デリバティブ取引のリスク」、その他当ファンドにかかる投資リスクについては後述の投資リスクの記載の内容をご確認ください。主要投資対象ファンドの投資対象は今後変更となることがあります。

主要投資対象ファンドの投資アプローチ

特定の市場指数にとらわれないアクティブかつフレキシブルな運用により、収益率の向上、インカム収入の獲得を目指します。

■柔軟性の高い運用

- ・セクター間の相関や各市場に対する連動性に配慮し、価格変動を抑え、魅力的な収益率やインカム収入の確保を目指します。
- ・償還年限、セクター、地域配分、通貨配分等に制約を設けず、運用チームの判断による柔軟な運用を目指します。

■リスクコントロール

- ・投資しているセクターにおけるリスクを様々な面からモニターします。デリバティブ取引等を利用し、リスクコントロールを行ないます。

※上記は主要投資対象ファンドにおける投資アプローチを説明するものです。将来変更される可能性があります。

- b. 投資対象とする投資信託証券（以下「投資対象ファンド」ということがあります。）は以下の通りです。
- ・ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラスJ投資証券（ルクセンブルグ籍証券投資法人、以下「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」といいます。）
 - ・ブラックロック・グローバル・ファンズ USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスX投資証券（ルクセンブルグ籍証券投資法人、以下「BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド」といいます。）
- 投資対象ファンドは、委託会社の判断により、変更することがあります。

c．当ファンドはファンド・オブ・ファンズ形式で運用します。

各投資信託証券への投資比率は、原則として、市況環境および投資対象ファンドの収益性等を勘案して委託会社が決定します。通常、BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ取得される投資信託証券）への投資比率を高位に保ちます。

d．原則として、毎月分配を行いません。

毎月20日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行ない、分配金をお支払いします。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

【イメージ図】



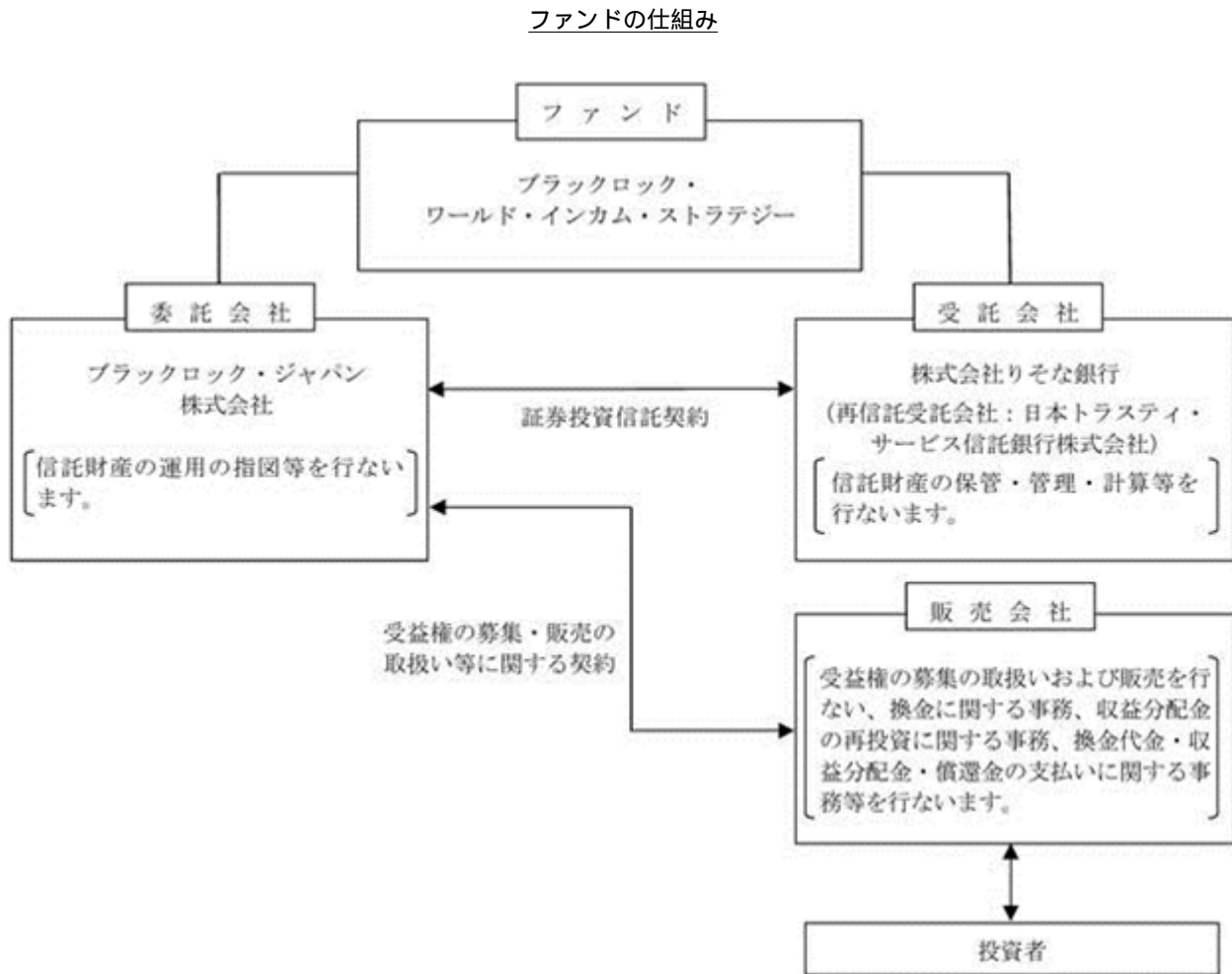
※上図はイメージであり、将来の分配金のお支払いおよび金額について示唆、保証するものではありません。

e．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。

(2) 【ファンドの沿革】

2005年7月7日	信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始
2006年10月1日	ファンド名称を変更 「メリルリンチ・ワールド・インカム・ストラテジー」から「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」へ変更
2007年1月4日	投資信託振替制度への移行
2009年12月2日	ファンドの委託会社としての業務をブラックロック・ジャパン株式会社からパークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社（新社名：ブラックロック・ジャパン株式会社）に承継

(3)【ファンドの仕組み】



< 契約等の概要 >

a. 「証券投資信託契約」

ファンドの設定・運営に関する事項、信託財産の運用・管理に関する事項、委託会社および受託会社の業務に関する事項、投資者に関する事項等について規定しています。

b. 「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」

委託会社が販売会社に委託する受益権の募集販売の取扱い、換金事務、投資者に対する収益分配金および換金代金の支払い、その他これらの業務に付随する業務等について規定しています。

< ファンド・オブ・ファンズの仕組み >

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



< 委託会社の概況 >

2018年6月末現在の委託会社の概況は、以下のとおりです。

a . 資本金 3,120百万円

b . 沿革

1985年1月	メリルリンチ投資顧問株式会社 (後のメリルリンチ・インベストメント・マネジャーズ株式会社)設立 1987年3月 証券投資顧問業者として登録 1987年6月 投資一任業務認可を取得 1997年12月 投資信託委託業務免許を取得
1988年3月	パークレイズ・デズート・ウェッド投資顧問株式会社 (後のパークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社)設立 1988年6月 証券投資顧問業者として登録 1989年1月 投資一任業務認可を取得 1998年3月 投資信託委託業務免許を取得
1999年4月	野村ブラックロック・アセット・マネジメント株式会社 (後のブラックロック・ジャパン株式会社)設立 1999年6月 証券投資顧問業者として登録 1999年8月 投資一任業務認可を取得
2006年10月	メリルリンチ・インベストメント・マネジャーズ株式会社を存続会社として、 ブラックロック・ジャパン株式会社と合併 新会社商号:「ブラックロック・ジャパン株式会社」
2009年12月	パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社を存続会社として、 ブラックロック・ジャパン株式会社と合併 新会社商号:「ブラックロック・ジャパン株式会社」

c . 大株主の状況

株主名	住所	所有 株式数	所有比率
ブラックロック・ジャパン・ ホールディングス合同会社	東京都千代田区丸の内一丁目8番3号	15,000株	100%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

主として、先進国の国債および投資適格債、先進国の高利回り社債（ハイ・イールド債）、エマージング諸国の債券等、世界の公社債を主要な投資対象とし、ブラックロック・グループの運用会社が運用する投資信託証券に投資します。副次的な投資対象として、一部を優先証券、転換社債、株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）に投資を行なう投資信託証券を含みます。投資対象とする投資信託証券は別に定めるものとします。

各投資信託証券への投資比率は、原則として、市況動向および各投資信託証券の収益性等を勘案して委託会社が決定します。通常、ファンド・オブ・ファンズにのみ取得される投資信託証券への投資比率を高位に保ちます。

別に定める投資信託証券は、委託会社の判断により、変更することがあります。

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。

資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

投資対象ファンドの選定にあたっては、上記の投資方針の他、当ファンドの運営上の効率性等を勘案します。

委託会社は、自己または第三者の利益を図るために投資者の利益を害することとなる潜在的なおそれのある取引を行ないまたは行なうことがある場合、投資者の利益を害しないことを確保するため、売買執行管理規程等の社内規程により管理します。

(2)【投資対象】**投資対象とする資産の種類**

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律（以下「投信法」といいます。）第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）とします。

- a．有価証券
- b．金銭債権
- c．約束手形（手形割引市場において売買される手形に限ります。）

投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として別に定める投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）および投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- a．国債証券
- b．短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）第66条第1号に規定する短期社債、保険業法第61条の10第1項に規定する短期社債、資産の流動化に関する法律第2条第8項に関する特定短期社債、信用金庫法第54条の4第1項に規定する短期債および農林中央金庫法第62条の2第1項に規定する短期農林債をいいます。）
- c．コマーシャル・ペーパー
- d．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- e．外国法人が発行する譲渡性預金証書

投資対象とする金融商品

この信託の設定、換金、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することの指図ができます。

- a．預金
- b．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- c．コール・ローン
- d．手形割引市場において売買される手形

投資対象ファンドの概要

投資方針における「別に定める投資信託証券」の概要は以下の通りです。

- (a) B G F フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ取得される投資信託証券）

形態	ルクセンブルグ籍（オープン・エンド型）会社型外国投資証券（米ドル建て）
投資目的および投資態度	ファンドはトータル・リターンの最大化を目指します。ファンドは、少なくとも純資産の70%を世界各国の政府、政府関連機関、企業が様々な通貨建てで発行する譲渡性のある債券に投資をします。非投資適格債を含むあらゆる種別の有価証券を投資対象とし、これらを有効利用します。通貨エクスポージャーについては柔軟に運用します。 また、ファンドは、投資適格、非投資適格に係わらず、資産担保証券（ABS、MBS）に純資産の50%を上限として投資を行なうことができます。
設定日	2007年1月31日
存続期間	無期限
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。 ・純資産総額の5%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。
管理報酬	ありません。（注）
その他費用	保管報酬および事務の処理に要する諸費用がファンドから差し引かれます。
決算日	年1回（原則として8月末日）に決算を行ないます。
収益分配方針	毎月（原則として毎月末営業日）に分配を行ないます。
申込手数料	ありません。
管理会社	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミテッド、ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク、ブラックロック（シンガポール）リミテッド（副投資顧問会社：ブラックロック・インベストメント・マネジメント（オーストラリア）リミテッド）
保管会社	ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン（インターナショナル）リミテッド

（注） 投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

(b) BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

形態	ルクセンブルグ籍（オープン・エンド型）会社型外国投資証券（米ドル建て）
投資目的および投資態度	純資産総額の80%以上を投資適格債に投資し、トータル・リターンを最大化することを目指します。純資産総額の70%以上をデュレーションが5年未満の米ドル建て投資適格債に投資し、ファンドの平均デュレーションは3年以下を原則とします。 通貨エクスポージャーについては柔軟に運用します。
設定日	2002年10月31日
存続期間	無期限
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。 ・純資産総額の5%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。
管理報酬	ありません。（注）
その他費用	保管報酬および事務の処理に要する諸費用がファンドから差し引かれます。
決算日	年1回（原則として8月末日）に決算を行ないます。
収益分配方針	分配を行ないません。
申込手数料	ありません。
管理会社	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク （副投資顧問会社：ブラックロック・インベストメント・マネジメント（オーストラリア）リミテッド）
保管会社	ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン（インターナショナル）リミテッド

（注） 投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

(3)【運用体制】

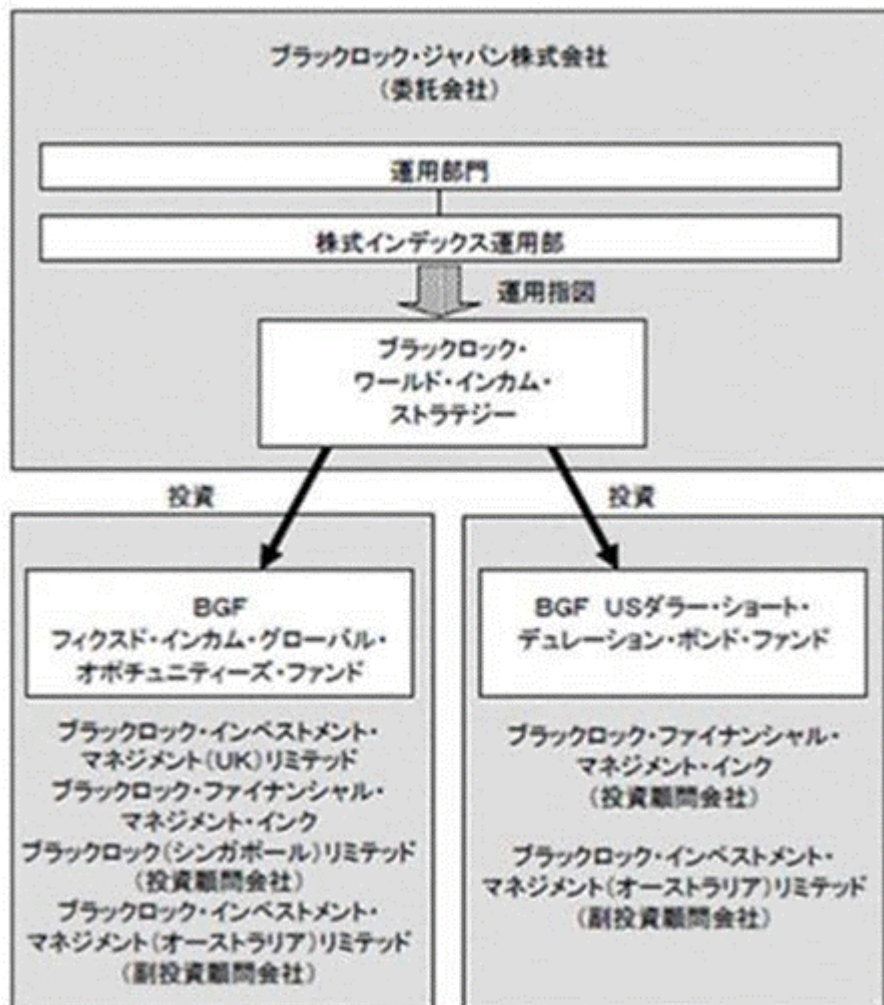
ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

ファンドの運用については委託会社の運用部門が統括しています。

社内には内部監査を担当する部門、ファンドの運用状況やリスク状況等をモニターし関連部署にフィードバックする部門、或いは投資委員会等開催により、各ファンドの投資方針等にしがって運用が行なわれているか確認する組織、機能が確立しています。

当ファンドの運用は、株式インデックス運用部（当ファンド担当：7名程度）が担当いたします。

運用体制図



運用体制等は、変更となる場合があります。

<参考：主要投資対象ファンドの運用体制>

ブラックロック・グループのファンダメンタル債券運用部門によって運用されます。

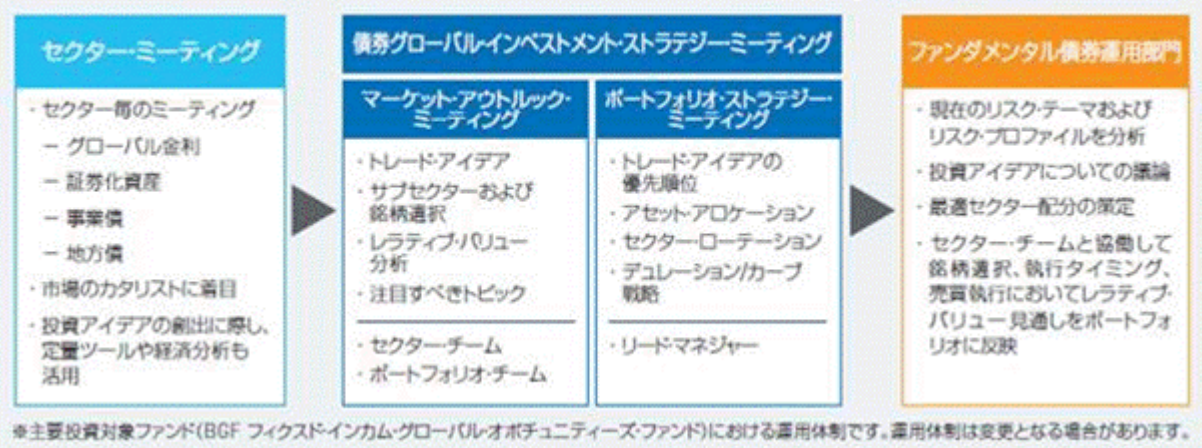
ポートフォリオ・マネジャーが協調しながら運用にあたる「チーム運用体制」を取っています。

基本戦略は、週次で行なわれる2つのインベストメント・ストラテジー・ミーティング（投資戦略会議）が中核となっています。マーケット・アウトルック・ミーティングには全ての債券運用プロフェッショナルが参加し、各セクター・チームにて事前に開催するチーム・ミーティングによって導き出された見解を、各チームのリード・マネジャーが発表します。次に、全チームのリード・マネジャーおよびリスク・クオンツ分析部門の代表者が参加するポートフォリオ・ストラテジー・ミーティングにおいて、セクター配分、ポートフォリオのリスク、投資テーマ等について議論を行ないます。

各ポートフォリオ・チームは、運用を担当するポートフォリオにとって適切と考える金利リスク、期限前償還リスク、利回りカーブ・リスク、信用リスク、流動性バイアス、およびセクター・アロケーションをそれぞれ独自に決定しますが、ポートフォリオ・ストラテジー・ミーティングでは各ポートフォリオ・チームの投資アイデアを共有することを主な目的とします。

ファンダメンタル債券運用部門は、セクター・チームと協働して、ポートフォリオの投資目的およびガイドラインを遵守しつつ、銘柄選択、タイミング、売買執行において、チームのレラティブ・バリューによる見通しをポートフォリオに反映します。ファンダメンタル債券運用部門は投資方針を策定し、その投資方針に基づいてセクター・スペシャリストが売買を執行します。投資テーマについては、週次で開催されるミーティングで定期的に議論かつ継続的に議論され、必要に応じて修正されます。

ポートフォリオ・マネジャーが協調しながら運用にあたる「チーム運用体制」を取っています。



ブラックロック・グループ

ブラックロック・グループは、運用資産残高約6.30兆ドル^{*}（約698兆円）を持つ世界最大級の独立系資産運用グループであり、当社はその日本人です。

当グループは、世界各国の機関投資家および個人投資家のため、株式、債券、キャッシュ・マネジメントおよびオルタナティブ商品といった様々な資産クラスの運用を行なっております。また、機関投資家向けに、リスク管理、投資システム・アウトソーシングおよびファイナンシャル・アドバイザー・サービスの提供を行なっております。

* 2018年6月末現在。（円換算レートは1ドル=110.765円を使用）

(4)【分配方針】

収益分配方針

月1回の毎決算時（原則として毎月20日。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、分配を行ないます。

a．分配対象額の範囲

分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買損益（繰越欠損補填後、評価損益を含みます。）等の全額とします。

b．分配対象収益についての分配方針

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。基準価額水準、市況動向等によっては分配を行なわないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

c．留保益の運用方針

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ないます。

収益の分配

a．信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

(a) 配当金、利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、諸費用（消費税に相当する金額および地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）を含みます。以下同じ。）、信託報酬（消費税等相当額を含みます。以下同じ。）を控除した後、その残額を投資者に分配することができます。なお、次期以降の分配に充てるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

(b) 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、諸費用および信託報酬を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、投資者に分配することができます。なお、次期以降の分配に充てるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b．毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越すものとします。

収益分配金の支払い

a．支払時期と支払場所

(a) 一般コースの場合

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として5営業日以内）に、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者にお支払いを開始します。収益分配金は販売会社の営業所等において支払います。

(b) 累積投資コースの場合

委託会社は、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金を販売会社に交付します。販売会社は累積投資契約^{*}に基づき、投資者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売り付けを行ないます。

* 当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

b．時効

投資者が、a．(a)に規定する支払開始日から5年間支払い請求を行なわない場合はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

収益分配金に関する留意事項

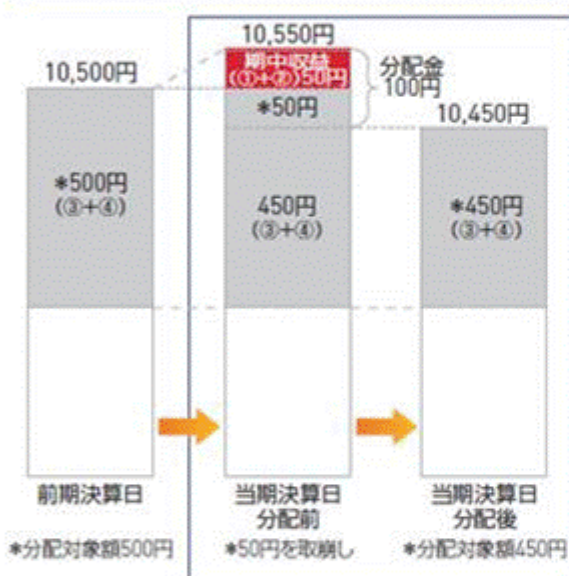
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



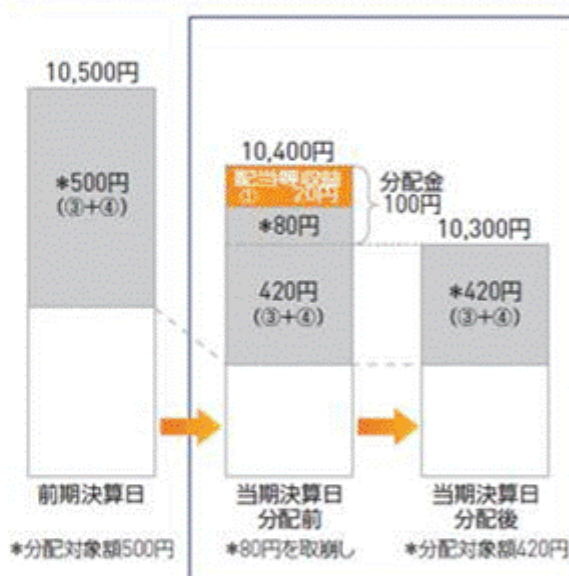
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合

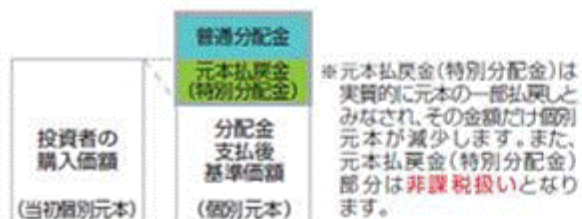


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

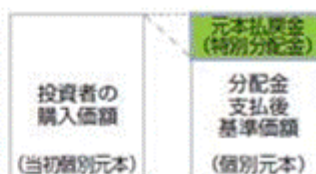
※ 上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないしすべてが、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より計算期間中の基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金：個別元本（投資者のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

※ 普通分配金に対する課税については、後記「手続・手数料等」の「ファンドの費用・税金」をご参照ください。

(5)【投資制限】

当ファンドの約款で定める投資制限です。

投資信託証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外への直接投資は行ないません。

投資信託証券への投資制限

投資信託証券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制限

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資制限

約款および定款等においてファンド・オブ・ファンズにのみ取得される（販売会社および運用会社が一時取得する場合を含みます。）投資信託証券であることが記載されていない同一銘柄の投資信託証券への投資割合は信託財産の純資産総額の50%以内とします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により、特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約の指図および範囲

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、換金に伴う支払資金の手当て（換金に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。
- b. 換金に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の換金代金入金日までの間もしくは投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却または換金代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- c. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

信用リスク集中回避のための投資制限

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行ないます。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

ファンドの基準価額は、組入れられている有価証券の値動きの他、為替変動による影響を受けます。これらの信託財産の運用によりに生じた損益はすべて投資者の皆様へ帰属します。したがって、当ファンドは元金および元金からの収益の確保が保証されているものではなく、基準価額の下落により投資者は損失を被り、元金を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金と異なります。当ファンドにかかる主なリスクは以下の通りです。

基準価額の変動要因

a．金利変動リスク

当ファンドの投資対象ファンドは、世界の債券に投資します。政治、経済、社会情勢等の影響により金利が上昇すれば債券の価格は下落し、金利が低下すれば債券の価格は上昇します。したがって、金利の変動が当ファンドの運用成果に影響を与えます。

b．信用リスク

当ファンドの投資対象ファンドは、世界の債券に投資します。投資した債券の発行体の財務状況により、債務不履行が生じることがあります。債務不履行が生じた場合には、当ファンドの運用成果に影響を与えます。また、債券の外部格付の変更により債券の価格が変動することがあり、それに伴い当ファンドの運用成果に影響を与えます。

当ファンドの投資対象ファンドは、信用格付が低い、または格付されていない公社債に純資産の相当部分を投資することができます。これらの種類の証券はより高い利回りを提供する可能性があるものの、格付が比較的高い証券に比べてより投機的であり、価格の変動がより激しく、債券投資の元本や金利収入を脅かすリスクも大きくなります。

c．期限前償還リスク

当ファンドの投資対象ファンドは、MBS、CMBS、ABS等（資産担保証券）の期限前償還リスクを伴う債券へ投資することができます。一般的に金利が低下した場合、資産担保証券の期限前償還が増加することにより、事前に見込まれた収益をあげることができず、さらに利回りの低い証券に再投資せざるを得ない可能性があります。これらの要因が当ファンドの運用成果に影響を与えます。

d．為替変動リスク

当ファンドは、外貨建ての投資信託証券を投資対象とします。当該投資信託証券に対して為替ヘッジを行いません。また、当ファンドの投資対象ファンドは、外貨建資産に投資を行いません。したがって、為替レートの変動が当ファンドの運用成果に影響を与えます。

e．カントリー・リスク

当ファンドの投資対象ファンドは、エマージング（新興）市場の発行体が発行する公社債にも投資します。エマージング諸国の経済は、先進諸国に比べて不安定であり、その市場を取り巻く社会的・経済的環境はより不透明な場合が多く、エマージング諸国の政府は自国経済を規制または監督する上で大きな影響力を行使することがあります。したがって、主として先進国市場に投資する場合に比べて、投資先の国の政治・経済事情、通貨・資本規制等の要因により、より大幅に公社債の価格が変動することが考えられ、それに伴い当ファンドの運用成果に影響を与えます。

f. デリバティブ取引のリスク

当ファンドの投資対象ファンドは、先物・オプション取引などのデリバティブ取引を用いることができます。また、当ファンドの主要投資対象ファンドが投資する資産担保証券においてデリバティブ取引が用いられることがあります。このような投資手法は現物資産への投資に代わって運用の効率を高めるため、または証券価格、市場金利、為替等の変動による影響から投資対象ファンドを守るために用いられます。デリバティブ取引を用いた結果、取引コストと投資元本を脅かすリスクが伴い、当ファンドの運用成果に影響を与えます。また、デリバティブ取引は必ず用いられるわけではなく、用いられたとしても本来の目的を達成できる保証はありません。

ファンド運営上のリスク

a. 購入および換金の受付の中止・取消

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の購入および換金の受付を中止する場合があります。また、この場合、既に受付けた受益権の購入および換金の受付を取り消す場合があります。

b. ファンドの繰上償還

当ファンドは換金により受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合、または投資者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情が発生したとき等は、ファンドを償還させる場合があります。

c. 法令・税制・会計等の変更

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

(2) リスクの管理体制

委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行っております。具体的には、運用担当部門とは異なる部門においてファンドの投資リスクの計測・分析、投資制限のモニタリングなどを行なうことにより、ファンドの投資リスクが運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行っております。

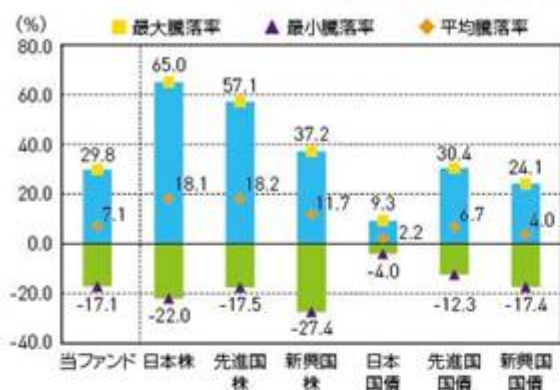
リスクの管理体制は、変更となる場合があります。

(参考情報)

運用実績(2018年6月29日現在)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2013年7月~2018年6月)



※上記グラフは、2013年7月~2018年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドについては、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※各資産クラスの指数

日本株---東証株価指数(配当込み)

先進国株---MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)

新興国株---MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

日本国債---NOMURA-BPI国債

先進国国債---FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国国債---J.P.モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

(2013年7月~2018年6月)



※上記グラフは、2013年7月~2018年6月の5年間の各月末における分配金再投資基準価額の1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

<各指数について>

東証株価指数(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場されている全銘柄を対象に時価総額を指数として算出したものです。東証株価指数(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(株)東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は、(株)東京証券取引所が有しています。(株)東京証券取引所は、東証株価指数(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(配当込み)の算出もしくは公表の停止または東証株価指数(配当込み)の商標の変更もしくは使用の停止を行なう権利を有しています。

MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)およびMSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発、計算した株価指数です。MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)は日本を除く世界の主要先進国の株式を、また、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は新興国の株式を対象として算出した指数です。同指数に関する著作権、知的財産その他の一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表している指数で、日本国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。同指数に関する知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行なわれるブラックロック・ジャパン株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

J.P.モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが発表しており、新興国の現地通貨建ての国債を対象として算出した指数です。同指数に関する著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額に3.24%（税抜3.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。詳細は販売会社にお問い合わせください。

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号：03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています（以下同じ。）。

購入時手数料は、購入時の商品説明、販売に関する事務手続き等の役務の対価として販売会社にお支払いいただくものです。

分配金の受取方法により、「一般コース」、「累積投資コース」の2つのコースがあります。「累積投資コース」を選択した投資者が分配金を再投資する場合は、無手数料とします。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額

計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.5552%（税抜1.44%）の率を乗じて得た金額とします。信託報酬に係る委託会社、販売会社、受託会社間の配分および当該報酬を対価とする役務の内容は次の通りとします。

	信託報酬の配分	役務の内容
委託会社	年0.7020% (税抜0.65%)	ファンドの運用、基準価額の計算、運用報告書等各種書類の作成等
販売会社	年0.8100% (税抜0.75%)	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
受託会社	年0.0432% (税抜0.04%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等

投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

信託報酬の支払時期と支払方法等

信託報酬は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

委託会社および販売会社に対する信託報酬は、ファンドから委託会社に対して支弁されます。信託報酬の販売会社への配分は、ファンドから委託会社に支弁された後、委託会社より販売会社に対して支払われます。受託会社の報酬は、ファンドから受託会社に対して支弁されます。

(4) 【その他の手数料等】

信託財産において換金代金等の支払資金に不足が生じるときに資金借入れの指図を行なった場合はその都度、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、投資者の負担とし、その都度、信託財産中から支弁します。

下記の諸費用（以下「諸費用」といいます）および諸費用に係る消費税等相当額は、投資者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。

- 1．受益権の管理事務に関連する費用
- 2．有価証券届出書、有価証券報告書等法定提出書類の作成、印刷および提出に係る費用
- 3．目論見書の作成、印刷および交付に係る費用
- 4．信託約款の作成、印刷および届出に係る費用
- 5．運用報告書の作成、印刷、交付および提出に係る費用
- 6．公告に係る費用ならびに信託約款の変更またはファンドの償還に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用
- 7．この信託の監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用

委託会社は、年0.108%（税抜0.10%）を上限とする、上記の諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で算出する率を毎日純資産総額に対して乗じて得た額、または上記の諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で算出する額を、上記の諸費用の支払の合計額とみなして、ファンドから受領することができます。諸費用および諸費用に係る消費税等相当額は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われるものとします。

外貨建資産の保管等に要する費用^{*}等は、その都度、信託財産中より支弁します。

^{*} 海外における保管銀行等に支払う有価証券の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用

投資対象ファンドに係る保管報酬および事務処理に要する諸費用が別途投資対象ファンドから支払われます。

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

日本の居住者（法人を含む。）である投資者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。

個別元本方式について

- a．追加型株式投資信託について、投資者毎の信託時の受益権の価額等（購入時手数料は含まれません。）が当該投資者の元本（「個別元本」といいます。）にあたります。
- b．投資者が同一ファンドの受益権を複数回購入した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- c．同一ファンドを複数の販売会社で購入する場合については各販売会社毎に、個別元本の算出が行なわれません。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを購入する場合は当該支店等毎に個別元本の算出が行なわれる場合があります。
- d．投資者が元本払戻金（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、その後の当該投資者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記「収益分配金の課税について」を参照。）

換金時および償還時の課税について

- a．個人の投資者の場合
換金時および償還時の差益（譲渡益）が課税対象となります。
- b．法人の投資者の場合
換金時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

収益分配金の課税について

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）」（投資者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

投資者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資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、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資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。

なお、投資者が元本払戻金（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、その後の当該投資者の個別元本となります。

個人、法人の課税の取扱いについて

- a．個人の投資者に対する課税

(a) 収益分配金の課税について

支払いを受ける収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税15.315%、地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれます。原則として、申告は不要です。

また、確定申告を行なうことにより総合課税（配当控除なし）と申告分離課税（20.315%（所得税15.315%、地方税5%））のいずれかを選択することができます。

(b) 換金時および償還時の差益の課税について

換金時および償還時の差益（換金価額および償還価額から購入費用（購入時手数料および当該購入時手数料にかかる消費税等相当額を含みます。）を控除した利益）は、譲渡益として課税対象（譲渡所得等）となり、20.315%（所得税15.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）の利用が可能な場合があります。

換金時および償還時に損失（譲渡損）が生じた場合には、確定申告することで、他の株式等の譲渡益、上場株式等の配当所得および特定公社債等の利子所得の金額（申告分離課税を選択したものに限り、）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。

また、換金時および償還時の差益（譲渡益）については、他の株式等の譲渡損と損益を相殺することができます。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」がご利用になれます。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、NISAの口座では、特定口座や一般口座で生じた配当所得および譲渡所得との損益通算はできません。非課税の対象となる金額、期間等を含めて詳しくは販売会社にお問い合わせください。

b. 法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%、地方税の源泉徴収はありません。）の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、当ファンドについては、法人税の課税対象となりますが、益金不算入制度の適用はありません。

上記は2018年6月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等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。

5【運用状況】

以下の運用状況は2018年6月末現在のものです。

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」

(1)【投資状況】

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	1,436,468,572	97.01
内 ルクセンブルグ	1,436,468,572	97.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	44,273,847	2.99
純資産総額	1,480,742,419	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

順位	銘柄	国/ 地域	種類	投資口数	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラスJ 投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	1,287,901	1,104.29	1,422,222,606	1,103.18	1,420,798,959	95.95
2	ブラックロック・グローバル・ファンズ USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスX 投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	9,735	1,607.25	15,648,088	1,609.46	15,669,613	1.06

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.01

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

2018年6月末現在、同日前1年以内における各月末および直近20特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第7特定期間	第34期(2008年7月22日)	26,213,540,971	26,326,387,997	0.9292	0.9332
	第35期(2008年8月20日)	26,330,514,378	26,443,133,902	0.9352	0.9392
	第36期(2008年9月22日)	24,961,848,378	25,074,472,877	0.8866	0.8906
	第37期(2008年10月20日)	21,940,834,129	22,051,622,772	0.7922	0.7962
	第38期(2008年11月20日)	19,882,589,375	19,991,253,269	0.7319	0.7359
	第39期(2008年12月22日)	19,446,434,956	19,552,888,120	0.7307	0.7347
第8特定期間	第40期(2009年1月20日)	19,034,354,837	19,139,727,309	0.7226	0.7266
	第41期(2009年2月20日)	19,513,893,830	19,593,054,633	0.7395	0.7425
	第42期(2009年3月23日)	18,538,961,270	18,611,926,067	0.7622	0.7652
	第43期(2009年4月20日)	18,364,027,254	18,433,643,934	0.7914	0.7944
	第44期(2009年5月20日)	17,662,594,042	17,730,704,246	0.7780	0.7810
	第45期(2009年6月22日)	16,706,815,281	16,770,956,599	0.7814	0.7844
第9特定期間	第46期(2009年7月21日)	16,459,175,020	16,522,406,387	0.7809	0.7839
	第47期(2009年8月20日)	16,539,085,565	16,601,108,801	0.8000	0.8030
	第48期(2009年9月24日)	16,495,357,752	16,557,085,526	0.8017	0.8047
	第49期(2009年10月20日)	16,368,225,399	16,429,411,038	0.8026	0.8056
	第50期(2009年11月20日)	15,855,289,033	15,915,097,990	0.7953	0.7983
	第51期(2009年12月21日)	15,727,275,360	15,786,916,559	0.7911	0.7941
第10特定期間	第52期(2010年1月20日)	15,879,099,243	15,938,976,920	0.7956	0.7986
	第53期(2010年2月22日)	15,622,514,310	15,682,374,624	0.7829	0.7859
	第54期(2010年3月23日)	15,153,523,145	15,211,297,623	0.7869	0.7899
	第55期(2010年4月20日)	14,712,789,821	14,767,653,188	0.8045	0.8075
	第56期(2010年5月20日)	14,149,503,857	14,203,706,884	0.7831	0.7861
	第57期(2010年6月21日)	13,688,423,551	13,724,013,776	0.7692	0.7712
第11特定期間	第58期(2010年7月20日)	11,953,075,578	11,984,914,441	0.7508	0.7528
	第59期(2010年8月20日)	11,308,909,494	11,339,059,482	0.7502	0.7522
	第60期(2010年9月21日)	10,792,419,166	10,821,365,833	0.7457	0.7477
	第61期(2010年10月20日)	9,719,515,608	9,733,187,683	0.7109	0.7119
	第62期(2010年11月22日)	8,197,751,787	8,209,183,400	0.7171	0.7181
	第63期(2010年12月20日)	7,552,878,249	7,563,501,906	0.7109	0.7119
第12特定期間	第64期(2011年1月20日)	7,099,765,359	7,109,923,367	0.6989	0.6999
	第65期(2011年2月21日)	6,740,300,864	6,749,866,393	0.7046	0.7056
	第66期(2011年3月22日)	6,459,285,013	6,468,682,205	0.6874	0.6884
	第67期(2011年4月20日)	6,064,782,117	6,073,395,050	0.7041	0.7051
	第68期(2011年5月20日)	5,829,780,579	5,838,139,774	0.6974	0.6984
	第69期(2011年6月20日)	5,472,705,804	5,480,744,958	0.6808	0.6818
第13特定期間	第70期(2011年7月20日)	5,194,094,232	5,201,873,380	0.6677	0.6687
	第71期(2011年8月22日)	4,982,537,926	4,990,074,175	0.6611	0.6621
	第72期(2011年9月20日)	4,825,687,355	4,833,044,388	0.6559	0.6569
	第73期(2011年10月20日)	4,726,461,704	4,733,673,067	0.6554	0.6564
	第74期(2011年11月21日)	4,597,750,464	4,604,774,306	0.6546	0.6556
	第75期(2011年12月20日)	4,628,803,830	4,635,786,108	0.6629	0.6639

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第14特定期間	第76期(2012年1月20日)	4,628,516,959	4,635,490,459	0.6637	0.6647
	第77期(2012年2月20日)	4,764,021,111	4,770,915,024	0.6910	0.6920
	第78期(2012年3月21日)	4,945,408,372	4,952,229,483	0.7250	0.7260
	第79期(2012年4月20日)	4,740,779,337	4,747,487,380	0.7067	0.7077
	第80期(2012年5月21日)	4,565,667,725	4,572,339,900	0.6843	0.6853
	第81期(2012年6月20日)	4,508,864,540	4,515,457,272	0.6839	0.6849
第15特定期間	第82期(2012年7月20日)	4,530,795,123	4,537,310,005	0.6955	0.6965
	第83期(2012年8月20日)	4,554,045,114	4,560,532,884	0.7019	0.7029
	第84期(2012年9月20日)	4,533,139,157	4,539,595,130	0.7022	0.7032
	第85期(2012年10月22日)	4,545,170,896	4,551,531,577	0.7146	0.7156
	第86期(2012年11月20日)	4,600,052,086	4,606,374,386	0.7276	0.7286
	第87期(2012年12月20日)	4,846,349,125	4,852,659,951	0.7679	0.7689
第16特定期間	第88期(2013年1月21日)	5,163,561,913	5,169,840,531	0.8224	0.8234
	第89期(2013年2月20日)	4,608,502,510	4,613,908,223	0.8525	0.8535
	第90期(2013年3月21日)	4,184,944,067	4,189,773,939	0.8665	0.8675
	第91期(2013年4月22日)	4,228,972,916	4,233,613,081	0.9114	0.9124
	第92期(2013年5月20日)	4,344,332,667	4,348,918,128	0.9474	0.9484
	第93期(2013年6月20日)	3,945,101,538	3,949,642,330	0.8688	0.8698
第17特定期間	第94期(2013年7月22日)	3,776,413,408	3,780,629,135	0.8958	0.8968
	第95期(2013年8月20日)	3,675,699,022	3,679,854,311	0.8846	0.8856
	第96期(2013年9月20日)	3,572,183,774	3,576,180,836	0.8937	0.8947
	第97期(2013年10月21日)	3,495,530,548	3,499,496,967	0.8813	0.8823
	第98期(2013年11月20日)	3,535,169,009	3,539,090,680	0.9014	0.9024
	第99期(2013年12月20日)	3,534,080,557	3,537,815,885	0.9461	0.9471
第18特定期間	第100期(2014年1月20日)	3,514,700,010	3,518,420,799	0.9446	0.9456
	第101期(2014年2月20日)	3,333,120,710	3,336,709,422	0.9288	0.9298
	第102期(2014年3月20日)	3,309,975,047	3,313,526,405	0.9320	0.9330
	第103期(2014年4月21日)	3,319,759,900	3,323,292,914	0.9396	0.9406
	第104期(2014年5月20日)	3,287,975,525	3,291,503,617	0.9319	0.9329
	第105期(2014年6月20日)	3,230,793,962	3,234,230,168	0.9402	0.9412
第19特定期間	第106期(2014年7月22日)	3,091,663,347	3,094,963,055	0.9370	0.9380
	第107期(2014年8月20日)	2,922,432,284	2,925,515,852	0.9477	0.9487
	第108期(2014年9月22日)	2,906,995,848	2,912,806,105	1.0006	1.0026
	第109期(2014年10月20日)	2,835,004,527	2,840,817,697	0.9754	0.9774
	第110期(2014年11月20日)	3,047,787,148	3,053,430,342	1.0802	1.0822
	第111期(2014年12月22日)	3,058,187,286	3,063,781,248	1.0934	1.0954
第20特定期間	第112期(2015年1月20日)	3,002,013,111	3,007,608,381	1.0731	1.0751
	第113期(2015年2月20日)	2,929,559,332	2,934,928,132	1.0913	1.0933
	第114期(2015年3月20日)	2,867,615,806	2,872,793,102	1.1078	1.1098
	第115期(2015年4月20日)	2,819,136,164	2,824,310,941	1.0896	1.0916
	第116期(2015年5月20日)	2,888,833,190	2,894,070,137	1.1033	1.1053
	第117期(2015年6月22日)	3,000,457,396	3,005,863,383	1.1100	1.1120
第21特定期間	第118期(2015年7月21日)	2,918,007,772	2,923,197,074	1.1246	1.1266
	第119期(2015年8月20日)	3,026,468,578	3,031,911,931	1.1120	1.1140
	第120期(2015年9月24日)	2,913,790,409	2,919,231,076	1.0711	1.0731
	第121期(2015年10月20日)	2,781,230,978	2,786,452,181	1.0654	1.0674
	第122期(2015年11月20日)	2,863,610,850	2,868,850,506	1.0931	1.0951
	第123期(2015年12月21日)	2,828,383,868	2,833,669,401	1.0702	1.0722

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第22特定期間	第124期(2016年1月20日)	2,723,110,213	2,728,407,951	1.0280	1.0300
	第125期(2016年2月22日)	2,562,948,245	2,568,192,861	0.9774	0.9794
	第126期(2016年3月22日)	2,531,544,368	2,536,750,608	0.9725	0.9745
	第127期(2016年4月20日)	2,363,085,461	2,368,056,126	0.9508	0.9528
	第128期(2016年5月20日)	2,380,314,677	2,385,285,544	0.9577	0.9597
	第129期(2016年6月20日)	2,235,938,659	2,240,853,941	0.9098	0.9118
第23特定期間	第130期(2016年7月20日)	2,318,637,912	2,323,619,489	0.9309	0.9329
	第131期(2016年8月22日)	2,202,719,547	2,207,683,608	0.8875	0.8895
	第132期(2016年9月20日)	2,203,052,536	2,207,976,757	0.8948	0.8968
	第133期(2016年10月20日)	2,234,897,644	2,239,799,071	0.9119	0.9139
	第134期(2016年11月21日)	2,280,133,521	2,284,832,847	0.9704	0.9724
	第135期(2016年12月20日)	2,378,370,666	2,383,007,837	1.0258	1.0278
第24特定期間	第136期(2017年1月20日)	2,345,704,373	2,350,332,348	1.0137	1.0157
	第137期(2017年2月20日)	2,223,820,787	2,228,289,084	0.9954	0.9974
	第138期(2017年3月21日)	2,191,165,925	2,195,583,001	0.9921	0.9941
	第139期(2017年4月20日)	2,021,218,544	2,025,426,520	0.9607	0.9627
	第140期(2017年5月22日)	2,049,029,165	2,053,204,866	0.9814	0.9834
	第141期(2017年6月20日)	1,923,838,255	1,927,733,743	0.9877	0.9897
第25特定期間	第142期(2017年7月20日)	1,751,647,392	1,755,183,621	0.9907	0.9927
	第143期(2017年8月21日)	1,694,543,009	1,698,050,221	0.9663	0.9683
	第144期(2017年9月20日)	1,678,331,145	1,681,718,526	0.9909	0.9929
	第145期(2017年10月20日)	1,652,233,908	1,655,536,528	1.0006	1.0026
	第146期(2017年11月20日)	1,588,029,359	1,591,236,903	0.9902	0.9922
	第147期(2017年12月20日)	1,596,544,272	1,599,736,181	1.0004	1.0024
第26特定期間	第148期(2018年1月22日)	1,507,949,613	1,511,000,100	0.9887	0.9907
	第149期(2018年2月20日)	1,463,089,728	1,466,167,490	0.9507	0.9527
	第150期(2018年3月20日)	1,450,640,831	1,453,732,320	0.9385	0.9405
	第151期(2018年4月20日)	1,471,975,699	1,475,085,877	0.9466	0.9486
	第152期(2018年5月21日)	1,506,549,465	1,509,660,796	0.9684	0.9704
	第153期(2018年6月20日)	1,476,791,897	1,479,878,953	0.9568	0.9588
	2017年6月末現在	1,841,343,510		0.9914	
	2017年7月末現在	1,729,857,858		0.9784	
	2017年8月末現在	1,717,858,114		0.9787	
	2017年9月末現在	1,677,191,133		1.0012	
	2017年10月末現在	1,638,243,756		1.0046	
	2017年11月末現在	1,590,895,184		0.9933	
	2017年12月末現在	1,594,141,452		1.0011	
	2018年1月末現在	1,493,578,167		0.9747	
	2018年2月末現在	1,471,520,944		0.9553	
	2018年3月末現在	1,449,625,133		0.9369	
	2018年4月末現在	1,480,558,104		0.9588	
	2018年5月末現在	1,470,656,513		0.9487	
	2018年6月末現在	1,480,742,419		0.9593	

【分配の推移】

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第7特定期間	第34期	0.0040
	第35期	0.0040
	第36期	0.0040
	第37期	0.0040
	第38期	0.0040
	第39期	0.0040
第8特定期間	第40期	0.0040
	第41期	0.0030
	第42期	0.0030
	第43期	0.0030
	第44期	0.0030
	第45期	0.0030
第9特定期間	第46期	0.0030
	第47期	0.0030
	第48期	0.0030
	第49期	0.0030
	第50期	0.0030
	第51期	0.0030
第10特定期間	第52期	0.0030
	第53期	0.0030
	第54期	0.0030
	第55期	0.0030
	第56期	0.0030
	第57期	0.0020
第11特定期間	第58期	0.0020
	第59期	0.0020
	第60期	0.0020
	第61期	0.0010
	第62期	0.0010
	第63期	0.0010
第12特定期間	第64期	0.0010
	第65期	0.0010
	第66期	0.0010
	第67期	0.0010
	第68期	0.0010
	第69期	0.0010
第13特定期間	第70期	0.0010
	第71期	0.0010
	第72期	0.0010
	第73期	0.0010
	第74期	0.0010
	第75期	0.0010
第14特定期間	第76期	0.0010
	第77期	0.0010
	第78期	0.0010
	第79期	0.0010
	第80期	0.0010
	第81期	0.0010
第15特定期間	第82期	0.0010
	第83期	0.0010
	第84期	0.0010
	第85期	0.0010
	第86期	0.0010
	第87期	0.0010
第16特定期間	第88期	0.0010
	第89期	0.0010
	第90期	0.0010
	第91期	0.0010
	第92期	0.0010
	第93期	0.0010

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第17特定期間	第94期	0.0010
	第95期	0.0010
	第96期	0.0010
	第97期	0.0010
	第98期	0.0010
	第99期	0.0010
第18特定期間	第100期	0.0010
	第101期	0.0010
	第102期	0.0010
	第103期	0.0010
	第104期	0.0010
	第105期	0.0010
第19特定期間	第106期	0.0010
	第107期	0.0010
	第108期	0.0020
	第109期	0.0020
	第110期	0.0020
第20特定期間	第111期	0.0020
	第112期	0.0020
	第113期	0.0020
	第114期	0.0020
	第115期	0.0020
	第116期	0.0020
	第117期	0.0020
第21特定期間	第118期	0.0020
	第119期	0.0020
	第120期	0.0020
	第121期	0.0020
	第122期	0.0020
	第123期	0.0020
第22特定期間	第124期	0.0020
	第125期	0.0020
	第126期	0.0020
	第127期	0.0020
	第128期	0.0020
	第129期	0.0020
第23特定期間	第130期	0.0020
	第131期	0.0020
	第132期	0.0020
	第133期	0.0020
	第134期	0.0020
	第135期	0.0020
第24特定期間	第136期	0.0020
	第137期	0.0020
	第138期	0.0020
	第139期	0.0020
	第140期	0.0020
	第141期	0.0020
第25特定期間	第142期	0.0020
	第143期	0.0020
	第144期	0.0020
	第145期	0.0020
	第146期	0.0020
	第147期	0.0020
第26特定期間	第148期	0.0020
	第149期	0.0020
	第150期	0.0020
	第151期	0.0020
	第152期	0.0020
	第153期	0.0020

【収益率の推移】

特定期間	計算期間	収益率(%)
第7特定期間	第34期	0.1
	第35期	1.1
	第36期	4.8
	第37期	10.2
	第38期	7.1
	第39期	0.4
第8特定期間	第40期	0.6
	第41期	2.8
	第42期	3.5
	第43期	4.2
	第44期	1.3
	第45期	0.8
第9特定期間	第46期	0.3
	第47期	2.8
	第48期	0.6
	第49期	0.5
	第50期	0.5
	第51期	0.2
第10特定期間	第52期	0.9
	第53期	1.2
	第54期	0.9
	第55期	2.6
	第56期	2.3
	第57期	1.5
第11特定期間	第58期	2.1
	第59期	0.2
	第60期	0.3
	第61期	4.5
	第62期	1.0
	第63期	0.7
第12特定期間	第64期	1.5
	第65期	1.0
	第66期	2.3
	第67期	2.6
	第68期	0.8
	第69期	2.2
第13特定期間	第70期	1.8
	第71期	0.8
	第72期	0.6
	第73期	0.1
	第74期	0.0
	第75期	1.4
第14特定期間	第76期	0.3
	第77期	4.3
	第78期	5.1
	第79期	2.4
	第80期	3.0
	第81期	0.1
第15特定期間	第82期	1.8
	第83期	1.1
	第84期	0.2
	第85期	1.9
	第86期	2.0
	第87期	5.7
第16特定期間	第88期	7.2
	第89期	3.8
	第90期	1.8
	第91期	5.3
	第92期	4.1
	第93期	8.2

特定期間	計算期間	収益率(%)
第17特定期間	第94期	3.2
	第95期	1.1
	第96期	1.1
	第97期	1.3
	第98期	2.4
	第99期	5.1
第18特定期間	第100期	0.1
	第101期	1.6
	第102期	0.5
	第103期	0.9
	第104期	0.7
	第105期	1.0
第19特定期間	第106期	0.2
	第107期	1.2
	第108期	5.8
	第109期	2.3
	第110期	10.9
第20特定期間	第111期	1.4
	第112期	1.7
	第113期	1.9
	第114期	1.7
	第115期	1.5
	第116期	1.4
第21特定期間	第117期	0.8
	第118期	1.5
	第119期	0.9
	第120期	3.5
	第121期	0.3
	第122期	2.8
第22特定期間	第123期	1.9
	第124期	3.8
	第125期	4.7
	第126期	0.3
	第127期	2.0
	第128期	0.9
第23特定期間	第129期	4.8
	第130期	2.5
	第131期	4.4
	第132期	1.0
	第133期	2.1
	第134期	6.6
第24特定期間	第135期	5.9
	第136期	1.0
	第137期	1.6
	第138期	0.1
	第139期	3.0
	第140期	2.4
第25特定期間	第141期	0.8
	第142期	0.5
	第143期	2.3
	第144期	2.8
	第145期	1.2
	第146期	0.8
第26特定期間	第147期	1.2
	第148期	1.0
	第149期	3.6
	第150期	1.1
	第151期	1.1
	第152期	2.5
	第153期	1.0

(注) 収益率とは、計算期間末の基準価額(分配の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配の額。以下「前期末基準価額」といいます。)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数です。

(4)【設定及び解約の実績】

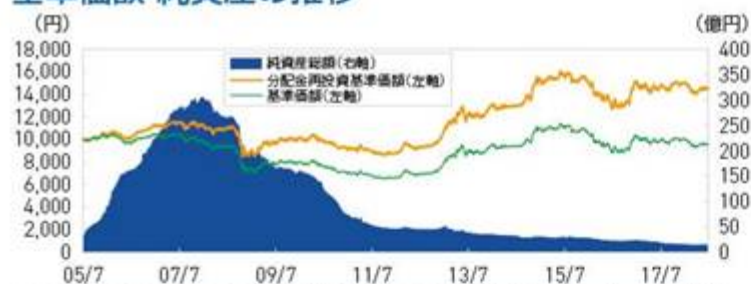
特定期間	計算期間	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第7特定期間	第34期	751,182,769	1,050,345,242	28,211,756,586
	第35期	598,163,767	655,039,120	28,154,881,233
	第36期	849,712,602	848,468,873	28,156,124,962
	第37期	494,787,705	953,751,906	27,697,160,761
	第38期	284,867,375	816,054,440	27,165,973,696
	第39期	327,222,267	879,904,776	26,613,291,187
第8特定期間	第40期	97,125,738	367,298,677	26,343,118,248
	第41期	562,124,790	518,308,525	26,386,934,513
	第42期	328,398,423	2,393,733,608	24,321,599,328
	第43期	622,807,703	1,738,846,730	23,205,560,301
	第44期	225,777,008	727,935,755	22,703,401,554
	第45期	263,084,548	1,586,046,444	21,380,439,658
第9特定期間	第46期	507,272,981	810,590,053	21,077,122,586
	第47期	402,163,674	804,874,200	20,674,412,060
	第48期	261,021,385	359,508,696	20,575,924,749
	第49期	281,412,125	462,123,684	20,395,213,190
	第50期	65,330,184	524,224,140	19,936,319,234
	第51期	720,753,964	776,673,457	19,880,399,741
第10特定期間	第52期	389,853,324	311,027,231	19,959,225,834
	第53期	494,786,499	500,574,086	19,953,438,247
	第54期	105,146,141	800,424,828	19,258,159,560
	第55期	88,919,025	1,059,289,288	18,287,789,297
	第56期	196,668,494	416,781,804	18,067,675,987
	第57期	91,237,133	363,800,184	17,795,112,936
第11特定期間	第58期	144,954,930	2,020,636,276	15,919,431,590
	第59期	79,936,100	924,373,465	15,074,994,225
	第60期	14,236,783	615,897,181	14,473,333,827
	第61期	31,216,474	832,474,826	13,672,075,475
	第62期	6,877,197	2,247,339,525	11,431,613,147
	第63期	14,242,171	822,197,553	10,623,657,765
第12特定期間	第64期	5,601,819	471,251,409	10,158,008,175
	第65期	5,496,284	597,974,968	9,565,529,491
	第66期	503,609,038	671,945,971	9,397,192,558
	第67期	5,663,077	789,922,129	8,612,933,506
	第68期	4,611,140	258,349,047	8,359,195,599
	第69期	4,949,469	324,990,364	8,039,154,704
第13特定期間	第70期	4,473,201	264,479,896	7,779,148,009
	第71期	4,418,716	247,316,861	7,536,249,864
	第72期	4,349,087	183,565,518	7,357,033,433
	第73期	4,368,375	150,037,906	7,211,363,902
	第74期	4,214,820	191,736,692	7,023,842,030
	第75期	78,238,723	119,801,796	6,982,278,957
第14特定期間	第76期	4,026,217	12,804,218	6,973,500,956
	第77期	4,013,535	83,600,619	6,893,913,872
	第78期	3,898,297	76,700,593	6,821,111,576
	第79期	3,582,088	116,649,681	6,708,043,983
	第80期	3,566,513	39,435,029	6,672,175,467
	第81期	3,864,403	83,307,511	6,592,732,359
第15特定期間	第82期	3,545,128	81,394,732	6,514,882,755
	第83期	3,473,000	30,585,116	6,487,770,639
	第84期	3,446,269	35,243,421	6,455,973,487
	第85期	3,452,479	98,744,853	6,360,681,113
	第86期	7,416,555	45,796,857	6,322,300,811
	第87期	3,564,657	15,038,546	6,310,826,922
第16特定期間	第88期	3,015,074	35,223,575	6,278,618,421
	第89期	2,744,790	875,649,572	5,405,713,639
	第90期	1,622,495	577,464,051	4,829,872,083
	第91期	56,914,015	246,620,601	4,640,165,497
	第92期	43,088,121	97,792,574	4,585,461,044
	第93期	35,159,285	79,827,431	4,540,792,898

特定期間	計算期間	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第17特定期間	第94期	1,512,360	326,577,670	4,215,727,588
	第95期	1,444,530	61,882,577	4,155,289,541
	第96期	34,217,565	192,444,545	3,997,062,561
	第97期	12,535,405	43,176,041	3,966,419,925
	第98期	1,497,780	46,246,055	3,921,671,650
	第99期	94,541,717	280,884,882	3,735,328,485
第18特定期間	第100期	19,488,243	34,027,554	3,720,789,174
	第101期	16,078,535	148,155,518	3,588,712,191
	第102期	12,423,450	49,777,022	3,551,358,619
	第103期	1,221,589	19,565,482	3,533,014,726
	第104期	53,519,669	58,441,461	3,528,092,934
	第105期	1,265,383	93,152,251	3,436,206,066
第19特定期間	第106期	1,231,953	137,729,565	3,299,708,454
	第107期	1,144,037	217,283,597	3,083,568,894
	第108期	1,136,709	179,576,779	2,905,128,824
	第109期	1,940,114	483,849	2,906,585,089
	第110期	2,081,007	87,068,940	2,821,597,156
	第111期	54,873,218	79,489,321	2,796,981,053
第20特定期間	第112期	1,707,713	1,053,303	2,797,635,463
	第113期	21,387,974	134,623,116	2,684,400,321
	第114期	5,384,936	101,137,169	2,588,648,088
	第115期	11,984,979	13,244,118	2,587,388,949
	第116期	68,718,931	37,634,305	2,618,473,575
	第117期	116,507,272	31,986,995	2,702,993,852
第21特定期間	第118期	23,805,200	132,147,917	2,594,651,135
	第119期	134,631,396	7,605,751	2,721,676,780
	第120期	5,392,817	6,735,845	2,720,333,752
	第121期	2,000,769	111,732,815	2,610,601,706
	第122期	45,259,938	36,033,529	2,619,828,115
	第123期	42,455,385	19,516,849	2,642,766,651
第22特定期間	第124期	9,188,478	3,085,927	2,648,869,202
	第125期	4,148,748	30,709,801	2,622,308,149
	第126期	7,308,447	26,496,225	2,603,120,371
	第127期	2,342,690	120,130,150	2,485,332,911
	第128期	2,030,731	1,929,774	2,485,433,868
	第129期	2,023,627	29,816,402	2,457,641,093
第23特定期間	第130期	34,403,560	1,255,876	2,490,788,777
	第131期	2,139,407	10,897,657	2,482,030,527
	第132期	2,298,361	22,218,045	2,462,110,843
	第133期	2,269,566	13,666,830	2,450,713,579
	第134期	2,201,905	103,251,998	2,349,663,486
	第135期	2,073,542	33,151,141	2,318,585,887
第24特定期間	第136期	2,008,917	6,606,817	2,313,987,987
	第137期	12,510,213	92,349,438	2,234,148,762
	第138期	1,931,772	27,542,490	2,208,538,044
	第139期	2,003,384	106,553,410	2,103,988,018
	第140期	1,968,778	18,105,815	2,087,850,981
	第141期	2,301,229	142,407,972	1,947,744,238
第25特定期間	第142期	2,405,582	182,035,113	1,768,114,707
	第143期	2,173,034	16,681,610	1,753,606,131
	第144期	2,447,603	62,362,805	1,693,690,929
	第145期	1,720,400	44,100,907	1,651,310,422
	第146期	2,467,791	50,005,896	1,603,772,317
	第147期	1,684,895	9,502,483	1,595,954,729
第26特定期間	第148期	2,620,049	73,331,252	1,525,243,526
	第149期	20,492,766	6,854,860	1,538,881,432
	第150期	6,863,252	0	1,545,744,684
	第151期	12,600,986	3,256,338	1,555,089,332
	第152期	13,019,597	12,443,194	1,555,665,735
	第153期	6,757,660	18,895,041	1,543,528,354

(参考情報)

運用実績（2018年6月29日現在）

基準価額・純資産の推移



※ 基準価額および分配金再投資基準価額は信託報酬控除後の値です。信託報酬等については、後述の「ファンドの費用」をご覧ください。

※ 分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

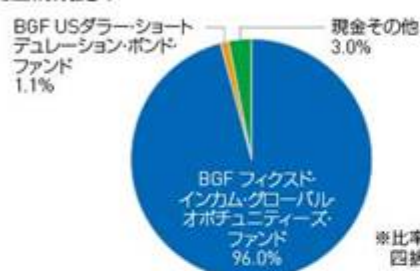
分配の推移

設定来累計		3,820円
直近1年間累計		240円
第149期	2018年2月	20円
第150期	2018年3月	20円
第151期	2018年4月	20円
第152期	2018年5月	20円
第153期	2018年6月	20円

※ 分配金は税引前、1万口当たり

主要な資産の状況

資産構成比率



※ 比率は対純資産総額。
四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

組入上位10銘柄*(%)

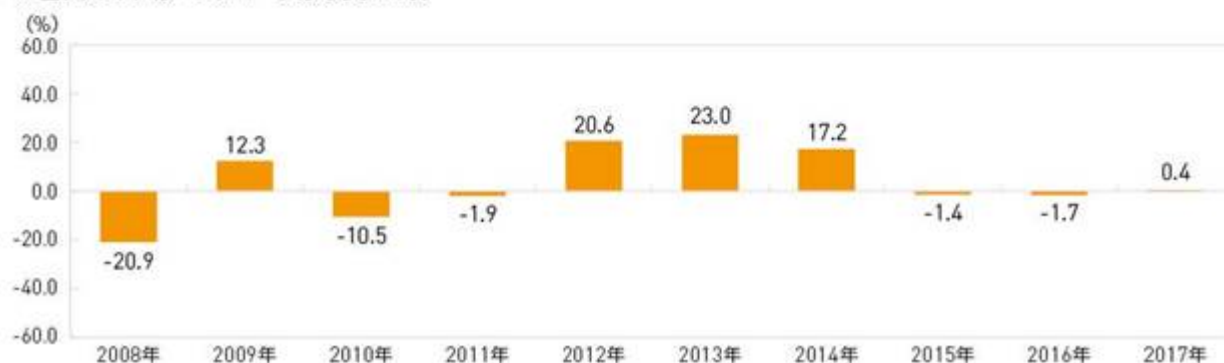
	銘柄名	種別	比率
1	FNMA 15YR TBA 3 07/17/2018	政府系不動産担保証券	10.7
2	TREASURY NOTE (OLD) 2.75 05/31/2023	国債	6.9
3	GNMA2 30YR TBA (REG C) 4 07/19/2018	政府系不動産担保証券	5.3
4	TREASURY (CPI) NOTE 0.125 04/15/2020	国債	4.6
5	FNMA 30YR TBA (REG A) 4 07/12/2018	政府系不動産担保証券	2.4
6	TREASURY NOTE (OTR) 2.875 05/15/2028	国債	2.4
7	TREASURY (CPI) NOTE 0.125 04/15/2021	国債	2.0
8	TREASURY NOTE (OLD) 2.75 02/15/2028	国債	1.5
9	TREASURY BOND (OLD) 3 02/15/2048	国債	1.4
10	GS SECURED NOTES 2018-14 144A VR 02/08/2019	社債	1.2

*当ファンドの主要投資対象ファンドである「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」の組入れ銘柄です。(2018年6月末現在) 残存期間1年未満の短期証券を除きます。比率はBGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンドの純資産総額に対する割合。

年間収益率の推移

※ ファンドの収益率は、決算時の分配金を非課税で再投資したものととして算出しています。

※ 当ファンドにはベンチマークはありません。

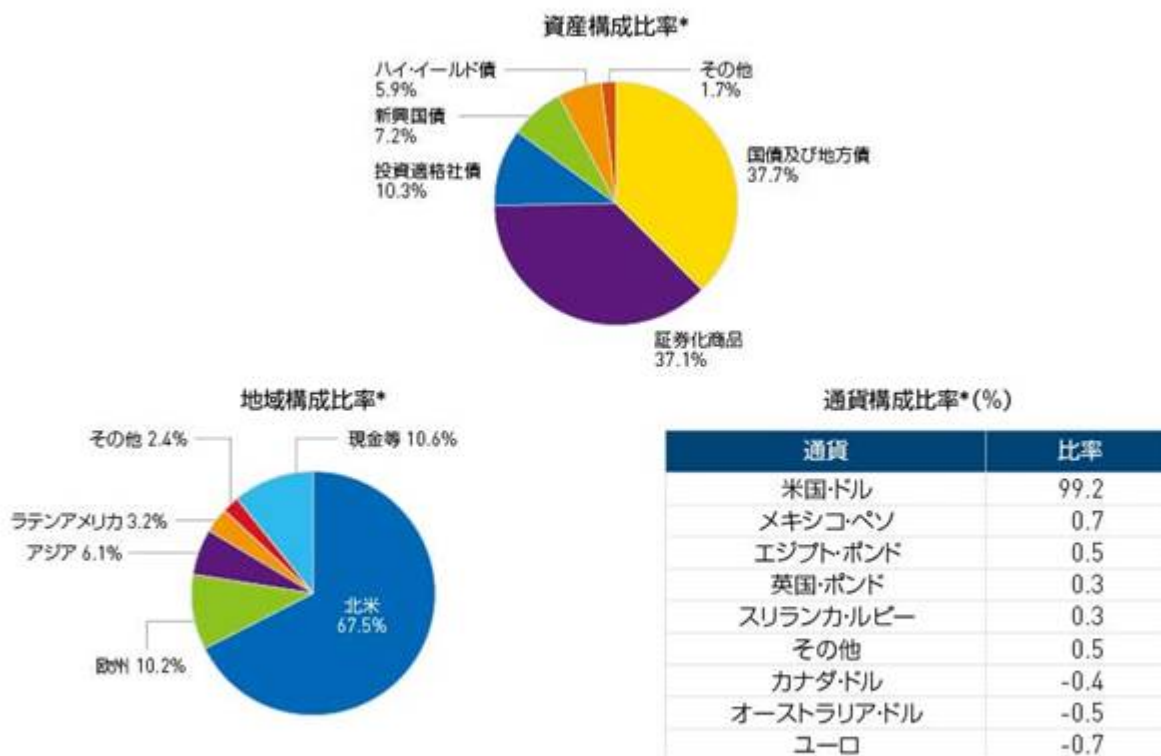


※ 運用実績・データ等は作成日現在および過去のものであり、今後の運用成果を保証するものではありません。

※ ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページにて開示しております。

主要投資対象ファンドの主な資産の状況

当ファンドの主要投資対象ファンドである「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」の運用状況です。



*比率はBGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンドの純資産総額に対する割合。四捨五入の関係で合計が100にならない場合があります。ただし、資産構成比率は、組入証券全体を100とした場合の構成比。地域構成比率の現金等には、残存期間1年未満の短期証券を含みます。

※ 運用実績・データ等は作成日現在および過去のものであり、今後の運用成果を保証するものではありません。
 ※ ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページにて開示しております。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

受益権の投資者は、販売会社と有価証券の取引に関する契約を締結します。販売会社は有価証券の取引にかかわる約款を投資者に交付し、投資者は当該約款に基づく取引口座の設定を申込む旨の申込書を提出します。

分配金の受取方法により、収益の分配時に分配金を受け取る「一般コース」と分配金が税引き後無手数料で再投資される「累積投資コース」の2つの申込方法があります。

「累積投資コース」を選択する投資者は、当該販売会社との間で「累積投資約款^{*}」にしたがって契約を締結します。

^{*} 当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

取り扱いを行なうコースは各販売会社により異なりますので、詳細は販売会社にお問い合わせください。

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号：03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

投資者は販売会社に、購入と同時にまたはあらかじめ当該投資者が受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該投資者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該購入の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該投資者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないません。受託会社は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないません。

(2) 申込期間

当ファンドの購入は、申込期間における販売会社の各営業日に、販売会社の本・支店、営業所等でお受けしています。なお、申込期間は、有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(3) 受付時間

購入の受付は、申込期間中の午後3時までに受付けたものを当日のお申込みとします。受付時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとします。ただし、受付時間は販売会社により異なることがあります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(4) 購入不可日

ルクセンブルクの銀行の休業日、12月24日、その他投資対象ファンドの受付不可日のいずれかに該当する場合には、販売会社の営業日であっても購入は受け付けません。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(5) 購入単位

- ・一般コース : 1万口以上1万口単位
- ・累積投資コース : 1万円以上1円単位

ただし、「累積投資コース」を選択した投資者が収益分配金を再投資する場合は1円単位とします。なお、販売会社により上記と異なる購入単位を別に定める場合があります。また、取り扱いを行なうコースは、各販売会社により異なります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(6) 購入価額

受益権の購入価額は、購入受付日の翌営業日の基準価額とします。なお、購入価額には購入時手数料は含まれておりません。

(7) 購入時手数料

- a . 購入受付日の翌営業日の基準価額に3.24%（税抜3.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳細は販売会社にお問い合わせください。

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています。

- b . 累積投資契約に基づく収益分配金の再投資は無手数料となります。

(8) 購入代金のお支払い

受益権の投資者は、販売会社が定める日までに購入代金（購入受付日の翌営業日の基準価額に購入口数を乗じた金額に、購入時手数料（消費税等相当額を含みます。）を加算した金額をいいます。）を販売会社に支払うものとします。

(9) 購入の受付の中止、既に受付けた購入の受付の取消

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社の判断により、受益権の購入の受付を中止することおよび既に受付けた購入の受付を取り消すことがあります。

2【換金（解約）手続等】

(1) 換金の申込と受付

投資者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に以下の単位をもって換金の申込をすることができます。なお、販売会社により下記と異なる換金単位を別に定める場合があります。また、取り扱いを行なうコースは、各販売会社により異なります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

- ・一般コース：1万口以上1万口単位
- ・累積投資コース：1口以上1口単位

投資者が換金の申込をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。換金の申込の受付は、午後3時までとなっております。ただし、受付時間は販売会社により異なる場合があります。詳細は販売会社にお問い合わせください。受付時間を過ぎての換金の申込は翌営業日の取扱とします。

(2) 換金不可日

ルクセンブルグの銀行の休業日、12月24日、その他投資対象ファンドの受付不可日のいずれかに該当する場合には、販売会社の営業日であっても換金は受けません。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(3) 換金価額

換金価額は、換金受付日の翌営業日の基準価額とします。なお手取額は、換金価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。

当ファンドの換金価額等につきましては販売会社または下記に問い合わせることにより知ることができます。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号：03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

(4) 換金受付の制限

信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口の換金の申込には制限があります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(5) 換金代金の支払い

換金代金は原則として換金受付日から起算して5営業日目から販売会社においてお支払いします。

(6) 換金の受付中止および取消

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付を中止することおよび既に受付けた換金の受付を取り消すことができます。換金の受付が中止された場合には、投資者は当該受付中止以前に行なった当日の換金の申込を撤回できます。ただし、投資者がその換金の申込を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に換金を受付けたものとします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

当ファンドにおいて基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(「外貨建有価証券」といいます。))、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額(1万口当り)は委託会社の営業日に毎日算出されます。投資者は、販売会社または下記に問い合わせることにより知ることができます。

また、日々の基準価額(1万口当り)は翌日の日本経済新聞に掲載されております。ファンド名は「Win」と省略されて記載されております。

当ファンドの主たる投資対象の評価方法は以下の通りです。

投資信託証券：金融商品取引所(海外取引所を含む)に上場されているものは、当該取引所における計算日の最終相場(海外取引所に上場されているものについては、計算日に知りうる直近の最終相場)で評価します。金融商品取引所に上場されていないものは、第一種金融商品取引業者、銀行等の提示する価格(原則として、計算日に知りうる直近の日の純資産価格)で評価します。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号：03-6703-4300(受付時間 営業日の9:00~17:00)

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

この信託の期間は、無期限とします。

(4)【計算期間】

計算期間は毎月21日から翌月20日までとすることを原則とします。計算期間終了日に該当する日が休業日のときは該当日の翌営業日を計算期間の終了日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

ファンドの償還条件等

- a．委託会社は、信託期間中において、当ファンドを償還することが投資者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、当ファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b．委託会社は、換金により、受益権の口数が30億口を下回るようになった場合には、受託会社と合意のうえ、当ファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- c．a．およびb．の場合において、委託会社は、この事項について、あらかじめ償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる投資者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d．c．の公告および書面には、投資者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e．d．の一定の期間内に異議を述べた投資者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、a．およびb．のファンドの償還を行いません。
- f．委託会社は、当ファンドの償還をしないこととしたときは、償還しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる投資者に対して交付します。ただし、全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- g．d．～f．までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、d．の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
- h．委託会社は、監督官庁より当ファンドの償還の命令を受けたときはその命令にしたがい、ファンドを償還させます。
- i．委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドを償還させます。
- j．i．にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更d．」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- k．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または投資者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、「信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドを償還させます。

信託約款の変更

- a. 委託会社は、投資者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる投資者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. b. の公告および書面には、投資者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. c. の一定の期間内に異議を述べた投資者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、信託約款の変更を行いません。
- e. 委託会社は、この信託約款の変更を行わないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる投資者に対して交付します。ただし、全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときはa. ~ e. の規定にしたがいます。

運用報告書の作成

毎年6月および12月の決算時および償還時に、委託会社が期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「交付運用報告書」を作成し、購入いただいた販売会社からあらかじめお申し出いただいた方法にて知れている受益者にお届けいたします。

信託事務の委託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務の処理の一部について日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行いません。

関係法人との契約の更改等に関する手続

「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」の期間は1年とし、委託会社、販売会社いずれからも別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様です。

公告

委託会社が投資者に対してする公告は日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

当ファンドの受益者（投資者）の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金受領権

投資者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて委託会社から受領する権利を有します。

<一般コース>

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として5営業日以内）に毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において換金が行なわれた受益権にかかる投資者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で購入代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として投資者とします。）にお支払いを開始します。

投資者が、収益分配金について支払開始日から5年間支払い請求を行わない場合はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

<累積投資コース>

受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が販売会社に支払われます。

販売会社は、累積投資契約に基づき、投資者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行いません。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2) 償還金受領権

投資者は、委託会社の決定した償還金を、持ち分に応じて委託会社から受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日以内）に償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者（償還日以前において換金が行なわれた受益権にかかる投資者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で購入代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として投資者とします。）にお支払いを開始します。なお、当該投資者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

償還金の支払いは、販売会社において行ないます。

投資者が、償還金について支払開始日から10年間支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属するものとします。

(3) 受益権の換金請求権

投資者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に換金を請求する権利を有します。

換金代金は、換金受付日から起算して、原則として5営業日目から投資者に支払います。

換金の請求を行なう投資者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該投資者の請求に係る当ファンドの換金を委託会社が行なうのと引き換えに、当該換金に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

(4) 反対者の買取請求権

ファンドの償還または信託約款の変更を行なう場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた投資者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(5) 帳簿書類の閲覧又は謄写の請求権

投資者は、委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。

第3 【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)及び同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(平成29年12月21日から平成30年6月20日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前特定期間末 (平成29年12月20日現在)	当特定期間末 (平成30年6月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	553	-
金銭信託	14,372,865	21,673,452
投資証券	1,546,850,273	1,460,237,217
派生商品評価勘定	2,882	-
未収入金	40,688,518	-
流動資産合計	1,601,915,091	1,481,910,669
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,191,909	3,087,056
未払解約金	301	-
未払受託者報酬	56,583	52,766
未払委託者報酬	1,980,566	1,847,029
その他未払費用	141,460	131,921
流動負債合計	5,370,819	5,118,772
負債合計	5,370,819	5,118,772
純資産の部		
元本等		
元本	1,595,954,729	1,543,528,354
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	589,543	66,736,457
（分配準備積立金）	270,998,404	248,089,058
元本等合計	1,596,544,272	1,476,791,897
純資産合計	1,596,544,272	1,476,791,897
負債純資産合計	1,601,915,091	1,481,910,669

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前特定期間 (自 平成29年 6月21日 至 平成29年12月20日)	当特定期間 (自 平成29年12月21日 至 平成30年 6月20日)
営業収益		
受取配当金	30,685,382	24,132,976
受取利息	3,530	7,404
有価証券売買等損益	7,193,049	21,055,985
為替差損益	18,200,653	38,103,993
営業収益合計	56,082,614	35,019,598
営業費用		
受託者報酬	366,628	321,593
委託者報酬	12,833,538	11,257,510
その他費用	1,247,709	1,187,252
営業費用合計	14,447,875	12,766,355
営業利益又は営業損失（ ）	41,634,739	47,785,953
経常利益又は経常損失（ ）	41,634,739	47,785,953
当期純利益又は当期純損失（ ）	41,634,739	47,785,953
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,819,920	173,252
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	23,905,983	589,543
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,954,914	1,513,469
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,954,914	1,513,469
剰余金減少額又は欠損金増加額	141,312	2,698,465
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	141,312	2,698,465
分配金	20,132,895	18,528,303
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	589,543	66,736,457

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

投資証券は移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として当該取引所等における特定期間末日において知りうる直近の最終相場で評価しております。

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

当該有価証券については、原則として、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。

(3) 時価が入手できなかった有価証券

適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

個別法に基づき、原則としてわが国における特定期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。

3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建資産・負債の円換算については原則として、わが国における特定期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。

4 収益及び費用の計上基準

(1) 受取配当金の計上基準

受取配当金は原則として、投資証券の配当落ち日に予想配当金額を計上し、入金金額との差額についてはそれぞれ入金時に計上しております。

(2) 有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

外貨建資産等の会計処理

外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前特定期間末 (平成29年12月20日現在)	当特定期間末 (平成30年6月20日現在)
1 当該特定期間の末日における受益権総数	1,595,954,729口	1,543,528,354口
2 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 - 円	元本の欠損 66,736,457円
3 1口当たり純資産額	1.0004円	0.9568円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前特定期間 (自 平成29年 6 月21日 至 平成29年12月20日)
分配金の計算過程	<p>第142期計算期間(平成29年 6 月21日～平成29年 7 月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,051,262円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(90,221,163円)、分配準備積立金(299,295,697円)により、分配対象収益は393,568,122円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,536,229円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第143期計算期間(平成29年 7 月21日～平成29年 8 月21日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,969,105円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(89,846,855円)、分配準備積立金(296,985,346円)により、分配対象収益は389,801,306円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,507,212円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第144期計算期間(平成29年 8 月22日～平成29年 9 月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,955,206円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(87,181,652円)、分配準備積立金(285,916,312円)により、分配対象収益は378,053,170円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,387,381円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第145期計算期間(平成29年 9 月21日～平成29年10月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,351,891円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(85,288,552円)、分配準備積立金(280,002,682円)により、分配対象収益は369,643,125円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,302,620円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第146期計算期間(平成29年10月21日～平成29年11月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,366,652円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(83,243,298円)、分配準備積立金(272,551,009円)により、分配対象収益は358,160,959円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,207,544円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第147期計算期間(平成29年11月21日～平成29年12月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,088,523円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(83,121,545円)、分配準備積立金(270,101,790円)により、分配対象収益は357,311,858円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,191,909円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p>

項目	当特定期間 (自 平成29年12月21日 至 平成30年 6月20日)
分配金の計算過程	<p>第148期計算期間(平成29年12月21日～平成30年 1月22日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(1,526,943円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(79,869,530円)、分配準備積立金(258,561,063円)により、分配対象収益は339,957,536円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,050,487円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第149期計算期間(平成30年 1月23日～平成30年 2月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,151,426円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(84,048,027円)、分配準備積立金(255,886,985円)により、分配対象収益は342,086,438円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,077,762円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第150期計算期間(平成30年 2月21日～平成30年 3月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(1,795,259円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(85,569,430円)、分配準備積立金(254,960,649円)により、分配対象収益は342,325,338円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,091,489円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第151期計算期間(平成30年 3月21日～平成30年 4月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,369,123円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(88,173,897円)、分配準備積立金(253,134,265円)により、分配対象収益は344,677,285円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,110,178円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第152期計算期間(平成30年 4月21日～平成30年 5月21日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,997,158円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(90,356,041円)、分配準備積立金(251,367,643円)により、分配対象収益は345,720,842円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,111,331円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第153期計算期間(平成30年 5月22日～平成30年 6月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(1,973,320円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(90,733,754円)、分配準備積立金(249,202,794円)により、分配対象収益は341,909,868円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,087,056円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券は投資証券であります。

当ファンドの主な投資リスクとして、「金利変動リスク」、「信用リスク」、「期限前償還リスク」、「為替変動リスク」、「カントリー・リスク」、「デリバティブ取引のリスク」等があります。

当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は、外貨建有価証券の売買の決済等に伴い必要となる外貨の売買の為に、その受渡日までの数日間の為替予約を利用しております。なお、当ファンドは外貨建資産の為替変動リスクの低減を目的としており、投機を目的とする為替予約は行わない方針であります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。

3 金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

ブラックロックソリューション・グリーンパッケージプロダクションチームが日次で計測し、運用部、その他の関係部署等にレポートをイントラネットで配信しております。また、運用ガイドラインのモニタリングはポートフォリオ・コンプライアンスチームが行っており、ガイドライン等を逸脱していた場合、関係部署へ報告され、適切な調整を行います。

(2) 信用リスクの管理

ファンダメンタル債券運用部により、国内債券の個別信用リスク及び銘柄間の相対価値については独自の定量・定性分析等を行っております。外国債券銘柄等については、社内のリサーチ・データベースによりグローバル・クレジット・チームとの情報・分析結果を共有しております。

(3) 取引先リスクの管理

リスク・クオンツ分析部は当社の親会社である米国のBlackRock, Inc.のRQA Counterparty & Concentration Riskチームと共に既存の承認済み取引先の信用悪化のモニタリングを行っており、取引先のデフォルトに対する取引先リスク、発行体リスクのファンドへの影響を分析しております。また、新規取引先の承認に際しては、リスク・クオンツ分析部が新規取引先申請の内容に問題がないかどうか確認を行い、当社の親会社である米国のBlackRock, Inc.のRQA Counterparty & Concentration Riskチームへ申請を行っております。

また、毎月開催される投資委員会では、リスク管理・運用分析手法等について審議を行っております。

金融商品の時価等に関する事項

前特定期間末 (平成29年12月20日現在)	当特定期間末 (平成30年6月20日現在)
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>4 金銭債権の特定期間末日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2 時価の算定方法 (1)有価証券 同左</p> <p>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>4 金銭債権の特定期間末日後の償還予定額 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 期中元本変動額

項目	前特定期間末 (平成29年12月20日現在)	当特定期間末 (平成30年6月20日現在)
期首元本額	1,947,744,238円	1,595,954,729円
期中追加設定元本額	12,899,305円	62,354,310円
期中一部解約元本額	364,688,814円	114,780,685円

2 有価証券関係

前特定期間末(平成29年12月20日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	6,060,973
合計	6,060,973

当特定期間末(平成30年6月20日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	4,343,448
合計	4,343,448

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	前特定期間末（平成29年12月20日現在）			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超 (円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	40,684,749	-	40,681,867	2,882
合計		40,684,749	-	40,681,867	2,882

(注1) 時価の算定方法

為替予約取引

1 特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

特定期間末日において為替予約の受渡日(以下「当該日」という)の対顧客先物相場が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

特定期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2 特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、特定期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

当特定期間末(平成30年6月20日現在)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポ チュニティーズ・ファンド クラスJ投資証券	1,313,560.660	13,122,470.990	
		ブラックロック・グローバル・ファンズ US ダラー・ショート・デュレーション・ボン ド・ファンド クラスX投資証券	9,735.930	141,560.420	
	アメリカドル	小計	1,323,296.590	13,264,031.410 (1,460,237,217)	
投資証券	合計		1,323,296.590	1,460,237,217 (1,460,237,217)	
合計				1,460,237,217 (1,460,237,217)	

(注1) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

(注2) 1 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

2 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示してあります。

3 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	投資証券 2銘柄	100.0%	100.0%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考情報)

当ファンドは、「ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラス」投資証券」及び「ブラックロック・グローバル・ファンズ USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスX投資証券」(以下、両者を併せて「同ファンド」という。)を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された投資証券は、すべて同ファンドの投資証券であります。同ファンドの状況は以下のとおりであります。なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外です。

同ファンドの状況

- (1) 同ファンドは、ルクセンブルグにおいて設立されたオープンエンド型投資法人が発行するファンドであり、同ファンドの現時点で日本語に翻訳された直近の情報は、2017年8月31日に終了する計算期間(2016年9月1日から2017年8月31日まで)に係る財務書類であります。
- (2) 当該財務書類は、同ファンドを含む「ブラックロック・グローバル・ファンズ」の2017年8月31日現在の財務書類のうち、同ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。

純資産計算書 2017年8月31日現在

	注記	フィクスト・インカム・ グローバル・オポチュニ ティーズ・ファンド	USダラー・ショート・ デュレーション・ボン ド・ファンド
		米ドル	米ドル
資産			
投資有価証券 - 取得原価		8,585,144,844	1,681,066,218
未実現評価益 / (損)		151,997,170	(928,475)
投資有価証券 - 時価	2 (a)	8,737,142,014	1,680,137,743
銀行預金	2 (a)	548,118,308	6,965,422
ブローカーに対する債権	15	43,509,633	-
未収利息および未収配当金	2 (a)	77,039,803	7,379,456
売却投資有価証券未収金	2 (a)	4,710,626,637*	1,170,805*
販売投資証券未収金	2 (a)	15,225,436	5,632,941
以下に係る未実現評価益：			
未決済先渡為替予約	2 (c)	-	756,950
事後通告証券契約の時価	2 (c)	-	139,300,215
スワップの時価	2 (c)	4,808,976	-
買建オプション / スワップオプションの時価	2 (c)	74,548,481	264,897
その他の資産	2 (a, c)	97,606	-
資産合計		14,211,116,894	1,841,608,429
負債			
ブローカーに対する債務	15	37,863,123	3,563,000
未払収益分配金	2 (a)	1,969,193	135,023
購入投資有価証券未払金	2 (a)	3,273,877,396*	135,289,559*
買戻し投資証券未払金	2 (a)	9,777,566	5,757,878
以下に係る未実現評価損：			
未決済上場先物取引	2 (c)	10,592,855	1,087,119
未決済先渡為替予約	2 (c)	17,311,908	-
差金決済契約	2 (c)	292,758	-
事後通告証券契約の時価	2 (c)	1,523,739,146	-
スワップの時価	2 (c)	-	742,133
売建オプション / スワップオプションの時価	2 (c)	52,139,227	-
その他の負債	5, 6, 7, 8	18,308,763	1,234,887
負債合計		4,945,871,935	147,809,599
純資産合計		9,265,244,959	1,693,798,830

* 事後通告証券契約を含む。詳細については、注記2を参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

3 会計年度末における純資産価額の概要 2017年8月31日現在

	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド			
	通貨	2017年 8月31日現在	2016年 8月31日現在	2015年 8月31日現在
純資産合計	米ドル	9,265,244,959	7,839,045,320	9,072,127,942
以下の1口当たり純資産価額：				
クラスA 毎年分配型投資証券	米ドル	9.94	9.80	9.90
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.91	9.95	10.15
クラスA 毎日分配型投資証券	米ドル	10.11	9.97	10.07
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	10.10	9.96	10.07
クラスA 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.15	10.01	10.08
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	7.31	7.34	7.47
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	シンガポール・ドル	14.80	14.66	14.68
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差分配型投資証券	豪ドル	9.61	9.59	9.77
クラスA 中国人民元・ヘッジ金利差分配型投資証券	人民元	99.07	97.07	97.84
クラスA 安定分配型投資証券	米ドル	12.40	12.32	12.54
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定分配型投資証券	香港ドル	95.54	95.50	97.58
クラスA 無分配投資証券	米ドル	13.86	13.34	13.20
クラスA スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	10.12	9.96	10.01
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.03	9.83	9.82
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,047	1,024	1,023
クラスA ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	ポーランド・ズロチ	15.32	14.69	14.43
クラスA スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローネ	102.02	100.12	100.32
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ドル	20.25	19.58	19.26
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英ポンド	10.29	10.00	9.92
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	10.11	9.97	10.07
クラスC 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.09	9.95	10.03
クラスC 無分配投資証券	米ドル	12.16	11.85	11.87
クラスD 毎年分配型投資証券	米ドル	13.46	13.27	13.40
クラスD カナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	カナダ・ドル	9.94	9.85	9.96
クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.91	9.95	-
クラスD 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	4.88	4.86	-
クラスD 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.67	10.52	10.60
クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	7.33	7.36	7.49
クラスD 無分配投資証券	米ドル	14.18	13.59	13.37

3 会計年度末における純資産価額の概要 2017年8月31日現在(続き)

	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド			
	通貨	2017年 8月31日現在	2016年 8月31日現在	2015年 8月31日現在
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	10.75	10.53	10.53
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.53	10.26	10.21
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	11.02	10.66	10.51
クラスDポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	ポーランド・ズ ロチ	15.70	14.98	14.64
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ ドル	20.74	19.95	19.53
クラスE無分配投資証券	米ドル	13.11	12.68	12.61
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.52	9.38	9.42
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	カナダ・ドル	9.83	9.75	9.86
クラスI 毎四半期分配型投資証券	米ドル	9.94	9.80	9.87
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	9.72	9.76	9.93
クラスI無分配投資証券	米ドル	11.25	10.75	10.57
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	カナダ・ドル	10.66	10.25	10.09
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	11.42	11.16	11.15
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.81	10.52	10.45
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	11.08	10.70	10.53
クラスI日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,073	1,043	1,035
クラスJ毎月分配型投資証券	米ドル	10.11	9.97	10.07
クラスX英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	英ポンド	9.88	9.84	9.93
クラスX毎月分配型投資証券	米ドル	10.11	9.97	10.07
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	豪ドル	10.67	10.45	10.39
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	ユーロ	9.78	9.82	10.02
クラスX無分配投資証券	米ドル	10.82	10.29	10.07
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	11.41	10.78	10.39
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	カナダ・ドル	10.60	10.14	9.93
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	11.66	11.35	11.28
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	11.26	10.91	10.78
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	10.78	10.36	10.14
クラスXスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・ クローネ	10.48	10.16	10.07

価格は各投資証券クラスの取引通貨で設定される。2種類以上の取引通貨が入手可能な当該投資証券クラスでは、各投資証券クラスの基準通貨が表示されている。追加の取引通貨額は評価時点の関連する直物為替レートで当該額を換算することによって算定される。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

3 会計年度末における純資産価額の概要 2017年8月31日現在

	USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド			
	通貨	2017年 8月31日現在	2016年 8月31日現在	2015年 8月31日現在
純資産合計	米ドル	1,693,798,830	1,532,772,836	1,497,665,243
以下の1口当たり純資産価額：				
クラスA毎日分配型投資証券	米ドル	8.57	8.60	8.63
クラスA毎月分配型投資証券	米ドル	8.56	8.59	8.62
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	シンガポール・ドル	9.82	9.90	9.87
クラスA無分配投資証券	米ドル	13.18	12.98	12.84
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.18	10.20	10.20
クラスC毎日分配型投資証券	米ドル	8.58	8.61	8.63
クラスC無分配投資証券	米ドル	10.95	10.92	10.94
クラスD毎月分配型投資証券	米ドル	9.83	9.86	9.89
クラスD無分配投資証券	米ドル	13.40	13.15	12.97
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.04	10.03	-
クラスE無分配投資証券	米ドル	12.15	12.02	11.96
クラスI無分配投資証券	米ドル	10.19	10.00	-
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.06	10.04	-
クラスX無分配投資証券	米ドル	14.50	14.16	13.90

価格は各投資証券クラスの取引通貨で設定される。2種類以上の取引通貨が入手可能な当該投資証券クラスでは、各投資証券クラスの基準通貨が表示されている。追加の取引通貨額は評価時点の関連する直物為替レートで当該額を換算することによって算定される。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

損益および純資産変動計算書 2017年8月31日に終了した会計年度

	注記	フィクスト・インカム・ グローバル・オポチュニ ティーズ・ファンド	U S 달러・ショート・ デュレーション・ボン ド・ファンド
		米ドル	米ドル
期首純資産		7,839,045,320	1,532,772,836
収益			
預金利息	2 (b)	525,768	140,814
債券利息	2 (b)	279,489,042	38,309,583
スワップ利息	2 (c)	93,077,880	7,252,701
短期金融商品預け入れによる利息	2 (b)	-	374,135
集団投資スキームによる収益	2 (b)	5,399,645	-
配当金、源泉徴収税控除後	2 (b)	1,243,311	-
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)	17,416	-
有価証券貸付による収益	2 (b)	1,432,899	112,822
投資運用報酬リベート	5	3,799	-
収益合計	2 (b)	381,189,760	46,190,055
費用			
差金決済契約に係る支払利息	2 (c)	13,059	-
スワップ利息	2 (c)	80,292,396	3,727,360
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)	50,995	-
管理事務代行報酬、補助金控除後	7	7,455,233	950,559
保管および預託報酬	2 (h), 8	2,093,357	251,098
販売報酬	6	7,064,737	1,544,244
税金	9	2,561,791	590,854
投資運用報酬	5	46,497,541	7,138,504
費用合計		146,029,109	14,202,619
純利益		235,160,651	31,987,436
以下に係る実現純評価益 / (損) :			
投資有価証券	2 (a)	(36,749,791)	(23,009,509)
事後通告証券契約	2 (c)	29,539,526	778,519
差金決済取引	2 (c)	555,085	-
上場先物取引	2 (c)	(28,862,665)	424,970
オプション / スワップション契約	2 (c)	(13,629,610)	9,103
スワップ取引	2 (c)	77,689,191	2,252,941
先渡為替予約	2 (c)	53,677,055	7,935,382
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	21,880,101	1,695,258
当期実現純評価益 / (損)		104,098,892	(9,913,336)
以下に係る未実現評価益 / (損) の純変動額 :			
投資有価証券	2 (a)	114,365,232	7,878,381
事後通告証券契約	2 (c)	(3,708,534)	468,716
差金決済取引	2 (c)	(306,535)	-
上場先物取引	2 (c)	10,226,610	(840,873)
オプション / スワップション契約	2 (c)	2,518,769	(409,474)
スワップ取引	2 (c)	(1,468,398)	32,321
先渡為替予約	2 (c)	3,642,921	683,801
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	1,105,791	79,703
当期末実現評価益 / (損) の純変動		126,375,856	7,892,575
運用成績による純資産の増加		465,635,399	29,966,675

損益および純資産変動計算書 2017年8月31日に終了した会計年度(続き)

	注記	フィクスト・インカム・ グローバル・オポチュニ ティーズ・ファンド	USダラー・ショート・ デュレーション・ボン ド・ファンド
		米ドル	米ドル
資本の変動			
投資証券発行による正味受取額		3,689,443,978	1,138,710,450
投資証券買戻しによる正味支払額		(2,690,869,390)	(1,006,007,385)
資本の変動による純資産の増加		998,574,588	132,703,065
配当金宣言額	16	(38,010,348)	(1,643,746)
期末純資産		9,265,244,959	1,693,798,830

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

発行済投資証券口数変動表 2017年8月31日に終了した会計年度

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA 毎年分配型投資証券	154,253	17,954	61,041	111,166
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	1,547,957	719,983	414,422	1,853,518
クラスA 毎日分配型投資証券	3,987,163	3,520,354	3,220,381	4,287,136
クラスA 毎月分配型投資証券	431,641	95,054	89,099	437,596
クラスA 毎四半期分配型投資証券	10,670,533	1,941,096	4,343,264	8,268,365
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	704,419	176,490	247,107	633,802
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	143,515	147,896	72,031	219,380
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差分配型投資証券	200,711	29,198	29,885	200,024
クラスA 中国人民元・ヘッジ金利差分配型投資証券	308	-	-	308
クラスA 安定分配型投資証券	437,889	74,429	301,274	211,044
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定分配型投資証券	94,843	36,336	6,056	125,123
クラスA 無分配投資証券	81,698,390	17,878,138	41,887,717	57,688,811
クラスA スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	2,823,323	1,611,984	587,444	3,847,863
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	17,346,421	22,428,760	9,592,482	30,182,699
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	986,491	3,702	489,239	500,954
クラスA ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	20,859,820	37,168,126	40,246,571	17,781,375
クラスA スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	1,044,519	271,963	274,070	1,042,412
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	2,148,050	1,445,980	520,056	3,073,974
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	45,854	201,620	19,564	227,910
クラスC 毎日分配型投資証券	1,158,351	62,668	543,929	677,090
クラスC 毎四半期分配型投資証券	2,473,251	100,484	1,379,072	1,194,663
クラスC 無分配投資証券	13,802,875	2,016,229	5,720,109	10,098,995
クラスD 毎年分配型投資証券	1,559,482	97,333	1,562,125	94,690
クラスD カナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	2,445	492,931	635	494,741
クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	759,115	1,161,083	80,400	1,839,798
クラスD 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	332,620	1,456,834	42,927	1,746,527
クラスD 毎四半期分配型投資証券	22,226,825	5,950,653	7,809,351	20,368,127
クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	441,781	708,382	190,952	959,211
クラスD 無分配投資証券	58,990,176	28,842,193	25,919,723	61,912,646
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	7,396,712	1,614,775	1,490,026	7,521,461
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	46,469,454	47,461,131	34,816,733	59,113,852
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	1,706,373	2,555,123	860,039	3,401,457

発行済投資証券口数変動表 2017年8月31日に終了した会計年度(続き)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスDポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	1,240	26,000	27,203	37
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	31,728	17,990	12,091	37,627
クラスE無分配投資証券	35,209,164	8,039,882	15,501,443	27,747,603
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	53,663,098	25,918,127	20,784,514	58,796,711
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	610	-	-	610
クラスI毎四半期分配型投資証券	39,441,017	2,957,078	89,113	42,308,982
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	4,930,086	1,602,167	4,930,074	1,602,179
クラスI無分配投資証券	40,696,985	13,518,044	12,239,134	41,975,895
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	570	200,000	190,495	10,075
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	19,813	1,599,111	73,325	1,545,599
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	22,586,153	40,805,987	3,608,629	59,783,511
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	25,137,165	27,131,991	574,959	51,694,197
クラスI日本円ヘッジ無分配投資証券	47,534,181	2,579,229	2,020,930	48,092,480
クラスJ毎月分配型投資証券	2,081,667	251,008	859,300	1,473,375
クラスX英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	17,941,587	11,967,554	2,901,411	27,007,730
クラスX毎月分配型投資証券	2,975,572	204,284	1,214,820	1,965,036
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	2,252,725	73,479	528,997	1,797,207
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	231,702	59,848	60,792	230,758
クラスX無分配投資証券	4,538,923	1,417,577	12,157	5,944,343
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	15,029,243	1,493,509	4,542,200	11,980,552
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	47,156,409	2,875,041	-	50,031,450
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	881,847	-	-	881,847
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	453,009	1,054,743	206,627	1,301,125
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	31,079,389	3,996,932	196,386	34,879,935
クラスXスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	46,305,143	90,375,165	4,668,626	132,011,682

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

発行済投資証券口数変動表 2017年8月31日に終了した会計年度

U S ダ ラ ー ・ シ ョ ー ト ・ デ ュ レ ー シ ョ ン ・ ボ ン ド ・ フ ァ ン ド

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA 毎日分配型投資証券	3,197,484	2,921,158	2,374,968	3,743,674
クラスA 毎月分配型投資証券	3,683,468	1,739,468	3,596,528	1,826,408
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型 投資証券	694	67,254	43,684	24,264
クラスA 無分配投資証券	32,369,855	26,153,098	24,304,936	34,218,017
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	2,091,677	4,361,946	4,040,169	2,413,454
クラスC 毎日分配型投資証券	915,717	55,196	561,095	409,818
クラスC 無分配投資証券	2,293,432	1,030,503	2,040,917	1,283,018
クラスD 毎月分配型投資証券	2,161,818	3,481,377	2,230,247	3,412,948
クラスD 無分配投資証券	24,458,975	18,100,939	21,430,302	21,129,612
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	40,162	981,063	62,702	958,523
クラスE 無分配投資証券	23,976,748	7,397,802	13,278,976	18,095,574
クラスI 無分配投資証券	500	6,114,398	2,189,025	3,925,873
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	455	1,175,154	141,788	1,033,821
クラスX 無分配投資証券	25,787,318	17,307,223	5,303,282	37,791,259

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

投資有価証券明細表 2017年8月31日現在

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ファンド			
	米国		
1,879,615	SPDR Bloomberg Barclays High Yield Bond - ETF*	69,940,474	0.75
		69,940,474	0.75
ファンド合計			
普通株式およびワラント			
	カナダ		
5,883	Norbord Inc	201,140	0.00
99,749	Northern Graphite Corp (Unit)	22,633	0.00
		223,773	0.00
	ケイマン諸島		
38,649	JD.com Inc ADR	1,613,596	0.02
147,094	Vantage Drilling Co	1,912	0.00
		1,615,508	0.02
	中国		
988,200	Guotai Junan Securities Co Ltd 'H'	2,159,589	0.02
	キプロス		
91,487	Aroundtown Property Holdings Plc	607,321	0.01
	ギリシャ		
121,323	Eurobank Ergasias SA	130,299	0.00
	イタリア		
393,056	Telecom Italia SpA/Milano	375,776	0.00
	日本		
3	Wessex Ltd (Wts 24/6/2019)	36,697	0.00
	英国		
31,813	Sky Plc	391,721	0.01
	米国		
44,616	Apple Inc	7,314,793	0.08
422,534	Bank of America Corp	10,094,337	0.11
11,091	C&J Energy Services Inc*	276,499	0.00
58,728	Citigroup Inc	3,999,377	0.04
30,443	Concho Resources Inc	3,346,599	0.04
106,801	Delta Air Lines Inc	5,045,279	0.06
97,576	Energen Corp*	4,954,909	0.05
84,246	JPMorgan Chase & Co	7,703,454	0.08
26,816	Marathon Petroleum Corp	1,400,332	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
104,356	Matador Resources Co*	2,444,018	0.03
60,964	Morgan Stanley	2,781,787	0.03
16,581	Pioneer Natural Resources Co	2,152,711	0.02
80,180	United Continental Holdings Inc	5,036,106	0.05
23,287	UnitedHealth Group Inc	4,599,648	0.05
103,197	Williams-Sonoma Inc	4,776,989	0.05
		65,926,838	0.71
	ベトナム		
366,692	Vingroup JSC	790,441	0.01
	普通株式およびワラント合計	72,257,963	0.78

債券

	アルゼンチン		
USD 1,143,000	Aeropuertos Argentina 2000 SA ' 144A ' 6.875% 1/2/2027	1,204,722	0.01
USD 1,362,000	Arcor SAIC ' 144A ' 6% 6/7/2023	1,464,150	0.02
ARS 3,401,120	Argentina Bogar Bonds FRN 4/2/2018	93,455	0.00
USD 3,980,000	Argentina Bonar Bonds 7.625% 18/4/2037	4,385,739	0.05
USD 7,972,886	Argentina Bonar Bonds 9% 29/11/2018	8,517,035	0.09
ARS 63,515,870	Argentina Treasury Bond BONCER 2.25% 28/4/2020	4,114,572	0.04
ARS 42,250,000	Argentina Treasury Bond BONCER 2.5% 22/7/2021	2,854,696	0.03
ARS 288,115,000	Argentine Bonos del Tesoro 21.2% 19/9/2018	16,455,629	0.18
ARS 176,738,000	Argentine Bonos del Tesoro 22.75% 5/3/2018	10,110,080	0.11
EUR 6,903,308	Argentine Republic Government International Bond FRN 31/12/2033	9,003,663	0.10
EUR 2,535,000	Argentine Republic Government International Bond 5% 15/1/2027	2,941,757	0.03
USD 20,859,000	Argentine Republic Government International Bond 5.625% 26/1/2022	21,860,232	0.24
USD 40,009,000	Argentine Republic Government International Bond 6.25% 22/4/2019	42,139,479	0.45
USD 2,393,000	Argentine Republic Government International Bond 6.875% 26/1/2027	2,590,422	0.03
USD 4,220,000	Argentine Republic Government International Bond 7.125% 28/6/2117	4,198,900	0.05
EUR 8,360,892	Argentine Republic Government International Bond 7.82% 31/12/2033	11,003,834	0.12
USD 1,115,000	Cablevision SA ' 144A ' 6.5% 15/6/2021	1,192,883	0.01
USD 164,000	Cia Latinoamericana de Infraestructura & Servicios SA ' 144A ' 9.5% 20/7/2023	174,067	0.00
USD 3,637,000	Generacion Mediterranea SA / Generacion Frias SA / Central Termica Roca SA ' 144A ' 9.625% 27/7/2023	4,037,070	0.04
USD 3,055,000	Genneia SA ' 144A ' 8.75% 20/1/2022	3,265,031	0.04
USD 2,593,000	Pampa Energia SA ' 144A ' 7.375% 21/7/2023*	2,806,923	0.03
USD 2,249,000	Pampa Energia SA ' 144A ' 7.5% 24/1/2027*	2,412,052	0.03
USD 5,997,000	Tarjeta Naranja SA ' 144A ' FRN 11/4/2022	5,562,218	0.06
USD 2,994,000	YPF SA ' 144A ' 6.95% 21/7/2027	3,192,353	0.03
USD 570,000	YPF SA ' 144A ' 8.5% 23/3/2021	648,375	0.01
USD 4,426,000	YPF SA ' 144A ' 8.875% 19/12/2018*	4,752,418	0.05
		170,981,755	1.85

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オーストラリア			
EUR 900,000	BHP Billiton Finance Ltd FRN 22/10/2079	1,279,646	0.01
USD 2,100,000	Commonwealth Bank of Australia 3.9% 12/7/2047	2,117,389	0.02
EUR 2,000,000	Cromwell SPV Finance Pty Ltd 2% 4/2/2020	2,376,758	0.03
USD 187,500	Linc Energy Ltd (Defaulted) 10/4/2018 (Zero Coupon)	65,625	0.00
USD 1,600,000	Macquarie Bank Ltd/London FRN 8/3/2027 (Perpetual)	1,634,320	0.02
EUR 600,000	Origin Energy Finance Ltd FRN 16/9/2074*	741,890	0.01
USD 777,000	QBE Insurance Group Ltd FRN 17/6/2046	836,398	0.01
USD 3,376,000	Virgin Australia Holdings Ltd 7.875% 15/10/2021	3,536,360	0.04
		12,588,386	0.14
オーストリア			
EUR 3,300,000	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 8.125% 30/10/2023	5,259,922	0.06
EUR 1,000,000	Erste Group Bank AG FRN 15/10/2021 (Perpetual)	1,391,974	0.01
EUR 200,000	Erste Group Bank AG FRN 15/4/2024 (Perpetual)	259,250	0.00
EUR 5,000,000	Raiffeisen Bank International AG FRN 15/12/2022 (Perpetual)	6,134,525	0.07
EUR 2,400,000	Raiffeisen Bank International AG FRN 21/2/2025	3,040,477	0.03
EUR 500,000	Raiffeisen Bank International AG 6% 16/10/2023	706,815	0.01
EUR 600,000	Raiffeisen Bank International AG 6.625% 18/5/2021	837,471	0.01
EUR 100,000	Sappi Papier Holding GmbH 4% 1/4/2023	125,506	0.00
		17,755,940	0.19
ベルギー			
EUR 700,000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 2% 17/3/2028	886,562	0.01
EUR 700,000	Ethias SA 5% 14/1/2026	910,928	0.01
EUR 200,000	KBC Group NV FRN 19/3/2019 (Perpetual)	246,647	0.00
EUR 300,000	Nyrstar NV 4.25% 25/9/2018	365,180	0.01
		2,409,317	0.03
バミューダ			
USD 1,675,000	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd 7.95% 15/2/2019	1,698,031	0.02
USD 418,000	Digicel Group Ltd '144A' 7.125% 1/4/2022	369,491	0.00
USD 418,000	Digicel Group Ltd '144A' 8.25% 30/9/2020	399,598	0.01
EUR 800,000	Fidelity International Ltd 2.5% 4/11/2026	992,918	0.01
USD 1,192,000	GeoPark Latin America Ltd Agencia en Chile '144A' 7.5% 11/2/2020	1,221,798	0.01
HKD 44,000,000	Haitong International Securities Group Ltd 25/10/2021 (Zero Coupon)	5,829,843	0.06
USD 1,145,000	Inkia Energy Ltd '144A' 8.375% 4/4/2021	1,186,506	0.01
CNH 6,000,000	IT Ltd 6.25% 15/5/2018	903,347	0.01
HKD 348,254	REXLot Holdings Ltd (Defaulted) 6% 28/4/2017	42,727	0.00
HKD 4,062,966	REXLot Holdings Ltd (Defaulted) 4.5% 17/4/2019	467,322	0.01
		13,111,581	0.14
ブラジル			
USD 3,007,000	Brazilian Government International Bond 4.25% 7/1/2025	3,039,325	0.03
USD 4,499,000	Brazilian Government International Bond 6% 7/4/2026	5,000,639	0.06
		8,039,964	0.09

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英領バージン諸島			
USD 1,000,000	Asia View Ltd 1.5% 8/8/2019	1,139,000	0.01
USD 979,000	Bluestar Finance Holdings Ltd 3.5% 30/9/2021*	991,399	0.01
USD 5,395,000	CCTI 2017 Ltd 3.625% 8/8/2022	5,391,517	0.06
USD 743,000	Central American Bottling Corp '144A' 5.75% 31/1/2027	786,651	0.01
USD 2,050,000	Chang Development International Ltd 3.625% 20/1/2020	2,046,156	0.02
USD 2,850,000	China Cinda Finance 2015 I Ltd 4.25% 23/4/2025	2,931,451	0.03
USD 2,400,000	China Cinda Finance 2017 I Ltd 4.4% 9/3/2027	2,471,305	0.03
USD 1,750,000	China Great Wall International Holdings III Ltd 2.625% 27/10/2021	1,719,944	0.02
USD 4,176,000	China Reinsurance Finance Corp Ltd 3.375% 9/3/2022	4,170,968	0.04
USD 4,400,000	China Yangtze Power International BVI 1 Ltd 9/11/2021 (Zero Coupon)	4,715,128	0.05
USD 3,450,000	Chinalco Capital Holdings Ltd 4.25% 21/4/2022*	3,521,057	0.04
USD 1,100,000	CNOOC Finance 2012 Ltd 5% 2/5/2042	1,249,913	0.01
USD 1,600,000	Cosmos Boom Investment Ltd 0.5% 23/6/2020	1,586,800	0.02
USD 2,600,000	CP Foods Holdings Ltd 0.5% 22/9/2021	2,662,400	0.03
USD 1,818,000	Dianjian Haiyu Ltd FRN 14/6/2022 (Perpetual)	1,822,127	0.02
EUR 400,000	Global Switch Holdings Ltd 2.25% 31/5/2027	492,400	0.01
USD 1,014,000	Huarong Finance 2017 Co Ltd FRN 24/1/2022 (Perpetual)	1,040,011	0.01
USD 1,800,000	Huarong Finance 2017 Co Ltd 4.75% 27/4/2027*	1,876,322	0.02
USD 1,217,000	Huarong Finance II Co Ltd 4.625% 3/6/2026*	1,258,877	0.01
USD 835,000	New Metro Global Ltd 5% 8/8/2022	836,509	0.01
USD 2,300,000	Oceanwide Holdings International 2017 Co Ltd 7.75% 27/7/2020	2,300,187	0.02
USD 970,000	PB Issuer No 4 Ltd 3.25% 3/7/2021	970,000	0.01
USD 4,524,000	Prime Bloom Holdings Ltd 6.95% 5/7/2022*	4,211,844	0.05
USD 6,275,000	Proven Glory Capital Ltd 3.25% 21/2/2022	6,352,059	0.07
USD 3,500,000	Proven Glory Capital Ltd 4% 21/2/2027	3,592,722	0.04
USD 699,000	Radiant Access Ltd 4.6% 18/5/2020 (Perpetual)	689,913	0.01
USD 3,680,000	Rock International Investment Inc 6.625% 27/3/2020	3,501,612	0.04
USD 6,400,000	Shanghai Port Group BVI Holding Co Ltd 9/8/2022 (Zero Coupon)	6,494,400	0.07
USD 875,000	Sino-Ocean Land Treasure Finance I Ltd 6% 30/7/2024*	971,194	0.01
USD 209,000	Sino-Ocean Land Treasure Finance II Ltd 5.95% 4/2/2027	228,400	0.00
USD 2,600,000	Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd 4.25% 12/4/2047	2,697,482	0.03
USD 1,800,000	Studio City Co Ltd 7.25% 30/11/2021	1,936,350	0.02
USD 2,545,000	Tewoo Group Finance No 3 Ltd 4.625% 6/4/2020*	2,596,322	0.03
		79,252,420	0.86
カナダ			
USD 3,953,056	Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust '144A' 5% 15/12/2023	4,135,094	0.04
USD 6,874,000	Canbriam Energy Inc '144A' 9.75% 15/11/2019	7,045,850	0.08
USD 3,080,000	Kinross Gold Corp '144A' 4.5% 15/7/2027	3,080,000	0.03
USD 4,578,000	Niska Gas Storage Ltd / Niska Gas Storage Canada Finance Corp 6.5% 1/4/2019	4,658,115	0.05
USD 4,250,000	NOVA Chemicals Corp '144A' 4.875% 1/6/2024	4,257,969	0.05

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
カナダ(続き)			
USD 1,060,000	NOVA Chemicals Corp '144A' 5% 1/5/2025	1,057,350	0.01
USD 6,147,000	NOVA Chemicals Corp '144A' 5.25% 1/8/2023	6,339,094	0.07
USD 5,982,000	Stoneway Capital Corp '144A' 10% 1/3/2027	6,323,572	0.07
USD 2,171,000	Transcanada Trust FRN 15/8/2076	2,371,818	0.03
USD 9,405,000	Transcanada Trust FRN 15/3/2077	9,706,665	0.10
EUR 206,000	Valeant Pharmaceuticals International Inc 4.5% 15/5/2023	202,187	0.00
USD 3,298,000	Valeant Pharmaceuticals International Inc '144A' 5.375% 15/3/2020	3,250,591	0.04
USD 1,099,000	Valeant Pharmaceuticals International Inc '144A' 5.625% 1/12/2021	1,011,080	0.01
USD 7,781,000	Valeant Pharmaceuticals International Inc '144A' 7% 15/3/2024	8,247,860	0.09
		61,687,245	0.67
ケイマン諸島			
USD 2,000,000	AYC Finance Ltd 0.5% 2/5/2019	2,160,000	0.02
USD 3,673,000	China Evergrande Group 7.5% 28/6/2023	3,661,522	0.04
USD 1,863,000	China Evergrande Group 8.75% 28/6/2025	1,881,630	0.02
USD 1,800,000	China Huiyuan Juice Group Ltd 6.5% 16/8/2020*	1,799,559	0.02
USD 4,000,000	China Overseas Finance Investment Cayman V Ltd 5/1/2023 (Zero Coupon)	4,257,500	0.05
USD 682,000	Ctrip.com International Ltd '144A' 1.25% 15/9/2022	737,839	0.01
USD 1,177,000	Energuate Trust '144A' 5.875% 3/5/2027	1,219,860	0.01
USD 3,415,000	ENN Energy Holdings Ltd 3.25% 24/7/2022	3,444,327	0.04
USD 2,200,000	Fantasia Holdings Group Co Ltd 7.95% 5/7/2022*	2,205,720	0.02
USD 1,275,000	Future Land Development Holdings Ltd 5% 16/2/2020	1,318,969	0.01
USD 1,500,000	Haitian International Holdings Ltd 2% 13/2/2019	1,698,180	0.02
HKD 6,000,000	HC International Inc 5% 27/11/2019	755,297	0.01
USD 1,400,000	Hilong Holding Ltd 7.25% 22/6/2020*	1,384,352	0.02
USD 3,188,000	Kaisa Group Holdings Ltd 8.5% 30/6/2022	3,210,391	0.03
USD 1,245,000	Logan Property Holdings Co Ltd 5.25% 23/2/2023*	1,235,663	0.01
HKD 12,454,460	Munsun Capital Group Ltd 7.25% 4/2/2018	1,516,073	0.02
USD 1,050,000	Phoenix Group Holdings 5.375% 6/7/2027	1,103,813	0.01
GBP 375,799	Punch Taverns Finance B Ltd 5.267% 30/3/2024	506,190	0.01
GBP 486,200	Punch Taverns Finance B Ltd 5.943% 30/9/2022	674,051	0.01
USD 2,250,000	Semiconductor Manufacturing International Corp 7/7/2022 (Zero Coupon)	2,423,475	0.03
USD 2,000,000	Shui On Development Holding Ltd FRN 4/6/2020 (Perpetual)	2,136,000	0.02
USD 3,236,000	SPARC EM SPC Panama Metro Line 2 SP 5/12/2022 (Zero Coupon)	2,925,878	0.03
EUR 7,000,000	Strategic International Group Ltd 21/7/2022 (Zero Coupon)	8,715,874	0.09
USD 2,315,000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd 4.45% 23/5/2020 (Perpetual)	2,305,203	0.03
USD 1,130,000	Tecnoglass Inc '144A' 8.2% 31/1/2022	1,169,550	0.01
USD 6,000,000	TPK Holding Co Ltd 8/4/2020 (Zero Coupon)	6,155,220	0.07
GBP 800,000	Trafford Centre Finance Ltd/The FRN 28/7/2035	936,681	0.01
EUR 983,000	UPCB Finance IV Ltd 4% 15/1/2027	1,224,674	0.01
EUR 100,000	Viridian Group FundCo II Ltd 7.5% 1/3/2020	122,988	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD 500,000	Xinyuan Real Estate Co Ltd 8.125% 30/8/2019	500,625	0.01
USD 1,225,000	Yuzhou Properties Co Ltd 6% 25/1/2022*	1,277,062	0.01
		64,664,166	0.70
チリ			
USD 6,757,000	Celeo Redes Operacion Chile SA '144A' 5.2% 22/6/2047	6,892,140	0.07
USD 784,000	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA '144A' 5% 25/1/2047	861,420	0.01
USD 2,106,000	GNL Quintero SA '144A' 4.634% 31/7/2029	2,200,770	0.02
USD 590,000	GNL Quintero SA 4.634% 31/7/2029	616,550	0.01
		10,570,880	0.11
中国			
USD 2,500,000	Bank of China Ltd/Macau 3.5% 20/4/2027	2,549,395	0.03
CNH 10,000,000	China Government Bond 3.3% 4/7/2023	1,478,768	0.02
USD 750,000	China Railway Construction Corp Ltd 29/1/2021 (Zero Coupon)	856,028	0.01
CNY 15,000,000	China Railway Construction Corp Ltd 1.5% 21/12/2021	2,247,634	0.02
USD 5,500,000	CRRC Corp Ltd 5/2/2021 (Zero Coupon)	5,747,500	0.06
USD 950,000	Jinan West City Investment & Development Group Co Ltd 3.125% 11/10/2021	933,380	0.01
USD 5,100,000	Union Life Insurance Co Ltd 3% 19/9/2021	4,910,744	0.05
EUR 5,700,000	Zhejiang Expressway Co Ltd 21/4/2022 (Zero Coupon)	6,902,952	0.08
		25,626,401	0.28
コロンビア			
USD 3,557,000	Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	3,617,469	0.04
USD 10,016,000	Colombia Government International Bond 4.375% 12/7/2021	10,722,128	0.12
USD 127,000	Colombia Government International Bond 11.75% 25/2/2020	157,163	0.00
USD 4,495,000	Credivalores-Crediservicios SAS '144A' 9.75% 27/7/2022	4,607,375	0.05
		19,104,135	0.21
キプロス			
EUR 100,000	Aroundtown Property Holdings Plc 1.5% 18/1/2021	135,730	0.00
GBP 1,800,000	Volcan Holdings Plc 4.125% 11/4/2020	2,687,521	0.03
		2,823,251	0.03
デンマーク			
EUR 200,000	Danske Bank A/S FRN 6/4/2020 (Perpetual)	253,511	0.00
USD 4,700,000	Danske Bank A/S FRN 28/3/2024 (Perpetual)	5,071,159	0.06
DKK 34,083,725	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 2% 1/10/2047	5,328,527	0.06
DKK 42,078,337	Nykredit Realkredit A/S 2% 1/10/2047	6,548,202	0.07
DKK 53,034,068	Realkredit Danmark A/S 2% 1/10/2047	8,284,817	0.09
		25,486,216	0.28
ドミニカ共和国			
USD 1,143,000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA '144A' 6.75% 30/3/2029	1,238,726	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
エジプト			
USD 4,035,000	Egypt Government International Bond 5.75% 29/4/2020	4,219,601	0.04
USD 2,182,000	Egypt Government International Bond '144A' 8.5% 31/1/2047	2,441,113	0.03
USD 3,323,000	Egypt Government International Bond 8.5% 31/1/2047	3,717,606	0.04
		10,378,320	0.11
フィンランド			
EUR 200,000	Stora Enso OYJ 2.5% 7/6/2027	236,604	0.00
フランス			
EUR 2,100,000	Altarea SCA 2.25% 5/7/2024	2,509,424	0.03
EUR 100,000	Autodis SA FRN 1/5/2022	120,475	0.00
EUR 150,000	Autodis SA 4.375% 1/5/2022	184,475	0.00
EUR 278,000	Banijay Group SAS 4% 1/7/2022	343,999	0.00
EUR 500,000	BNP Paribas Cardif SA FRN 25/11/2025 (Perpetual)	645,802	0.01
USD 1,505,000	BNP Paribas SA '144A' 2.95% 23/5/2022	1,522,536	0.02
USD 9,363,000	BNP Paribas SA '144A' 4.625% 13/3/2027	9,967,634	0.11
EUR 419,000	Burger King France SAS FRN 1/5/2023*	515,692	0.01
EUR 325,000	Burger King France SAS 6% 1/5/2024*	414,856	0.01
EUR 1,000,000	Casino Guichard Perrachon SA 1.865% 13/6/2022*	1,205,550	0.01
EUR 200,000	Casino Guichard Perrachon SA 3.58% 7/2/2025	250,343	0.00
EUR 1,300,000	Casino Guichard Perrachon SA 4.048% 5/8/2026	1,668,330	0.02
EUR 2,400,000	Casino Guichard Perrachon SA 4.498% 7/3/2024	3,188,588	0.04
EUR 200,000	Casino Guichard Perrachon SA 5.976% 26/5/2021*	279,118	0.00
EUR 311,000	CMA CGM SA 6.5% 15/7/2022	384,152	0.00
EUR 243,000	CMA CGM SA 7.75% 15/1/2021	304,340	0.00
EUR 300,000	CNP Assurances FRN 10/6/2047	401,907	0.00
EUR 100,000	Credit Agricole Assurances SA FRN 14/10/2025 (Perpetual)	130,075	0.00
EUR 200,000	Credit Agricole SA FRN 23/6/2021 (Perpetual)	262,866	0.00
EUR 227,000	Crown European Holdings SA 3.375% 15/5/2025	282,654	0.00
EUR 400,000	Electricite de France SA FRN 22/1/2022 (Perpetual)	505,713	0.01
USD 1,875,000	Electricite de France SA 3.625% 13/10/2025	1,949,029	0.02
EUR 300,000	Electricite de France SA 4.625% 26/4/2030	471,645	0.01
EUR 300,000	Faurecia 3.625% 15/6/2023	375,815	0.00
EUR 200,000	Groupama SA FRN 28/5/2024 (Perpetual)	273,520	0.00
EUR 600,000	Groupama SA 6% 23/1/2027*	876,753	0.01
EUR 106,000	HomeVi SAS 6.875% 15/8/2021	130,288	0.00
EUR 520,000	Horizon Holdings I SAS 7.25% 1/8/2023	662,604	0.01
EUR 456,000	La Financiere Atalian SAS 4% 15/5/2024	565,031	0.01
EUR 167,000	Loxam SAS 3.5% 15/4/2022*	208,813	0.00
EUR 200,000	Loxam SAS 3.5% 3/5/2023	249,006	0.00
EUR 220,000	Loxam SAS 4.25% 15/4/2024*	281,311	0.00
EUR 108,000	Loxam SAS 6% 15/4/2025	139,533	0.00
EUR 2,850,000	NEW Areva Holding SA 4.875% 23/9/2024	3,787,225	0.04
EUR 5,638	Nexans SA 2.5% 1/1/2019	523,858	0.01
EUR 1,195,000	Orange SA FRN 1/10/2021 (Perpetual)	1,538,656	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
フランス(続き)			
GBP 100,000	Orange SA FRN 1/4/2023 (Perpetual)	144,090	0.00
EUR 510,000	Orange SA FRN 7/2/2024 (Perpetual)	695,750	0.01
EUR 300,000	Orange SA 1% 12/5/2025	362,305	0.00
EUR 1,400,000	Orange SA 3.375% 16/9/2022*	1,910,405	0.02
EUR 271,000	Paprec Holding SA 5.25% 1/4/2022	337,085	0.00
EUR 250,000	Rexel SA 2.625% 15/6/2024	302,275	0.00
EUR 410,000	Rexel SA 3.5% 15/6/2023	513,869	0.01
EUR 300,000	Safran SA FRN 28/6/2021	356,576	0.00
EUR 1,400,000	SapphireOne Mortgages FCT '2016-3' FRN 27/6/2061	1,664,017	0.02
EUR 503,000	SFR Group SA 5.375% 15/5/2022	623,478	0.01
USD 200,000	SFR Group SA 6% 15/5/2022	209,252	0.00
USD 4,160,000	SFR Group SA '144A' 6% 15/5/2022*	4,352,442	0.05
USD 2,093,000	SFR Group SA '144A' 7.375% 1/5/2026	2,257,175	0.03
EUR 320,400	SMCP Group SAS 5.875% 1/5/2023*	413,466	0.01
GBP 200,000	Societe Generale SA FRN 16/6/2018 (Perpetual)	273,001	0.00
EUR 510,000	Solvay Finance SA FRN 2/6/2021 (Perpetual)	675,949	0.01
EUR 100,000	Solvay Finance SA FRN 12/11/2023 (Perpetual)	136,581	0.00
EUR 300,000	SPIE SA 3.125% 22/3/2024*	371,667	0.00
EUR 700,000	Suez FRN 19/4/2024 (Perpetual)	854,564	0.01
EUR 600,000	TDF Infrastructure SAS 2.5% 7/4/2026	747,176	0.01
EUR 100,000	Tereos Finance Groupe I SA 4.125% 16/6/2023	123,910	0.00
EUR 751,000	TOTAL SA FRN 18/5/2022 (Perpetual)	964,681	0.01
EUR 1,550,000	TOTAL SA FRN 26/2/2025 (Perpetual)	1,838,784	0.02
EUR 250,000	Verallia Packaging SASU 5.125% 1/8/2022	315,507	0.00
EUR 450,000	WFS Global Holding SAS 9.5% 15/7/2022	579,291	0.01
		58,144,912	0.63
ドイツ			
EUR 134,000	ADLER Real Estate AG 4.75% 8/4/2020	167,157	0.00
EUR 2,400,000	Bertelsmann SE & Co KGaA FRN 23/4/2075*	2,903,142	0.03
EUR 15,762,000	Bundesrepublik Deutschland 0.25% 15/2/2027*	18,630,147	0.20
EUR 217,000	DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate AG 2.875% 15/7/2022	261,817	0.00
USD 6,295,000	Deutsche Bank AG/New York NY 2.7% 13/7/2020	6,338,218	0.07
EUR 12,472,000	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.1% 15/4/2026*	16,700,152	0.18
EUR 100,000	Deutsche Pfandbriefbank AG 4.6% 22/2/2027	130,069	0.00
EUR 100,000	FTE Verwaltungs GmbH 9% 15/7/2020	123,455	0.00
EUR 298,000	Hapag-Lloyd AG 5.125% 15/7/2024	362,696	0.00
EUR 320,000	HP Pelzer Holding GmbH 4.125% 1/4/2024	390,865	0.00
USD 2,153,000	HSH Nordbank AG 7.25% 30/12/2017 (Perpetual)	476,351	0.01
EUR 425,000	IHO Verwaltungs GmbH 2.75% 15/9/2021	518,019	0.01
EUR 400,000	IHO Verwaltungs GmbH 3.25% 15/9/2023	491,554	0.01
EUR 175,000	IHO Verwaltungs GmbH 3.75% 15/9/2026	217,977	0.00
EUR 225,000	LANXESS AG FRN 6/12/2076	293,582	0.00
EUR 112,000	ProGroup AG FRN 31/3/2024	133,829	0.00
EUR 390,000	ProGroup AG 5.125% 1/5/2022	487,774	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ドイツ(続き)		
EUR 600,000	RAG-Stiftung 31/12/2018 (Zero Coupon)	718,835	0.01
EUR 400,000	RWE AG FRN 21/4/2075	479,415	0.01
EUR 301,000	Senvion Holding GmbH 3.875% 25/10/2022	369,445	0.00
EUR 675,000	thyssenkrupp AG 1.375% 3/3/2022	805,180	0.01
EUR 100,000	thyssenkrupp AG 2.75% 8/3/2021	125,610	0.00
EUR 1,000,000	Unitymedia GmbH 3.75% 15/1/2027	1,207,251	0.01
EUR 992,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 3.5% 15/1/2027	1,221,255	0.01
EUR 497,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 4% 15/1/2025	624,300	0.01
EUR 400,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 4.625% 15/2/2026	516,249	0.01
USD 2,070,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH ‘ 144A’ 5% 15/1/2025	2,189,025	0.02
USD 8,061,300	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH ‘ 144A’ 5.5% 15/1/2023	8,363,599	0.09
EUR 631,400	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 5.625% 15/4/2023	792,253	0.01
EUR 371,061	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 5.75% 15/1/2023	461,182	0.00
EUR 358,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 6.25% 15/1/2029	483,906	0.01
		66,984,309	0.72
	ギリシャ		
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2023	239,087	0.01
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2024	234,304	0.01
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2025	230,466	0.01
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2026	227,528	0.01
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2027	223,630	0.00
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2028	214,091	0.00
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2029	206,321	0.00
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2030	202,159	0.00
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2031	198,302	0.00
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2032	195,792	0.00
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2033	192,467	0.00
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2034	189,546	0.00
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2035	186,242	0.00
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2036	183,401	0.00
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2037	181,491	0.00
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2038	179,589	0.00
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2039	179,138	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ギリシャ(続き)		
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2040	178,772	0.00
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2041	178,584	0.00
EUR 214,328	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2042	178,845	0.00
		3,999,755	0.04
	ガーンジー		
USD 603,774	Doric Nimrod Air Alpha 2013-1 Class A Pass Through Trust '144A' 5.25% 30/5/2023	633,420	0.01
USD 2,525,000	EFG International Guernsey Ltd FRN 5/4/2027	2,591,562	0.03
		3,224,982	0.04
	ホンジュラス		
USD 1,319,000	Inversiones Atlantida SA '144A' 8.25% 28/7/2022	1,358,570	0.01
	香港		
USD 4,600,000	Bagan Capital Ltd 23/9/2021 (Zero Coupon)	5,081,505	0.05
USD 1,834,000	Bank of East Asia Ltd/The FRN 2/12/2020 (Perpetual)*	1,875,723	0.02
USD 335,000	Bank of East Asia Ltd/The FRN 18/5/2022 (Perpetual)	343,416	0.00
USD 1,200,000	Baosteel Hong Kong Investment Co Ltd 1/12/2018 (Zero Coupon)	1,299,600	0.01
USD 1,550,000	Chalieco Hong Kong Corp Ltd FRN 15/1/2020 (Perpetual)	1,609,427	0.02
CNH 942,566	China City Construction International Co Ltd (Defaulted) 5.35% 3/7/2017	99,199	0.00
USD 2,205,000	Chong Hing Bank Ltd FRN 26/7/2027	2,225,391	0.02
USD 9,095,000	CNAC HK Finbridge Co Ltd 3.5% 19/7/2022	9,223,534	0.10
USD 3,400,000	CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.125% 19/7/2027	3,492,689	0.04
USD 6,047,000	CNAC HK Synbridge Co Ltd 5% 5/5/2020	6,204,313	0.07
USD 950,000	Dah Sing Bank Ltd FRN 30/11/2026	980,659	0.01
USD 5,200,000	HeSteel Hong Kong Co Ltd 4.25% 7/4/2020	5,221,970	0.06
USD 1,100,000	Hongkong & Shanghai Banking Corp Ltd/The FRN 27/10/2017 (Perpetual)	916,384	0.01
USD 6,000,000	ICBCIL Finance Co Ltd 3.375% 5/4/2022	6,098,420	0.07
USD 2,350,000	Industrial & Commercial Bank of China Asia Ltd FRN 21/7/2021 (Perpetual)	2,344,125	0.03
USD 5,000,000	Nanyang Commercial Bank Ltd FRN 2/6/2022 (Perpetual)	5,044,303	0.05
USD 1,715,000	Shanghai Hong Kong International Investments Ltd 3.875% 20/4/2020	1,735,863	0.02
CNH 3,000,000	Yufu Eternity Ltd 5.625% 26/11/2017	453,018	0.01
		54,249,539	0.59
	インド		
USD 2,200,000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd '144A' 3.95% 19/1/2022	2,267,720	0.03
INR 2,130,000,000	Food Corp of India 9.95% 7/3/2022	36,801,323	0.40
USD 2,055,000	Hindustan Petroleum Corp Ltd 4% 12/7/2027	2,096,759	0.02
INR 1,300,000,000	Housing Development Finance Corp Ltd 6.875% 30/4/2020	20,453,681	0.22
INR 420,000,000	Housing Development Finance Corp Ltd 7.875% 21/8/2019	6,723,549	0.07
INR 458,000,000	Housing Development Finance Corp Ltd 8.7% 18/5/2020	7,410,934	0.08

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
インド(続き)			
INR 338,000,000	Housing Development Finance Corp Ltd 9.45% 21/8/2019	5,498,564	0.06
INR 830,000,000	Housing Development Finance Corp Ltd 9.65% 17/1/2019	13,390,921	0.15
INR 1,309,000,000	India Government Bond 6.79% 15/5/2027	20,831,995	0.23
INR 185,500,000	India Government Bond 6.79% 26/12/2029	2,887,998	0.03
INR 1,144,000,000	India Government Bond 7.16% 20/5/2023	18,331,382	0.20
INR 182,000,000	India Government Bond 7.59% 20/3/2029	2,977,568	0.03
INR 458,000,000	LIC Housing Finance Ltd 7.2% 24/4/2020	7,164,335	0.08
INR 250,000,000	LIC Housing Finance Ltd 8.25% 23/10/2025	4,090,765	0.04
INR 458,000,000	LIC Housing Finance Ltd 8.6% 28/12/2020	7,445,037	0.08
INR 800,000,000	Mahanagar Telephone Nigam Ltd 8.29% 28/11/2024	13,220,605	0.14
INR 540,000,000	National Highways Authority of India 7.3% 18/5/2022	8,700,990	0.09
INR 200,000,000	NTPC Ltd 9.17% 22/9/2024	3,435,888	0.04
USD 100,000	Suzlon Energy Ltd (Step-up coupon) 5.75% 16/7/2019	105,500	0.00
USD 116,049	Videocon Industries Ltd 2.8% 31/12/2020	67,889	0.00
		183,903,403	1.99
インドネシア			
USD 1,826,000	Bukit Makmur Mandiri Utama PT 7.75% 13/2/2022*	1,919,583	0.02
EUR 3,000,000	Indonesia Government International Bond 3.75% 14/6/2028	3,965,215	0.04
USD 4,580,000	Indonesia Government International Bond 4.125% 15/1/2025	4,816,946	0.05
USD 18,012,000	Indonesia Government International Bond 4.75% 8/1/2026	19,714,314	0.21
USD 7,807,000	Indonesia Government International Bond 5.875% 13/3/2020	8,532,114	0.09
IDR 162,972,000,000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/5/2027	12,498,836	0.14
IDR 215,897,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.5% 15/8/2032	16,770,934	0.18
IDR 160,914,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.5% 15/5/2038	12,392,380	0.13
IDR 678,916,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2036	55,986,097	0.61
IDR 14,959,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/3/2024	1,222,793	0.01
IDR 177,077,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/9/2026	14,670,992	0.16
IDR 121,207,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/3/2034	9,956,880	0.11
USD 970,000	Japfa Comfeed Indonesia Tbk PT 5.5% 31/3/2022	980,913	0.01
USD 3,243,000	Pertamina Persero PT 5.625% 20/5/2043	3,484,644	0.04
USD 6,178,000	Pertamina Persero PT 6.45% 30/5/2044	7,317,113	0.08
USD 1,793,000	Perusahaan Gas Negara Persero Tbk 5.125% 16/5/2024*	1,947,906	0.02
USD 3,750,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.15% 29/3/2027	3,882,244	0.04
		180,059,904	1.94
国際機関			
INR 177,190,000	Asian Development Bank 5.9% 20/12/2022	2,794,517	0.03
アイルランド			
USD 1,922,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.5% 26/5/2022	1,975,911	0.02
USD 5,095,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.65% 21/7/2027	5,104,117	0.05

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	アイルランド(続き)		
EUR 200,000	Allied Irish Banks Plc FRN 3/12/2020 (Perpetual)	261,977	0.00
EUR 639,000	Allied Irish Banks Plc FRN 26/11/2025	812,523	0.01
EUR 625,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 2.75% 15/3/2024	761,985	0.01
EUR 175,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 4.125% 15/5/2023	221,539	0.00
USD 2,192,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc ‘ 144A’ 4.25% 15/9/2022	2,255,020	0.02
USD 6,911,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc ‘ 144A’ 4.625% 15/5/2023	7,109,691	0.08
GBP 372,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 4.75% 15/7/2027*	485,062	0.01
USD 1,100,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc ‘ 144A’ 6% 30/6/2021	1,137,125	0.01
EUR 425,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 6.75% 15/5/2024	566,742	0.01
EUR 150,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/7/2028	177,334	0.00
EUR 150,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/7/2028	173,362	0.00
EUR 550,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/7/2028	496,358	0.01
EUR 2,705,000	Bank of Ireland FRN 11/6/2024	3,392,848	0.04
EUR 800,000	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO 2015-3 DAC ‘ 2015-3X D’ FRN 15/1/2029	953,162	0.01
EUR 1,120,000	CVC Cordatus Loan Fund VI DAC FRN 15/4/2029	1,255,559	0.01
EUR 462,000	eircom Finance DAC 4.5% 31/5/2022	573,588	0.01
EUR 485,000	Fresenius Finance Ireland Plc 3% 30/1/2032	618,532	0.01
USD 18,380,000	GE Capital International Funding Co Unlimited Co 4.418% 15/11/2035	20,042,416	0.22
USD 372,000	Johnson Controls International plc 4.5% 15/2/2047	399,731	0.00
EUR 200,000	Smurfit Kappa Acquisitions Unltd Co 2.375% 1/2/2024	245,924	0.00
EUR 789,025	Taurus 2016-2 DEU DAC ‘2016 - DE2 C’ FRN 3/1/2027	938,801	0.01
EUR 838,484	Taurus 2016-2 DEU DAC ‘2016 - DE2 D’ FRN 3/1/2027	997,898	0.01
GBP 750,000	Virgin Media Receivables Financing Notes I DAC 5.5% 15/9/2024	1,005,247	0.01
		51,962,452	0.56
	マン島		
USD 3,200,000	GohI Capital Ltd 4.25% 24/1/2027	3,340,078	0.04
	イタリア		
EUR 819,770	Asset-Backed European Securitisation Transaction Ten Srl FRN 10/12/2028	973,660	0.01
GBP 200,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 8/2/2022 (Perpetual)	281,156	0.00
EUR 1,100,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 12/12/2042	1,648,636	0.02
EUR 403,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 27/10/2047	552,374	0.01
EUR 700,000	Assicurazioni Generali SpA 4.125% 4/5/2026	928,789	0.01
EUR 600,000	Banco BPM SpA 2.75% 27/7/2020	744,358	0.01
EUR 200,000	Banco BPM SpA 4.25% 30/1/2019	248,628	0.00
EUR 500,000	Buzzi Unicem SpA 2.125% 28/4/2023	623,825	0.01
EUR 257,000	Enel SpA FRN 10/1/2074	328,121	0.00
EUR 200,000	Enel SpA FRN 15/1/2075	256,903	0.00
GBP 105,000	Enel SpA FRN 10/9/2075	155,097	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
イタリア(続き)			
EUR 1,866,771	Fondi Immobili Pubblici Funding SRL FRN 10/1/2023	2,166,538	0.02
EUR 1,470,000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 19/1/2021 (Perpetual)*	1,877,418	0.02
USD 2,720,000	Intesa Sanpaolo SpA ' 144A ' FRN 17/9/2025 (Perpetual)	2,856,000	0.03
EUR 5,005,000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 11/1/2027 (Perpetual)*	6,800,054	0.07
USD 5,380,000	Intesa Sanpaolo SpA ' 144A ' 3.125% 14/7/2022	5,394,117	0.06
USD 6,589,000	Intesa Sanpaolo SpA ' 144A ' 5.017% 26/6/2024	6,675,293	0.07
EUR 150,000	Intesa Sanpaolo SpA 5.15% 16/7/2020	199,410	0.00
EUR 13,590,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.45% 22/5/2023	16,215,079	0.18
EUR 21,020,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.05% 1/8/2027	24,821,502	0.27
EUR 16,455,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.1% 15/9/2021*	23,686,193	0.26
EUR 15,100,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.15% 12/11/2017*	18,056,502	0.20
EUR 8,300,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.2% 1/6/2027*	9,985,585	0.11
EUR 2,600,000	Leonardo SpA 1.5% 7/6/2024	3,075,855	0.03
EUR 351,000	LKQ Italia Bondco SpA 3.875% 1/4/2024	456,803	0.01
EUR 300,000	Prysmian SpA 17/1/2022 (Zero Coupon)	373,818	0.00
EUR 320,000	Snaittech SpA 6.375% 7/11/2021*	408,530	0.01
EUR 2,700,000	Telecom Italia SpA/Milano 1.125% 26/3/2022	3,199,534	0.04
EUR 1,490,000	Telecom Italia SpA/Milano 3% 30/9/2025	1,886,949	0.02
EUR 1,155,000	Telecom Italia SpA/Milano 3.25% 16/1/2023	1,515,374	0.02
EUR 267,000	Telecom Italia SpA/Milano 3.625% 19/1/2024*	355,031	0.00
USD 1,218,000	Telecom Italia SpA/Milano ' 144A ' 5.303% 30/5/2024	1,323,052	0.01
GBP 200,000	Telecom Italia SpA/Milano 5.875% 19/5/2023	306,773	0.00
EUR 200,000	UniCredit SpA FRN 10/9/2021 (Perpetual)	246,109	0.00
EUR 3,935,000	UniCredit SpA FRN 3/6/2022 (Perpetual)	5,457,267	0.06
EUR 12,600,000	UniCredit SpA FRN 3/6/2023 (Perpetual)	15,446,980	0.17
EUR 1,412,000	UniCredit SpA FRN 28/10/2025	1,859,298	0.02
EUR 1,445,000	UniCredit SpA FRN 3/1/2027	1,839,271	0.02
USD 15,318,000	UniCredit SpA ' 144A ' FRN 19/6/2032	16,039,325	0.17
EUR 900,000	UniCredit SpA 6.95% 31/10/2022	1,296,508	0.01
		180,561,715	1.95
日本			
JPY 40,000,000	Chugoku Electric Power Co Inc/The 23/3/2018 (Zero Coupon)	361,165	0.00
JPY 20,000,000	Chugoku Electric Power Co Inc/The 25/3/2020 (Zero Coupon)	181,172	0.00
JPY 40,000,000	Ezaki Glico Co Ltd 30/1/2024 (Zero Coupon)	387,862	0.00
JPY 380,000,000	HIS Co Ltd 30/8/2019 (Zero Coupon)	3,605,792	0.04
JPY 230,000,000	Iida Group Holdings Co Ltd 18/6/2020 (Zero Coupon)	2,123,580	0.02
JPY 360,000,000	Iwatani Corp 22/10/2020 (Zero Coupon)	3,408,266	0.04
JPY 70,000,000	Kanden Co Ltd 31/3/2021 (Zero Coupon)	731,035	0.01
JPY 250,000,000	Kansai Paint Co Ltd 17/6/2019 (Zero Coupon)	2,566,484	0.03
JPY 230,000,000	Kansai Paint Co Ltd 17/6/2022 (Zero Coupon)	2,272,846	0.03
JPY 90,000,000	Kyushu Electric Power Co Inc 31/3/2022 (Zero Coupon)	872,050	0.01
JPY 230,000,000	LIXIL Group Corp 4/3/2020 (Zero Coupon)	2,131,791	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	日本(続き)		
JPY 20,000,000	LIXIL Group Corp 4/3/2022 (Zero Coupon)	188,747	0.00
JPY 290,000,000	Mitsubishi Chemical Holdings Corp 30/3/2022 (Zero Coupon)	2,768,211	0.03
JPY 140,000,000	Mitsubishi Chemical Holdings Corp 29/3/2024 (Zero Coupon)	1,363,017	0.02
USD 9,460,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.665% 25/7/2022	9,524,300	0.10
USD 2,961,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.998% 22/2/2022	3,028,848	0.03
USD 2,850,000	Mitsui Fudosan Co Ltd 3.65% 20/7/2027	2,975,423	0.03
USD 900,000	Mitsui OSK Lines Ltd 24/4/2020 (Zero Coupon)	867,375	0.01
USD 8,443,000	Mizuho Financial Group Inc 2.953% 28/2/2022	8,584,091	0.09
JPY 130,000,000	Nagoya Railroad Co Ltd 11/12/2024 (Zero Coupon)	1,252,849	0.01
JPY 380,000,000	Resorttrust Inc 1/12/2021 (Zero Coupon)	3,479,704	0.04
JPY 150,000,000	Shimizu Corp 16/10/2020 (Zero Coupon)	1,477,534	0.02
USD 100,000	Shizuoka Bank Ltd/The 25/4/2018 (Zero Coupon)	98,762	0.00
USD 4,782,000	SoftBank Group Corp FRN 19/7/2023 (Perpetual)	4,805,910	0.05
USD 500,000	SoftBank Group Corp FRN 19/7/2027 (Perpetual)	514,280	0.01
EUR 160,000	SoftBank Group Corp 4.75% 30/7/2025	213,731	0.00
EUR 700,000	SoftBank Group Corp 5.25% 30/7/2027	950,131	0.01
USD 5,275,000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.784% 12/7/2022	5,332,302	0.06
JPY 80,000,000	Takashimaya Co Ltd 11/12/2018 (Zero Coupon)	725,498	0.01
JPY 50,000,000	Tohoku Electric Power Co Inc 3/12/2018 (Zero Coupon)	452,530	0.01
JPY 320,000,000	Tohoku Electric Power Co Inc 3/12/2020 (Zero Coupon)	2,939,686	0.03
JPY 140,000,000	Toray Industries Inc 30/8/2019 (Zero Coupon)	1,533,632	0.02
JPY 120,000,000	Transcosmos Inc 22/12/2020 (Zero Coupon)	1,091,379	0.01
USD 7,299,978	Universal Entertainment Corp ' 144A ' 8.5% 24/8/2020	7,483,353	0.08
USD 3,000,000	Yamaguchi Financial Group Inc FRN 26/3/2020	3,117,750	0.03
		83,411,086	0.90
	ジャージー		
GBP 3,477,000	AA Bond Co Ltd 2.75% 31/7/2023	4,534,681	0.05
EUR 430,000	Adient Global Holdings Ltd 3.5% 15/8/2024	524,088	0.01
EUR 350,000	Avis Budget Finance Plc 4.125% 15/11/2024*	414,895	0.00
EUR 560,000	Avis Budget Finance Plc 4.5% 15/5/2025	663,680	0.01
GBP 4,738,000	CPUK Finance Ltd 4.25% 28/8/2022	6,213,986	0.07
GBP 184,000	CPUK Finance Ltd 4.875% 28/8/2025	241,147	0.00
USD 214,000	Delphi Automotive Plc 4.25% 15/1/2026	230,417	0.00
USD 738,000	Delphi Automotive Plc 4.4% 1/10/2046	750,255	0.01
USD 1,400,000	HBOS Capital Funding LP 6.85% 23/12/2017 (Perpetual)	1,436,750	0.02
EUR 1,357,000	LHC3 Plc 4.125% 15/8/2024	1,628,829	0.02
EUR 100,000	Lincoln Finance Ltd 6.875% 15/4/2021	126,304	0.00
EUR 900,000	Mercury Bondco Plc 7.125% 30/5/2021*	1,114,798	0.01
EUR 606,912	Mercury Bondco Plc 8.25% 30/5/2021*	759,530	0.01
EUR 250,000	RZB Finance Jersey IV Ltd FRN 16/11/2017 (Perpetual)	290,723	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ジャージー (続き)		
USD 400,000	Tullow Oil Jersey Ltd 6.625% 12/7/2021	426,660	0.00
GBP 202,000	TVL Finance Plc FRN 15/5/2023	263,698	0.00
		19,620,441	0.21
	クウェート		
USD 1,075,000	Kuwait International Government Bond 2.75% 20/3/2022	1,092,469	0.01
	レバノン		
USD 8,682,000	Lebanon Government International Bond 6.85% 23/3/2027*	8,703,358	0.09
	ルクセンブルグ		
EUR 3,800,000	ADO Properties SA 1.5% 26/7/2024	4,534,129	0.05
EUR 2,290,000	Allergan Funding SCS 1.25% 1/6/2024	2,727,699	0.03
EUR 2,500,000	Allergan Funding SCS 2.125% 1/6/2029	3,029,804	0.03
USD 25,313,000	Allergan Funding SCS 3.8% 15/3/2025	26,429,734	0.29
USD 6,550,000	Allergan Funding SCS 4.55% 15/3/2035	7,044,767	0.08
USD 2,550,000	Allergan Funding SCS 4.75% 15/3/2045	2,788,558	0.03
USD 1,359,000	Altice Financing SA '144A' 6.625% 15/2/2023	1,432,250	0.02
USD 450,000	Altice Finco SA '144A' 8.125% 15/1/2024	485,437	0.01
EUR 810,000	Altice Luxembourg SA 6.25% 15/2/2025*	1,046,699	0.01
EUR 558,000	Altice Luxembourg SA 7.25% 15/5/2022	703,951	0.01
GBP 100,000	Amigo Luxembourg SA 7.625% 15/1/2024	132,411	0.00
EUR 100,000	ArcelorMittal 3% 9/4/2021	127,699	0.00
EUR 100,000	ArcelorMittal 3.125% 14/1/2022	129,121	0.00
EUR 200,000	ARD Finance SA 6.625% 15/9/2023	253,165	0.00
GBP 200,000	B&M European Value Retail SA 4.125% 1/2/2022	267,044	0.00
EUR 498,000	Befesa Zinc SAU Via Zinc Capital SA 8.875% 15/5/2018*	589,257	0.01
EUR 810,000	Bilbao Luxembourg SA 10.5% 1/12/2018*	962,846	0.01
EUR 125,000	BMBG Bond Finance SCA 3% 15/6/2021	152,784	0.00
GBP 100,000	Cabot Financial Luxembourg SA 6.5% 1/4/2021	132,768	0.00
GBP 244,000	Cabot Financial Luxembourg SA 7.5% 1/10/2023*	340,951	0.00
EUR 100,000	Cirsa Funding Luxembourg SA 5.75% 15/5/2021	125,589	0.00
EUR 330,000	Cirsa Funding Luxembourg SA 5.875% 15/5/2023	413,798	0.00
EUR 401,000	CNH Industrial Finance Europe SA 1.375% 23/5/2022	483,059	0.01
EUR 391,000	Codere Finance 2 Luxembourg SA 6.75% 1/11/2021	476,712	0.01
EUR 276,000	ContourGlobal Power Holdings SA 5.125% 15/6/2021	345,163	0.00
EUR 380,000	DEA Finance SA 7.5% 15/10/2022*	492,080	0.01
USD 3,347,329	Dragon Aviation Finance Luxembourg SA 4% 28/11/2022	3,402,711	0.04
EUR 400,000	Eurofins Scientific SE 2.125% 25/7/2024	480,556	0.01
EUR 18,067,000	European Financial Stability Facility 1.8% 10/7/2048	22,321,552	0.24
EUR 159,000	Fiat Chrysler Finance Europe SA 4.75% 15/7/2022	214,467	0.00
EUR 165,000	Gestamp Funding Luxembourg SA 3.5% 15/5/2023	205,451	0.00
EUR 400,000	Grand City Properties SA FRN 18/2/2022 (Perpetual)	505,927	0.01
EUR 325,000	Horizon Parent Holdings Sarl 8.25% 15/2/2022	412,852	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ルクセンブルグ (続き)			
EUR 300,000	INEOS Group Holdings SA 5.375% 1/8/2024	381,980	0.00
EUR 800,000	JH-Holding Finance SA 8.25% 1/12/2022	1,043,166	0.01
EUR 139,000	Matterhorn Telecom SA FRN 1/2/2023	165,717	0.00
EUR 505,000	Matterhorn Telecom SA 3.875% 1/5/2022	619,719	0.01
USD 732,000	Minerva Luxembourg SA ' 144A ' 6.5% 20/9/2026	737,036	0.01
USD 295,000	Raizen Fuels Finance SA ' 144A ' 5.3% 20/1/2027	310,119	0.00
USD 4,451,000	Rumo Luxembourg Sarl ' 144A ' 7.375% 9/2/2024*	4,745,879	0.05
EUR 2,000,000	SES SA FRN 2/1/2022 (Perpetual)	2,550,125	0.03
EUR 251,000	Swissport Financing Sarl 6.75% 15/12/2021	320,732	0.00
EUR 970,000	Swissport Financing Sarl 9.75% 15/12/2022*	1,273,704	0.01
EUR 700,000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/1/2033	1,224,435	0.01
EUR 729,000	Telenet Finance V Luxembourg SCA 6.75% 15/8/2024*	944,868	0.01
EUR 300,000	Telenet Finance VI Luxembourg SCA 4.875% 15/7/2027*	392,314	0.00
EUR 400,000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc 6.375% 1/5/2022	510,952	0.01
USD 1,498,000	Venator Finance Sarl / Venator Materials LLC ' 144A ' 5.75% 15/7/2025	1,530,769	0.02
USD 2,354,000	VM Holding SA ' 144A ' 5.375% 4/5/2027	2,468,875	0.03
EUR 849,000	Wind Acquisition Finance SA 4% 15/7/2020	1,018,792	0.01
USD 200,000	Wind Acquisition Finance SA ' 144A ' 4.75% 15/7/2020	203,000	0.00
EUR 200,000	Wind Acquisition Finance SA 7% 23/4/2021	247,885	0.00
USD 1,010,000	Wind Acquisition Finance SA ' 144A ' 7.375% 23/4/2021	1,051,031	0.01
		104,932,089	1.13
マレーシア			
USD 4,200,000	1MDB Energy Ltd 5.99% 11/5/2022	4,562,250	0.05
USD 1,000,000	Cahaya Capital Ltd 18/9/2021 (Zero Coupon)	980,250	0.01
		5,542,500	0.06
モルディブ			
USD 1,400,000	Republic of Maldives Ministry of Finance and Treasury Bond 7% 7/6/2022	1,408,894	0.02
モーリシャス			
USD 4,475,000	Greenko Investment Co 4.875% 16/8/2023	4,410,672	0.05
USD 3,299,000	Neerg Energy Ltd 6% 13/2/2022	3,395,908	0.03
		7,806,580	0.08
メキシコ			
USD 2,314,000	Banco Inbursa SA Institucion de Banca Multiple ' 144A ' 4.375% 11/4/2027	2,328,462	0.02
USD 2,360,000	Grupo KU0 SAB De CV ' 144A ' 5.75% 7/7/2027*	2,451,450	0.03
MXN 2,283,000	Mexican Bonos 4.75% 14/6/2018	12,621,504	0.14
MXN 2,989,716	Mexican Bonos 5.75% 5/3/2026	15,700,851	0.17
MXN 1,058,000	Mexican Bonos 7.5% 3/6/2027	6,236,339	0.07
MXN 300,000	Mexican Bonos 8% 7/11/2047	1,853,636	0.02
MXV 167,499	Mexican Udibonos 3.5% 14/12/2017	5,493,650	0.06
USD 6,010,000	Mexico Government International Bond 4.15% 28/3/2027	6,363,088	0.07
USD 894,000	Petroleos Mexicanos 4.625% 21/9/2023	928,642	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	メキシコ(続き)		
USD 388,000	PLA Administradora Industrial S de RL de CV ' 144A ' 5.25% 10/11/2022	410,310	0.00
USD 1,135,000	Trust F/1401 6.95% 30/1/2044*	1,234,313	0.01
		55,622,245	0.60
	モンゴル		
USD 569,492	Energy Resources LLC FRN 30/9/2022	570,489	0.00
CNH 5,000,000	Mongolia Government International Bond 7.5% 30/6/2018	764,718	0.01
USD 1,430,000	Trade & Development Bank of Mongolia LLC 9.375% 19/5/2020	1,550,735	0.02
		2,885,942	0.03
	オランダ		
EUR 2,100,000	ABN AMRO Bank NV FRN 22/9/2020 (Perpetual)	2,656,036	0.03
USD 74,359	AE-Rotor Holding BV 4.969% 28/3/2018	74,406	0.00
EUR 782,000	ASML Holding NV 1.625% 28/5/2027	955,426	0.01
USD 500,000	AT Securities BV FRN 21/7/2023 (Perpetual)	495,030	0.01
EUR 800,000	ATF Netherlands BV 1.875% 19/1/2026	946,348	0.01
EUR 150,000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/1/2025	187,489	0.00
EUR 200,000	Constellium NV 7% 15/1/2023*	252,320	0.00
USD 259,000	Constellium NV ' 144A ' 7.875% 1/4/2021	276,482	0.00
EUR 200,000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/6/2020 (Perpetual)	253,679	0.00
EUR 400,000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/6/2021 (Perpetual)	530,464	0.01
EUR 100,000	Darling Global Finance BV 4.75% 30/5/2022	124,891	0.00
USD 4,300,000	Deutsche Telekom International Finance BV ' 144A ' 3.6% 19/1/2027	4,393,921	0.05
EUR 171,000	Diamond BC BV 5.625% 15/8/2025	206,507	0.00
EUR 1,225,000	ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG FRN 29/9/2047	1,524,073	0.02
USD 2,240,000	Enel Finance International NV ' 144A ' 2.875% 25/5/2022	2,262,158	0.02
USD 10,290,000	Enel Finance International NV ' 144A ' 3.625% 25/5/2027	10,430,103	0.11
EUR 100,000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.75% 29/3/2024	129,002	0.00
EUR 1,000,000	Gas Natural Fenosa Finance BV FRN 24/4/2024 (Perpetual)	1,211,791	0.01
USD 4,250,000	Greenko Dutch BV 5.25% 24/7/2024*	4,279,219	0.05
EUR 500,000	Hertz Holdings Netherlands BV 4.125% 15/10/2021*	582,395	0.01
USD 775,000	ING Groep NV FRN 16/4/2022 (Perpetual)	840,224	0.01
USD 3,891,000	ING Groep NV 3.95% 29/3/2027	4,083,733	0.04
USD 867,000	Jababeka International BV 6.5% 5/10/2023	896,209	0.01
EUR 292,000	Koninklijke KPN NV FRN 14/9/2018 (Perpetual)	365,254	0.00
GBP 220,000	Koninklijke KPN NV FRN 14/3/2073	314,809	0.00
USD 6,214,000	LYB International Finance II BV 3.5% 2/3/2027	6,234,195	0.07
USD 767,000	Marfrig Holdings Europe BV ' 144A ' 8% 8/6/2023	792,886	0.01
EUR 100,000	Maxeda DIY Holding BV 6.125% 15/7/2022	122,954	0.00
USD 4,150,000	Minejesa Capital BV 4.625% 10/8/2030	4,237,623	0.05
USD 2,141,000	NXP BV / NXP Funding LLC ' 144A ' 3.875% 1/9/2022	2,218,611	0.02
USD 10,173,000	NXP BV / NXP Funding LLC ' 144A ' 4.125% 1/6/2021	10,632,006	0.12
EUR 790,000	Nyrstar Netherlands Holdings BV 6.875% 15/3/2024*	964,910	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ(続き)			
EUR 175,000	OI European Group BV 3.125% 15/11/2024	214,016	0.00
EUR 380,000	Petrobras Global Finance BV 3.75% 14/1/2021	475,312	0.01
USD 2,220,000	Petrobras Global Finance BV 4.375% 20/5/2023*	2,167,308	0.02
EUR 700,000	Petrobras Global Finance BV 4.75% 14/1/2025	870,665	0.01
USD 1,149,000	Petrobras Global Finance BV 4.875% 17/3/2020	1,182,011	0.01
USD 13,542,000	Petrobras Global Finance BV 5.375% 27/1/2021	14,054,836	0.15
USD 1,149,000	Petrobras Global Finance BV 5.75% 20/1/2020	1,203,577	0.01
USD 1,193,000	Petrobras Global Finance BV 6.125% 17/1/2022*	1,266,071	0.01
USD 1,218,000	Petrobras Global Finance BV 7.375% 17/1/2027	1,340,713	0.02
USD 17,429,000	Petrobras Global Finance BV 8.375% 23/5/2021	19,803,701	0.21
EUR 300,000	Repsol International Finance BV FRN 25/3/2021 (Perpetual)*	374,739	0.00
EUR 1,747,000	Repsol International Finance BV FRN 25/3/2075	2,203,491	0.02
USD 538,000	Royal Capital BV FRN 5/5/2024 (Perpetual)*	544,429	0.01
USD 200,000	Samvardhana Motherson Automotive Systems Group BV 4.875% 16/12/2021	210,000	0.00
USD 6,390,000	Siemens Financieringsmaatschappij NV ' 144A ' 3.125% 16/3/2024	6,576,521	0.07
USD 9,715,000	Siemens Financieringsmaatschappij NV ' 144A ' 3.4% 16/3/2027	10,026,351	0.11
EUR 1,200,000	Telefonica Europe BV FRN 4/12/2019 (Perpetual)	1,506,042	0.02
GBP 200,000	Telefonica Europe BV FRN 26/11/2020 (Perpetual)	286,503	0.00
EUR 700,000	Telefonica Europe BV FRN 18/9/2021 (Perpetual)	994,251	0.01
EUR 500,000	Telefonica Europe BV FRN 15/3/2022 (Perpetual)	620,663	0.01
EUR 2,000,000	TenneT Holding BV FRN 1/6/2024 (Perpetual)	2,417,536	0.03
EUR 395,000	United Group BV FRN 1/7/2023	474,303	0.01
EUR 258,000	United Group BV 4.375% 1/7/2022	312,113	0.00
EUR 354,000	United Group BV 4.875% 1/7/2024	427,468	0.01
EUR 200,000	UPC Holding BV 6.75% 15/3/2023	252,611	0.00
EUR 4,100,000	Volkswagen International Finance NV FRN 14/12/2022 (Perpetual)	4,820,107	0.05
EUR 14,200,000	Volkswagen International Finance NV FRN 14/6/2027 (Perpetual)	16,496,242	0.18
EUR 2,000,000	Volkswagen International Finance NV 1.875% 30/3/2027	2,387,439	0.03
EUR 300,000	Wereldhave NV 1% 22/5/2019	359,490	0.00
EUR 1,200,000	Ziggo Bond Co BV 7.125% 15/5/2024	1,607,779	0.02
EUR 481,000	Ziggo Bond Finance BV 4.625% 15/1/2025*	604,302	0.01
EUR 500,000	Ziggo Secured Finance BV 4.25% 15/1/2027	627,404	0.01
USD 8,437,000	Ziggo Secured Finance BV ' 144A ' 5.5% 15/1/2027*	8,700,656	0.09
		168,883,804	1.82
ノルウェー			
USD 200,000	DNB Bank ASA FRN 26/3/2022 (Perpetual)	217,138	0.00
EUR 400,000	Silk Bidco AS 7.5% 1/2/2022	502,647	0.01
		719,785	0.01
パナマ			
USD 1,158,000	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA ' 144A ' 5.625% 18/5/2036	1,240,872	0.01
USD 851,000	AES Panama SRL ' 144A ' 6% 25/6/2022	894,614	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	パナマ(続き)		
USD 1,972,000	Avianca Holdings SA / Avianca Leasing LLC / Grupo Taca Holdings Ltd 8.375% 10/5/2020	1,991,720	0.02
		4,127,206	0.04
	ペルー		
USD 2,351,000	Orazul Energy Egenor S en C por A '144A' 5.625% 28/4/2027	2,296,339	0.02
	ポルトガル		
EUR 200,000	Banco Espirito Santo SA (Restricted) (Defaulted) 2.625% 8/5/2017	73,792	0.00
EUR 1,800,000	Banco Espirito Santo SA (Restricted) 4% 21/1/2019	618,787	0.01
EUR 2,000,000	Banco Espirito Santo SA (Restricted) 4.75% 15/1/2018	687,541	0.01
EUR 500,000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No. 1 FRN 20/3/2033	597,234	0.00
EUR 900,000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No. 1 FRN 20/3/2033	1,079,929	0.01
EUR 11,887,020	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta IV 2.423% 12/2/2021	14,566,913	0.16
EUR 1,342,551	TAGUS-Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta II Electricity Receivables 2.98% 16/2/2018	1,607,573	0.02
		19,231,769	0.21
	ロシア連邦		
RUB 550,338,000	Russian Federal Bond - OFZ 6.4% 27/5/2020	9,171,318	0.10
RUB 665,894,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.05% 19/1/2028	11,022,779	0.12
RUB 325,929,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.4% 7/12/2022	5,537,905	0.06
RUB 1,960,481,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.5% 18/8/2021	33,516,160	0.36
RUB 737,277,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.75% 16/9/2026	12,729,802	0.14
RUB 2,172,544,000	Russian Federal Bond - OFZ 8.15% 3/2/2027	38,592,756	0.41
USD 2,600,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.25% 23/6/2027	2,674,100	0.03
USD 10,600,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.75% 27/5/2026	11,289,000	0.12
USD 7,400,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.875% 16/9/2023	8,114,100	0.09
		132,647,920	1.43
	シンガポール		
USD 4,125,000	BPRL International Singapore Pte Ltd 4.375% 18/1/2027	4,333,303	0.05
USD 4,200,000	Bumi Investment Pte Ltd (Defaulted) 10.75% 6/10/2017	2,331,000	0.02
USD 1,000,000	Enercoal Resources Pte Ltd (Defaulted) 9.25% 5/8/2014	400,000	0.00
USD 3,200,000	Medco Straits Services Pte Ltd 8.5% 17/8/2022	3,264,089	0.04
USD 1,600,000	Modernland Overseas Pte Ltd 6.95% 13/4/2024*	1,598,000	0.02
USD 424,000	TML Holdings Pte Ltd 5.75% 7/5/2021	450,712	0.00
		12,377,104	0.13
	南アフリカ		
USD 19,401,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.5% 9/3/2020	20,746,944	0.22
USD 3,888,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.875% 30/5/2022	4,295,754	0.05
		25,042,698	0.27

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
韓国			
USD 2,850,000	GS Caltex Corp 3% 12/6/2022	2,858,869	0.03
USD 2,000,000	GS Engineering & Construction Corp 4.5% 21/7/2021	2,094,910	0.02
USD 3,800,000	Hyundai Capital Services Inc 3% 29/8/2022	3,793,180	0.04
USD 600,000	Hyundai Heavy Industries Co Ltd 29/6/2020 (Zero Coupon)	589,872	0.01
KRW 3,600,000,000	Kakao Corp 11/5/2021 (Zero Coupon)	3,191,823	0.03
KRW 45,000,000,000	Korea Monetary Stabilization Bond 1.46% 2/4/2018	40,028,019	0.43
USD 700,000	Korean Air Lines Co Ltd FRN 12/6/2047*	718,495	0.01
USD 3,249,000	Woori Bank FRN 27/9/2021 (Perpetual)	3,263,621	0.04
USD 6,500,000	Woori Bank FRN 16/5/2022 (Perpetual)*	6,663,287	0.07
USD 3,100,000	Woori Bank 4.75% 30/4/2024	3,262,931	0.04
		66,465,007	0.72
スペイン			
EUR 600,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 19/2/2019 (Perpetual)	737,487	0.01
EUR 800,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 18/2/2020 (Perpetual)	998,120	0.01
EUR 3,200,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 14/4/2021 (Perpetual)	4,426,892	0.05
EUR 400,000	Banco Santander SA FRN 12/3/2019 (Perpetual)	488,984	0.01
EUR 1,900,000	Banco Santander SA FRN 25/4/2022 (Perpetual)	2,469,072	0.03
EUR 6,600,000	Bankia SA FRN 18/7/2022 (Perpetual)*	7,853,082	0.08
EUR 1,500,000	Bankia SA FRN 22/5/2024	1,860,610	0.02
EUR 6,400,000	Bankia SA FRN 15/3/2027*	7,901,407	0.09
EUR 200,000	BPE Financiaciones SA 2% 3/2/2020	247,331	0.00
EUR 11,800,000	CaixaBank SA FRN 13/6/2024 (Perpetual)*	14,991,535	0.16
EUR 4,500,000	CaixaBank SA FRN 15/2/2027	5,667,021	0.06
EUR 200,000	Grifols SA 3.2% 1/5/2025	241,137	0.00
EUR 316,000	Grupo-Antolin Irausa SA 3.25% 30/4/2024	384,791	0.00
EUR 310,000	NH Hotel Group SA 3.75% 1/10/2023	388,723	0.00
EUR 33,834,000	Spain Government Bond '144A' 1.5% 30/4/2027	40,352,691	0.44
EUR 400,000	SRF 2017-1 Fondo de Titulizacion FRN 26/4/2063	450,896	0.01
EUR 900,000	SRF 2017-1 Fondo de Titulizacion FRN 26/4/2063	1,076,032	0.01
EUR 200,000	SRF 2017-1 Fondo de Titulizacion '2017-1 C' FRN 26/4/2063	234,675	0.00
		90,770,486	0.98
スリランカ			
LKR 1,500,000,000	Sri Lanka Government Bonds 10.75% 15/1/2019	9,960,086	0.11
LKR 1,072,010,000	Sri Lanka Government Bonds 11% 1/8/2021	7,172,484	0.08
LKR 1,500,000,000	Sri Lanka Government Bonds 11.5% 15/12/2021	10,231,127	0.11
USD 1,750,000	Sri Lanka Government International Bond 5.75% 18/1/2022	1,853,670	0.02
USD 875,000	Sri Lanka Government International Bond 6.25% 27/7/2021	943,373	0.01
USD 2,649,000	Sri Lanka Government International Bond 6.825% 18/7/2026	2,906,350	0.03
USD 4,950,000	Sri Lanka Government International Bond 6.85% 3/11/2025	5,440,916	0.06
USD 300,000	SriLankan Airlines Ltd 5.3% 27/6/2019	305,118	0.00
		38,813,124	0.42

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
スウェーデン			
SEK 6,682,183	Bluestep Mortgage Securities No2 Ltd FRN 10/11/2055	852,421	0.01
EUR 200,000	Corral Petroleum Holdings AB 11.75% 15/5/2021	261,754	0.00
EUR 208,000	Intrum Justitia AB FRN 15/7/2022	251,313	0.00
EUR 275,000	Intrum Justitia AB 2.75% 15/7/2022	329,986	0.01
USD 7,800,000	Skandinaviska Enskilda Banken AB FRN 13/5/2022 (Perpetual)	8,151,624	0.09
EUR 200,000	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 1.875% 1/3/2024	233,437	0.00
EUR 100,000	Unilabs Subholding AB 5.75% 15/5/2025	119,505	0.00
EUR 112,500	Verisure Holding AB 6% 1/11/2022	144,103	0.00
		10,344,143	0.11
スイス			
USD 11,870,000	Credit Suisse Group AG FRN 29/7/2022 (Perpetual)	12,805,890	0.14
USD 1,600,000	Credit Suisse Group AG FRN 11/12/2023 (Perpetual)	1,806,000	0.02
USD 2,600,000	Credit Suisse Group AG FRN 18/12/2024 (Perpetual)	2,762,500	0.03
USD 8,570,000	Credit Suisse Group AG '144A' 3.574% 9/1/2023	8,812,677	0.10
USD 2,740,000	Credit Suisse Group AG '144A' 4.282% 9/1/2028	2,863,132	0.03
USD 5,795,000	UBS AG/London '144A' 2.2% 8/6/2020	5,822,833	0.06
USD 3,400,000	UBS Group AG FRN 19/2/2020 (Perpetual)	3,644,851	0.04
USD 2,158,000	UBS Group AG FRN 22/3/2021 (Perpetual)	2,314,207	0.02
USD 800,000	UBS Group AG FRN 10/8/2021 (Perpetual)	858,156	0.01
EUR 800,000	UBS Group AG FRN 19/2/2022 (Perpetual)*	1,063,754	0.01
USD 1,800,000	UBS Group AG FRN 19/2/2025 (Perpetual)	2,004,777	0.02
USD 2,647,000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' 3.491% 23/5/2023	2,723,146	0.03
USD 8,846,000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' 4.253% 23/3/2028	9,403,457	0.10
		56,885,380	0.61
台湾			
USD 2,400,000	Advanced Semiconductor Engineering Inc 27/3/2018 (Zero Coupon)	2,445,000	0.03
USD 1,500,000	Neo Solar Power Corp 27/10/2019 (Zero Coupon)	1,514,055	0.01
		3,959,055	0.04
タイ			
THB 79,000,000	Bangkok Dusit Medical Services PCL 18/9/2019 (Zero Coupon)	2,587,337	0.03
USD 2,800,000	PTTEP Treasury Center Co Ltd FRN 17/7/2022 (Perpetual)	2,856,736	0.03
USD 2,900,000	Singha Estate PCL 2% 20/7/2022	2,976,125	0.03
		8,420,198	0.09
チュニジア			
EUR 1,937,000	Banque Centrale de Tunisie International Bond 4.5% 22/6/2020*	2,410,957	0.03
トルコ			
TRY 30,790,000	Turkey Government Bond 8.8% 27/9/2023	8,248,872	0.09
TRY 64,015,000	Turkey Government Bond 9.2% 22/9/2021	17,608,237	0.19
TRY 87,883,000	Turkey Government Bond 11% 2/3/2022	25,760,342	0.28
USD 1,197,000	Turkey Government International Bond 5.125% 25/3/2022	1,263,284	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
トルコ(続き)			
USD 8,295,000	Turkey Government International Bond 6% 25/3/2027	9,108,947	0.10
USD 11,987,000	Turkey Government International Bond 7% 5/6/2020	13,226,156	0.14
USD 9,474,000	Turkey Government International Bond 7.375% 5/2/2025	11,211,295	0.12
USD 1,794,379	Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust '144A' ' 4.2% 15/3/2027	1,735,130	0.02
		88,162,263	0.95
アラブ首長国連邦			
USD 2,800,000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC FRN 12/1/2023	2,847,950	0.03
英国			
EUR 300,000	Anglo American Capital Plc 3.25% 3/4/2023	395,526	0.00
EUR 456,000	Anglo American Capital Plc 3.5% 28/3/2022	602,896	0.01
USD 3,148,000	Anglo American Capital Plc '144A' 4.875% 14/5/2025	3,356,555	0.04
USD 3,990,000	Aon Plc 4.75% 15/5/2045	4,401,213	0.05
GBP 2,100,000	Ardonagh Midco 3 Plc 8.375% 15/7/2023	2,627,458	0.03
EUR 254,000	Arrow Global Finance Plc FRN 1/4/2025	301,683	0.00
GBP 100,000	Arrow Global Finance Plc 5.125% 15/9/2024	134,101	0.00
USD 6,625,000	AstraZeneca Plc 2.375% 12/6/2022	6,605,917	0.07
GBP 837,987	Auburn Securities 5 Plc FRN 1/12/2041	1,064,565	0.01
EUR 2,800,000	Barclays Plc FRN 15/12/2020 (Perpetual)	3,701,365	0.04
USD 275,000	Barclays Plc FRN 15/3/2022 (Perpetual)	298,702	0.00
GBP 2,900,000	Barclays Plc FRN 15/3/2023 (Perpetual)	4,051,541	0.04
USD 15,405,000	Barclays Plc 4.836% 9/5/2028	15,963,192	0.17
USD 14,424,000	Barclays Plc 5.2% 12/5/2026	15,422,530	0.17
EUR 5,360,000	BAT International Finance Plc 2.25% 16/1/2030	6,514,579	0.07
GBP 273,375	Brass No 3 Plc FRN 16/4/2051	353,661	0.00
GBP 1,000,000	Canary Wharf Finance II Plc FRN 22/10/2037	1,008,219	0.01
GBP 4,392,000	Canary Wharf Finance II Plc FRN 22/10/2037	4,455,505	0.05
GBP 2,073,000	Castell 2017-1 Plc '2017-1 X' FRN 25/10/2044	2,666,307	0.03
EUR 3,500,000	Centrica Plc FRN 10/4/2076	4,277,060	0.05
GBP 1,850,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	2,463,042	0.03
EUR 3,925,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	4,745,671	0.05
EUR 2,625,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	3,201,800	0.03
GBP 200,000	Cognita Financing Plc 7.75% 15/8/2021	267,955	0.00
GBP 182,000	Drax Finco Plc 4.25% 1/5/2022	244,418	0.00
EUR 1,425,000	DS Smith Plc 1.375% 26/7/2024	1,703,685	0.02
GBP 1,430,000	E-CARAT 5 Plc FRN 18/4/2023	1,853,974	0.02
GBP 10,240,000	EI Group Plc 6% 6/10/2023	14,439,993	0.16
GBP 425,000	EI Group Plc 6.375% 15/2/2022	594,075	0.01
GBP 390,000	EI Group Plc 6.875% 15/2/2021	563,343	0.01
GBP 413,908	Eurosail 2006-4np Plc '2006-4X A3C' FRN 10/12/2044	524,900	0.01
GBP 2,485,000	Eurosail-UK 2007-4bl Plc '2007-4X A3' FRN 13/6/2045	3,186,310	0.03
GBP 1,130,000	Eurosail-UK 2007-4bl Plc '2007-4X A4' FRN 13/6/2045	1,341,887	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 1,325,000	Finsbury Square 2016-1 Plc '2016-1 B' FRN 16/2/2058	1,719,370	0.02
GBP 781,000	Finsbury Square 2016-2 Plc '2016-2 B' FRN 16/8/2058	1,017,607	0.01
GBP 967,000	Finsbury Square 2016-2 Plc '2016-2 C' FRN 16/8/2058	1,266,637	0.01
GBP 423,383	Finsbury Square 2016-2 Plc '2016-2 X' FRN 16/8/2058	546,334	0.01
GBP 949,979	Finsbury Square 2017-1 Plc FRN 12/3/2059	1,233,824	0.01
GBP 455,000	Gengarto 2015-2 Plc '2015-2 B' FRN 16/2/2054	584,251	0.01
GBP 615,000	Gosforth Funding 2014-1 Plc '2014-1 A2' FRN 19/10/2056	796,060	0.01
GBP 5,390,000	Great Hall Mortgages No 1 Plc '2007-2X BA' FRN 18/6/2039	6,074,023	0.07
GBP 10,365,795	Greene King Finance Plc FRN 15/12/2033	13,238,749	0.14
GBP 1,389,347	Greene King Finance Plc 4.064% 15/3/2035	2,008,967	0.02
GBP 3,220,000	Hawksmoor Mortgages 2016-1 Plc '2016-1 B' FRN 25/5/2053	4,169,418	0.05
GBP 178,000	Heathrow Finance Plc 3.875% 1/3/2027	227,009	0.00
EUR 1,435,000	HSBC Holdings Plc FRN 29/9/2023 (Perpetual)*	1,938,779	0.02
USD 21,495,000	HSBC Holdings Plc FRN 22/5/2027 (Perpetual)	22,591,245	0.24
USD 3,311,000	HSBC Holdings Plc FRN 13/3/2028	3,474,886	0.04
EUR 5,775,000	HSBC Holdings Plc FRN 4/7/2029 (Perpetual)*	7,055,118	0.08
USD 16,010,000	HSBC Holdings Plc 4.375% 23/11/2026	16,823,668	0.18
GBP 200,000	Iceland Bondco Plc 6.75% 15/7/2024	284,921	0.00
EUR 561,000	INEOS Finance Plc 4% 1/5/2023	689,066	0.01
EUR 200,800	Inovyn Finance Plc 6.25% 15/5/2021	248,517	0.00
EUR 280,000	International Game Technology Plc 4.75% 15/2/2023	367,574	0.00
EUR 1,501,000	ITV Plc 2% 1/12/2023	1,844,538	0.02
EUR 200,000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 2.2% 15/1/2024	239,356	0.00
GBP 925,000	Jerrold Finco Plc 6.125% 15/1/2024	1,206,653	0.01
GBP 345,000	Jerrold Finco Plc 6.25% 15/9/2021*	464,304	0.01
EUR 2,497,000	Kensington Mortgage Securities Plc '2007-1X A3B' FRN 14/6/2040	2,873,683	0.03
GBP 6,300,000	Logistics UK 2015 Plc '2015-1X A' FRN 20/8/2025	8,125,998	0.09
GBP 8,830,000	Logistics UK 2015 Plc '2015-1X E' FRN 20/8/2025	11,347,713	0.12
EUR 965,205	Ludgate Funding Plc '2007-1 BB' FRN 1/1/2061	904,758	0.01
EUR 827,318	Ludgate Funding Plc '2007-1 MB' FRN 1/1/2061	889,061	0.01
GBP 161,000	Marketplace Originated Consumer Assets 2016-1 Plc '2016-1 B' FRN 20/10/2024	208,003	0.00
GBP 325,000	Marks & Spencer Plc 3% 8/12/2023	434,035	0.01
GBP 2,137,000	Motor 2016-1 Plc 3.75% 25/11/2025	2,829,262	0.03
GBP 426,000	Motor 2016-1 Plc 4.25% 25/11/2025	551,679	0.01
GBP 355,000	Motor 2016-1 Plc 5.25% 25/11/2025	459,735	0.01
USD 1,000,000	National Westminster Bank Plc FRN 28/11/2017 (Perpetual)	847,844	0.01
GBP 143,428	Nemus II Arden Plc '2006-2 C' FRN 15/2/2020	171,026	0.00
GBP 1,750,000	Newday Funding 2017-1 Plc FRN 15/7/2025	2,253,022	0.02
GBP 2,200,000	Newday Funding 2017-1 Plc '2017-1 C' FRN 15/7/2025	2,833,984	0.03
GBP 200,000	Old Mutual Plc 8% 3/6/2021	300,155	0.00
EUR 742,000	OTE Plc 3.5% 9/7/2020	927,718	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
EUR 112,045	Paragon Mortgages No 10 Plc FRN 15/6/2041	119,463	0.00
EUR 414,776	Paragon Mortgages No 11 Plc FRN 15/10/2041	445,634	0.01
EUR 475,000	Paragon Mortgages No 12 Plc FRN 15/11/2038	494,601	0.01
EUR 1,165,000	Paragon Mortgages No 13 Plc FRN 15/1/2039	1,200,667	0.01
EUR 2,795,000	Paragon Mortgages No 14 Plc FRN 15/9/2039	2,856,878	0.03
GBP 1,175,000	Paragon Mortgages NO 23 Plc FRN 15/1/2043	1,522,781	0.02
EUR 2,955,639	Paragon Mortgages NO 23 Plc ' A1 ' FRN 15/1/2043	3,505,312	0.04
GBP 3,191,859	Paragon Mortgages NO 23 Plc ' A2 ' FRN 15/1/2043	4,129,635	0.04
GBP 282,000	PCL Funding II Plc ' 2017-1 B ' FRN 15/6/2022	363,912	0.00
GBP 179,000	PCL Funding II Plc ' 2017-1 C ' FRN 15/6/2022	230,992	0.00
GBP 100,000	Pension Insurance Corp Plc 6.5% 3/7/2024	140,880	0.00
GBP 370,707	Precise Mortgage Funding 2014-1 Plc ' 2014-1 A ' FRN 12/9/2047	477,765	0.01
GBP 29,851	Punch Taverns Finance Plc FRN 15/7/2021	37,650	0.00
GBP 5,160,000	Punch Taverns Finance Plc FRN 15/10/2027	6,647,413	0.07
GBP 425,000	Punch Taverns Finance Plc ' AIV ' 7.274% 15/10/2026	690,368	0.01
GBP 1,116,900	Punch Taverns Finance Plc ' AIF ' 7.274% 15/10/2026	1,841,836	0.02
GBP 544,000	Punch Taverns Finance Plc 7.32% 15/10/2025	911,900	0.01
GBP 1,368,865	Punch Taverns Finance Plc 7.32% 15/10/2025	2,208,168	0.02
GBP 2,981,000	Residential Mortgage Securities 29 Plc FRN 20/12/2046	3,842,898	0.04
GBP 799,000	Residential Mortgage Securities 29 Plc FRN 20/12/2046	1,028,363	0.01
GBP 180,000	Residential Mortgage Securities 30 Plc FRN 20/3/2050	231,018	0.00
GBP 15,000,000	Ripon Mortgages Plc FRN 20/8/2056	19,374,689	0.21
EUR 1,118,493	RMAC Securities No 1 Plc ' 2007- NS1X M1C ' FRN 12/6/2044	1,200,550	0.01
GBP 800,000	Rochester Financing No 1 Plc FRN 16/7/2046	1,030,416	0.01
USD 200,000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN 10/8/2020 (Perpetual)	210,750	0.00
USD 225,000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN 15/8/2021 (Perpetual)	249,007	0.00
USD 8,005,000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN 15/5/2023	8,087,904	0.09
GBP 275,000	Santander UK Group Holdings Plc FRN 24/6/2024 (Perpetual)	386,615	0.00
USD 3,175,000	Sensata Technologies UK Financing Co Plc ' 144A ' 6.25% 15/2/2026	3,480,594	0.04
GBP 7,174,995	Silverstone Master Issuer Plc ' 2015-1X 1A ' FRN 21/1/2070	9,245,887	0.10
EUR 2,640,000	Sky Plc 2.25% 17/11/2025	3,366,380	0.04
GBP 475,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2028	643,565	0.01
GBP 4,567,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2031	5,729,227	0.06
GBP 2,215,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2036	2,878,435	0.03
USD 1,850,000	SSE Plc FRN 16/9/2077	1,893,179	0.02
GBP 209,000	Stanlinton No 1 Plc FRN 12/6/2046	277,016	0.00
GBP 1,875,000	Stonegate Pub Co Financing Plc FRN 15/3/2022	2,433,554	0.03
GBP 625,000	Stonegate Pub Co Financing Plc 4.875% 15/3/2022	821,349	0.01
EUR 302,000	Synlab Bondco Plc 6.25% 1/7/2022	386,277	0.00
EUR 183,000	Synlab Unsecured Bondco Plc 8.25% 1/7/2023	241,666	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
EUR 2,504,961	Taurus 2015-2 DEU Ltd ' 2015-DE2 A ' FRN 1/2/2026	2,976,576	0.03
EUR 1,821,000	Taurus 2015-2 DEU Ltd ' 2015-DE2 D ' FRN 1/2/2026	2,177,443	0.02
EUR 2,309,000	Taurus 2015-2 DEU Ltd ' 2015-DE2 E ' FRN 1/2/2026	2,768,492	0.03
GBP 946,683	Tesco Property Finance 1 Plc 7.623% 13/7/2039	1,612,028	0.02
GBP 2,167,494	Tesco Property Finance 3 Plc 5.744% 13/4/2040	3,164,737	0.03
GBP 980,236	Tesco Property Finance 4 Plc 5.801% 13/10/2040	1,439,796	0.02
EUR 100,000	Titan Global Finance Plc 3.5% 17/6/2021	127,072	0.00
GBP 360,000	Trinity Square 2015-1 Plc ' 2015-1X B ' FRN 15/7/2051	450,652	0.01
USD 660,000	Tullow Oil Plc 6% 1/11/2020*	641,850	0.01
USD 203,000	Tullow Oil Plc ' 144A ' 6% 1/11/2020	197,417	0.00
USD 800,000	Tullow Oil Plc 6.25% 15/4/2022*	751,000	0.01
USD 600,000	Tullow Oil Plc ' 144A ' 6.25% 15/4/2022	563,250	0.01
GBP 4,321,317	Unique Pub Finance Co Plc/The 5.659% 30/6/2027	6,292,138	0.07
GBP 12,850,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.464% 30/3/2032	16,304,233	0.18
GBP 3,581,440	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.542% 30/3/2021	5,039,688	0.05
GBP 1,084,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28/3/2024	1,607,161	0.02
GBP 2,370,000	United Kingdom Gilt 1.5% 22/7/2047	2,913,954	0.03
USD 1,782,000	Vedanta Resources Plc 6.375% 30/7/2022*	1,856,621	0.02
USD 2,000,000	Vedanta Resources Plc 7.125% 31/5/2023*	2,140,000	0.02
USD 985,000	Vedanta Resources Plc 8.25% 7/6/2021	1,103,816	0.01
GBP 318,000	Virgin Media Secured Finance Plc 4.875% 15/1/2027	427,624	0.01
GBP 100,000	Virgin Media Secured Finance Plc 5.125% 15/1/2025	136,328	0.00
GBP 2,684,000	Virgin Media Secured Finance Plc 6.25% 28/3/2029*	3,776,086	0.04
GBP 900,000	Vodafone Group Plc 26/11/2020 (Zero Coupon)	1,136,273	0.01
GBP 510,000	Vue International Bidco Plc 7.875% 15/7/2020	672,997	0.01
GBP 6,849,767	Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc ' A ' FRN 21/9/2049	8,889,661	0.10
GBP 6,200,000	Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc ' B ' FRN 21/9/2049	7,959,004	0.09
GBP 3,700,000	Warwick Finance Residential Mortgages No Two Plc FRN 21/9/2049	4,737,209	0.05
GBP 4,795,000	Westfield Stratford City Finance Plc FRN 4/11/2019	6,192,869	0.07
		422,323,347	4.56
	米国		
USD 5,750,000	245 Park Avenue Trust ' 2017-245P E ' ' 144A ' FRN 5/6/2037	5,523,806	0.06
USD 7,000,000	245 Park Avenue Trust ' 2017-245P XA ' ' 144A ' FRN 5/6/2037	119,105	0.00
USD 3,603,000	AbbVie Inc 4.45% 14/5/2046	3,775,767	0.04
USD 6,450,000	AbbVie Inc 4.5% 14/5/2035	6,906,476	0.07
USD 4,440,000	Accredited Mortgage Loan Trust ' 2006-1 M2 ' FRN 25/4/2036	2,319,772	0.03
USD 2,574,747	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series '2007-HE4 A2A' FRN 25/5/2037	883,752	0.01
USD 1,531,149	Ace Securities Manufactured Housing Loan Trust 15/8/2030 (Zero Coupon)	1,186,404	0.01
USD 2,060,000	Adams Mill CLO Ltd ' 2014-1A A2R ' ' 144A ' FRN 15/7/2026	2,061,634	0.02
USD 3,985,000	Aetna Inc 3.875% 15/8/2047	4,049,718	0.04
USD 1,154,000	AHS Hospital Corp 5.024% 1/7/2045	1,393,005	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 250,000	AIMCO CLO Series ' 2014-AA DR ' ' 144A ' FRN 20/7/2026	250,929	0.00
USD 250,000	AIMCO CLO Series ' 2015-AA E ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	254,077	0.00
USD 1,190,000	Air Lease Corp 2.625% 1/7/2022	1,188,995	0.01
USD 1,064,000	Air Lease Corp 3.625% 1/4/2027	1,072,152	0.01
USD 6,286,111	Ajax Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) ' 2015-C A ' ' 144A ' 3.875% 25/3/2057	6,197,328	0.07
USD 1,797,787	Ajax Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) ' 2016-C A ' ' 144A ' 4% 25/10/2057	1,800,470	0.02
USD 2,580,761	Ajax Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) ' 2016-B A ' ' 144A ' 4% 25/9/2065	2,583,143	0.03
USD 2,149,550	Ajax Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) ' 2016-1 A ' ' 144A ' 4.25% 25/7/2047	2,148,505	0.02
USD 3,830,511	Ajax Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) ' 2016-A A ' ' 144A ' 4.25% 25/8/2064	3,875,808	0.04
USD 8,531,948	AJAX Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) ' 2017-A A ' ' 144A ' 3.47% 25/4/2057	8,567,030	0.09
USD 1,050,000	Allegro CLO II Ltd ' 2014-1A CR ' ' 144A ' FRN 21/1/2027	1,054,019	0.01
USD 280,000	Allegro CLO II Ltd ' 2014-1A D ' ' 144A ' FRN 21/1/2027	282,111	0.00
USD 700,000	Allegro CLO V Ltd ' 2017-1A A ' ' 144A ' FRN 16/10/2030	700,000	0.01
USD 5,661,000	Allstate Corp/The 4.2% 15/12/2046	6,054,643	0.07
USD 2,180,000	Ally Financial Inc 8% 1/11/2031	2,804,025	0.03
USD 250,000	ALM V Ltd ' 2012-5A DR ' ' 144A ' FRN 18/10/2026	251,996	0.00
USD 811,000	ALM VI Ltd ' 2012-6A A2RR ' ' 144A ' FRN 15/7/2026	812,253	0.01
USD 2,620,000	ALM VI Ltd ' 2012-6A CRR ' ' 144A ' FRN 15/7/2026	2,631,649	0.03
USD 3,100,000	ALM VI Ltd ' 2012-6A DRR ' ' 144A ' FRN 15/7/2026	3,099,972	0.03
USD 5,070,000	ALM VII Ltd ' 2012-7A A1R ' ' 144A ' FRN 15/10/2028	5,132,278	0.06
USD 13,709,000	ALM XI Ltd ' 2014-11A A1R ' ' 144A ' FRN 17/10/2026	13,730,116	0.15
USD 1,440,000	ALM XII Ltd ' 2015-12A A1R ' ' 144A ' FRN 16/4/2027	1,441,407	0.02
USD 1,293,000	ALM XII Ltd ' 2015-12A BR ' ' 144A ' FRN 16/4/2027	1,298,432	0.01
USD 950,000	ALM XII Ltd ' 2015-12A C1R ' ' 144A ' FRN 16/4/2027	956,616	0.01
USD 460,000	ALM XII Ltd ' 2015-12A C2R ' ' 144A ' FRN 16/4/2027	462,530	0.01
USD 4,675,000	ALM XIV Ltd ' 2014-14A A1R ' ' 144A ' FRN 28/7/2026	4,678,534	0.05
USD 831,000	ALM XIV Ltd ' 2014-14A BR ' ' 144A ' FRN 28/7/2026	834,210	0.01
USD 1,645,000	ALM XIV Ltd ' 2014-14A C ' ' 144A ' FRN 28/7/2026	1,659,362	0.02
USD 750,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC '2015-16A BR ' ' 144A ' FRN 15/7/2027	752,161	0.01
USD 2,250,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC '2015-16A C2R ' ' 144A ' FRN 15/7/2027	2,239,417	0.02
USD 340,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC '2015-16A D ' ' 144A ' FRN 15/7/2027	337,151	0.00
USD 720,000	ALM XVII Ltd ' 2015-17A C1 ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	730,117	0.01
USD 275,000	ALM XVIII Ltd ' 2016-18A D ' ' 144A ' FRN 15/7/2027	279,103	0.00
USD 1,535,698	Alternative Loan Trust ' 2005-38 A3 ' FRN 25/9/2035	1,468,597	0.02
USD 4,031,159	Alternative Loan Trust ' 2005-72 A3 ' FRN 25/1/2036	3,688,857	0.04
USD 1,355,873	Alternative Loan Trust '2005-76 2A1' FRN 25/2/2036	1,257,363	0.01
USD 2,412,123	Alternative Loan Trust ' 2006-23CB 2A5 ' FRN 25/8/2036	976,986	0.01
USD 3,009,489	Alternative Loan Trust ' 2006-OA6 1A2 ' FRN 25/7/2046	2,942,470	0.03
USD 874,814	Alternative Loan Trust ' 2006-OA8 1A1 ' FRN 25/7/2046	795,848	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,114,492	Alternative Loan Trust ' 2006-0C7 2A3 ' FRN 25/7/2046	1,699,346	0.02
USD 1,038,878	Alternative Loan Trust '2006-0A11 A4' FRN 25/9/2046	871,347	0.01
USD 3,745,643	Alternative Loan Trust ' 2006-0A16 A4C ' FRN 25/10/2046	2,153,977	0.02
USD 1,378,160	Alternative Loan Trust ' 2006-J7 2A1 ' FRN 20/11/2046	954,783	0.01
USD 5,047,589	Alternative Loan Trust ' 2006-0A14 1A1 ' FRN 25/11/2046	4,857,091	0.05
USD 7,844,127	Alternative Loan Trust ' 2007-0A2 1A1 ' FRN 25/3/2047	6,462,440	0.07
USD 1,770,567	Alternative Loan Trust ' 2007-0A3 1A1 ' FRN 25/4/2047	1,633,785	0.02
USD 10,296,766	Alternative Loan Trust ' 2007-OH3 A1A ' FRN 25/9/2047	9,247,036	0.10
USD 5,099,435	Alternative Loan Trust '2007-9T1 1A1' 6% 25/5/2037	3,864,693	0.04
USD 1,596,679	Alternative Loan Trust '2006-15CB A1' 6.5% 25/6/2036	1,210,280	0.01
USD 5,306,470	Alternative Loan Trust '2007-25 1A3' 6.5% 25/11/2037	4,056,059	0.04
USD 4,500,000	Altice US Finance I Corp ' 144A ' 5.375% 15/7/2023	4,708,125	0.05
USD 15,810,000	Amazon.com Inc ' 144A ' 4.05% 22/8/2047	16,279,035	0.18
USD 8,509,000	Amazon.com Inc 4.95% 5/12/2044*	9,891,610	0.11
USD 2,363,000	American Airlines Group Inc ' 144A ' 4.625% 1/3/2020	2,436,135	0.03
USD 1,378,863	American Home Mortgage Assets Trust ' 2006-3 2A11 ' FRN 25/10/2046	1,216,848	0.01
USD 3,183,141	American Home Mortgage Assets Trust ' 2006-4 1A12 ' FRN 25/10/2046	2,542,309	0.03
USD 4,581,247	American Home Mortgage Assets Trust ' 2006-5 A1 ' FRN 25/11/2046	2,708,028	0.03
USD 884,938	American Home Mortgage Assets Trust ' 2007-1 A1 ' FRN 25/2/2047	569,327	0.01
USD 1,876,000	American Homes 4 Rent 2014-SFR2 Trust ' 2014-SFR2 E ' ' 144A ' 6.231% 17/10/2036	2,134,302	0.02
USD 2,190,000	American International Group Inc 3.9% 1/4/2026	2,285,284	0.02
USD 4,463,000	American International Group Inc 4.5% 16/7/2044	4,653,521	0.05
USD 917,000	American International Group Inc 4.8% 10/7/2045	1,003,529	0.01
USD 725,000	American Municipal Power Inc 6.449% 15/2/2044	969,601	0.01
USD 6,990,000	American Tower Corp 3.55% 15/7/2027	6,961,191	0.08
USD 550,000	Americold 2010 LLC ' 2010-ARTA C ' ' 144A ' 6.811% 14/1/2029	615,865	0.01
USD 1,585,000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.5% 20/5/2025	1,608,775	0.02
USD 1,709,000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5.625% 20/5/2024	1,781,632	0.02
USD 9,882,000	Amgen Inc 4.4% 1/5/2045	10,320,603	0.11
USD 530,000	AMMC CLO 15 Ltd ' 2014-15A D ' ' 144A ' FRN 9/12/2026	539,948	0.01
USD 1,365,000	AMMC CLO 17 Ltd ' 2015-17A B ' ' 144A ' FRN 15/11/2027	1,379,879	0.02
USD 670,000	AMMC CLO 17 Ltd ' 2015-17A C ' ' 144A ' FRN 15/11/2027	676,154	0.01
USD 450,000	AMMC CLO 18 Ltd ' 2016-18A D ' ' 144A ' FRN 26/5/2028	459,021	0.01
USD 260,000	Ammc Clo 19 Ltd ' 2016-19A C ' ' 144A ' FRN 15/10/2028	262,189	0.00
USD 2,500,000	AMMC CLO XIII Ltd '2013-13A A1LR ' ' 144A' FRN 24/7/2029	2,519,450	0.03
USD 2,160,000	AMMC CLO XIV Ltd '2014-14A A1LR ' ' 144A' FRN 25/7/2029	2,181,363	0.02
USD 3,288,000	Analog Devices Inc 3.5% 5/12/2026	3,372,825	0.04
USD 572,000	Analog Devices Inc 4.5% 5/12/2036	596,158	0.01
USD 250,000	Anchorage Capital CLO 2012-1 Ltd ' 2012-1A DR ' ' 144A ' FRN 13/1/2027	253,121	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 840,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd ' 2013-1A A1 ' ' 144A ' FRN 13/7/2025	840,343	0.01
USD 1,520,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd ' 2013-1A A2A ' ' 144A ' FRN 13/7/2025	1,523,651	0.02
USD 340,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd ' 2013-1A B ' ' 144A ' FRN 13/7/2025	340,942	0.00
USD 390,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd ' 2013-1A D ' ' 144A ' FRN 13/7/2025	390,839	0.00
USD 770,000	Anchorage Capital CLO 3 Ltd ' 2014-3A A2AR ' ' 144A ' FRN 28/4/2026	771,340	0.01
USD 2,375,000	Anchorage Capital CLO 3 Ltd ' 2014-3A BR ' ' 144A ' FRN 28/4/2026	2,385,120	0.03
USD 1,098,969	Anchorage Capital CLO 3 Ltd ' 2014-3A C ' ' 144A ' FRN 28/4/2026	1,102,343	0.01
USD 2,180,000	Anchorage Capital CLO 3 Ltd ' 2014-3A D ' ' 144A ' FRN 28/4/2026	2,169,441	0.02
USD 510,000	Anchorage Capital CLO 4 Ltd ' 2014-4A A1AR ' ' 144A ' FRN 28/7/2026	511,702	0.01
USD 2,010,000	Anchorage Capital CLO 4 Ltd ' 2014-4A CR ' ' 144A ' FRN 28/7/2026	2,016,423	0.02
USD 250,000	Anchorage Capital CLO 5 Ltd ' 2014-5A E ' ' 144A ' FRN 15/10/2026	246,852	0.00
USD 1,570,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd ' 2015-6A AR ' ' 144A ' FRN 15/7/2030	1,570,117	0.02
USD 590,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd ' 2015-6A DR ' ' 144A ' FRN 15/7/2030	593,620	0.01
USD 500,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd ' 2015-6A ER ' ' 144A ' FRN 15/7/2030	479,880	0.01
USD 1,812,500	Anchorage Capital CLO 7 Ltd ' 2015-7A C ' ' 144A ' FRN 15/10/2027	1,825,056	0.02
USD 1,625,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd ' 2015-7A D ' ' 144A ' FRN 15/10/2027	1,630,234	0.02
USD 390,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd ' 2016-8A D ' ' 144A ' FRN 28/7/2028	394,609	0.00
USD 640,000	Anchorage Capital CLO 9 Ltd ' 2016-9A D ' ' 144A ' FRN 15/1/2029	650,291	0.01
USD 330,000	Anchorage Capital CLO 9 Ltd ' 2016-9A E ' ' 144A ' FRN 15/1/2029	335,999	0.00
USD 5,335,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 5.25% 15/1/2025	5,675,106	0.06
USD 9,490,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 6.25% 15/10/2022	10,083,125	0.11
USD 1,748,832	Angel Oak Mortgage Trust I LLC (Step-up coupon) ' 2016-1 A1 ' ' 144A ' 3.5% 25/7/2046	1,759,648	0.02
USD 442,713	Angel Oak Mortgage Trust LLC (Step-up coupon) ' 2015-1 A ' ' 144A ' FRN 25/11/2045	443,499	0.00
USD 250,000	Annisa CLO Ltd ' 2016-2A E ' ' 144A ' FRN 20/7/2028	253,407	0.00
USD 390,000	Antero Resources Corp 5.375% 1/11/2021	398,287	0.00
USD 17,967,366	Apidos CLO XII ' 2013-12A A ' ' 144A ' FRN 15/4/2025	17,997,439	0.19
USD 1,110,000	Apidos CLO XIV ' 2013-14A C1 ' ' 144A ' FRN 15/4/2025	1,114,086	0.01
USD 830,000	Apidos CLO XIX ' 2014-19A DR ' ' 144A ' FRN 17/10/2026	837,502	0.01
USD 800,000	Apidos CLO XIX ' 2014-19A E ' ' 144A ' FRN 17/10/2026	802,052	0.01
USD 1,290,000	Apidos CLO XV ' 2013-15A A1R ' ' 144A ' FRN 20/10/2025	1,291,178	0.01
USD 1,120,000	Apidos CLO XV ' 2013-15A D ' ' 144A ' FRN 20/10/2025	1,120,001	0.01
USD 475,000	Apidos CLO XVI ' 2013-16A CR ' ' 144A ' FRN 19/1/2025	478,595	0.01
USD 675,000	Apidos CLO XVII ' 2014-17A A1R ' ' 144A ' FRN 17/4/2026	676,693	0.01
USD 1,030,000	Apidos CLO XVIII ' 2014-18A A1R ' ' 144A ' FRN 22/7/2026	1,031,813	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 420,000	Apidos CLO XVIII ' 2014-18A CR ' ' 144A ' FRN 22/7/2026	421,706	0.00
USD 1,845,000	Apidos CLO XVIII ' 2014-18A D ' ' 144A ' FRN 22/7/2026	1,853,373	0.02
USD 290,000	Apidos CLO XX ' 2015-20A A1R ' ' 144A ' FRN 16/1/2027	290,487	0.00
USD 500,000	Apidos CLO XXI ' 2015-21A C ' ' 144A ' FRN 18/7/2027	503,816	0.01
USD 380,000	Apidos CLO XXII ' 2015-22A D ' ' 144A ' FRN 20/10/2027	382,376	0.00
USD 1,070,000	Apidos CLO XXIII ' 2015-23A D2 ' ' 144A ' FRN 14/1/2027	1,086,286	0.01
USD 3,130,000	Apple Inc 3.2% 11/5/2027	3,199,010	0.03
USD 15,258,000	Apple Inc 3.35% 9/2/2027	15,800,361	0.17
USD 4,932,000	Apple Inc 3.85% 4/8/2046	4,982,785	0.05
USD 470,000	Apple Inc 4.25% 9/2/2047	507,621	0.01
USD 2,653,000	Applied Materials Inc 4.35% 1/4/2047	2,840,551	0.03
USD 7,031,527	APS Resecuritization Trust ' 2016-3 3A ' ' 144A ' FRN 27/9/2046	7,303,459	0.08
USD 1,973,377	APS Resecuritization Trust ' 2016-3 4A ' ' 144A ' FRN 27/4/2047	2,012,731	0.02
USD 3,160,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2016-FL1 Ltd ' 2016-FL1A A ' ' 144A ' FRN 15/9/2026	3,152,258	0.03
USD 1,330,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2017-FL2 Ltd ' 2017-FL2 A ' ' 144A ' FRN 15/8/2027	1,330,000	0.01
USD 1,520,000	Arconic Inc 5.87% 23/2/2022	1,668,200	0.02
USD 7,540,000	Arconic Inc 5.9% 1/2/2027*	8,256,300	0.09
USD 4,485,000	Ares Capital Corp 3.5% 10/2/2023	4,482,417	0.05
USD 9,070,000	Ares Capital Corp 3.625% 19/1/2022	9,202,318	0.10
USD 940,000	Ares XL CLO Ltd ' 2016-40A C ' ' 144A ' FRN 15/10/2027	952,260	0.01
USD 400,000	Ares XLI Clo Ltd ' 2016-41A D ' ' 144A ' FRN 15/1/2029	407,472	0.00
USD 255,000	Ares XXXII CLO Ltd ' 2014-32A BR ' ' 144A ' FRN 15/11/2025	256,123	0.00
USD 515,000	Ares XXXII CLO Ltd ' 2014-32A CR ' ' 144A ' FRN 15/11/2025	517,014	0.01
USD 460,000	Ares XXXII CLO Ltd ' 2014-32A D ' ' 144A ' FRN 15/11/2025	460,041	0.01
USD 380,000	Ares XXXIII CLO Ltd ' 2015-1A A2R ' ' 144A ' FRN 5/12/2025	383,716	0.00
USD 250,000	Ares XXXIII CLO Ltd ' 2015-1A B2R ' ' 144A ' FRN 5/12/2025	253,442	0.00
USD 1,125,000	Ares XXXIII CLO Ltd ' 2015-1A CR ' ' 144A ' FRN 5/12/2025	1,145,382	0.01
USD 800,000	Ares XXXIII CLO Ltd ' 2015-1A D ' ' 144A ' FRN 5/12/2025	807,431	0.01
USD 840,000	Ares XXXIX CLO Ltd ' 2016-39A E ' ' 144A ' FRN 18/7/2028	847,297	0.01
USD 1,445,000	Ares XXXVII CLO Ltd ' 2015-4A C ' ' 144A ' FRN 15/10/2026	1,456,889	0.02
USD 500,000	Ares XXXVII CLO Ltd ' 2015-4A D1 ' ' 144A ' FRN 15/10/2026	503,882	0.01
USD 835,000	Ares XXXVII CLO Ltd ' 2015-4A D2 ' ' 144A ' FRN 15/10/2026	844,475	0.01
USD 280,000	Ares XXXVIII CLO Ltd ' 2015-38A D ' ' 144A ' FRN 20/1/2027	282,797	0.00
USD 5,708,793	Argent Mortgage Loan Trust ' 2005-W1 A2 ' FRN 25/5/2035	5,159,703	0.06
USD 1,905,000	Arizona Health Facilities Authority FRN 1/1/2037	1,672,257	0.02
USD 1,285,000	Arrow Electronics Inc 3.875% 12/1/2028	1,297,358	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
EUR 775,000	AT&T Inc FRN 4/9/2023	933,929	0.01
EUR 600,000	AT&T Inc 2.35% 4/9/2029	721,118	0.01
EUR 2,900,000	AT&T Inc 3.15% 4/9/2036	3,478,511	0.04
USD 2,940,000	AT&T Inc 5.15% 14/2/2050	2,965,647	0.03
USD 975,000	Atlas Senior Loan Fund III Ltd ' 2013-1A A ' ' 144A ' FRN 18/8/2025	975,733	0.01
USD 820,000	Atlas Senior Loan Fund IV Ltd ' 2013-2A A2LR ' ' 144A ' FRN 17/2/2026	820,079	0.01
USD 300,000	Atlas Senior Loan Fund IV Ltd ' 2013-2A A3LR ' ' 144A ' FRN 17/2/2026	299,979	0.00
USD 1,655,000	Atlas Senior Loan Fund Ltd ' 2017-8A E ' ' 144A ' FRN 16/1/2030	1,587,649	0.02
USD 500,000	Atlas Senior Loan Fund VI Ltd ' 2014-6A DR ' ' 144A ' FRN 15/10/2026	501,576	0.01
USD 1,710,000	Atrium VIII ' 144A ' FRN 23/10/2024	1,724,457	0.02
USD 1,110,000	Atrium VIII ' 144A ' FRN 23/10/2024	1,126,163	0.01
USD 1,680,000	Atrium X ' 10A B1R ' ' 144A ' FRN 16/7/2025	1,681,709	0.02
USD 1,130,000	Atrium X ' 10A CR ' ' 144A ' FRN 16/7/2025	1,132,793	0.01
USD 830,000	Atrium X ' 144A ' FRN 16/7/2025	832,083	0.01
USD 520,000	Atrium XI ' 144A ' FRN 23/10/2025	520,789	0.01
USD 385,000	Atrium XII ' 144A ' FRN 22/10/2026	388,077	0.00
USD 1,250,000	Atrium XII ' 144A ' FRN 22/10/2026	1,257,484	0.01
USD 7,605,000	Autodesk Inc 3.5% 15/6/2027	7,677,498	0.08
USD 1,160,000	Aventura Mall Trust ' 2013-AVM E ' ' 144A ' FRN 5/12/2032	1,191,317	0.01
USD 2,160,000	Avery Point V CLO Ltd ' 2014-5A AR ' ' 144A ' FRN 17/7/2026	2,166,470	0.02
USD 520,000	Avery Point V CLO Ltd ' 2014-5A BR ' ' 144A ' FRN 17/7/2026	522,141	0.01
USD 1,330,000	Avery Point VII CLO Ltd ' 2015-7A A1 ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	1,342,198	0.01
USD 780,000	Aviation Capital Group Corp ' 144A ' 7.125% 15/10/2020	888,110	0.01
USD 16,283,214	B2R Mortgage Trust ' 2015-2 XA ' ' 144A ' FRN 15/11/2048	785,584	0.01
USD 884,944	B2R Mortgage Trust ' 2015-1 A1 ' ' 144A ' 2.524% 15/5/2048	885,119	0.01
USD 1,359,262	B2R Mortgage Trust ' 2015-2 A ' ' 144A ' 3.336% 15/11/2048	1,381,074	0.02
USD 4,855,405	Babson CLO Ltd ' 2013-1A A ' ' 144A ' FRN 20/4/2025	4,860,579	0.05
USD 1,030,000	Babson CLO Ltd ' 2013-1A D ' ' 144A ' FRN 20/4/2025	1,037,324	0.01
USD 260,000	Babson CLO Ltd ' 2016-1A E ' ' 144A ' FRN 23/4/2027	262,817	0.00
USD 300,000	Babson CLO Ltd ' 2016-2A E ' ' 144A ' FRN 20/7/2028	303,685	0.00
USD 1,315,000	Ball Corp 4% 15/11/2023	1,336,369	0.01
EUR 401,000	Ball Corp 4.375% 15/12/2023	543,793	0.01
USD 2,320,000	Ballyrock CLO 2014-1 LLC ' 2014-1A CR ' ' 144A ' FRN 20/10/2026	2,308,793	0.03
USD 2,030,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust ' 2013-DSMZ M ' ' 144A ' FRN 15/9/2018	2,033,786	0.02
USD 2,667,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust ' 2013-DSNY F ' ' 144A ' FRN 15/9/2026	2,667,330	0.03
USD 2,925,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust ' 2014-FL1 D ' ' 144A ' FRN 15/12/2031	2,859,548	0.03
USD 2,657,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust ' 2015-200P F ' ' 144A ' FRN 14/4/2033	2,607,591	0.03
USD 5,000,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust ' 2016-ISQ E ' ' 144A ' FRN 14/8/2034	4,510,088	0.05

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,148,491	Banc of America Commercial Mortgage Trust ' 2015-UBS7 XA ' FRN 15/9/2048	229,140	0.00
USD 456,876	Banc of America Commercial Mortgage Trust ' 2007-1 AMFX ' FRN 15/1/2049	456,383	0.01
USD 2,030,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust ' 2016-UB10 C ' FRN 15/7/2049	2,194,592	0.02
USD 19,000,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust ' 2017-BNK3 XB ' FRN 15/2/2050	998,165	0.01
USD 4,000,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust ' 2017-BNK3 XD ' ' 144A ' FRN 15/2/2050	374,220	0.00
USD 5,361,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust ' 2007-5 AM ' FRN 10/2/2051	5,383,248	0.06
USD 124,368	Banc of America Commercial Mortgage Trust ' 2008-1 A4 ' FRN 10/2/2051	124,326	0.00
USD 807,397	Banc of America Funding 2006-A Trust ' 2006-A 3A2 ' FRN 20/2/2036	736,120	0.01
USD 6,817	Banc of America Re-REMIC Trust ' 2010-UB4 A4B ' ' 144A ' FRN 20/12/2041	6,815	0.00
USD 4,380,000	Bank of America Corp FRN 10/3/2026 (Perpetual)	4,943,925	0.05
USD 3,240,000	Bank of America Corp FRN 20/1/2028	3,339,180	0.04
USD 15,895,000	Bank of America Corp FRN 21/7/2028	16,087,083	0.17
USD 5,130,000	Bank of America Corp 3.248% 21/10/2027	5,047,520	0.05
USD 14,320,000	Bank of America Corp 4.25% 22/10/2026	15,018,852	0.16
USD 9,800,000	Bank of America Corp 4.45% 3/3/2026	10,420,154	0.11
USD 1,016,000	Bank of New York Mellon Corp/The FRN 20/9/2026 (Perpetual)	1,031,240	0.01
USD 942,000	Bank of New York Mellon Corp/The 3% 30/10/2028	927,886	0.01
USD 5,030,000	Bank of New York Mellon Corp/The 3.25% 16/5/2027	5,162,000	0.06
USD 2,380,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust '1998-2 B1' FRN 10/12/2025	1,843,307	0.02
USD 6,930,000	BAT Capital Corp ' 144A ' 4.39% 15/8/2037	7,147,408	0.08
USD 250,000	Battalion CLO VII Ltd ' 2014-7A C ' ' 144A ' FRN 17/10/2026	250,907	0.00
USD 3,535,000	Bay Area Toll Authority 6.918% 1/4/2040	5,104,186	0.06
USD 2,275,000	Bay Area Toll Authority 7.043% 1/4/2050	3,565,221	0.04
USD 1,780,000	Baylor Scott & White Holdings 4.185% 15/11/2045	1,928,270	0.02
USD 364,168	Bayview Commercial Asset Trust ' 2005-4A A1 ' ' 144A ' FRN 25/1/2036	338,166	0.00
USD 102,479	Bayview Commercial Asset Trust ' 2005-4A A2 ' ' 144A ' FRN 25/1/2036	95,700	0.00
USD 270,838	Bayview Commercial Asset Trust ' 2005-4A M1 ' ' 144A ' FRN 25/1/2036	253,295	0.00
USD 424,173	Bayview Commercial Asset Trust ' 2006-1A A2 ' ' 144A ' FRN 25/4/2036	390,613	0.00
USD 1,621,004	Bayview Commercial Asset Trust ' 2006-3A A1 ' ' 144A ' FRN 25/10/2036	1,513,334	0.02
USD 716,254	Bayview Commercial Asset Trust ' 2006-3A A2 ' ' 144A ' FRN 25/10/2036	670,368	0.01
USD 6,806,365	Bayview Commercial Asset Trust ' 2007-4A A1 ' ' 144A ' FRN 25/9/2037	6,383,060	0.07
USD 408,579	Bayview Commercial Asset Trust ' 2007-5A A3 ' ' 144A ' FRN 25/10/2037	396,860	0.00
USD 1,590,000	Bayview Commercial Asset Trust ' 2007-6A A4A ' ' 144A ' FRN 25/12/2037	1,176,273	0.01
USD 393,557	Bayview Commercial Asset Trust ' 2008-4 A3 ' ' 144A ' FRN 25/7/2038	422,393	0.00
USD 8,502,135	Bayview Financial Revolving Asset Trust ' 2004-B A1 ' ' 144A ' FRN 28/5/2039	6,655,085	0.07
USD 1,419,322	Bayview Financial Revolving Asset Trust ' 2005-E A1 ' ' 144A ' FRN 28/12/2040	1,264,801	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,450,000	BBCMS Trust ' 2015-SLP D ' ' 144A ' FRN 15/2/2028	1,458,252	0.02
USD 100,000	BBCMS Trust ' 2015-STP E ' ' 144A ' FRN 10/9/2028	98,465	0.00
USD 20,840,000	BBCMS Trust ' 2015-SRCH XA ' ' 144A ' FRN 10/8/2035	1,486,413	0.02
USD 11,710,000	BBCMS Trust ' 2015-SRCH XB ' ' 144A ' FRN 10/8/2035	219,738	0.00
USD 954,478	BCAP LLC 2010-RR11-I Trust ' 2010-RR11 4A1 ' ' 144A ' FRN 27/3/2047	888,410	0.01
USD 542,184	BCMSC Trust ' 1999-A M1 ' FRN 15/3/2029	475,115	0.01
USD 1,627,548	BCMSC Trust ' 2000-A A2 ' FRN 15/6/2030	671,646	0.01
USD 1,510,990	BCMSC Trust ' 2000-A A3 ' FRN 15/6/2030	688,215	0.01
USD 2,587,019	BCMSC Trust ' 2000-A A4 ' FRN 15/6/2030	1,246,850	0.01
USD 1,115,455	Bear Stearns ALT-A Trust ' 2006-6 1A1 ' FRN 25/11/2036	1,077,345	0.01
USD 4,237,531	Bear Stearns ALT-A Trust II ' 2007-1 1A1 ' FRN 25/9/2047	3,320,134	0.04
USD 210,793	Bear Stearns ARM Trust ' 2004-5 2A ' FRN 25/7/2034	210,037	0.00
USD 351,737	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust ' 2004-HE7 M2 ' FRN 25/8/2034	349,747	0.00
USD 1,270,491	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust ' 2007-FS1 1A3 ' FRN 25/5/2035	1,284,035	0.01
USD 1,599,630	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust ' 2006-HE1 1M4 ' FRN 25/12/2035	1,760,582	0.02
USD 2,429,751	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust ' 2006-EC2 M2 ' FRN 25/2/2036	2,224,223	0.02
USD 5,514,008	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust ' 2006-HE7 1A2 ' FRN 25/9/2036	6,106,245	0.07
USD 1,575,345	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust ' 2007-AQ2 A2 ' FRN 25/1/2037	1,580,401	0.02
USD 939,718	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust ' 2007-HE1 21A2 ' FRN 25/1/2037	886,560	0.01
USD 876,664	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust ' 2007-HE2 1A4 ' FRN 25/3/2037	637,766	0.01
USD 1,222,407	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust ' 2007-HE2 22A ' FRN 25/3/2037	1,161,481	0.01
USD 2,885,863	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust ' 2007-HE2 23A ' FRN 25/3/2037	2,784,863	0.03
USD 5,550,537	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust ' 2007-HE3 1A4 ' FRN 25/4/2037	3,826,007	0.04
USD 4,105,321	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust (Step-up coupon) ' 2005-AC9 A5 ' 6.25% 25/12/2035	4,070,648	0.04
USD 4,780,201	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust (Step-up coupon) ' 2006-AC1 1A2 ' 6.25% 25/2/2036	3,903,601	0.04
USD 587,212	Bear Stearns Asset Backed Securities Trust ' 2005-4 M2 ' FRN 25/1/2036	569,152	0.01
USD 36,888	Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust ' 2007-PW17 AMFL ' ' 144A ' FRN 11/6/2050	36,889	0.00
USD 410,654	Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust ' 2007-PW18 AM ' FRN 11/6/2050	412,724	0.00
USD 730,994	Bear Stearns Mortgage Funding Trust ' 2007-AR2 A1 ' FRN 25/3/2037	655,169	0.01
USD 1,113,992	Bear Stearns Mortgage Funding Trust ' 2007-AR3 1A1 ' FRN 25/3/2037	1,055,237	0.01
USD 895,231	Bear Stearns Mortgage Funding Trust ' 2007-AR4 2A1 ' FRN 25/6/2037	806,332	0.01
USD 1,330,000	Bear Stearns Second Lien Trust ' 2007-SV1A M1 ' ' 144A ' FRN 25/1/2036	1,288,428	0.01
USD 1,135,000	Becton Dickinson and Co 2.894% 6/6/2022	1,141,317	0.01
EUR 200,000	Belden Inc 5.5% 15/4/2023	250,594	0.00
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO II Ltd ' 2013-IIA CR ' ' 144A ' FRN 15/7/2029	502,668	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,415,000	Benefit Street Partners CLO IV Ltd ' 2014-IVA A1R ' ' 144A ' ' FRN 20/1/2029	3,456,506	0.04
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO IX Ltd ' 2016-9A E ' ' 144A ' ' FRN 20/7/2028	505,536	0.01
USD 1,020,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd ' 2015-VIA A2 ' ' 144A ' ' FRN 18/4/2027	1,020,089	0.01
USD 610,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd ' 2015-VIA C ' ' 144A ' ' FRN 18/4/2027	610,052	0.01
USD 1,000,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd ' 2015-VIA D ' ' 144A ' ' FRN 18/4/2027	999,842	0.01
USD 5,190,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd ' 2015-VIA A1R ' ' 144A ' ' FRN 18/10/2029	5,190,000	0.06
USD 1,440,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd ' 2015-VIA A2R ' ' 144A ' ' FRN 18/10/2029	1,440,000	0.02
USD 610,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd ' 2015-VIA CR ' ' 144A ' ' FRN 18/10/2029	610,000	0.01
USD 2,370,000	Benefit Street Partners CLO VII Ltd ' 2015-VIIA D ' ' 144A ' ' FRN 18/7/2027	2,350,238	0.03
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd ' 2015-8A B ' ' 144A ' ' FRN 20/1/2028	504,621	0.01
USD 680,000	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd ' 2015-8A C ' ' 144A ' ' FRN 20/1/2028	686,192	0.01
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd ' 2015-8A D ' ' 144A ' ' FRN 20/1/2028	494,195	0.01
USD 600,000	Betony CLO Ltd ' 2015-1A CR ' ' 144A ' ' FRN 15/4/2027	603,052	0.01
USD 460,000	Betony CLO Ltd ' 2015-1A D ' ' 144A ' ' FRN 15/4/2027	460,639	0.01
USD 2,400,000	BHMS 2014-ATLS Mortgage Trust ' 2014-ATLS AFL ' ' 144A ' ' FRN 5/7/2033	2,403,134	0.03
USD 280,000	Birchwood Park CLO Ltd ' 2014-1A D1 ' ' 144A ' ' FRN 15/7/2026	282,423	0.00
USD 330,000	BlueMountain CLO 2012-2 Ltd ' 2012-2A DR ' ' 144A ' ' FRN 20/11/2028	333,511	0.00
USD 1,020,000	BlueMountain CLO 2013-2 Ltd ' 2013-2A A ' ' 144A ' ' FRN 22/1/2025	1,021,828	0.01
USD 450,000	BlueMountain CLO 2013-3 Ltd ' 2013-3A B1R ' ' 144A ' ' FRN 29/10/2025	450,397	0.01
USD 1,940,000	BlueMountain CLO 2013-3 Ltd ' 2013-3A CR ' ' 144A ' ' FRN 29/10/2025	1,943,083	0.02
USD 790,000	BlueMountain CLO 2014-2 Ltd ' 2014-2A AR ' ' 144A ' ' FRN 20/7/2026	790,658	0.01
USD 1,593,000	BlueMountain CLO 2014-3 Ltd ' 2014-3A D ' ' 144A ' ' FRN 15/10/2026	1,597,022	0.02
USD 840,000	BlueMountain CLO 2014-4 Ltd ' 2014-4A A1R ' ' 144A ' ' FRN 30/11/2026	839,142	0.01
USD 530,000	BlueMountain CLO 2014-4 Ltd ' 2014-4A E ' ' 144A ' ' FRN 30/11/2026	532,775	0.01
USD 480,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd ' 2015-1A C ' ' 144A ' ' FRN 13/4/2027	485,851	0.01
USD 889,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd ' 2015-1A D ' ' 144A ' ' FRN 13/4/2027	893,641	0.01
USD 750,000	BlueMountain CLO 2015-2 Ltd ' 2015-2A E ' ' 144A ' ' FRN 18/7/2027	743,077	0.01
USD 280,000	BlueMountain CLO 2015-4 Ltd ' 2015-4A D2 ' ' 144A ' ' FRN 20/1/2027	283,538	0.00
USD 280,000	BlueMountain CLO 2015-4 Ltd ' 2015-4A E ' ' 144A ' ' FRN 20/1/2027	284,483	0.00
USD 250,000	BlueMountain CLO 2016-2 Ltd ' 2016-2A D ' ' 144A ' ' FRN 20/8/2028	253,768	0.00
USD 250,000	BlueMountain CLO 2016-3 Ltd ' 2016-3A E ' ' 144A ' ' FRN 15/11/2027	253,483	0.00
USD 4,875,000	Boyd Gaming Corp 6.875% 15/5/2023	5,271,094	0.06
USD 4,955,000	Brinker International Inc ' 144A ' 5% 1/10/2024	4,880,675	0.05

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 750,000	Bristol Park CLO Ltd ' 2016-1A E ' ' 144A ' FRN 15/4/2029	763,475	0.01
USD 13,448,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd ' 144A ' 3% 15/1/2022	13,635,855	0.15
USD 10,686,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd ' 144A ' 3.625% 15/1/2024	11,002,813	0.12
USD 17,605,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd ' 144A ' 3.875% 15/1/2027	18,125,932	0.20
USD 1,950,000	Brooklyn Arena Local Development Corp 5% 15/7/2042	2,211,670	0.02
USD 2,573,405	Brookside Mill CLO Ltd ' 2013-1A A1 ' ' 144A ' FRN 17/4/2025	2,577,973	0.03
USD 3,010,000	Bsprt 2017-FL1 Issuer Ltd ' 2017-FL1 A ' ' 144A ' FRN 15/6/2027	3,013,759	0.03
USD 3,590,000	Buckeye Tobacco Settlement Financing Authority 5.875% 1/6/2047	3,436,761	0.04
USD 250,000	Burnham Park Clo Ltd ' 2016-1A E ' ' 144A ' FRN 20/10/2029	253,509	0.00
USD 3,962,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust ' 2013-1515 F ' ' 144A ' FRN 10/3/2033	3,922,822	0.04
USD 2,730,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust ' 2013-1515 D ' ' 144A ' 3.633% 10/3/2033	2,751,600	0.03
USD 2,002,000	BWAY 2015-1740 Mortgage Trust ' 2015-1740 E ' ' 144A ' FRN 10/1/2035	1,992,227	0.02
USD 2,238,000	BWAY Holding Co ' 144A ' 5.5% 15/4/2024	2,338,710	0.03
USD 380,000	BXHTL 2015-JWRZ Mortgage Trust ' 2015-JWRZ GL2 ' ' 144A ' FRN 15/5/2029	385,465	0.00
USD 1,340,000	BXP Trust ' 2017-CC D ' ' 144A ' FRN 13/8/2037	1,296,484	0.01
USD 4,820,000	BXP Trust ' 2017-CC E ' ' 144A ' FRN 13/8/2037	4,458,521	0.05
USD 7,180,000	BXP Trust ' 2017-GM D ' ' 144A ' FRN 13/6/2039	6,996,946	0.08
USD 1,650,000	BXP Trust ' 2017-GM E ' ' 144A ' FRN 13/6/2039	1,569,340	0.02
USD 2,079,000	Caesars Entertainment Resort Properties LLC / Caesars Entertainment Resort Prope 8% 1/10/2020	2,130,975	0.02
USD 8,475,000	Caesars Growth Properties Holdings LLC / Caesars Growth Properties Finance Inc 9.375% 1/5/2022	9,153,000	0.10
USD 1,005,000	California Health Facilities Financing Authority 5% 15/8/2033	1,201,689	0.01
USD 510,000	California Housing Finance Agency 3.656% 1/2/2029	524,025	0.01
USD 1,970,000	California Pollution Control Financing Authority ' 144A ' 5% 21/11/2045	2,118,055	0.02
USD 1,735,000	California State Public Works Board 8.361% 1/10/2034	2,626,946	0.03
USD 1,520,000	Calpine Corp 5.375% 15/1/2023	1,457,300	0.02
USD 2,184,000	Calpine Corp 5.5% 1/2/2024	2,039,310	0.02
USD 1,070,000	Calpine Corp 5.75% 15/1/2025	991,087	0.01
USD 1,930,000	Calpine Corp ' 144A ' 5.875% 15/1/2024	1,987,900	0.02
USD 2,170,000	Calpine Corp ' 144A ' 6% 15/1/2022	2,246,319	0.02
USD 917,724	Canyon Capital CLO 2006-1 Ltd ' 2006-1A A1 ' ' 144A ' FRN 15/12/2020	914,186	0.01
USD 580,000	Canyon Capital CLO 2012-1 Ltd ' 2012-1A DR ' ' 144A ' FRN 15/1/2026	580,009	0.01
USD 250,000	Canyon Capital CLO 2016-1 Ltd ' 2016-1A E ' ' 144A ' FRN 15/4/2028	251,034	0.00
USD 930,000	Canyon Capital CLO 2016-2 Ltd ' 2016-2A E ' ' 144A ' FRN 15/10/2028	924,408	0.01
USD 1,455,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2012-3 Ltd ' 2012-3A CR ' ' 144A ' FRN 14/10/2028	1,469,365	0.02
USD 1,190,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2013-3 Ltd ' 2013-3A B ' ' 144A ' FRN 15/7/2025	1,193,653	0.01
USD 250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2013-3 Ltd ' 2013-3A C ' ' 144A ' FRN 15/7/2025	251,380	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 660,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-1 Ltd ' 2014-1A CR ' ' 144A ' FRN 17/4/2025	664,797	0.01
USD 250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-3 Ltd ' 2014-3A C1R ' ' 144A ' FRN 27/7/2026	250,790	0.00
USD 1,618,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-3 Ltd ' 2014-3A D1 ' ' 144A ' FRN 27/7/2026	1,623,926	0.02
USD 1,310,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd ' 2015-1A CR ' ' 144A ' FRN 20/4/2027	1,315,457	0.01
USD 525,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd ' 2015-1A DR ' ' 144A ' FRN 20/4/2027	527,891	0.01
USD 485,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd ' 2015-1A E1 ' ' 144A ' FRN 20/4/2027	480,197	0.01
USD 250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-2 Ltd ' 2015-2A C ' ' 144A ' FRN 27/4/2027	251,356	0.00
USD 280,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-2 Ltd ' 2015-2A D ' ' 144A ' FRN 27/4/2027	277,815	0.00
USD 630,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-3 Ltd ' 2015-3A D ' ' 144A ' FRN 28/7/2028	633,831	0.01
USD 370,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-4 Ltd ' 2015-4A D ' ' 144A ' FRN 20/10/2027	373,435	0.00
USD 580,667	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-4 Ltd ' 2015-4A SBB1 ' ' 144A ' FRN 20/10/2027	589,323	0.01
USD 500,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2016-1 Ltd ' 2016-1A D ' ' 144A ' FRN 20/4/2027	511,811	0.01
USD 1,841,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2005-FRE1 M1 ' FRN 25/12/2035	1,785,339	0.02
USD 490,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-NC1 M2 ' FRN 25/1/2036	279,364	0.00
USD 1,885,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-FRE1 A4 ' FRN 25/4/2036	1,489,365	0.02
USD 757,185	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-NC2 A3 ' FRN 25/6/2036	737,754	0.01
USD 1,255,344	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-FRE2 A2 ' FRN 25/10/2036	847,749	0.01
USD 3,573,327	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-FRE2 A3 ' FRN 25/10/2036	2,425,346	0.03
USD 3,319,574	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-FRE2 A5 ' FRN 25/10/2036	2,230,348	0.02
USD 1,080,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-NC4 A3 ' FRN 25/10/2036	933,894	0.01
USD 1,690,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2007-RFC1 A4 ' FRN 25/10/2036	1,199,654	0.01
USD 2,629,110	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-NC5 A3 ' FRN 25/1/2037	1,925,603	0.02
USD 341,769	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-NC5 A5 ' FRN 25/1/2037	299,139	0.00
USD 1,081,760	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2007-HE1 A2 ' FRN 25/6/2037	1,071,100	0.01
USD 1,886,000	Carrizo Oil & Gas Inc 7.5% 15/9/2020	1,919,005	0.02
EUR 100,000	Catalent Pharma Solutions Inc 4.75% 15/12/2024	127,123	0.00
USD 1,100,000	Catamaran CLO 2012-1 Ltd ' 2012-1A BR ' ' 144A ' FRN 20/12/2023	1,101,828	0.01
USD 1,285,000	Catholic Health Initiatives 4.35% 1/11/2042	1,225,506	0.01
USD 3,610,000	Cavalry CLO IV Ltd ' 2014-4A A ' ' 144A ' FRN 15/10/2026	3,612,130	0.04
USD 780,000	CBAM 2017-2 Ltd ' 2017-2A B1 ' ' 144A ' FRN 17/10/2029	780,000	0.01
USD 1,130,390	C-BASS 2006-CB9 TRUST ' 2006-CB9 A2 ' FRN 25/11/2036	717,928	0.01
USD 188,971	C-BASS 2006-CB9 TRUST ' 2006-CB9 A4 ' FRN 25/11/2036	122,265	0.00
USD 5,675,191	C-BASS 2007-CB1 TRUST (Step-up coupon) ' 2007-CB1 AF2 ' 3.753% 25/1/2037	2,838,404	0.03
USD 387,915	C-BASS 2007-CB1 TRUST (Step-up coupon) ' 2007-CB1 AF4 ' 3.753% 25/1/2037	193,953	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,081,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp ' 144A ' 5.125% 1/5/2027	1,106,674	0.01
USD 3,245,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.25% 30/9/2022	3,346,406	0.04
USD 6,270,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp ' 144A ' 5.75% 15/2/2026	6,599,175	0.07
USD 530,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust ' 2016-HEAT D ' ' 144A ' FRN 10/4/2029	542,334	0.01
USD 16,000,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust ' 2016-HEAT X ' ' 144A ' FRN 10/4/2029	684,186	0.01
USD 1,539,376	CD 2006-CD3 Mortgage Trust ' 2006-CD3 AM ' 5.648% 15/10/2048	1,549,534	0.02
USD 455,000	CD 2007-CD5 Mortgage Trust ' 2007-CD5 AJ ' FRN 15/11/2044	455,095	0.01
USD 2,200,000	CD 2007-CD5 Mortgage Trust ' 2007-CD5 AJA ' FRN 15/11/2044	2,206,557	0.02
USD 7,380,749	CD 2017-CD3 Mortgage Trust ' 2017-CD3 XA ' FRN 10/2/2050	565,377	0.01
USD 1,515,000	CDW LLC / CDW Finance Corp 5.5% 1/12/2024	1,666,500	0.02
USD 8,870,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd '2017-8A A1 ' ' 144A ' FRN 17/10/2030	8,870,000	0.10
USD 580,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd '2017-8A B ' ' 144A ' FRN 17/10/2030	580,000	0.01
USD 890,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd '2017-8A C ' ' 144A ' FRN 17/10/2030	890,000	0.01
USD 700,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd '2017-8A D ' ' 144A ' FRN 17/10/2030	700,000	0.01
USD 1,130,000	CEMEX Finance LLC ' 144A ' 9.375% 12/10/2022	1,194,975	0.01
USD 306,000	Cent CLO 24 Ltd ' 2015-24A D2 ' ' 144A ' FRN 15/10/2026	311,438	0.00
USD 740,000	Central Texas Regional Mobility Authority 5% 1/1/2045	834,228	0.01
USD 740,000	Central Texas Regional Mobility Authority 5% 1/1/2046	836,614	0.01
USD 8,110,000	CF Industries Inc ' 144A ' 4.5% 1/12/2026	8,429,753	0.09
USD 290,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust ' 2016-C3 D ' ' 144A ' FRN 10/1/2048	219,656	0.00
USD 5,430,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust ' 2016-C3 XD ' ' 144A ' FRN 10/1/2048	617,961	0.01
USD 2,270,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust ' 2016-C4 C ' FRN 10/5/2058	2,434,161	0.03
USD 5,619,586	CFCRE Commercial Mortgage Trust ' 2016-C4 XA ' FRN 10/5/2058	634,019	0.01
USD 5,439,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust ' 2016-C4 XB ' FRN 10/5/2058	299,118	0.00
USD 330,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust ' 2016-C3 A3 ' 3.865% 10/1/2048	352,324	0.00
USD 1,820,000	CGBAM Commercial Mortgage Trust ' 2015-SMRT E ' ' 144A ' FRN 10/4/2028	1,835,878	0.02
USD 752,000	CG-CCRE Commercial Mortgage Trust ' 2014-FL1 E ' ' 144A ' FRN 15/6/2031	752,600	0.01
USD 118,000	CGDB Commercial Mortgage Trust ' 2017-B10 D ' ' 144A ' FRN 15/5/2030	117,707	0.00
USD 3,150,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust ' 2017-B10C A ' ' 144A ' FRN 15/7/2028	3,142,261	0.03
USD 4,100,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust ' 2017-B10C D ' ' 144A ' FRN 15/7/2028	4,077,287	0.04
USD 4,960,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust ' 2017-B10C E ' ' 144A ' FRN 15/7/2028	4,979,186	0.05
USD 730,000	CGMS Commercial Mortgage Trust ' 2017-B1 A4 ' 3.458% 15/8/2050	761,328	0.01
USD 12,535,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital ' 144A ' 5.375% 1/5/2047	12,827,015	0.14

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
EUR 330,000	Chemours Co/The 6.125% 15/5/2023	424,016	0.00
USD 8,531,000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC ' 144A ' 5.125% 30/6/2027	8,786,930	0.10
USD 730,000	Chesapeake Bay Bridge & Tunnel District 5% 1/7/2041	835,704	0.01
USD 575,000	Chesapeake Bay Bridge & Tunnel District 5% 1/7/2051	647,392	0.01
USD 6,549,000	Chesapeake Energy Corp 6.625% 15/8/2020	6,549,000	0.07
USD 669,000	Chesapeake Energy Corp ' 144A ' 8% 15/12/2022	692,208	0.01
USD 1,310,000	Chicago Skyscraper Trust '2017-SKY D ' ' 144A ' FRN 15/2/2030	1,321,836	0.01
USD 2,810,000	Chicago Skyscraper Trust '2017-SKY E ' ' 144A ' FRN 15/2/2030	2,836,850	0.03
USD 360,000	Chicago Skyscraper Trust '2017-SKY F ' ' 144A ' FRN 15/2/2030	363,472	0.00
USD 2,080,000	Chino Valley Unified School District 5.25% 1/8/2047	2,520,118	0.03
USD 2,902,012	CHL Mortgage Pass-Through Trust ' 2006-OA4 A1 ' FRN 25/4/2046	1,683,949	0.02
USD 1,250,000	CIFC Funding 2012-II Ltd ' 2012-2A B2R ' ' 144A ' FRN 5/12/2024	1,261,338	0.01
USD 490,000	CIFC Funding 2012-III Ltd ' 2012-3A A3R ' ' 144A ' FRN 29/1/2025	491,236	0.01
USD 670,000	CIFC Funding 2012-III Ltd ' 2012-3A B1R ' ' 144A ' FRN 29/1/2025	674,446	0.01
USD 250,000	CIFC Funding 2013-I Ltd ' 2013-1A A2R ' ' 144A ' FRN 16/7/2030	250,700	0.00
USD 200,000	CIFC Funding 2013-II Ltd ' 2013-2A B1L ' ' 144A ' FRN 21/4/2025	201,517	0.00
USD 440,000	CIFC Funding 2013-IV Ltd ' 2013-4A DR ' ' 144A ' FRN 27/11/2024	442,665	0.00
USD 2,020,000	CIFC Funding 2014 Ltd ' 2014-1A AR ' ' 144A ' FRN 18/4/2025	2,021,802	0.02
USD 750,000	CIFC Funding 2014 Ltd ' 2014-1A E ' ' 144A ' FRN 18/4/2025	738,918	0.01
USD 4,750,000	CIFC Funding 2014-II Ltd ' 2014-2A A1LR ' ' 144A ' FRN 24/5/2026	4,754,732	0.05
USD 1,390,000	CIFC Funding 2014-II Ltd ' 2014-2A B1L ' ' 144A ' FRN 24/5/2026	1,401,374	0.02
USD 280,000	CIFC Funding 2014-III Ltd ' 2014-3A B1R ' ' 144A ' FRN 22/7/2026	280,358	0.00
USD 1,013,000	CIFC Funding 2014-III Ltd ' 2014-3A C1R ' ' 144A ' FRN 22/7/2026	1,014,960	0.01
USD 745,000	CIFC Funding 2014-IV Ltd ' 2014-4A D ' ' 144A ' FRN 17/10/2026	751,510	0.01
USD 4,825,000	CIFC Funding 2014-V Ltd ' 2014-5A A1R ' ' 144A ' FRN 17/1/2027	4,843,155	0.05
USD 280,000	CIFC Funding 2014-V Ltd ' 2014-5A CR ' ' 144A ' FRN 17/1/2027	282,370	0.00
USD 990,000	CIFC Funding 2015-I Ltd ' 2015-1A A1R ' ' 144A ' FRN 22/1/2027	990,036	0.01
USD 680,000	CIFC Funding 2015-I Ltd '2015-1A D ' ' 144A ' FRN 22/1/2027	687,101	0.01
USD 3,370,000	CIFC Funding 2015-II Ltd '2015-2A A ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	3,379,503	0.04
USD 250,000	CIFC Funding 2015-II Ltd '2015-2A D ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	251,442	0.00
USD 750,000	CIFC Funding 2015-III Ltd ' 2015-3A E ' ' 144A ' FRN 19/10/2027	751,957	0.01
USD 280,000	CIFC Funding 2015-V Ltd '2015-5A D ' ' 144A ' FRN 25/10/2027	279,840	0.00
USD 940,000	CIFC Funding 2016-I Ltd '2016-1A E ' ' 144A ' FRN 21/10/2028	942,892	0.01
USD 22,610,000	CIM Trust ' 2017-6 ' 3% 25/6/2057	22,609,141	0.24
USD 820,000	CIT Group Inc ' 144A ' 5.5% 15/2/2019	859,975	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,290,000	Citicorp Residential Mortgage Trust Series (Step-up coupon) ' 2007-2 M1 ' 5.232% 25/6/2037	2,227,238	0.02
USD 300,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust ' 2015-SHP2 F ' ' 144A ' FRN 15/7/2027	300,787	0.00
USD 563,500	Citigroup Commercial Mortgage Trust ' 2015-SSHP D ' ' 144A ' FRN 15/9/2027	565,269	0.01
USD 8,700,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust ' 2013-SMP XB ' ' 144A ' FRN 12/1/2030	107	0.00
USD 190,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust ' 2013-375P D ' ' 144A ' FRN 10/5/2035	191,958	0.00
USD 2,874,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust ' 2013-375P E ' ' 144A ' FRN 10/5/2035	2,834,225	0.03
USD 974,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust ' 2014-GC21 C ' FRN 10/5/2047	1,014,854	0.01
USD 2,420,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust ' 2014-GC25 XE ' ' 144A ' FRN 10/10/2047	166,412	0.00
USD 4,250,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust ' 2015-GC27 C ' FRN 10/2/2048	4,123,808	0.04
USD 50,850,635	Citigroup Commercial Mortgage Trust ' 2015-P1 XA ' FRN 15/9/2048	2,470,893	0.03
USD 100,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust ' 2016-P3 C ' FRN 15/4/2049	106,692	0.00
USD 8,228,351	Citigroup Commercial Mortgage Trust ' 2016-P3 XA ' FRN 15/4/2049	877,117	0.01
USD 1,190,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust ' 2016-C1 C ' FRN 10/5/2049	1,259,855	0.01
USD 1,340,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust ' 2016-GC37 D ' ' 144A ' 2.788% 10/4/2049	970,332	0.01
USD 260,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust ' 2016-SMPL D ' ' 144A ' 3.52% 10/9/2031	262,502	0.00
USD 500,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust ' 2016-SMPL E ' ' 144A ' 4.509% 10/9/2031	510,924	0.01
USD 15,815,000	Citigroup Inc FRN 24/7/2028	16,050,280	0.17
USD 18,390,000	Citigroup Inc 3.2% 21/10/2026	18,194,478	0.20
USD 15,153,000	Citigroup Inc 4.125% 25/7/2028	15,615,689	0.17
USD 10,280,000	Citigroup Inc 4.45% 29/9/2027	10,854,698	0.12
USD 4,230,000	Citigroup Mortgage Loan Trust ' 2006-NC1 A2D ' FRN 25/8/2036	3,439,393	0.04
USD 6,370,966	Citigroup Mortgage Loan Trust ' 2007-AHL2 A3B ' FRN 25/5/2037	4,802,035	0.05
USD 2,183,941	Citigroup Mortgage Loan Trust ' 2007-AHL2 A3C ' FRN 25/5/2037	1,658,075	0.02
USD 1,400,000	City of Aurora CO Water Revenue 5% 1/8/2046	1,649,697	0.02
USD 715,000	City of Houston TX Airport System Revenue 5% 1/7/2024	817,363	0.01
USD 990,000	City of Houston TX Combined Utility System Revenue 5% 15/11/2035	1,179,595	0.01
USD 1,105,000	City of Riverside CA Electric Revenue 7.605% 1/10/2040	1,640,848	0.02
USD 860,000	Clark County School District 5% 15/6/2023	1,025,971	0.01
USD 1,025,000	Clark County School District 5% 15/6/2024	1,242,848	0.01
USD 220,000	Clark County School District 5% 15/6/2026	270,491	0.00
USD 860,000	Clark County School District 5% 15/6/2027	1,050,761	0.01
USD 835,000	Clark County School District 5% 15/6/2028	1,011,728	0.01
USD 2,160,000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc 6.5% 15/11/2022	2,230,200	0.02
USD 1,195,000	CLNS Trust ' 2017-IKPR E ' ' 144A ' FRN 11/6/2032	1,204,947	0.01
EUR 355,000	Colfax Corp 3.25% 15/5/2025	432,593	0.00
USD 720,000	Colorado Health Facilities Authority 5.25% 1/2/2031	764,377	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 799,320	COLT 2015-1 LLC ' 2015-1 A1V ' ' 144A ' FRN 26/12/2045	805,395	0.01
USD 9,980,000	Comcast Corp 3.15% 15/2/2028	9,966,911	0.11
USD 1,278,000	Comcast Corp 3.2% 15/7/2036	1,190,061	0.01
USD 9,800,000	Comcast Corp 3.3% 1/2/2027	9,964,522	0.11
USD 5,898,000	Comcast Corp 3.4% 15/7/2046	5,382,447	0.06
USD 640,000	COMM ' 2013-GAM A2 ' ' 144A ' 3.367% 10/2/2028	657,202	0.01
USD 390,000	COMM 2005-C6 Mortgage Trust ' 2005-C6 F ' ' 144A ' FRN 10/6/2044	403,627	0.00
USD 100,000	COMM 2013-300P Mortgage Trust ' 2013-300P D ' ' 144A ' FRN 10/8/2030	106,614	0.00
USD 1,740,000	COMM 2013-WWP Mortgage Trust ' 2013-WWP D ' ' 144A ' FRN 3.898% 10/3/2031	1,820,188	0.02
USD 100,000	COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust ' 2014-CR18 C ' FRN 15/7/2047	102,644	0.00
USD 1,915,000	COMM 2014-FL4 Mortgage Trust ' 2014-FL4 D ' ' 144A ' FRN 13/7/2031	1,902,180	0.02
USD 1,447,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust ' 2014-PAT D ' ' 144A ' FRN 13/8/2027	1,450,163	0.02
USD 1,020,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust ' 2014-PAT E ' ' 144A ' FRN 13/8/2027	1,025,549	0.01
USD 8,430,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust ' 2014-PAT F ' ' 144A ' FRN 13/8/2027	8,282,837	0.09
USD 6,905,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust ' 2014-PAT G ' ' 144A ' FRN 13/8/2027	6,915,530	0.07
USD 3,725,000	COMM 2014-TWC Mortgage Trust ' 2014-TWC E ' ' 144A ' FRN 13/2/2032	3,755,490	0.04
USD 1,090,000	COMM 2015-3BP Mortgage Trust ' 2015-3BP F ' ' 144A ' FRN 10/2/2035	1,004,217	0.01
USD 550,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust ' 2015-CR23 C ' FRN 10/5/2048	533,666	0.01
USD 3,210,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust ' 2015-CR23 CMD ' ' 144A ' FRN 10/5/2048	3,178,787	0.03
USD 1,950,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust ' 2015-CR23 CME ' ' 144A ' FRN 10/5/2048	1,947,110	0.02
USD 5,320,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust ' 2015-CR23 D ' FRN 10/5/2048	4,479,316	0.05
USD 41,344,452	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust ' 2015-CR23 XA ' FRN 10/5/2048	2,080,699	0.02
USD 1,680,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust ' 2015-CR23 E ' ' 144A ' FRN 3.234% 10/5/2048	1,049,688	0.01
USD 1,520,000	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust ' 2015-CR25 C ' FRN 10/8/2048	1,562,439	0.02
USD 2,715,000	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust ' 2015-CR25 D ' FRN 10/8/2048	2,314,695	0.03
USD 23,472,463	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust ' 2015-CR25 XA ' FRN 10/8/2048	1,347,785	0.01
USD 2,890,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust ' 2015-LC19 C ' FRN 10/2/2048	2,967,481	0.03
USD 4,146,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust ' 2015-LC19 D ' ' 144A ' FRN 10/2/2048	3,375,694	0.04
USD 9,660,000	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust ' 2015-LC21 XD ' ' 144A ' FRN 10/7/2048	731,890	0.01
USD 11,006,765	COMM 2016-DC2 Mortgage Trust ' 2016-DC2 XA ' FRN 10/2/2049	728,482	0.01
USD 555,000	Commercial Metals Co 4.875% 15/5/2023	572,344	0.01
USD 5,086,000	Commercial Metals Co 5.375% 15/7/2027	5,302,155	0.06
USD 124,513	Commercial Mortgage Trust ' 2006-GG7 AM ' FRN 10/7/2038	124,394	0.00
USD 1,455,000	Commonwealth Financing Authority 4.144% 1/6/2038	1,558,363	0.02
USD 11,890,000	Commonwealth of Puerto Rico 8% 1/7/2035	6,896,200	0.07

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,075,000	Connecticut State Health & Educational Facility Authority 5% 1/7/2045	2,340,745	0.03
USD 1,400,000	Connecticut State Health & Educational Facility Authority 5% 1/7/2045	1,522,570	0.02
USD 2,105,147	Conseco Finance Corp ' 1997-3 M1 ' FRN 15/3/2028	2,093,763	0.02
USD 1,329,868	Conseco Finance Corp ' 1997-6 M1 ' FRN 15/1/2029	1,307,275	0.01
USD 1,530,166	Conseco Finance Corp ' 1999-5 A5 ' FRN 1/3/2030	1,251,693	0.01
USD 1,119,730	Conseco Finance Corp ' 1999-5 A6 ' FRN 1/3/2030	887,290	0.01
USD 290,447	Conseco Finance Corp ' 1998-4 M1 ' FRN 1/4/2030	257,924	0.00
USD 720,487	Conseco Finance Corp ' 1998-6 M1 ' FRN 1/6/2030	667,606	0.01
USD 2,321,770	Conseco Finance Corp ' 1998-8 M1 ' FRN 1/9/2030	1,946,924	0.02
USD 1,438,606	Conseco Finance Corp ' 1998-8 A1 ' 6.28% 1/9/2030	1,518,524	0.02
USD 1,358,922	Conseco Finance Securitizations Corp ' 2000-1 A5 ' FRN 1/9/2029	786,122	0.01
USD 1,678,866	Conseco Finance Securitizations Corp ' 2000-4 A6 ' FRN 1/5/2032	952,756	0.01
USD 2,047,952	Conseco Finance Securitizations Corp ' 2000-5 A6 ' 7.96% 1/5/2031	1,407,226	0.02
USD 4,681,648	Conseco Finance Securitizations Corp ' 2000-4 A5 ' 7.97% 1/5/2032	2,551,855	0.03
USD 3,727,301	Conseco Finance Securitizations Corp ' 2000-5 A7 ' 8.2% 1/5/2031	2,626,752	0.03
USD 143	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	159	0.00
USD 295,164	Continental Airlines 2010-1 Class B Pass Through Trust 6% 12/1/2019	303,529	0.00
USD 850,000	Continental Airlines 2012-3 Class C Pass Through Trust 6.125% 29/4/2018	875,500	0.01
USD 890,000	Contra Costa Community College District 6.504% 1/8/2034	1,168,614	0.01
USD 8,992,000	Core Industrial Trust ' 2015-CALW G ' ' 144A ' FRN 10/2/2034	8,843,317	0.10
USD 2,480,000	Core Industrial Trust ' 2015-TEXW D ' ' 144A ' FRN 10/2/2034	2,540,666	0.03
USD 250,000	Core Industrial Trust ' 2015-TEXW E ' ' 144A ' FRN 10/2/2034	249,995	0.00
USD 5,140,000	Core Industrial Trust ' 2015-TEXW F ' ' 144A ' FRN 10/2/2034	5,008,101	0.05
USD 13,340,000	Core Industrial Trust ' 2015-TEXW XA ' ' 144A ' FRN 10/2/2034	414,407	0.00
USD 424,000	Core Industrial Trust ' 2015-WEST E ' ' 144A ' FRN 10/2/2037	431,904	0.00
USD 9,240,000	Core Industrial Trust ' 2015-WEST XA ' ' 144A ' FRN 10/2/2037	549,179	0.01
USD 4,019,000	Cosmopolitan Hotel Trust ' 2016-CSMO A ' ' 144A ' FRN 15/11/2033	4,045,663	0.04
USD 3,252,220	Countrywide Asset-Backed Certificates ' 2007-S3 A3 ' FRN 25/5/2037	2,935,127	0.03
USD 816,307	Countrywide Asset-Backed Certificates (Step-up coupon) ' 2006-S3 A3 ' 6.401% 25/6/2021	993,358	0.01
USD 2,533,060	Countrywide Asset-Backed Certificates (Step-up coupon) ' 2006-S3 A4 ' 6.401% 25/1/2029	2,544,053	0.03
USD 154,209	Countrywide Commercial Mortgage Trust ' 2007-MF1 A ' ' 144A ' FRN 12/11/2043	154,814	0.00
USD 1,430,000	County of Clark Department of Aviation 5% 1/7/2021	1,624,923	0.02
USD 1,000,000	County of Miami-Dade FL 5% 1/7/2034	1,178,590	0.01
USD 910,000	County of Miami-Dade FL 5% 1/7/2035	1,068,608	0.01
USD 2,015,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 2.504% 1/10/2024	1,995,374	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 455,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.354% 1/10/2029	461,274	0.01
USD 835,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.454% 1/10/2030	848,669	0.01
USD 780,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.504% 1/10/2031	794,251	0.01
USD 755,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.554% 1/10/2032	764,505	0.01
USD 1,810,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2038	2,062,214	0.02
USD 7,595,000	Cox Communications Inc ' 144A ' 3.5% 15/8/2027	7,530,959	0.08
USD 1,290,000	Cox Communications Inc ' 144A ' 4.6% 15/8/2047	1,314,012	0.01
USD 250,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust ' 2015-1A C ' ' 144A ' 3.3% 17/7/2023	251,759	0.00
USD 1,912,077	Credit Suisse ABS Repackaging Trust ' 2013-A B ' ' 144A ' 2.5% 25/1/2030	1,824,397	0.02
USD 1,450,000	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp ' 2005-C3 C ' FRN 15/7/2037	1,486,602	0.02
USD 510,000	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp ' 2004-C4 F ' ' 144A ' FRN 15/10/2039	526,780	0.01
USD 136,597	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp ' 2005-C2 AMFX ' 4.877% 15/4/2037	134,172	0.00
USD 120,162	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp ' 2005-C3 B ' 4.882% 15/7/2037	120,014	0.00
USD 2,668,691	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC ' 2007-CB6 A4 ' ' 144A ' FRN 25/7/2037	1,804,592	0.02
USD 913,492	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC ' 2007-RP1 A ' ' 144A ' FRN 25/5/2046	763,736	0.01
USD 489,683	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) ' 2006-CB2 AF4 ' 3.422% 25/12/2036	391,184	0.00
USD 4,122,767	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) ' 2006-SL1 A2 ' ' 144A ' 5.556% 25/9/2036	971,020	0.01
USD 705,000	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) ' 2006-MH1 B1 ' ' 144A ' 6.25% 25/10/2036	729,813	0.01
USD 1,510,000	CRH America Finance Inc ' 144A ' 3.4% 9/5/2027	1,542,184	0.02
USD 8,580,000	Crown Castle International Corp 3.65% 1/9/2027	8,646,800	0.09
USD 8,520,000	Crown Castle International Corp 4% 1/3/2027	8,806,383	0.10
USD 6,851,000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc ' 144A ' 7.125% 15/4/2021	7,047,966	0.08
USD 555,000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc ' 144A ' 7.75% 15/2/2023	591,075	0.01
USD 21,822,735	CSAIL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust ' 2016-C5 XA ' FRN 15/11/2048	1,282,818	0.01
USD 5,452,000	CSC Holdings LLC ' 144A ' 6.625% 15/10/2025	5,969,940	0.06
USD 1,990,000	CSC Holdings LLC ' 144A ' 10.125% 15/1/2023	2,303,425	0.03
USD 4,162,000	CSC Holdings LLC ' 144A ' 10.875% 15/10/2025	5,134,868	0.06
USD 1,252,523	CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Series '2005-10 10A1' FRN 25/11/2035	550,880	0.01
USD 590,000	CSMC ' 2016-MFF A ' ' 144A ' FRN 15/11/2033	593,156	0.01
USD 122,260,000	CSMC 2014-USA OA LLC '2014-USA X2' ' 144A' FRN 15/9/2037	820,365	0.01
USD 23,124,095	CSMC 2017-1 TR 4.5% 25/3/2021	23,198,393	0.25
USD 188,239	CSMC Series ' 2010-20R 9A1 ' ' 144A ' FRN 27/1/2036	190,271	0.00
USD 870,000	CSMC Series ' 2014-4R 16A3 ' ' 144A ' FRN 27/2/2036	778,940	0.01
USD 1,079,540	CSMC Series ' 2015-6R 5A1 ' ' 144A ' FRN 27/3/2036	1,054,770	0.01
USD 2,708,147	CSMC Series ' 2015-6R 5A2 ' ' 144A ' FRN 27/3/2036	1,461,646	0.02
USD 1,766,928	CSMC Series ' 2014-9R 9A1 ' ' 144A ' FRN 27/8/2036	1,692,720	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,650,000	CSMC Series ' 2015-4R 1A4 ' ' 144A ' FRN 27/10/2036	1,061,224	0.01
USD 570,000	CSMC Series ' 2015-4R 1A2 ' ' 144A ' FRN 27/11/2036	493,071	0.01
USD 2,127,197	CSMC Series ' 2014-9R 3A1 ' ' 144A ' FRN 27/11/2037	2,104,079	0.02
USD 4,721,002	CSMC Series ' 2014-11R 16A1 ' ' 144A ' FRN 27/9/2047	4,683,136	0.05
USD 502,823	CSMC Series ' 2010-UD1 B ' ' 144A ' FRN 16/12/2049	502,048	0.01
USD 2,202,347	CSMC Trust ' 2015-DEAL A ' ' 144A ' FRN 15/4/2029	2,207,738	0.02
USD 1,390,000	CSMC Trust ' 2015-DEAL D ' ' 144A ' FRN 15/4/2029	1,393,769	0.02
USD 1,689,000	CSMC Trust ' 2017-CHOP E ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	1,693,114	0.02
USD 5,600,000	CSMC Trust ' 2013-5R 1A6 ' ' 144A ' FRN 27/2/2036	5,370,861	0.06
USD 3,695,000	CSX Corp 3.25% 1/6/2027	3,708,620	0.04
USD 7,200,000	CSX Corp 4.25% 1/11/2066	7,041,550	0.08
USD 250,000	Cumberland Park CLO Ltd '2015-2A E ' ' 144A ' FRN 20/7/2026	248,715	0.00
USD 303,916	CWABS Asset-Backed Certificates Trust ' 2006-11 3AV2 ' FRN 25/9/2046	297,572	0.00
USD 1,287,792	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series ' 2004-U 2A ' FRN 15/3/2034	1,050,346	0.01
USD 2,159,840	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series ' 2007-S1 A3 ' FRN 25/11/2036	2,162,072	0.02
USD 323,518	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series ' 2006-S2 A3 ' 5.841% 25/7/2027	391,382	0.00
USD 861,162	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series ' 2006-S5 A4 ' 5.842% 25/6/2035	912,387	0.01
USD 778,385	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series ' 2006-S5 A5 ' 6.155% 25/6/2035	783,237	0.01
USD 14,281,843	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series ' 2006-RES 5B1A ' ' 144A ' FRN 15/5/2035	13,648,086	0.15
USD 420,009	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series ' 2006-RES 5B1B ' ' 144A ' FRN 15/5/2035	378,677	0.00
USD 1,371,966	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series ' 2005-B 2A ' FRN 15/5/2035	1,271,751	0.01
USD 2,467,280	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series ' 2006-H 1A ' FRN 15/11/2036	1,959,083	0.02
USD 1,460,000	Dallas Area Rapid Transit 5% 1/12/2041	1,701,812	0.02
USD 1,970,000	Dallas Area Rapid Transit 5% 1/12/2046	2,282,117	0.02
USD 340,000	Dallas/Fort Worth International Airport 5% 1/11/2043	369,400	0.00
USD 8,561,000	DaVita Inc 5.125% 15/7/2024	8,732,220	0.09
USD 2,150,000	DaVita Inc 5.75% 15/8/2022	2,221,219	0.02
USD 2,322,000	DBJPM 16-C3 Mortgage Trust ' 2016-C3 D ' ' 144A ' FRN 10/9/2049	1,993,442	0.02
USD 4,600,000	DBJPM 17-C6 Mortgage Trust ' 2017-C6 XD ' ' 144A ' FRN 10/6/2050	334,627	0.00
USD 900,000	DBUBS 2011-LC1 Mortgage Trust ' 2011-LC1A E ' ' 144A ' FRN 10/11/2046	956,672	0.01
USD 8,330,136	DCP Rights LLC ' 2014-1A A ' ' 144A ' 5.463% 25/10/2044	8,542,678	0.09
USD 2,346,041	Deephaven Residential Mortgage Trust ' 2016-1A A1 ' ' 144A ' 4% 25/7/2046	2,356,603	0.03
USD 11,000,000	Dell International LLC / EMC Corp ' 144A ' 6.02% 15/6/2026	12,283,656	0.13
USD 2,217,000	Delta Air Lines Inc 2.875% 13/3/2020	2,254,996	0.02
USD 3,163,000	Delta Air Lines Inc 3.625% 15/3/2022	3,265,010	0.04
USD 450,727	Deutsche ALT-A Securities Inc ALT ' 2007-RS1 A2 ' ' 144A ' FRN 27/1/2037	899,853	0.01
USD 835,490	Deutsche Alt-A Securities Mortgage Loan Trust Series '2007-OA4 1A1B' FRN 25/8/2047	796,612	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 650,708	Deutsche Alt-B Securities Mortgage Loan Trust Series ' 2006-AB3 A3 ' FRN 25/7/2036	557,528	0.01
USD 415,356	Deutsche Alt-B Securities Mortgage Loan Trust Series ' 2006-AB3 A8 ' FRN 25/7/2036	355,926	0.00
USD 2,315,000	Diamondback Energy Inc 4.75% 1/11/2024	2,332,362	0.03
USD 944,000	Discover Bank 3.45% 27/7/2026	931,792	0.01
USD 2,050,000	DISH DBS Corp 4.25% 1/4/2018	2,073,062	0.02
USD 1,525,000	DISH DBS Corp 5.875% 15/7/2022	1,641,281	0.02
USD 945,000	District of Columbia 5% 15/7/2034	1,086,079	0.01
USD 945,000	District of Columbia 5% 15/7/2035	1,081,557	0.01
USD 2,205,000	District of Columbia 5.591% 1/12/2034	2,772,567	0.03
USD 2,140,000	District of Columbia Water & Sewer Authority 5% 1/10/2052	2,482,186	0.03
USD 655,000	Dominion Energy Inc 2.579% 1/7/2020	661,495	0.01
USD 250,000	Dryden 31 Senior Loan Fund '2014-31A DR ' ' 144A ' FRN 18/4/2026	252,248	0.00
USD 450,000	Dryden 34 Senior Loan Fund '2014-34A CR ' ' 144A ' FRN 15/10/2026	451,850	0.01
USD 340,000	Dryden 34 Senior Loan Fund '2014-34A DR ' ' 144A ' FRN 15/10/2026	343,028	0.00
USD 250,000	Dryden 36 Senior Loan Fund '2014-36A CR ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	254,134	0.00
USD 500,000	Dryden 36 Senior Loan Fund ' 2014-36A DR ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	509,311	0.01
USD 250,000	Dryden 41 Senior Loan Fund ' 2015-41A E ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	251,739	0.00
USD 250,000	Dryden 43 Senior Loan Fund ' 2016-43A E ' ' 144A ' FRN 20/7/2029	252,229	0.00
USD 1,222,266	Dryden XXV Senior Loan Fund ' 2012-25A AR ' ' 144A ' FRN 15/1/2025	1,223,990	0.01
USD 250,000	Dryden XXV Senior Loan Fund ' 2012-25A CR ' ' 144A ' FRN 15/1/2025	250,843	0.00
USD 3,065,000	Dryden XXVIII Senior Loan Fund ' 2013-28A A1LR ' ' 144A ' FRN 15/8/2030	3,068,792	0.03
USD 10,740,000	Duke Energy Corp 3.75% 1/9/2046	10,424,985	0.11
USD 2,175,000	Dutchess County Local Development Corp 5% 1/7/2046	2,436,468	0.03
USD 720,000	Elevation CLO 2016-5 Ltd ' 2016-5A D ' ' 144A ' FRN 15/7/2028	730,683	0.01
USD 960,000	Eleven Madison Trust 2015-11MD Mortgage Trust ' 2015-11MD A ' ' 144A ' FRN 10/9/2035	1,012,070	0.01
USD 4,640,000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc ' 144A ' 7% 15/8/2021	4,808,200	0.05
USD 5,375,000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc ' 144A ' 8.125% 15/9/2023	5,764,687	0.06
USD 4,295,000	Energen Corp 4.625% 1/9/2021	4,348,687	0.05
USD 2,351,000	Equinix Inc 5.375% 1/4/2023	2,462,672	0.03
USD 3,030,000	Exelon Corp 3.497% 1/6/2022	3,140,622	0.03
USD 1,114,000	Exelon Corp 4.95% 15/6/2035	1,259,937	0.01
USD 610,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' 2016-C02 1M2 ' FRN 25/9/2028	715,682	0.01
USD 3,746,971	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' 2016-C04 1M2 ' FRN 25/1/2029	4,087,344	0.04
USD 3,395,727	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' 2016-C06 1M2 ' FRN 25/4/2029	3,819,945	0.04
USD 1,366,931	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' 2017-C01 1B1 ' FRN 25/7/2029	1,494,564	0.02
USD 3,100,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' 2017-C01 1M2 ' FRN 25/7/2029	3,228,952	0.04

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,240,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' 2017-C03 1B1 ' FRN 25/10/2029	2,304,459	0.03
USD 504,541	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' 2017-C03 1M2 ' FRN 25/10/2029	519,559	0.01
USD 2,127,460	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' 2017-C04 2M2 ' FRN 25/11/2029	2,152,332	0.02
USD 3,060,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' 2017-C05 1B1 ' FRN 25/1/2030	2,809,233	0.03
USD 3,132,341	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' 2017-C05 1M2 ' FRN 25/1/2030	3,048,057	0.03
USD 1,053,800	Fannie Mae Pool ' 190400 ' 4.5% 1/11/2039	1,137,178	0.01
USD 14,907,568	Fannie Mae Pool ' 890751 ' 4% 1/9/2046	15,936,932	0.17
USD 17,798,219	Fannie Mae Pool ' 890783 ' 2.5% 1/6/2032	18,048,270	0.19
USD 13,978,875	Fannie Mae Pool ' AB4210 ' 3% 1/1/2027	14,463,870	0.16
USD 15,142,605	Fannie Mae Pool ' AB4212 ' 3% 1/1/2027	15,667,336	0.17
USD 3,200,032	Fannie Mae Pool ' AB4924 ' 3% 1/4/2027	3,310,950	0.04
USD 1,947,192	Fannie Mae Pool ' AB8742 ' 4% 1/3/2043	2,090,399	0.02
USD 3,508,391	Fannie Mae Pool ' AB9009 ' 3% 1/4/2028	3,627,633	0.04
USD 2,757,170	Fannie Mae Pool ' AB9076 ' 4% 1/4/2043	2,961,009	0.03
USD 1,158,053	Fannie Mae Pool ' AB9936 ' 3% 1/7/2028	1,197,355	0.01
USD 4,964,264	Fannie Mae Pool ' AE0625 ' 4% 1/12/2040	5,345,125	0.06
USD 6,530,869	Fannie Mae Pool ' AJ9300 ' 4% 1/1/2042	6,934,620	0.08
USD 5,852,366	Fannie Mae Pool ' AL2463 ' 4% 1/7/2042	6,204,758	0.07
USD 727,947	Fannie Mae Pool ' AL2840 ' 2.5% 1/11/2027	742,461	0.01
USD 11,114,157	Fannie Mae Pool ' AL4289 ' 3% 1/9/2028	11,507,585	0.12
USD 10,518,311	Fannie Mae Pool ' AL5936 ' 3% 1/9/2029	10,885,570	0.12
USD 3,137,748	Fannie Mae Pool ' AL6900 ' 3.5% 1/5/2045	3,275,690	0.04
USD 23,763,853	Fannie Mae Pool ' AL8060 ' 3% 1/2/2031	24,579,692	0.27
USD 4,742,313	Fannie Mae Pool ' AL8231 ' 2.5% 1/4/2031	4,810,460	0.05
USD 3,806,838	Fannie Mae Pool ' AL8673 ' 3.5% 1/6/2046	3,968,147	0.04
USD 7,244,074	Fannie Mae Pool ' AL9023 ' 3% 1/11/2028	7,495,024	0.08
USD 39,511,118	Fannie Mae Pool ' AL9070 ' 3.5% 1/7/2046	41,108,841	0.44
USD 2,923,608	Fannie Mae Pool ' AL9091 ' 3.5% 1/9/2046	3,047,632	0.03
USD 9,597,469	Fannie Mae Pool ' AL9234 ' 3.5% 1/10/2046	10,024,252	0.11
USD 3,177,133	Fannie Mae Pool ' AL9276 ' 4% 1/9/2046	3,397,354	0.04
USD 4,041,735	Fannie Mae Pool ' AL9378 ' 3% 1/9/2031	4,180,541	0.05
USD 55,653,666	Fannie Mae Pool ' AL9424 ' 3.5% 1/11/2046	57,915,536	0.63
USD 27,145,591	Fannie Mae Pool ' AL9470 ' 4% 1/7/2046	29,025,824	0.31
USD 3,447,278	Fannie Mae Pool ' AL9497 ' 3.5% 1/7/2046	3,593,236	0.04
USD 3,512,980	Fannie Mae Pool ' AL9499 ' 3.5% 1/1/2046	3,649,594	0.04
USD 3,016,292	Fannie Mae Pool ' AL9503 ' 3.5% 1/3/2046	3,149,222	0.03
USD 8,393,032	Fannie Mae Pool ' AL9520 ' 4% 1/2/2046	8,974,915	0.10
USD 11,807,288	Fannie Mae Pool ' AL9556 ' 3.5% 1/12/2046	12,332,700	0.13
USD 21,624,368	Fannie Mae Pool ' AL9635 ' 3.5% 1/12/2045	22,614,498	0.24
USD 18,674,142	Fannie Mae Pool ' AL9726 ' 3.5% 1/1/2047	19,504,489	0.21
USD 15,276,582	Fannie Mae Pool ' AL9774 ' 3.5% 1/1/2047	15,983,025	0.17
USD 12,106,101	Fannie Mae Pool ' AL9786 ' 3% 1/1/2032	12,525,049	0.14
USD 3,845,481	Fannie Mae Pool ' AL9854 ' 4.5% 1/1/2047	4,136,571	0.04

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 6,013,090	Fannie Mae Pool ' AL9871 ' 3% 1/2/2032	6,221,898	0.07
USD 10,800,766	Fannie Mae Pool ' AL9872 ' 3% 1/2/2032	11,171,690	0.12
USD 5,035,437	Fannie Mae Pool ' AL9937 ' 3% 1/9/2030	5,213,114	0.06
USD 22,969,062	Fannie Mae Pool ' AL9980 ' 4% 1/2/2046	24,559,074	0.27
USD 3,421,460	Fannie Mae Pool ' AP6347 ' 4% 1/9/2042	3,681,606	0.04
USD 5,288,657	Fannie Mae Pool ' AQ4135 ' 3% 1/10/2028	5,467,617	0.06
USD 501,027	Fannie Mae Pool ' AS1984 ' 3% 1/3/2029	518,801	0.01
USD 1,397,619	Fannie Mae Pool ' AS3707 ' 4% 1/11/2044	1,488,536	0.02
USD 24,005	Fannie Mae Pool ' AS3834 ' 2.5% 1/11/2029	24,407	0.00
USD 7,390,380	Fannie Mae Pool ' AS4067 ' 4% 1/12/2044	7,948,279	0.09
USD 64,795	Fannie Mae Pool ' AS4314 ' 2.5% 1/1/2030	65,882	0.00
USD 104,086	Fannie Mae Pool ' AS4485 ' 2.5% 1/2/2030	105,837	0.00
USD 99,773	Fannie Mae Pool ' AS4488 ' 2.5% 1/2/2030	101,452	0.00
USD 746,469	Fannie Mae Pool ' AS4797 ' 3.5% 1/4/2045	775,527	0.01
USD 2,315,526	Fannie Mae Pool ' AS4886 ' 3.5% 1/5/2045	2,413,678	0.03
USD 6,091,001	Fannie Mae Pool ' AS5175 ' 3.5% 1/6/2045	6,336,997	0.07
USD 287,463	Fannie Mae Pool ' AS5872 ' 2.5% 1/9/2030	292,299	0.00
USD 6,359,640	Fannie Mae Pool ' AS6016 ' 4% 1/10/2045	6,800,946	0.07
USD 3,466,705	Fannie Mae Pool ' AS6130 ' 3.5% 1/11/2045	3,606,957	0.04
USD 260,269	Fannie Mae Pool ' AS6141 ' 2.5% 1/11/2030	264,647	0.00
USD 3,646,563	Fannie Mae Pool ' AS6220 ' 4% 1/11/2045	3,899,024	0.04
USD 8,982,603	Fannie Mae Pool ' AS6640 ' 3.5% 1/2/2046	9,346,382	0.10
USD 3,810,183	Fannie Mae Pool ' AS6840 ' 4% 1/3/2046	4,057,790	0.04
USD 201,399	Fannie Mae Pool ' AS6899 ' 2.5% 1/3/2031	204,293	0.00
USD 101,915	Fannie Mae Pool ' AS6902 ' 2.5% 1/12/2030	103,620	0.00
USD 9,936,215	Fannie Mae Pool ' AS6991 ' 4% 1/4/2046	10,625,298	0.11
USD 115,171	Fannie Mae Pool ' AS7048 ' 2.5% 1/4/2031	116,826	0.00
USD 120,430	Fannie Mae Pool ' AS7061 ' 3% 1/4/2031	124,598	0.00
USD 187,423	Fannie Mae Pool ' AS7079 ' 2.5% 1/4/2031	190,116	0.00
USD 3,555,858	Fannie Mae Pool ' AS7166 ' 3.5% 1/5/2046	3,700,149	0.04
USD 500,000	Fannie Mae Pool ' AS7269 ' 2.5% 1/6/2031	507,185	0.01
USD 10,527,945	Fannie Mae Pool ' AS7314 ' 3.5% 1/6/2046	10,940,046	0.12
USD 7,284,724	Fannie Mae Pool ' AS7469 ' 3.5% 1/7/2046	7,580,779	0.08
USD 7,099,449	Fannie Mae Pool ' AS7470 ' 3.5% 1/7/2046	7,387,976	0.08
USD 2,500,854	Fannie Mae Pool ' AS7495 ' 2.5% 1/7/2031	2,538,891	0.03
USD 2,182,814	Fannie Mae Pool ' AS7591 ' 3.5% 1/7/2046	2,271,525	0.02
USD 139,870	Fannie Mae Pool ' AS7605 ' 2.5% 1/7/2031	141,917	0.00
USD 8,708,670	Fannie Mae Pool ' AS7616 ' 3.5% 1/7/2046	9,062,605	0.10
USD 65,518	Fannie Mae Pool ' AS7617 ' 2.5% 1/7/2031	66,477	0.00
USD 95,298	Fannie Mae Pool ' AS7643 ' 2.5% 1/8/2031	96,668	0.00
USD 9,901,122	Fannie Mae Pool ' AS7756 ' 4% 1/8/2046	10,587,904	0.11
USD 7,256,180	Fannie Mae Pool ' AS7867 ' 4% 1/9/2046	7,759,513	0.08
USD 5,257,426	Fannie Mae Pool ' AS7940 ' 4% 1/9/2046	5,599,709	0.06
USD 1,513,166	Fannie Mae Pool ' AS7992 ' 3% 1/4/2031	1,565,492	0.02
USD 59,120	Fannie Mae Pool ' AS8009 ' 2.5% 1/10/2031	59,977	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 63,996	Fannie Mae Pool ' AS8012 ' 2.5% 1/9/2031	64,916	0.00
USD 13,545,514	Fannie Mae Pool ' AS8139 ' 4% 1/10/2046	14,385,104	0.16
USD 82,968	Fannie Mae Pool ' AS8193 ' 2.5% 1/10/2031	84,170	0.00
USD 680,119	Fannie Mae Pool ' AS8204 ' 3.5% 1/10/2046	707,761	0.01
USD 101,282	Fannie Mae Pool ' AS8208 ' 2.5% 1/10/2031	102,767	0.00
USD 3,664,215	Fannie Mae Pool ' AS8231 ' 2.5% 1/8/2031	3,716,870	0.04
USD 59,144	Fannie Mae Pool ' AS8240 ' 2.5% 1/11/2031	60,010	0.00
USD 55,351	Fannie Mae Pool ' AS8241 ' 2.5% 1/11/2031	56,153	0.00
USD 3,436	Fannie Mae Pool ' AS8245 ' 2.5% 1/11/2031	3,487	0.00
USD 6,999,968	Fannie Mae Pool ' AS8246 ' 2.5% 1/11/2031	7,100,559	0.08
USD 13,075,453	Fannie Mae Pool ' AS8375 ' 4% 1/11/2046	13,982,433	0.15
USD 5,753,759	Fannie Mae Pool ' AS8376 ' 4% 1/11/2046	6,128,371	0.07
USD 8,206,085	Fannie Mae Pool ' AS8377 ' 4% 1/11/2046	8,740,353	0.09
USD 800,000	Fannie Mae Pool ' AS8391 ' 2.5% 1/11/2031	811,496	0.01
USD 10,500,003	Fannie Mae Pool ' AS8449 ' 2.5% 1/12/2031	10,650,889	0.12
USD 3,473,369	Fannie Mae Pool ' AS8497 ' 3.5% 1/12/2046	3,609,372	0.04
USD 1,000,001	Fannie Mae Pool ' AS8712 ' 2.5% 1/2/2032	1,014,371	0.01
USD 705,635	Fannie Mae Pool ' AS9495 ' 2.5% 1/4/2032	715,477	0.01
USD 6,515	Fannie Mae Pool ' AS9498 ' 2.5% 1/4/2032	6,606	0.00
USD 8,127,905	Fannie Mae Pool ' AS9626 ' 3% 1/5/2027	8,409,853	0.09
USD 11,582,622	Fannie Mae Pool ' AS9920 ' 4% 1/7/2047	12,344,141	0.13
USD 2,168,365	Fannie Mae Pool ' AT3247 ' 3% 1/6/2028	2,245,238	0.02
USD 2,491,149	Fannie Mae Pool ' AV0022 ' 4% 1/11/2043	2,633,570	0.03
USD 1,073,870	Fannie Mae Pool ' AZ0814 ' 3.5% 1/7/2045	1,115,681	0.01
USD 119,178	Fannie Mae Pool ' AZ0881 ' 2.5% 1/7/2030	121,178	0.00
USD 30,975	Fannie Mae Pool ' AZ2170 ' 2.5% 1/7/2030	31,496	0.00
USD 30,635	Fannie Mae Pool ' AZ6345 ' 2.5% 1/7/2030	31,057	0.00
USD 47,635	Fannie Mae Pool ' AZ9594 ' 2.5% 1/12/2030	48,303	0.00
USD 23,384	Fannie Mae Pool ' BA6848 ' 2.5% 1/2/2031	23,720	0.00
USD 2,305,632	Fannie Mae Pool ' BC0170 ' 4% 1/1/2046	2,455,300	0.03
USD 20,882	Fannie Mae Pool ' BC0259 ' 2.5% 1/2/2031	21,182	0.00
USD 73,497	Fannie Mae Pool ' BC0864 ' 2.5% 1/4/2031	74,553	0.00
USD 2,704,774	Fannie Mae Pool ' BC0878 ' 4% 1/5/2046	2,870,474	0.03
USD 17,096,785	Fannie Mae Pool ' BC0896 ' 3.5% 1/5/2046	17,821,224	0.19
USD 2,879,042	Fannie Mae Pool ' BC0908 ' 4% 1/5/2046	3,062,574	0.03
USD 2,127	Fannie Mae Pool ' BC0926 ' 2.5% 1/5/2031	2,158	0.00
USD 5,000,932	Fannie Mae Pool ' BC1222 ' 4% 1/7/2046	5,364,846	0.06
USD 54,984	Fannie Mae Pool ' BC1224 ' 2.5% 1/12/2030	55,735	0.00
USD 24,673,604	Fannie Mae Pool ' BC1444 ' 3.5% 1/7/2046	25,720,293	0.28
USD 2,084,467	Fannie Mae Pool ' BC1468 ' 3% 1/7/2031	2,156,864	0.02
USD 150,979	Fannie Mae Pool ' BC2857 ' 2.5% 1/9/2031	153,148	0.00
USD 68,915	Fannie Mae Pool ' BC4777 ' 2.5% 1/10/2031	69,867	0.00
USD 4,762,938	Fannie Mae Pool ' BC4778 ' 2.5% 1/10/2031	4,831,382	0.05
USD 173,823	Fannie Mae Pool ' BC6358 ' 2.5% 1/4/2031	176,218	0.00
USD 917,687	Fannie Mae Pool ' BC7141 ' 2.5% 1/7/2031	930,341	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 582,345	Fannie Mae Pool ' BC7155 ' 3.5% 1/7/2046	606,013	0.01
USD 605,768	Fannie Mae Pool ' BC8411 ' 2.5% 1/6/2031	614,140	0.01
USD 21,668,564	Fannie Mae Pool ' BC9091 ' 3.5% 1/12/2046	22,587,779	0.24
USD 482,371	Fannie Mae Pool ' BC9684 ' 2.5% 1/6/2031	489,035	0.01
USD 49,876	Fannie Mae Pool ' BC9691 ' 2.5% 1/7/2031	50,563	0.00
USD 721,444	Fannie Mae Pool ' BD1348 ' 2.5% 1/9/2031	732,187	0.01
USD 716,415	Fannie Mae Pool ' BD1946 ' 2.5% 1/6/2031	726,709	0.01
USD 916,613	Fannie Mae Pool ' BD1958 ' 3.5% 1/7/2046	953,866	0.01
USD 896,213	Fannie Mae Pool ' BD3401 ' 2.5% 1/8/2031	908,617	0.01
USD 13,003,254	Fannie Mae Pool ' BD3697 ' 3% 1/8/2031	13,427,654	0.15
USD 5,851,556	Fannie Mae Pool ' BD3715 ' 3.5% 1/8/2046	6,080,513	0.07
USD 259,288	Fannie Mae Pool ' BD4198 ' 3.5% 1/10/2046	270,826	0.00
USD 172,910	Fannie Mae Pool ' BD4245 ' 2.5% 1/11/2031	175,395	0.00
USD 292,627	Fannie Mae Pool ' BD5642 ' 2.5% 1/10/2031	296,832	0.00
USD 308,764	Fannie Mae Pool ' BD6043 ' 4% 1/8/2046	331,233	0.00
USD 3,342,799	Fannie Mae Pool ' BD6387 ' 3% 1/9/2031	3,452,134	0.04
USD 364,288	Fannie Mae Pool ' BD7602 ' 3.5% 1/10/2046	380,498	0.00
USD 1,504,943	Fannie Mae Pool ' BD7718 ' 3.5% 1/10/2046	1,568,787	0.02
USD 455,437	Fannie Mae Pool ' BD7994 ' 2.5% 1/9/2031	461,738	0.01
USD 49,999	Fannie Mae Pool ' BD8741 ' 2.5% 1/10/2031	50,717	0.00
USD 73,262	Fannie Mae Pool ' BD8756 ' 2.5% 1/12/2031	74,315	0.00
USD 983,303	Fannie Mae Pool ' BD8795 ' 3.5% 1/11/2046	1,021,505	0.01
USD 400,000	Fannie Mae Pool ' BD9715 ' 2.5% 1/10/2031	405,748	0.00
USD 386,073	Fannie Mae Pool ' BE0146 ' 2.5% 1/10/2031	391,405	0.00
USD 271,110	Fannie Mae Pool ' BE0198 ' 2.5% 1/12/2031	274,862	0.00
USD 6,146,526	Fannie Mae Pool ' BE0231 ' 2.5% 1/1/2032	6,231,283	0.07
USD 369,900	Fannie Mae Pool ' BE0467 ' 3.5% 1/8/2046	384,934	0.00
USD 500,000	Fannie Mae Pool ' BE0501 ' 2.5% 1/10/2031	507,185	0.01
USD 3,184,998	Fannie Mae Pool ' BE0505 ' 2.5% 1/10/2031	3,230,766	0.04
USD 4,929,540	Fannie Mae Pool ' BE0506 ' 2.5% 1/10/2031	5,000,378	0.05
USD 147,307	Fannie Mae Pool ' BE1029 ' 3.5% 1/11/2046	153,862	0.00
USD 309,030	Fannie Mae Pool ' BE1088 ' 2.5% 1/10/2031	313,471	0.00
USD 456,730	Fannie Mae Pool ' BE2555 ' 2.5% 1/11/2031	463,293	0.01
USD 6,647,273	Fannie Mae Pool ' BE2981 ' 3% 1/2/2032	6,868,832	0.07
USD 479,465	Fannie Mae Pool ' BE2993 ' 3.5% 1/12/2046	498,092	0.01
USD 715,476	Fannie Mae Pool ' BE3091 ' 3.5% 1/12/2046	743,491	0.01
USD 3,475,311	Fannie Mae Pool ' BE3193 ' 4% 1/2/2047	3,717,146	0.04
USD 24,102,228	Fannie Mae Pool ' BE3696 ' 4% 1/6/2047	25,686,869	0.28
USD 86,063	Fannie Mae Pool ' BE3715 ' 2.5% 1/6/2032	87,258	0.00
USD 4,647,463	Fannie Mae Pool ' BE5013 ' 4% 1/2/2045	4,970,583	0.05
USD 5,510,895	Fannie Mae Pool ' BE5046 ' 3.5% 1/11/2046	5,754,052	0.06
USD 6,664,847	Fannie Mae Pool ' BE5588 ' 4% 1/1/2047	7,126,256	0.08
USD 916,146	Fannie Mae Pool ' BE7255 ' 2.5% 1/2/2032	928,783	0.01
USD 25,846	Fannie Mae Pool ' BE8308 ' 2.5% 1/2/2032	26,217	0.00
USD 3,227,387	Fannie Mae Pool ' BE8818 ' 4% 1/7/2047	3,454,486	0.04

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 35,030	Fannie Mae Pool ' BH8076 ' 2.5% 1/8/2032	35,533	0.00
USD 583,210	Fannie Mae Pool ' BM1422 ' 2.5% 1/3/2032	591,590	0.01
USD 522,658	Fannie Mae Pool ' MA2510 ' 2.5% 1/1/2031	530,168	0.01
USD 907,995	Fannie Mae Pool ' MA2675 ' 2.5% 1/7/2031	921,043	0.01
USD 10,832,266	Fannie Mae Pool ' MA2775 ' 2.5% 1/10/2031	10,987,927	0.12
USD 11,383,026	Fannie Mae Pool ' MA2803 ' 2.5% 1/11/2031	11,546,601	0.12
USD 9,690,972	Fannie Mae Pool ' MA2830 ' 2.5% 1/12/2031	9,830,232	0.11
USD 48,961	Fannie Mae Pool ' MA2868 ' 2.5% 1/1/2032	49,665	0.00
USD 1,729,170	Fannie Mae Pool ' MA3010 ' 3% 1/5/2027	1,789,101	0.02
USD 5,480,705	Fannie Mae Pool ' MA3030 ' 3% 1/6/2027	5,664,185	0.06
USD 14,163,871	Fannie Mae Pool ' MA3061 ' 3% 1/7/2027	14,656,087	0.16
USD 3,865,000	Fannie Mae Pool ' MA3103 ' 3% 1/8/2027	3,994,615	0.04
USD 472,460	Fannie Mae Pool ' MA3114 ' 2.5% 1/8/2032	479,249	0.01
USD 78,446,000	Fannie Mae Pool ' MA3124 ' 2.5% 1/9/2032	79,573,277	0.86
USD 2,668,000	Fannie Mae-Aces ' 2017-M7 A2 ' FRN 25/2/2027	2,732,248	0.03
USD 8,980,000	Fannie Mae-Aces ' 2017-M8 A2 ' FRN 25/5/2027	9,244,057	0.10
USD 10,883,465	Fannie Mae-Aces ' 2016-M4 X2 ' FRN 25/1/2039	1,284,194	0.01
USD 3,869,000	FedEx Corp 3.9% 1/2/2035	3,927,600	0.04
USD 7,532,000	FedEx Corp 4.4% 15/1/2047	7,764,129	0.08
USD 395,742	Finn Square CLO Ltd ' 2012-1A A1R ' ' 144A ' FRN 24/12/2023	396,044	0.00
USD 940,000	Finn Square CLO Ltd ' 2012-1A A2R ' ' 144A ' FRN 24/12/2023	942,361	0.01
USD 10,799,000	First Data Corp ' 144A ' 5% 15/1/2024	11,284,955	0.12
USD 640,000	First Data Corp ' 144A ' 5.375% 15/8/2023	668,800	0.01
USD 799,734	First Franklin Mortgage Loan Trust ' 2004-FFH3 M3 ' FRN 25/10/2034	697,557	0.01
USD 2,943,129	First Franklin Mortgage Loan Trust ' 2006-FFH1 M2 ' FRN 25/1/2036	1,664,508	0.02
USD 1,177,025	First Franklin Mortgage Loan Trust ' 2006-FF5 2A3 ' FRN 25/4/2036	1,121,301	0.01
USD 673,683	FirstKey Lending 2015-SFR1 Trust ' 2015-SFR1 A ' ' 144A ' 2.553% 9/3/2047	674,715	0.01
USD 1,400,000	Flatiron CLO 2015-1 Ltd '2015-1A AR ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	1,400,000	0.02
USD 1,918,441	Freddie Mac Gold Pool ' A94055 ' 4% 1/9/2040	2,033,831	0.02
USD 610,789	Freddie Mac Gold Pool ' A94585 ' 4% 1/10/2040	647,501	0.01
USD 3,959,622	Freddie Mac Gold Pool ' A95150 ' 4% 1/11/2040	4,203,873	0.05
USD 2,344,943	Freddie Mac Gold Pool ' C03805 ' 3.5% 1/4/2042	2,445,497	0.03
USD 281,126	Freddie Mac Gold Pool ' G06231 ' 4% 1/12/2040	298,080	0.00
USD 3,562,473	Freddie Mac Gold Pool ' G07996 ' 4% 1/1/2040	3,791,708	0.04
USD 4,306,763	Freddie Mac Gold Pool ' G14967 ' 3% 1/12/2028	4,451,774	0.05
USD 3,332,800	Freddie Mac Gold Pool ' G15426 ' 3% 1/5/2028	3,445,029	0.04
USD 12,109,312	Freddie Mac Gold Pool ' G15653 ' 3% 1/10/2028	12,519,662	0.14
USD 18,541,569	Freddie Mac Gold Pool ' G15655 ' 3% 1/10/2028	19,165,406	0.21
USD 2,875,876	Freddie Mac Gold Pool ' G16123 ' 3% 1/3/2032	2,978,155	0.03
USD 4,962,398	Freddie Mac Gold Pool ' G60138 ' 3.5% 1/8/2045	5,186,064	0.06
USD 4,969,075	Freddie Mac Gold Pool ' G60584 ' 3.5% 1/6/2046	5,171,970	0.06
USD 6,192,205	Freddie Mac Gold Pool ' G60608 ' 4% 1/5/2046	6,543,100	0.07

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 3,851,063	Freddie Mac Gold Pool ' G60659 ' 3.5% 1/8/2046	4,008,282	0.04
USD 3,612,423	Freddie Mac Gold Pool ' G60691 ' 4% 1/6/2046	3,848,183	0.04
USD 7,689,216	Freddie Mac Gold Pool ' G60817 ' 3.5% 1/1/2047	8,032,223	0.09
USD 10,965,655	Freddie Mac Gold Pool ' G60865 ' 3.5% 1/2/2047	11,474,138	0.12
USD 5,027,971	Freddie Mac Gold Pool ' G60884 ' 4% 1/2/2047	5,379,728	0.06
USD 5,489,033	Freddie Mac Gold Pool ' G61012 ' 4% 1/4/2044	5,818,874	0.06
USD 7,204,747	Freddie Mac Gold Pool ' G61075 ' 4% 1/7/2044	7,639,359	0.08
USD 16,597,021	Freddie Mac Gold Pool ' G67700 ' 3.5% 1/8/2046	17,303,823	0.19
USD 97,198,998	Freddie Mac Gold Pool ' G67702 ' 4% 1/1/2047	103,943,311	1.12
USD 1,153,193	Freddie Mac Gold Pool ' J34484 ' 3% 1/6/2031	1,193,185	0.01
USD 654,600	Freddie Mac Gold Pool ' Q04154 ' 3.5% 1/10/2041	682,660	0.01
USD 2,664,589	Freddie Mac Gold Pool ' Q04688 ' 4% 1/11/2041	2,839,883	0.03
USD 1,246,156	Freddie Mac Gold Pool ' Q05692 ' 4% 1/1/2042	1,321,489	0.01
USD 404,510	Freddie Mac Gold Pool ' Q07958 ' 4% 1/5/2042	429,713	0.00
USD 380,182	Freddie Mac Gold Pool ' Q09850 ' 4% 1/8/2042	403,148	0.00
USD 259,881	Freddie Mac Gold Pool ' Q10048 ' 4% 1/8/2042	275,948	0.00
USD 386,238	Freddie Mac Gold Pool ' Q29436 ' 4% 1/11/2044	408,126	0.00
USD 3,386,482	Freddie Mac Gold Pool ' Q30211 ' 4% 1/12/2044	3,578,384	0.04
USD 25,402	Freddie Mac Gold Pool ' Q32378 ' 4% 1/3/2045	26,841	0.00
USD 17,623	Freddie Mac Gold Pool ' Q35164 ' 4% 1/5/2045	18,622	0.00
USD 67,210	Freddie Mac Gold Pool ' Q36238 ' 4% 1/9/2045	71,019	0.00
USD 97,272	Freddie Mac Gold Pool ' Q36412 ' 4% 1/9/2045	102,784	0.00
USD 693,291	Freddie Mac Gold Pool ' Q36494 ' 4% 1/9/2045	732,578	0.01
USD 114,972	Freddie Mac Gold Pool ' Q36501 ' 4% 1/9/2045	121,488	0.00
USD 43,969	Freddie Mac Gold Pool ' Q37577 ' 4% 1/12/2045	46,460	0.00
USD 510,881	Freddie Mac Gold Pool ' Q37776 ' 4% 1/12/2045	539,831	0.01
USD 458,467	Freddie Mac Gold Pool ' Q37864 ' 4% 1/10/2045	484,447	0.01
USD 595,881	Freddie Mac Gold Pool ' Q38470 ' 4% 1/1/2046	629,648	0.01
USD 1,203,094	Freddie Mac Gold Pool ' Q38714 ' 4% 1/2/2046	1,271,270	0.01
USD 305,236	Freddie Mac Gold Pool ' Q38808 ' 4% 1/12/2045	322,557	0.00
USD 82,904	Freddie Mac Gold Pool ' Q39054 ' 4% 1/12/2045	87,602	0.00
USD 2,183,781	Freddie Mac Gold Pool ' Q39335 ' 4% 1/3/2046	2,307,530	0.03
USD 22,709	Freddie Mac Gold Pool ' Q39440 ' 4% 1/3/2046	23,995	0.00
USD 2,004,872	Freddie Mac Gold Pool ' Q39454 ' 4% 1/3/2046	2,118,708	0.02
USD 1,107,612	Freddie Mac Gold Pool ' Q39580 ' 4% 1/3/2046	1,170,378	0.01
USD 43,552	Freddie Mac Gold Pool ' Q39868 ' 4% 1/4/2046	46,020	0.00
USD 2,568,772	Freddie Mac Gold Pool ' Q39950 ' 4% 1/4/2046	2,714,337	0.03
USD 61,926	Freddie Mac Gold Pool ' Q40017 ' 4% 1/4/2046	65,435	0.00
USD 163,170	Freddie Mac Gold Pool ' Q40104 ' 4% 1/4/2046	172,416	0.00
USD 1,225,041	Freddie Mac Gold Pool ' Q40204 ' 4% 1/4/2046	1,294,460	0.01
USD 2,726,805	Freddie Mac Gold Pool ' Q40648 ' 4% 1/5/2046	2,895,884	0.03
USD 1,244,456	Freddie Mac Gold Pool ' Q40649 ' 4% 1/5/2046	1,314,976	0.01
USD 2,499,903	Freddie Mac Gold Pool ' Q41119 ' 4% 1/4/2046	2,641,566	0.03
USD 4,704,776	Freddie Mac Gold Pool ' Q41451 ' 4% 1/7/2046	4,971,383	0.05
USD 932,762	Freddie Mac Gold Pool ' Q41643 ' 4% 1/7/2046	985,619	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
（続き）

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国（続き）		
USD 1,924,641	Freddie Mac Gold Pool ' Q41777 ' 3.5% 1/5/2046	2,000,366	0.02
USD 3,534,604	Freddie Mac Gold Pool ' Q41935 ' 3.5% 1/7/2046	3,678,913	0.04
USD 900,732	Freddie Mac Gold Pool ' Q42001 ' 4% 1/7/2046	951,774	0.01
USD 1,207,278	Freddie Mac Gold Pool ' Q42441 ' 3.5% 1/6/2046	1,254,632	0.01
USD 1,201,685	Freddie Mac Gold Pool ' Q42453 ' 4% 1/6/2046	1,269,781	0.01
USD 50,226	Freddie Mac Gold Pool ' Q42533 ' 4% 1/8/2046	53,072	0.00
USD 3,909,656	Freddie Mac Gold Pool ' Q42584 ' 4% 1/8/2046	4,131,206	0.04
USD 25,826	Freddie Mac Gold Pool ' Q43030 ' 4% 1/9/2046	27,289	0.00
USD 978,521	Freddie Mac Gold Pool ' Q43079 ' 4% 1/6/2046	1,033,971	0.01
USD 5,923,676	Freddie Mac Gold Pool ' Q44455 ' 3.5% 1/11/2046	6,164,612	0.07
USD 153,729	Freddie Mac Gold Pool ' Q44713 ' 3.5% 1/12/2046	159,781	0.00
USD 14,362,673	Freddie Mac Gold Pool ' Q45054 ' 3.5% 1/12/2046	14,924,608	0.16
USD 2,161,119	Freddie Mac Gold Pool ' Q45071 ' 3.5% 1/12/2046	2,247,509	0.02
USD 812,715	Freddie Mac Gold Pool ' Q46811 ' 3.5% 1/2/2047	844,491	0.01
USD 3,722,113	Freddie Mac Gold Pool ' Q47409 ' 4% 1/4/2047	3,984,616	0.04
USD 132,555	Freddie Mac Gold Pool ' V61193 ' 3% 1/10/2027	137,009	0.00
USD 139,444	Freddie Mac Gold Pool ' V61194 ' 3% 1/6/2028	144,169	0.00
USD 153,748	Freddie Mac Gold Pool ' V61457 ' 3% 1/4/2028	158,939	0.00
USD 127,538	Freddie Mac Gold Pool ' V61458 ' 3% 1/8/2028	131,844	0.00
USD 233,370	Freddie Mac Gold Pool ' V81283 ' 4% 1/7/2044	246,597	0.00
USD 1,843,088	Freddie Mac Gold Pool ' V81990 ' 4% 1/10/2045	1,947,530	0.02
USD 601,035	Freddie Mac Gold Pool ' V81993 ' 4% 1/10/2045	635,094	0.01
USD 2,003,050	Freddie Mac Gold Pool ' V82514 ' 3.5% 1/7/2046	2,081,886	0.02
USD 13,137,256	Freddie Mac Gold Pool ' V82515 ' 3.5% 1/6/2046	13,654,299	0.15
USD 1,464,626	Freddie Mac Gold Pool ' V82721 ' 4% 1/9/2044	1,547,622	0.02
USD 9,769,683	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' K044 X1 ' FRN 25/1/2025	447,647	0.01
USD 20,965,503	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' K045 X1 ' FRN 25/1/2025	606,790	0.01
USD 8,020,895	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' K056 X1 ' FRN 25/5/2026	691,334	0.01
USD 3,280,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' K059 A2 ' FRN 25/9/2026	3,417,329	0.04
USD 670,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' K059 AM ' FRN 25/9/2026	696,728	0.01
USD 187,246	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' K062 A2 ' 3.413% 25/12/2026	199,582	0.00
USD 1,240,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' K063 A2 ' FRN 25/1/2027	1,322,379	0.01
USD 21,106,846	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' K064 X1 ' FRN 25/3/2027	1,050,790	0.01
USD 4,191,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' K065 A2 ' 3.243% 25/4/2027	4,406,857	0.05
USD 37,006,086	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' K065 X1 ' FRN 25/4/2027	2,071,046	0.02
USD 6,937,997	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' K718 X1 ' FRN 25/1/2022	163,778	0.00
USD 15,120,951	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' K721 X1 ' FRN 25/8/2022	214,680	0.00
USD 36,227,892	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' KC01 X1 ' FRN 25/12/2022	877,139	0.01
USD 20,868,547	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' KW01 X1 ' FRN 25/1/2026	1,308,203	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 399,577	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2015-DN1 B' FRN 25/1/2025	570,250	0.01
USD 418,426	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2015-HQ2 B' FRN 25/5/2025	484,195	0.01
USD 2,600,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2016-DNA4 M3' FRN 25/3/2029	2,840,715	0.03
USD 2,710,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2017-DNA1 M2' FRN 25/7/2029	2,784,384	0.03
USD 1,800,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2017-DNA2 B1' FRN 25/10/2029	1,877,570	0.02
USD 4,440,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2017-DNA2 M2' FRN 25/10/2029	4,689,706	0.05
USD 2,355,333	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2017-HQA2 M2' FRN 25/12/2029	2,332,772	0.03
USD 620,000	FREMF 2015-K48 Mortgage Trust '2015-K48 B' '144A' FRN 25/8/2048	632,249	0.01
USD 108,561,731	FREMF 2015-K718 Mortgage Trust '2015-K718 X2A' '144A' FRN 25/2/2022	388,097	0.00
USD 1,848,333	FREMF Mortgage Trust '2017-K64 B' '144A' FRN 25/3/2027	1,917,700	0.02
USD 254,726	GAHR Commercial Mortgage Trust '2015-NRF AFL1' '144A' FRN 15/12/2034	255,321	0.00
USD 5,458,000	GAHR Commercial Mortgage Trust '2015-NRF EFX' '144A' FRN 15/12/2034	5,497,489	0.06
USD 1,330,000	GAHR Commercial Mortgage Trust '2015-NRF FFX' '144A' FRN 15/12/2034	1,328,650	0.01
USD 6,942,000	GAHR Commercial Mortgage Trust '2015-NRF GFX' '144A' FRN 15/12/2034	6,876,495	0.07
USD 330,000	Galaxy XIV CLO Ltd '2012-14A DR' '144A' FRN 15/11/2026	332,480	0.00
USD 1,544,549	Galaxy XV CLO Ltd '2013-15A A' '144A' FRN 15/4/2025	1,546,208	0.02
EUR 380,000	Gates Global LLC / Gates Global Co 5.75% 15/7/2022	466,548	0.01
USD 1,707,000	GATX Corp 3.85% 30/3/2027	1,771,266	0.02
USD 6,607,621	GCAT 2017-4 LLC (Step-up coupon) '2017-4 A1' '144A' 3.228% 25/5/2022	6,658,333	0.07
USD 1,560,000	Geisinger Authority 5% 15/2/2045	1,788,665	0.02
USD 5,099,000	General Electric Co 4.5% 11/3/2044	5,682,553	0.06
USD 7,150,000	General Motors Co 5.15% 1/4/2038	7,220,917	0.08
USD 7,450,000	General Motors Financial Co Inc 3.15% 30/6/2022	7,479,398	0.08
USD 6,955,000	General Motors Financial Co Inc 4.35% 17/1/2027	7,148,304	0.08
USD 538,077	GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates Series '2005-2 A2C' FRN 25/12/2035	522,372	0.01
USD 4,213,428	GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates Series '2005-2 M1' FRN 25/12/2035	2,559,281	0.03
USD 323,254	GE-WMC Mortgage Securities Trust '2006-1 A2A' FRN 25/8/2036	205,436	0.00
USD 11,866,967	GE-WMC Mortgage Securities Trust '2006-1 A2B' FRN 25/8/2036	7,716,180	0.08
USD 1,253,750	GE-WMC Mortgage Securities Trust '2006-1 A2C' FRN 25/8/2036	830,295	0.01
USD 6,380,000	Gilead Sciences Inc 4% 1/9/2036	6,525,780	0.07
USD 6,035,000	Gilead Sciences Inc 4.15% 1/3/2047	6,169,028	0.07
USD 59,657,572	Ginnie Mae II Pool 'MA4512' 4.5% 20/6/2047	63,646,823	0.69
USD 9,056,636	Ginnie Mae II Pool 'MA4588' 4.5% 20/7/2047	9,661,758	0.10
USD 2,136,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4.375% 1/11/2018	2,184,060	0.02
USD 194,828	GMACM Home Equity Loan Trust '2006-HE4 A2' FRN 25/12/2036	189,957	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,660,000	Golden State Tobacco Securitization Corp 5.125% 1/6/2047	3,644,610	0.04
USD 660,000	Golden State Tobacco Securitization Corp 5.75% 1/6/2047	660,700	0.01
USD 703,000	GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd ' 2014-9A D ' ' 144A ' FRN 29/10/2026	706,681	0.01
USD 250,000	Goldentree Loan Opportunities VIII Ltd ' 2014-8A B1R ' ' 144A ' FRN 19/4/2026	250,493	0.00
USD 250,000	Goldentree Loan Opportunities VIII Ltd ' 2014-8A DR ' ' 144A ' FRN 19/4/2026	250,745	0.00
USD 750,000	Goldentree Loan Opportunities XI Ltd ' 2015-11A D ' ' 144A ' FRN 18/4/2027	752,211	0.01
USD 1,500,000	Goldentree Loan Opportunities XI Ltd ' 2015-11A E ' ' 144A ' FRN 18/4/2027	1,504,076	0.02
USD 11,500,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.5% 16/11/2026	11,559,737	0.12
USD 26,500,000	Goldman Sachs Group Inc/The 4.25% 21/10/2025	27,766,382	0.30
USD 3,273,297	Government National Mortgage Association ' 2013-145 SI ' FRN 16/4/2040	297,952	0.00
USD 3,840,782	Government National Mortgage Association ' 2012-23 IO ' FRN 16/6/2053	120,540	0.00
USD 2,391,467	Government National Mortgage Association ' 2013-191 IO ' FRN 16/11/2053	91,195	0.00
USD 7,716,591	Government National Mortgage Association ' 2016-125 IO ' FRN 16/12/2057	602,863	0.01
USD 8,383,132	Government National Mortgage Association ' 2016-119 IO ' FRN 16/4/2058	675,011	0.01
USD 5,276,113	Government National Mortgage Association ' 2016-110 IO ' FRN 16/5/2058	425,970	0.00
USD 5,654,683	Government National Mortgage Association ' 2016-158 IO ' FRN 16/6/2058	440,330	0.00
USD 15,251,806	Government National Mortgage Association ' 2016-152 IO ' FRN 15/8/2058	1,232,326	0.01
USD 8,215,877	Government National Mortgage Association ' 2016-87 IO ' FRN 16/8/2058	620,434	0.01
USD 20,597,142	Government National Mortgage Association ' 2017-111 IO ' FRN 16/2/2059	1,607,916	0.02
USD 7,122,652	Government National Mortgage Association ' 2017-100 IO ' FRN 16/5/2059	519,419	0.01
USD 4,889,714	Government National Mortgage Association ' 2017-86 IO ' FRN 16/5/2059	354,724	0.00
USD 4,554,956	Government National Mortgage Association ' 2017-69 IO ' FRN 16/7/2059	338,244	0.00
USD 6,147,071	Government National Mortgage Association ' 2014-112 IO ' 1.072% 16/1/2048	350,955	0.00
USD 2,530,000	GP Portfolio Trust ' 2014-GPP E ' ' 144A ' FRN 15/2/2027	2,478,044	0.03
USD 7,520,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust ' 2014-GRCE F ' ' 144A ' FRN 10/6/2028	7,646,226	0.08
USD 730,000	Grant County Public Utility District No 2 4.584% 1/1/2040	771,143	0.01
USD 500,000	Great Lakes Water Authority Water Supply System Revenue 5.25% 1/7/2033	601,652	0.01
USD 2,325,000	Great Wolf Trust ' 2015-WFMZ M ' ' 144A ' FRN 15/5/2032	2,334,358	0.03
USD 2,135,000	Great Wolf Trust ' 2015-WOLF D ' ' 144A ' FRN 15/5/2034	2,143,945	0.02
USD 760,000	Great Wolf Trust ' 2015-WOLF F ' ' 144A ' FRN 15/5/2034	764,003	0.01
USD 1,020,000	Greenpoint Manufactured Housing ' 1999-5 M1B ' FRN 15/12/2029	1,107,174	0.01
USD 1,329,336	Greenpoint Manufactured Housing ' 1999-5 M2 ' FRN 15/12/2029	1,145,251	0.01
USD 2,037,284	GreenPoint Mortgage Funding Trust ' 2006-AR2 4A1 ' FRN 25/3/2036	1,885,289	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 820,000	Greystone Commercial Real Estate Notes 2017-FL1 Ltd ‘ 2017-FL1A A ’ ‘ 144A ’ FRN 15/3/2027	820,770	0.01
USD 630,000	Greywolf CLO IV Ltd ‘ 2014-2A BR ’ ‘ 144A ’ FRN 17/1/2027	632,419	0.01
USD 160,000	GS Mortgage Securities Corp II ‘ 2005-ROCK H ’ ‘ 144A ’ 5.713% 3/5/2032	186,531	0.00
USD 1,820,000	GS Mortgage Securities Corp Trust ‘ 2016-RENT C ’ ‘ 144A ’ FRN 10/2/2029	1,896,747	0.02
USD 1,450,000	GS Mortgage Securities Corp Trust ‘ 2017-500K D ’ ‘ 144A ’ FRN 15/7/2032	1,448,887	0.02
USD 2,000,000	GS Mortgage Securities Corp Trust ‘ 2017-500K E ’ ‘ 144A ’ FRN 15/7/2032	1,998,478	0.02
USD 1,370,000	GS Mortgage Securities Corp Trust ‘ 2017-500K F ’ ‘ 144A ’ FRN 15/7/2032	1,368,971	0.01
USD 880,000	GS Mortgage Securities Corp Trust ‘ 2017-500K G ’ ‘ 144A ’ FRN 15/7/2032	880,458	0.01
USD 110,000	GS Mortgage Securities Trust ‘ 2014-GC20 B ’ FRN 10/4/2047	114,303	0.00
USD 1,485,736	GS Mortgage Securities Trust ‘ 2014-GC20 XA ’ FRN 10/4/2047	76,526	0.00
USD 930,000	GS Mortgage Securities Trust ‘ 2014-GC22 D ’ ‘ 144A ’ FRN 10/6/2047	811,993	0.01
USD 4,011,600	GS Mortgage Securities Trust ‘ 2016-GS3 XA ’ FRN 10/10/2049	342,096	0.00
USD 1,129,000	GS Mortgage Securities Trust ‘ 2017-GS7 D ’ ‘ 144A ’ 3% 10/8/2050	981,653	0.01
USD 780,000	GS Mortgage Securities Trust ‘ 2017-GS7 E ’ ‘ 144A ’ 3% 10/8/2050	636,749	0.01
USD 280,000	GS Mortgage Securities Trust ‘ 2015-GC32 D ’ 3.345% 10/7/2048	236,875	0.00
USD 820,000	GS Mortgage Securities Trust ‘ 2017-GS7 A4 ’ 3.43% 10/8/2050	849,540	0.01
USD 526,890	GSAA Home Equity Trust ‘ 2007-2 AF3 ’ FRN 25/3/2037	230,614	0.00
USD 2,840,000	GSAA Home Equity Trust ‘ 2007-4 A3B ’ FRN 25/3/2037	428,587	0.00
USD 1,379,384	GSAMP Trust ‘ 2007-H1 A1B ’ FRN 25/1/2047	931,195	0.01
USD 1,544,150	GSMPs Mortgage Loan Trust ‘ 2005-RP1 1AF ’ ‘ 144A ’ FRN 25/1/2035	1,398,978	0.02
USD 1,885,421	GSMPs Mortgage Loan Trust ‘ 2005-RP2 1AF ’ ‘ 144A ’ FRN 25/3/2035	1,735,973	0.02
USD 1,435,183	GSMPs Mortgage Loan Trust ‘ 2006-RP1 1AF1 ’ ‘ 144A ’ FRN 25/1/2036	1,249,485	0.01
USD 1,490,000	GT Loan Financing I Ltd ‘ 2013-1A A ’ ‘ 144A ’ FRN 28/10/2024	1,490,778	0.02
USD 1,930,000	Halcon Resources Corp ‘ 144A ’ 12% 15/2/2022	2,325,650	0.03
USD 7,835,000	Halliburton Co 3.8% 15/11/2025	8,096,188	0.09
USD 2,171,000	HCA Inc 5% 15/3/2024	2,309,401	0.03
USD 2,140,000	HCA Inc 5.25% 15/6/2026	2,297,825	0.03
USD 5,348,000	HCA Inc 5.875% 15/2/2026	5,775,840	0.06
USD 944,000	HD Supply Inc ‘ 144A ’ 5.25% 15/12/2021	994,740	0.01
USD 3,620,000	HD Supply Inc ‘ 144A ’ 5.75% 15/4/2024	3,891,500	0.04
USD 2,290,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 3.652% 15/8/2057	2,320,228	0.03
USD 785,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 5% 15/11/2029	932,753	0.01
USD 900,000	Hertz Corp/The ‘ 144A ’ 7.625% 1/6/2022	906,750	0.01
USD 290,000	Highbridge Loan Management 2013-2 Ltd ‘ 2013-2A D ’ ‘ 144A ’ FRN 20/10/2024	291,017	0.00
USD 785,000	Highbridge Loan Management 4-2014 Ltd ‘ 4A-2014 B ’ ‘ 144A ’ FRN 28/7/2025	788,633	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 920,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd ' 5A-2015 C1R ' ' 144A ' FRN 29/1/2026	924,498	0.01
USD 250,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd ' 5A-2015 C2R ' ' 144A ' FRN 29/1/2026	250,000	0.00
USD 1,030,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd ' 5A-2015 D1R ' ' 144A ' FRN 29/1/2026	1,030,000	0.01
USD 250,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd ' 5A-2015 D2R ' ' 144A ' FRN 29/1/2026	250,000	0.00
USD 500,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd ' 5A-2015 E ' ' 144A ' FRN 29/1/2026	497,397	0.01
USD 670,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd ' 5X-2015 E ' FRN 29/1/2026	666,512	0.01
USD 360,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd ' 6A-2015 A ' ' 144A ' FRN 5/5/2027	360,804	0.00
USD 430,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd ' 6A-2015 D ' ' 144A ' FRN 5/5/2027	431,905	0.00
USD 380,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd ' 6A-2015 E1 ' ' 144A ' FRN 5/5/2027	379,039	0.00
USD 330,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd ' 7A-2015 C ' ' 144A ' FRN 15/11/2026	332,987	0.00
USD 340,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd ' 7A-2015 D ' ' 144A ' FRN 15/11/2026	342,047	0.00
USD 500,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd ' 7A-2015 E ' ' 144A ' FRN 15/11/2026	500,884	0.01
USD 440,000	Highbridge Loan Management 8-2016 Ltd ' 8A-2016 D ' ' 144A ' FRN 20/4/2027	449,570	0.01
USD 250,000	Highbridge Loan Management 8-2016 Ltd ' 8A-2016 E ' ' 144A ' FRN 20/4/2027	253,168	0.00
USD 1,980,000	Home Equity Asset Trust '2007-1 2A3' FRN 25/5/2037	1,639,915	0.02
USD 11,091,824	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS ' 2006-E 2A3 ' FRN 25/4/2037	7,971,064	0.09
USD 687,486	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series SPMD ' 2004-A M2 ' FRN 25/7/2034	694,700	0.01
USD 3,581,795	Home Equity Mortgage Trust (Step-up coupon) ' 2006-2 1A1 ' 5.867% 25/7/2036	1,458,655	0.02
USD 1,642,734	Home Loan Mortgage Loan Trust ' 2005-1 A3 ' FRN 15/4/2036	1,519,024	0.02
USD 1,338,000	HPS Loan Management 10-2016 Ltd ' 10A-16 C ' ' 144A ' FRN 20/1/2028	1,338,037	0.01
USD 1,000,000	HPS Loan Management 10-2016 Ltd ' 10A-16 D ' ' 144A ' FRN 20/1/2028	983,483	0.01
USD 520,000	HPS Loan Management 9-2016 Ltd ' 9A-2016 D2 ' ' 144A ' FRN 19/7/2027	524,853	0.01
USD 890,000	Huntington Ingalls Industries Inc ' 144A ' 5% 15/12/2021	923,108	0.01
EUR 200,000	Huntsman International LLC 5.125% 15/4/2021	270,455	0.00
USD 1,595,000	Huntsman International LLC 5.125% 15/11/2022	1,690,700	0.02
USD 1,177,000	Hyundai Auto Receivables Trust ' 2013-B CERT ' 16/9/2019 (Zero Coupon)	1,230,365	0.01
USD 7,154,000	Hyundai Capital America ' 144A ' 3.1% 5/4/2022	7,201,395	0.08
USD 5,417,290	Impac CMB Trust Series '2005-7 A1' FRN 25/11/2035	4,695,707	0.05
USD 1,210,000	IMT Trust ' 2017-APTS AFX ' ' 144A ' FRN 15/6/2034	1,260,911	0.01
USD 2,798,000	IMT Trust ' 2017-APTS BFX ' ' 144A ' FRN 15/6/2034	2,865,418	0.03
USD 5,890,000	IMT Trust ' 2017-APTS DFX ' ' 144A ' FRN 15/6/2034	5,820,999	0.06
USD 3,300,000	Incitec Pivot Finance LLC 3.95% 3/8/2027	3,347,801	0.04
USD 7,426,078	IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust ' 2007-HO01 AXPP ' 25/7/2047 (Zero Coupon)	356,905	0.00
USD 1,919,467	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust ' 2007-FLX2 A1A ' FRN 25/4/2037	1,845,607	0.02
USD 2,850,000	Intel Corp 4.1% 11/5/2047	3,001,382	0.03

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 8,130,000	International Paper Co 4.35% 15/8/2048	8,214,621	0.09
USD 1,106,938	Invitation Homes 2014-SFR2 Trust '2014-SFR2 A' '144A' FRN 17/9/2031	1,111,274	0.01
USD 1,350,000	Invitation Homes 2014-SFR2 Trust '2014-SFR2 C' '144A' FRN 17/9/2031	1,351,836	0.01
USD 1,400,000	Invitation Homes 2014-SFR2 Trust '2014-SFR2 E' '144A' FRN 17/9/2031	1,404,075	0.02
USD 184,516	Invitation Homes 2014-SFR3 Trust '2014-SFR3 D' '144A' FRN 17/12/2031	184,862	0.00
USD 684,000	Invitation Homes 2015-SFR1 Trust '2015-SFR1 E' '144A' FRN 17/3/2032	701,454	0.01
USD 1,295,000	Invitation Homes 2015-SFR3 Trust '2015-SFR3 E' '144A' FRN 17/8/2032	1,321,900	0.01
USD 1,490,000	IPALCO Enterprises Inc '144A' 3.7% 1/9/2024	1,502,747	0.02
USD 2,170,000	Iron Mountain Inc '144A' 6% 1/10/2020	2,251,375	0.02
USD 638,000	Iron Mountain Inc 6% 15/8/2023	678,672	0.01
USD 1,135,000	Iron Mountain US Holdings Inc '144A' 5.375% 1/6/2026	1,197,425	0.01
USD 766,289	Irwin Home Equity Loan Trust '2006-P1 1A' '144A' FRN 25/12/2036	693,652	0.01
USD 1,850,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2016-WPT A' '144A' FRN 15/10/2033	1,859,550	0.02
USD 3,710,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2016-NINE A' '144A' FRN 6/10/2038	3,707,367	0.04
USD 12,241,000	Jamestown CLO III Ltd '2013-3A A1AR' '144A' FRN 15/1/2026	12,250,868	0.13
USD 4,044,000	Johnson & Johnson 3.625% 3/3/2037	4,206,223	0.05
USD 544,267	JP Morgan Alternative Loan Trust '2007-A2 2A1' FRN 25/5/2037	535,767	0.01
USD 1,770,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp '2017-MAUI D' '144A' FRN 15/7/2034	1,770,125	0.02
USD 10,000,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp '2017-MAUI E' '144A' FRN 15/7/2034	10,000,749	0.11
USD 2,900,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp '2017-MAUI F' '144A' FRN 15/7/2034	2,900,226	0.03
USD 1,770,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-DSTY D' '144A' FRN 10/6/2027	1,693,547	0.02
USD 1,170,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-PHH B' '144A' FRN 15/8/2027	1,171,052	0.01
USD 970,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-CBM E' '144A' FRN 15/10/2029	973,140	0.01
USD 1,595,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL4 C' '144A' FRN 15/12/2030	1,607,349	0.02
USD 606,448	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 A' '144A' FRN 15/11/2031	608,639	0.01
USD 992,334	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 BAT1' '144A' FRN 15/11/2031	993,820	0.01
USD 151,607	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 BAT2' '144A' FRN 15/11/2031	151,836	0.00
USD 2,170,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 DFW1' '144A' FRN 15/11/2031	2,191,820	0.02
USD 1,160,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 DFW2' '144A' FRN 15/11/2031	1,171,581	0.01
USD 520,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 VINE' '144A' FRN 15/11/2031	522,807	0.01
USD 4,957,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-UES E' '144A' FRN 5/9/2032	5,000,051	0.05
USD 131,148	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2002-CIB4 C' '144A' FRN 12/5/2034	132,072	0.00
USD 821,209	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-SGP A' '144A' FRN 15/7/2036	825,586	0.01
USD 950,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2003-PM1A G' '144A' FRN 12/8/2040	1,020,023	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,230,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-JP1 D' FRN 15/1/2049	2,106,962	0.02
USD 10,620,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2016-JP3 XC' '144A' FRN 15/8/2049	470,625	0.01
USD 2,986,444	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2016-JP4 XA' FRN 15/12/2049	141,602	0.00
USD 1,818,237	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2008-C2 A4FL' FRN 12/2/2051	1,766,767	0.02
USD 920,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-DSTY A' '144A' 3.429% 10/6/2027	935,727	0.01
USD 1,550,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2016-ATRM D' '144A' 5.355% 5/10/2028	1,569,642	0.02
USD 1,202,479	JP Morgan Madison Avenue Securities Trust Series '2014-CH1 M2' '144A' FRN 25/11/2024	1,311,544	0.01
USD 960,000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust '2006-CW1 M1' FRN 25/5/2036	811,009	0.01
USD 993,100	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust (Step-up coupon) '2006-WF1 A3A' 5.83% 25/7/2036	563,638	0.01
USD 751,141	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust (Step-up coupon) '2006-WF1 A6' 6% 25/7/2036	426,210	0.00
USD 2,923,979	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust (Step-up coupon) '2006-WF1 A5' 6.41% 25/7/2036	1,658,149	0.02
USD 7,615,685	JP Morgan Mortgage Trust '2017-2 A6' '144A' FRN 25/5/2047	7,757,070	0.08
USD 22,590,000	JP Morgan Mortgage Trust '2017-3 1A6' '144A' FRN 25/8/2047	22,741,777	0.25
USD 1,227,542	JP Morgan Resecuritization Trust Series '2015-3 1A7' '144A' FRN 26/6/2037	1,180,477	0.01
USD 950,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C22 D' '144A' FRN 15/9/2047	825,444	0.01
USD 2,661,406	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C22 XA' FRN 15/9/2047	130,582	0.00
USD 3,419,800	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C23 XA' FRN 15/9/2047	111,823	0.00
USD 2,262,053	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C26 XA' FRN 15/1/2048	116,381	0.00
USD 7,006,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2015-C27 XD' '144A' FRN 15/2/2048	218,902	0.00
USD 2,576,665	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2015-C29 XA' FRN 15/5/2048	96,965	0.00
USD 1,480,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2015-C33 D1' '144A' FRN 15/12/2048	1,446,160	0.02
USD 12,801	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2015-C33 XA' FRN 15/12/2048	813	0.00
USD 450,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C22 A4' 3.801% 15/9/2047	480,024	0.01
USD 1,340,000	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust '2017-JP5 D' '144A' FRN 15/3/2050	1,348,891	0.01
USD 2,410,000	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust '2017-JP7 B' 4.05% 15/9/2050	2,510,172	0.03
USD 4,150,000	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust '2016-C4 XC' '144A' FRN 15/12/2049	185,941	0.00
USD 15,600,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/10/2024 (Perpetual)	17,062,500	0.18
USD 12,785,000	JPMorgan Chase & Co FRN 24/7/2038	12,881,380	0.14
USD 10,510,000	JPMorgan Chase & Co 4.125% 15/12/2026	11,005,504	0.12
USD 12,819,000	JPMorgan Chase & Co 4.25% 1/10/2027	13,584,846	0.15
USD 8,627	JPMorgan Commercial Mortgage-Backed Securities Trust '2009-RR1 A4B' '144A' FRN 18/3/2051	8,616	0.00
USD 4,810,000	Kaiser Aluminum Corp 5.875% 15/5/2024	5,134,675	0.06
USD 3,009,000	Kaiser Foundation Hospitals 4.15% 1/5/2047	3,232,217	0.04
USD 690,000	Kentucky Economic Development Finance Authority 5.25% 1/6/2050	754,080	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
（続き）

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国（続き）		
USD 4,406,000	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC '144A' 5% 1/6/2024	4,602,948	0.05
USD 522,000	KLA-Tencor Corp 4.65% 1/11/2024	571,131	0.01
GBP 300,000	Kraft Heinz Foods Co 4.125% 1/7/2027	435,111	0.00
USD 1,808,000	LafargeHolcim Finance US LLC '144A' 3.5% 22/9/2026	1,828,340	0.02
USD 1,673,000	LafargeHolcim Finance US LLC '144A' 4.75% 22/9/2046	1,783,308	0.02
USD 331,000	Lam Research Corp 2.8% 15/6/2021	337,337	0.00
USD 1,242	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2005-C7 D' FRN 15/11/2040	1,243	0.00
USD 488,659	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2007-C6 AMFL' '144A' 6.114% 15/7/2040	489,201	0.01
USD 4,030,000	LCCM 2014-909 Mortgage Trust '2014-909 E' '144A' FRN 15/5/2031	3,978,988	0.04
USD 660,000	LCM XIV LP '144A' FRN 15/7/2025	660,338	0.01
USD 670,000	LCM XVI LP '144A' FRN 15/7/2026	670,626	0.01
USD 440,000	LCM XVII LP '144A' FRN 15/10/2026	442,720	0.00
USD 830,000	LCM XVIII LP '144A' FRN 20/4/2027	833,837	0.01
USD 580,000	LCM XVIII LP '18A D' '144A' FRN 20/4/2027	584,285	0.01
USD 570,000	LCM XVIII LP '18A E' '144A' FRN 20/4/2027	566,830	0.01
USD 480,000	LCM XVIII LP '144A' 20/4/2027 (Zero Coupon)	309,245	0.00
USD 400,000	LCM Xxiv Ltd '144A' FRN 20/3/2030	401,887	0.00
USD 468,072	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust '2002-A C' 15/6/2033 (Zero Coupon)	347,251	0.00
USD 5,630,000	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust '2001-B M1' FRN 15/4/2040	6,056,666	0.07
USD 469,506	Lehman ABS Mortgage Loan Trust '2007-1 2A1' '144A' FRN 25/6/2037	304,777	0.00
USD 530,000	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust '2006-2A M2' '144A' FRN 25/9/2036	474,445	0.01
USD 1,763,066	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust '2007-1A 1A' '144A' FRN 25/3/2037	1,638,321	0.02
USD 1,409,925	Lehman XS Trust Series '2007-20N A1' FRN 25/12/2037	1,390,246	0.02
USD 13,520,000	Lendmark Funding Trust '2017-1A A' '144A' 2.83% 22/12/2025	13,581,175	0.15
USD 1,400,000	Lennar Corp 4.125% 1/12/2018	1,429,750	0.02
USD 8,953,000	Lennar Corp 4.75% 15/11/2022	9,448,549	0.10
USD 1,030,000	Lennar Corp 4.875% 15/12/2023	1,091,594	0.01
EUR 225,000	Levi Strauss & Co 3.375% 15/3/2027	275,934	0.00
USD 5,727,694	LFRF '2015-1' '144A' 4% 30/10/2027	5,699,056	0.06
USD 720,000	Lime Street CLO Ltd '2007-1A B' '144A' FRN 20/6/2021	718,079	0.01
USD 2,165,000	Limerock CLO III LLC '2014-3A C' '144A' FRN 20/10/2026	2,172,435	0.02
USD 795,818	Lone Star Portfolio Trust '2015-LSP A1A2' '144A' FRN 15/9/2028	798,397	0.01
USD 4,556,209	Lone Star Portfolio Trust '2015-LSP E' '144A' FRN 15/9/2028	4,635,692	0.05
USD 4,553,888	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-1 1A' FRN 25/2/2036	4,258,875	0.05
USD 1,591,531	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-5 2A3' FRN 25/6/2036	905,405	0.01
USD 1,847,781	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-9 2A4' FRN 25/10/2036	956,394	0.01
USD 415,143	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-10 2A2' FRN 25/11/2036	210,968	0.00
USD 4,269,793	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-10 2A3' FRN 25/11/2036	2,188,272	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,518,926	Long Beach Mortgage Loan Trust ' 2006-10 2A4 ' FRN 25/11/2036	786,196	0.01
USD 18,760,313	Long Beach Mortgage Loan Trust ' 2006-2 2A3 ' FRN 25/3/2046	9,819,996	0.11
USD 7,979,374	Long Beach Mortgage Loan Trust ' 2006-2 2A4 ' FRN 25/3/2046	4,272,227	0.05
USD 5,867,540	Long Beach Mortgage Loan Trust ' 2006-3 2A3 ' FRN 25/5/2046	2,812,424	0.03
USD 2,400,000	Los Angeles Community College District/CA 6.6% 1/8/2042	3,513,312	0.04
USD 5,000,000	Los Angeles Department of Water 5% 1/7/2043	5,705,925	0.06
USD 1,285,000	Los Angeles Department of Water & Power Power System Revenue 6.603% 1/7/2050	1,963,210	0.02
USD 2,996,443	LSTAR Commercial Mortgage Trust ' 2017-5 X ' ' 144A ' FRN 10/3/2050	166,048	0.00
USD 8,296,979	LSTAR Securities Investment Ltd ' 2016-3 A ' ' 144A ' FRN 1/9/2021	8,355,500	0.09
USD 5,330,224	LSTAR Securities Investment Ltd ' 2016-5 A1 ' ' 144A ' FRN 1/11/2021	5,344,712	0.06
USD 8,655,871	LSTAR Securities Investment Ltd ' 2017-2 A1 ' ' 144A ' FRN 1/2/2022	8,678,896	0.09
USD 4,200,000	MAD Mortgage Trust ' 2017-330M D ' ' 144A ' FRN 15/8/2034	4,296,101	0.05
USD 6,600,000	MAD Mortgage Trust ' 2017-330M E ' ' 144A ' FRN 15/8/2034	6,453,249	0.07
USD 1,430,000	Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust ' 2002- A B2 ' FRN 25/3/2032	1,478,477	0.02
USD 1,240,000	Madison Avenue Trust ' 2013-650M E ' ' 144A ' FRN 12/10/2032	1,238,685	0.01
USD 920,000	Madison Park Funding V Ltd ' 2007-5X D ' FRN 26/2/2021	922,658	0.01
USD 919,000	Madison Park Funding XI Ltd ' 2013-11A A1B ' ' 144A ' FRN 23/10/2025	919,139	0.01
USD 2,229,000	Madison Park Funding XI Ltd ' 2013-11A D ' ' 144A ' FRN 23/10/2025	2,229,687	0.02
USD 2,066,000	Madison Park Funding XIII Ltd ' 2014-13A CR ' ' 144A ' FRN 19/1/2025	2,073,725	0.02
USD 2,990,000	Madison Park Funding XIII Ltd ' 2014-13A E ' ' 144A ' FRN 19/1/2025	3,004,658	0.03
USD 4,301,000	Madison Park Funding XIV Ltd ' 2014-14A A2R ' ' 144A ' FRN 20/7/2026	4,306,495	0.05
USD 854,000	Madison Park Funding XIV Ltd ' 2014-14A DR ' ' 144A ' FRN 20/7/2026	857,019	0.01
USD 500,000	Madison Park Funding XIV Ltd ' 2014-14A E ' ' 144A ' FRN 20/7/2026	499,491	0.01
USD 250,000	Madison Park Funding XIX Ltd ' 2015-19A D ' ' 144A ' FRN 22/1/2028	252,321	0.00
USD 340,000	Madison Park Funding XV Ltd ' 2014-15A CR ' ' 144A ' FRN 27/1/2026	341,715	0.00
USD 300,000	Madison Park Funding XVI Ltd ' 2015-16A C ' ' 144A ' FRN 20/4/2026	302,835	0.00
USD 1,220,000	Madison Park Funding XVI Ltd ' 2015-16A D ' ' 144A ' FRN 20/4/2026	1,223,354	0.01
USD 510,000	Madison Park Funding XX Ltd ' 2016-20A E ' ' 144A ' FRN 27/4/2027	516,426	0.01
USD 260,000	Marsh & McLennan Cos Inc 4.35% 30/1/2047	282,447	0.00
USD 835,000	Maryland Health & Higher Educational Facilities Authority 5.25% 1/7/2027	972,483	0.01
USD 795,000	Massachusetts Clean Water Trust/ The 5% 1/2/2027	989,107	0.01
USD 1,140,000	Massachusetts Clean Water Trust/ The 5% 1/2/2028	1,402,382	0.02
USD 1,040,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2047	1,184,565	0.01
USD 500,000	Massachusetts Educational Financing Authority 5% 1/1/2022	565,345	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,752,000	Massachusetts Mutual Life Insurance Co ' 144A ' 4.9% 1/4/2077	5,295,218	0.06
USD 5,288,357	Mastr Asset Backed Securities Trust ' 2006-HE2 A3 ' FRN 25/6/2036	2,968,730	0.03
USD 1,401,845	Mastr Asset Backed Securities Trust ' 2007-HE1 A4 ' FRN 25/5/2037	1,010,670	0.01
USD 872,287	MASTR Resecuritization Trust '2008-3 A1 ' ' 144A ' FRN 25/8/2037	608,595	0.01
USD 668,720	Mastr Specialized Loan Trust '2006-3 A ' ' 144A ' FRN 25/6/2046	630,737	0.01
USD 6,210,000	McDonald's Corp 4.7% 9/12/2035	6,916,701	0.07
USD 100,000	Meccanica Holdings USA Inc ' 144A ' 6.25% 15/1/2040	113,000	0.00
USD 380,000	Meccanica Holdings USA Inc ' 144A ' 7.375% 15/7/2039	463,600	0.01
USD 6,180,000	Medtronic Inc 4.375% 15/3/2035	6,814,797	0.07
USD 4,134,000	Meritor Inc 6.25% 15/2/2024	4,371,705	0.05
USD 3,602,000	Meritor Inc 6.75% 15/6/2021	3,720,866	0.04
USD 1,446,987	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series ' 2007-2 A2C ' FRN 25/5/2037	942,816	0.01
USD 968,283	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series ' 2006-RM3 A2B ' FRN 25/6/2037	300,483	0.00
USD 1,070,000	Merrill Lynch Mortgage Trust ' 2005-MKB2 F ' ' 144A ' FRN 12/9/2042	1,158,797	0.01
USD 670,000	Merrill Lynch Mortgage Trust ' 2008-C1 AJ ' FRN 12/2/2051	673,608	0.01
USD 1,400,000	Metropolitan Government Nashville & Davidson County Health & Educational Facs Bd 5% 1/7/2046	1,573,978	0.02
USD 1,818,000	Metropolitan Life Global Funding I ' 144A ' 2.65% 8/4/2022	1,847,425	0.02
USD 1,400,000	Metropolitan Transportation Authority 5% 15/11/2042	1,645,553	0.02
USD 1,720,000	Metropolitan Transportation Authority 5.25% 15/11/2057	2,038,604	0.02
USD 1,360,000	Metropolitan Transportation Authority 6.687% 15/11/2040	1,868,150	0.02
USD 500,000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 1/10/2039 (Zero Coupon)	216,423	0.00
USD 1,000,000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 5% 1/10/2053	1,069,825	0.01
USD 1,280,000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 7.462% 1/10/2046	1,890,278	0.02
USD 2,162,000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.625% 1/5/2024	2,356,580	0.03
USD 4,330,000	MGM Resorts International 6% 15/3/2023	4,798,181	0.05
USD 3,566,000	MHGE Parent LLC / MHGE Parent Finance Inc ' 144A ' 8.5% 1/8/2019*	3,588,287	0.04
USD 1,680,000	Miami-Dade County Educational Facilities Authority 5.073% 1/4/2050	1,884,691	0.02
USD 880,000	Michigan Finance Authority 5% 1/6/2039	998,109	0.01
USD 700,000	Michigan Finance Authority 5% 15/11/2041	786,590	0.01
USD 6,170,000	Microsoft Corp 3.45% 8/8/2036	6,169,661	0.07
USD 4,330,000	Microsoft Corp 4.1% 6/2/2037	4,734,054	0.05
USD 4,194,000	Microsoft Corp 4.5% 6/2/2057	4,670,348	0.05
USD 500,000	Mill Creek II CLO Ltd ' 2016-1A C ' ' 144A ' FRN 20/4/2028	506,089	0.01
USD 500,000	Mill Creek II CLO Ltd ' 2016-1A E ' ' 144A ' FRN 20/4/2028	503,493	0.01
USD 1,330,000	Mississippi Hospital Equipment & Facilities Authority 5% 1/9/2046	1,468,679	0.02
USD 1,070,000	Monsanto Co 3.95% 15/4/2045	1,023,078	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,385,000	Moody ' s Corp ' 144A ' 3.25% 15/1/2028	3,412,501	0.04
USD 4,966,000	Morgan Stanley FRN 14/2/2020	4,991,699	0.05
USD 5,855,000	Morgan Stanley FRN 22/7/2038	5,928,433	0.06
USD 2,416,000	Morgan Stanley 3.125% 27/7/2026	2,388,092	0.03
USD 10,270,000	Morgan Stanley 3.875% 27/1/2026	10,699,527	0.12
USD 8,850,000	Morgan Stanley 3.95% 23/4/2027	9,065,073	0.10
USD 20,590,000	Morgan Stanley 4.35% 8/9/2026	21,658,868	0.23
USD 4,010,000	Morgan Stanley 4.375% 22/1/2047	4,231,962	0.05
USD 3,656,540	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust ' 2005-HE5 M4 ' FRN 25/9/2035	1,758,874	0.02
USD 12,376,403	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust ' 2007-NC1 A1 ' FRN 25/11/2036	7,964,030	0.09
USD 11,026,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2014-C19 XD ' ' 144A ' FRN 15/12/2047	823,724	0.01
USD 3,830,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2014-C19 XF ' ' 144A ' FRN 15/12/2047	302,819	0.00
USD 3,341,950	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C20 XA ' FRN 15/2/2048	241,942	0.00
USD 3,510,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C21 XB ' ' 144A ' FRN 15/3/2048	79,891	0.00
USD 25,844,231	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C22 XA ' FRN 15/4/2048	1,581,270	0.02
USD 990,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C25 C ' FRN 15/10/2048	1,040,789	0.01
USD 10,820,003	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C26 XA ' FRN 15/10/2048	721,672	0.01
USD 5,350,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C26 XD ' ' 144A ' FRN 15/10/2048	505,816	0.01
USD 3,485,031	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2016-C28 XA ' FRN 15/1/2049	276,199	0.00
USD 6,530,395	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2016-C29 XA ' FRN 15/5/2049	664,600	0.01
USD 8,700,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2016-C29 XB ' FRN 15/5/2049	645,855	0.01
USD 2,222,654	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2016-C31 XA ' FRN 15/11/2049	209,230	0.00
USD 660,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2017-C33 C ' FRN 15/5/2050	691,248	0.01
USD 480,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C23 D ' ' 144A ' FRN 15/7/2050	420,689	0.00
USD 2,600,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C26 D ' ' 144A ' 3.06% 15/10/2048	2,146,779	0.02
USD 166,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C25 D ' 3.068% 15/10/2048	137,420	0.00
USD 700,000	Morgan Stanley Capital I Trust ' 2015-XLF2 AFSB ' ' 144A ' FRN 15/8/2026	701,313	0.01
USD 2,513,000	Morgan Stanley Capital I Trust ' 2014-CPT F ' ' 144A ' FRN 13/7/2029	2,504,637	0.03
USD 1,750,000	Morgan Stanley Capital I Trust ' 2014-CPT G ' ' 144A ' FRN 13/7/2029	1,730,840	0.02
USD 1,400,000	Morgan Stanley Capital I Trust ' 2014-150E F ' ' 144A ' FRN 9/9/2032	1,415,628	0.02
USD 560,000	Morgan Stanley Capital I Trust ' 2017-PRME D ' ' 144A ' FRN 15/2/2034	560,652	0.01
USD 360,000	Morgan Stanley Capital I Trust ' 2015-MS1 C ' FRN 15/5/2048	361,012	0.00
USD 250,000	Morgan Stanley Capital I Trust ' 2015-MS1 D ' ' 144A ' FRN 15/5/2048	218,730	0.00
USD 510,000	Morgan Stanley Capital I Trust ' 2017-H1 C ' FRN 15/6/2050	520,377	0.01
USD 2,640,000	Morgan Stanley Capital I Trust ' 2017-H1 XD ' ' 144A ' FRN 15/6/2050	423,073	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,180,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2017-H1 D' '144A' 2.546% 15/6/2050	1,730,626	0.02
USD 466,652	Morgan Stanley Capital I Trust '2005-IQ9 AJ' 4.77% 15/7/2056	466,457	0.01
USD 1,109,139	Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust '2006-2 A2' ' FRN 25/11/2036	585,159	0.01
USD 1,409,203	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust '2007-9SL A' FRN 25/7/2037	1,273,422	0.01
USD 2,169,584	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2006- 15XS A2B' 5.507% 25/11/2036	1,140,096	0.01
USD 5,835	Morgan Stanley Re-REMIC Trust '2012-XA A' '144A' 2% 27/7/2049	5,848	0.00
USD 1,190,211	Morgan Stanley Resecuritization Trust '2014-R8 3B1' ' 144A' FRN 26/6/2047	1,116,040	0.01
USD 9,195,462	Mortgage Loan Resecuritization Trust '2009-RS1 A85' ' 144A' FRN 16/4/2036	7,881,390	0.09
USD 1,630,000	Mountain Hawk I CLO Ltd '2013-1A B1' '144A' FRN 20/1/2024	1,644,952	0.02
USD 1,674,000	Mountain Hawk II CLO Ltd '2013-2A A1' '144A' FRN 22/7/2024	1,676,140	0.02
USD 1,454,994	MP CLO III Ltd '2013-1A A' '144A' FRN 20/4/2025	1,455,889	0.02
USD 400,000	MP CLO VII Ltd '2015-1A A1' '144A' FRN 18/4/2027	400,074	0.00
USD 1,000,000	MP CLO VII Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 18/4/2027	997,139	0.01
USD 172,000	MSBAM Commercial Mortgage Securities Trust '2012-CKSV D' '144A' FRN 15/10/2030	164,234	0.00
USD 1,330,000	Municipal Electric Authority of Georgia 5% 1/1/2020	1,440,909	0.02
USD 3,344,000	Murphy Oil Corp 5.75% 15/8/2025	3,369,080	0.04
USD 370,000	Nationstar Home Equity Loan Trust '2007-C 2AV3' FRN 25/6/2037	357,210	0.00
USD 4,895,000	Navient Private Education Loan Trust '2014-CTA B' '144A' ' FRN 17/10/2044	4,978,517	0.05
USD 2,150,000	Navient Private Education Loan Trust '2016-AA B' '144A' FRN 16/12/2058	1,986,766	0.02
USD 1,760,000	Navient Private Education Loan Trust '2015-CA B' '144A' ' 3.25% 15/5/2040	1,782,581	0.02
USD 3,020,000	Navient Private Education Loan Trust '2014-AA B' '144A' ' 3.5% 15/8/2044	2,993,639	0.03
USD 2,278,000	Navient Private Education Loan Trust '2015-AA B' '144A' ' 3.5% 15/12/2044	2,218,689	0.02
USD 1,119,000	NCR Corp 5% 15/7/2022	1,145,576	0.01
USD 400,000	Neuberger Berman CLO XV '2013-15A D' '144A' FRN 15/10/2025	401,371	0.00
USD 1,300,000	Neuberger Berman CLO XVI Ltd '2014-16A B2R' '144A' FRN 15/4/2026	1,302,627	0.01
USD 250,000	Neuberger Berman CLO XVI Ltd '2014-16A D' '144A' FRN 15/4/2026	250,804	0.00
USD 599,000	Neuberger Berman CLO XVII Ltd '2014-17A DR' '144A' FRN 22/4/2029	601,828	0.01
USD 640,000	Neuberger Berman CLO XVIII Ltd '2014-18A CR' '144A' FRN 14/11/2027	647,664	0.01
USD 250,000	Neuberger Berman CLO XVIII Ltd '2014-18A DR' '144A' FRN 14/11/2027	254,875	0.00
USD 250,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd '2015-20A D' '144A' FRN 15/1/2028	252,003	0.00
USD 910,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd '2015-20A E' '144A' FRN 15/1/2028	914,628	0.01
USD 580,000	Neuberger Berman CLO XXI Ltd '2016-21A E' '144A' FRN 20/4/2027	579,972	0.01
USD 390,000	Neuberger Berman CLO XXIII Ltd '2016-23A E' '144A' FRN 17/10/2027	391,178	0.00
USD 780,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5% 15/6/2029	867,103	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,159,000	New York and Presbyterian Hospital/The 3.563% 1/8/2036	1,156,239	0.01
USD 770,000	New York City Transitional Finance Authority Building Aid Revenue 5% 15/7/2040	893,473	0.01
USD 1,050,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 2.28% 1/5/2026	1,000,451	0.01
USD 3,695,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.05% 1/5/2027	3,719,793	0.04
USD 400,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5% 1/8/2031	482,580	0.01
USD 860,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5% 1/2/2035	1,012,078	0.01
USD 820,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5% 1/5/2036	966,760	0.01
USD 5,965,000	New York City Water & Sewer System 5% 15/6/2047	6,998,496	0.08
USD 1,570,000	New York City Water & Sewer System 5.75% 15/6/2041	2,109,342	0.02
USD 780,000	New York Convention Center Development Corp 5% 15/11/2040	903,607	0.01
USD 1,950,000	New York Convention Center Development Corp 5% 15/11/2046	2,259,572	0.02
USD 740,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2027	923,735	0.01
USD 740,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2028	912,801	0.01
USD 2,140,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2029	2,640,000	0.03
USD 650,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2031	783,559	0.01
USD 1,225,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2032	1,472,144	0.02
USD 4,505,000	New York State Urban Development Corp 2.86% 15/3/2024	4,564,646	0.05
USD 70,000	New York State Urban Development Corp 5% 15/3/2027	86,637	0.00
USD 170,000	New York State Urban Development Corp 5% 15/3/2028	207,862	0.00
USD 1,800,000	New York Transportation Development Corp 5% 1/8/2020	1,943,190	0.02
USD 620,000	New York Transportation Development Corp 5% 1/7/2046	683,094	0.01
USD 2,500,000	New York Transportation Development Corp 5.25% 1/1/2050	2,780,988	0.03
USD 4,615,000	Newfield Exploration Co 5.375% 1/1/2026*	4,828,444	0.05
USD 7,940,000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 3.55% 1/5/2027	8,239,664	0.09
USD 6,570,000	NGPL PipeCo LLC ' 144A ' 7.768% 15/12/2037	8,198,046	0.09
USD 2,325,000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co ' 144A ' 5% 15/4/2022	2,406,375	0.03
USD 4,430,000	NiSource Finance Corp 3.49% 15/5/2027	4,539,795	0.05
USD 462,993	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series ' 2006-S5 A1 ' ' 144A ' FRN 25/10/2036	417,726	0.00
USD 573,660	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series (Step-up coupon) '2006-AF1 1A4' 6.634% 25/5/2036	262,439	0.00
USD 75,418	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	80,603	0.00
USD 1,820,000	Northwest Independent School District 5% 15/2/2042	2,113,284	0.02
USD 7,528,000	NVIDIA Corp 3.2% 16/9/2026	7,554,649	0.08
USD 350,000	Oak Hill Credit Partners X Ltd ' 2014-10A CR ' ' 144A ' FRN 20/7/2026	351,598	0.00
USD 250,000	Oak Hill Credit Partners X Ltd ' 2014-10A DR ' ' 144A ' FRN 20/7/2026	250,806	0.00
USD 430,000	Oak Hill Credit Partners XII Ltd ' 2015-12A D1 ' ' 144A ' FRN 23/1/2027	435,004	0.00
USD 450,000	Oaktree EIF II Series B1 Ltd ' 2015-B1A B ' ' 144A ' FRN 15/2/2026	451,287	0.01
USD 650,000	Oaktree EIF II Series B1 Ltd ' 2015-B1A C ' ' 144A ' FRN 15/2/2026	653,199	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 855,218	Oakwood Mortgage Investors Inc ' 2001-D A2 ' FRN 15/1/2019	693,800	0.01
USD 711,181	Oakwood Mortgage Investors Inc ' 2001-D A4 ' FRN 15/9/2031	649,319	0.01
USD 1,580,000	Ochsner Clinic Foundation 5.897% 15/5/2045	2,016,595	0.02
USD 440,000	OCP CLO 2012-2 Ltd ' 2012-2A DR ' ' 144A ' FRN 22/11/2025	444,166	0.00
USD 390,000	OCP CLO 2014-5 Ltd ' 2014-5A A1 ' ' 144A ' FRN 26/4/2026	390,520	0.00
USD 300,000	OCP CLO 2014-5 Ltd ' 2014-5A A2 ' ' 144A ' FRN 26/4/2026	300,497	0.00
USD 1,540,000	OCP CLO 2014-7 Ltd ' 2014-7A A1A ' ' 144A ' FRN 20/10/2026	1,544,944	0.02
USD 2,110,000	OCP CLO 2015-8 Ltd ' 2015-8A A1 ' ' 144A ' FRN 17/4/2027	2,111,395	0.02
USD 440,000	OCP CLO 2016-12 Ltd ' 2016-12A C ' ' 144A ' FRN 18/10/2028	447,828	0.01
USD 5,210,000	OCP CLO 2017-13 Ltd ' 2017-13A A1A ' ' 144A ' FRN 15/7/2030	5,208,915	0.06
USD 920,000	OCP CLO 2017-13 Ltd ' 2017-13A D ' ' 144A ' FRN 15/7/2030	915,782	0.01
USD 940,000	Octagon Investment Partners 24 Ltd ' 2015-1A D ' ' 144A ' FRN 21/5/2027	940,594	0.01
USD 430,000	Octagon Investment Partners 26 Ltd ' 2016-1A C ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	435,798	0.00
USD 600,000	Octagon Investment Partners 26 Ltd ' 2016-1A D ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	611,217	0.01
USD 1,500,000	Octagon Investment Partners 26 Ltd ' 2016-1A E ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	1,523,596	0.02
USD 1,500,000	Octagon Investment Partners 27 Ltd ' 2016-1A E ' ' 144A ' FRN 15/7/2027	1,517,037	0.02
USD 448,000	OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 31 LLC ' 2017-1A F ' ' 144A ' FRN 20/7/2030	428,826	0.00
USD 1,325,000	Octagon Investment Partners XVII Ltd ' 2013-1A A1R ' ' 144A ' FRN 25/10/2025	1,328,127	0.01
USD 3,010,000	Octagon Investment Partners XVII Ltd ' 2013-1A A2R ' ' 144A ' FRN 25/10/2025	3,013,220	0.03
USD 450,000	Octagon Investment Partners XVIII Ltd ' 2013-1A CR ' ' 144A ' FRN 16/12/2024	452,461	0.01
USD 1,775,000	Octagon Investment Partners XXI Ltd ' 2014-1A C ' ' 144A ' FRN 14/11/2026	1,790,757	0.02
USD 3,100,000	Octagon Investment Partners XXI Ltd ' 2014-1A D ' ' 144A ' FRN 14/11/2026	3,115,624	0.03
USD 460,000	Octagon Investment Partners XXII Ltd ' 2014-1A D1R ' ' 144A ' FRN 25/11/2025	462,207	0.01
USD 5,169,000	OFSI Fund VI Ltd ' 2014-6A A2 ' ' 144A ' FRN 20/3/2025	5,180,992	0.06
USD 641,000	OHA Credit Partners IX Ltd ' 2013-9A A1R ' ' 144A ' FRN 20/10/2025	641,338	0.01
USD 4,519,236	OHA Credit Partners VIII Ltd ' 2013-8A A ' ' 144A ' FRN 20/4/2025	4,523,883	0.05
USD 280,000	OHA Credit Partners XI Ltd ' 2015-11A E ' ' 144A ' FRN 20/10/2028	281,555	0.00
USD 1,360,000	OHA Loan Funding 2013-2 Ltd ' 2013-2A A ' ' 144A ' FRN 23/8/2024	1,360,757	0.01
USD 1,802,000	OHA Loan Funding 2014-1 LLC ' 2014-1A A1R ' ' 144A ' FRN 20/10/2026	1,807,050	0.02
USD 2,000,000	OHA Loan Funding 2014-1 LLC ' 2014-1A E ' ' 144A ' 7.75% 20/10/2026	2,022,351	0.02
USD 4,570,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust ' 2017-OT E ' ' 144A ' FRN 10/5/2039	4,468,233	0.05
USD 29,500,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust ' 2017-OT XA ' ' 144A ' FRN 10/5/2039	1,043,858	0.01
USD 43,880,000	One Market Plaza Trust ' 2017-1MKT XCP ' ' 144A ' FRN 10/2/2032	263,719	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 322,451	OneMain Financial Issuance Trust ' 2014-1A A ' ' 144A ' 2.43% 18/6/2024	322,499	0.00
USD 1,056,859	OneMain Financial Issuance Trust ' 2014-2A A ' ' 144A ' 2.47% 18/9/2024	1,059,704	0.01
USD 6,604,602	OneMain Financial Issuance Trust ' 2015-2A A ' ' 144A ' 2.57% 18/7/2025	6,619,567	0.07
USD 4,205,000	OneMain Financial Issuance Trust ' 2014-2A B ' ' 144A ' 3.02% 18/9/2024	4,223,267	0.05
USD 16,601,000	OneMain Financial Issuance Trust ' 2015-2A B ' ' 144A ' 3.1% 18/7/2025	16,647,068	0.18
USD 5,425,000	OneMain Financial Issuance Trust ' 2015-1A A ' ' 144A ' 3.19% 18/3/2026	5,494,967	0.06
USD 10,298,000	OneMain Financial Issuance Trust ' 2014-1A B ' ' 144A ' 3.24% 18/6/2024	10,308,637	0.11
USD 1,985,000	OneMain Financial Issuance Trust ' 2016-1A A ' ' 144A ' 3.66% 20/2/2029	2,032,583	0.02
USD 1,588,000	OneMain Financial Issuance Trust ' 2016-2A A ' ' 144A ' 4.1% 20/3/2028	1,622,187	0.02
USD 8,170,000	OneMain Financial Issuance Trust ' 2015-2A C ' ' 144A ' 4.32% 18/7/2025	8,190,283	0.09
USD 2,815,000	OneMain Financial Issuance Trust ' 2014-2A C ' ' 144A ' 4.33% 18/9/2024	2,838,396	0.03
USD 810,000	OneMain Financial Issuance Trust ' 2016-1A B ' ' 144A ' 4.57% 20/2/2029	840,397	0.01
USD 2,733,000	OneMain Financial Issuance Trust ' 2015-1A C ' ' 144A ' 5.12% 18/3/2026	2,802,842	0.03
USD 11,050,000	OneMain Financial Issuance Trust ' 2014-2A D ' ' 144A ' 5.31% 18/9/2024	11,175,950	0.12
USD 2,630,000	OneMain Financial Issuance Trust ' 2015-2A D ' ' 144A ' 5.64% 18/7/2025	2,645,845	0.03
USD 1,950,000	Option One Mortgage Loan Trust ' 2007-CP1 2A3 ' FRN 25/3/2037	1,360,097	0.01
USD 12,215,871	Option One Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2007-FXD2 1A1' 5.82% 25/3/2037	12,043,764	0.13
USD 4,130,000	Oracle Corp 3.9% 15/5/2035	4,319,177	0.05
USD 4,730,000	Oracle Corp 4% 15/7/2046	4,867,714	0.05
USD 3,255,000	Orange County Local Transportation Authority 6.908% 15/2/2041	4,679,095	0.05
USD 3,695,000	Oregon School Boards Association 4.759% 30/6/2028	4,126,502	0.04
USD 704,056	Origen Manufactured Housing Contract Trust ' 2001-A M1 ' FRN 15/3/2032	696,417	0.01
USD 2,710,000	Owens Corning 4.3% 15/7/2047	2,631,821	0.03
USD 1,590,000	Ownit Mortgage Loan Trust Series (Step-up coupon) ' 2006-2 A2C ' 6% 25/1/2037	1,491,493	0.02
USD 1,010,000	Oxnard School District 5% 1/8/2045	1,168,838	0.01
USD 6,944,000	OZLM Funding II Ltd ' 2012-2A A1R ' ' 144A ' FRN 30/10/2027	6,968,064	0.08
USD 940,000	OZLM Funding II Ltd ' 2012-2A DR ' ' 144A ' FRN 30/10/2027	956,130	0.01
USD 2,060,000	OZLM Funding III Ltd ' 2013-3A BR ' ' 144A ' FRN 22/1/2029	2,094,024	0.02
USD 1,330,000	OZLM Funding IV Ltd ' 2013-4A A1 ' ' 144A ' FRN 22/7/2025	1,330,194	0.01
USD 320,000	OZLM Funding IV Ltd ' 2013-4A C ' ' 144A ' FRN 22/7/2025	320,055	0.00
USD 500,000	OZLM Funding IV Ltd ' 2013-4A D ' ' 144A ' FRN 22/7/2025	500,067	0.01
USD 1,430,000	OZLM Funding V Ltd ' 2013-5A BR ' ' 144A ' FRN 17/1/2026	1,434,635	0.02
USD 280,000	OZLM Funding V Ltd ' 2013-5A CR ' ' 144A ' FRN 17/1/2026	281,892	0.00
USD 500,000	OZLM Funding V Ltd ' 2013-5A D ' ' 144A ' FRN 17/1/2026	502,919	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 720,000	OZLM IX Ltd ' 2014-9A BR ' ' 144A ' FRN 20/1/2027	723,168	0.01
USD 2,380,000	OZLM IX Ltd ' 2014-9A CR ' ' 144A ' FRN 20/1/2027	2,391,989	0.03
USD 1,400,000	OZLM VI Ltd ' 2014-6A BR ' ' 144A ' FRN 17/4/2026	1,405,241	0.02
USD 390,000	OZLM VII Ltd ' 2014-7A B1R ' ' 144A ' FRN 17/7/2026	391,532	0.00
USD 560,000	OZLM VII Ltd ' 2014-7A CR ' ' 144A ' FRN 17/7/2026	564,680	0.01
USD 5,345,000	OZLM VIII Ltd ' 2014-8A A1AR ' ' 144A ' FRN 17/10/2026	5,352,667	0.06
USD 1,250,000	OZLM VIII Ltd ' 2014-8A BR ' ' 144A ' FRN 17/10/2026	1,255,020	0.01
USD 1,315,000	OZLM VIII Ltd ' 2014-8A CR ' ' 144A ' FRN 17/10/2026	1,320,376	0.01
USD 531,000	OZLM XI Ltd ' 2015-11A BR ' ' 144A ' FRN 30/10/2030	531,000	0.01
USD 874,000	OZLM XI Ltd ' 2015-11A CR ' ' 144A ' FRN 30/10/2030	874,000	0.01
USD 620,000	OZLM XII Ltd ' 2015-12A A1 ' ' 144A ' FRN 30/4/2027	624,689	0.01
USD 620,000	OZLM XII Ltd ' 2015-12A A2 ' ' 144A ' FRN 30/4/2027	621,781	0.01
USD 290,000	OZLM XII Ltd ' 2015-12A B ' ' 144A ' FRN 30/4/2027	293,469	0.00
USD 875,000	OZLM XII Ltd ' 2015-12A C ' ' 144A ' FRN 30/4/2027	883,727	0.01
USD 970,000	OZLM XII Ltd ' 2015-12A D ' ' 144A ' FRN 30/4/2027	943,711	0.01
USD 335,000	OZLM XIII Ltd ' 2015-13A C ' ' 144A ' FRN 30/7/2027	340,969	0.00
USD 470,000	OZLM XIV Ltd ' 2015-14A C ' ' 144A ' FRN 15/1/2029	475,437	0.01
USD 660,000	OZLM XIV Ltd ' 2015-14A D ' ' 144A ' FRN 15/1/2029	664,911	0.01
USD 2,120,000	OZLM XV Ltd ' 2016-15A A1 ' ' 144A ' FRN 20/1/2029	2,145,673	0.02
USD 830,000	OZLM XV Ltd ' 2016-15A A2A ' ' 144A ' FRN 20/1/2029	835,073	0.01
USD 440,000	OZLM XV Ltd ' 2016-15A C ' ' 144A ' FRN 20/1/2029	446,366	0.01
USD 440,000	OZLM XV Ltd ' 2016-15A D ' ' 144A ' FRN 20/1/2029	444,882	0.01
USD 2,292,000	Palmer Square CLO 2013-1 Ltd ' 2013-1A A2R ' ' 144A ' FRN 15/5/2025	2,293,643	0.02
USD 250,000	Palmer Square CLO 2013-2 Ltd ' 2013-2A A1AR ' ' 144A ' FRN 17/10/2027	251,477	0.00
USD 640,000	Palmer Square CLO 2013-2 Ltd ' 2013-2A CR ' ' 144A ' FRN 17/10/2027	645,759	0.01
USD 530,000	Palmer Square CLO 2014-1 Ltd ' 2014-1A CR ' ' 144A ' FRN 17/1/2027	535,492	0.01
USD 440,000	Palmer Square CLO 2014-1 Ltd ' 2014-1A DR ' ' 144A ' FRN 17/1/2027	444,369	0.00
USD 630,000	Palmer Square CLO 2015-2 Ltd ' 2015-2A DR ' ' 144A ' FRN 20/7/2030	618,836	0.01
USD 1,280,000	Palmer Square Loan Funding 2017-1 Ltd ' 2017-1A A2 ' ' 144A ' FRN 15/10/2025	1,280,000	0.01
USD 110,429	Paragon Mortgages No 13 Plc FRN 15/1/2039	105,624	0.00
USD 3,250,000	Parallel 2015-1 Ltd ' 2015-1A D ' ' 144A ' FRN 20/7/2027	3,271,141	0.04
USD 670,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd ' 2016-1A D ' ' 144A ' FRN 23/8/2028	675,959	0.01
USD 2,578,000	Parker-Hannifin Corp ' 144A ' 3.25% 1/3/2027	2,635,123	0.03
USD 1,506,000	Parker-Hannifin Corp ' 144A ' 4.1% 1/3/2047	1,573,917	0.02
USD 8,838,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp ' 144A ' 5.375% 15/1/2025	8,904,285	0.10
USD 2,150,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp ' 144A ' 6.25% 1/6/2024	2,246,750	0.02
USD 5,010,000	PDC Energy Inc 7.75% 15/10/2022	5,216,663	0.06
USD 1,000,000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2022	1,162,245	0.01
USD 400,000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2038	450,670	0.01
USD 5,880,000	Pfizer Inc 4% 15/12/2036	6,349,956	0.07

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 360,000	Pinnacle Park CLO Ltd ' 2014-1A D ' ' 144A ' FRN 15/4/2026	362,054	0.00
USD 3,182,000	Pioneer Energy Services Corp 6.125% 15/3/2022	2,545,600	0.03
USD 4,002,000	Pitney Bowes Inc 3.875% 15/5/2022	4,064,415	0.04
USD 1,070,000	Ply Gem Industries Inc 6.5% 1/2/2022	1,120,825	0.01
USD 2,875,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.458% 1/10/2062	3,304,496	0.04
USD 1,425,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.81% 15/10/2065	1,720,103	0.02
USD 260,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.926% 1/10/2051	320,156	0.00
USD 5,548,000	Post Holdings Inc ' 144A ' 5.5% 1/3/2025	5,756,050	0.06
USD 3,310,000	Post Holdings Inc ' 144A ' 6% 15/12/2022	3,492,050	0.04
USD 2,964,048	Pretium Mortgage Credit Partners I 2016-NPL6 LLC (Step-up coupon) ' 2016-NPL6 A1 ' ' 144A ' 3.5% 27/10/2031	2,986,791	0.03
USD 10,874,460	Pretium Mortgage Credit Partners I 2017-NPL2 LLC (Step-up coupon) ' 2017-NPL2 A1 ' ' 144A ' 3.25% 28/3/2057	10,923,177	0.12
USD 8,800,000	Pretium Mortgage Credit Partners I 2017-NPL3 LLC (Step-up coupon) ' 2017-NPL3 A1 ' ' 144A ' 3.25% 29/6/2032	8,823,446	0.10
USD 368,930	Prime Mortgage Trust ' 2006-DR1 2A1 ' ' 144A ' 5.5% 25/5/2035	355,444	0.00
USD 2,493,594	Progress Residential 2015-SFR2 Trust ' 2015-SFR2 A ' ' 144A ' 2.74% 12/6/2032	2,519,491	0.03
USD 590,000	Progress Residential 2015-SFR3 Trust ' 2015-SFR3 F ' ' 144A ' 6.643% 12/11/2032	623,124	0.01
USD 1,291,607	Progress Residential 2016-SFR1 Trust ' 2016-SFR1 A ' ' 144A ' FRN 17/9/2033	1,312,973	0.01
USD 2,450,000	Progress Residential 2016-SFR1 Trust ' 2016-SFR1 E ' ' 144A ' FRN 17/9/2033	2,542,605	0.03
USD 1,350,000	Progress Residential 2016-SFR2 Trust ' 2016-SFR2 E ' ' 144A ' FRN 17/1/2034	1,396,549	0.02
USD 2,090,000	Progress Residential 2017-SFR1 Trust ' 2017-SFR1 A ' ' 144A ' 2.768% 17/8/2034	2,114,359	0.02
USD 250,000	Progress Residential 2017-SFR1 Trust ' 2017-SFR1 D ' ' 144A ' 3.565% 17/8/2034	254,076	0.00
USD 380,000	Progress Residential 2017-SFR1 Trust ' 2017-SFR1 E ' ' 144A ' 4.261% 17/8/2034	388,419	0.00
USD 2,190,000	Progressive Corp/The 4.35% 25/4/2044	2,391,067	0.03
USD 540,618	PRPM 2017-1 LLC (Step-up coupon) ' 2017-1A A1 ' ' 144A ' 4.25% 25/1/2022	544,769	0.01
EUR 638,000	PSPC Escrow Corp 6% 1/2/2023	796,923	0.01
USD 11,390,000	Quicken Loans Inc ' 144A ' 5.75% 1/5/2025	11,959,500	0.13
EUR 450,000	Quintiles IMS Inc 3.25% 15/3/2025*	547,432	0.01
USD 2,570,000	Race Point IX CLO Ltd ' 2015-9A A1 ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	2,570,406	0.03
USD 630,000	Race Point IX CLO Ltd ' 2015-9A A1AR ' ' 144A ' FRN 15/10/2030	630,000	0.01
USD 2,809,870	RAIT 2017-FL7 Trust ' 2017-FL7 A ' ' 144A ' FRN 15/6/2037	2,811,036	0.03
USD 430,000	RAIT 2017-FL7 Trust ' 2017-FL7 C ' ' 144A ' FRN 15/6/2037	430,490	0.00
USD 1,291,020	RALI Series 2006-Q06 Trust ' 2006-Q06 A2 ' FRN 25/6/2046	649,361	0.01
USD 1,375,379	RALI Series 2007-QH1 Trust ' 2007-QH1 A1 ' FRN 25/2/2037	1,264,052	0.01
USD 2,320,756	RALI Series 2007-QH6 Trust ' 2007-QH6 A1 ' FRN 25/7/2037	2,195,810	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,477,259	RALI Series 2007-QH9 Trust ' 2007-QH9 A1 ' FRN 25/11/2037	1,289,591	0.01
USD 934,311	RBSSP Resecuritization Trust ' 2013-2 1A2 ' ' 144A ' FRN 26/12/2036	892,580	0.01
USD 425,079	RCO Mortgage LLC ' 2015-NQM1 A ' ' 144A ' FRN 25/11/2045	426,965	0.00
USD 310,000	Regatta IV Funding Ltd ' 2014-1A DR ' ' 144A ' FRN 25/7/2026	310,214	0.00
USD 585,000	Regatta V Funding Ltd ' 2014-1A BR ' ' 144A ' FRN 25/10/2026	587,898	0.01
USD 1,025,000	Regatta V Funding Ltd ' 2014-1A C ' ' 144A ' FRN 25/10/2026	1,028,540	0.01
USD 3,420,000	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue 6.583% 15/5/2049	4,839,779	0.05
USD 207,523	Reperforming Loan REMIC Trust ' 2005-R3 AF ' ' 144A ' FRN 25/9/2035	186,025	0.00
USD 8,122,000	Resolute Energy Corp 8.5% 1/5/2020	8,132,153	0.09
USD 3,710,000	Resource Capital Corp 2017-CRE5 Ltd ' 2017-CRE5 A ' ' 144A ' FRN 15/7/2034	3,714,635	0.04
USD 1,170,000	Resource Capital Corp 2017-CRE5 Ltd ' 2017-CRE5 B ' ' 144A ' FRN 15/7/2034	1,172,192	0.01
USD 11,900,000	Reynolds American Inc 4.45% 12/6/2025	12,875,800	0.14
USD 4,185,000	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu ' 144A ' 5.125% 15/7/2023	4,362,863	0.05
USD 6,099,000	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu 5.75% 15/10/2020	6,220,980	0.07
USD 1,060,000	Rockford Tower CLO 2017-1 Ltd ' 2017-1A B ' ' 144A ' FRN 15/4/2029	1,063,143	0.01
USD 1,300,000	Rockford Tower CLO 2017-1 Ltd ' 2017-1A D ' ' 144A ' FRN 15/4/2029	1,255,270	0.01
USD 1,410,000	Rockford Tower CLO 2017-1 Ltd ' 2017-1A E ' ' 144A ' FRN 15/4/2029	1,290,758	0.01
USD 630,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd ' 2017-2A B ' ' 144A ' FRN 15/10/2029	630,000	0.01
USD 3,870,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd ' 2017-2A D ' ' 144A ' FRN 15/10/2029	3,857,229	0.04
USD 1,860,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd ' 2017-2A E ' ' 144A ' FRN 15/10/2029	1,783,554	0.02
USD 2,201,000	Rossllyn Portfolio Trust ' 2017-ROSS E ' ' 144A ' FRN 15/6/2033	2,226,977	0.02
USD 960,000	Royal Oak Hospital Finance Authority 5% 1/9/2039	1,068,854	0.01
USD 3,782,000	RSP Permian Inc 6.625% 1/10/2022	3,947,463	0.04
USD 713,000	RWJ Barnabas Health Inc 3.949% 1/7/2046	720,987	0.01
USD 1,713,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 15/4/2023	1,894,175	0.02
USD 13,110,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 1/3/2025	14,465,220	0.16
USD 5,840,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15/5/2024	6,489,209	0.07
USD 1,975,000	Sabre GBLB Inc ' 144A ' 5.25% 15/11/2023	2,034,250	0.02
USD 3,650,000	Sabre GBLB Inc ' 144A ' 5.375% 15/4/2023	3,759,500	0.04
USD 753,184	SACO I Trust ' 2006-9 A1 ' FRN 25/8/2036	1,237,448	0.01
USD 900,000	Salt Lake City Corp Airport Revenue 5% 1/7/2047	1,049,612	0.01
USD 1,775,000	Salt Lake City Corp Airport Revenue 5% 1/7/2047	2,035,943	0.02
USD 1,020,000	Salt River Project Agricultural Improvement & Power District 5% 1/12/2036	1,208,624	0.01
USD 1,000,000	San Diego Public Facilities Financing Authority Sewer Revenue 5% 15/5/2039	1,178,830	0.01
USD 1,390,000	San Francisco City & County Airport Comm-San Francisco International Airport 5% 1/5/2041	1,585,691	0.02
EUR 118,000	Sealed Air Corp 4.5% 15/9/2023	159,171	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 7,173,707	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust '2006- WM4 A1 ' ' 144A' FRN 25/11/2036	4,497,223	0.05
USD 1,029,587	Security National Mortgage Loan Trust ' 2007-1A 2A ' ' 144A ' FRN 25/4/2037	989,116	0.01
USD 1,750,000	Seneca Park CLO Ltd ' 2014-1A CR ' ' 144A ' FRN 17/7/2026	1,756,661	0.02
USD 1,590,000	Seneca Park CLO Ltd ' 2014-1A D ' ' 144A ' FRN 17/7/2026	1,590,382	0.02
USD 250,000	Seneca Park CLO Ltd '2014-1A SUB ' ' 144A' FRN 17/7/2026	128,894	0.00
USD 1,518,000	SESI LLC 6.375% 1/5/2019	1,520,429	0.02
USD 1,471,000	SG Mortgage Securities Trust ' 2006-FRE2 A2C ' FRN 25/7/2036	537,437	0.01
USD 1,310,000	SG Mortgage Securities Trust ' 2006-OPT2 A3D ' FRN 25/10/2036	857,386	0.01
USD 4,030,000	Shackleton 2014-V CLO Ltd '2014-5A AR ' ' 144A' FRN 7/5/2026	4,034,114	0.04
USD 730,000	Sherwin-Williams Co/The 3.125% 1/6/2024	740,796	0.01
USD 1,045,000	Sherwin-Williams Co/The 3.45% 1/6/2027	1,056,208	0.01
EUR 225,000	Silgan Holdings Inc 3.25% 15/3/2025	274,803	0.00
USD 500,000	Silver Creek CLO Ltd ' 2014-1A DR ' ' 144A ' FRN 20/7/2030	502,651	0.01
USD 2,395,000	Sirius XM Radio Inc ' 144A ' 5.375% 15/4/2025	2,532,713	0.03
USD 3,900,000	SLC Private Student Loan Trust ' 2006-A C ' FRN 15/7/2036	3,550,664	0.04
USD 8,389,559	SLM Private Credit Student Loan Trust ' 2004-B A3 ' FRN 15/3/2024	8,342,145	0.09
USD 4,255,404	SLM Private Credit Student Loan Trust ' 2004-A A3 ' FRN 15/6/2033	4,165,362	0.05
USD 6,040,715	SLM Private Credit Student Loan Trust ' 2006-B A5 ' FRN 15/12/2039	5,794,346	0.06
USD 5,405,466	SLM Private Education Loan Trust ' 2013-A A2B ' ' 144A ' FRN 17/5/2027	5,443,837	0.06
USD 2,475,000	SLM Private Education Loan Trust ' 2013-C B ' ' 144A ' FRN 15/6/2044	2,523,984	0.03
USD 872,847	SLM Private Education Loan Trust ' 2012-E A2B ' ' 144A ' FRN 15/6/2045	883,147	0.01
USD 4,235,000	SLM Private Education Loan Trust ' 2013-A B ' ' 144A ' 2.5% 15/3/2047	4,228,321	0.05
USD 2,690,000	SLM Private Education Loan Trust ' 2013-B B ' ' 144A ' 3% 16/5/2044	2,723,644	0.03
USD 4,740,000	SLM Private Education Loan Trust ' 2014-A B ' ' 144A ' 3.5% 15/11/2044	4,871,207	0.05
USD 521,157	SLM Private Education Loan Trust ' 2011-C ' 4.54% 17/10/2044	539,204	0.01
USD 1,760,761	SMB Private Education Loan Trust ' 2014-A A2B ' ' 144A ' FRN 15/5/2026	1,786,204	0.02
USD 4,560,000	SMB Private Education Loan Trust ' 2015-B B ' ' 144A ' 3.5% 17/12/2040	4,627,096	0.05
USD 3,880,000	SMB Private Education Loan Trust ' 2015-C B ' ' 144A ' 3.5% 15/9/2043	3,903,776	0.04
USD 7,090,000	SMB Private Education Loan Trust ' 2015-C C ' ' 144A ' 4.5% 17/9/2046	7,283,137	0.08
USD 3,275,000	SolarCity LMC Series IV LLC ' 2015-1 B ' ' 144A ' 5.58% 21/8/2045	3,250,110	0.04
USD 423,380	Sound Point CLO II Ltd '2013-1A A1L ' ' 144A' FRN 26/4/2025	423,627	0.00
USD 2,035,000	Sound Point CLO II Ltd '2013-1A A3L ' ' 144A' FRN 26/4/2025	2,040,535	0.02
USD 250,000	Sound Point CLO III Ltd ' 2013-2A C1R ' ' 144A ' FRN 15/7/2025	250,726	0.00
USD 1,190,000	Sound Point CLO III Ltd '2013-2A DR ' ' 144A' FRN 15/7/2025	1,193,407	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,340,000	Sound Point CLO III Ltd '2013-2A E' '144A' FRN 15/7/2025	1,337,103	0.01
USD 680,000	Sound Point CLO IV Ltd '2013-3A CR' '144A' FRN 21/1/2026	682,341	0.01
USD 1,085,000	Sound Point CLO IV Ltd '2013-3A DR' '144A' FRN 21/1/2026	1,088,948	0.01
USD 700,000	Sound Point CLO IX Ltd '2015-2A E' '144A' FRN 20/7/2027	698,024	0.01
USD 449,000	Sound Point CLO V Ltd '2014-1A E' '144A' FRN 18/4/2026	437,751	0.00
USD 2,025,000	Sound Point CLO VII Ltd '2014-3A AR' '144A' FRN 23/1/2027	2,029,827	0.02
USD 590,000	Sound Point CLO VII Ltd '2014-3A D' '144A' FRN 23/1/2027	592,858	0.01
USD 2,010,000	Sound Point CLO VIII Ltd '2015-1A B' '144A' FRN 15/4/2027	2,014,975	0.02
USD 500,000	Sound Point CLO VIII Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 15/4/2027	502,770	0.01
USD 1,380,000	Sound Point CLO X Ltd '2015-3A E' '144A' FRN 20/1/2028	1,390,841	0.02
USD 1,000,000	Sound Point CLO XI Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 20/7/2028	1,012,162	0.01
USD 1,300,000	Sound Point Clo XII Ltd '2016-2A A' '144A' FRN 20/10/2028	1,315,122	0.01
USD 650,000	Sound Point Clo XII Ltd '2016-2A E' '144A' FRN 20/10/2028	651,957	0.01
USD 440,000	Sound Point Clo XIV Ltd '2016-3A C' '144A' FRN 23/1/2029	443,637	0.00
USD 660,000	Sound Point Clo XIV Ltd '2016-3A E' '144A' FRN 23/1/2029	664,042	0.01
USD 126,065	Soundview Home Loan Trust '2004-WMC1 M2' FRN 25/1/2035	120,182	0.00
USD 2,225,000	South Carolina Public Service Authority 2.388% 1/12/2023	2,113,906	0.02
USD 1,430,000	South Carolina Public Service Authority 5% 1/12/2049	1,572,113	0.02
USD 1,430,000	South Carolina Public Service Authority 5% 1/12/2050	1,589,602	0.02
USD 1,500,000	Southern Baptist Hospital of Florida Inc 4.857% 15/7/2045	1,697,699	0.02
USD 1,744,000	Southern Co Gas Capital Corp 4.4% 30/5/2047	1,841,666	0.02
EUR 300,000	Spectrum Brands Inc 4% 1/10/2026	370,436	0.00
USD 2,700,000	Spectrum Brands Inc 5.75% 15/7/2025	2,882,250	0.03
USD 13,942,243	SpringCastle America Funding LLC '2016-AA A' '144A' 3.05% 25/4/2029	14,059,250	0.15
USD 5,363,000	Springleaf Funding Trust '2016-AA A' '144A' 2.9% 15/11/2029	5,424,388	0.06
USD 13,300,000	Springleaf Funding Trust '2015-AA A' '144A' 3.16% 15/11/2024	13,417,443	0.15
USD 11,187,000	Springleaf Funding Trust '2015-AA B' '144A' 3.62% 15/11/2024	11,394,320	0.12
USD 480,000	Springleaf Funding Trust '2016-AA B' '144A' 3.8% 15/11/2029	488,554	0.01
USD 1,000,000	Springleaf Funding Trust '2015-AA D' '144A' 6.31% 15/11/2024	1,024,381	0.01
USD 2,178,000	Sprint Communications Inc '144A' 7% 1/3/2020	2,389,702	0.03
USD 863,000	Sprint Communications Inc '144A' 9% 15/11/2018	928,804	0.01
USD 3,165,000	Sprint Corp 7.875% 15/9/2023	3,592,275	0.04
USD 17,685,000	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 3.36% 20/9/2021	17,957,422	0.19
USD 2,219,000	SSM Health Care Corp 3.823% 1/6/2027	2,325,494	0.03
USD 9,838,000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 6% 15/10/2025	10,600,445	0.11

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,679,321	Stanwich Mortgage Loan Co 2016-NPL2 LLC (Step-up coupon) ' 2016-NPL2 NOTE ' ' 144A ' 3.721% 16/8/2046	1,680,613	0.02
USD 14,202,252	Stanwich Mortgage Loan Co 2017-NPL-B-1 LLC (Step-up coupon) ' 2017-NPB1 A1 ' ' 144A ' 3.598% 17/5/2022	14,206,513	0.15
USD 2,955,000	State Board of Administration Finance Corp 2.995% 1/7/2020	3,026,437	0.03
USD 1,000,000	State of California 5% 1/9/2027	1,246,625	0.01
USD 755,000	State of California 7.3% 1/10/2039	1,125,192	0.01
USD 1,210,000	State of California 7.35% 1/11/2039	1,813,863	0.02
USD 2,575,000	State of California 7.5% 1/4/2034	3,801,369	0.04
USD 1,360,000	State of California 7.55% 1/4/2039	2,121,777	0.02
USD 750,000	State of Georgia 5% 1/7/2026	948,446	0.01
USD 1,480,000	State of Georgia 5% 1/2/2028	1,866,162	0.02
USD 1,480,000	State of Georgia 5% 1/2/2029	1,854,610	0.02
USD 1,480,000	State of Georgia 5% 1/2/2030	1,840,276	0.02
USD 1,000,000	State of Georgia 5% 1/2/2031	1,234,790	0.01
USD 1,000,000	State of Georgia 5% 1/2/2032	1,230,020	0.01
USD 740,000	State of Kansas Department of Transportation 5% 1/9/2035	877,337	0.01
USD 690,000	State of Maryland 5% 15/3/2028	870,808	0.01
USD 1,440,000	State of Ohio 5% 1/5/2027	1,761,214	0.02
USD 980,000	State of Ohio 5% 1/5/2030	1,174,628	0.01
USD 1,960,000	State of Ohio 5% 15/3/2032	2,305,029	0.03
USD 1,310,000	State of Ohio 5% 1/5/2032	1,557,950	0.02
USD 900,000	State of Ohio 5% 1/5/2034	1,062,041	0.01
USD 900,000	State of Ohio 5% 1/5/2035	1,058,603	0.01
USD 2,150,000	State of Ohio 5% 1/5/2036	2,523,971	0.03
USD 1,630,000	State of Ohio 5% 1/5/2037	1,909,798	0.02
USD 5,035,000	State of South Carolina 5% 1/10/2022	5,992,884	0.06
USD 865,000	State of Washington 5% 1/7/2028	1,040,911	0.01
USD 3,780,000	State of Wisconsin 3.154% 1/5/2027	3,892,720	0.04
USD 3,310,000	State Street Corp FRN 15/6/2047	3,061,750	0.03
USD 4,367,000	State Street Corp 2.65% 19/5/2026	4,326,214	0.05
USD 1,859,000	Steel Dynamics Inc 5% 15/12/2026	1,975,188	0.02
USD 1,006,000	Steel Dynamics Inc 5.125% 1/10/2021	1,034,872	0.01
USD 4,323,000	Steel Dynamics Inc 5.5% 1/10/2024	4,652,629	0.05
USD 1,045,000	Stewart Park CLO Ltd ' 2015-1A E ' ' 144A ' FRN 15/4/2026	1,040,925	0.01
USD 1,670,066	STRIPs 2012-1 Ltd ' 2012-1A B ' ' 144A ' 0.5% 25/12/2044	1,639,399	0.02
USD 2,471,484	Structured Asset Mortgage Investments II Trust ' 2006-AR2 A1 ' FRN 25/2/2036	2,348,078	0.03
USD 6,607,639	Structured Asset Mortgage Investments II Trust ' 2006-AR4 3A1 ' FRN 25/6/2036	6,194,863	0.07
USD 700,700	Structured Asset Mortgage Investments II Trust ' 2006-AR5 2A1 ' FRN 25/5/2046	584,534	0.01
USD 1,364,787	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust Series ' 2006-RF4 2A1 ' ' 144A ' 6% 25/10/2036	1,202,107	0.01
USD 795,000	Sumter Landing Community Development District 4.172% 1/10/2047	849,203	0.01
USD 9,855,000	SunTrust Banks Inc FRN 15/6/2022 (Perpetual)	10,036,697	0.11

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 250,000	Symphony CLO VIII LP ' 2012-8A CR ' ' 144A ' FRN 9/1/2023	250,681	0.00
USD 1,370,000	Symphony CLO VIII LP ' 2012-8A ER ' ' 144A ' FRN 9/1/2023	1,373,238	0.02
USD 4,500,000	Symphony CLO XII Ltd '2013-12A AR ' ' 144A ' FRN 15/10/2025	4,498,636	0.05
USD 1,275,000	Symphony CLO XV Ltd ' 2014-15A DR ' ' 144A ' FRN 17/10/2026	1,279,314	0.01
USD 425,000	Symphony CLO XV Ltd ' 2014-15A E ' ' 144A ' FRN 17/10/2026	419,539	0.00
USD 330,000	Symphony CLO XVI Ltd ' 2015-16A E ' ' 144A ' FRN 15/7/2028	327,175	0.00
USD 250,000	Symphony CLO XVII Ltd '2016-17A E ' ' 144A ' FRN 15/4/2028	253,560	0.00
USD 250,000	Symphony CLO XVIII Ltd '2016-18A D ' ' 144A ' FRN 23/1/2028	254,040	0.00
USD 579,000	TCI-Symphony CLO 2017-1 Ltd ' 2017-1A E ' ' 144A ' FRN 15/7/2030	565,635	0.01
USD 7,135,000	Teachers Insurance & Annuity Association of America ' 144A ' 4.27% 15/5/2047	7,440,296	0.08
USD 2,440,000	Team Health Holdings Inc ' 144A ' 6.375% 1/2/2025*	2,354,600	0.03
USD 4,192,000	Tesla Inc ' 144A ' 5.3% 15/8/2025	4,118,640	0.04
USD 4,000,000	Texas A&M University 2.756% 15/5/2026	4,044,320	0.04
USD 1,780,000	Texas A&M University 2.836% 15/5/2027	1,795,771	0.02
USD 570,000	Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp 5% 31/12/2055	627,781	0.01
USD 1,260,000	Texas Water Development Board 5% 15/10/2040	1,481,842	0.02
USD 1,080,000	Texas Water Development Board 5% 15/10/2045	1,263,260	0.01
USD 1,410,000	Thacher Park CLO Ltd ' 2014-1A D1R ' ' 144A ' FRN 20/10/2026	1,422,272	0.02
EUR 700,000	Thermo Fisher Scientific Inc 1.4% 23/1/2026	832,728	0.01
EUR 2,575,000	Thermo Fisher Scientific Inc 1.95% 24/7/2029	3,060,824	0.03
EUR 1,425,000	Thermo Fisher Scientific Inc 2.875% 24/7/2037	1,713,128	0.02
USD 2,500,000	THL Credit Wind River 2012-1 CLO Ltd ' 2012-1A DR ' ' 144A ' FRN 15/1/2026	2,540,430	0.03
USD 250,000	THL Credit Wind River 2013-2 CLO Ltd ' 2013-2A A2A ' ' 144A ' FRN 18/1/2026	250,151	0.00
USD 350,000	THL Credit Wind River 2013-2 CLO Ltd ' 2013-2A B1 ' ' 144A ' FRN 18/1/2026	350,626	0.00
USD 250,000	THL Credit Wind River 2014-3 CLO Ltd ' 2014-3A DR ' ' 144A ' FRN 22/1/2027	249,743	0.00
USD 250,000	THL Credit Wind River 2014-3 CLO Ltd ' 2014-3A E ' ' 144A ' FRN 22/1/2027	250,638	0.00
USD 670,000	THL Credit Wind River 2015-1 CLO Ltd ' 2015-1A E1 ' ' 144A ' FRN 20/7/2027	669,991	0.01
USD 1,303,795	Thornburg Mortgage Securities Trust ' 2007-3 4A1 ' FRN 25/6/2047	1,174,127	0.01
USD 250,000	TIAA CLO II Ltd ' 2017-1A E ' ' 144A ' FRN 20/4/2029	236,530	0.00
USD 290,000	TICP CLO I Ltd ' 2015-1A C ' ' 144A ' FRN 20/7/2027	291,461	0.00
USD 290,000	TICP CLO I Ltd ' 2015-1A D ' ' 144A ' FRN 20/7/2027	287,705	0.00
USD 1,416,000	TICP CLO III Ltd ' 2014-3A AR ' ' 144A ' FRN 20/1/2027	1,417,301	0.02
USD 800,000	TICP CLO VII Ltd ' 2017-7A E ' ' 144A ' FRN 15/7/2029	785,536	0.01
USD 2,173,000	T-Mobile USA Inc 6% 15/4/2024	2,326,197	0.03
USD 195,000	T-Mobile USA Inc 6.836% 28/4/2023	207,431	0.00
USD 2,805,000	Tobacco Settlement Finance Authority 7.467% 1/6/2047	2,700,626	0.03
USD 1,430,000	Tobacco Settlement Financing Corp/NJ 5% 1/6/2041	1,385,477	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,945,000	Tobacco Settlement Financing Corp/VA 6.706% 1/6/2046	2,601,598	0.03
USD 1,298,000	Toll Brothers Finance Corp 4.875% 15/11/2025	1,345,053	0.01
USD 2,800,000	Total System Services Inc 3.8% 1/4/2021	2,925,209	0.03
USD 1,091,000	TransDigm Inc 5.5% 15/10/2020	1,110,082	0.01
USD 3,690,000	TransDigm Inc 6% 15/7/2022	3,829,113	0.04
USD 2,150,000	TransDigm Inc 6.5% 15/7/2024	2,238,688	0.02
USD 260,000	Treman Park CLO Ltd ' 2015-1A AR ' ' 144A ' FRN 20/4/2027	261,813	0.00
USD 1,750,000	Treman Park CLO Ltd ' 2015-1A D ' ' 144A ' FRN 20/4/2027	1,759,625	0.02
USD 11,930,000	Triaxx Prime CDO 2006-1 Ltd ' 2006-1A A2 ' ' 144A ' FRN 3/3/2039	1,266,443	0.01
USD 1,089,449	Tricon American Homes 2015-SFR1 Trust ' 2015-SFR1 A ' ' 144A ' FRN 17/5/2032	1,097,732	0.01
USD 7,243,677	U.S. Residential Opportunity Fund IV Trust (Step-up coupon) ' 2016-2IV NOTE ' ' 144A ' 3.475% 27/8/2036	7,235,657	0.08
USD 178,670	UAL 2007-1 Pass Through Trust 6.636% 2/7/2022	194,527	0.00
USD 5,553,448	UBS Commercial Mortgage Trust ' 2017-C1 XA ' FRN 15/6/2050	649,785	0.01
USD 2,610,972	United Airlines 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/8/2021	2,748,048	0.03
USD 2,150,000	United Rentals North America Inc 5.5% 15/7/2025	2,297,813	0.02
USD 945,000	United Rentals North America Inc 5.75% 15/11/2024	1,008,788	0.01
USD 300,601,400	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2019*	314,862,699	3.40
USD 71,868,400	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2020*	75,560,520	0.82
USD 43,925,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/7/2026*	44,088,730	0.48
USD 12,469,800	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.375% 15/1/2027*	12,594,773	0.14
USD 14,580,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.875% 15/2/2047†	14,764,134	0.16
USD 52,650,000	United States Treasury Note/Bond 1.5% 15/8/2020*	52,759,002	0.57
USD 181,000	United States Treasury Note/Bond 1.625% 31/8/2022	180,258	0.00
USD 174,000	United States Treasury Note/Bond 1.875% 31/7/2022	175,278	0.00
USD 95,405,000	United States Treasury Note/Bond 2.25% 15/8/2027	96,455,945	1.04
USD 61,161,900	United States Treasury Note/Bond 2.75% 15/8/2047†	61,348,253	0.66
USD 6,820,000	United Technologies Corp 2.8% 4/5/2024	6,854,935	0.07
USD 4,910,000	United Technologies Corp 4.05% 4/5/2047	4,977,584	0.05
USD 1,480,000	University of California 3.063% 1/7/2025	1,525,702	0.02
USD 790,000	University of Houston 5% 15/2/2033	936,197	0.01
USD 720,000	University of Houston 5% 15/2/2034	849,650	0.01
USD 1,630,000	University of Houston 5% 15/2/2035	1,916,758	0.02
USD 2,110,000	University of Houston 5% 15/2/2036	2,475,969	0.03
USD 1,000,000	University of Massachusetts Building Authority 5% 1/11/2031	1,193,145	0.01
USD 1,260,000	University of New Mexico/The 5% 1/6/2047	1,459,861	0.02
USD 2,080,000	University of Virginia 5% 1/4/2044	2,485,007	0.03
USD 1,440,000	University of Virginia 5% 1/4/2046	1,717,704	0.02
USD 2,629,312	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.95% 15/11/2025	2,754,205	0.03
USD 789,211	US Airways 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/11/2021	838,537	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 10,090,000	US Bancorp FRN 15/4/2027 (Perpetual)	10,972,875	0.12
USD 4,780,000	US Bancorp 2.375% 22/7/2026	4,604,378	0.05
USD 10,050,000	US Bancorp 3.15% 27/4/2027	10,217,579	0.11
USD 941,182	US Residential Opportunity Fund II Trust (Step-up coupon) ' 2016-1III A ' ' 144A ' 3.475% 27/7/2036	940,353	0.01
USD 4,827,648	US Residential Opportunity Fund II Trust (Step-up coupon) ' 2016-2II A ' ' 144A ' 3.475% 27/8/2036	4,821,678	0.05
USD 1,410,291	US Residential Opportunity Fund II Trust (Step-up coupon) ' 2016-3II A ' ' 144A ' 3.598% 27/10/2036	1,419,365	0.02
USD 6,939,052	US Residential Opportunity Fund III Trust (Step-up coupon) ' 2016-1III A ' ' 144A ' 3.475% 27/7/2036	6,999,689	0.08
USD 12,604,160	US Residential Opportunity Fund III Trust (Step-up coupon) ' 2016-2III A ' ' 144A ' 3.475% 27/8/2036	12,589,848	0.14
USD 7,065,470	US Residential Opportunity Fund III Trust (Step-up coupon) ' 2016-3III A ' ' 144A ' 3.598% 27/10/2036	7,056,665	0.08
USD 8,472,553	US Residential Opportunity Fund IV Trust (Step-up coupon) ' 2016-1IV A ' ' 144A ' 3.475% 27/7/2036	8,518,098	0.09
USD 3,686,785	US Residential Opportunity Fund IV Trust (Step-up coupon) ' 2016-3IV A ' ' 144A ' 3.598% 27/10/2036	3,710,890	0.04
USD 1,280,000	Valeant Pharmaceuticals International ' 144A ' 7% 1/10/2020	1,281,600	0.01
USD 2,957,000	Valvoline Inc ' 144A ' 5.5% 15/7/2024	3,145,509	0.03
USD 1,402,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust ' 2014-1 M1 ' ' 144A ' FRN 25/9/2044	1,458,979	0.02
USD 1,531,818	Velocity Commercial Capital Loan Trust ' 2015-1 AFL ' ' 144A ' FRN 25/6/2045	1,575,706	0.02
USD 1,143,438	Velocity Commercial Capital Loan Trust ' 2016-2 AFL ' FRN 25/10/2046	1,156,770	0.01
USD 310,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust ' 2016-2 M1 ' FRN 25/10/2046	314,263	0.00
USD 170,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust ' 2016-2 M2 ' FRN 25/10/2046	175,631	0.00
USD 290,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust ' 2016-2 M3 ' FRN 25/10/2046	302,614	0.00
USD 310,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust ' 2016-2 M4 ' FRN 25/10/2046	324,961	0.00
USD 3,438,699	Velocity Commercial Capital Loan Trust ' 2017-1 AFL ' ' 144A ' FRN 25/5/2047	3,468,007	0.04
USD 332,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust ' 2017-1 M1 ' ' 144A ' FRN 25/5/2047	340,803	0.00
USD 330,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust ' 2017-1 M2 ' ' 144A ' FRN 25/5/2047	333,786	0.00
USD 330,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust ' 2017-1 M3 ' ' 144A ' FRN 25/5/2047	339,460	0.00
USD 850,000	VENTURE XIII CLO Ltd ' 2013-13A D ' ' 144A ' FRN 10/6/2025	850,100	0.01
USD 1,200,000	Venture XIX CLO Ltd ' 2014-19A AR ' ' 144A ' FRN 15/1/2027	1,199,887	0.01
USD 650,000	Venture XIX CLO Ltd ' 2014-19A BR ' ' 144A ' FRN 15/1/2027	655,891	0.01
USD 1,280,000	Venture XVII CLO Ltd ' 2014-17A B2R ' ' 144A ' FRN 15/7/2026	1,282,142	0.01
USD 250,000	Venture XX CLO Ltd ' 2015-20A B1 ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	250,929	0.00
USD 320,000	Venture XX CLO Ltd ' 2015-20A C ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	321,612	0.00
USD 330,000	Venture XX CLO Ltd ' 2015-20A D ' ' 144A ' FRN 15/4/2027	331,765	0.00
USD 470,000	Venture XXI CLO Ltd ' 2015-21A D ' ' 144A ' FRN 15/7/2027	472,041	0.01
USD 220,000	Venture XXII CLO Ltd ' 2015-22A E ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	221,144	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 804,000	Venture XXIV CLO Ltd ' 2016-24A E ' ' 144A ' FRN 20/10/2028	811,711	0.01
USD 750,000	Venture XXVI CLO Ltd ' 2017-26A D ' ' 144A ' FRN 20/1/2029	766,743	0.01
EUR 200,000	Veritas US Inc / Veritas Bermuda Ltd 7.5% 1/2/2023	253,475	0.00
USD 645,000	Vibrant Clo III Ltd ' 2015-3A A1R ' ' 144A ' FRN 20/4/2026	647,379	0.01
USD 250,000	Vibrant Clo III Ltd ' 2015-3A A2R ' ' 144A ' FRN 20/4/2026	250,849	0.00
USD 440,000	Vibrant Clo III Ltd ' 2015-3A BR ' ' 144A ' FRN 20/4/2026	442,194	0.00
USD 1,310,000	Vibrant Clo IV Ltd ' 2016-4A C ' ' 144A ' FRN 20/7/2028	1,333,990	0.01
USD 470,000	Vibrant Clo IV Ltd ' 2016-4A D ' ' 144A ' FRN 20/7/2028	476,331	0.01
USD 830,000	Vibrant Clo V Ltd ' 2016-5A A ' ' 144A ' FRN 20/1/2029	834,214	0.01
USD 2,885,000	VMware Inc 2.95% 21/8/2022	2,894,578	0.03
USD 6,025,000	VMware Inc 3.9% 21/8/2027	6,047,624	0.07
USD 885,000	VNDO 2013-PENN Mortgage Trust ' 2013-PENN E ' ' 144A ' FRN 13/12/2029	893,209	0.01
USD 3,310,000	VNDO Trust ' 2016-350P E ' ' 144A ' FRN 10/1/2035	3,235,045	0.04
USD 8,546,829	VOLT LIX LLC (Step-up coupon) ' 2017-NPL6 A1 ' ' 144A ' 3.25% 25/5/2047	8,626,115	0.09
USD 16,275,843	VOLT LX LLC (Step-up coupon) ' 2017-NPL7 A1 ' ' 144A ' 3.25% 25/4/2059	16,410,110	0.18
USD 3,976,598	VOLT LXI LLC (Step-up coupon) ' 2017-NPL8 A1 ' ' 144A ' 3.125% 25/6/2047	4,008,000	0.04
USD 463,806	Voya CLO 2013-1 Ltd ' 2013-1A A1 ' ' 144A ' FRN 15/4/2024	464,129	0.01
USD 1,699,004	Voya CLO 2013-2 Ltd ' 2013-2A A1 ' ' 144A ' FRN 25/4/2025	1,706,743	0.02
USD 1,210,000	Voya CLO 2013-2 Ltd ' 2013-2A C ' ' 144A ' FRN 25/4/2025	1,218,709	0.01
USD 2,640,000	Voya CLO 2013-3 Ltd ' 2013-3A A1R ' ' 144A ' FRN 18/1/2026	2,644,497	0.03
USD 1,275,000	Voya CLO 2013-3 Ltd ' 2013-3A A2R ' ' 144A ' FRN 18/1/2026	1,276,072	0.01
USD 685,000	Voya CLO 2013-3 Ltd ' 2013-3A BR ' ' 144A ' FRN 18/1/2026	687,466	0.01
USD 440,000	Voya CLO 2014-1 Ltd ' 2014-1A C ' ' 144A ' FRN 18/4/2026	443,689	0.00
USD 415,000	Voya CLO 2014-3 Ltd ' 2014-3A C ' ' 144A ' FRN 25/7/2026	418,406	0.00
USD 5,010,000	Voya CLO 2014-4 Ltd ' 2014-4A A1R ' ' 144A ' FRN 14/10/2026	5,013,084	0.05
USD 865,000	Voya CLO 2014-4 Ltd ' 2014-4A BR ' ' 144A ' FRN 14/10/2026	868,800	0.01
USD 2,965,000	Voya CLO 2014-4 Ltd ' 2014-4A CR ' ' 144A ' FRN 14/10/2026	2,978,388	0.03
USD 275,000	Voya CLO 2015-1 Ltd ' 2015-1A D ' ' 144A ' FRN 18/4/2027	275,141	0.00
USD 275,000	Voya CLO 2016-2 Ltd ' 2016-2A D ' ' 144A ' FRN 19/7/2028	278,994	0.00
USD 330,000	Voya CLO 2016-3 Ltd ' 2016-3A D ' ' 144A ' FRN 18/10/2027	333,416	0.00
USD 250,000	Voya CLO 2016-4 Ltd ' 2016-4A E2 ' ' 144A ' FRN 20/7/2029	253,064	0.00
EUR 100,000	VWR Funding Inc 4.625% 15/4/2022	123,431	0.00
USD 2,862,833	Wachovia Asset Securitization Issuance II LLC 2007-HE2 Trust ' 2007-HE2A A ' ' 144A ' FRN 25/7/2037	2,554,695	0.03
USD 3,671,336	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series ' 2006-C28 AJ ' FRN 15/10/2048	3,668,698	0.04

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 5,490,000	Walgreens Boots Alliance Inc 3.45% 1/6/2026	5,514,269	0.06
USD 178,000	Walgreens Boots Alliance Inc 4.65% 1/6/2046	187,453	0.00
USD 2,524,000	Walgreens Boots Alliance Inc 4.8% 18/11/2044	2,730,066	0.03
USD 641,864	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR15 Trust '2006-AR15 2A' FRN 25/11/2046	614,061	0.01
USD 867,993	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust '2007-OA5 1A' FRN 25/6/2047	815,090	0.01
USD 4,000,000	Washington Mill CLO Ltd '2014-1A A1R' '144A' FRN 20/4/2026	4,000,170	0.04
USD 7,220,000	Washington Mutual Bank / Debt not acquired by JPMorgan (Defaulted) 1/5/2009 (Zero Coupon)	1,638,038	0.02
USD 10,740,000	Washington Mutual Bank / Debt not acquired by JPMorgan (Defaulted) 6/11/2009 (Zero Coupon)	2,436,638	0.03
USD 3,399,000	Washington Mutual Bank / Debt not acquired by JPMorgan (Defaulted) 16/6/2010 (Zero Coupon)	771,148	0.01
USD 3,780,000	Washington Mutual Bank / Debt not acquired by JPMorgan (Defaulted) 4/2/2011 (Zero Coupon)	857,588	0.01
USD 630,000	Washington Mutual Bank / Debt not acquired by JPMorgan (Defaulted) 5.55% 16/6/2010	142,931	0.00
USD 2,247,772	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust (Step-up coupon) '2006-4 3A1' 6.5% 25/5/2036	1,897,562	0.02
USD 2,140,283	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2007-OA1 Trust '2007-OA1 2A' FRN 25/12/2046	1,710,772	0.02
USD 5,195,319	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE4 Trust '2006-HE4 2A2' FRN 25/9/2036	2,666,299	0.03
USD 2,024,077	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust '2006-HE5 1A' FRN 25/10/2036	1,676,530	0.02
USD 3,820,486	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust '2006-HE5 2A2' FRN 25/10/2036	2,145,170	0.02
USD 4,892,631	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2007-HE2 Trust '2007-HE2 2A2' FRN 25/2/2037	2,208,182	0.02
USD 2,380,000	Waste Management Inc 3.9% 1/3/2035	2,505,637	0.03
USD 2,240,000	Webster Park CLO Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 20/1/2027	2,271,785	0.02
USD 1,250,000	Webster Park CLO Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 20/1/2027	1,269,279	0.01
USD 1,821,000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp '144A' 6.625% 15/8/2025	1,789,133	0.02
USD 1,240,000	Weld County School District No RE-4 5.25% 1/12/2041	1,483,524	0.02
USD 24,105,000	Wells Fargo & Co FRN 15/6/2024 (Perpetual)	26,184,056	0.28
USD 13,330,000	Wells Fargo & Co FRN 22/5/2028	13,632,271	0.15
USD 9,605,000	Wells Fargo & Co 2.625% 22/7/2022	9,665,512	0.10
USD 5,110,000	Wells Fargo & Co 4.3% 22/7/2027	5,451,925	0.06
USD 5,245,000	Wells Fargo & Co 4.75% 7/12/2046	5,725,772	0.06
USD 1,390,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2014-TISH SCH2' '144A' FRN 15/1/2027	1,392,393	0.02
USD 16,779,723	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-C27 XA' FRN 15/2/2048	908,984	0.01
USD 3,400,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-NXS1 XB' FRN 15/5/2048	111,181	0.00
USD 1,470,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-NXS4 D' FRN 15/12/2048	1,339,530	0.01
USD 2,290,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2016-C34 C' FRN 15/6/2049	2,429,807	0.03
USD 5,483,598	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2016-BNK1 XB' FRN 15/8/2049	555,626	0.01
USD 2,760,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2016-BNK1 XD' '144A' FRN 15/8/2049	244,550	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,730,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust ' 2017-C39 D ' ' 144A ' FRN 15/9/2050	1,675,786	0.02
USD 9,215	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust ' 2015-NXS3 XA ' FRN 15/9/2057	542	0.00
USD 800,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust ' 2016-NXS5 C ' FRN 15/1/2059	861,130	0.01
USD 15,409,207	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust ' 2016-C33 XA ' FRN 15/3/2059	1,644,988	0.02
USD 10,437,993	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust ' 2016-LC25 XA ' FRN 15/12/2059	682,906	0.01
USD 660,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust ' 2015-NXS3 D ' ' 144A ' 3.153% 15/9/2057	477,221	0.01
USD 480,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust ' 2015-P2 D ' ' 144A ' 3.241% 15/12/2048	367,964	0.00
USD 2,200,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust ' 2015-C27 D ' ' 144A ' 3.768% 15/2/2048	1,691,366	0.02
USD 270,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust ' 2015-C31 D ' 3.852% 15/11/2048	213,515	0.00
USD 2,069,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust ' 2015-C27 C ' 3.894% 15/2/2048	1,990,950	0.02
USD 1,940,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust ' 2017-C39 C ' 4.118% 15/9/2050	1,949,714	0.02
USD 899,314	Wells Fargo Mortgage Backed Securities 2005-AR16 Trust ' 2005-AR16 CRB1 ' FRN 25/10/2035	749,909	0.01
USD 430,000	WESCO Distribution Inc 5.375% 15/12/2021	445,050	0.01
USD 2,380,000	Wesleyan University 4.781% 1/7/2116	2,473,890	0.03
USD 7,616,000	West CLO 2013-1 Ltd ' 2013-1A A1AR ' ' 144A ' FRN 7/11/2025	7,622,067	0.08
USD 2,199,000	West Corp ' 144A ' 4.75% 15/7/2021	2,237,483	0.02
USD 830,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2019	885,137	0.01
USD 895,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2020	985,077	0.01
USD 890,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2021	1,006,991	0.01
USD 975,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2022	1,129,065	0.01
USD 810,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2023	953,605	0.01
USD 860,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2024	1,024,264	0.01
USD 330,000	Westcott Park CLO Ltd ' 2016-1A E ' ' 144A ' FRN 20/7/2028	333,171	0.00
USD 3,612,000	Western Refining Logistics LP / WNRL Finance Corp 7.5% 15/2/2023	3,890,846	0.04
USD 360,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust ' 2012-C8 C ' FRN 15/8/2045	378,575	0.00
USD 4,899,680	WFRBS Commercial Mortgage Trust ' 2014-C20 XA ' FRN 15/5/2047	247,698	0.00
USD 150,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust ' 2014-C21 C ' FRN 15/8/2047	149,506	0.00
USD 14,689,871	WFRBS Commercial Mortgage Trust ' 2014-C23 XA ' FRN 15/10/2057	496,537	0.01
USD 1,055,000	Whiting Petroleum Corp 5% 15/3/2019	1,049,725	0.01
USD 7,197,000	Willis North America Inc 3.6% 15/5/2024	7,422,316	0.08
USD 650,000	Wisconsin Health & Educational Facilities Authority 5% 15/12/2044	714,321	0.01
EUR 200,000	WMG Acquisition Corp 4.125% 1/11/2024	251,882	0.00
USD 670,000	World Financial Network Credit Card Master Trust ' 2012-D B ' 3.34% 17/4/2023	682,709	0.01
USD 1,520,000	World Financial Network Credit Card Master Trust ' 2012-C C ' 4.55% 15/8/2022	1,555,856	0.02
USD 1,330,154	WVUE (Step-up coupon) ' 2015-1A A ' ' 144A ' 4.5% 25/9/2020	1,331,827	0.01
USD 1,315,000	Xilinx Inc 2.95% 1/6/2024	1,339,610	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品
(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
EUR 324,000	XPO Logistics Inc 5.75% 15/6/2021	401,370	0.00
USD 2,253,872	Yale Mortgage Loan Trust '2007-1 A' '144A' FRN 25/6/2037	1,033,331	0.01
USD 340,000	York CLO 1 Ltd '2014-1A CR' '144A' FRN 22/1/2027	339,667	0.00
USD 600,000	York CLO 1 Ltd '2014-1A DR' '144A' FRN 22/1/2027	596,914	0.01
USD 1,120,000	York CLO 1 Ltd '2014-1A E' '144A' FRN 22/1/2027	1,108,595	0.01
USD 1,170,000	York Clo-3 Ltd '2016-1A BR' '144A' FRN 20/10/2029	1,170,000	0.01
USD 2,660,000	York Clo-3 Ltd '2016-1A DR' '144A' FRN 20/10/2029	2,660,000	0.03
USD 1,520,000	York Clo-3 Ltd '2016-1A ER' '144A' FRN 20/10/2029	1,485,800	0.02
USD 730,000	York Clo-3 Ltd '2016-1A FR' '144A' FRN 20/10/2029	659,409	0.01
USD 2,190,000	York Clo-3 Ltd '2016-1A SUB' '144A' FRN 20/10/2029	2,162,023	0.02
USD 610,000	York Clo-4 Ltd '2016-2A D' '144A' FRN 20/1/2030	618,590	0.01
USD 1,820,000	York Clo-4 Ltd '2016-2A E' '144A' FRN 20/1/2030	1,855,351	0.02
USD 3,115,000	Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc 6% 1/4/2023	3,294,113	0.04
USD 1,085,000	Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc 6.375% 15/5/2025	1,166,375	0.01
EUR 1,000,000	ZF North America Capital Inc 2.75% 27/4/2023	1,281,849	0.01
USD 12,231,000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.5% 29/4/2022	12,876,797	0.14
		5,830,649,837	62.93
債券合計		8,594,943,419	92.77
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている 譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計		8,737,141,856	94.30

その他の譲渡可能な有価証券

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	債券		
	米国		
USD 5,257,881	American Homes 4 Rent '2015-SFR1 XS' '144A' FRN 17/4/2052**	-	0.00
USD 2,391	Lehman Brothers Holdings Inc (Defaulted) 31/12/2049 (Zero Coupon)**	145	0.00
USD 2,391	Lehman Brothers Special Finance (Defaulted) 31/12/2049 (Zero Coupon)**	12	0.00
USD 8,776,000	One Market Plaza Trust '2017-1MKT XNCP' '144A' FRN 10/2/2032**	1	0.00
		158	0.00
債券合計		158	0.00
その他の譲渡可能な有価証券合計		158	0.00
投資有価証券合計		8,737,142,014	94.30
その他の純資産		528,102,945	5.70
純資産合計(米ドル)		9,265,244,959	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

** 注記2(j)に記載のとおり、公正価値調整の対象である有価証券。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

事後通告証券契約 2017年8月31日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
	米国		
USD 724,681,000	Fannie Mae Pool ' 2.5 9/17 ' 2.5% TBA	734,211,352	7.92
USD (773,291,390)	Fannie Mae Pool ' 3 9/17 ' 3% TBA	(797,804,108)	(8.61)
USD (109,200,000)	Fannie Mae Pool ' 3 10/17 ' 3% TBA	(112,525,053)	(1.22)
USD 85,968,670	Fannie Mae Pool ' 3 9/17 ' 3% TBA	86,835,071	0.94
USD 250,143,100	Fannie Mae Pool ' 3.5 9/17 ' 3.5% TBA	258,898,109	2.79
USD 11,870,265	Fannie Mae Pool ' 4 M1630 ' 4% TBA	12,590,653	0.13
USD (1,093,808,099)	Fannie Mae Pool ' 4 9/17 ' 4% TBA	(1,154,736,601)	(12.46)
USD (612,010,000)	Fannie Mae Pool ' 4 10/17 ' 4% TBA	(645,144,588)	(6.96)
USD (4,327,000)	Fannie Mae Pool ' 4.5 10/17 ' 4.5% TBA	(4,647,506)	(0.05)
USD (1,044,000)	Fannie Mae Pool ' 4.5 9/17 ' 4.5% TBA	(1,122,391)	(0.01)
USD 263,750,000	Freddie Mac Gold Pool ' 3.5 9/17 ' 3.5% TBA	273,043,047	2.95
USD (195,724,000)	Freddie Mac Gold Pool ' 4 9/17 ' 4% TBA	(206,657,006)	(2.23)
USD 101,488,000	Ginnie Mae II Pool ' 4 9/17 ' 4% TBA	106,824,046	1.15
USD (69,129,000)	Ginnie Mae II Pool ' 4.5 9/17 ' 4.5% TBA	(73,504,171)	(0.79)
T B A 合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 4,468,543,702米ドル)		(1,523,739,146)	(16.45)

事後通告(以下「T B A」という。)契約は、主にパス・スルー代理人の発行体の所在国により分類される。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益 / (損) (米ドル)
CNH	29,493,672	USD	4,320,000	HSBC Bank Plc	1/9/2017	146,209
KRW	5,307,710,000	USD	4,700,000	HSBC Bank Plc	1/9/2017	7,086
TWD	282,145,600	USD	9,350,000	HSBC Bank Plc	1/9/2017	(927)
USD	4,320,000	CNH	29,493,677	Morgan Stanley	1/9/2017	(146,209)
USD	4,700,000	KRW	5,275,750,000	JP Morgan	1/9/2017	21,258
USD	9,350,000	TWD	282,463,500	Standard Chartered Bank	1/9/2017	(9,607)
BRL	82,724,797	USD	26,060,800	BNP Paribas	5/9/2017	286,802
MXN	100,888,160	USD	5,680,000	Goldman Sachs	5/9/2017	(7,744)
MXN	101,247,113	USD	5,680,000	Morgan Stanley	5/9/2017	12,437
MXN	94,719,357	USD	5,278,000	BNP Paribas	5/9/2017	47,426
RUB	321,782,018	USD	5,310,000	JP Morgan	5/9/2017	214,332
TRY	18,788,624	USD	5,278,000	BNP Paribas	5/9/2017	153,381
USD	5,663,000	BRL	17,804,472	Morgan Stanley	5/9/2017	(7,671)
USD	7,107,800	BRL	22,585,035	Goldman Sachs	5/9/2017	(85,466)
USD	8,045,000	BRL	25,265,323	BNP Paribas	5/9/2017	(1,930)
USD	5,245,000	BRL	16,488,969	RBS Plc	5/9/2017	(6,687)
USD	5,278,000	EUR	4,468,844	Bank of America	5/9/2017	(19,720)
USD	5,310,000	GBP	4,023,331	Bank of America	5/9/2017	133,200
USD	5,278,000	HUF	1,360,400,805	Citibank	5/9/2017	4,302
USD	5,278,000	JPY	582,362,908	Citibank	5/9/2017	1,049
USD	5,680,000	MXN	101,037,629	BNP Paribas	5/9/2017	(659)
USD	5,680,000	MXN	101,150,008	Morgan Stanley	5/9/2017	(6,978)
USD	5,278,000	SEK	42,614,076	BNP Paribas	5/9/2017	(59,849)
ZAR	70,024,546	USD	5,278,000	BNP Paribas	5/9/2017	101,934
BRL	16,629,922	USD	5,278,000	BNP Paribas	6/9/2017	17,721
DKK	123,441,098	USD	19,781,139	Morgan Stanley	6/9/2017	(107,796)
EUR	247,161,000	USD	294,577,602	Deutsche Bank	6/9/2017	(1,557,840)
GBP	195,650,000	USD	252,779,800	UBS	6/9/2017	(1,029,119)
KRW	8,000,000,000	USD	7,111,364	HSBC Bank Plc	6/9/2017	(15,755)
USD	8,505,609	CNH	57,024,818	RBS Plc	6/9/2017	(128,657)
USD	8,478,391	CNH	56,832,707	BNP Paribas	6/9/2017	(126,787)
USD	19,502,742	DKK	123,442,000	Standard Chartered Bank	6/9/2017	(170,745)
USD	589,697,033	EUR	499,375,488	Deutsche Bank	6/9/2017	(2,333,614)
USD	260,429,950	GBP	198,271,000	HSBC Bank Plc	6/9/2017	5,306,723
USD	4,085,893	JPY	450,634,000	Barclays	6/9/2017	2,381
USD	7,124,740	KRW	8,000,000,000	JP Morgan	6/9/2017	29,131
USD	14,805,616	MXN	265,683,000	BNP Paribas	6/9/2017	(129,532)
COP	16,201,239,250	USD	5,449,000	BNP Paribas	7/9/2017	44,673
USD	5,449,000	COP	16,864,655,000	Barclays	7/9/2017	(269,631)
BRL	9,811,500	USD	3,100,000	Morgan Stanley	8/9/2017	23,412
USD	3,100,000	BRL	9,809,330	BNP Paribas	8/9/2017	(22,722)
HKD	102,881,288	USD	13,200,000	Citibank	11/9/2017	(49,036)
HKD	173,545,638	USD	22,260,000	HSBC Bank Plc	11/9/2017	(76,254)

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
MXN	28,768,387	USD	1,625,661	Goldman Sachs	11/9/2017	(9,771)
MXN	71,897,822	USD	4,063,339	UBS	11/9/2017	(24,914)
USD	35,460,000	HKD	277,280,459	JP Morgan	11/9/2017	16,186
USD	8,149,326	TRY	29,035,478	HSBC Bank Plc	11/9/2017	(229,794)
BRL	10,253,760	USD	3,200,000	Deutsche Bank	12/9/2017	62,082
USD	3,200,000	BRL	10,323,200	Deutsche Bank	12/9/2017	(84,173)
EUR	1,587,000	USD	1,910,446	JP Morgan	13/9/2017	(28,288)
EUR	441,000	USD	527,355	Goldman Sachs	13/9/2017	(4,336)
USD	1,681,186	EUR	1,411,000	JP Morgan	13/9/2017	7,761
CAD	8,735,446	USD	6,610,000	Morgan Stanley	14/9/2017	345,478
EUR	5,680,000	USD	6,795,024	Goldman Sachs	14/9/2017	(58,269)
MXN	120,390,440	EUR	5,680,000	Goldman Sachs	14/9/2017	22,182
USD	7,015,390	CNH	47,922,131	Goldman Sachs	14/9/2017	(237,366)
USD	11,796,427	EUR	10,171,032	Bank of America	14/9/2017	(266,910)
USD	13,582,203	EUR	12,016,086	UBS	14/9/2017	(669,458)
USD	6,188,732	EUR	5,450,158	JP Morgan	14/9/2017	(275,420)
USD	5,121,494	HKD	39,829,344	HSBC Bank Plc	14/9/2017	29,787
USD	48,854	JPY	5,531,916	Barclays	14/9/2017	(1,293)
USD	1,626,512	JPY	177,605,540	UBS	14/9/2017	16,492
USD	1,441,800	JPY	159,820,000	HSBC Bank Plc	14/9/2017	(6,992)
USD	1,416,401	JPY	158,610,000	Citibank	14/9/2017	(21,422)
USD	31,284,308	JPY	3,417,419,609	BNP Paribas	14/9/2017	304,901
AUD	9,058,030	USD	7,000,000	HSBC Bank Plc	15/9/2017	164,038
JPY	3,176,164,300	USD	28,714,724	UBS	15/9/2017	79,036
JPY	12,962,635,700	USD	117,857,136	HSBC Bank Plc	15/9/2017	(343,374)
MYR	10,296,375	USD	2,384,524	UBS	15/9/2017	26,005
MYR	6,118,308	USD	1,417,916	Goldman Sachs	15/9/2017	14,468
RUB	642,864,800	USD	10,673,029	Goldman Sachs	15/9/2017	341,080
RUB	762,485,128	USD	12,664,740	Citibank	15/9/2017	398,806
RUB	335,709,372	USD	5,621,013	Morgan Stanley	15/9/2017	130,647
RUB	213,525,244	USD	3,500,414	Societe Generale	15/9/2017	157,883
RUB	858,737,673	USD	14,079,645	Credit Suisse	15/9/2017	632,984
RUB	753,862,500	USD	12,340,840	HSBC Bank Plc	15/9/2017	574,977
RUB	482,037,200	USD	7,917,884	JP Morgan	15/9/2017	340,790
USD	7,000,000	AUD	9,284,989	Deutsche Bank	15/9/2017	(343,541)
USD	29,676,515	IDR	399,280,280,136	Deutsche Bank	15/9/2017	(221,449)
USD	1,176,122	INR	76,415,000	HSBC Bank Plc	15/9/2017	(17,134)
USD	28,054,465	INR	1,794,055,000	Barclays	15/9/2017	39,455
USD	65,844,494	INR	4,213,439,517	Citibank	15/9/2017	49,659
USD	1,228,828	INR	79,840,000	Goldman Sachs	15/9/2017	(17,911)
USD	2,990,000	JPY	332,790,588	Credit Suisse	15/9/2017	(26,938)
USD	137,482,305	JPY	16,138,800,000	Bank of America	15/9/2017	(8,825,215)
USD	4,089,708	KRW	4,585,666,347	Bank of America	15/9/2017	20,116

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	3,510,540	MYR	15,155,000	Goldman Sachs	15/9/2017	(37,463)
USD	5,505,271	RUB	326,836,949	HSBC Bank Plc	15/9/2017	(94,379)
USD	5,487,179	RUB	333,945,858	Credit Suisse	15/9/2017	(234,266)
USD	76,342,217	RUB	4,434,181,476	Deutsche Bank	15/9/2017	372,031
USD	34,449,507	RUB	1,997,795,798	JP Morgan	15/9/2017	221,562
USD	30,489,958	RUB	1,768,036,469	BNP Paribas	15/9/2017	198,446
USD	2,506,127	THB	85,438,878	BNY Mellon	15/9/2017	(67,130)
USD	4,096,227	TWD	122,985,118	Barclays	15/9/2017	15,527
USD	4,887,000	ZAR	64,070,334	Goldman Sachs	15/9/2017	(27,467)
EUR	4,245,000	USD	5,119,071	BNP Paribas	18/9/2017	(83,220)
TRY	35,867,554	EUR	8,677,000	Citibank	18/9/2017	36,428
ARS	42,204,800	USD	2,398,000	Citibank	19/9/2017	8,353
ARS	56,288,000	USD	3,200,000	BNP Paribas	19/9/2017	9,323
USD	5,598,000	ARS	93,794,490	BNP Paribas	19/9/2017	250,204
AUD	7,230,000	CAD	7,208,397	Citibank	20/9/2017	(22,072)
AUD	4,590,000	JPY	397,705,140	JP Morgan	20/9/2017	23,759
AUD	6,455,000	JPY	556,355,804	Citibank	20/9/2017	60,109
AUD	1,238,462	JPY	107,343,554	Goldman Sachs	20/9/2017	6,086
AUD	3,361,538	JPY	291,344,538	Morgan Stanley	20/9/2017	16,669
AUD	16,260,500	NZD	17,380,729	Morgan Stanley	20/9/2017	432,949
AUD	1,251,250	NZD	1,334,201	Credit Suisse	20/9/2017	35,640
AUD	12,400,000	NZD	13,398,178	Goldman Sachs	20/9/2017	227,269
AUD	13,818,750	NZD	14,739,208	Deutsche Bank	20/9/2017	390,495
AUD	7,158,750	NZD	7,640,934	JP Morgan	20/9/2017	198,473
AUD	6,780,750	NZD	7,130,486	Bank of America	20/9/2017	264,486
AUD	4,585,000	NZD	4,790,500	Citibank	20/9/2017	200,994
AUD	434,000	USD	347,747	Societe Generale	20/9/2017	(4,514)
AUD	29,620,000	USD	23,615,094	BNP Paribas	20/9/2017	(189,860)
AUD	3,575,000	USD	2,858,359	UBS	20/9/2017	(31,039)
AUD	2,681,250	USD	2,129,543	Goldman Sachs	20/9/2017	(9,053)
AUD	2,323,750	USD	1,845,611	HSBC Bank Plc	20/9/2017	(7,853)
AUD	25,810,000	USD	20,328,841	Deutsche Bank	20/9/2017	83,220
AUD	15,636,000	USD	12,258,663	Barclays	20/9/2017	107,203
AUD	29,150,000	USD	22,919,018	Citibank	20/9/2017	134,511
AUD	7,070,000	USD	5,550,389	JP Morgan	20/9/2017	40,982
AUD	20,428,000	USD	16,000,637	Morgan Stanley	20/9/2017	155,024
BRL	16,249,310	USD	5,170,000	BNP Paribas	20/9/2017	(7,244)
BRL	11,186,019	USD	3,510,000	JP Morgan	20/9/2017	44,039
CAD	9,090,828	AUD	9,090,000	JP Morgan	20/9/2017	50,038
CAD	2,884,609	EUR	1,966,250	Morgan Stanley	20/9/2017	(35,827)
CAD	6,555,813	EUR	4,468,750	JP Morgan	20/9/2017	(81,518)
CAD	6,435,000	NOK	40,401,201	Citibank	20/9/2017	(50,733)
CAD	6,430,000	NOK	40,687,575	Morgan Stanley	20/9/2017	(91,395)
CAD	9,270,000	NOK	59,038,313	JP Morgan	20/9/2017	(180,418)

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
CAD	22,073,472	USD	17,604,000	HSBC Bank Plc	20/9/2017	(27,096)
CAD	16,193,906	USD	12,755,000	Goldman Sachs	20/9/2017	140,060
CAD	3,914,599	USD	3,100,000	JP Morgan	20/9/2017	17,160
CAD	7,741,026	USD	6,000,000	BNP Paribas	20/9/2017	164,108
CAD	9,217,095	USD	6,952,500	UBS	20/9/2017	386,989
CAD	33,369,002	USD	26,077,500	Deutsche Bank	20/9/2017	493,931
CAD	33,201,360	USD	26,045,000	Citibank	20/9/2017	392,939
CHF	3,720,000	NOK	32,471,043	JP Morgan	20/9/2017	(304,505)
CHF	5,170,000	NOK	45,337,876	Citibank	20/9/2017	(450,109)
CHF	2,021,186	USD	2,100,000	Citibank	20/9/2017	(5,676)
EUR	6,435,000	CAD	9,452,841	JP Morgan	20/9/2017	107,456
EUR	11,470,000	GBP	10,380,181	Goldman Sachs	20/9/2017	245,200
EUR	10,330,000	JPY	1,330,051,029	HSBC Bank Plc	20/9/2017	195,264
EUR	21,910,200	JPY	2,729,887,346	Barclays	20/9/2017	1,241,007
EUR	3,215,000	NOK	29,928,888	Standard Chartered Bank	20/9/2017	(19,131)
EUR	3,215,000	NOK	29,928,249	BNP Paribas	20/9/2017	(19,049)
EUR	9,210,462	NOK	87,158,099	Citibank	20/9/2017	(236,256)
EUR	4,946,538	NOK	47,015,082	Deutsche Bank	20/9/2017	(153,302)
EUR	3,170,000	SEK	30,502,296	JP Morgan	20/9/2017	(63,005)
EUR	3,195,000	SEK	30,685,349	Bank of America	20/9/2017	(56,294)
EUR	13,050,000	SEK	125,829,002	Goldman Sachs	20/9/2017	(291,923)
EUR	5,170,000	SEK	50,392,905	Morgan Stanley	20/9/2017	(183,776)
EUR	5,170,000	SEK	50,134,007	HSBC Bank Plc	20/9/2017	(151,319)
EUR	3,720,000	TRY	15,566,355	Morgan Stanley	20/9/2017	(67,069)
EUR	17,350,000	USD	20,183,533	Morgan Stanley	20/9/2017	401,000
EUR	1,785,000	USD	2,060,167	Credit Suisse	20/9/2017	57,608
EUR	16,425,553	USD	19,271,673	Barclays	20/9/2017	216,070
EUR	3,215,000	USD	3,818,248	Standard Chartered Bank	20/9/2017	(3,881)
EUR	4,650,000	USD	5,517,448	Bank of America	20/9/2017	(556)
EUR	26,509,000	USD	31,213,497	Deutsche Bank	20/9/2017	237,533
EUR	38,671,000	USD	43,256,569	Toronto Dominion	20/9/2017	2,623,805
EUR	23,285,000	USD	27,161,230	BNP Paribas	20/9/2017	464,756
EUR	21,021,900	USD	24,369,711	JP Morgan	20/9/2017	571,268
EUR	14,895,000	USD	17,692,615	RBS Plc	20/9/2017	(20,764)
EUR	14,873,654	USD	17,259,593	Goldman Sachs	20/9/2017	386,932
EUR	50,139,100	USD	58,319,644	Citibank	20/9/2017	1,166,809
GBP	10,052,652	EUR	11,470,000	Barclays	20/9/2017	(666,851)
GBP	7,340,000	MXN	172,237,246	JP Morgan	20/9/2017	(211,063)
GBP	8,890,000	USD	11,593,920	JP Morgan	20/9/2017	(149,201)
GBP	4,130,000	USD	5,354,359	Deutsche Bank	20/9/2017	(37,521)
GBP	200,000	USD	259,145	Goldman Sachs	20/9/2017	(1,671)
GBP	5,903,086	USD	7,620,473	BNP Paribas	20/9/2017	(21,016)
JPY	556,259,625	AUD	6,455,000	Deutsche Bank	20/9/2017	(60,981)

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
JPY	795,105,015	AUD	9,190,000	Credit Suisse	20/9/2017	(58,195)
JPY	830,975,315	EUR	6,410,200	BNP Paribas	20/9/2017	(70,185)
JPY	1,283,647,120	EUR	10,330,000	Bank of America	20/9/2017	(616,042)
JPY	1,929,450,695	EUR	15,500,000	Citibank	20/9/2017	(893,906)
JPY	423,473,268	USD	3,720,000	UBS	20/9/2017	119,941
JPY	1,459,168,582	USD	12,997,620	RBS Plc	20/9/2017	233,725
JPY	418,473,216	USD	3,720,000	JP Morgan	20/9/2017	74,601
JPY	488,307,600	USD	4,500,000	Goldman Sachs	20/9/2017	(72,159)
JPY	4,851,341,011	USD	43,909,000	HSBC Bank Plc	20/9/2017	81,643
JPY	518,065,038	USD	4,590,000	Credit Suisse	20/9/2017	107,673
JPY	2,323,315,733	USD	21,065,000	Deutsche Bank	20/9/2017	2,196
JPY	3,444,263,449	USD	31,388,673	Citibank	20/9/2017	(157,028)
JPY	391,851,711	USD	3,504,550	Barclays	20/9/2017	48,655
JPY	630,670,031	USD	5,625,000	Morgan Stanley	20/9/2017	93,745
JPY	869,003,624	USD	7,750,000	BNP Paribas	20/9/2017	129,888
KRW	9,927,463,000	USD	8,890,000	BNP Paribas	20/9/2017	(76,976)
KRW	4,634,025,200	USD	4,130,000	HSBC Bank Plc	20/9/2017	(16,182)
KRW	597,220,000	USD	520,000	Citibank	20/9/2017	10,177
KRW	9,969,037,100	USD	8,890,000	Deutsche Bank	20/9/2017	(40,070)
KRW	4,723,894,000	USD	4,130,000	JP Morgan	20/9/2017	63,598
MXN	88,066,164	GBP	3,720,000	JP Morgan	20/9/2017	150,396
MXN	84,548,720	GBP	3,620,000	Deutsche Bank	20/9/2017	81,848
MXN	64,726,847	NZD	5,005,000	Morgan Stanley	20/9/2017	51,912
MXN	52,487,048	USD	2,830,000	Citibank	20/9/2017	113,868
MXN	199,385,495	USD	11,066,429	Goldman Sachs	20/9/2017	116,608
MXN	53,740,245	USD	3,000,000	RBS Plc	20/9/2017	14,157
MXN	247,066,449	USD	13,840,000	BNP Paribas	20/9/2017	17,343
MXN	179,388,533	USD	9,894,760	JP Morgan	20/9/2017	166,697
MXN	500,058,829	USD	27,534,000	Barclays	20/9/2017	513,057
MXN	75,240,976	USD	4,130,000	Morgan Stanley	20/9/2017	90,079
MXN	137,992,190	USD	7,650,000	Deutsche Bank	20/9/2017	89,639
NOK	22,746,980	CAD	3,580,000	Barclays	20/9/2017	62,869
NOK	59,186,118	CAD	9,285,000	JP Morgan	20/9/2017	187,405
NOK	59,730,195	CAD	9,270,000	Citibank	20/9/2017	269,039
NOK	32,854,735	CHF	3,720,000	Morgan Stanley	20/9/2017	353,651
NOK	45,420,001	CHF	5,170,000	UBS	20/9/2017	460,628
NOK	13,288,001	EUR	1,428,889	BNP Paribas	20/9/2017	6,744
NOK	8,312,558	EUR	893,056	JP Morgan	20/9/2017	5,183
NOK	8,312,667	EUR	893,056	Bank of America	20/9/2017	5,197
NOK	30,076,725	EUR	3,208,111	Citibank	20/9/2017	46,240
NOK	43,553,610	EUR	4,618,889	Goldman Sachs	20/9/2017	98,665
NOK	74,398,293	EUR	7,780,000	Deutsche Bank	20/9/2017	299,033
NOK	16,823,980	EUR	1,765,000	Barclays	20/9/2017	60,885
NOK	31,000,000	SEK	31,599,850	JP Morgan	20/9/2017	9,113

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益 / (損) (米ドル)
NOK	29,630,350	USD	3,720,000	BNP Paribas	20/9/2017	75,260
NOK	33,003,867	USD	4,130,000	Morgan Stanley	20/9/2017	97,363
NOK	62,825,191	USD	8,047,059	Bank of America	20/9/2017	25
NOK	22,468,862	USD	2,711,379	Deutsche Bank	20/9/2017	166,588
NOK	46,561,733	USD	5,582,739	JP Morgan	20/9/2017	381,209
NOK	75,767,334	USD	9,448,824	Barclays	20/9/2017	255,979
NOK	26,887,436	USD	3,185,000	RBS Plc	20/9/2017	258,928
NZD	7,634,682	AUD	7,139,444	Bank of America	20/9/2017	(187,675)
NZD	1,926,080	AUD	1,787,500	Nomura	20/9/2017	(36,559)
NZD	5,584,686	AUD	5,170,000	HSBC Bank Plc	20/9/2017	(95,822)
NZD	8,050,733	AUD	7,600,000	Morgan Stanley	20/9/2017	(254,444)
NZD	13,263,215	AUD	12,430,000	JP Morgan	20/9/2017	(347,490)
NZD	13,256,344	AUD	12,400,000	Deutsche Bank	20/9/2017	(328,677)
NZD	32,273,395	AUD	29,988,056	Citibank	20/9/2017	(641,604)
NZD	5,005,000	MXN	64,562,083	BNP Paribas	20/9/2017	(42,671)
NZD	12,400,000	USD	9,148,229	HSBC Bank Plc	20/9/2017	(282,523)
NZD	6,200,000	USD	4,467,931	JP Morgan	20/9/2017	(35,078)
NZD	14,632,500	USD	10,664,673	Deutsche Bank	20/9/2017	(202,783)
NZD	2,947,500	USD	2,124,502	Citibank	20/9/2017	(17,110)
RUB	109,350,000	USD	1,800,000	Societe Generale	20/9/2017	71,559
RUB	109,314,000	USD	1,800,000	JP Morgan	20/9/2017	70,942
RUB	192,288,000	USD	3,200,000	Credit Suisse Commonwealth	20/9/2017	91,068
SEK	62,022,399	EUR	6,365,000	Bank of Australia	20/9/2017	223,950
SEK	42,292,976	EUR	4,350,000	Goldman Sachs	20/9/2017	141,183
SEK	100,751,652	EUR	10,340,000	HSBC Bank Plc	20/9/2017	363,270
SEK	227,542,595	EUR	23,660,000	Morgan Stanley	20/9/2017	455,454
SEK	31,546,286	NOK	31,000,000	BNP Paribas	20/9/2017	(15,828)
SEK	33,539,499	USD	4,130,000	Morgan Stanley	20/9/2017	74,749
SEK	63,989,275	USD	7,850,000	Deutsche Bank	20/9/2017	172,149
TRY	15,363,600	EUR	3,720,000	JP Morgan	20/9/2017	8,709
TRY	2,571,851	USD	720,000	Citibank	20/9/2017	20,276
TRY	119,867,574	USD	33,472,184	Barclays	20/9/2017	1,030,218
TRY	11,506,880	USD	3,200,000	Morgan Stanley	20/9/2017	112,113
TRY	24,738,000	USD	6,820,000	BNP Paribas	20/9/2017	300,528
TRY	6,450,481	USD	1,801,300	Goldman Sachs	20/9/2017	55,392
TWD	96,939,576	USD	3,227,500	HSBC Bank Plc	20/9/2017	(9,027)
TWD	97,389,813	USD	3,227,500	Standard Chartered Bank	20/9/2017	5,921
USD	43,051,070	AUD	54,208,000	Morgan Stanley	20/9/2017	180,204
USD	12,845,084	AUD	16,270,000	Bank of America	20/9/2017	(22,187)
USD	4,081,974	AUD	5,170,000	Deutsche Bank	20/9/2017	(6,766)
USD	3,625,850	AUD	4,550,000	BNP Paribas	20/9/2017	27,443
USD	10,383,426	AUD	13,680,000	Barclays	20/9/2017	(435,520)
USD	26,808,877	AUD	33,720,000	Citibank	20/9/2017	141,123

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	4,747,251	AUD	6,030,000	HSBC Bank Plc	20/9/2017	(21,627)
USD	2,380,000	BRL	7,500,332	JP Morgan	20/9/2017	(3,017)
USD	8,060,000	BRL	26,008,073	BNP Paribas	20/9/2017	(203,325)
USD	3,176,471	CAD	4,105,698	State Street	20/9/2017	(92,859)
USD	7,263,529	CAD	9,269,998	BNP Paribas	20/9/2017	(118,086)
USD	21,798,000	CAD	28,132,450	Goldman Sachs	20/9/2017	(603,613)
USD	6,535,000	CAD	8,308,344	RBS Plc	20/9/2017	(80,859)
USD	1,775,000	CAD	2,256,427	Barclays	20/9/2017	(21,772)
USD	9,300,000	CAD	11,810,963	Deutsche Bank	20/9/2017	(104,963)
USD	8,160,000	CAD	10,547,425	Credit Suisse	20/9/2017	(238,819)
USD	11,600,000	CAD	15,225,167	HSBC Bank Plc	20/9/2017	(523,661)
USD	7,520,000	CAD	9,832,950	Bank of America	20/9/2017	(309,888)
USD	6,465,000	CAD	8,208,897	JP Morgan	20/9/2017	(71,670)
USD	11,740,000	CAD	14,986,654	Morgan Stanley	20/9/2017	(193,736)
USD	10,780,000	CAD	13,693,787	Citibank	20/9/2017	(124,237)
USD	4,130,000	CHF	3,983,344	Morgan Stanley	20/9/2017	2,517
USD	2,100,000	CHF	2,004,476	Goldman Sachs	20/9/2017	22,991
USD	7,644,393	EUR	6,500,000	BNP Paribas	20/9/2017	(67,392)
USD	16,465,615	EUR	13,954,000	UBS	20/9/2017	(89,808)
USD	7,627,228	EUR	6,455,000	RBS Plc	20/9/2017	(31,167)
USD	21,078,572	EUR	17,640,000	Goldman Sachs	20/9/2017	149,975
USD	34,897,722	EUR	29,660,000	HSBC Bank Plc	20/9/2017	(291,745)
USD	21,300,473	EUR	18,380,000	Bank of America	20/9/2017	(506,082)
USD	58,897,973	EUR	51,651,566	Morgan Stanley	20/9/2017	(2,382,912)
USD	45,248,715	EUR	40,210,000	Barclays	20/9/2017	(2,457,571)
USD	23,874,160	EUR	20,670,000	Citibank	20/9/2017	(649,315)
USD	12,739,249	EUR	11,030,000	Deutsche Bank	20/9/2017	(347,056)
USD	13,532,734	EUR	11,680,000	JP Morgan	20/9/2017	(324,750)
USD	2,300,000	GBP	1,765,686	HSBC Bank Plc	20/9/2017	26,909
USD	6,748,815	GBP	5,170,000	UBS	20/9/2017	93,112
USD	5,549,784	GBP	4,330,000	Bank of America	20/9/2017	(24,529)
USD	4,783,191	GBP	3,720,000	Morgan Stanley	20/9/2017	(5,825)
USD	7,853,333	JPY	869,673,369	JP Morgan	20/9/2017	(32,629)
USD	2,890,000	JPY	328,315,560	Morgan Stanley	20/9/2017	(87,076)
USD	3,720,000	JPY	419,366,760	HSBC Bank Plc	20/9/2017	(82,704)
USD	723,333	JPY	78,783,802	Nomura	20/9/2017	8,943
USD	4,550,000	JPY	499,849,350	RBS Plc	20/9/2017	17,502
USD	28,790,000	JPY	3,163,017,474	Citibank	20/9/2017	108,616
USD	8,164,550	JPY	900,549,209	Deutsche Bank	20/9/2017	(1,385)
USD	4,971,000	JPY	560,481,306	Barclays	20/9/2017	(111,293)
USD	23,938,000	JPY	2,657,678,149	Credit Suisse	20/9/2017	(161,104)
USD	20,365,000	JPY	2,282,265,685	Goldman Sachs	20/9/2017	(329,965)
USD	21,505,000	JPY	2,385,810,933	BNP Paribas	20/9/2017	(128,885)
USD	4,130,000	KRW	4,653,890,500	BNP Paribas	20/9/2017	(1,453)

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	18,180,000	KRW	20,439,388,000	JP Morgan	20/9/2017	35,100
USD	3,720,000	KRW	4,248,054,000	Deutsche Bank	20/9/2017	(51,175)
USD	3,180,000	MXN	58,399,707	Morgan Stanley	20/9/2017	(95,494)
USD	5,170,000	MXN	93,256,460	Barclays	20/9/2017	(60,523)
USD	10,330,000	MXN	186,478,193	JP Morgan	20/9/2017	(129,098)
USD	10,550,970	MXN	188,704,085	Citibank	20/9/2017	(32,973)
USD	5,170,000	MXN	93,869,105	BNP Paribas	20/9/2017	(94,885)
USD	18,490,000	MXN	334,082,581	RBS Plc	20/9/2017	(247,862)
USD	12,934,030	MXN	231,567,870	Goldman Sachs	20/9/2017	(54,037)
USD	4,470,000	NOK	35,315,003	RBS Plc	20/9/2017	(53,389)
USD	2,200,000	NOK	17,396,850	Barclays	20/9/2017	(28,308)
USD	3,720,000	NOK	29,298,860	Morgan Stanley	20/9/2017	(32,800)
USD	4,470,000	NOK	35,341,487	JP Morgan	20/9/2017	(56,781)
USD	9,165,000	NOK	74,578,108	Bank of America	20/9/2017	(387,477)
USD	8,378,200	NOK	70,457,638	Deutsche Bank	20/9/2017	(646,499)
USD	4,750,000	NOK	38,773,893	UBS	20/9/2017	(216,428)
USD	3,391,800	NOK	28,454,161	HSBC Bank Plc	20/9/2017	(252,805)
USD	4,527,184	NZD	6,200,000	Citibank	20/9/2017	94,332
USD	4,489,389	NZD	6,200,000	Deutsche Bank	20/9/2017	56,536
USD	12,128,143	NZD	16,550,000	HSBC Bank Plc	20/9/2017	295,286
USD	5,278,747	NZD	7,230,000	BNP Paribas	20/9/2017	109,469
USD	1,800,000	RUB	106,893,000	Societe Generale	20/9/2017	(29,506)
USD	5,000,000	RUB	297,010,000	Deutsche Bank	20/9/2017	(83,417)
USD	100,000	RUB	6,031,850	BNP Paribas	20/9/2017	(3,237)
USD	705,000	SEK	5,722,976	Citibank	20/9/2017	(12,473)
USD	2,120,000	SEK	17,069,907	Barclays	20/9/2017	(20,004)
USD	5,300,000	SEK	42,706,453	BNP Paribas	20/9/2017	(53,983)
USD	3,100,000	SEK	25,795,100	UBS	20/9/2017	(133,856)
USD	10,055,000	SEK	81,232,639	Deutsche Bank	20/9/2017	(128,898)
USD	185,000	TRY	665,075	BNP Paribas	20/9/2017	(6,434)
USD	921,212	TRY	3,299,533	JP Morgan	20/9/2017	(28,518)
USD	1,197,576	TRY	4,289,121	Credit Suisse	20/9/2017	(36,995)
USD	3,595,000	TRY	12,921,847	Morgan Stanley	20/9/2017	(124,394)
USD	16,536,919	TRY	59,651,194	Bank of America	20/9/2017	(632,941)
USD	13,902,381	TRY	50,032,585	Citibank	20/9/2017	(498,881)
USD	54,489,130	TRY	194,070,423	Barclays	20/9/2017	(1,371,646)
USD	6,455,000	TWD	194,747,350	JP Morgan	20/9/2017	(10,770)
USD	10,800,000	ZAR	142,137,501	BNP Paribas	20/9/2017	(93,660)
USD	4,440,000	ZAR	59,072,646	Deutsche Bank	20/9/2017	(87,428)
USD	4,130,000	ZAR	55,221,701	Standard Chartered Bank	20/9/2017	(102,285)
USD	18,545,549	ZAR	245,870,955	Citibank	20/9/2017	(298,420)
USD	13,113,400	ZAR	172,547,155	JP Morgan	20/9/2017	(110,907)
USD	12,631,676	ZAR	166,117,931	Bank of America	20/9/2017	(99,884)
ZAR	45,178,931	USD	3,430,000	Barclays	20/9/2017	32,590

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
ZAR	59,343,264	USD	4,440,000	JP Morgan	20/9/2017	108,169
ZAR	380,378,754	USD	28,620,780	Citibank	20/9/2017	532,095
ZAR	162,889,711	USD	12,395,000	Deutsche Bank	20/9/2017	89,145
ZAR	77,011,863	USD	5,790,000	BNP Paribas	20/9/2017	112,320
ZAR	31,502,798	USD	2,400,000	Goldman Sachs	20/9/2017	14,428
CLP	5,090,764,800	USD	7,860,000	Deutsche Bank	21/9/2017	228,271
CLP	2,645,430,000	USD	4,045,000	BNP Paribas	21/9/2017	158,093
MXN	101,118,200	USD	5,680,000	BNP Paribas	21/9/2017	(9,447)
TRY	1,615,886	USD	466,500	BNP Paribas	21/9/2017	(1,521)
TRY	86,770,827	USD	24,432,000	HSBC Bank Plc	21/9/2017	536,731
USD	4,762,000	CLP	3,059,108,800	RBS Plc	21/9/2017	(98,351)
USD	7,143,000	CLP	4,620,925,700	Credit Suisse	21/9/2017	(198,785)
USD	5,680,000	MXN	101,444,471	Goldman Sachs	21/9/2017	(8,850)
USD	18,015,000	TRY	62,407,563	Deutsche Bank	21/9/2017	56,917
USD	6,883,500	TRY	24,461,921	HSBC Bank Plc	21/9/2017	(155,538)
BRL	5,730,300	USD	1,800,000	Goldman Sachs	22/9/2017	20,047
BRL	10,896,100	USD	3,400,000	RBS Plc	22/9/2017	60,798
KRW	8,986,400,000	USD	8,000,000	Morgan Stanley	22/9/2017	(21,388)
RUB	10,620,000	USD	180,000	BNP Paribas	22/9/2017	1,690
RUB	412,001,036	USD	6,856,000	JP Morgan	22/9/2017	192,631
USD	4,500,000	KRW	5,128,200,000	JP Morgan	22/9/2017	(53,093)
USD	5,377,778	KRW	6,100,156,447	HSBC Bank Plc	22/9/2017	(38,271)
ARS	36,404,195	USD	2,111,000	BNP Paribas	25/9/2017	(41,767)
USD	2,111,000	ARS	35,802,560	JP Morgan	25/9/2017	75,964
USD	5,680,000	CAD	7,133,411	BNP Paribas	25/9/2017	(596)
BRL	5,656,000	USD	1,750,000	Deutsche Bank	26/9/2017	45,277
CAD	6,905,038	USD	5,200,000	BNP Paribas	26/9/2017	298,797
CAD	2,911,446	USD	2,160,000	JP Morgan	26/9/2017	158,517
EUR	1,914,051	USD	2,190,000	Morgan Stanley	26/9/2017	81,612
JPY	246,992,580	USD	2,190,000	Morgan Stanley	26/9/2017	50,300
MXN	33,218,710	USD	1,750,000	Deutsche Bank	26/9/2017	111,351
RUB	102,060,000	USD	1,750,000	Societe Generale	26/9/2017	(5,362)
TRY	7,646,730	USD	2,100,000	BNP Paribas	26/9/2017	97,220
TRY	6,722,345	USD	1,750,000	JP Morgan	26/9/2017	181,606
USD	1,750,000	BRL	5,890,500	RBS Plc	26/9/2017	(119,710)
USD	438,000	CAD	579,982	Goldman Sachs	26/9/2017	(23,866)
USD	1,752,000	CAD	2,319,846	Bank of America	26/9/2017	(95,399)
USD	2,190,000	EUR	2,043,845	Bank of America	26/9/2017	(235,652)
USD	1,752,000	JPY	190,075,356	Credit Suisse	26/9/2017	27,957
USD	438,000	JPY	47,521,686	JP Morgan	26/9/2017	6,963
USD	1,700,000	MXN	31,470,106	BNP Paribas	26/9/2017	(63,371)
USD	1,750,000	RUB	102,373,950	JP Morgan	26/9/2017	(5)
USD	3,850,000	TRY	14,290,523	BNP Paribas	26/9/2017	(256,254)
USD	1,750,000	ZAR	23,841,244	BNP Paribas	26/9/2017	(75,444)

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
ZAR	24,166,275	USD	1,750,000	JP Morgan	26/9/2017	100,330
IDR	287,183,229,000	USD	21,398,000	BNP Paribas	27/9/2017	83,767
RUB	7,442,820	USD	126,000	BNP Paribas	28/9/2017	1,177
RUB	284,268,765	USD	4,799,000	Deutsche Bank	28/9/2017	58,361
TRY	1,049,464	USD	302,400	BNP Paribas	28/9/2017	(1,020)
TRY	35,148,115	USD	10,011,600	HSBC Bank Plc	28/9/2017	82,078
BRL	21,433,410	USD	6,756,000	Deutsche Bank	3/10/2017	39,436
USD	19,813,964	DKK	123,441,098	Morgan Stanley	4/10/2017	109,260
USD	295,031,142	EUR	247,161,000	Deutsche Bank	4/10/2017	1,573,023
USD	253,033,558	GBP	195,650,000	UBS	4/10/2017	1,036,358
COP	32,205,878,580	USD	10,898,000	Credit Suisse	6/10/2017	(23,851)
USD	5,605,000	COP	16,627,566,160	RBS Plc	6/10/2017	(9,212)
USD	10,898,000	COP	32,530,530,000	BNP Paribas	6/10/2017	(85,766)
ARS	99,644,400	USD	5,598,000	Citibank	10/10/2017	20,781
USD	7,112,692	KRW	8,000,000,000	HSBC Bank Plc	10/10/2017	4,054
ARS	123,510,750	USD	6,945,000	BNP Paribas	11/10/2017	15,679
USD	4,380,000	ARS	80,044,500	BNP Paribas	11/10/2017	(131,057)
USD	2,565,000	ARS	46,888,200	RBS Plc	11/10/2017	(77,472)
USD	22,231,255	EUR	18,679,112	Goldman Sachs	11/10/2017	44,668
USD	88,476	AUD	111,000	Deutsche Bank	13/10/2017	716
USD	4,469,916	AUD	5,663,000	Barclays	13/10/2017	(7,443)
JPY	10,067,284	USD	90,000	Morgan Stanley	23/10/2017	1,430
JPY	386,849,750	USD	3,500,000	Goldman Sachs	23/10/2017	13,345
USD	18,136,022	MXN	325,260,486	Goldman Sachs	23/10/2017	(7,966)
USD	89,485,212	TRY	324,937,000	BNP Paribas	23/10/2017	(3,134,317)
IDR	35,550,758,732	USD	2,646,524	Citibank	26/10/2017	4,626
IDR	47,125,424,602	USD	3,507,661	Deutsche Bank	26/10/2017	6,655
IDR	93,545,621,508	USD	6,963,351	BNP Paribas	26/10/2017	12,688
IDR	47,779,472,158	USD	3,556,873	Morgan Stanley	26/10/2017	6,218
USD	14,133,787	IDR	190,290,246,964	BNP Paribas	26/10/2017	(56,856)
USD	34,408,600	IDR	462,517,123,136	Deutsche Bank	26/10/2017	(82,999)
USD	3,050,595	IDR	41,219,637,030	Bank of America	26/10/2017	(23,305)
USD	2,577,558	IDR	34,688,776,976	Goldman Sachs	26/10/2017	(9,311)
USD	14,162,274	IDR	190,543,430,001	JP Morgan	26/10/2017	(47,249)
USD	6,166,425	IDR	82,920,159,800	UBS	26/10/2017	(17,235)
USD	10,293,586	IDR	138,416,303,842	Barclays	26/10/2017	(28,625)
USD	2,043,200	EUR	1,702,758	JP Morgan	27/10/2017	18,916
USD	888,292	EUR	752,775	Morgan Stanley	3/11/2017	(6,974)
USD	6,663,443	EUR	5,647,225	Credit Suisse	3/11/2017	(52,728)
USD	20,667,535	GBP	15,600,000	Barclays	3/11/2017	554,455
USD	4,400,000	JPY	486,536,600	Goldman Sachs	10/11/2017	(22,393)
BRL	3,271,692	USD	1,030,000	Morgan Stanley	14/11/2017	1,281
KRW	2,758,752,000	USD	2,480,000	Morgan Stanley	14/11/2017	(27,908)
USD	2,090,000	JPY	231,770,550	HSBC Bank Plc	14/11/2017	(17,066)

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	1,250,000	KRW	1,427,500,000	UBS	14/11/2017	(18,821)
CAD	1,366,158	USD	1,082,848	Deutsche Bank	15/11/2017	5,610
CAD	1,533,842	USD	1,213,365	Barclays	15/11/2017	8,691
CHF	22,840,000	EUR	20,012,793	Credit Suisse	15/11/2017	(62,107)
CHF	21,460,000	EUR	18,933,713	Bank of America	15/11/2017	(213,174)
CHF	20,645,000	USD	21,572,848	Deutsche Bank	15/11/2017	(102,310)
EUR	3,190,129	SEK	30,300,000	Citibank	15/11/2017	(14,426)
EUR	1,814,012	SEK	17,204,002	Bank of America	15/11/2017	(4,986)
EUR	3,933,246	SEK	37,295,998	Barclays	15/11/2017	(9,968)
EUR	8,355,000	USD	9,900,324	Barclays	15/11/2017	42,207
GBP	900,000	USD	1,156,990	UBS	15/11/2017	3,794
GBP	5,101,108	USD	6,581,969	Barclays	15/11/2017	(2,765)
GBP	77,338,892	USD	100,504,365	Bank of America	15/11/2017	(755,755)
JPY	957,070,000	USD	8,755,399	Barclays	15/11/2017	(54,117)
JPY	374,000,000	USD	3,428,205	Deutsche Bank	15/11/2017	(27,953)
MXN	6,443,260	USD	358,114	Deutsche Bank	15/11/2017	8
MXN	21,241,740	USD	1,181,063	RBS Plc	15/11/2017	(427)
MXN	39,300,000	USD	2,168,575	Barclays	15/11/2017	15,757
RUB	493,875,000	USD	8,063,924	Morgan Stanley	15/11/2017	300,689
SEK	24,826,069	EUR	2,599,010	Deutsche Bank	15/11/2017	29,429
SEK	5,503,931	EUR	576,441	Credit Suisse	15/11/2017	6,237
SEK	165,772,973	EUR	17,243,581	UBS	15/11/2017	328,576
SEK	72,960,000	USD	9,002,073	Citibank	15/11/2017	173,815
TRY	15,880,000	USD	4,370,742	JP Morgan	15/11/2017	125,976
USD	1,221,007	CAD	1,550,000	Barclays	15/11/2017	(13,923)
USD	3,344,640	CAD	4,240,000	UBS	15/11/2017	(33,491)
USD	31,952,392	EUR	26,965,000	Barclays	15/11/2017	(136,219)
USD	1,146,608	GBP	890,000	Barclays	15/11/2017	(1,278)
USD	27,898,429	GBP	21,460,000	Bank of America	15/11/2017	220,179
USD	1,849,692	IDR	24,863,555,000	HSBC Bank Plc	15/11/2017	(88)
USD	1,849,829	IDR	24,863,555,502	BNP Paribas	15/11/2017	50
USD	2,456,922	IDR	33,156,160,000	Goldman Sachs	15/11/2017	(9,804)
USD	3,937,226	IDR	53,044,160,000	Bank of America	15/11/2017	(9,111)
USD	83,850,143	INR	5,389,467,921	HSBC Bank Plc	15/11/2017	289,805
USD	4,550,353	JPY	494,000,000	Deutsche Bank	15/11/2017	59,111
USD	5,474,730	JPY	594,000,000	Citibank	15/11/2017	74,329
USD	4,717,459	JPY	512,000,000	Barclays	15/11/2017	62,568
USD	9,145,823	JPY	994,000,000	Bank of America	15/11/2017	108,788
USD	1,527,059	MXN	27,300,000	Citibank	15/11/2017	9,699
USD	9,747,335	RUB	594,875,000	JP Morgan	15/11/2017	(327,884)
USD	9,720,897	RUB	594,880,000	Goldman Sachs	15/11/2017	(354,407)
USD	53,378,148	TRY	193,014,000	BNP Paribas	20/11/2017	(1,203,414)
ARS	55,720,900	USD	3,102,500	Citibank	21/11/2017	(34,115)
USD	3,102,500	ARS	51,459,927	Citibank	21/11/2017	268,755

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
IDR	62,010,220,000	USD	4,607,000	HSBC Bank Plc	22/11/2017	2,388
IDR	61,964,150,000	USD	4,607,000	JP Morgan	29/11/2017	(5,115)
AUD	9,415,000	NZD	10,336,380	Goldman Sachs	20/12/2017	59,404
AUD	4,715,000	NZD	5,121,791	Morgan Stanley	20/12/2017	68,745
AUD	4,720,000	USD	3,758,223	Morgan Stanley	20/12/2017	(29,735)
AUD	11,270,000	USD	8,925,003	Barclays	20/12/2017	(22,448)
AUD	2,895,000	USD	2,298,164	Deutsche Bank	20/12/2017	(11,305)
CAD	4,715,000	NOK	29,252,383	BNP Paribas	20/12/2017	3,377
CLP	2,116,520,200	USD	3,268,000	Credit Suisse	20/12/2017	86,012
CNH	31,309,733	USD	4,595,000	Morgan Stanley	20/12/2017	117,840
EUR	180,769	JPY	23,314,351	Deutsche Bank	20/12/2017	3,182
EUR	4,519,231	JPY	582,818,077	Citibank	20/12/2017	79,909
EUR	799,342	SEK	7,617,864	Morgan Stanley	20/12/2017	(6,956)
EUR	7,400,658	SEK	70,538,411	Deutsche Bank	20/12/2017	(65,525)
EUR	4,725,000	USD	5,694,428	BNP Paribas	20/12/2017	(60,857)
JPY	603,892,660	EUR	4,700,000	Goldman Sachs	20/12/2017	(103,491)
NOK	59,045,474	CAD	9,430,000	JP Morgan	20/12/2017	62,636
NOK	37,720,000	SEK	38,270,335	Deutsche Bank	20/12/2017	17,799
NOK	4,720,000	SEK	4,818,497	Citibank	20/12/2017	(1,507)
NZD	15,426,819	AUD	14,130,000	Morgan Stanley	20/12/2017	(150,527)
RUB	320,885,700	EUR	4,455,000	Deutsche Bank	20/12/2017	89,867
SEK	33,348,910	EUR	3,500,000	Morgan Stanley	20/12/2017	29,617
SEK	44,573,390	EUR	4,700,000	Deutsche Bank	20/12/2017	13,379
SEK	33,618,816	NOK	33,000,000	BNP Paribas	20/12/2017	1,736
SEK	9,597,034	NOK	9,440,000	Citibank	20/12/2017	(2,022)
TWD	95,825,075	USD	3,182,500	HSBC Bank Plc	20/12/2017	15,561
TWD	96,366,100	USD	3,182,500	Goldman Sachs	20/12/2017	33,617
USD	7,460,133	AUD	9,445,000	HSBC Bank Plc	20/12/2017	(792)
USD	7,417,470	AUD	9,440,000	BNP Paribas	20/12/2017	(39,506)
USD	4,595,000	CNH	31,619,245	Morgan Stanley	20/12/2017	(164,429)
USD	5,692,962	EUR	4,725,000	Goldman Sachs	20/12/2017	59,390
USD	3,182,500	TWD	96,620,700	Deutsche Bank	20/12/2017	(42,114)
USD	3,182,500	TWD	96,652,525	Goldman Sachs	20/12/2017	(43,176)
USD	6,540,000	TWD	196,232,700	HSBC Bank Plc	21/12/2017	(9,311)
BRL	17,251,698	USD	5,361,000	Deutsche Bank	17/1/2018	31,384
USD	5,361,000	BRL	17,251,698	Goldman Sachs	17/1/2018	(31,384)
HKD	145,126,670	USD	18,325,000	Goldman Sachs	19/1/2018	287,471
USD	18,325,000	HKD	143,347,313	Goldman Sachs	19/1/2018	(59,268)
INR	785,358,750	USD	11,850,000	JP Morgan	20/2/2018	211,540
INR	607,352,500	USD	9,090,000	HSBC Bank Plc	20/2/2018	237,720
USD	11,850,000	INR	785,358,750	Deutsche Bank	20/2/2018	(211,540)
USD	1,760,000	INR	117,550,400	HSBC Bank Plc	20/2/2018	(45,339)
USD	7,330,000	INR	491,566,900	JP Morgan	20/2/2018	(219,484)
USD	520,513	EUR	482,506	Citibank	21/2/2018	(56,918)

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	849,504	EUR	790,198	Morgan Stanley	21/2/2018	(96,151)
USD	837,675	EUR	779,160	Deutsche Bank	21/2/2018	(94,772)
TWD	34,822,000	USD	1,150,000	JP Morgan	5/3/2018	15,478
USD	490,000	KRW	554,925,000	JP Morgan	5/3/2018	(4,144)
HKD	246,622,208	USD	31,670,000	JP Morgan	19/3/2018	(6,391)
USD	31,670,000	HKD	246,622,208	JP Morgan	19/3/2018	6,391
CNH	12,127,530	USD	1,765,000	HSBC Bank Plc	17/5/2018	43,523
USD	1,765,000	CNH	12,260,749	HSBC Bank Plc	17/5/2018	(63,389)
CNH	83,101,928	USD	11,785,000	HSBC Bank Plc	21/5/2018	604,429
USD	11,785,000	CNH	83,113,713	JP Morgan	21/5/2018	(606,186)
TRY	315,626,000	USD	81,641,826	BNP Paribas	25/6/2018	2,627,609
USD	2,495,310	TRY	9,311,000	BNP Paribas	25/6/2018	9,353
TRY	192,662,000	USD	49,557,445	BNP Paribas	20/8/2018	1,122,652
USD	93,043	TRY	352,000	BNP Paribas	20/8/2018	449
MXN	85,946,400	USD	4,320,000	Barclays	14/6/2019	79,603
USD	4,320,000	MXN	85,060,800	Barclays	14/6/2019	(34,270)
未実現純評価損						(7,106,844)
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	158,233,025	USD	125,505,910	BNY Mellon	15/9/2017	(358,721)
USD	857,089	AUD	1,082,557	BNY Mellon	15/9/2017	890
未実現純評価損						(357,831)
ヘッジを使用したカナダ・ドル建投資証券クラス						
CAD	533,238,172	USD	421,500,694	BNY Mellon	15/9/2017	3,087,291
未実現純評価益						3,087,291
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	147,854,536	USD	152,558,862	BNY Mellon	15/9/2017	594,094
USD	171,377	CHF	165,575	BNY Mellon	15/9/2017	(132)
未実現純評価益						593,962
ヘッジを使用した中国元建投資証券クラス						
CNY	30,616	USD	4,560	BNY Mellon	15/9/2017	73
未実現純評価益						73
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	2,224,927,278	USD	2,633,681,360	BNY Mellon	15/9/2017	5,327,924
USD	22,916,800	EUR	19,416,462	BNY Mellon	15/9/2017	(113,227)
未実現純評価益						5,214,697

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	1,260,962,047	USD	1,645,062,441	BNY Mellon	15/9/2017	(22,013,400)
USD	693,643	GBP	534,793	BNY Mellon	15/9/2017	5,284
未実現純評価損						(22,008,116)
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	12,538,376	USD	1,604,642	BNY Mellon	15/9/2017	(1,712)
USD	74,138	HKD	579,708	BNY Mellon	15/9/2017	27
未実現純評価損						(1,685)
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	51,975,322,107	USD	471,379,113	BNY Mellon	15/9/2017	(192,780)
USD	55,304	JPY	6,072,217	BNY Mellon	15/9/2017	256
未実現純評価損						(192,524)
ヘッジを使用したポーランド・ズロチ建投資証券クラス						
PLN	275,700,276	USD	76,532,834	BNY Mellon	15/9/2017	280,668
USD	1,027,262	PLN	3,699,641	BNY Mellon	15/9/2017	(3,504)
未実現純評価益						277,164
ヘッジを使用したスウェーデン・クローネ建投資証券クラス						
SEK	1,485,716,254	USD	183,040,938	BNY Mellon	15/9/2017	3,164,053
USD	208,819	SEK	1,693,123	BNY Mellon	15/9/2017	(3,380)
未実現純評価益						3,160,673
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	276,260	USD	204,389	BNY Mellon	5/9/2017	(1,151)
USD	80,228	SGD	108,439	BNY Mellon	5/9/2017	452
SGD	66,369,330	USD	48,810,257	BNY Mellon	15/9/2017	20,826
USD	206,232	SGD	278,801	BNY Mellon	15/9/2017	1,105
未実現純評価益						21,232
未実現純評価損合計 (米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 13,642,093,824米ドル)						(17,311,908)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済上場先物取引 2017年8月31日現在

契約数	通貨	契約 / 摘要	満期日	基礎となるエクスポージャー額 (米ドル)	未実現評価益 / (損) (米ドル)
142	AUD	Australian 10 Year Bond	2017年9月	14,490,247	(36,669)
340	EUR	EURO STOXX 50 Index	2017年9月	13,832,377	(164,636)
(28)	EUR	30 Year Euro-BUXL	2017年9月	5,592,790	(50,873)
(28)	EUR	Euro Schatz	2017年9月	3,726,259	(6,970)
(201)	EUR	Euro Bund	2017年9月	39,366,725	(46,137)
(315)	EUR	Euro-BTP	2017年9月	42,243,408	(82,292)
(406)	EUR	Euro BOBL	2017年9月	64,101,510	(119,855)
(1,337)	EUR	Euro-OAT	2017年9月	239,082,247	(2,225,424)
(1,355)	EUR	Euro-BTP	2017年9月	220,954,102	(1,619,472)
44	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2017年9月	60,256,071	450,777
28	JPY	Nikkei 225 (OSE)	2017年9月	4,997,962	(76,507)
533	KRW	Korean 3 Year Bond	2017年9月	51,655,053	(75,630)
290	KRW	Korean 10 Year Bond	2017年9月	31,967,895	(293,633)
507	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	2017年9月	60,520,590	2,018,634
(89)	USD	CBOE Volatility Index	2017年9月	1,157,000	13,350
(1,834)	USD	S&P 500 E-Mini Index	2017年9月	226,155,125	(1,949,567)
188	EUR	VSTOXX Mini Index	2017年10月	377,744	5,548
(22)	USD	CBOE Volatility Index	2017年10月	306,680	570
803	CAD	Banker's Acceptance	2017年12月	157,436,717	(149,792)
128	CAD	Canadian 10 Year Bond	2017年12月	14,080,430	29,736
(19)	EUR	Euro Bund	2017年12月	3,656,367	(901)
(142)	EUR	Euro BOBL	2017年12月	22,155,463	4,303
(411)	GBP	Long Gilt	2017年12月	67,344,355	(154,964)
156	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2017年12月	213,324,193	(28,995)
3,895	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2017年12月	461,496,641	617,503
2,001	USD	90 Day Euro \$	2017年12月	493,171,463	168,010
515	USD	US Ultra 10 Year Note	2017年12月	70,281,406	265,963
(902)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2017年12月	152,212,500	(939,539)
(1,559)	USD	US Long Bond (CBT)	2017年12月	243,155,281	(1,458,319)
(3,239)	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2017年12月	700,686,794	(82,801)
(7,040)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2017年12月	893,420,000	(2,646,984)
83	AUD	90 Day Bank Bill	2018年3月	65,356,956	(4,272)
712	GBP	90 Day Sterling	2018年3月	114,042,351	82,474
464	CAD	Banker's Acceptance	2018年6月	90,838,238	(11,703)
(430)	GBP	90 Day Sterling	2018年6月	68,846,229	(13,831)
(366)	USD	90 Day Euro \$	2018年6月	90,118,350	(85,467)
(2,166)	GBP	90 Day Sterling	2018年12月	346,514,177	(95,132)
(448)	USD	90 Day Euro \$	2018年12月	110,180,000	(89,600)
(84)	AUD	90 Day Bank Bill	2019年3月	66,095,718	1,080
(712)	GBP	90 Day Sterling	2019年3月	113,847,681	(113,901)
(1,173)	USD	90 Day Euro \$	2019年3月	288,382,050	(1,569,737)
(366)	USD	90 Day Euro \$	2019年6月	89,944,500	(57,200)
合計				6,017,371,645	(10,592,855)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

スワップ 2017年8月31日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (16,583,472)	ファンドは Mexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2020	413,321	203,341
CDS	USD 16,583,472	ファンドは Mexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2020	(343,011)	(191,777)
CDS	JPY 307,692,308	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(45,682)	(64,955)
CDS	JPY 192,307,692	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(27,828)	(40,597)
CDS	USD 720,000	ファンドはRussian Foreign Bond - Eurobondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2021	(28,366)	8,301
CDS	USD 316,000	ファンドは French Republic Government Bond OATに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.25%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2022	(4,298)	(635)
CDS	USD 360,000	ファンドは French Republic Government Bond OATに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.25%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2022	(5,534)	(724)
CDS	USD 632,000	ファンドは French Republic Government Bond OATに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.25%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2022	(8,595)	(1,270)
CDS	USD 320,000	ファンドは French Republic Government Bond OATに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.25%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2022	(4,919)	(643)
CDS	USD 6,394,915	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2022	(76,544)	(127,367)
CDS	EUR 781,000	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2022	(3,282)	22,080
CDS	EUR (640,000)	ファンドはNext Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2022	(2,027)	(14,071)
CDS	USD 600,000	ファンドはFrench Republic Government Bond OATに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.25%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2022	(8,161)	(1,206)
CDS	EUR 3,730,000	ファンドはTDC A/Sに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2022	(57,868)	(13,171)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 6,467,000	ファンドは Republic of South Africa Government Bond に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2022	(98,542)	206,396
CDS	USD 672,000	ファンドは French Republic Government Bond OAT に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.25%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2022	(9,880)	(1,351)
CDS	EUR 5,120,000	ファンドは Vodafone Group Plc に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2022	(79,374)	(106,114)
CDS	USD 2,600,000	ファンドは Autozone Inc に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2022	10,678	(32,736)
CDS	USD 1,880,000	ファンドは Transocean Inc に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2017	(4,563)	(2,222)
CDS	USD (3,000,000)	ファンドは China Government Bond に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/9/2020	83,356	58,865
CDS	JPY 142,719,549	ファンドは Mitsubishi Corp に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(20,872)	(35,818)
CDS	JPY 74,812,967	ファンドは Sumitomo Corp に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(20,707)	(18,299)
CDS	JPY 115,384,616	ファンドは ITRAXX.JPN.25.V1 に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(16,451)	(24,358)
CDS	USD 2,050,895	ファンドは Thailand Government Bond に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(41,747)	(43,882)
CDS	EUR 2,957,000	ファンドは Lafargeholcim Ltd に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2021	(49,781)	(57,984)
CDS	EUR (500,000)	ファンドは Hellenic Telecom Org SA に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2021	56,612	88,988
CDS	USD 4,420,000	ファンドは Republic of South Africa Government Bond に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(46,295)	141,066
CDS	USD 622,723	ファンドは China Government Bond に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(8,828)	(12,403)
CDS	EUR 720,000	ファンドは Marks and Spencer Plc に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(4,167)	20,356
CDS	EUR 325,000	ファンドは ITV Plc に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(8,043)	(66,034)
CDS	USD 1,562,000	ファンドは Argentine Republic Government International Bond に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(18,909)	(142,027)
CDS	USD 9,573,300	ファンドは Argentine Republic Government International Bond に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(447,266)	(870,466)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (120,000)	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2022	89	22,556
CDS	EUR (585,000)	ファンドはTelecom Italia SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2022	4,447	(9,979)
CDS	USD 1,662,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(22,340)	(151,120)
CDS	USD 14,700,000	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(166,072)	(292,779)
CDS	USD 3,500,000	ファンドはAutozone Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	34,942	(44,068)
CDS	EUR (1,600,000)	ファンドはTelecom Italia SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2022	(1,134)	(27,293)
CDS	EUR (1,230,000)	ファンドはImperial Brands Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2022	(6,436)	23,655
CDS	USD 4,433,052	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(51,038)	(88,293)
CDS	USD 1,563,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(18,922)	(142,118)
CDS	EUR (940,000)	ファンドはNext Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2022	(1,339)	(20,667)
CDS	EUR (1,220,000)	ファンドはImperial Brands Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2022	(7,050)	23,462
CDS	USD (39,490,000)	ファンドはCDX.NA.IG.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2022	15,779	749,832
CDS	USD 1,500,000	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(15,711)	47,873
CDS	USD 3,500,000	ファンドはSimon Property Group LPに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(27,891)	(32,370)
CDS	USD 1,750,000	ファンドはSaudi Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(2,434)	(9,342)
CDS	EUR (1,180,000)	ファンドはImperial Brands Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2022	(6,819)	22,693
CDS	EUR 3,000,000	ファンドはITV Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(57,753)	(609,548)
CDS	EUR 2,770,000	ファンドはVodafone Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(39,520)	(57,409)
CDS	EUR 1,390,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(62,393)	(37,827)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 2,460,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(108,876)	(66,946)
CDS	EUR 102,000	ファンドはBanco Comercial Portugues SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(10,478)	(11,647)
CDS	USD 1,949,105	ファンドはThailand Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(37,642)	(41,704)
CDS	EUR 200,000	ファンドはStatoil ASAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2021	(3,785)	(8,002)
CDS	EUR 200,000	ファンドはClariant AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2021	(3,596)	(4,058)
CDS	EUR (920,000)	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2022	(11,715)	(26,010)
CDS	EUR 1,300,000	ファンドはTDC A/Sに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2022	(14,453)	(4,590)
CDS	EUR (703,000)	ファンドはTelecom Italia SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2022	10,587	(11,992)
CDS	EUR 920,000	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2022	6,628	23,558
CDS	EUR (2,900,000)	ファンドはITRAXX.FINSUB.19.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2018	(139,236)	134,361
CDS	EUR 4,100,000	ファンドはITRAXX.FINSR.19.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2018	(13,515)	(34,696)
CDS	EUR 2,900,000	ファンドはITRAXX.FINSR.20.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2018	(17,320)	(38,316)
CDS	EUR (2,300,000)	ファンドはITRAXX.FINSUB.20.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2018	(90,977)	169,804
CDS	USD 3,000,000	ファンドはWestpac Banking Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2020	(59,330)	(65,623)
CDS	EUR 2,221,000	ファンドはLafargeholcim Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2021	(34,277)	(43,552)
CDS	USD 14,855,414	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(226,362)	474,115
CDS	EUR 200,000	ファンドはIceland Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(6,709)	(20,643)
CDS	EUR (850,000)	ファンドはImperial Brands Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2022	(532)	16,347
CDS	USD 8,750,000	ファンドはSaudi Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(15,645)	(46,710)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 3,357,178	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(26,877)	(305,256)
CDS	USD 3,357,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(26,120)	(305,240)
CDS	EUR 497,000	ファンドはPernod-Ricard SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(3,936)	(13,970)
CDS	USD 2,305,677	ファンドはIndonesia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(26,657)	777
CDS	USD (130,000)	ファンドはHertz Corp/Theに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2022	(5,530)	(18,891)
CDS	USD 3,358,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(27,931)	(305,331)
CDS	USD 3,357,340	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(28,390)	(305,271)
CDS	EUR 4,968,000	ファンドはPernod-Ricard SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(39,345)	(139,641)
CDS	EUR 630,000	ファンドはITRAXX.FINSR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(20,070)	(16,143)
CDS	USD 7,642,000	ファンドはCDX.NA.HY.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2022	(46,068)	(551,890)
CDS	USD 22,115,000	ファンドはCDX.NA.HY.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2022	(111,052)	(1,597,101)
CDS	USD (58,350,000)	ファンドはCDX.NA.IG.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2022	91,022	1,107,943
CDS	USD (8,900,000)	ファンドはCDX.NA.HY.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2022	72,053	642,740
CDS	EUR 300,000	ファンドはTechem GmbHに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2021	(6,391)	(54,748)
CDS	EUR (578,000)	ファンドはTelecom Italia SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	4,071	(9,860)
CDS	EUR (150,000)	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	(470)	28,195
CDS	USD (25,820,000)	ファンドはCDX.NA.IG.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	15,353	490,267
CDS	USD (62,500,000)	ファンドはCDX.NA.HY.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	351,471	4,513,625
CDS	EUR 640,000	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2022	952	16,388
CDS	USD 73,077,000	ファンドはCDX.NA.IG.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2022	(34,111)	(1,387,577)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (91,340,000)	ファンドはCDX.NA.IG.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	88,844	1,734,353
CDS	USD (26,700,000)	ファンドはCDX.NA.HY.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	221,497	1,928,221
CDS	EUR (1,070,000)	ファンドはNext Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	(13,661)	(23,526)
CDS	USD (14,900,000)	ファンドはCDX.NA.HY.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	(69,348)	1,076,048
CDS	USD (63,748,542)	ファンドはCDX.NA.IG.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	912	1,210,450
CDS	USD 3,500,000	ファンドはCBS Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2022	(6,793)	(66,526)
CDS	EUR 1,270,000	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2022	(11,424)	32,520
CDS	EUR 1,250,000	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2022	(12,475)	32,007
CDS	USD (3,900,000)	ファンドはCDX.NA.HY.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	29,331	281,650
CDS	EUR (200,000)	ファンドはSaipem Finance International BVに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	1,605	15,942
CDS	EUR (270,000)	ファンドはLadbrokes Coral Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	2,250	(31,721)
CDS	USD (62,500,000)	ファンドはCDX.NA.HY.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	161,343	4,513,625
CDS	USD (645,000)	ファンドはCMBX.NA.7.AAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/1/2047	55,776	1,282
CDS	USD 3,560,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	17/9/2058	(17,572)	26,131
CDS	USD (1,450,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/9/2058	(8,208)	(55,648)
CDS	USD (1,130,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/9/2058	(8,359)	(135,140)
CDS	USD (420,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/9/2058	5,881	(16,119)
CDS	USD (2,120,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/9/2058	(27,406)	(253,538)
CDS	USD (670,000)	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	11/5/2063	(38,451)	(95,395)
CDS	USD (1,130,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	17/9/2058	82,240	(43,367)
CDS	USD (2,950,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	17/9/2058	(6,476)	(113,214)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (1,120,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	17/9/2058	(264)	(133,944)
CDS	USD (1,090,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	17/9/2058	75,112	(41,832)
CDS	USD 2,860,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	17/9/2058	(14,623)	20,992
CDS	USD (1,050,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	17/9/2058	(7,656)	(125,573)
CDS	USD 4,737,357	ファンドはCMBX.NA.6.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	(20,286)	(21,984)
CDS	USD 3,369,668	ファンドはCMBX.NA.6.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	(16,303)	(15,637)
CDS	USD 5,431,112	ファンドはCMBX.NA.6.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	(26,980)	(25,204)
CDS	USD 1,400,000	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	71,219	199,333
CDS	EUR (110,000)	ファンドはScandinavian Airlines System Denに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2017	5,371	1,212
CDS	EUR (410,000)	ファンドはScandinavian Airlines System Denに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2019	47,378	9,438
CDS	USD 7,495,000	ファンドはFord Motor Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2020	(52,280)	(947,913)
CDS	USD 11,990,000	ファンドはGeneral Motors Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2020	(94,381)	(1,512,598)
CDS	USD (3,000,000)	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/9/2020	84,777	58,865
CDS	USD (5,750,000)	ファンドはTRAXX.ASIA.XJ.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2020	267,362	100,036
CDS	JPY 175,953,079	ファンドはMitsui & Co Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(36,778)	(43,214)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはMitsubishi Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(13,888)	(22,079)
CDS	JPY 87,976,539	ファンドはItochu Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(16,613)	(20,775)
CDS	JPY 96,070,381	ファンドはItochu Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(17,952)	(22,686)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはMitsui & Co Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(19,310)	(21,607)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはItochu Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(16,851)	(20,775)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 1,820,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(63,328)	(49,529)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはItochu Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(17,768)	(20,775)
CDS	EUR (170,000)	ファンドはHellenic Telecom Org SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2021	20,449	30,256
CDS	EUR (1,890,000)	ファンドはBP Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2022	24,389	50,397
CDS	EUR (1,000,000)	ファンドはImperial Brands Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2022	(5,251)	19,231
CDS	EUR 230,000	ファンドはCable & Wireless Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(8,152)	(43,874)
CDS	USD 3,418,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(28,658)	(310,786)
CDS	USD 4,226,000	ファンドはTarget Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(11,217)	(71,475)
CDS	EUR 1,830,000	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	7,746	46,859
CDS	USD 166,989,000	ファンドはCDX.NA.IG.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(744,298)	(3,170,768)
CDS	USD 8,800,000	ファンドはRio Tinto Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(119,997)	(144,427)
CDS	USD 1,410,000	ファンドはMacys Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(6,628)	89,353
CDS	EUR 4,510,000	ファンドはKoninklijke DSM NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(23,744)	(162,688)
CDS	USD 360,000	ファンドはFrench Republic Government Bond OATに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.25%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(4,654)	(724)
CDS	EUR (5,270,000)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2022	74,867	91,239
CDS	USD 3,547,482	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(28,145)	(322,560)
CDS	USD 828,000	ファンドはFrench Republic Government Bond OATに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.25%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(10,704)	(1,664)
CDS	USD 316,000	ファンドはFrench Republic Government Bond OATに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.25%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(4,928)	(635)
CDS	USD 3,955,506	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(59,864)	126,241

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 5,380,000	ファンドはHeidelbergcement AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(180,188)	(1,301,131)
CDS	USD 30,775,000	ファンドはCDX.NA.IG.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(25,546)	(584,352)
CDS	USD 3,420,087	ファンドはIndonesia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(40,588)	1,153
CDS	USD (7,495,000)	ファンドはFord Motor Coに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2022	33,802	1,313,573
CDS	USD (7,495,000)	ファンドはGeneral Motors Coに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2022	75,693	1,299,664
CDS	EUR (1,366,000)	ファンドはTelecom Italia SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2022	26,957	(23,302)
CDS	USD 18,558,372	ファンドはCDX.NA.HY.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(135,050)	(1,340,249)
CDS	USD (30,767,035)	ファンドはCDX.NA.IG.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2022	32,789	584,201
CDS	USD 8,700,000	ファンドはTarget Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(5,738)	(147,145)
CDS	USD 645,000	ファンドはCMBX.NA.7.AAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1.5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	17/1/2047	(45,420)	(1,282)
CDS	USD (430,000)	ファンドはCMBX.NA.8.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/10/2057	23,241	(22,029)
CDS	USD (1,400,000)	ファンドはCMBX.NA.8.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/10/2057	8,778	(71,723)
CDS	USD (2,280,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	3,612	(272,672)
CDS	USD (1,120,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(17,349)	(133,944)
CDS	USD (1,129,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(17,495)	(135,021)
CDS	USD (1,130,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(8,822)	(135,140)
CDS	USD 9,145,000	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2022	(130,840)	291,866
CDS	USD 16,583,472	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	(308,142)	(203,341)
CDS	USD (16,583,472)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	423,374	191,777
CDS	USD 3,450,000	ファンドはCommonwealth Bank of Australiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(66,338)	(74,687)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはAustralia & New Zealand Bankingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(64,963)	(65,677)
CDS	USD 3,614,314	ファンドはAustralia & New Zealand Bankingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(67,991)	(79,126)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはCommonwealth Bank of Australiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(59,592)	(64,945)
CDS	USD 2,385,686	ファンドはAustralia & New Zealand Bankingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(44,131)	(52,228)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはNational Australia Bank Limitedに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(62,915)	(65,619)
CDS	JPY 75,949,367	ファンドはSumitomo Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(22,637)	(18,577)
CDS	JPY 96,153,846	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(12,098)	(20,298)
CDS	USD 1,440,144	ファンドはThailand Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(30,418)	(30,814)
CDS	USD 1,440,144	ファンドはThailand Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(29,899)	(30,814)
CDS	JPY 192,307,692	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(27,097)	(40,597)
CDS	JPY 96,153,846	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(13,549)	(20,298)
CDS	EUR 300,000	ファンドはIberdrola SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2021	(5,019)	(8,722)
CDS	EUR 333,000	ファンドはBNP Paribas SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2021	(6,898)	(11,239)
CDS	USD (12,021,000)	ファンドはCDX.NA.HY.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2022	16,512	868,133
CDS	USD 3,872,033	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(38,904)	(77,119)
CDS	USD 20,755,000	ファンドはCDX.NA.HY.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	39,331	(1,498,885)
CDS	USD (293,555,000)	ファンドはCDX.NA.IG.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2022	496,114	5,573,988
CDS	USD (245,760,000)	ファンドはCDX.NA.IG.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2022	490,023	4,666,462
CDS	USD 89,240,000	ファンドはCDX.NA.IG.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	67,394	(1,694,479)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 4,400,000	ファンドはAutozone Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	21,795	(51,698)
CDS	USD 2,640,000	ファンドはGeneral Mills Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	1,188	(73,736)
CDS	EUR 894,000	ファンドはLanxessに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(9,483)	(20,689)
CDS	USD 30,073,000	ファンドはPhilippine Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(461,557)	(533,273)
CDS	USD 74,890,000	ファンドはCDX.NA.IG.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	902	(1,422,003)
CDS	USD 89,240,000	ファンドはCDX.NA.IG.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	67,394	(1,694,479)
CDS	USD 360,000	ファンドはFrench Republic Government Bond OATに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.25%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(5,134)	(724)
CDS	USD (14,976,000)	ファンドはCDX.NA.IG.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2022	48,152	284,363
CDS	USD 4,226,000	ファンドはTarget Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(7,375)	(71,475)
CDS	EUR 333,078	ファンドはSTMicroelectronics NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(2,721)	(4,537)
CDS	USD 2,640,000	ファンドはGeneral Mills Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	1,166	(73,736)
CDS	USD 3,074,236	ファンドはIndonesia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(39,538)	1,036
CDS	USD 2,640,000	ファンドはGeneral Mills Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	1,369	(73,736)
CDS	USD 5,700,000	ファンドはKorea International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	28,951	(103,778)
CDS	EUR 400,000	ファンドはMelia Hotels International SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(16,911)	(96,211)
CDS	USD (14,900,000)	ファンドはCDX.NA.HY.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2022	(57,014)	1,076,048
CDS	USD 74,850,000	ファンドはCDX.NA.IG.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	29,569	(1,421,243)
CDS	EUR 4,500,000	ファンドはDaimler AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	9,267	(97,044)
CDS	USD (590,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	(3,471)	(22,643)
CDS	USD (1,130,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	(8,037)	(43,367)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 590,000	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、2%の固定金利を支払う	JP Morgan	17/9/2058	(58,363)	22,643
CDS	USD (522,175)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	45,885	(20,040)
CDS	USD (1,150,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	9,629	(137,532)
CDS	USD (1,120,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	(10,922)	(133,944)
CDS	USD (1,080,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	(10,852)	(41,448)
CDS	USD (1,130,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	(11,259)	(135,140)
CDS	USD (35,000)	ファンドはCMBX.NA.10.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/11/2059	(628)	(3,791)
CDS	USD 670,000	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	JP Morgan	11/5/2063	51,848	95,395
CDS	USD 670,000	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	JP Morgan	11/5/2063	51,848	95,395
CDS	USD 700,000	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	JP Morgan	11/5/2063	29,581	99,667
CDS	EUR 46,471,000	ファンドはITRAXX.X0.27.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/6/2022	(1,262,518)	(6,416,989)
CDS	EUR 18,382,000	ファンドはITRAXX.EUR.27.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/6/2022	(37,240)	(468,044)
CDS	EUR 18,900,000	ファンドはITRAXX.FINSR.27.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/6/2022	(497,968)	(497,968)
CDS	USD 360,000	ファンドはFrench Republic Government Bond OATに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.25%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/6/2022	(4,650)	(724)
CDS	EUR 720,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2020	(32,573)	(19,594)
CDS	USD 1,119,712	ファンドはThailand Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2021	(22,437)	(23,958)
CDS	USD 6,900,000	ファンドはHalliburton Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2022	(20,199)	(109,581)
CDS	USD 1,047,277	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2022	(15,317)	(20,859)
CDS	EUR (1,830,000)	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2022	(13,651)	(51,737)
CDS	USD 2,625,000	ファンドはSaudi Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2022	(4,832)	(14,013)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (270,000)	ファンドはCMBX.NA.8.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/10/2057	10,059	(13,832)
CDS	USD (740,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	8,253	(28,399)
CDS	USD (1,440,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(4,784)	(55,264)
CDS	USD 7,120,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(44,601)	52,261
CDS	USD (300,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(5,049)	(35,878)
CDS	USD (1,120,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(17,003)	(133,944)
CDS	USD 2,000,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(9,872)	14,680
CDS	USD 3,630,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(17,918)	26,644
CDS	USD (565,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(7,373)	(67,570)
CDS	USD (1,320,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	22,114	(50,659)
CDS	USD (1,120,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(1,941)	(42,983)
CDS	USD 1,700,000	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、2%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(149,629)	65,242
CDS	USD 4,410,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(32,691)	32,370
CDS	USD 670,000	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	11/5/2063	55,372	95,395
CDS	EUR 300,000	ファンドはCredit Suisse Group AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Societe Generale	20/12/2021	(11,039)	(5,139)
CDS	EUR (750,000)	ファンドはImperial Brands Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Societe Generale	20/6/2022	4,260	14,424
CDS	EUR (710,000)	ファンドはNext Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Societe Generale	20/6/2022	(9,065)	(15,610)
CS	KRW (45,000,000,000)	ファンドはKRW 1.46%の固定金利を支払い、4/4/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取る	JP Morgan	4/4/2018	(157,560)	(157,560)
IFS	EUR 5,630,000	ファンドはCPTFEM + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.87375%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	15/8/2047	31,024	31,024
IFS	GBP 3,395,000	ファンドはUKRPI + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.5325%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	15/11/2046	70,931	70,931
IRS	BRL 203,447,733	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、9.5%の固定金利を支払う	Bank of America	2/10/2017	(36,047)	(36,047)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	MXN 55,991,678	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.3%の固定金利を支払う	Bank of America	7/12/2017	26,115	26,115
IRS	MXN 48,534,715	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.85%の固定金利を支払う	Bank of America	1/11/2018	74,667	74,667
IRS	MXN 37,929,872	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.7%の固定金利を支払う	Bank of America	6/12/2018	65,899	65,899
IRS	BRL 148,342,954	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、7.75%の固定金利を支払う	Bank of America	2/1/2019	(10,603)	(10,603)
IRS	THB 1,055,895,000	ファンドは1.7925%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	Bank of America	21/6/2019	183,152	183,152
IRS	BRL 65,856,884	ファンドは9.135%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	4/1/2021	30,326	30,326
IRS	CNY 111,544,950	ファンドは3.84%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Bank of America	13/4/2022	19,683	19,683
IRS	CNY 166,485,000	ファンドは3.85%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Bank of America	13/4/2022	40,381	40,381
IRS	CNY 102,160,000	ファンドは3.915%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Bank of America	26/4/2022	66,101	66,101
IRS	THB 440,145,000	ファンドは6ヶ月THB BKIBORの変動金利を受け取り、2.3075%の固定金利を支払う	Bank of America	21/6/2022	(322,274)	(322,274)
IRS	CNY 16,338,168	ファンドは3.72%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Bank of America	30/6/2022	(10,977)	(10,977)
IRS	CNY 16,377,605	ファンドは3.81%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Bank of America	20/9/2022	(4,242)	(4,242)
IRS	BRL 14,635,561	ファンドは12.47%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2023	781,006	781,006
IRS	MXN 90,735,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.31%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	235,297	235,297
IRS	MXN 90,735,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.31%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	235,297	235,297
IRS	MXN 10,285,479	ファンドは6.27%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	5/12/2025	(29,462)	(29,462)
IRS	MXN 80,656,062	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.55%の固定金利を支払う	Barclays	21/3/2018	70,591	70,591
IRS	MXN 1,065,934,395	ファンドは6.94%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	BNP Paribas	29/11/2018	(213,797)	(213,797)
IRS	THB 1,055,895,000	ファンドは1.7925%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	21/6/2019	183,152	183,152
IRS	MXN 1,786,090,000	ファンドは7.08%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	BNP Paribas	8/8/2019	1,776	1,776
IRS	CNY 138,146,731	ファンドは3.84%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	BNP Paribas	14/4/2022	25,183	25,183
IRS	THB 440,145,000	ファンドは6ヶ月THB BKIBORの変動金利を受け取り、2.3075%の固定金利を支払う	BNP Paribas	21/6/2022	(322,274)	(322,274)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	CNY 33,221,088	ファンドは3.73%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(26,870)	(26,870)
IRS	MXN 279,950,277	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.71%の固定金利を支払う	BNP Paribas	19/11/2026	(643,293)	(643,293)
IRS	BRL 50,356,290	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、8.98%の固定金利を支払う	Citibank	2/1/2018	(14,298)	(14,298)
IRS	BRL 195,031,522	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、9.62%の固定金利を支払う	Citibank	2/1/2018	(211,460)	(211,460)
IRS	BRL 195,021,991	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、9.6275%の固定金利を支払う	Citibank	2/1/2018	(237,587)	(237,587)
IRS	BRL 151,646,812	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、9.985%の固定金利を支払う	Citibank	2/1/2018	(235,220)	(235,220)
IRS	MXN 393,052,250	ファンドは7.07%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	21/11/2018	(45,387)	(45,387)
IRS	MXN 670,800,000	ファンドは6.98%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	28/11/2018	(116,560)	(116,560)
IRS	MXN 37,929,873	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.77%の固定金利を支払う	Citibank	5/12/2018	63,967	63,967
IRS	MXN 37,929,873	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.76%の固定金利を支払う	Citibank	6/12/2018	64,335	64,335
IRS	BRL 133,962,282	ファンドは9.25%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2019	706,988	706,988
IRS	BRL 145,696,578	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、8%の固定金利を支払う	Citibank	2/1/2019	(141,494)	(141,494)
IRS	THB 2,172,895,000	ファンドは1.67%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	Citibank	21/6/2019	234,623	234,623
IRS	THB 2,111,790,000	ファンドは1.7825%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	Citibank	21/6/2019	355,015	355,015
IRS	SGD 39,159,826	ファンドは1.45%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Citibank	20/12/2019	14,875	14,875
IRS	SGD 39,159,825	ファンドは1.4925%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Citibank	20/12/2019	38,931	38,931
IRS	SGD 38,575,349	ファンドは1.4975%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Citibank	20/12/2019	41,138	41,138
IRS	SGD 38,965,000	ファンドは1.5025%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Citibank	20/12/2019	44,370	44,370
IRS	BRL 130,170,295	ファンドは9.48%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2020	792,909	792,909
IRS	BRL 130,105,866	ファンドは9.5%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2020	814,226	814,226
IRS	BRL 146,118,169	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、8.78%の固定金利を支払う	Citibank	2/1/2020	(277,902)	(277,902)
IRS	KRW 13,694,646,121	ファンドは1.6975%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Citibank	20/9/2020	(3,496)	(3,496)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	BRL 15,260,000	ファンドは9.28%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	4/1/2021	29,004	29,004
IRS	CNY 24,733,980	ファンドは3.78%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Citibank	19/6/2022	(4,476)	(4,476)
IRS	THB 277,193,520	ファンドは6ヶ月THB BKIBORの変動金利を受け取り、2.0625%の固定金利を支払う	Citibank	21/6/2022	(108,697)	(108,697)
IRS	THB 880,290,000	ファンドは6ヶ月THB BKIBORの変動金利を受け取り、2.2875%の固定金利を支払う	Citibank	21/6/2022	(620,110)	(620,110)
IRS	CNY 16,791,861	ファンドは3.765%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Citibank	20/9/2022	(9,542)	(9,542)
IRS	BRL 20,137,910	ファンドは12.27%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2023	975,093	975,093
IRS	BRL 64,908,372	ファンドは9.84%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2023	212,138	212,138
IRS	BRL 34,154,876	ファンドは9.85%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2023	116,027	116,027
IRS	MXN 86,921,000	ファンドは6.325%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	17/7/2025	(218,452)	(218,452)
IRS	MXN 274,683,000	ファンドは6.02%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	24/3/2026	(1,071,297)	(1,071,297)
IRS	KRW 9,189,670,000	ファンドは3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を受け取り、1.8775%の固定金利を支払う	Citibank	15/3/2027	36,548	36,548
IRS	KRW 4,427,643,351	ファンドは3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を受け取り、1.979%の固定金利を支払う	Citibank	20/9/2027	(12,475)	(12,475)
IRS	MXN 1,235,687,404	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.3614%の固定金利を支払う	Credit Suisse	28/1/2019	(166,277)	(166,277)
IRS	MXN 495,000,000	ファンドは6.92%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Credit Suisse	1/7/2022	24,928	24,928
IRS	MXN 148,500,000	ファンドは6.88%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Credit Suisse	1/8/2022	(6,827)	(6,827)
IRS	MXN 99,000,000	ファンドは6.9%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Credit Suisse	2/8/2022	129	129
IRS	MXN 282,000,000	ファンドは1日MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.29%の固定金利を支払う	Credit Suisse	25/6/2027	(177,681)	(177,681)
IRS	MXN 84,600,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.16%の固定金利を支払う	Credit Suisse	26/7/2027	(8,239)	(8,239)
IRS	MXN 56,400,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.18%の固定金利を支払う	Credit Suisse	27/7/2027	(10,040)	(10,040)
IRS	KRW 22,575,222,776	ファンドは1.92%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Deutsche Bank	10/11/2017	20,569	20,569

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	KRW 22,575,222,776	ファンドは3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を受け取り、1.69%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	10/11/2017	(11,643)	(11,643)
IRS	MXN 1,109,740,000	ファンドは7.16%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Deutsche Bank	29/4/2020	326,624	326,624
IRS	CNY 32,240,000	ファンドは3.92%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Deutsche Bank	31/5/2022	26,296	26,296
IRS	CNY 32,240,000	ファンドは3.94%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Deutsche Bank	31/5/2022	30,781	30,781
IRS	MXN 336,807,890	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.3072%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/8/2025	876,684	876,684
IRS	USD 405,320,000	ファンドは1.935%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	9/3/2019	1,542,115	1,542,115
IRS	MXN 1,000,000,000	ファンドは7.345%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	20/2/2020	476,635	476,635
IRS	USD 415,990,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.31125%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	9/3/2020	(2,284,352)	(2,284,352)
IRS	MXN 876,300,000	ファンドは7.45%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	28/5/2020	638,014	638,014
IRS	KRW 13,832,975,880	ファンドは1.7%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	20/9/2020	(2,634)	(2,634)
IRS	KRW 14,166,300,600	ファンドは1.7%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	20/9/2020	(2,697)	(2,697)
IRS	MXN 377,615,945	ファンドは7.445%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	7/3/2022	457,851	457,851
IRS	MXN 188,850,992	ファンドは7.47%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	7/3/2022	239,365	239,365
IRS	MXN 188,832,063	ファンドは7.48%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	7/3/2022	243,495	243,495
IRS	CNY 88,323,319	ファンドは3.825%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Goldman Sachs	14/4/2022	7,345	7,345
IRS	CNY 24,249,000	ファンドは3.81%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Goldman Sachs	9/6/2022	29	29
IRS	CNY 21,239,712	ファンドは3.725%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(17,909)	(17,909)
IRS	CNY 33,379,200	ファンドは3.7675%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(18,395)	(18,395)
IRS	CNY 12,793,800	ファンドは3.8225%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(2,214)	(2,214)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	MXN 261,414,000	ファンドは6.321%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	6/8/2025	(666,494)	(666,494)
IRS	KRW 4,594,835,000	ファンドは3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を受け取り、1.91%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	15/3/2027	6,705	6,705
IRS	MXN 414,800,000	ファンドは7.481%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	14/4/2027	582,383	582,383
IRS	KRW 4,580,134,900	ファンドは3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を受け取り、1.9825%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/9/2027	(14,200)	(14,200)
IRS	KRW 4,472,367,020	ファンドは3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を受け取り、1.985%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/9/2027	(14,769)	(14,769)
IRS	MXN 455,215,000	ファンドは7.16%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	HSBC Bank Plc	1/6/2022	274,892	274,892
IRS	KRW 4,594,835,000	ファンドは3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を受け取り、1.9%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	15/3/2027	10,265	10,265
IRS	BRL 151,652,093	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、9.98%の固定金利を支払う	JP Morgan	2/1/2018	(233,463)	(233,463)
IRS	MXN 471,662,700	ファンドは7.06%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	JP Morgan	21/11/2018	(57,603)	(57,603)
IRS	MXN 380,532,808	ファンドは6.98%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	JP Morgan	28/11/2018	(66,122)	(66,122)
IRS	BRL 127,171,224	ファンドは9.275%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2019	684,694	684,694
IRS	THB 2,172,895,000	ファンドは1.78%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	JP Morgan	21/6/2019	362,384	362,384
IRS	BRL 33,737,878	ファンドは12.17%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	4/1/2021	1,149,947	1,149,947
IRS	BRL 34,917,848	ファンドは12.235%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	4/1/2021	1,227,877	1,227,877
IRS	THB 906,525,000	ファンドは6ヶ月THB BKIBORの変動金利を受け取り、2.28%の固定金利を支払う	JP Morgan	21/6/2022	(629,154)	(629,154)
IRS	BRL 16,995,037	ファンドは12.4%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	877,431	877,431
IRS	KRW 32,605,970,000	ファンドは3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を受け取り、1.837%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/9/2027	282,133	282,133
IRS	USD 2,100,330,000	ファンドは1日USD LIBORの変動金利を受け取り、1.24125%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	31/1/2018	(46,440)	(46,440)
IRS	USD 3,249,618,000	ファンドは1日USD LIBORの変動金利を受け取り、1.256%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	31/1/2018	(136,766)	(136,766)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 352,910,000	ファンドは1日USD LIBORの変動金利を受け取り、1.3625%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/3/2019	27,297	27,297
IRS	USD 352,330,000	ファンドは1日USD LIBORの変動金利を受け取り、1.44875%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/3/2019	(48,030)	(48,030)
IRS	USD 351,980,000	ファンドは1日USD LIBORの変動金利を受け取り、1.4525%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/3/2019	(51,252)	(51,252)
IRS	USD 3,753,100,000	ファンドは1日USD LIBORの変動金利を受け取り、1.458%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/3/2019	(597,626)	(597,626)
IRS	USD 352,200,000	ファンドは1日USD LIBORの変動金利を受け取り、1.46%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/3/2019	(57,828)	(57,828)
IRS	USD 352,150,000	ファンドは1日USD LIBORの変動金利を受け取り、1.4895%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/3/2019	(83,555)	(83,555)
IRS	USD 1,741,060,000	ファンドは1日USD LIBORの変動金利を受け取り、1.5055%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/3/2019	(482,113)	(482,113)
IRS	USD 223,460,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.626%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	14/7/2019	(382,379)	(382,379)
IRS	USD 468,550,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.6875%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	25/8/2019	(235,579)	(235,579)
IRS	USD 269,590,000	ファンドは1.64%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	30/9/2019	288,530	288,530
IRS	USD 42,840,000	ファンドは1.763%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	22/8/2020	33,083	33,083
IRS	USD 77,010,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.0875%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/7/2021	(447,818)	1,703,099
IRS	USD 175,000,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.154%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	22/7/2021	(1,907,608)	3,439,790
IRS	USD 704,190,000	ファンドは2.075%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	29/7/2021	3,544,414	3,544,414
IRS	USD 468,420,000	ファンドは2%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	3/8/2021	1,664,272	1,664,272
IRS	USD 60,840,000	ファンドは1.84%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	30/8/2021	21,649	21,649
IRS	USD 98,550,000	ファンドは1日USD LIBORの変動金利を受け取り、1.55%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	28/2/2022	(227,562)	(227,562)
IRS	EUR 11,950,000	ファンドは0.317%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	13/7/2022	121,167	121,167
IRS	SEK 117,880,000	ファンドは3ヶ月SEK STIBORの変動金利を受け取り、0.4145%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	13/7/2022	(43,560)	(43,560)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 84,485,000	ファンドは2.15%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	29/9/2022	1,554,601	1,554,601
IRS	EUR 15,330,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.623%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	10/7/2023	(235,752)	(235,752)
IRS	JPY 4,275,000,000	ファンドは0.26625%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	15/12/2026	238,778	240,128
IRS	USD 7,550,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.245%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	13/1/2027	(140,702)	(140,567)
IRS	USD 53,290,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.17%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	15/5/2027	(456,837)	(456,837)
IRS	USD 53,910,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.23543%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	15/5/2027	(766,673)	(766,673)
IRS	SEK 96,590,000	ファンドは3ヶ月SEK STIBORの変動金利を受け取り、1.1125%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	17/5/2027	7,937	7,937
IRS	USD 119,000,000	ファンドは2.13%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	16/6/2027	858,317	858,317
IRS	USD 98,530,000	ファンドは2.1455%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	15/8/2027	778,555	778,555
IRS	USD 46,050,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.2265%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	18/8/2027	(704,762)	(704,762)
IRS	USD 18,100,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.148%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	25/8/2027	(145,445)	(145,445)
IRS	USD 5,175,000	ファンドは2.041%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	31/8/2027	(8,267)	(8,267)
IRS	USD 5,175,000	ファンドは2.045%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	31/8/2027	(6,360)	(6,360)
IRS	USD 5,170,000	ファンドは2.0475%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	31/8/2027	(5,163)	(5,163)
IRS	PLN 76,730,000	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、3.194%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/9/2027	(829,787)	(829,787)
IRS	USD 154,040,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.535%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	29/7/2029	(3,614,844)	(3,614,844)
IRS	USD 103,360,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.465%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	3/8/2029	(1,754,337)	(1,754,337)
IRS	USD 13,220,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.279%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	30/8/2029	(51)	(51)
IRS	USD 21,520,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.46%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	15/11/2043	(367,584)	(367,584)

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	JPY 1,266,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.89%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	15/12/2046	(84,634)	(72,599)
IRS	USD 85,011,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.5825%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	11/5/2047	(4,086,057)	(4,086,057)
IRS	JPY 795,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.8075%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	31/5/2047	135,169	135,169
IRS	JPY 480,500,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.913%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	12/7/2047	(46,159)	(46,159)
IRS	JPY 480,500,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.92%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	12/7/2047	(54,797)	(54,797)
IRS	MXN 174,450,000	ファンドは6.32%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Morgan Stanley	17/7/2025	(441,431)	(441,431)
IRS	MXN 566,665,605	ファンドは6.92%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	UBS	28/11/2018	(121,432)	(121,432)
IRS	MXN 144,525,723	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.64%の固定金利を支払う	UBS	18/11/2026	(293,159)	(293,159)
TRS	USD (2,759)	ファンドは1ヶ月USD BBA LIBOR - 35bpsを受け取り、Autozone Inc + Obpsを支払う	Citibank	15/9/2017	(37,853)	(37,853)
TRS	EUR 7,100,000	ファンドはIBOXX EUR Coporate + Obpsを受け取り、3ヶ月EUR BBA EURIBOR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2017	81,911	82,650
TRS	EUR 3,630,000	ファンドはIBOXX EUR Liquid high Yield + Obpsを受け取り、3ヶ月EUR BBA EURIBOR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2017	42,268	42,913
TRS	USD 43,470,000	ファンドはIBOXX US\$ Liquid High Yield + Obpsを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/12/2017	420,684	345,605
TRS	EUR 7,100,000	ファンドはIBOXX EUR Coporate + Obpsを受け取り、3ヶ月EUR BBA EURIBOR + Obpsを支払う	JP Morgan	20/9/2017	116,644	116,968
TRS	USD (26,758)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 30bpsを受け取り、Darden Restaurants Inc + Obpsを支払う	Merrill Lynch	15/12/2017	22,054	22,054
TRS	USD (32,145)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 30bpsを受け取り、Target Corp + Obpsを支払う	Merrill Lynch	15/12/2017	49,355	49,355
TRS	USD 22,111	ファンドはCentene Corp + Obpsを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + 20bpsを支払う	Merrill Lynch	15/12/2017	181,315	181,315
TRS	USD 13,600	ファンドはCentene Corp + Obpsを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + 20bpsを支払う	Merrill Lynch	15/12/2017	123,488	123,488
TRS	USD 19,738	ファンドはCentene Corp + Obpsを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + 20bpsを支払う	Merrill Lynch	15/12/2017	76,789	76,789
TRS	USD (32,168)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 30bpsを受け取り、Target Corp + Obpsを支払う	Merrill Lynch	15/12/2017	11,960	11,960

スワップ 2017年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	USD (900)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 30bpsを受け取り、Ally Financial Incを支払う	Merrill Lynch	24/1/2018	(585)	(585)
TRS	USD (3,567)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 30bpsを受け取り、O'Reilly Automotive Inc + 0bpsを支払う	Merrill Lynch	31/8/2018	160,361	160,361
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 21,943,117,024米ドル)					(5,381,187)	4,808,976

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

CS: 通貨スワップ

IFS: インフレーション・スワップ

IRS: 金利スワップ

TRS: トータル・リターン・スワップ

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建オプション 2017年8月31日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
17,665,000	コール	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.32	13/9/2017	(28,736)	146
17,500,000	コール	OTC USD/HKD	Bank of America	USD 7.7425	10/11/2017	18,578	158,228
20,670,000	コール	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 113	10/11/2017	(51,108)	111,338
20,670,000	プット	OTC USD/BRL	Barclays	USD 3.2	5/9/2017	166,529	388,140
41,340,000	プット	OTC AUD/USD	Barclays	AUD 0.72	7/9/2017	(111,245)	-
17,800,000	コール	OTC USD/CAD	Barclays	USD 1.28	22/9/2017	(157,568)	32,537
17,500,000	プット	OTC AUD/JPY	Barclays	AUD 84	12/10/2017	(84,520)	55,213
26,600,000	プット	OTC AUD/JPY	Barclays	AUD 84	16/10/2017	(99,928)	92,778
31,000,000	プット	OTC GBP/USD	Barclays	GBP 1.25	21/11/2017	(200,562)	195,730
15,500,000	コール	OTC USD/TRY	Barclays	USD 3.65	21/2/2018	(120,395)	428,615
17,500,000	プット	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 110.5	1/9/2017	(61,845)	2,905
33,000,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.185	4/9/2017	148,802	183,858
85,655,000	コール	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.11	18/9/2017	5,310,155	6,530,311
20,670,000	コール	OTC USD/KRW	BNP Paribas	USD 1,150	19/9/2017	(195,690)	59,843
5,500,000	プット	OTC EUR/GBP	BNP Paribas	EUR 0.9	28/9/2017	3,204	12,031
20,670,000	プット	OTC USD/TRY	BNP Paribas	USD 3.54	11/10/2017	337,564	446,929
9,719,000	コール	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.275	16/10/2017	(4,493)	49,301
20,660,000	コール	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.195	16/11/2017	104,149	321,150
36,000,000	コール	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.3	7/2/2018	(180,958)	293,882
18,000,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 110	5/9/2017	(137,524)	47,066
8,490,000	コール	OTC EUR/TRY	Citibank	EUR 4.25	15/9/2017	(81,785)	11,187
4,400,000	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 18.2	26/9/2017	32,386	106,262
27,500,000	プット	OTC EUR/GBP	Citibank	EUR 0.9	28/9/2017	13,625	60,152
20,670,000	プット	OTC USD/TRY	Citibank	USD 3.45	11/10/2017	67,961	141,649
20,670,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 107	10/11/2017	(50,656)	128,656
20,670,000	コール	OTC USD/KRW	Citibank	USD 1,245	10/11/2017	(67,192)	41,041
17,500,000	プット	OTC EUR/SEK	Citibank	EUR 9.5	15/11/2017	104,405	271,951
35,250,000	コール	OTC USD/JPY	Citibank	USD 118	15/11/2017	(32,481)	31,850
110,860,000	コール	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.3	16/7/2018	(61,858)	1,079,522
113,070,000	コール	OTC EUR/CHF	Credit Suisse	EUR 1.08	5/9/2017	6,228,699	7,622,989
2,900,000	プット	OTC USD/RUB	Credit Suisse	USD 58.34	26/9/2017	(77,167)	29,698
17,500,000	コール	OTC USD/CAD	Credit Suisse	USD 1.37	29/9/2017	(129,764)	16
16,984,000	プット	OTC USD/CNH	Deutsche Bank	USD 6.8	1/9/2017	430,300	504,181
5,070,000	コール	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 3.31	6/9/2017	(5,550)	179
7,781,000	プット	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.165	7/9/2017	(38,817)	10,441
31,000,000	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 118	7/9/2017	(6,510)	-
10,100,000	プット	OTC USD/INR	Deutsche Bank	USD 64.75	8/9/2017	35,570	106,876
10,230,000	プット	OTC AUD/USD	Deutsche Bank	AUD 0.78	12/9/2017	(36,079)	16,566
16,800,000	プット	OTC AUD/JPY	Deutsche Bank	AUD 84	19/9/2017	(71,523)	16,657
17,500,000	プット	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.33	21/9/2017	(74,358)	17
41,340,000	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 118	21/9/2017	(17,774)	415
41,340,000	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 115	21/9/2017	(185,285)	11,907
22,200,000	コール	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.31	22/9/2017	(39,353)	3,707
17,800,000	コール	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.28	22/9/2017	(131,223)	32,537
6,000,000	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 56.5	26/9/2017	(63,629)	9,391

買建オプション 2017年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
8,800,000	プット	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 3.5	26/9/2017	28,464	121,920
13,430,000	プット	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 12.6	29/9/2017	8,691	41,728
7,610,000	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 60.3	12/10/2017	111,789	265,892
6,100,000	コール	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 3.75	25/10/2017	(20,307)	14,890
17,600,000	プット	OTC USD/SEK	Deutsche Bank	USD 8.25	27/10/2017	366,309	698,069
26,400,000	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 110.4	1/11/2017	(61,617)	37,118
20,670,000	コール	OTC USD/CHF	Deutsche Bank	USD 1.01	10/11/2017	35,450	51,366
20,670,000	コール	OTC USD/CHF	Deutsche Bank	USD 0.97	10/11/2017	131,488	230,498
41,340,000	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 116	10/11/2017	(149,519)	74,130
20,670,000	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 108	10/11/2017	(42,011)	173,163
53,000,000	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 120	15/11/2017	(77,036)	18,895
10,233,000	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18	17/11/2017	2,180	186,579
36,000,000	プット	OTC EUR/SEK	Deutsche Bank	EUR 9.35	20/11/2017	57,887	276,050
17,880,000	プット	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 3	12/1/2018	19,511	102,832
8,518,000	プット	OTC EUR/TRY	Deutsche Bank	EUR 4.32	15/2/2018	43,205	315,636
17,600,000	プット	OTC USD/INR	Deutsche Bank	USD 67	16/2/2018	444,248	594,376
20,660,000	プット	OTC EUR/TRY	Deutsche Bank	EUR 4.05	26/2/2018	48,361	199,527
17,410,000	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 17.35	30/7/2018	(23,220)	244,198
41,340,000	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 127	24/8/2018	65,391	138,149
26,800,000	プット	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 3.15	8/9/2017	88,245	197,938
8,500,000	プット	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 17	21/9/2017	(3,400)	2,601
20,670,000	コール	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 13.5	29/9/2017	(422,353)	108,846
8,270,000	コール	OTC USD/NOK	Goldman Sachs	USD 8.25	17/10/2017	(39,314)	8,001
8,500,000	コール	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 18.25	19/10/2017	(1,585)	67,698
35,300,000	プット	OTC USD/SEK	Goldman Sachs	USD 8.5	27/10/2017	1,839,059	2,411,696
17,700,000	プット	OTC USD/SEK	Goldman Sachs	USD 8.25	27/10/2017	492,786	702,035
20,670,000	プット	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 3.07	10/11/2017	(106,118)	135,039
20,670,000	コール	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 3.23	10/11/2017	(148,410)	278,571
20,670,000	コール	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 14	22/11/2017	(477,554)	202,923
20,670,000	プット	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 17	22/2/2018	(22,745)	121,758
20,670,000	プット	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 17.1	22/2/2018	(26,359)	138,836
26,800,000	プット	OTC USD/INR	Goldman Sachs	USD 64.5	26/7/2018	(1,196)	294,113
12,591,000	コール	OTC USD/TWD	HSBC Bank Plc	USD 30.5	1/9/2017	(104,353)	845
17,800,000	コール	OTC USD/CAD	HSBC Bank Plc	USD 1.31	22/9/2017	(19,722)	2,973
20,670,000	コール	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,160	28/9/2017	(27,765)	64,679
17,500,000	コール	OTC USD/HKD	HSBC Bank Plc	USD 7.7446	10/11/2017	18,146	153,770
5,210,000	コール	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 118	10/11/2017	(91,251)	3,977
41,340,000	コール	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,270	10/11/2017	11,466	50,015
20,670,000	コール	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,240	10/11/2017	7,675	44,943
53,000,000	コール	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 114	15/11/2017	(744,505)	214,795
20,670,000	コール	OTC EUR/USD	HSBC Bank Plc	EUR 1.22	16/11/2017	(31,467)	155,435
17,500,000	コール	OTC USD/HKD	HSBC Bank Plc	USD 7.75	9/2/2018	16,324	125,524
1,870,000	コール	OTC USD/TWD	HSBC Bank Plc	USD 30.49	2/3/2018	(36,753)	15,186
35,150,000	コール	OTC USD/HKD	HSBC Bank Plc	USD 7.75	15/3/2018	34,099	245,878
76,611,000	コール	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,292	15/9/2017	(51,325)	5

買建オプション 2017年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
76,611,000	コール	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,180	15/9/2017	(1,047,241)	55,827
10,330,000	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 12.2	25/9/2017	(52,281)	4,121
10,330,000	コール	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.2	5/10/2017	(56,635)	92,943
20,670,000	コール	OTC USD/NOK	JP Morgan	USD 8.45	17/10/2017	(91,496)	9,167
10,330,000	コール	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.2	10/11/2017	(60,792)	170,703
20,670,000	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 110	10/11/2017	(78,795)	311,904
20,850,000	コール	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,210	10/11/2017	(267,393)	73,505
8,270,000	プット	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,115	10/11/2017	(51,698)	92,149
4,135,000	コール	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,150	10/11/2017	(3,621)	36,574
20,670,000	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 12.6	10/11/2017	(140,011)	161,585
17,500,000	コール	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 114	15/11/2017	(199,102)	70,923
20,670,000	コール	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 15	22/11/2017	(192,042)	75,035
20,670,000	コール	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 14.5	22/11/2017	(238,473)	122,838
17,500,000	コール	OTC USD/HKD	JP Morgan	USD 7.7806	18/12/2017	(5,196)	74,237
2,610,000	コール	OTC USD/TWD	JP Morgan	USD 30.225	1/3/2018	(46,844)	26,758
17,850,000	プット	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6.9	17/5/2018	512,898	662,177
26,800,000	プット	OTC USD/INR	JP Morgan	USD 65	24/7/2018	27,066	365,899
20,670,000	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.14	5/9/2017	(85,073)	92,606
7,230,000	プット	OTC AUD/USD	Morgan Stanley	AUD 0.77	7/9/2017	(13,454)	1,370
20,670,000	コール	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 115	7/9/2017	(38,206)	75
1,200,000	コール	OTC USD/CAD	Morgan Stanley	USD 1.4	15/9/2017	(168,715)	348
5,600,000	プット	OTC AUD/JPY	Morgan Stanley	AUD 84	19/9/2017	(5,146)	5,552
10,430,000	コール	OTC USD/KRW	Morgan Stanley	USD 1,180	19/9/2017	(7,285)	11,437
10,330,000	コール	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 14	25/9/2017	(199,696)	12,730
26,600,000	プット	OTC AUD/JPY	Morgan Stanley	AUD 81	16/10/2017	(9,115)	32,279
7,000,000	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 17.3	20/10/2017	(44,096)	22,754
35,300,000	プット	OTC USD/SEK	Morgan Stanley	USD 8	27/10/2017	517,568	603,771
20,670,000	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.15	10/11/2017	93,918	335,716
10,330,000	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.25	10/11/2017	(23,264)	121,583
41,340,000	コール	OTC USD/CAD	Morgan Stanley	USD 1.375	10/11/2017	(200,244)	5,464
41,340,000	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 111.5	10/11/2017	365,133	931,573
20,670,000	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 109.5	10/11/2017	(174,784)	270,365
20,670,000	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 105.25	10/11/2017	(79,320)	78,620
8,270,000	プット	OTC USD/KRW	Morgan Stanley	USD 1,115	10/11/2017	(139,155)	92,149
10,330,000	コール	OTC USD/TRY	Morgan Stanley	USD 3.57	10/11/2017	(186,795)	126,638
35,250,000	コール	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 118	15/11/2017	(56,275)	31,850
20,670,000	プット	OTC USD/CHF	Morgan Stanley	USD 0.94	22/11/2017	(1,184)	162,749
10,330,000	コール	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 13.5	22/11/2017	(267,824)	183,349
8,900,000	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 17.5	16/2/2018	(20,248)	99,769
15,500,000	コール	OTC USD/TRY	Morgan Stanley	USD 3.75	21/2/2018	(7,654)	300,145
113,070,000	コール	OTC EUR/CHF	Morgan Stanley	EUR 1.1	5/3/2018	4,754,639	6,188,763
41,340,000	コール	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 116	24/8/2018	84,012	516,222
6,200,000	プット	OTC USD/ZAR	RBS Plc	USD 13	29/9/2017	30,181	76,247
72,310,000	プット	OTC EUR/SEK	UBS	EUR 9.2	19/10/2017	(703,488)	114,195
10,430,000	コール	OTC USD/KRW	UBS	USD 1,170	10/11/2017	(198,577)	65,824

買建オプション 2017年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
31,230,000	コール	OTC GBP/USD	UBS	GBP 1.35	17/4/2018	(40,663)	441,114
667	コール	Nifty 50 Index	Citibank	USD 10,236.4948	31/8/2017	(70,632)	-
117	プット	KOSPI 200 Index	Citibank	KRW 300.4876	14/9/2017	(64,191)	19,846
10,000,000,000	プット	JGB Index	Deutsche Bank	JPY 109.31	20/9/2017	118,279	213,735
100	コール	Nikkei 225 Index	JP Morgan	JPY 20,120.02	13/10/2017	21,758	88,179
500	コール	Nifty 50 Index	UBS	USD 10,076.99	31/8/2017	(72,120)	-
167	プット	KOSPI 200 Index	UBS	KRW 307.9638	14/9/2017	14,692	94,546
8,010	プット	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98	13/10/2017	(2,264,907)	50,062
594	プット	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98	15/12/2017	(135,147)	14,850
22,815	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 23	20/9/2017	(495,086)	399,262
16,916	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 29	20/9/2017	(71,047)	169,160
12,199	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 19	20/9/2017	(289,116)	396,468
599	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 16	20/9/2017	(4,912)	32,945
626	プット	Conagra Brands Inc	Exchange Traded	USD 32	19/1/2018	12,708	101,725
626	コール	Conagra Brands Inc	Exchange Traded	USD 37	19/1/2018	(8,889)	21,910
521	プット	Costco Wholesale Corp	Exchange Traded	USD 138	19/1/2018	(88,414)	110,192
40	プット	Euro Bund	Exchange Traded	EUR 161.5	24/11/2017	(12,322)	53,344
20	プット	Euro Bund	Exchange Traded	EUR 160	24/11/2017	(13,001)	15,766
10	プット	Euro Bund	Exchange Traded	EUR 158	24/11/2017	(9,165)	3,615
1,490	コール	EURO STOXX 50	Exchange Traded	EUR 3,600	20/10/2017	(725,414)	138,652
1,200	プット	General Mills Inc	Exchange Traded	USD 50	20/10/2017	(23,640)	61,800
600	コール	General Mills Inc	Exchange Traded	USD 65	20/10/2017	4,380	17,100
703	プット	General Mills Inc	Exchange Traded	USD 50	19/1/2018	34,306	99,826
441	プット	General Mills Inc	Exchange Traded	USD 55	19/1/2018	69,502	174,195
3,302	コール	JP Morgan Chase & Co	Exchange Traded	USD 95	20/10/2017	(431,571)	282,321
577	プット	Kellogg Co	Exchange Traded	USD 65	15/12/2017	(1,420)	135,595
453	コール	Kellogg Co	Exchange Traded	USD 75	15/12/2017	(18,496)	11,325
300	コール	Kimberly-Clark Corp	Exchange Traded	USD 130	19/1/2018	(15,156)	64,500
300	プット	Kimberly-Clark Corp	Exchange Traded	USD 115	19/1/2018	(26,962)	79,500
305	プット	Netflix Inc	Exchange Traded	USD 165	15/9/2017	(66,547)	24,705
305	コール	Netflix Inc	Exchange Traded	USD 180	15/9/2017	27,295	57,340
388	コール	Nikkei 225 Index	Exchange Traded	JPY 20,625	8/9/2017	(571,212)	7,031
199	コール	Russell 2000 Index	Exchange Traded	USD 1,470	15/9/2017	(312,868)	5,970
4	プット	S&P 500 E Mini Index	Exchange Traded	USD 2,430	15/9/2017	(9,411)	1,250
14,586	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 247	15/9/2017	(472,116)	2,114,970
10,050	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 248	15/9/2017	58,290	924,600

買建オプション 2017年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
255	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 250	15/9/2017	(10,889)	7,777
2,407	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 248	29/9/2017	45,252	320,131
5,909	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 249	20/10/2017	(101,635)	1,116,801
1,073	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 248	20/10/2017	107,211	259,666
608	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 250	20/10/2017	32,039	87,248
2,911	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 280	19/1/2018	(36,924)	20,377
2,802	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 270	19/1/2018	(84,301)	43,431
1,449	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 300	15/6/2018	(13,331)	15,939
2,785	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 310	18/1/2019	(62,791)	90,512
2,793	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 350	20/12/2019	(40,705)	101,944
1,543	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 124.5	27/10/2017	(425,481)	204,929
1,543	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 127	27/10/2017	469,285	1,169,304
313	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 125.5	24/11/2017	4,443	136,938
715	コール	Valero Energy Corp	Exchange Traded	USD 70	15/9/2017	(49,040)	20,735
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 1,845,542,600米ドル)						6,641,355	52,094,563

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

売建オプション 2017年8月31日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(31,005,000)	コール	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 116	10/11/2017	31,247	(55,598)
(41,340,000)	プット	OTC USD/BRL	Barclays	USD 3.12	5/9/2017	127,460	(82,009)
(20,670,000)	コール	OTC USD/CAD	Barclays	USD 1.26	13/9/2017	95,983	(97,748)
(40,000,000)	コール	OTC USD/CAD	Barclays	USD 1.31	22/9/2017	143,145	(6,680)
(17,500,000)	プット	OTC AUD/JPY	Barclays	AUD 81	12/10/2017	43,593	(17,691)
(26,600,000)	プット	OTC AUD/JPY	Barclays	AUD 81	16/10/2017	51,131	(32,279)
(62,000,000)	プット	OTC GBP/USD	Barclays	GBP 1.21	21/11/2017	264,502	(116,934)
(31,000,000)	コール	OTC USD/TRY	Barclays	USD 3.75	21/2/2018	179,670	(600,290)
(13,226,000)	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.185	11/9/2017	(52,624)	(105,241)
(13,226,000)	コール	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.2028	11/9/2017	15,114	(36,098)
(10,330,000)	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.16	14/9/2017	40,593	(16,799)
(10,330,000)	コール	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.185	14/9/2017	(41,531)	(97,714)
(41,340,000)	コール	OTC USD/KRW	BNP Paribas	USD 1,180	19/9/2017	222,964	(45,333)
(5,170,000)	プット	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 12.8	20/9/2017	57,900	(24,510)
(10,330,000)	コール	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 13.9	20/9/2017	139,502	(9,560)
(41,340,000)	プット	OTC USD/TRY	BNP Paribas	USD 3.45	11/10/2017	(204,422)	(283,299)
(41,320,000)	コール	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.22	16/11/2017	(117,400)	(310,719)
(53,800,000)	コール	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.35	7/2/2018	128,077	(162,443)
(10,330,000)	コール	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.77	7/9/2017	(141,239)	(214,646)
(20,670,000)	プット	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.75	7/9/2017	104,248	(18)
(8,490,000)	プット	OTC EUR/TRY	Citibank	EUR 3.96	15/9/2017	24,230	(3,265)
(85,655,000)	コール	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.11	18/9/2017	(5,676,249)	(6,530,311)
(41,340,000)	プット	OTC USD/TRY	Citibank	USD 3.41	11/10/2017	(66,333)	(144,466)
(6,100,000)	コール	OTC USD/TRY	Citibank	USD 3.75	25/10/2017	71,730	(14,890)
(17,800,000)	コール	OTC USD/JPY	Citibank	USD 110.5	10/11/2017	(78,668)	(235,842)
(20,670,000)	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 103	10/11/2017	19,745	(40,611)
(20,670,000)	コール	OTC USD/KRW	Citibank	USD 1,270	10/11/2017	53,254	(25,008)
(26,500,000)	プット	OTC EUR/SEK	Citibank	EUR 9.35	15/11/2017	(70,373)	(192,330)
(17,500,000)	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 110.5	1/9/2017	98,504	(41,671)
(18,000,000)	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 110	5/9/2017	93,154	(47,066)
(26,800,000)	プット	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 3.15	8/9/2017	47,550	(197,938)
(15,170,000)	プット	OTC USD/INR	Deutsche Bank	USD 63.9	8/9/2017	13,388	(19,076)
(10,230,000)	コール	OTC AUD/USD	Deutsche Bank	AUD 0.8	12/9/2017	17,790	(16,931)
(82,680,000)	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 118	21/9/2017	114,094	(831)
(17,700,000)	コール	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.28	22/9/2017	96,325	(32,354)
(2,900,000)	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 58.34	26/9/2017	50,864	(29,698)
(10,330,000)	コール	OTC EUR/TRY	Deutsche Bank	EUR 4.2	27/9/2017	16,923	(60,509)
(10,330,000)	プット	OTC EUR/TRY	Deutsche Bank	EUR 4.09	27/9/2017	(27,949)	(81,091)
(7,610,000)	コール	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 63	12/10/2017	120,698	(14,380)
(6,200,000)	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18.3	20/10/2017	44,950	(46,314)
(17,650,000)	プット	OTC USD/SEK	Deutsche Bank	USD 8.5	27/10/2017	(726,297)	(1,205,848)
(17,650,000)	プット	OTC USD/SEK	Deutsche Bank	USD 8.25	27/10/2017	(367,349)	(700,052)
(41,340,000)	コール	OTC USD/CHF	Deutsche Bank	USD 0.99	10/11/2017	(136,140)	(213,859)
(41,340,000)	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 105.25	10/11/2017	54,835	(157,239)
(82,680,000)	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 120	10/11/2017	100,573	(23,447)

売建オプション 2017年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(15,350,000)	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18.6	17/11/2017	3,251	(125,689)
(36,000,000)	プット	OTC EUR/SEK	Deutsche Bank	EUR 9.15	20/11/2017	(29,691)	(94,379)
(5,963,000)	コール	OTC EUR/TRY	Deutsche Bank	EUR 4.5	15/2/2018	22,262	(128,691)
(5,963,000)	プット	OTC EUR/TRY	Deutsche Bank	EUR 4.1	15/2/2018	(19,292)	(72,495)
(17,410,000)	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20.8	30/7/2018	96,239	(316,552)
(5,070,000)	コール	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 3.31	6/9/2017	117,688	(179)
(8,500,000)	プット	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 17.518	21/9/2017	16,945	(25,699)
(33,070,000)	コール	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 14	29/9/2017	441,201	(58,962)
(10,330,000)	コール	OTC USD/NOK	Goldman Sachs	USD 8.45	17/10/2017	19,890	(4,581)
(8,500,000)	プット	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 13	19/10/2017	(17,022)	(131,959)
(8,500,000)	コール	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 13.5	19/10/2017	67,782	(83,671)
(17,650,000)	プット	OTC USD/SEK	Goldman Sachs	USD 8.5	27/10/2017	(735,087)	(1,205,848)
(17,650,000)	プット	OTC USD/SEK	Goldman Sachs	USD 8.25	27/10/2017	(565,912)	(700,052)
(35,300,000)	プット	OTC USD/SEK	Goldman Sachs	USD 8	27/10/2017	(493,565)	(603,771)
(31,005,000)	プット	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 3	10/11/2017	92,457	(85,656)
(33,072,000)	コール	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 3.28	10/11/2017	211,570	(318,967)
(31,000,000)	コール	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 14.5	22/11/2017	552,352	(184,228)
(17,500,000)	コール	OTC USD/HKD	Goldman Sachs	USD 7.7806	18/12/2017	141,013	(74,236)
(41,340,000)	プット	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 16.65	22/2/2018	8,588	(151,026)
(41,340,000)	プット	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 16.5	22/2/2018	3,881	(120,574)
(26,800,000)	プット	OTC USD/INR	Goldman Sachs	USD 62.5	26/7/2018	(1,752)	(118,841)
(15,500,000)	コール	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,150	1/9/2017	34,487	(145)
(15,500,000)	プット	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,105	1/9/2017	63,763	(4)
(12,591,000)	プット	OTC USD/TWD	HSBC Bank Plc	USD 30	1/9/2017	32,880	(2,060)
(8,270,000)	プット	OTC EUR/USD	HSBC Bank Plc	EUR 1.1825	14/9/2017	(29,705)	(60,275)
(8,270,000)	コール	OTC EUR/USD	HSBC Bank Plc	EUR 1.2	14/9/2017	12,603	(31,689)
(17,500,000)	コール	OTC USD/CAD	HSBC Bank Plc	USD 1.37	29/9/2017	63,859	(16)
(17,500,000)	コール	OTC USD/HKD	HSBC Bank Plc	USD 7.7425	10/11/2017	(63,728)	(158,228)
(17,500,000)	コール	OTC USD/HKD	HSBC Bank Plc	USD 7.7446	10/11/2017	(52,708)	(153,771)
(15,640,000)	コール	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 123	10/11/2017	153,947	(777)
(20,670,000)	コール	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,245	10/11/2017	(17,167)	(41,041)
(20,670,000)	コール	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,270	10/11/2017	(4,794)	(25,008)
(53,000,000)	コール	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 120	15/11/2017	274,461	(18,894)
(31,005,000)	コール	OTC EUR/USD	HSBC Bank Plc	EUR 1.24	16/11/2017	17,698	(132,073)
(2,600,000)	コール	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,242	2/3/2018	29,331	(21,434)
(17,850,000)	プット	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.9	17/5/2018	(433,252)	(662,178)
(76,611,000)	コール	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,292	15/9/2017	244,385	(5)
(22,400,000)	プット	OTC AUD/JPY	JP Morgan	AUD 84	19/9/2017	40,101	(22,209)
(10,330,000)	コール	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 13.5	25/9/2017	173,732	(44,644)
(10,330,000)	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 12.5	25/9/2017	91,513	(18,192)
(10,330,000)	コール	OTC AUD/CAD	JP Morgan	AUD 1.005	26/9/2017	(1,440)	(23,722)
(10,330,000)	プット	OTC AUD/CAD	JP Morgan	AUD 0.985	26/9/2017	13,609	(35,181)
(10,330,000)	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 12.6	29/9/2017	106,553	(32,096)
(20,670,000)	コール	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 14	29/9/2017	203,415	(36,853)
(20,670,000)	コール	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.26	5/10/2017	89,268	(103,894)

売建オプション 2017年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(31,005,000)	コール	OTC USD/NOK	JP Morgan	USD 8.65	17/10/2017	53,346	(8,872)
(20,660,000)	コール	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.28	10/11/2017	104,547	(199,258)
(20,670,000)	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 111.5	10/11/2017	70,635	(465,787)
(16,530,000)	プット	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,100	10/11/2017	76,346	(99,837)
(31,000,000)	コール	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,240	10/11/2017	301,910	(67,403)
(36,172,500)	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 12.3	10/11/2017	143,568	(142,733)
(44,100,000)	コール	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 118	15/11/2017	182,947	(39,846)
(41,340,000)	コール	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 15	22/11/2017	337,742	(150,070)
(17,500,000)	コール	OTC USD/HKD	JP Morgan	USD 7.75	9/2/2018	(2,691)	(125,524)
(17,600,000)	プット	OTC USD/INR	JP Morgan	USD 67	16/2/2018	(94,202)	(594,376)
(2,610,000)	コール	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,233.67	28/2/2018	26,682	(22,712)
(35,150,000)	コール	OTC USD/HKD	JP Morgan	USD 7.75	15/3/2018	(14,591)	(245,878)
(26,800,000)	プット	OTC USD/INR	JP Morgan	USD 62.5	24/7/2018	(3,783)	(118,166)
(113,070,000)	コール	OTC EUR/CHF	Morgan Stanley	EUR 1.08	5/9/2017	(5,896,124)	(7,622,989)
(20,670,000)	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.2	5/9/2017	20,154	(388,140)
(10,330,000)	コール	OTC AUD/CAD	Morgan Stanley	AUD 1.015	7/9/2017	25,283	(5,481)
(10,330,000)	プット	OTC AUD/CAD	Morgan Stanley	AUD 0.985	7/9/2017	11,489	(12,794)
(31,000,000)	コール	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 118	7/9/2017	12,710	-
(10,330,000)	コール	OTC USD/CAD	Morgan Stanley	USD 1.27	13/9/2017	50,437	(24,280)
(10,330,000)	プット	OTC USD/CAD	Morgan Stanley	USD 1.26	13/9/2017	23,011	(79,515)
(20,670,000)	プット	OTC USD/CAD	Morgan Stanley	USD 1.305	13/9/2017	(644,986)	(802,884)
(25,830,000)	コール	OTC USD/CAD	Morgan Stanley	USD 1.34	13/9/2017	188,991	(7)
(5,077,000)	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.3	15/9/2017	50,776	(4,370)
(6,200,000)	プット	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 13.2	15/9/2017	(57,627)	(114,307)
(6,200,000)	コール	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 13.5	15/9/2017	35,828	(12,483)
(15,500,000)	コール	OTC USD/CHF	Morgan Stanley	USD 0.98	21/9/2017	13,565	(43,057)
(15,500,000)	コール	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 14.4	25/9/2017	202,099	(5,074)
(4,400,000)	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 18.2	26/9/2017	39,813	(106,262)
(7,750,000)	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.07	10/11/2017	1,348	(50,632)
(20,660,000)	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.31	10/11/2017	34,898	(164,822)
(41,340,000)	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.07	10/11/2017	(45,396)	(270,078)
(20,670,000)	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 111.5	10/11/2017	207,456	(465,787)
(31,005,000)	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 103	10/11/2017	68,932	(60,917)
(62,000,000)	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 108.5	10/11/2017	(158,908)	(603,510)
(20,670,000)	コール	OTC USD/KRW	Morgan Stanley	USD 1,185	10/11/2017	120,269	(104,227)
(20,670,000)	プット	OTC USD/KRW	Morgan Stanley	USD 1,100	10/11/2017	289,220	(124,842)
(20,660,000)	コール	OTC USD/TRY	Morgan Stanley	USD 3.63	10/11/2017	289,773	(166,937)
(26,400,000)	コール	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 118	15/11/2017	105,903	(23,853)
(31,000,000)	プット	OTC USD/CHF	Morgan Stanley	USD 0.91	22/11/2017	(10,083)	(92,604)
(20,670,000)	コール	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 14.5	22/11/2017	335,601	(122,839)
(17,880,000)	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3	12/1/2018	46,216	(102,832)
(8,900,000)	コール	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 19	16/2/2018	6,101	(135,720)
(31,000,000)	コール	OTC USD/TRY	Morgan Stanley	USD 3.85	21/2/2018	17,460	(428,382)
(93,000,000)	コール	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 121	24/8/2018	(192,561)	(626,127)
(17,900,000)	コール	OTC USD/CAD	RBS Plc	USD 1.28	22/9/2017	62,151	(32,719)

売建オプション 2017年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(6,200,000)	プット	OTC USD/ZAR	RBS Plc	USD 12.6	29/9/2017	(3,888)	(19,264)
(20,850,000)	コール	OTC USD/KRW	UBS	USD 1,210	10/11/2017	267,914	(73,504)
(117)	プット	KOSPI 200 Index	Citibank	KRW 285.1566	14/9/2017	31,115	(2,266)
(10,000,000,000)	コール	JGB Index	Deutsche Bank	JPY 109.31	20/9/2017	(384,899)	(394,034)
(33,490,000)	プット	Fabrinet	JP Morgan	USD 98.625	6/9/2017	152,934	(6,666)
(48,203,000)	コール	Fabrinet	JP Morgan	USD 99.625	6/9/2017	(742,554)	(963,484)
(167)	プット	KOSPI 200 Index	UBS	KRW 292.2514	14/9/2017	9,202	(8,288)
(3,687)	プット	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.5	13/10/2017	63,564	(23,044)
(8,010)	プット	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.625	13/10/2017	438,467	(50,062)
(1,430)	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 13	20/9/2017	(18,876)	(157,300)
(1,430)	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 12.5	20/9/2017	(1,001)	(110,825)
(3,040)	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 12	20/9/2017	(14,288)	(144,400)
(16,916)	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 30	20/9/2017	498,148	(126,870)
(626)	コール	Conagra Brands Inc	Exchange Traded	USD 33	19/1/2018	18,965	(89,205)
(521)	プット	Costco Wholesale Corp	Exchange Traded	USD 128	19/1/2018	50,430	(51,579)
(888)	コール	Delta Air Lines Inc	Exchange Traded	USD 50	20/10/2017	(21,047)	(74,148)
(1,490)	プット	EURO STOXX 50	Exchange Traded	EUR 3,200	20/10/2017	89,602	(334,708)
(600)	コール	General Mills Inc	Exchange Traded	USD 55	20/10/2017	26,578	(47,100)
(3,302)	コール	JP Morgan Chase & Co	Exchange Traded	USD 100	20/10/2017	225,520	(54,483)
(453)	コール	Kellogg Co	Exchange Traded	USD 67.5	15/12/2017	39,793	(74,745)
(300)	コール	Kimberly-Clark Corp	Exchange Traded	USD 120	19/1/2018	10,629	(174,000)
(305)	コール	Netflix Inc	Exchange Traded	USD 172.5	15/9/2017	(77,899)	(166,987)
(199)	コール	Russell 2000 Index	Exchange Traded	USD 1,520	15/9/2017	113,589	(1,393)
(16,148)	プット	SPDR Bloomberg Barclays High	Exchange Traded	USD 36	15/9/2017	77,506	(80,740)
(4,396)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 237	1/9/2017	363,980	(4,396)
(127)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 235	15/9/2017	16,040	(2,604)
(1,058)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 243	15/9/2017	73,845	(83,582)
(2,407)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 235	29/9/2017	129,491	(132,385)
(304)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 225	20/10/2017	30,414	(17,024)
(898)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 231	20/10/2017	53,974	(79,922)
(2,955)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 233	20/10/2017	571,181	(311,752)
(299)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 220	18/1/2019	10,548	(265,662)
(447)	コール	United Continental Holdings	Exchange Traded	USD 67.5	20/10/2017	8,961	(51,852)
(187)	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 127.5	22/9/2017	(267)	(43,828)

売建オプション 2017年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(1,372)	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 127	22/9/2017	(263,802)	(578,812)
(1,543)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 124.5	22/9/2017	310,699	(36,165)
(375)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 125.5	27/10/2017	19,972	(108,398)
(626)	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 128.5	24/11/2017	(10,676)	(273,875)
合計 (米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 1,325,101,863米ドル)						(5,447,110)	(38,919,366)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

差金決済取引 2017年8月31日現在

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価 益/(損) (米ドル)
ギリシャ			
67,930	Hellenic Telecommunications Organization SA	Merrill Lynch	(22,547)
1,104,018	National Bank of Greece SA	Merrill Lynch	(40,571)
			(63,118)
オランダ			
12,633	Altice NV	Merrill Lynch	3,220
英国			
(105,783)	Anglo American Plc	Merrill Lynch	(220,148)
(67,996)	Tullow Oil Plc	Merrill Lynch	263
			(219,885)
米国			
10,058	JPMorgan Chase & Co	Merrill Lynch	(12,975)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 12,222,424米ドル)			(292,758)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建スワップション 2017年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 217,770,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2%の固定金利を29/10/2019より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/7/2019より四半期毎に支払う。	Barclays	25/4/2019	312,239	1,836,920
USD 147,738,180	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは28/9/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.1%の固定金利を28/12/2018より半年毎に支払う。	Citibank	26/6/2018	(125,315)	160,111
USD 21,460,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.5%の固定金利を24/8/2027より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を24/5/2027より四半期毎に支払う。	Citibank	22/2/2027	205,064	1,298,451
GBP 450,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは22/3/2018より6ヶ月GBP BBA LIBORの変動金利を半年毎に受け取り、1.127%の固定金利を22/3/2018より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	22/9/2017	(3,295)	2,856
USD 598,180,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.11%の固定金利を26/3/2018より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を26/12/2017より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	22/9/2017	1,659,838	4,347,267
USD 119,270,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/12/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.1%の固定金利を29/3/2018より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	27/9/2017	(502,295)	3,196
USD 1,692,540,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6/1/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、1.60035%の固定金利を6/4/2018より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	4/10/2017	(2,002,072)	28,976
USD 29,900,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは30/1/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.45%の固定金利を30/4/2018より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	26/10/2017	(200,902)	19,013
USD 274,860,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは31/1/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.39%の固定金利を30/4/2018より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	27/10/2017	(1,127,514)	308,629
USD 274,860,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.09%の固定金利を30/4/2018より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を31/1/2018より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	27/10/2017	1,151,787	2,587,931

買建スワップション 2017年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR 250,150,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/5/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、0.45%の固定金利を8/11/2018より毎年支払う。	Goldman Sachs	6/11/2017	(1,020,147)	133,884
USD 18,200,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6/6/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、4%の固定金利を6/9/2019より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	4/3/2019	(300,779)	92,796
USD 52,700,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1/3/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.75%の固定金利を1/6/2022より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	29/11/2021	(549,291)	1,058,059
USD 34,930,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/8/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.25%の固定金利を5/11/2022より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	3/5/2022	(397,827)	1,451,992
USD 34,040,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/8/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.25%の固定金利を5/11/2022より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	3/5/2022	(479,334)	1,414,996
USD 170,725,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/12/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.37%の固定金利を20/3/2018より半年毎に支払う。	JP Morgan	18/9/2017	(627,530)	8,420
EUR 60,200,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/6/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、1.2%の固定金利を19/12/2018より毎年支払う。	JP Morgan	15/12/2017	(383,679)	107,043
EUR 28,598,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/6/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、1.2%の固定金利を19/12/2018より毎年支払う。	JP Morgan	15/12/2017	(159,876)	50,851
USD 42,670,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.2%の固定金利を11/6/2019より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を11/3/2019より四半期毎に支払う。	JP Morgan	7/12/2018	(100,994)	1,183,902
USD 162,000,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは18/11/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3%の固定金利を18/2/2023より半年毎に支払う。	JP Morgan	16/8/2022	(990,147)	6,358,625
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 898,846,300米ドル)				(5,642,069)	22,453,918

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

売建スワップション 2017年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (40,330,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは15/9/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、15/3/2019より0.1%の固定金利を毎年支払う。	Barclays	13/3/2018	15,119	(93,703)
USD (435,540,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/7/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、29/10/2019より1.5%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	25/4/2019	(192,213)	(1,646,119)
USD (147,738,180)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは28/9/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、28/12/2018より1.4%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	26/6/2018	6,233	(228,223)
USD (149,600,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは30/1/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、30/4/2018より1.65%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	26/10/2017	(132,381)	(306,607)
EUR (250,150,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/11/2018より0.75%の固定金利を毎年受け取り、8/5/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	6/11/2017	261,117	(13,652)
USD (73,460,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは28/2/2019より2.75%の固定金利を半年毎に受け取り、28/11/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	23/8/2018	210,840	(545,797)
USD (214,800,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/6/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、25/9/2019より1.6%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	21/3/2019	(330,732)	(942,912)
USD (214,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/9/2019より2.6%の固定金利を半年毎に受け取り、25/6/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	21/3/2019	984,993	(303,807)
USD (85,090,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/11/2022より3.25%の固定金利を半年毎に受け取り、5/8/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	3/5/2022	588,806	(1,273,282)
USD (87,330,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/11/2022より3.25%の固定金利を半年毎に受け取り、5/8/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	3/5/2022	519,835	(1,306,801)

売建スワップション 2017年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (295,700,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1%の固定金利を受け取り、20/6/2017よりCDX.NA.IG.28.V1の変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	20/9/2017	552,347	(76,015)
USD (51,500,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/10/2018より2.15%の固定金利を半年毎に受け取り、10/7/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	6/4/2018	133,895	(18,674)
USD (140,400,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/2/2019より2.7%の固定金利を半年毎に受け取り、20/11/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	16/8/2018	761,879	(1,135,206)
USD (227,000,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/2/2019より2.7%の固定金利を半年毎に受け取り、20/11/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	16/8/2018	942,781	(1,835,411)
USD (42,670,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/6/2019より3.4%の固定金利を半年毎に受け取り、11/3/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	7/12/2018	641,120	(139,617)
USD (64,000,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/3/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、11/6/2019より1.7%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	7/12/2018	234,223	(748,830)
USD (141,300,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1/10/2019より2.75%の固定金利を半年毎に受け取り、1/7/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	28/3/2019	490,105	(159,169)
USD (141,300,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1/7/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、1/10/2019より1.75%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	28/3/2019	(202,795)	(810,385)
USD (26,930,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/10/2019より2.35%の固定金利を半年毎に受け取り、10/7/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	8/4/2019	105,423	(64,236)
USD (158,990,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/8/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、8/11/2019より1.65%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	6/5/2019	(195,715)	(799,877)

売建スワップション 2017年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (158,990,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/11/2019より2.65%の固定金利を半年毎に受け取り、8/8/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	6/5/2019	416,823	(250,935)
EUR (10,775,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/7/2020より0.4%の固定金利を毎年受け取り、10/1/2020より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	8/7/2019	3,846	(37,987)
EUR (108,250,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/11/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、29/5/2019より0.05%の固定金利を毎年支払う。	Morgan Stanley	25/5/2018	670,086	(210,960)
EUR (108,250,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/5/2019より0.75%の固定金利を毎年受け取り、29/11/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	25/5/2018	681,805	(271,656)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 904,828,480米ドル)				7,167,440	(13,219,861)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表 2017年8月31日現在

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
コマーシャル・ペーパー			
米国			
USD 11,000,000	Toronto Dominion Holdings 5/10/2017 (Zero Coupon)	10,986,723	0.65
コマーシャル・ペーパー合計		10,986,723	0.65
預託証書			
日本			
USD 3,800,000	Mizuho Bank Ltd (New York Branch) FRN 3/10/2017	3,802,869	0.23
米国			
USD 3,800,000	Bank of Tokyo Mitsubishi UFJ Ltd (New York Branch) 1.55% 13/10/2017	3,801,458	0.22
USD 4,500,000	Wells Fargo Bank 1.35% 6/10/2017	4,500,616	0.27
預託証書合計		8,302,074	0.49
		12,104,943	0.72
債券			
アルゼンチン			
EUR 184,720	Argentine Republic Government International Bond FRN 31/12/2033	240,922	0.01
USD 193,000	Argentine Republic Government International Bond 5.625% 26/1/2022	202,264	0.01
USD 3,090,000	Argentine Republic Government International Bond 6.25% 22/4/2019	3,254,542	0.19
USD 91,000	Argentine Republic Government International Bond 6.875% 26/1/2027	98,507	0.01
EUR 198,126	Argentine Republic Government International Bond 7.82% 31/12/2033	260,755	0.02
USD 82,000	Genneia SA '144A' 8.75% 20/1/2022	87,638	0.01
USD 435,000	Tarjeta Naranja SA '144A' FRN 11/4/2022	403,463	0.02
		4,548,091	0.27
オーストラリア			
AUD 293,720	Apollo Series 2009-1 Trust '2009-1 A3' FRN 3/10/2040	233,216	0.02
USD 9,000,000	National Australia Bank Ltd '144A' 2.4% 7/12/2021	9,104,004	0.54
AUD 274,924	National Rmbs Trust '2012-2 A1' FRN 20/6/2044	218,205	0.01
AUD 1,703,950	TORRENS Series 2013-1 Trust '2013-1 A' FRN 12/4/2044	1,351,568	0.08
USD 1,830,831	Virgin Australia 2013-1A Pass Through Trust '144A' 5% 23/10/2023	1,915,507	0.11
USD 1,675,602	Virgin Australia 2013-1B Pass Through Trust '144A' 6% 23/10/2020	1,721,681	0.10
USD 2,750,000	Westpac Banking Corp 1.6% 19/8/2019	2,740,634	0.16
		17,284,815	1.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
カナダ			
USD 1,827,778	Air Canada 2013-1 Class B Pass Through Trust '144A' 5.375% 15/5/2021	1,928,306	0.11
USD 1,950,000	Alimentation Couche-Tard Inc '144A' 2.7% 26/7/2022	1,956,482	0.11
USD 10,000,000	Bank of Montreal '144A' 1.75% 15/6/2021*	9,892,780	0.58
USD 7,955,000	Bank of Nova Scotia/The 1.875% 26/4/2021	7,901,081	0.47
USD 6,690,000	Bombardier Inc '144A' 8.75% 1/12/2021	7,609,875	0.45
USD 5,000,000	Canadian Imperial Bank of Commerce '144A' 2.35% 27/7/2022	5,030,960	0.30
USD 6,000,000	CPPIB Capital Inc '144A' 1.25% 20/9/2019	5,944,800	0.35
USD 17,520,000	Province of Alberta Canada 1.9% 6/12/2019	17,566,270	1.04
USD 4,500,000	Province of Ontario Canada 2.4% 8/2/2022	4,570,787	0.27
USD 10,000,000	Royal Bank of Canada 1.875% 5/2/2020	10,017,925	0.59
USD 5,595,000	Royal Bank of Canada 2.1% 14/10/2020	5,612,619	0.33
USD 4,000,000	Toronto-Dominion Bank/The '144A' 2.25% 15/3/2021	4,023,126	0.24
USD 1,125,000	TransCanada PipeLines Ltd 6.5% 15/8/2018	1,175,528	0.07
		83,230,539	4.91
ケイマン諸島			
USD 2,780,000	Baidu Inc 2.875% 6/7/2022*	2,807,489	0.17
USD 2,005,000	Park Aerospace Holdings Ltd '144A' 5.25% 15/8/2022	2,080,789	0.12
		4,888,278	0.29
キプロス			
EUR 1,996,000	Cyprus Government International Bond '144A' 4.625% 3/2/2020	2,618,374	0.15
EUR 3,230,000	Cyprus Government International Bond 4.75% 25/6/2019	4,153,027	0.25
		6,771,401	0.40
エジプト			
USD 200,000	Egypt Government International Bond '144A' 8.5% 31/1/2047	223,750	0.01
USD 237,000	Egypt Government International Bond 8.5% 31/1/2047	265,144	0.02
		488,894	0.03
フランス			
EUR 74,617	AUTO ABS FCT Compartiment '2013-2 A' FRN 27/1/2023	88,681	0.00
USD 3,575,000	Banque Federative du Credit Mutuel SA '144A' 2.7% 20/7/2022	3,595,848	0.21
USD 2,000,000	BNP Paribas SA '144A' 2.95% 23/5/2022	2,023,304	0.12
USD 1,085,000	BNP Paribas SA '144A' 3.8% 10/1/2024	1,129,332	0.07
USD 605,000	BPCE SA '144A' 3% 22/5/2022	610,758	0.04
		7,447,923	0.44
ドイツ			
EUR 2,263,024	Compartiment VCL 24 FRN 21/8/2022	2,688,910	0.16
USD 4,800,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.875% 30/6/2020	4,837,810	0.28
USD 5,830,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.875% 30/11/2020*	5,867,962	0.35
		13,394,682	0.79

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	インドネシア		
USD 682,000	Indonesia Government International Bond 4.75% 8/1/2026	746,456	0.04
USD 147,000	Indonesia Government International Bond 5.875% 13/3/2020	160,653	0.01
IDR 3,413,000,000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/5/2027	261,754	0.02
IDR 8,145,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.5% 15/8/2032	632,706	0.04
IDR 6,032,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.5% 15/5/2038	464,539	0.03
IDR 11,723,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2036	966,725	0.06
IDR 1,015,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/3/2024	82,969	0.00
IDR 8,785,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/9/2026	727,845	0.04
IDR 4,595,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/3/2034	377,469	0.02
		<hr/> 4,421,116	<hr/> 0.26
	国際機関		
USD 12,120,000	International Bank for Reconstruction & Development 0.875% 15/8/2019*	11,990,074	0.71
	アイルランド		
USD 1,000,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.5% 26/5/2022	1,028,050	0.06
USD 1,010,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.25% 1/7/2020	1,061,699	0.06
USD 1,775,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.625% 30/10/2020	1,893,010	0.11
USD 1,500,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 5% 1/10/2021	1,623,214	0.10
USD 5,180,000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 1.9% 23/9/2019	5,163,732	0.30
USD 1,515,000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.4% 23/9/2021	1,505,194	0.09
USD 754,000	Willis Towers Watson Plc 5.75% 15/3/2021	832,019	0.05
		<hr/> 13,106,918	<hr/> 0.77
	イタリア		
EUR 511,494	Asset-Backed European Securitisation Transaction Ten SrI FRN 10/12/2028	607,513	0.04
USD 2,867,000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.017% 26/6/2024	2,904,547	0.17
		<hr/> 3,512,060	<hr/> 0.21
	日本		
USD 1,740,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.95% 1/3/2021	1,777,903	0.10
USD 2,840,000	Mizuho Financial Group Inc 2.953% 28/2/2022	2,887,459	0.17
USD 4,095,000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.846% 11/1/2022	4,160,817	0.25
		<hr/> 8,826,179	<hr/> 0.52
	レバノン		
USD 591,000	Lebanon Government International Bond 6.85% 23/3/2027	592,454	0.04

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ルクセンブルグ			
USD 395,000	Allergan Funding SCS 2.45% 15/6/2019	398,687	0.02
USD 6,500,000	Allergan Funding SCS 3% 12/3/2020	6,635,610	0.39
USD 305,000	Tyco Electronics Group SA 3.45% 1/8/2024	318,937	0.02
		7,353,234	0.43
メキシコ			
USD 230,000	Mexico Government International Bond 4.15% 28/3/2027	243,512	0.01
オランダ			
USD 5,000,000	Deutsche Telekom International Finance BV '144A' 2.82% 19/1/2022	5,061,720	0.30
USD 1,080,000	Enel Finance International NV '144A' 2.875% 25/5/2022	1,090,683	0.06
USD 3,715,000	ING Bank NV '144A' 5.8% 25/9/2023	4,255,244	0.25
USD 1,340,000	ING Groep NV 3.15% 29/3/2022	1,372,685	0.08
USD 2,210,000	Mylan NV 2.5% 7/6/2019	2,218,157	0.13
USD 1,583,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 3.75% 1/6/2018	1,604,370	0.10
USD 703,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 3.875% 1/9/2022	728,484	0.04
USD 2,947,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.125% 1/6/2021	3,079,969	0.18
USD 480,000	Petrobras Global Finance BV 5.375% 27/1/2021	498,178	0.03
USD 691,000	Petrobras Global Finance BV 8.375% 23/5/2021	785,149	0.05
USD 2,980,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 1.7% 19/7/2019	2,928,595	0.17
		23,623,234	1.39
ノルウェー			
USD 3,000,000	DNB Boligkreditt AS '144A' 2% 28/5/2020	3,010,110	0.18
パナマ			
USD 1,380,000	Carnival Corp 3.95% 15/10/2020	1,461,974	0.09
ポルトガル			
EUR 369,887	TAGUS-Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta II Electricity Receivables 2.98% 16/2/2018	442,903	0.03
ロシア連邦			
RUB 20,377,000	Russian Federal Bond - OFZ 6.4% 27/5/2020	339,580	0.02
RUB 47,762,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.05% 19/1/2028	790,621	0.05
RUB 19,554,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.4% 7/12/2022	332,245	0.02
RUB 110,339,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.5% 18/8/2021	1,886,343	0.11
RUB 41,550,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.75% 16/9/2026	717,401	0.04
RUB 114,101,000	Russian Federal Bond - OFZ 8.15% 3/2/2027	2,026,874	0.12
USD 200,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.75% 27/5/2026	213,000	0.01
USD 200,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.875% 16/9/2023	219,300	0.02
		6,525,364	0.39

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	南アフリカ		
USD 854,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.5% 9/3/2020	913,246	0.05
USD 147,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.875% 30/5/2022	162,417	0.01
		1,075,663	0.06
	スイス		
USD 3,340,000	Credit Suisse AG/New York NY 2.3% 28/5/2019	3,369,145	0.20
USD 5,745,000	Credit Suisse Group AG '144A' 3.574% 9/1/2023	5,907,681	0.35
USD 675,000	UBS AG/Stamford CT 2.375% 14/8/2019	682,217	0.04
USD 2,215,000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' FRN 15/8/2023	2,217,313	0.13
USD 895,000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' 2.65% 1/2/2022	894,586	0.05
USD 2,890,000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' 3.491% 23/5/2023	2,973,137	0.18
		16,044,079	0.95
	トルコ		
TRY 2,230,000	Turkey Government Bond 8.8% 27/9/2023	597,434	0.03
TRY 5,000,000	Turkey Government Bond 9.2% 22/9/2021	1,375,321	0.08
TRY 6,877,000	Turkey Government Bond 11% 2/3/2022	2,015,792	0.12
USD 591,000	Turkey Government International Bond 6% 25/3/2027	648,992	0.04
USD 45,000	Turkey Government International Bond 7% 5/6/2020	49,652	0.00
USD 675,000	Turkey Government International Bond 7.375% 5/2/2025	798,778	0.05
		5,485,969	0.32
	英国		
USD 3,219,000	AXIS Specialty Finance Plc 2.65% 1/4/2019	3,241,230	0.19
USD 1,210,000	Barclays Plc 3.684% 10/1/2023	1,243,688	0.07
USD 3,845,000	Barclays Plc 4.375% 11/9/2024	3,937,272	0.23
USD 1,590,000	BAT International Finance Plc '144A' 2.75% 15/6/2020*	1,617,122	0.10
USD 1,410,000	BAT International Finance Plc '144A' 3.25% 7/6/2022	1,447,441	0.09
USD 709,000	BP Capital Markets Plc 2.521% 15/1/2020	722,054	0.04
USD 3,000,000	BP Capital Markets Plc 3.216% 28/11/2023	3,086,162	0.18
GBP 4,391,981	Compartment Driver UK Four FRN 25/3/2025	5,648,948	0.33
GBP 211,983	First Flexible No 7 Plc FRN 15/9/2033	270,846	0.02
USD 5,170,000	HSBC Holdings Plc FRN 13/3/2023	5,301,502	0.31
USD 6,030,000	HSBC Holdings Plc 2.95% 25/5/2021	6,155,020	0.36
USD 3,310,000	Lloyds Banking Group Plc 3% 11/1/2022	3,342,882	0.20
USD 3,640,000	Lloyds Banking Group Plc 4.5% 4/11/2024	3,833,473	0.23
GBP 6,095,000	Oat Hill No 1 Plc FRN 25/2/2046	7,806,434	0.46
GBP 641,451	Rochester Financing No 1 Plc FRN 16/7/2046	826,517	0.05
USD 800,000	Santander UK Group Holdings Plc 2.875% 5/8/2021	806,407	0.05
USD 475,000	Santander UK Group Holdings Plc 3.571% 10/1/2023	487,236	0.03
USD 6,490,000	Sky Plc '144A' 2.625% 16/9/2019	6,557,918	0.39
USD 2,269,000	Sky Plc '144A' 6.1% 15/2/2018	2,313,192	0.14
EUR 6,177,054	Turbo Finance 7 Plc FRN 20/6/2023	7,338,104	0.43
GBP 559,600	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.542% 30/3/2021	787,451	0.05
GBP 1,080,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28/3/2024	1,601,231	0.09
		68,372,130	4.04

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国		
USD 2,390,000	Abbott Laboratories 2.35% 22/11/2019	2,410,573	0.14
USD 1,835,000	AbbVie Inc 2.5% 14/5/2020	1,858,533	0.11
USD 1,595,000	AbbVie Inc 2.9% 6/11/2022	1,622,687	0.10
USD 4,655,000	Adams Mill CLO Ltd '2014-1A A2R' '144A' FRN 15/7/2026	4,658,693	0.27
USD 3,770,000	Air Lease Corp 2.125% 15/1/2018	3,775,644	0.22
USD 2,230,000	Air Lease Corp 2.625% 4/9/2018	2,248,704	0.13
USD 4,915,000	Air Lease Corp 2.625% 1/7/2022	4,910,849	0.29
USD 2,500,000	Ally Financial Inc 3.25% 13/2/2018	2,512,500	0.15
USD 696,000	Ally Financial Inc 6.25% 1/12/2017	703,830	0.04
USD 2,525,000	ALM XII Ltd '2015-12A A1R' '144A' FRN 16/4/2027	2,527,467	0.15
USD 1,344,145	American Airlines 2013-2 Class B Pass Through Trust '144A' 5.6% 15/7/2020	1,409,672	0.08
USD 3,815,000	American Express Co 2.5% 1/8/2022	3,833,493	0.23
USD 8,380,000	American Express Credit Account Master Trust '2017-4 A' 1.64% 15/12/2021	8,392,406	0.50
USD 3,459,000	American International Group Inc 2.3% 16/7/2019	3,487,262	0.21
USD 2,250,000	American International Group Inc 3.3% 1/3/2021	2,328,813	0.14
USD 540,000	American International Group Inc 6.4% 15/12/2020	610,490	0.04
USD 3,525,000	American Tower Corp 3.45% 15/9/2021	3,658,915	0.22
USD 4,346,161	AmericoId 2010 LLC '2010-ARTA A1' '144A' 3.847% 14/1/2029	4,483,916	0.26
USD 4,550,000	AmeriCredit Automobile Receivables Trust '2014-4 C' 2.47% 9/11/2020	4,583,035	0.27
USD 7,200,000	AmeriCredit Automobile Receivables Trust '2016-3 A3' '1.46% 10/5/2021	7,184,853	0.42
USD 1,030,000	AmeriCredit Automobile Receivables Trust '2017-1 A3' '1.87% 18/8/2021	1,032,171	0.06
USD 1,740,000	AmeriCredit Automobile Receivables Trust '2017-2 A3' '1.98% 20/12/2021	1,747,281	0.10
USD 1,940,000	Amgen Inc 2.65% 11/5/2022	1,954,716	0.12
USD 3,400,000	AMMC CLO XIII Ltd '2013-13A A1LR' '144A' FRN 24/7/2029	3,426,452	0.20
USD 1,855,000	Amphenol Corp 2.2% 1/4/2020	1,864,336	0.11
USD 550,000	Analog Devices Inc 3.5% 5/12/2026	564,189	0.03
USD 1,000,000	Anchorage Capital CLO 3 Ltd '2014-3A BR' '144A' FRN 28/4/2026	1,004,261	0.06
USD 3,520,000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc 3.3% 1/2/2023	3,657,028	0.22
USD 1,536,000	Apidos CLO XIX '2014-19A A1R' '144A' FRN 17/10/2026	1,539,224	0.09
USD 1,000,000	Apidos CLO XV '2013-15A A1R' '144A' FRN 20/10/2025	1,000,913	0.06
USD 750,000	Apidos CLO XVI '2013-16A A1R' '144A' FRN 19/1/2025	750,155	0.04
USD 2,580,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2016-FL1 Ltd '2016-FL1A A' '144A' FRN 15/9/2026	2,573,679	0.15
USD 7,690,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2017-FL1 Ltd '2017-FL1 A' '144A' FRN 15/4/2027	7,691,645	0.45
USD 6,040,000	ARI Fleet Lease Trust '2017-A A2' '144A' 1.91% 15/4/2026	6,049,771	0.36
USD 5,245,000	ARI Fleet Lease Trust '2017-A A3' '144A' 2.28% 15/4/2026	5,282,357	0.31
USD 1,805,000	AT&T Inc FRN 14/2/2023	1,803,641	0.11

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,805,000	AT&T Inc 2.85% 14/2/2023	1,804,207	0.11
USD 3,790,000	Atlas Senior Loan Fund IV Ltd '2013-2A A1LR' '144A' ' FRN 17/2/2026	3,790,435	0.22
USD 2,000,000	Atrium X '144A' FRN 16/7/2025	2,001,562	0.12
USD 2,105,000	Aviation Capital Group Corp '144A' 2.875% 20/1/2022	2,120,757	0.12
USD 560,000	Avon International Operations Inc '144A' 7.875% 15/8/2022	583,800	0.03
USD 3,531,506	B2R Mortgage Trust '2015-1 A1' '144A' 2.524% 15/5/2048	3,532,204	0.21
USD 5,958,409	B2R Mortgage Trust '2015-2 A' '144A' 3.336% 15/11/2048	6,054,024	0.36
USD 3,500,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2007-5 AM' ' FRN 10/2/2051	3,514,525	0.21
USD 47,504	Banc of America Mortgage 2003-J Trust '2003-J 2A1' FRN 25/11/2033	47,751	0.00
USD 4,950,000	Bank of America Corp FRN 20/1/2023	5,048,255	0.30
USD 6,765,000	Bank of America Corp FRN 24/4/2023	6,820,947	0.40
USD 2,835,000	Bank of America Corp 2.25% 21/4/2020	2,849,921	0.17
USD 7,220,000	BAT Capital Corp '144A' 2.297% 14/8/2020	7,257,266	0.43
USD 2,540,000	BAT Capital Corp '144A' 2.764% 15/8/2022	2,559,018	0.15
USD 23,275	Bear Stearns ALT-A Trust '2004-13 A1' FRN 25/11/2034	23,222	0.00
USD 2,040,000	Becton Dickinson and Co 2.404% 5/6/2020*	2,051,845	0.12
USD 6,385,000	BlueMountain CLO 2013-3 Ltd '2013-3A AR' '144A' FRN 29/10/2025	6,387,858	0.38
USD 10,000,000	BlueMountain CLO 2013-4 Ltd '2013-4A AR' '144A' FRN 15/4/2025	10,006,991	0.59
USD 10,805,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd '144A' 2.375% 15/1/2020	10,877,118	0.64
USD 2,340,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd '144A' 3.625% 15/1/2024	2,409,375	0.14
USD 3,130,000	Bsprt 2017-FL1 Issuer Ltd '2017-FL1 A' '144A' FRN 15/6/2027	3,133,909	0.18
USD 1,060,000	CA Inc 3.6% 15/8/2022	1,083,526	0.06
USD 172,000	Cablevision Systems Corp 8.625% 15/9/2017	172,473	0.01
USD 1,850,000	Capital One Financial Corp 3.05% 9/3/2022	1,880,011	0.11
USD 5,500,000	Capital One Multi-Asset Execution Trust '2015-A2 A2' ' 2.08% 15/3/2023	5,555,582	0.33
USD 8,695,000	Capital One NA/Mclean VA 2.35% 17/8/2018	8,739,179	0.52
USD 1,500,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-3 Ltd ' 2014-3A A2R' '144A' FRN 27/7/2026	1,503,459	0.09
USD 4,980,000	CarMax Auto Owner Trust '2016-2 A3' 1.52% 16/2/2021	4,973,719	0.29
USD 6,000,000	CarMax Auto Owner Trust '2015-4 A3' 1.56% 16/11/2020	6,000,796	0.35
USD 3,250,000	CarMax Auto Owner Trust '2014-4B' 2.2% 15/9/2020	3,266,237	0.19
USD 2,337,887	Catamaran CLO 2012-1 Ltd '2012-1A AR' '144A' FRN 20/12/2023	2,340,737	0.14
USD 1,095,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust '2016-HEAT A' ' 144A' 3.357% 10/4/2029	1,115,173	0.07
USD 1,305,000	CD 2007-CD5 Mortgage Trust '2007-CD5 AJ' FRN 15/11/2044	1,305,271	0.08
USD 2,085,000	CD 2007-CD5 Mortgage Trust '2007-CD5 AJA' FRN 15/11/2044	2,091,214	0.12
USD 1,820,000	CenterPoint Energy Inc 2.5% 1/9/2022	1,826,048	0.11

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,680,000	CGDB Commercial Mortgage Trust '2017-B10 A' '144A' ' FRN 15/5/2030	4,671,052	0.28
USD 3,150,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust '2017-B10C A' ' '144A' FRN 15/7/2028	3,142,261	0.19
USD 752,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3.579% 23/7/2020	771,002	0.05
USD 3,425,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.464% 23/7/2022	3,625,803	0.21
USD 8,230,000	Chesapeake Funding II LLC '2017-2A A2' '144A' FRN 15/5/2029	8,254,783	0.49
USD 8,948,530	Chesapeake Funding II LLC '2016-2A A1' '144A' 1.88% 15/6/2028	8,955,211	0.53
USD 2,910,000	Chicago Skyscraper Trust '2017-SKY A' '144A' FRN 15/2/2030	2,919,647	0.17
USD 313,269	CHL Mortgage Pass-Through Trust '2005-HYB8 2A1' FRN 20/12/2035	281,748	0.02
USD 3,905,177	CIFC Funding 2012-II Ltd '2012-2A A1R' '144A' FRN 5/12/2024	3,908,867	0.23
USD 1,000,000	CIFC Funding 2014-II Ltd '2014-2A A1LR' '144A' FRN 24/5/2026	1,000,996	0.06
USD 1,000,000	CIFC Funding 2014-V Ltd '2014-5A CR' '144A' FRN 17/1/2027	1,008,464	0.06
USD 9,305,000	Citibank Credit Card Issuance Trust '2017-A3 A3' 1.92% 7/4/2022	9,351,241	0.55
USD 5,790,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-SSHP A' '144A' FRN 15/9/2027	5,791,129	0.34
USD 3,750,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2013-375P A' '144A' 3.251% 10/5/2035	3,895,781	0.23
USD 3,365,000	Citigroup Inc FRN 24/7/2023	3,383,371	0.20
USD 775,000	Citigroup Inc 2.45% 10/1/2020	783,239	0.05
USD 2,000,000	Citigroup Inc 2.65% 26/10/2020	2,029,148	0.12
USD 640,000	Citigroup Inc 2.75% 25/4/2022	645,021	0.04
USD 2,593,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.2% 26/5/2020	2,602,008	0.15
USD 1,615,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.25% 2/3/2020	1,621,663	0.10
USD 2,005,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.3% 3/12/2018	2,017,185	0.12
USD 6,510,000	CLNS Trust '2017-IKPR A' '144A' FRN 11/6/2032	6,500,545	0.38
USD 5,130,000	CNH Equipment Trust '2016-B A3' 1.63% 15/8/2021	5,128,656	0.30
USD 6,140,000	CNH Equipment Trust '2017-B A3' 1.86% 15/9/2022	6,155,141	0.36
USD 2,894,411	Colony American Homes '2015-1A A' '144A' FRN 17/7/2032	2,910,213	0.17
USD 3,070,000	Comcast Corp 3% 1/2/2024	3,138,329	0.18
USD 1,363,676	COMM '2013-GAM A1' '144A' 1.705% 10/2/2028	1,358,263	0.08
USD 3,013,000	COMM 2005-C6 Mortgage Trust '2005-C6 F' '144A' FRN 10/6/2044	3,118,278	0.18
USD 1,635,000	COMM 2013-LC6 Mortgage Trust '2013-LC6 ASB' 2.478% 10/1/2046	1,658,617	0.10
USD 1,007,739	COMM 2013-SFS Mortgage Trust '2013-SFS A1' '144A' 1.873% 12/4/2035	997,003	0.06
USD 5,238,000	COMM 2014-TWC Mortgage Trust '2014-TWC A' '144A' FRN 13/2/2032	5,253,513	0.31
USD 5,500,000	COMM 2015-CCRE22 Mortgage Trust '2015-CR22 A2' 2.856% 10/3/2048	5,618,325	0.33
USD 10,917,565	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust '2015-CR23 XA' FRN 10/5/2048	549,437	0.03

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,655,000	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust '2015-CR24 ASB' 3.445% 10/8/2048	2,803,568	0.17
USD 10,700,000	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust '2015-LC21 A2' 2.976% 10/7/2048	10,991,520	0.65
USD 42,141	Continental Airlines 1997-4 Class A Pass Through Trust 6.9% 2/1/2018	42,773	0.00
USD 258	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	286	0.00
USD 299,887	Continental Airlines 2010-1 Class B Pass Through Trust 6% 12/1/2019	308,386	0.02
USD 2,250,000	Continental Airlines 2012-3 Class C Pass Through Trust 6.125% 29/4/2018	2,317,500	0.14
USD 42,580,000	Core Industrial Trust '2015-CALW XA' '144A' FRN 10/2/2034	1,383,637	0.08
USD 3,000,000	Core Industrial Trust '2015-CALW A' '144A' 3.04% 10/2/2034	3,099,727	0.18
USD 6,450,000	Core Industrial Trust '2015-TEXW A' '144A' 3.077% 10/2/2034	6,649,769	0.39
USD 1,553,806	Credit Acceptance Auto Loan Trust '2015-1A A' '144A' 2% 15/7/2022	1,554,231	0.09
USD 8,500,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust '2016-3A A' '144A' 2.15% 15/4/2024	8,499,655	0.50
USD 10,820,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust '2016-2A A' '144A' 2.42% 15/11/2023	10,873,504	0.64
USD 5,150,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust '2017-1A A' '144A' 2.56% 15/10/2025	5,177,018	0.31
USD 3,015,901	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2006-C1 G' '144A' FRN 15/2/2039	3,001,558	0.18
USD 3,315,000	Crown Castle International Corp 3.2% 1/9/2024	3,322,548	0.20
USD 1,870,000	Crown Castle International Corp 4.875% 15/4/2022	2,045,186	0.12
USD 4,170,785	CSMC Trust '2015-DEAL A' '144A' FRN 15/4/2029	4,180,994	0.25
USD 7,029,697	DBUBS 2011-LC2 Mortgage Trust '2011-LC2A A3FL' '144A' FRN 12/7/2044	7,050,512	0.42
USD 750,921	Delta Air Lines 2012-1 Class B Pass Through Trust '144A' 6.875% 7/5/2019	799,052	0.05
USD 680,000	Delta Air Lines Inc 2.875% 13/3/2020	691,654	0.04
USD 925,000	Delta Air Lines Inc 3.625% 15/3/2022	954,832	0.06
USD 11,560,000	Discover Card Execution Note Trust '2016-A4 A4' 1.39% 15/3/2022	11,510,097	0.68
USD 5,000,000	Discover Card Execution Note Trust '2014-A4 A4' 2.12% 15/12/2021	5,048,060	0.30
USD 1,265,000	Discovery Communications LLC 4.375% 15/6/2021	1,337,885	0.08
USD 1,500,000	DISH DBS Corp 4.25% 1/4/2018	1,516,875	0.09
USD 830,000	Dominion Energy Inc 2.579% 1/7/2020	838,231	0.05
USD 2,110,000	Drive Auto Receivables Trust '2017-AA A3' '144A' 1.77% 15/1/2020	2,111,226	0.12
USD 2,350,000	Drive Auto Receivables Trust '2017-2 B' 2.25% 15/6/2021	2,356,117	0.14
USD 1,500,000	Dryden 41 Senior Loan Fund '2015-41A A' '144A' FRN 15/1/2028	1,505,499	0.09
USD 2,325,000	E*TRADE Financial Corp 2.95% 24/8/2022	2,335,222	0.14
USD 2,245,000	eBay Inc 2.15% 5/6/2020	2,250,388	0.13
USD 1,435,000	Emera US Finance LP 2.15% 15/6/2019	1,437,355	0.08

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 6,951,105	Enterprise Fleet Financing LLC '2016-2 A2' '144A' 1.74% 22/2/2022	6,951,224	0.41
USD 3,840,000	Enterprise Fleet Financing LLC '2016-2 A3' '144A' 2.04% 22/2/2022	3,840,489	0.23
USD 1,920,000	Enterprise Fleet Financing LLC '2017-1 A2' '144A' 2.13% 20/7/2022	1,930,597	0.11
USD 915,000	Enterprise Products Operating LLC 1.65% 7/5/2018	914,750	0.05
USD 320,000	Equifax Inc 2.3% 1/6/2021	321,175	0.02
USD 461,957	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2014-C02 1M1' FRN 25/5/2024	463,835	0.03
USD 3,847,077	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2017-C02 2M1' FRN 25/9/2029	3,880,784	0.23
USD 4,935,780	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2017-C04 2M1' FRN 25/11/2029	4,956,359	0.29
USD 12,478	Fannie Mae Pool '255316' 5% 1/7/2019	12,809	0.00
USD 37,970	Fannie Mae Pool 'AD0454' 5% 1/11/2021	38,897	0.00
USD 141,831	Fannie Mae Pool 'AE0812' 5% 1/7/2025	145,464	0.01
USD 2,488,474	Fannie Mae Pool 'AL4364' FRN 1/9/2042	2,600,483	0.15
USD 50,131	Fannie Mae Pool 'AQ2392' 2.5% 1/11/2027	51,121	0.00
USD 29,395	Fannie Mae Pool 'AS4517' 2.5% 1/2/2030	29,889	0.00
USD 2,970,253	Fannie Mae Pool 'AS7467' 2.5% 1/7/2031	3,012,936	0.18
USD 4,755,511	Fannie Mae Pool 'AS7495' 2.5% 1/7/2031	4,827,840	0.28
USD 1,999,999	Fannie Mae Pool 'AS8028' 2.5% 1/9/2031	2,028,739	0.12
USD 570,713	Fannie Mae Pool 'AS8227' 2.5% 1/10/2031	578,914	0.03
USD 599,696	Fannie Mae Pool 'AS8678' 2.5% 1/1/2032	608,076	0.04
USD 1,136,103	Fannie Mae Pool 'AS8764' 2.5% 1/2/2032	1,151,968	0.07
USD 923,232	Fannie Mae Pool 'AS8892' 2.5% 1/2/2032	936,499	0.06
USD 189,908	Fannie Mae Pool 'AT2062' 2.5% 1/4/2028	193,623	0.01
USD 4,458,678	Fannie Mae Pool 'AX0000' FRN 1/9/2044	4,598,277	0.27
USD 67,078	Fannie Mae Pool 'AZ4120' 2.5% 1/12/2031	68,042	0.00
USD 178,187	Fannie Mae Pool 'BA3822' 2.5% 1/9/2031	180,748	0.01
USD 4,142,561	Fannie Mae Pool 'BC1187' 2.5% 1/6/2031	4,202,090	0.25
USD 446,479	Fannie Mae Pool 'BC1873' 2.5% 1/6/2031	452,994	0.03
USD 717,306	Fannie Mae Pool 'BC4938' 2.5% 1/4/2031	727,613	0.04
USD 3,520,060	Fannie Mae Pool 'BC9041' 2.5% 1/11/2031	3,570,644	0.21
USD 663,570	Fannie Mae Pool 'BD1946' 2.5% 1/6/2031	673,106	0.04
USD 3,449,390	Fannie Mae Pool 'BD4371' 2.5% 1/9/2031	3,498,958	0.21
USD 146,539	Fannie Mae Pool 'BD6462' 2.5% 1/8/2031	148,644	0.01
USD 78,330	Fannie Mae Pool 'BD7100' 2.5% 1/3/2032	79,455	0.00
USD 3,957,514	Fannie Mae Pool 'BD8284' 2.5% 1/10/2031	4,014,384	0.24
USD 217,138	Fannie Mae Pool 'BD8309' 2.5% 1/11/2031	220,258	0.01
USD 469,291	Fannie Mae Pool 'BD9359' 2.5% 1/11/2031	476,035	0.03
USD 444,903	Fannie Mae Pool 'BD9575' 2.5% 1/12/2031	451,296	0.03
USD 401,699	Fannie Mae Pool 'BE0070' 2.5% 1/11/2031	407,472	0.02
USD 703,001	Fannie Mae Pool 'BE0505' 2.5% 1/10/2031	713,103	0.04
USD 109,965	Fannie Mae Pool 'BE1964' 2.5% 1/11/2031	111,545	0.01
USD 203,710	Fannie Mae Pool 'BE2200' 2.5% 1/12/2031	206,638	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 572,271	Fannie Mae Pool 'BE4333' 2.5% 1/1/2032	580,524	0.03
USD 765,047	Fannie Mae Pool 'BE5828' 2.5% 1/1/2032	776,041	0.05
USD 1,180,722	Fannie Mae Pool 'BE7255' 2.5% 1/2/2032	1,197,009	0.07
USD 4,476,172	Fannie Mae Pool 'BH5042' 2.5% 1/8/2032	4,540,495	0.27
USD 3,900,800	Fannie Mae Pool 'BH5048' 2.5% 1/8/2032	3,956,855	0.23
USD 1,448,100	Fannie Mae Pool 'BH5053' 2.5% 1/8/2032	1,468,909	0.09
USD 1,198,449	Fannie Mae Pool 'BH5062' 2.5% 1/9/2032	1,215,296	0.07
USD 1,345,070	Fannie Mae Pool 'BH5063' 2.5% 1/9/2032	1,364,399	0.08
USD 870,069	Fannie Mae Pool 'BH8076' 2.5% 1/8/2032	882,572	0.05
USD 1,100,738	Fannie Mae Pool 'BH9183' 2.5% 1/8/2032	1,116,556	0.07
USD 3,360,881	Fannie Mae Pool 'BM1422' 2.5% 1/3/2032	3,409,177	0.20
USD 811,134	Fannie Mae Pool 'MA2775' 2.5% 1/10/2031	822,790	0.05
USD 1,220,452	Fannie Mae Pool 'MA2803' 2.5% 1/11/2031	1,237,990	0.07
USD 155,432	Fannie Mae Pool 'MA2830' 2.5% 1/12/2031	157,666	0.01
USD 1,945,004	Fannie Mae Pool 'MA3005' 2.5% 1/5/2032	1,972,953	0.12
USD 175,617	Fannie Mae Pool 'MA3076' 2.5% 1/7/2032	178,141	0.01
USD 980,380	Fannie Mae Pool 'MA3114' 2.5% 1/8/2032	994,468	0.06
USD 26,489,136	Fannie Mae Pool 'MA3124' 2.5% 1/9/2032	26,869,788	1.59
USD 6,375,838	Fannie Mae REMICS '2013-133 NA' 3% 25/5/2036	6,542,550	0.39
USD 3,588,961	Fannie Mae REMICS '2015-10 KA' 3% 25/7/2040	3,680,985	0.22
USD 4,254	Fannie Mae REMICS '2008-29 CA' 4.5% 25/9/2035	4,253	0.00
USD 5,075,972	Fannie Mae-Aces '2013-M5 X2' FRN 25/1/2022	295,529	0.02
USD 255,766,226	Fannie Mae-Aces '2014-M13 X2' FRN 25/8/2024	2,214,040	0.13
USD 24,918	Federal Express Corp 2012 Pass Through Trust '144A' 2.625% 15/1/2018	24,940	0.00
USD 555,000	Fidelity National Information Services Inc 2.25% 15/8/2021	554,844	0.03
USD 663,000	Fifth Third Bancorp 2.875% 27/7/2020	678,740	0.04
USD 2,413,061	Finn Square CLO Ltd '2012-1A A1R' '144A' FRN 24/12/2023	2,414,901	0.14
USD 1,330,000	FirstEnergy Corp 2.85% 15/7/2022	1,334,998	0.08
USD 3,000,000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A '2016-5 A1' 1.95% 15/11/2021	3,014,195	0.18
USD 1,015,000	Ford Motor Credit Co LLC 1.897% 12/8/2019	1,011,450	0.06
USD 3,655,000	Ford Motor Credit Co LLC 2.681% 9/1/2020	3,691,000	0.22
USD 2,082,000	Forest Laboratories LLC '144A' 4.375% 1/2/2019	2,143,671	0.13
USD 110,018,979	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K040 X1' FRN 25/9/2024	4,777,393	0.28
USD 3,346,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'KJ05 A2' 2.158% 25/10/2021	3,341,607	0.20
USD 3,719,447	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'KP03 A2' 1.78% 25/7/2019	3,728,745	0.22
USD 13,811,382	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'KW01 X1' FRN 25/1/2026	865,805	0.05
USD 9,723,050	Freddie Mac Non Gold Pool '849692' FRN 1/5/2045	10,014,620	0.59
USD 2,595,717	Freddie Mac REMICS '4482 DH' 3% 15/6/2042	2,669,456	0.16
USD 4,534,856	Freddie Mac REMICS '4459 BN' 3% 15/8/2043	4,664,104	0.28
USD 3,196,717	Freddie Mac REMICS '4390 CA' 3.5% 15/6/2050	3,319,521	0.20

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 5,512,762	Freddie Mac REMICS '4446 MA' 3.5% 15/12/2050	5,741,100	0.34
USD 4,363,562	Freddie Mac REMICS '4286 MP' 4% 15/12/2043	4,617,661	0.27
USD 7,098,185	Freddie Mac REMICS '4593 MP' 4% 15/4/2054	7,434,107	0.44
USD 246,463	Freddie Mac REMICS '3817 MA' 4.5% 15/10/2037	255,791	0.01
USD 401,519	Freddie Mac REMICS '3986 M' 4.5% 15/9/2041	429,740	0.03
USD 343,156	Freddie Mac REMICS '3959 MA' 4.5% 15/11/2041	369,184	0.02
USD 1,620,562	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2016-HQA2 M1' FRN 25/11/2028	1,628,386	0.10
USD 6,959,734	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2017-DNA2 M1' FRN 25/10/2029	7,030,164	0.41
USD 635,000	General Motors Financial Co Inc 2.4% 9/5/2019	638,164	0.04
USD 6,657,000	General Motors Financial Co Inc 3.15% 30/6/2022	6,683,269	0.39
USD 375,000	General Motors Financial Co Inc 3.25% 15/5/2018	378,727	0.02
USD 9,387,231	GoldenTree Loan Opportunities VII Ltd '2013-7A A' '144A' FRN 25/4/2025	9,400,272	0.55
USD 780,000	Goldman Sachs Group Inc/The 2.3% 13/12/2019	785,316	0.05
USD 2,810,000	Goldman Sachs Group Inc/The 2.6% 23/4/2020	2,845,441	0.17
USD 6,755,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3% 26/4/2022	6,864,725	0.40
USD 9,964,159	Government National Mortgage Association '2012-120 10' FRN 16/2/2053	471,875	0.03
USD 11,250,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust '2014-GRCE A' '144A' '3.369% 10/6/2028	11,747,231	0.69
USD 4,530,000	Greystone Commercial Real Estate Notes 2017-FL1 Ltd '2017-FL1A A' '144A' FRN 15/3/2027	4,534,256	0.27
USD 6,014,798	GS Mortgage Securities Trust '2012-GCJ7 A4' 3.377% 10/5/2045	6,274,204	0.37
USD 1,513,000	Hartford Financial Services Group Inc/The 5.125% 15/4/2022	1,690,737	0.10
USD 5,612,000	Hewlett Packard Enterprise Co 2.85% 5/10/2018	5,672,885	0.33
USD 7,360,000	Honda Auto Receivables 2016-2 Owner Trust '2016-2 A3' '1.39% 15/4/2020	7,352,480	0.43
USD 2,475,000	Huntington National Bank/The 2.375% 10/3/2020	2,499,144	0.15
USD 3,260,000	Huntington National Bank/The 2.875% 20/8/2020	3,333,358	0.20
USD 880,000	Hyundai Capital America '144A' 2.4% 30/10/2018	882,561	0.05
USD 1,575,000	Hyundai Capital America '144A' 2.55% 3/4/2020	1,581,150	0.09
USD 1,170,000	Hyundai Floorplan Master Owner Trust Series '2016-1A A2' '144A' 1.81% 15/3/2021	1,170,494	0.07
USD 2,500,000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.875% 15/3/2019	2,528,125	0.15
USD 1,651,000	International Lease Finance Corp 4.625% 15/4/2021	1,765,479	0.10
USD 1,030,000	International Lease Finance Corp '144A' 7.125% 1/9/2018	1,083,193	0.06
USD 2,583,000	Interpublic Group of Cos Inc/The 2.25% 15/11/2017	2,585,165	0.15

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,405,000	IPALCO Enterprises Inc '144A' 3.7% 1/9/2024	1,417,020	0.08
USD 8,000,000	Jamestown CLO III Ltd '2013-3A A1AR' '144A' FRN 15/1/2026	8,006,449	0.47
USD 6,610,000	John Deere Owner Trust '2017-B A3' 1.82% 15/10/2021	6,636,163	0.39
USD 682,651	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 A' '144A' FRN 15/11/2031	685,117	0.04
USD 12,941,258	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2016-JP4 XA' FRN 15/12/2049	613,610	0.04
USD 7,340,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2013-LC11 ASB' 2.554% 15/4/2046	7,455,991	0.44
USD 6,000,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C20 A2' 2.872% 15/7/2047	6,104,246	0.36
USD 5,000,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2012-CBX A4' 3.483% 15/6/2045	5,253,493	0.31
USD 4,305,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2013-C16 ASB' 3.674% 15/12/2046	4,532,645	0.27
USD 2,807,627	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2007-C1 A4' 5.716% 15/2/2051	2,810,643	0.17
USD 6,334,519	JP Morgan Mortgage Trust '2016-2 A1' '144A' FRN 25/6/2046	6,391,990	0.38
USD 9,404,558	JP Morgan Mortgage Trust '2017-1 A4' '144A' FRN 25/1/2047	9,489,766	0.56
USD 7,055,850	JP Morgan Mortgage Trust '2017-2 A6' '144A' FRN 25/5/2047	7,186,842	0.42
USD 18,120,000	JP Morgan Mortgage Trust '2017-3 1A6' '144A' FRN 25/8/2047	18,241,744	1.08
USD 1,055,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C26 ASB' 3.288% 15/1/2048	1,102,591	0.06
USD 3,830,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C23 ASB' 3.657% 15/9/2047	4,065,398	0.24
USD 11,740,000	JPMorgan Chase & Co FRN 25/4/2023	11,838,205	0.70
USD 7,565,000	JPMorgan Chase & Co 2.2% 22/10/2019	7,639,300	0.45
USD 971,000	Lam Research Corp 2.75% 15/3/2020	990,674	0.06
USD 3,465,000	Lam Research Corp 2.8% 15/6/2021	3,531,337	0.21
USD 4,400,000	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2007-C7 AM' FRN 15/9/2045	4,414,736	0.26
USD 1,618,000	Lennar Corp 4.75% 15/12/2017	1,624,067	0.10
USD 3,431,659	LFRF '2015-1' '144A' 4% 30/10/2027	3,414,501	0.20
USD 1,385,000	Madison Avenue Trust '2013-650M A' '144A' 3.843% 12/10/2032	1,454,300	0.09
USD 4,125,000	Marsh & McLennan Cos Inc 2.35% 6/3/2020	4,171,767	0.25
USD 3,750,000	Maxim Integrated Products Inc 2.5% 15/11/2018	3,779,940	0.22
USD 7,042,000	Mercedes-Benz Master Owner Trust '2016-BA A' '144A' FRN 17/5/2021	7,099,624	0.42
USD 9,820,000	Mercedes-Benz Master Owner Trust '2017-BA A' '144A' FRN 16/5/2022	9,857,430	0.58
USD 7,311,198	Mill City Mortgage Loan Trust '2016-1 A1' '144A' FRN 25/4/2057	7,364,156	0.43
USD 325,000	Moody's Corp 2.75% 15/12/2021	330,281	0.02
USD 4,250,000	Morgan Stanley FRN 22/7/2022	4,257,427	0.25
USD 7,000,000	Morgan Stanley 2.5% 21/4/2021	7,037,992	0.42
USD 3,000,000	Morgan Stanley 2.625% 17/11/2021	3,021,019	0.18

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,000,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2013-C10 ASB' FRN 15/7/2046	2,112,278	0.12
USD 5,000,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2013-C9 AAB' 2.657% 15/5/2046	5,101,253	0.30
USD 6,585,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2014-C19 A2' 3.101% 15/12/2047	6,765,318	0.40
USD 1,301,216	Morgan Stanley Capital I Trust '2008-T29 A4' FRN 11/1/2043	1,310,659	0.08
USD 4,940,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2014-MP A' '144A' 3.469% 11/8/2033	5,158,792	0.30
USD 1,572,879	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-HQ13 A3' 5.569% 15/12/2044	1,575,272	0.09
USD 870,000	National Retail Properties Inc 5.5% 15/7/2021	959,292	0.06
USD 295,509	Navient Private Education Loan Trust '2014-CTA A' '144A' FRN 16/9/2024	295,709	0.02
USD 1,660,338	Navient Private Education Loan Trust '2014-AA A2B' '144A' FRN 15/2/2029	1,686,234	0.10
USD 2,681,445	Navient Private Education Loan Trust '2014-AA A2A' '144A' 2.74% 15/2/2029	2,720,873	0.16
USD 1,275,090	New Residential Mortgage Loan Trust '2016-3A A1B' '144A' FRN 25/9/2056	1,313,325	0.08
USD 7,180,000	NextGear Floorplan Master Owner Trust '2014-1A A' '144A' 1.92% 15/10/2019	7,182,942	0.42
USD 915,000	NextGear Floorplan Master Owner Trust '2014-1A B' '144A' 2.61% 15/10/2019	915,624	0.05
USD 4,000,000	Nissan Auto Receivables 2016-B Owner Trust '2016-B A3' 1.32% 15/1/2021	3,987,614	0.24
USD 8,200,000	Nissan Master Owner Trust Receivables '2017-B A' FRN 18/4/2022	8,241,393	0.49
USD 7,610,000	Nissan Master Owner Trust Receivables '2016-A A2' 1.54% 15/6/2021	7,584,713	0.45
USD 125,162	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	133,767	0.01
USD 1,000,000	Octagon Investment Partners XVI Ltd '2013-1A A' '144A' FRN 17/7/2025	1,001,411	0.06
USD 189,582	OneMain Financial Issuance Trust '2014-1A A' '144A' 2.43% 18/6/2024	189,610	0.01
USD 1,489,267	OneMain Financial Issuance Trust '2014-2A A' '144A' 2.47% 18/9/2024	1,493,275	0.09
USD 500,000	OZLM Funding IV Ltd '2013-4A A1' '144A' FRN 22/7/2025	500,073	0.03
USD 1,000,000	Palmer Square CLO 2013-2 Ltd '2013-2A A1AR' '144A' FRN 17/10/2027	1,005,907	0.06
USD 385,000	Penske Automotive Group Inc 3.75% 15/8/2020	393,662	0.02
USD 7,643,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 2.875% 17/7/2018	7,719,117	0.46
USD 827,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 3.05% 9/1/2020	845,936	0.05
USD 1,490,000	PFS Financing Corp '2016-BA A' '144A' 1.87% 15/10/2021	1,485,961	0.09

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 199,000	Pioneer Natural Resources Co 3.45% 15/1/2021	205,518	0.01
USD 2,000,000	PNC Bank NA 2.3% 1/6/2020	2,020,721	0.12
USD 1,505,000	PNC Bank NA 2.45% 5/11/2020	1,527,367	0.09
USD 1,915,000	Prestige Auto Receivables Trust '2014-1A C' '144A' ' 2.39% 15/5/2020	1,919,385	0.11
USD 1,475,000	Priceline Group Inc/The 2.75% 15/3/2023	1,482,594	0.09
USD 4,091,000	QVC Inc 3.125% 1/4/2019	4,145,942	0.24
USD 2,159,900	RAIT 2017-FL7 Trust '2017-FL7 A' '144A' FRN 15/6/2037	2,160,797	0.13
USD 2,775,000	Realty Income Corp 6.75% 15/8/2019	3,025,766	0.18
USD 3,100,000	Resource Capital Corp 2017-CRE5 Ltd FRN 15/7/2034	3,103,873	0.18
USD 3,085,000	Reynolds American Inc 3.25% 12/6/2020	3,178,523	0.19
USD 2,675,000	Reynolds American Inc 6.875% 1/5/2020	2,996,579	0.18
USD 650,000	Ryder System Inc 2.5% 1/9/2022	650,708	0.04
USD 1,795,000	Ryder System Inc 2.875% 1/9/2020	1,835,450	0.11
USD 2,590,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2016-2 A3' 1.56% 15/5/2020	2,590,682	0.15
USD 970,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2017-1 A3' 1.77% 15/9/2020	970,485	0.06
USD 6,460,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2017-2 A3' 1.87% 15/12/2020	6,462,698	0.38
USD 1,394,430	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-3 C' 2.13% 17/8/2020	1,396,533	0.08
USD 534,102	Santander Drive Auto Receivables Trust '2013-5 C' 2.25% 17/6/2019	534,798	0.03
USD 552,369	Santander Drive Auto Receivables Trust '2013-A C' ' 144A' 3.12% 15/10/2019	553,566	0.03
USD 1,535,000	Santander Holdings USA Inc '144A' 3.7% 28/3/2022	1,565,563	0.09
USD 47,332	SLM Private Credit Student Loan Trust '2003-B A2' FRN 15/3/2022	47,390	0.00
USD 2,172,664	SLM Private Education Loan Trust '2014-A A2B' ' 144A' FRN 15/1/2026	2,189,757	0.13
USD 1,600,000	SLM Private Education Loan Trust '2011-B A3' '144A' ' FRN 16/6/2042	1,666,046	0.10
USD 1,560,850	SLM Private Education Loan Trust '2014-A A2A' ' 144A' 2.59% 15/1/2026	1,572,656	0.09
USD 635,289	SLM Private Education Loan Trust '2012-B A2' '144A' ' 3.48% 15/10/2030	640,788	0.04
USD 1,303,501	SLM Private Education Loan Trust '2012-A A2' '144A' ' 3.83% 17/1/2045	1,325,551	0.08
USD 1,157,452	SLM Private Education Loan Trust '2011-C A2B' ' 144A' 4.54% 17/10/2044	1,198,984	0.07
USD 1,848,893	SLM Student Loan Trust '2013-4 A' FRN 25/6/2043	1,858,137	0.11
USD 6,978,480	SMB Private Education Loan Trust '2017-A A1' '144A' ' FRN 17/6/2024	6,990,924	0.41
USD 2,762,000	SMB Private Education Loan Trust '2016-B A2A' ' 144A' 2.43% 17/2/2032	2,770,582	0.16
USD 2,430,000	SMB Private Education Loan Trust '2016-A A2A' ' 144A' 2.7% 15/5/2031	2,461,783	0.15
USD 1,189,130	SoFi Professional Loan Program 2014-B LLC '2014-B A2' ' '144A' 2.55% 27/8/2029	1,199,083	0.07

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,960,486	SoFi Professional Loan Program 2015-A LLC ' 2015-A A1 ' ' 144A ' FRN 25/3/2033	1,991,333	0.12
USD 2,363,713	Sofi Professional Loan Program 2016-A LLC ' 2016-A A2 ' ' 144A ' 2.76% 26/12/2036	2,396,597	0.14
USD 1,130,000	SoFi Professional Loan Program 2016-C LLC ' 2016-C A2B ' ' 144A ' 2.36% 27/12/2032	1,131,072	0.07
USD 1,746,116	SoFi Professional Loan Program 2016-D LLC ' 2016-D A2A ' ' 144A ' 1.53% 25/4/2033	1,744,618	0.10
USD 1,010,000	SoFi Professional Loan Program 2016-D LLC ' 2016-D A2B ' ' 144A ' 2.34% 25/4/2033	1,009,594	0.06
USD 6,390,000	Sofi Professional Loan Program 2016-E LLC ' 2016-E A2B ' ' 144A ' 2.49% 25/1/2036	6,434,819	0.38
USD 4,479,829	Sofi Professional Loan Program 2017-C LLC ' 2017-C A2A ' ' 144A ' 1.75% 25/7/2040	4,485,205	0.26
USD 670,000	Sound Point Clo XII Ltd ' 2016-2A A ' ' 144A ' FRN 20/10/2028	677,794	0.04
USD 1,500,000	Sound Point Clo XIV Ltd ' 2016-3A C ' ' 144A ' FRN 23/1/2029	1,512,398	0.09
USD 123,814	Soundview Home Loan Trust ' 2003-2 A2 ' FRN 25/11/2033	125,473	0.01
USD 2,780,000	Springleaf Funding Trust ' 2015-AA A ' ' 144A ' 3.16% 15/11/2024	2,804,548	0.17
USD 1,367,000	Sprint Communications Inc ' 144A ' 9% 15/11/2018	1,471,234	0.09
USD 925,000	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC ' 144A ' 3.36% 20/9/2021	939,249	0.06
USD 1,375,000	Stryker Corp 2% 8/3/2019	1,380,041	0.08
USD 2,650,000	Synchrony Bank 3% 15/6/2022	2,652,932	0.16
USD 8,590,000	Synchrony Credit Card Master Note Trust ' 2016-3 A ' 1.58% 15/9/2022	8,564,649	0.51
USD 2,120,000	Synchrony Financial 2.6% 15/1/2019	2,135,530	0.13
USD 2,100,000	THL Credit Wind River 2012-1 CLO Ltd ' 2012-1A DR ' ' 144A ' FRN 15/1/2026	2,133,961	0.13
USD 510,000	Toll Brothers Finance Corp 8.91% 15/10/2017	515,100	0.03
USD 4,377,127	Towd Point Mortgage Trust ' 2016-3 A1 ' ' 144A ' FRN 25/4/2056	4,385,777	0.26
USD 5,539,256	Towd Point Mortgage Trust ' 2016-4 A1 ' ' 144A ' FRN 25/7/2056	5,546,221	0.33
USD 3,810,000	Toyota Auto Receivables 2016-B Owner Trust ' 2016-B A4 ' 1.52% 16/8/2021	3,802,292	0.22
USD 6,390,000	United States Steel Corp ' 144A ' 8.375% 1/7/2021	7,092,900	0.42
USD 58,000,000	United States Treasury Note/Bond 0.75% 30/9/2018	57,691,875	3.41
USD 16,000,000	United States Treasury Note/Bond 1% 15/8/2018	15,965,000	0.94
USD 104,000,000	United States Treasury Note/Bond 1.5% 15/8/2020* †	104,215,313	6.15
USD 3,267,753	US Airways 2011-1 Class B Pass Through Trust 9.75% 22/10/2018	3,578,304	0.21
USD 1,481,049	US Airways 2012-1 Class B Pass Through Trust 8% 1/10/2019	1,610,641	0.09
USD 4,000,000	Ventas Realty LP / Ventas Capital Corp 2% 15/2/2018	4,004,450	0.24
USD 1,000,000	Venture XIX CLO Ltd ' 2014-19A BR ' ' 144A ' FRN 15/1/2027	1,009,063	0.06
USD 143,000	Viacom Inc 2.75% 15/12/2019	144,583	0.01
USD 4,215,000	VMware Inc 2.3% 21/8/2020	4,228,802	0.25

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品（続き）

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国（続き）		
USD 3,284,000	Volkswagen Group of America Finance LLC '144A' 1.65% 22/5/2018	3,280,859	0.19
USD 323,568	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C34 A1A' FRN 15/5/2046	323,288	0.02
USD 807,539	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C33 AM' FRN 15/2/2051	806,792	0.05
USD 1,030,000	Waldorf Astoria Boca Raton Trust 2016-BOCA '2016-BOCA A' '144A' FRN 15/6/2029	1,033,454	0.06
USD 1,541,000	Walgreens Boots Alliance Inc 2.7% 18/11/2019	1,567,476	0.09
USD 4,985,000	Wells Fargo & Co 2.625% 22/7/2022	5,016,405	0.30
USD 4,610,000	Wells Fargo & Co 3.069% 24/1/2023	4,711,457	0.28
USD 4,065,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2014-LC16 ASB' 3.477% 15/8/2050	4,272,676	0.25
USD 3,330,000	Welltower Inc 2.25% 15/3/2018	3,336,141	0.20
USD 890,000	WestRock Co '144A' 3% 15/9/2024	892,290	0.05
USD 973,856	Wheels SPV 2 LLC '2016-1A A2' '144A' 1.59% 20/5/2025	973,262	0.06
USD 1,160,000	Wheels SPV 2 LLC '2017-1A A2' '144A' 1.88% 20/4/2026	1,162,784	0.07
USD 2,515,000	Wm Wrigley Jr Co '144A' 3.375% 21/10/2020	2,603,593	0.15
USD 985,000	Xilinx Inc 2.95% 1/6/2024	1,003,434	0.06
USD 1,515,000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.5% 29/4/2022	1,594,992	0.09
		1,342,904,481	79.28
債券合計		1,657,046,077	97.83
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計		1,680,137,743	99.20

その他の譲渡可能な有価証券

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	債券		
	米国		
USD 260,000	Countrywide Asset-Backed Certificates 4.896% 25/1/2037**	-	0.00
USD 350,000	Structured Asset Receivables Trust Series '2003-2' FRN 31/12/2049**	-	0.00
		-	0.00
債券合計		-	0.00
その他の譲渡可能な有価証券合計		-	0.00
投資有価証券合計		1,680,137,743	99.20
その他の純資産		13,661,087	0.80
純資産合計（米ドル）		1,693,798,830	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

** 注記2(j)に記載のとおり、公正価値調整の対象である有価証券。

† 差入れた有価証券または保証として引渡した有価証券。詳細については注記14を参照のこと。

事後通告証券契約 2017年8月31日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
	米国		
USD 5,250,000	Fannie Mae Pool ' 2 9/17 ' 2% TBA	5,194,561	0.31
USD 56,921,000	Fannie Mae Pool ' 2.5 9/17 ' 2.5% TBA	57,669,574	3.40
USD 4,000,000	Fannie Mae Pool ' 2.5 8/17 ' 2.5% TBA	4,056,543	0.24
USD 13,905,000	Fannie Mae Pool ' 3 9/17 ' 3% TBA	14,345,777	0.85
USD 5,855,000	Fannie Mae Pool ' 4 9/17 ' 4% TBA	6,053,020	0.36
USD 5,000,000	Fannie Mae Pool ' 4.5 9/17 ' 4.5% TBA	5,113,244	0.30
USD 11,065,000	Freddie Mac Gold Pool ' 3 9/17 ' 3% TBA	11,421,803	0.67
USD 21,500,000	Freddie Mac Gold Pool ' 3 9/17 ' 3% TBA	21,708,410	1.28
USD 13,130,000	Freddie Mac Gold Pool ' 3.5 9/17 ' 3.5% TBA	13,737,283	0.81
T B A 合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 139,300,215米ドル)		139,300,215	8.22

事後通告(以下「T B A」という。)契約は、主にパス・スルー代理人の発行体の所在国により分類される。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
AUD	32,459,874	EUR	21,960,000	Barclays	1/9/2017	(355,777)
EUR	11,710,000	AUD	17,491,051	Deutsche Bank	1/9/2017	45,693
EUR	9,150,000	AUD	13,478,466	Barclays	1/9/2017	185,007
EUR	1,100,000	AUD	1,597,012	Morgan Stanley	1/9/2017	40,711
BRL	5,526,197	USD	1,741,200	BNP Paribas	5/9/2017	18,877
MXN	3,730,020	USD	210,000	Goldman Sachs	5/9/2017	(286)
MXN	3,743,291	USD	210,000	Morgan Stanley	5/9/2017	460
USD	214,200	BRL	673,445	Morgan Stanley	5/9/2017	(290)
USD	497,000	BRL	1,570,172	Goldman Sachs	5/9/2017	(3,095)
USD	625,000	BRL	1,962,813	BNP Paribas	5/9/2017	(150)
USD	405,000	BRL	1,273,219	RBS Plc	5/9/2017	(516)
USD	210,000	MXN	3,735,546	BNP Paribas	5/9/2017	(24)
USD	210,000	MXN	3,739,701	Morgan Stanley	5/9/2017	(258)
AUD	2,184,280	USD	1,733,019	Nomura	6/9/2017	(5,281)
EUR	7,041,500	USD	8,392,377	Deutsche Bank	6/9/2017	(44,382)
EUR	501,000	USD	600,968	Citibank	6/9/2017	(7,011)
EUR	499,000	USD	584,556	Goldman Sachs	6/9/2017	7,030
GBP	12,202,233	USD	15,765,286	UBS	6/9/2017	(64,184)
USD	1,741,909	AUD	2,185,000	State Street	6/9/2017	13,602
USD	17,811,047	EUR	15,083,000	Deutsche Bank	6/9/2017	(70,484)
USD	16,267,759	GBP	12,385,000	HSBC Bank Plc	6/9/2017	331,485
COP	1,290,390,500	USD	434,000	BNP Paribas	7/9/2017	3,558
USD	434,000	COP	1,343,230,000	Barclays	7/9/2017	(21,475)
MXN	1,061,937	USD	60,009	Goldman Sachs	11/9/2017	(361)
MXN	2,653,989	USD	149,991	UBS	11/9/2017	(920)
USD	590,224	TRY	2,102,927	HSBC Bank Plc	11/9/2017	(16,643)
AUD	2,746,161	EUR	1,840,000	BNP Paribas	12/9/2017	(10,069)
AUD	2,751,010	GBP	1,620,000	Citibank	12/9/2017	90,907
AUD	2,730,000	SEK	17,698,415	Bank of America	12/9/2017	(58,545)
CAD	5,326,600	AUD	5,355,000	Citibank	12/9/2017	5,692
CAD	134,212	EUR	90,000	Goldman Sachs	12/9/2017	129
CAD	5,611,694	EUR	3,740,000	Citibank	12/9/2017	32,784
CAD	2,675,051	NZD	2,880,000	BNP Paribas	12/9/2017	70,494
CHF	119,600	EUR	110,000	State Street	12/9/2017	(6,590)
CHF	4,054,571	EUR	3,740,000	Bank of America	12/9/2017	(236,311)
CHF	2,061,564	USD	2,120,000	State Street	12/9/2017	15,018
CHF	1,244,296	USD	1,302,428	Citibank	12/9/2017	(13,798)
CHF	2,940,512	USD	3,077,572	Bank of America	12/9/2017	(32,289)
EUR	1,840,000	AUD	2,708,614	Bank of America	12/9/2017	39,766
EUR	3,830,000	CAD	5,685,376	Barclays	12/9/2017	15,282
EUR	3,850,000	CHF	4,183,641	Citibank	12/9/2017	233,094
EUR	1,820,000	GBP	1,611,077	BNP Paribas	12/9/2017	84,906
EUR	1,790,000	SEK	17,040,261	Barclays	12/9/2017	(12,516)
EUR	3,660,000	SEK	34,939,458	Deutsche Bank	12/9/2017	(37,792)
GBP	1,620,000	AUD	2,716,278	Deutsche Bank	12/9/2017	(63,436)
GBP	1,629,138	EUR	1,820,000	BNP Paribas	12/9/2017	(61,660)

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
GBP	1,660,000	NOK	16,748,540	BNP Paribas	12/9/2017	(8,446)
GBP	1,690,000	USD	2,189,363	Bank of America	12/9/2017	(14,316)
NOK	16,634,627	GBP	1,615,000	Barclays	12/9/2017	51,773
NOK	17,551,706	GBP	1,630,000	BNP Paribas	12/9/2017	149,913
NOK	16,714,058	NZD	2,900,000	Citibank	12/9/2017	66,735
NOK	36,200,000	SEK	37,179,319	Citibank	12/9/2017	(23,032)
NZD	2,880,000	CAD	2,657,428	Deutsche Bank	12/9/2017	(56,462)
NZD	5,850,000	USD	4,216,852	State Street	12/9/2017	(33,636)
SEK	17,714,520	AUD	2,730,000	BNP Paribas	12/9/2017	60,563
SEK	17,220,099	EUR	1,790,000	Barclays	12/9/2017	35,052
SEK	52,345,319	EUR	5,460,000	Citibank	12/9/2017	84,263
SEK	17,160,203	GBP	1,650,000	BNP Paribas	12/9/2017	26,780
SEK	36,339,620	NOK	36,200,000	BNP Paribas	12/9/2017	(82,191)
USD	4,235,000	CHF	4,083,208	Barclays	12/9/2017	6,307
USD	2,240,000	CHF	2,151,567	Citibank	12/9/2017	11,772
USD	4,280,000	CHF	4,120,679	State Street	12/9/2017	12,501
USD	2,156,505	GBP	1,690,000	BNP Paribas	12/9/2017	(18,542)
USD	4,255,601	NZD	5,850,000	BNP Paribas	12/9/2017	72,385
EUR	210,000	USD	251,224	Goldman Sachs	14/9/2017	(2,154)
MXN	4,451,055	EUR	210,000	Goldman Sachs	14/9/2017	820
RUB	47,473,700	USD	787,765	Goldman Sachs	15/9/2017	25,596
RUB	57,030,962	USD	946,738	Citibank	15/9/2017	30,365
RUB	23,830,215	USD	399,006	Morgan Stanley	15/9/2017	9,274
RUB	16,801,907	USD	275,441	Societe Generale	15/9/2017	12,424
RUB	67,572,502	USD	1,107,902	Credit Suisse	15/9/2017	49,808
RUB	59,320,000	USD	971,077	HSBC Bank Plc	15/9/2017	45,243
RUB	37,930,600	USD	623,043	JP Morgan	15/9/2017	26,816
USD	403,162	RUB	23,934,915	HSBC Bank Plc	15/9/2017	(6,912)
USD	401,837	RUB	24,455,515	Credit Suisse	15/9/2017	(17,155)
USD	5,551,598	RUB	322,453,239	Deutsche Bank	15/9/2017	27,054
USD	2,505,165	RUB	145,279,513	JP Morgan	15/9/2017	16,112
USD	2,217,227	RUB	128,571,438	BNP Paribas	15/9/2017	14,431
USD	179,000	ZAR	2,346,755	Goldman Sachs	15/9/2017	(1,006)
TRY	1,330,148	EUR	319,000	Citibank	18/9/2017	4,656
TRY	9,418,712	USD	2,630,110	Barclays	20/9/2017	80,950
USD	3,722,177	TRY	13,280,404	Barclays	20/9/2017	(100,423)
USD	518	TRY	1,904	HSBC Bank Plc	20/9/2017	(30)
USD	1,230,377	TRY	4,440,011	Bank of America	20/9/2017	(47,626)
USD	1,095,410	TRY	3,942,215	Citibank	20/9/2017	(39,308)
CLP	388,608,000	USD	600,000	Deutsche Bank	21/9/2017	17,425
CLP	100,062,000	USD	153,000	BNP Paribas	21/9/2017	5,980
MXN	3,738,525	USD	210,000	BNP Paribas	21/9/2017	(349)
TRY	754,584	USD	212,500	HSBC Bank Plc	21/9/2017	4,635
USD	301,200	CLP	193,490,880	RBS Plc	21/9/2017	(6,221)
USD	451,800	CLP	292,276,778	Credit Suisse	21/9/2017	(12,574)

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
USD	210,000	MXN	3,750,588	Goldman Sachs	21/9/2017	(327)
USD	212,500	TRY	755,162	HSBC Bank Plc	21/9/2017	(4,802)
RUB	32,113,966	USD	534,400	JP Morgan	22/9/2017	15,015
USD	275,400	RUB	16,270,632	Deutsche Bank	22/9/2017	(2,963)
USD	210,000	CAD	263,735	BNP Paribas	25/9/2017	(22)
RUB	22,153,890	USD	374,000	Deutsche Bank	28/9/2017	4,548
TRY	1,315,301	USD	379,000	BNP Paribas	28/9/2017	(1,278)
USD	193,000	RUB	11,414,020	Deutsche Bank	28/9/2017	(2,034)
BRL	1,576,882	USD	497,000	Goldman Sachs	3/10/2017	2,949
USD	249,000	BRL	789,953	Deutsche Bank	3/10/2017	(1,453)
USD	1,732,442	AUD	2,184,280	Nomura	4/10/2017	5,267
USD	8,405,298	EUR	7,041,500	Deutsche Bank	4/10/2017	44,815
USD	15,781,112	GBP	12,202,233	UBS	4/10/2017	64,635
COP	672,007,200	USD	228,000	UBS	6/10/2017	(1,100)
COP	2,565,122,280	USD	868,000	Credit Suisse	6/10/2017	(1,900)
USD	434,000	COP	1,287,591,200	RBS Plc	6/10/2017	(749)
USD	868,000	COP	2,590,980,000	BNP Paribas	6/10/2017	(6,832)
USD	679,621	EUR	571,030	Goldman Sachs	11/10/2017	1,365
AUD	2,200	USD	1,754	Barclays	13/10/2017	(14)
USD	169,072	AUD	214,200	Barclays	13/10/2017	(282)
CHF	2,018,950	USD	2,105,000	Barclays	18/10/2017	(9,075)
USD	2,105,000	CHF	1,995,825	Barclays	18/10/2017	33,082
TRY	12,962,000	USD	3,708,196	BNP Paribas	23/10/2017	(13,528)
USD	6,849,971	TRY	24,902,000	BNP Paribas	23/10/2017	(248,055)
IDR	3,242,517,902	USD	241,384	Morgan Stanley	26/10/2017	422
IDR	3,198,131,457	USD	238,045	Deutsche Bank	26/10/2017	452
IDR	6,348,403,168	USD	472,563	BNP Paribas	26/10/2017	861
IDR	2,412,625,473	USD	179,604	Citibank	26/10/2017	314
USD	531,025	IDR	7,149,466,057	BNP Paribas	26/10/2017	(2,136)
USD	2,318,247	IDR	31,161,758,459	Deutsche Bank	26/10/2017	(5,599)
USD	114,323	IDR	1,544,728,471	Bank of America	26/10/2017	(873)
USD	97,719	IDR	1,315,103,024	Goldman Sachs	26/10/2017	(353)
USD	535,622	IDR	7,206,377,473	JP Morgan	26/10/2017	(1,784)
USD	232,828	IDR	3,130,830,173	UBS	26/10/2017	(650)
USD	390,342	IDR	5,248,869,042	Barclays	26/10/2017	(1,086)
TRY	50,000	USD	14,196	BNP Paribas	20/11/2017	(56)
USD	1,975,029	TRY	7,142,000	BNP Paribas	20/11/2017	(44,625)
IDR	2,301,660,000	USD	171,000	HSBC Bank Plc	22/11/2017	89
IDR	2,299,950,000	USD	171,000	JP Morgan	29/11/2017	(190)
TRY	37,864,000	USD	9,915,073	BNP Paribas	25/6/2018	194,291
TRY	7,192,000	USD	1,850,316	BNP Paribas	20/8/2018	41,553
未実現純評価益						647,494

未決済先渡為替予約 2017年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益 / (損) (米ドル)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	45,106,102	USD	53,389,707	BNY Mellon	15/9/2017	111,107
USD	729,941	EUR	616,839	BNY Mellon	15/9/2017	(1,698)
未実現純評価益						109,409
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	261,836	USD	192,566	BNY Mellon	15/9/2017	79
USD	17,389	SGD	23,678	BNY Mellon	15/9/2017	(32)
未実現純評価益						47
未実現純評価益合計 (米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 510,875,152米ドル)						756,950

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済上場先物取引 2017年8月31日現在

契約数	通貨	契約 / 摘要	満期日	基礎となるエク スポージャー (米ドル)	未実現評価損 (米ドル)
(3)	EUR	Euro BOBL	2017年9月	473,656	(676)
(13)	EUR	Euro Bund	2017年9月	2,546,107	(42,687)
2,206	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2017年12月	477,219,842	(3,184)
(56)	USD	US Long Bond (CBT)	2017年12月	8,734,250	(56,007)
(276)	USD	US Ultra 10 Year Note	2017年12月	37,665,375	(150,487)
(568)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2017年12月	72,082,750	(19,377)
(2,810)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2017年12月	332,941,094	(538,776)
(2,042)	USD	90 Day Euro \$	2018年12月	502,204,375	(229,725)
(44)	USD	90 Day Euro \$	2019年3月	10,817,400	(46,200)
合計				1,444,684,849	(1,087,119)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

スワップ 2017年8月31日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (575,434)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2020	14,342	7,056
CDS	USD 575,434	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2020	(11,903)	(6,654)
CDS	USD 360,000	ファンドは Republic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2022	(5,485)	11,490
CDS	USD 122,000	ファンドは Argentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(1,477)	(11,093)
CDS	USD 749,700	ファンドは Argentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(35,026)	(68,167)
CDS	USD 130,000	ファンドは Argentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(1,747)	(11,820)
CDS	USD 123,000	ファンドは Argentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(1,489)	(11,184)
CDS	USD 4,083,000	ファンドはL Brands Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(9,849)	271,246
CDS	USD 124,355	ファンドは Argentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(996)	(11,307)
CDS	USD 972,000	ファンドはL Brands Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(1,977)	64,573
CDS	USD 1,945,000	ファンドはL Brands Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(4,376)	129,212
CDS	USD 124,285	ファンドは Argentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(1,051)	(11,301)
CDS	USD 124,000	ファンドは Argentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(1,031)	(11,275)
CDS	USD 208,000	ファンドは Republic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(3,169)	6,638
CDS	USD 124,000	ファンドは Argentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(965)	(11,275)
CDS	USD (7,259,000)	ファンドは CDX.NA.HY.28.VI に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2022	(4,749)	524,231
CDS	USD (13,000,000)	ファンドは CDX.NA.IG.28.VI に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	17,457	246,842
CDS	USD (1,130,000)	ファンドは CMBX.NA.10.BBB- に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/11/2059	(23,316)	(122,395)
CDS	USD 131,360	ファンドは Argentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(1,042)	(11,944)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 12,283,000	ファンドはCDX.NA.IG.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(54,748)	(233,228)
CDS	USD 222,500	ファンドは Republic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(3,367)	7,101
CDS	USD 2,810,000	ファンドはTarget Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	5,552	(47,526)
CDS	USD 127,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(1,065)	(11,548)
CDS	USD (2,905,000)	ファンドはNewmont Mining Corpに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2022	55,693	55,531
CDS	USD (6,205,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(65,612)	(742,076)
CDS	USD (6,375,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(114,521)	(762,407)
CDS	USD 320,000	ファンドは Republic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2022	(4,578)	10,213
CDS	USD 575,434	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	(10,693)	(7,056)
CDS	USD (575,434)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	14,691	6,655
CDS	USD (14,290,000)	ファンドはCDX.NA.HY.28.VIに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2022	(62,936)	1,031,995
CDS	USD 2,740,000	ファンドはLowe's Companies Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(4,067)	(90,183)
CDS	USD 2,537,804	ファンドは Philippine Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(38,950)	(45,002)
CDS	USD (3,665,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(63,574)	(438,309)
CDS	USD (1,230,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(17,546)	(147,100)
CDS	USD (500,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(5,923)	(59,797)
CDS	USD (2,495,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(51,221)	(298,385)
CDS	USD (2,495,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(46,363)	(298,385)
CDS	USD (2,495,000)	ファンドはCMBX.NA.10.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/11/2059	(60,610)	(270,244)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	BRL 16,011,260	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、9.5%の固定金利を支払う	Bank of America	2/10/2017	(2,837)	(2,837)
IRS	BRL 5,428,388	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、7.75%の固定金利を支払う	Bank of America	2/1/2019	(388)	(388)
IRS	BRL 2,409,593	ファンドは9.135%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	4/1/2021	1,109	1,109
IRS	MXN 2,978,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.31%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	7,723	7,723
IRS	MXN 2,978,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.31%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	7,723	7,723
IRS	USD 35,970,000	ファンドは1.485%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Barclays	20/1/2019	(2,208)	(2,208)
IRS	USD 37,040,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.135%の固定金利を支払う	Barclays	31/8/2020	539,725	539,725
IRS	USD 14,940,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.935%の固定金利を支払う	Barclays	20/1/2022	(142,357)	(142,357)
IRS	MXN 66,110,000	ファンドは7.08%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	BNP Paribas	8/8/2019	66	66
IRS	BRL 3,914,164	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、8.98%の固定金利を支払う	Citibank	2/1/2018	(1,111)	(1,111)
IRS	BRL 10,660,584	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、9.985%の固定金利を支払う	Citibank	2/1/2018	(16,536)	(16,536)
IRS	MXN 29,180,086	ファンドは7.07%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	21/11/2018	(3,370)	(3,370)
IRS	MXN 49,800,000	ファンドは6.98%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	28/11/2018	(8,653)	(8,653)
IRS	BRL 9,289,957	ファンドは9.25%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2019	49,028	49,028
IRS	BRL 5,401,377	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、8%の固定金利を支払う	Citibank	2/1/2019	(5,245)	(5,245)
IRS	BRL 5,416,854	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、8.78%の固定金利を支払う	Citibank	2/1/2020	(10,302)	(10,302)
IRS	BRL 2,405,937	ファンドは9.84%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2023	7,863	7,863
IRS	BRL 1,266,165	ファンドは9.85%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2023	4,301	4,301
IRS	MXN 3,077,500	ファンドは6.325%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	17/7/2025	(7,735)	(7,735)
IRS	MXN 9,181,000	ファンドは6.33%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	6/8/2025	(23,122)	(23,122)
IRS	USD 90,000,000	ファンドは1.6%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Citigroup	30/9/2019	34,889	34,889
IRS	MXN 91,737,079	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.3614%の固定金利を支払う	Credit Suisse	28/1/2019	(12,344)	(12,344)
IRS	KRW 846,158,536	ファンドは1.92%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Deutsche Bank	10/11/2017	771	771
IRS	KRW 846,158,536	ファンドは3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を受け取り、1.69%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	10/11/2017	(436)	(436)
IRS	EUR 31,100,000	ファンドは0.49361%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Deutsche Bank	4/7/2019	471,189	471,189
IRS	EUR 31,100,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.44988%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	4/7/2019	(441,352)	(441,352)
IRS	MXN 76,960,000	ファンド7.16%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Deutsche Bank	29/4/2020	22,651	22,651
IRS	MXN 11,053,204	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.3072%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/8/2025	28,771	28,771
IRS	USD 4,195,000	ファンドは2.645%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Deutsche Bank	20/1/2027	56,271	56,271

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	MXN 27,013,100	ファンドは7.445%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	7/3/2022	32,753	32,753
IRS	MXN 13,509,627	ファンドは7.47%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	7/3/2022	17,123	17,123
IRS	MXN 13,508,273	ファンドは7.48%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	7/3/2022	17,419	17,419
IRS	USD 440,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.231%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	13/1/2027	(7,638)	(7,638)
IRS	USD 190,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.238%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	13/1/2027	(3,412)	(3,412)
IRS	USD 540,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.245%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	13/1/2027	(10,021)	(10,021)
IRS	USD 60,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.251%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	13/1/2027	(1,144)	(1,144)
IRS	MXN 32,002,000	ファンドは7.16%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	HSBC Bank Plc	1/6/2022	19,325	19,325
IRS	BRL 10,660,955	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、9.98%の固定金利を支払う	JP Morgan	2/1/2018	(16,412)	(16,412)
IRS	MXN 35,016,104	ファンドは7.06%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	JP Morgan	21/11/2018	(4,277)	(4,277)
IRS	MXN 28,250,647	ファンドは6.98%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	JP Morgan	28/11/2018	(4,909)	(4,909)
IRS	BRL 8,819,014	ファンドは9.275%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2019	47,482	47,482
IRS	MXN 6,176,000	ファンドは6.32%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Morgan Stanley	17/7/2025	(15,628)	(15,628)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 413,920,852米ドル)					17,058	(742,133)

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IRS: 金利スワップ

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建オプション 2017年8月31日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価損 (米ドル)	時価 (米ドル)
360,000	コール	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.275	16/10/2017	(167)	1,826
613,000	プット	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.165	7/9/2017	(3,058)	823
16,890,000	コール	OTC USD/CHF	Deutsche Bank	USD 0.995	16/10/2017	(1,516)	48,647
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 2,127,532米ドル)						(4,741)	51,296

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建スワップション 2017年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価損 (米ドル)	時価 (米ドル)
JPY 7,480,000,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/7/2019より6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を半年毎に受け取り、25/7/2019より1.38%の固定金利を半年毎に支払う	Credit Suisse	23/1/2019	(168,846)	53,705
USD 12,585,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/4/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、20/7/2022より3.35%の固定金利を半年毎に支払う	Deutsche Bank	18/1/2022	(123,266)	159,896
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 5,117,876米ドル)				(292,112)	213,601

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(2018年6月末現在)

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」

資産総額	1,481,349,106円
負債総額	606,687円
純資産総額(-)	1,480,742,419円
発行済数量	1,543,539,411口
1 単位当たり純資産額(/)	0.9593円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

1 受益証券の名義書換え等

該当事項はありません。

2 受益者名簿の閉鎖の時期

受益者名簿は作成していません。

3 投資者に対する特典

該当事項はありません。

4 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

譲渡制限は設けておりません。

5 受益証券の再発行

投資者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとしします。

6 受益権の譲渡

投資者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとしします。

前項の申請のある場合には、の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとしします。ただし、

の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとしします。

の振替について、委託会社は、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

7 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

8 受益権の再分割

委託会社は、受益権の再分割を行ないません。ただし、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとしします。

9 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者（償還日以前において換金が行なわれた受益権に係る投資者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で購入代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として投資者とします。）に支払います。なお、当該投資者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

10 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、換金の受付、換金代金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

資本金 3,120百万円

発行する株式の総数 36,000株

発行済株式の総数 15,000株

直近5カ年における主な資本金の額の増減

2017年12月7日付で、資本金を2,435百万円から3,120百万円に増額しました。

(2) 委託会社の機構

経営の意思決定機構

<株主総会>

株主により構成される会社における最高の意思決定機関として、取締役の選任、利益処分承認、定款の変更等、会社法および定款の定めにしたがって重要事項の決定を行ないます。

<取締役会>

取締役により構成され、当社の業務執行を決定し、その執行について監督します。

<エグゼクティブ委員会他各委員会>

当社における適切な経営戦略の構築、業務執行体制の構築および業務運営の推進を目的として、エグゼクティブ委員会を設置します。また、その他各種委員会を設置し、業務の能率的運営および責任体制の確立を図っています。

運用の意思決定機構

投資委員会

・投資委員会にて運用にかかる投資方針、パフォーマンスおよびリスク管理に関する重要事項を審議します。

運用担当部署

・各運用担当部署では、投資委員会の決定にしたがい、ファンドの個別の運用計画を策定し、各部署の投資プロセスを通して運用を行ないます。

ポートフォリオ・マネジャー

・ポートフォリオ・マネジャーは、策定された運用計画に基づき、個別銘柄を選択し売買に関する指図を行ないます。

リスク管理

・委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行なっております。具体的には、運用担当部門とは異なる部門においてファンドの投資リスクの計測・分析、投資制限のモニタリングなどを行なうことにより、ファンドの投資リスクが運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行なっております。

2【事業の内容及び営業の概況】

投信法に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用(投資運用業)を行なっています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務、第一種金融商品取引業務および第二種金融商品取引業務等を行なっています。

委託会社の運用する証券投資信託は2018年6月末現在、以下の通りです(親投資信託を除きます。)

種類		本数	純資産総額
公募投資信託	追加型株式投資信託	77本	1,327,786百万円
	単位型株式投資信託	0本	0百万円
私募投資信託		68本	5,619,040百万円
合計		145本	6,946,826百万円

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表の作成方法について

委託会社であるブラックロック・ジャパン株式会社(以下「当社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。)第2条及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号。)に基づいて作成しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第31期事業年度(自平成29年1月1日 至平成29年12月31日)の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

3．財務諸表に記載している金額については、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

		第30期 (平成28年12月31日現在)	第31期 (平成29年12月31日現在)
資産の部			
流動資産			
現金・預金		12,415	19,097
立替金		49	11
前払費用		127	171
未収入金	2	2	3
未収委託者報酬		1,163	1,585
未収運用受託報酬		2,771	2,642
未収収益	2	1,192	1,384
為替予約		-	0
繰延税金資産		845	860
その他流動資産		5	33
流動資産計		18,573	25,789
固定資産			
有形固定資産			
建物附属設備	1	1,087	946
器具備品	1	449	411
有形固定資産計		1,536	1,358
無形固定資産			
ソフトウェア		8	4
のれん		98	42
無形固定資産計		106	47
投資その他の資産			
投資有価証券		0	3
長期差入保証金		972	1,124
前払年金費用		501	588
長期前払費用		8	25
投資その他の資産計		1,483	1,741
固定資産計		3,127	3,147
資産合計		21,701	28,937

	第30期 (平成28年12月31日現在)	第31期 (平成29年12月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	86	119
未払金	2	
未払収益分配金	3	4
未払償還金	75	74
未払手数料	392	593
その他未払金	1,385	1,737
未払費用	2	
未払消費税等	52	150
未払法人税等	263	438
前受金	-	79
前受収益	-	15
賞与引当金	1,884	1,886
役員賞与引当金	141	144
早期退職慰労引当金	37	9
流動負債計	5,465	6,500
固定負債		
退職給付引当金	60	55
資産除去債務	258	262
繰延税金負債	29	74
固定負債計	348	392
負債合計	5,813	6,892
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,435	3,120
資本剰余金		
資本準備金	2,316	3,001
その他資本剰余金	3,846	3,846
資本剰余金合計	6,162	6,847
利益剰余金		
利益準備金	336	336
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	6,953	11,739
利益剰余金合計	7,290	12,076
株主資本合計	15,887	22,044
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	0
評価・換算差額等合計	0	0
純資産合計	15,887	22,044
負債・純資産合計	21,701	28,937

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

	第30期 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)	第31期 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
営業収益		
委託者報酬	3,977	5,202
運用受託報酬	1 9,036	8,890
その他営業収益	1 10,533	12,257
営業収益計	23,546	26,350
営業費用		
支払手数料	1,296	1,830
広告宣伝費	237	208
調査費		
調査費	383	380
委託調査費	1 4,020	4,313
調査費計	4,404	4,693
委託計算費	114	86
営業雑経費		
通信費	53	50
印刷費	63	62
諸会費	31	32
営業雑経費計	148	145
営業費用計	6,201	6,964
一般管理費		
給料		
役員報酬	604	353
給料・手当	3,809	3,960
賞与	2,232	2,232
給料計	6,646	6,546
退職給付費用	256	287
福利厚生費	822	892
事務委託費	1 2,216	2,433
交際費	51	69
寄付金	2	2
旅費交通費	241	243
租税公課	142	231
不動産賃借料	732	735
水道光熱費	64	65
固定資産減価償却費	229	262
のれん償却額	56	56
資産除去債務利息費用	3	3
諸経費	414	363
一般管理費計	11,881	12,194
営業利益	5,463	7,191

	第30期 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)	第31期 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
営業外収益		
受取利息	3	0
有価証券売却益	-	0
為替差益	12	-
雑益	0	0
営業外収益計	16	1
営業外費用		
支払利息	0	-
有価証券売却損	0	-
為替差損	-	34
固定資産除却損	1	-
営業外費用計	1	34
経常利益	5,479	7,158
特別利益		
特別利益計	-	-
特別損失		
特別退職金	163	119
特別損失計	163	119
税引前当期純利益	5,315	7,039
法人税、住民税及び事業税	1,920	2,223
法人税等調整額	76	29
当期純利益	3,318	4,786

(3)【株主資本等変動計算書】

第30期（自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日）

(単位：百万円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他 有価証券 評価 差額金		評価・換 算差額等 合計
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益 剰余金 合計				
平成28年1月1日残高	2,435	2,316	3,846	6,162	336	9,634	9,971	18,569	-	-	18,569
事業年度中の変動額											
剰余金の配当						6,000	6,000	6,000			6,000
当期純利益						3,318	3,318	3,318			3,318
株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額（純額）									0	0	0
事業年度中の変動額合計	-	-	-	-	-	2,681	2,681	2,681	0	0	2,681
平成28年12月31日残高	2,435	2,316	3,846	6,162	336	6,953	7,290	15,887	0	0	15,887

第31期（自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日）

(単位：百万円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他 有価証券 評価 差額金		評価・換 算差額等 合計
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益 剰余金 合計				
平成29年1月1日残高	2,435	2,316	3,846	6,162	336	6,953	7,290	15,887	0	0	15,887
事業年度中の変動額											
新株の発行	685	685		685				1,370			1,370
剰余金の配当							-	-			-
当期純利益						4,786	4,786	4,786			4,786
株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額（純額）									0	0	0
事業年度中の変動額合計	685	685	-	685	-	4,786	4,786	6,156	0	0	6,156
平成29年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	11,739	12,076	22,044	0	0	22,044

注 記 事 項

【重要な会計方針】

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定）を採用しております。

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却方法

(1) 有形固定資産

定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は建物附属設備6～18年、器具備品2～15年であります。

(2) 無形固定資産

自社利用のソフトウェアの減価償却方法については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

のれんの償却方法については、その効果の及ぶ期間（5～9年）に基づく定額法によっております。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金の計上方法

債権の貸倒損失に備えるため、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 退職給付引当金の計上方法

旧退職金制度

適格退職年金制度移行日現在在籍していた従業員については、旧退職金制度に基づく給付額を保証しているため、期末現在の当該給付額と年金制度に基づく給付額との差額を引当て計上しております。

確定拠出年金制度

確定拠出年金制度（DC）による退職年金制度を有しております。

確定給付年金制度

キャッシュ・バランス型の年金制度（CB）の退職年金制度を有しております。CBには、一定の利回り保証を付しており、これの将来の支払に備えるため、確定給付型の会計基準に準じた会計処理方法により引当金を計上しております。

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当期までの期間に帰属させる方法については、ポイント基準によっております。

過去勤務債務は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（9年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異は各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（9年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理または費用から控除することとしております。

(3) 賞与引当金の計上方法

従業員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。

(4) 役員賞与引当金の計上方法

役員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。

(5) 早期退職慰労引当金の計上方法

早期退職慰労の支払に備えて、早期退職慰労支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。

5. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

6. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の処理方法

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

親会社であるブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社を連結納税親会社として、連結納税制度を適用しております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
建物附属設備	1,191 百万円	1,346 百万円
器具備品	717 百万円	821 百万円

2 関係会社に対する資産及び負債

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
未収収益	484 百万円	508 百万円
未払金	1,361 百万円	1,713 百万円
未払費用	173 百万円	356 百万円

3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行2行と当座貸越契約を締結しております。これら契約に基づく事業年度末の借入未実行残高は次のとおりであります。

	前事業年度 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
当座貸越極度額	1,000 百万円	1,000 百万円
借入実行残高	-	-
差引額	1,000 百万円	1,000 百万円

（損益計算書関係）

1 関係会社に対する営業収益及び営業費用

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)		当事業年度 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)	
その他営業収益	4,730	百万円	4,670	百万円
委託調査費	377	百万円	438	百万円
事務委託費	630	百万円	824	百万円
運用受託報酬	4	百万円	48	百万円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日）

1. 発行済株式に関する事項

	前事業年度期首	増加	減少	前事業年度末
普通株式（株）	10,158	-	-	10,158

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

配当支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成28年9月8日 取締役会決議	普通株式	6,000	590,667	平成28年9月9日	平成28年9月9日

当事業年度（自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日）

1. 発行済株式に関する事項

	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	10,158	4,842	-	15,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定し、また、資金調達については関連当事者からの長期借入に限定しています。

投資有価証券は、当社設定の投資信託であり、通常の営業過程において保有しております。

デリバティブについては、外貨建て営業債権及び債務の為替変動リスクを回避するために利用し、投機的な取引は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。当該リスクに関しては、当社の経理規程に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行い、個別に未収債権の回収可能性を管理する体制をしいております。

営業債務である未払手数料はその全てが1年以内の支払期日となっております。

営業債務は流動性リスクに晒されていますが、当社では資金繰計画を作成するなどの方法により管理しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、金額的重要性が低いものについては含めておりません。

前事業年度（平成28年12月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 現金・預金	12,415	12,415	-
(2) 未収委託者報酬	1,163	1,163	-
(3) 未収運用受託報酬	2,771	2,771	-
(4) 未収収益	1,192	1,192	-
(5) 長期差入保証金	972	969	3
資産計	18,516	18,512	3
(1) 未払手数料	392	392	-
(2) 未払費用	1,141	1,141	-
負債計	1,533	1,533	-

当事業年度(平成29年12月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 現金・預金	19,097	19,097	-
(2) 未収委託者報酬	1,585	1,585	-
(3) 未収運用受託報酬	2,642	2,642	-
(4) 未収収益	1,384	1,384	-
(5) 長期差入保証金	1,124	1,109	14
資産計	25,834	25,819	14
(1) 未払手数料	593	593	-
(2) 未払費用	1,245	1,245	-
負債計	1,838	1,838	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

資 産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収収益

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(5) 長期差入保証金

事務所敷金の時価については、事務所の敷金を当該賃貸借契約期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。また従業員社宅敷金の時価については、平均残存勤務期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。

負 債

(1) 未払手数料、(2) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成28年12月31日)

	1年以内 (百万円)	1年超 5年以内 (百万円)	5年超 10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	12,415	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,163	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,771	-	-	-
(4) 未収収益	1,192	-	-	-
(5) 長期差入保証金	-	907	53	11
合計	17,543	907	53	11

当事業年度（平成29年12月31日）

	1年以内 （百万円）	1年超 5年以内 （百万円）	5年超 10年以内 （百万円）	10年超 （百万円）
(1) 現金・預金	19,097	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,585	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,642	-	-	-
(4) 未収収益	1,384	-	-	-
(5) 長期差入保証金	-	1,051	61	11
合計	24,709	1,051	61	11

（有価証券関係）

前事業年度（平成28年12月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（平成29年12月31日）

その他有価証券

	種類	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	その他 投資信託	3	3	0
合計		3	3	0

（退職給付関係）

前事業年度（自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社で設けられていた、旧退職金制度を引き続き有しています。当社は、平成21年12月2日に旧ブラックロック・ジャパン株式会社との合併に伴い、旧ブラックロック・ジャパン株式会社における退職年金制度（確定拠出年金制度及び確定給付年金制度）を承継しました。また、平成23年1月1日付で旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社から引き継いだ適格退職年金制度はキャッシュ・バランス型の確定給付年金制度に移行しました。従って、平成23年1月1日以降、からの三つの制度を有しています。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	前事業年度 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,661
勤務費用	250
利息費用	11
数理計算上の差異の発生額	8
退職給付の支払額	168
退職給付債務の期末残高	1,745

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	前事業年度 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)
年金資産の期首残高	2,304
期待運用収益	27
数理計算上の差異の発生額	56
事業主からの拠出額	274
退職給付の支払額	168
年金資産の期末残高	2,381

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成28年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,685
年金資産	2,381
	696
非積立型制度の退職給付債務	60
未積立退職給付債務	635
未認識数理計算上の差異	174
未認識過去勤務費用	20
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	441
退職給付引当金	60
前払年金費用	501
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	441

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)
勤務費用	250
利息費用	11
期待運用収益	27
数理計算上の差異の費用処理額	39
過去勤務費用の処理額	6
確定給付制度に係る退職給付費用合計	188
特別退職金	163
合計	351

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	前事業年度 (平成28年12月31日)
合同運用	100%
合計	100%

合同運用による年金資産の主な商品分類ごとの比率は、債券73%、株式22%及びその他3%となっております。

長期期待運用収益率の算定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)
割引率	0.5%
長期期待運用収益率	0.8%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、68百万円 でありました。

当事業年度（自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社で設けられていた、旧退職金制度を引き続き有しています。当社は、平成21年12月2日に旧ブラックロック・ジャパン株式会社との合併に伴い、旧ブラックロック・ジャパン株式会社における退職年金制度（確定拠出年金制度及び 確定給付年金制度）を承継しました。また、平成23年1月1日付で旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社から引き継いだ適格退職年金制度はキャッシュ・バランス型の 確定給付年金制度に移行しました。従って、平成23年1月1日以降、 から の三つの制度を有しています。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	当事業年度 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,745
勤務費用	268
利息費用	8
数理計算上の差異の発生額	20
退職給付の支払額	170
退職給付債務の期末残高	1,832

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	当事業年度 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
年金資産の期首残高	2,381
期待運用収益	19
数理計算上の差異の発生額	83
事業主からの拠出額	290
退職給付の支払額	153
年金資産の期末残高	2,621

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位：百万円)

	当事業年度 (平成29年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,776
年金資産	2,621
	845
非積立型制度の退職給付債務	55
未積立退職給付債務	789
未認識数理計算上の差異	242
未認識過去勤務費用	13
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	532
退職給付引当金	55
前払年金費用	588
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	532

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	当事業年度 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
勤務費用	268
利息費用	8
期待運用収益	19
数理計算上の差異の費用処理額	35
過去勤務費用の処理額	6
確定給付制度に係る退職給付費用合計	216
特別退職金	119
合計	335

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	当事業年度 (平成29年12月31日)
合同運用	100%
合計	100%

合同運用による年金資産の主な商品分類ごとの比率は、債券72%、株式23%及びその他5%となっております。

長期期待運用収益率の算定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	当事業年度 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
割引率	0.4%
長期期待運用収益率	0.9%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、71百万円 でありました。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	196	206
賞与引当金	581	537
資産除去債務	79	80
資産調整勘定	24	4
未払事業税	55	74
早期退職慰労引当金	11	2
退職給付引当金	18	17
有形固定資産	5	4
その他	9	44
繰延税金資産合計	983	973
繰延税金負債		
退職給付引当金	153	180
資産除去債務に対応する除去費用	13	6
繰延税金負債合計	167	186
繰延税金資産の純額	815	786

(注) 前事業年度及び当事業年度における繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

(単位：百万円)

	前事業年度 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
流動資産 - 繰延税金資産	845	860
固定負債 - 繰延税金負債	29	74

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

	前事業年度 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
法定実効税率	33.1 %	30.9 %
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	3.3	2.1
損金不算入ののれん償却額	0.3	0.2
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.8	0.2
所得拡大促進税制による税額控除	-	1.8
その他	0.0	0.4
税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.5 %	32.0 %

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

当事業所の定期建物賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を当該定期建物賃貸借契約上の賃貸借期間10年と見積り、割引率は1.5%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)	当事業年度 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
期首残高	254	258
時の経過による調整額	3	3
資産除去債務の履行による減少額	-	-
期末残高	258	262

(デリバティブ取引関係)

前事業年度（平成28年12月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（平成29年12月31日）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	69	-	0	0
合計		69	-	0	0

(注) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

（セグメント情報等）

前事業年度（自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日）

1. セグメント情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：百万円）

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	3,977	9,036	10,533	23,546

(2) 地域ごとの情報

売上高

（単位：百万円）

日本	北米	その他	合計
12,127	9,200	2,218	23,546

（注） 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

（単位：百万円）

相手先	営業収益	関連するセグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	4,735	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	2,815	投資運用業

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自平成29年1月1日至平成29年12月31日)

1. セグメント情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位:百万円)

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	5,202	8,890	12,257	26,350

(2) 地域ごとの情報

売上高

(単位:百万円)

日本	北米	その他	合計
13,186	10,831	2,332	26,350

(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位:百万円)

相手先	営業収益	関連するセグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	4,719	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	3,512	投資運用業

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 ニュー ヨーク州	13,889 百万 米ドル	投資 顧問業	(被所有) 間接 100	投資顧問 契約の 再委任等	運用受託報酬	4	未収収益	484
							受入手数料	4,730		
							委託調査費	377	未払費用	173
							事務委託費	630		
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本 東京都	1万円	持株会社	(被所有) 直接 100	株式の 保有等	営業外収益	0	その他未払金	1,361

当事業年度（自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 ニュー ヨーク州	14,286 百万 米ドル	投資 顧問業	(被所有) 間接 100	投資顧問 契約の 再委任等	運用受託報酬	48	未収収益	508
							受入手数料	4,670		
							委託調査費	438	未払費用	356
							事務委託費	824		
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本 東京都	1万円	持株会社	(被所有) 直接 100	株式の 保有等	営業外収益	0	その他未払金	1,645

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

前事業年度（自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日）

該当事項はありません。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国 カリフォル ニア州	1,000 米ドル	投資 顧問業	なし	投資顧問 契約の 再委任等	受入手数料	2,815	未収収益	267
							委託調査費	40		
							事務委託費	0	未払費用	3
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エルエルシー	米国 デラウェア 州	87 百万 米ドル	投資 顧問業	なし	投資顧問 契約の 再委任等	受入手数料	425	未収収益	35
							委託調査費	1,556		
							事務委託費	81	未払費用	135

当事業年度(自平成29年1月1日至平成29年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国カリフォルニア州	1,000米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	3,512	未収収益	296
							委託調査費	77	未払費用	17
							事務委託費	10		
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エルエルシー	米国デラウェア州	213百万米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	363	未収収益	28
							委託調査費	1,427	未払費用	129
							事務委託費	119	その他未払金	1

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 運用受託報酬については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (2) 受入手数料については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (3) 委託調査費については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (4) 事務委託費については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (5) 支払利息については、市場金利を勘案して決定しております。なお、担保は差し入れておりません。
- (6) 長期借入金の期末残高は劣後特約付借入金に係るものであります。

2. 親会社に関する注記

(1) 親会社情報

ブラックロック・インク(ニューヨーク証券取引所に上場)
 ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク(非上場)
 ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社(非上場)

(1株当たり情報)

項目	前事業年度 (自平成28年1月1日 至平成28年12月31日)	当事業年度 (自平成29年1月1日 至平成29年12月31日)
1株当たり純資産額	1,564,056円75銭	1,469,634円10銭
1株当たり当期純利益金額	326,685円49銭	456,306円62銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	前事業年度 (自平成28年1月1日 至平成28年12月31日)	当事業年度 (自平成29年1月1日 至平成29年12月31日)
当期純利益 (百万円)	3,318	4,786
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益 (百万円)	3,318	4,786
普通株式の期中平均株式数 (株)	10,158	10,490

独立監査人の監査報告書は、当事業年度(自平成29年1月1日至平成29年12月31日)を対象としております。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして金融商品取引業等に関する内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として金融商品取引法施行令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記に掲げるもののほか、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして金融商品取引業等に関する内閣府令で定める行為。

5【その他】

定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

変更年月日	変更事項
2007年9月18日	証券業登録に伴う商号変更(「パークレイズ・グローバル・インベスターズ証券投信投資顧問株式会社」に変更)のため、定款変更を行ないました。
2007年9月30日	商号変更(「パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社」に変更)のため、定款変更を行ないました。
2007年9月30日	公告の方法を変更するため、定款変更を行ないました。
2007年12月27日	事業を営むことの目的を変更するため、定款変更を行ないました。
2008年7月1日	グループ会社の1つであるパークレイズ・グローバル・インベスターズ・サービス株式会社を吸収合併し、それに伴い資本金の額を変更いたしました。
2008年7月1日	株式取扱規則に関する記述を追加するため、定款変更を行ないました。
2009年6月22日	本店所在地変更のため、定款変更を行ないました。
2009年12月2日	ブラックロック・ジャパン株式会社と合併 商号変更(「ブラックロック・ジャパン株式会社」に変更)および定款変更を行ないました。
2011年4月1日	グループ会社であるブラックロック証券株式会社を吸収合併し、それに先立ち定款変更および資本金の額の変更を行ないました。
2013年10月5日	MGPA Japan LLCより不動産投資関連の事業を譲受し、それに先立ち定款変更を行ないました。
2014年12月1日	決算期を3月31日から12月31日に変更するため、定款変更を行ないました。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

- ・名称 : 株式会社りそな銀行
- ・資本金の額 : 279,928百万円(2018年3月末現在)
- ・事業の内容 : 銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

<参考:再信託受託会社の概要>

- ・名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・資本金 : 51,000百万円(2018年3月末現在)
- ・事業の内容 : 銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。
- ・再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部(信託財産の管理)を原信託受託会社から再信託受託会社(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名称	資本金の額(百万円) (2018年3月末現在)	事業の内容
藍澤証券株式会社	8,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
四国アライアンス証券株式会社*	3,000	
株式会社SBI証券	48,323	
SMB C日興証券株式会社	10,000	
高木証券株式会社	11,069	
マネックス証券株式会社	12,200	
三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社	8,000	
楽天証券株式会社	7,495	銀行法に基づき、銀行業を営んでおります。
株式会社伊予銀行*	20,948	

* 四国アライアンス証券株式会社および株式会社伊予銀行は、換金に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、換金代金・償還金の支払いに関する事務等を行ない、新規の募集および販売の取扱いを行いません。

2 【関係業務の概要】

(1) 受託会社

受託会社（受託者）として、ファンドの信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行いません。

(2) 販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いおよび販売を行ない、換金に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、換金代金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行いません。

3 【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

1 交付目論見書の表紙等に、以下の事項を記載します。

(1) 委託会社等の情報

委託会社名

金融商品取引業者登録番号

設立年月日

資本金

当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額

「ファンドの運用の指図を行なう者である。」旨

(2) 受託会社に関する情報

受託会社名および「ファンドの財産の保管および管理を行なう者である。」旨

(3) 詳細情報の入手方法

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載します。

委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間等

請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に添付されている旨

(4) 交付目論見書の使用開始日

(5) 届出の効力に関する事項

金商法第4条第1項又は第2項の規定による届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載します。

届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

(6) その他の記載事項

商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、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、以下「投信法」という。）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

2 交付目論見書の「投資リスク」記載箇所に金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨を記載します。

3 目論見書は別称として、「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

4 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

平成30年2月28日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 星 知 子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 中 島 紀 子

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているブラックロック・ジャパン株式会社の平成29年1月1日から平成29年12月31日までの第31期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・ジャパン株式会社の平成29年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

- (注) 1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年8月1日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 辻村 和之

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーの平成29年12月21日から平成30年6月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーの平成30年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

ブラックロック・ジャパン株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。