

【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】 2020年3月19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: B R 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3.30%（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】

2020年3月20日から2020年9月18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。

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>

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信 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、為替のヘッジを行な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みます。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ドルー・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ドルー・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なわないことがあります。

【イメージ図】



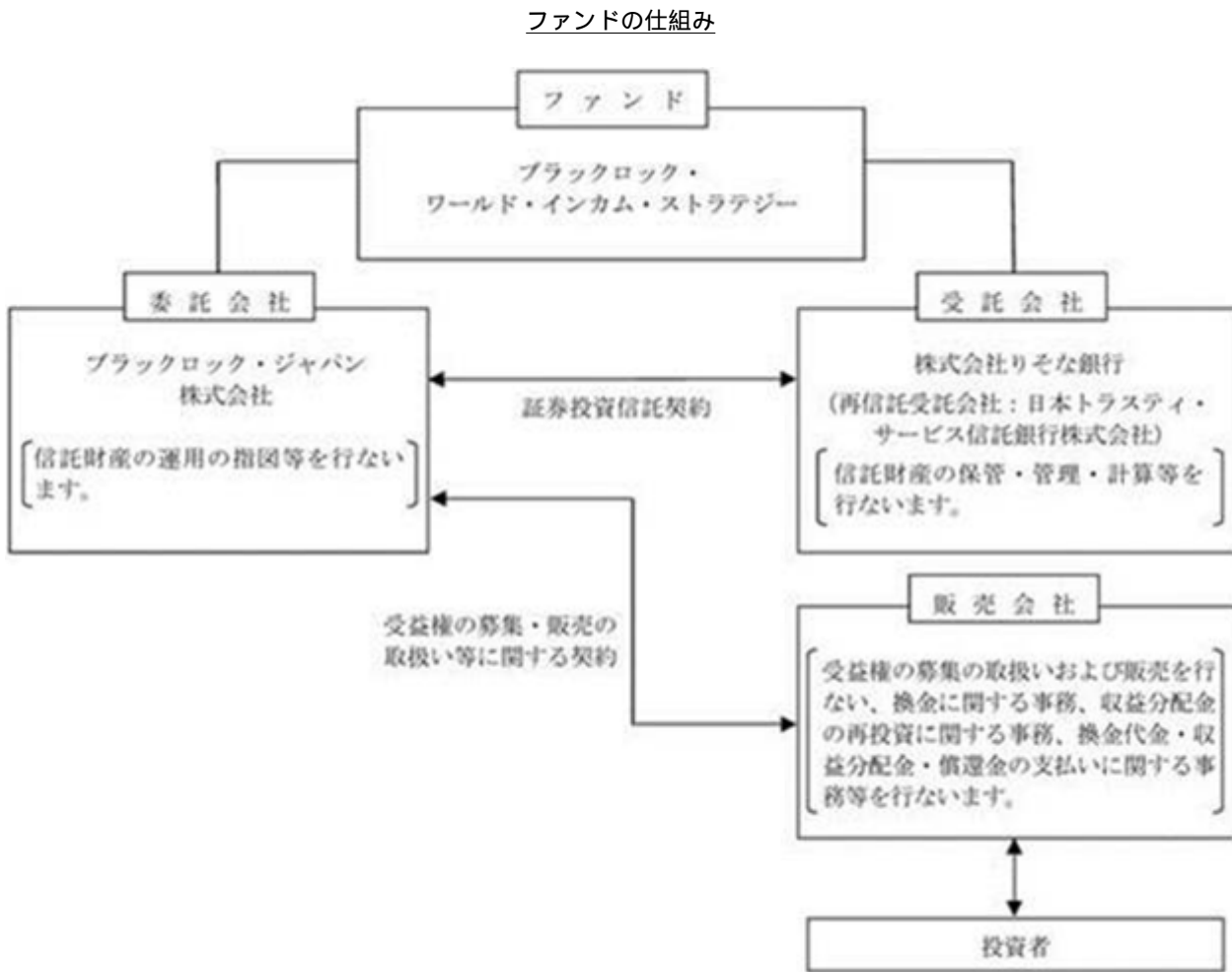
※上図はイメージであり、将来の分配金のお支払いおよび金額について示唆、保証するものではありません。

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 >

2019年12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めます。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ないません。

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) BGF フィクスド・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	<p>ファンドはトータル・リターンを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。</p> <p>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100%を上限として投資を行なうことができます。</p> <p>なお、ファンドは中国の規制により許容される方法により、中国本土に流通する債券に純資産の20%を上限として投資することができます。</p>
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）に決算を行いません。
収益分配方針	毎月（原則として毎月末営業日）に分配を行いません。
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・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・エス・エー／エヌ・ブイ

（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)に決算を行いません。
収益分配方針	分配を行いません。
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・エス・エー/エヌ・ブイ

(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】

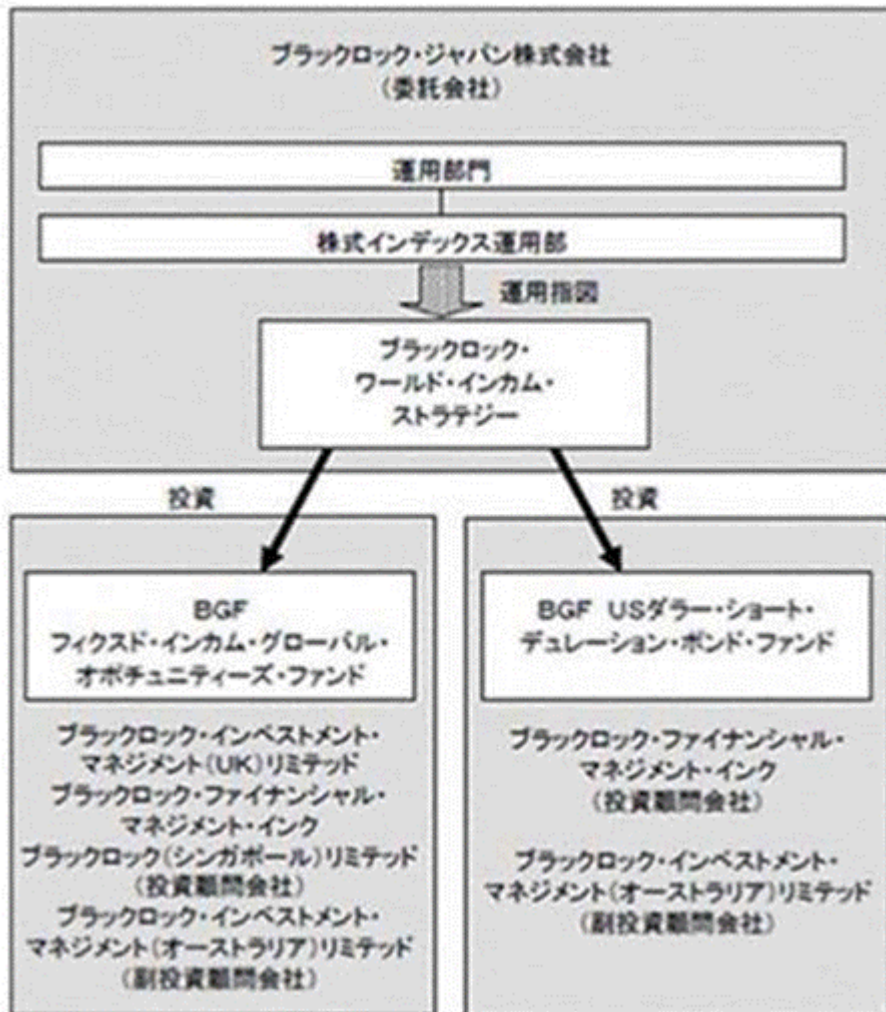
ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

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ながら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：8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>

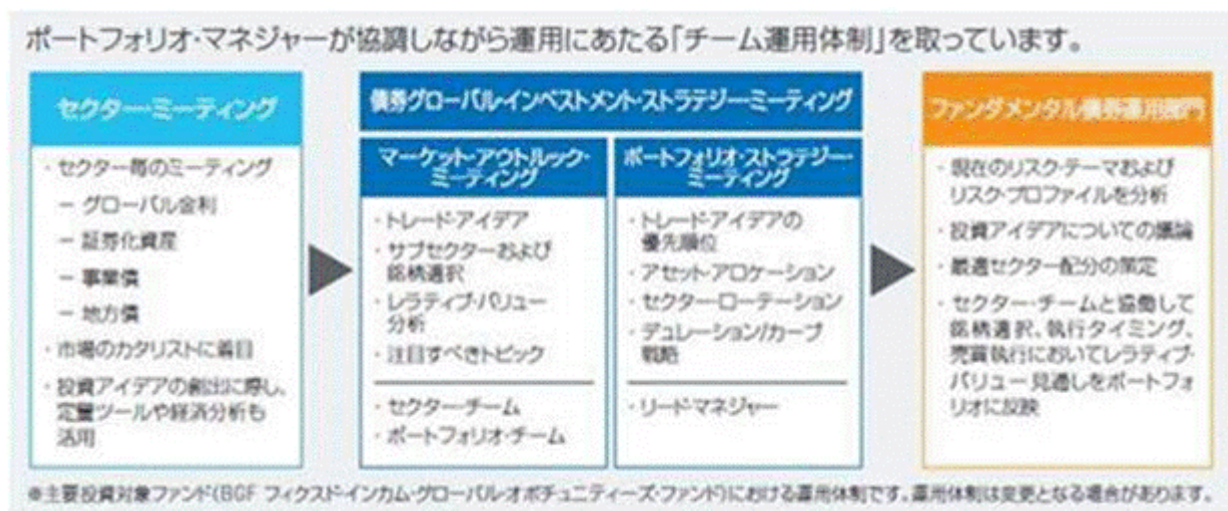
ブラックロック・グループのファンダメンタル債券運用部門によって運用されます。

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。



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7.43兆ドル（約807兆円）を持つ世界最大級の独立系資産運用グループであり、当社はその日本法人です。

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。

* 2019年12月末現在。(円換算レートは1ドル=108.675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

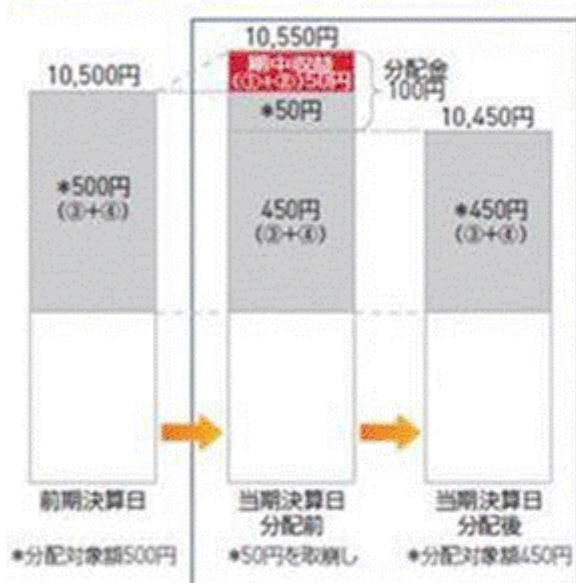
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



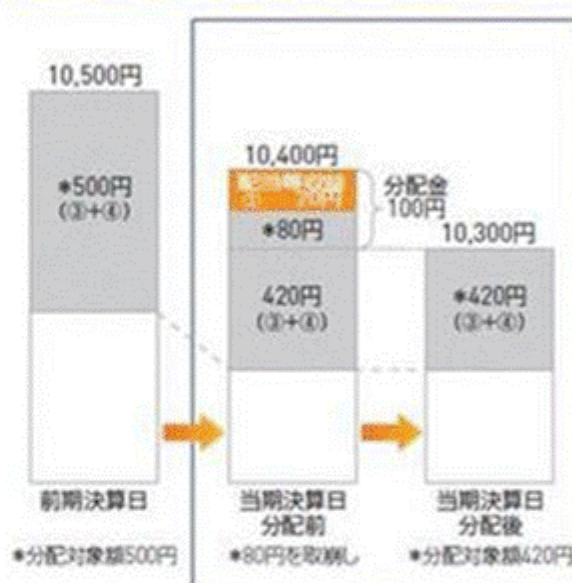
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

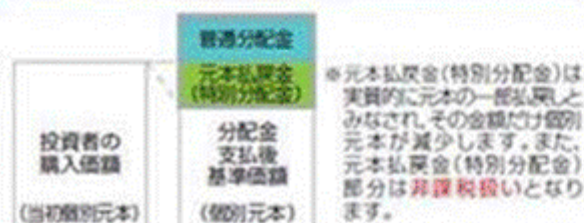


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

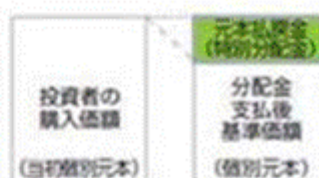
※ 上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

- 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幅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

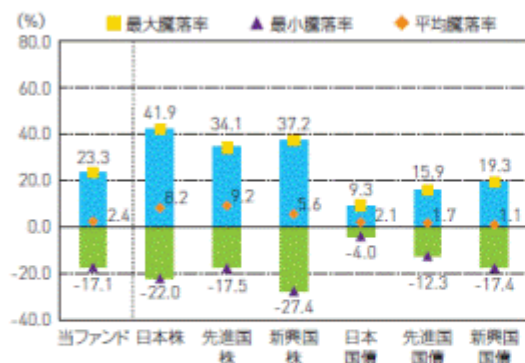
委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行っております。具体的には、運用担当部門とは異なる部門においてファンドの投資リスクの計測・分析、投資制限のモニタリングなどを行なうことにより、ファンドの投資リスクが運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行っております。

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)

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

(2015年1月～2019年12月)



※上記グラフは、2015年1月～2019年12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

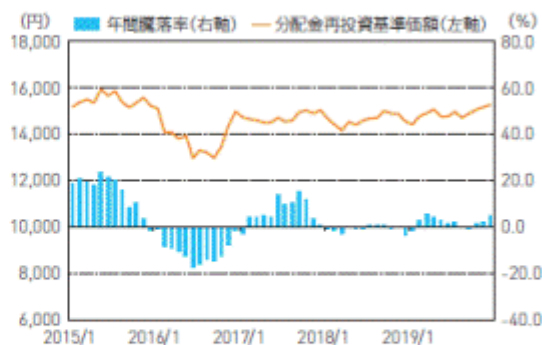
先進国国債…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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・ディバースィファイド(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

(2015年1月～2019年12月)



※上記グラフは、2015年1月～2019年12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・ディバースィファイド(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3.30%（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1.584%（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0.715% (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0.825% (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0.044% (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0.11%（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。

外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2019年12月末現在のもので、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2019年12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	1,676,470,145	94.86
内 ルクセンブルグ	1,676,470,145	94.86
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	90,761,758	5.14
純資産総額	1,767,231,903	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	1,483,308	1,115.32	1,654,364,386	1,117.51	1,657,614,612	93.80
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	11,124	1,693.79	18,843,344	1,694.89	18,855,533	1.07

(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	94.86

(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】

2019年12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12特定期間	第63期(2010年12月20日)	7,552,878,249	7,563,501,906	0.7109	0.7119
	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13特定期間	第69期(2011年6月20日)	5,472,705,804	5,480,744,958	0.6808	0.6818
	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
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

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
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

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
第27特定期間	第154期(2018年7月20日)	1,505,204,680	1,508,289,741	0.9758	0.9778
	第155期(2018年8月20日)	1,450,503,874	1,453,536,322	0.9567	0.9587
	第156期(2018年9月20日)	1,493,518,221	1,496,599,091	0.9695	0.9715
	第157期(2018年10月22日)	1,458,466,849	1,461,487,394	0.9657	0.9677
	第158期(2018年11月20日)	1,419,628,883	1,422,577,205	0.9630	0.9650
	第159期(2018年12月20日)	1,571,272,396	1,574,554,228	0.9576	0.9596
第28特定期間	第160期(2019年1月21日)	1,573,860,687	1,577,219,906	0.9370	0.9390
	第161期(2019年2月20日)	1,607,828,729	1,611,202,149	0.9532	0.9552
	第162期(2019年3月20日)	1,652,695,868	1,656,126,642	0.9635	0.9655
	第163期(2019年4月22日)	1,797,871,043	1,801,571,397	0.9717	0.9737
	第164期(2019年5月20日)	1,785,780,207	1,789,524,700	0.9538	0.9558
	第165期(2019年6月20日)	1,821,290,712	1,825,152,093	0.9433	0.9453
第29特定期間	第166期(2019年7月22日)	1,836,069,064	1,839,933,710	0.9502	0.9522
	第167期(2019年8月20日)	1,805,072,782	1,808,919,672	0.9385	0.9405
	第168期(2019年9月20日)	1,827,834,682	1,831,684,936	0.9495	0.9515
	第169期(2019年10月21日)	1,756,210,870	1,759,896,442	0.9530	0.9550
	第170期(2019年11月20日)	1,778,667,655	1,782,397,419	0.9538	0.9558
	第171期(2019年12月20日)	1,761,494,563	1,765,148,656	0.9641	0.9661
	2018年12月末現在	1,625,243,792		0.9450	
	2019年1月末現在	1,575,747,592		0.9343	
	2019年2月末現在	1,611,434,089		0.9548	
	2019年3月末現在	1,750,055,984		0.9612	
	2019年4月末現在	1,796,733,966		0.9704	
	2019年5月末現在	1,754,339,050		0.9483	
	2019年6月末現在	1,829,092,391		0.9467	
	2019年7月末現在	1,841,473,432		0.9574	
	2019年8月末現在	1,807,739,267		0.9391	
	2019年9月末現在	1,827,857,717		0.9487	
	2019年10月末現在	1,765,834,498		0.9576	
	2019年11月末現在	1,792,659,978		0.9616	
	2019年12月末現在	1,767,231,903		0.9665	

【分配の推移】

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
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
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111期	0.0020

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第20特定期間	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
第27特定期間	第154期	0.0020
	第155期	0.0020
	第156期	0.0020
	第157期	0.0020
	第158期	0.0020
	第159期	0.0020
第28特定期間	第160期	0.0020
	第161期	0.0020
	第162期	0.0020
	第163期	0.0020
	第164期	0.0020
	第165期	0.0020
第29特定期間	第166期	0.0020
	第167期	0.0020
	第168期	0.0020
	第169期	0.0020
	第170期	0.0020
	第171期	0.0020

【収益率の推移】

特定期間	計算期間	収益率(%)
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
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111期	1.4

特定期間	計算期間	収益率(%)
第20特定期間	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117期	0.8
第21特定期間	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123期	1.9
第22特定期間	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129期	4.8
第23特定期間	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135期	5.9
第24特定期間	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141期	0.8
第25特定期間	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147期	1.2
第26特定期間	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
第27特定期間	第154期	2.2
	第155期	1.8
	第156期	1.5
	第157期	0.2
	第158期	0.1
	第159期	0.4
第28特定期間	第160期	1.9
	第161期	1.9
	第162期	1.3
	第163期	1.1
	第164期	1.6
	第165期	0.9
第29特定期間	第166期	0.9
	第167期	1.0
	第168期	1.4
	第169期	0.6
	第170期	0.3
	第171期	1.3

(注) 収益率とは、計算期間末の基準価額(分配付の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落の額。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
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

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		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
第27特定期間	第154期	1,520,868	2,518,683	1,542,530,539
	第155期	2,523,420	28,829,809	1,516,224,150
	第156期	26,234,878	2,023,647	1,540,435,381
	第157期	1,583,740	31,746,269	1,510,272,852
	第158期	1,517,491	37,628,983	1,474,161,360
	第159期	198,343,463	31,588,377	1,640,916,446
第28特定期間	第160期	79,034,742	40,341,196	1,679,609,992
	第161期	7,100,270		1,686,710,262
	第162期	29,344,531	667,493	1,715,387,300
	第163期	159,526,725	24,736,827	1,850,177,198
	第164期	22,070,503	932	1,872,246,769
	第165期	104,913,835	46,469,726	1,930,690,878
第29特定期間	第166期	1,653,449	21,324	1,932,323,003
	第167期	1,621,547	10,499,501	1,923,445,049
	第168期	1,772,570	90,572	1,925,127,047
	第169期	1,783,314	84,124,204	1,842,786,157
	第170期	22,483,380	387,455	1,864,882,082
	第171期	1,586,403	39,421,574	1,827,046,911

(参考情報)

運用実績

2019年12月末現在

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。

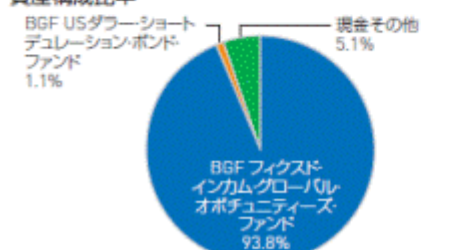
分配の推移

設定来累計		4,180
直近1年間累計		240円
第167期	2019年8月	20円
第168期	2019年9月	20円
第169期	2019年10月	20円
第170期	2019年11月	20円
第171期	2019年12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	比率
1	UMBS 30YR TBA(REG A)	26.7
2	TREASURY (CPI) NOTE 0.5 04/15/2024	6.5
3	GNMA2 30YR TBA(REG C)	2.9
4	UMBS 30YR TBA	2.2
5	GNMA2 30YR 2019 PRODUCTION	1.5
6	TREASURY NOTE 1.5 08/31/2021	1.5
7	ITALY (REPUBLIC OF) 1.75 07/01/2024	1.1
8	TREASURY NOTE 1.5 09/30/2021	1.0
9	INDIA (REPUBLIC OF) 7.27 04/08/2026	0.7
10	CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERN 3.29 05/23/2029	0.6

債券種別構成比率*(%)

債券	比率
政府系モーゲージ	35.1
国債	28.3
証券化商品	21.2
新興国債	15.9
ハイ・イールド債	6.6
地方債	4.3
その他	2.7
投資適格社債	2.3
派生商品合計	0.8

※主要投資対象ファンドはデリバティブ取引を活用するため、合計が100%を超える場合があります。

※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。

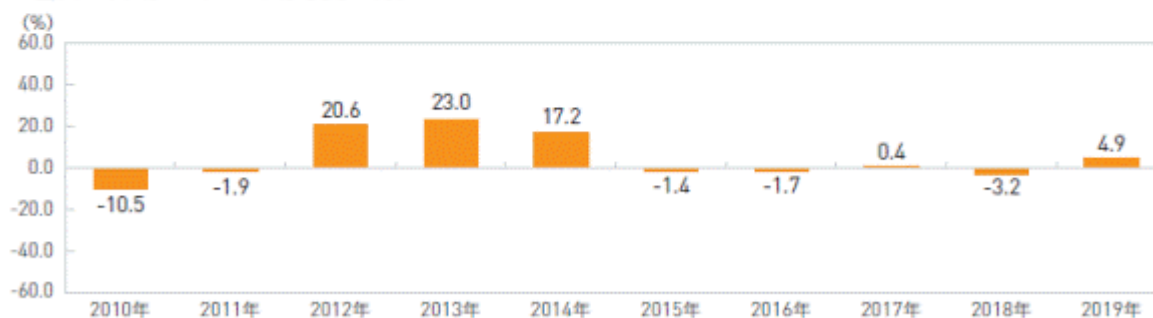
通貨構成比率*(%)

通貨	比率
米国ドル	94.7
中国・人民元	1.7
ブラジル・レアル	1.1
インドネシア・ルピア	0.9
日本・円	0.9
その他	2.9
シンガポール・ドル	-0.5
オフショア・人民元	-0.7
ユーロ	-0.9

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。

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み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す。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す。

(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。

(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3.30%（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換金は受け付けません。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(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お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。

<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ないます。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するものとし、

(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(2019年6月21日から2019年12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 (2019年6月20日現在)	当特定期間末 (2019年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,749	877
金銭信託	19,607,449	16,341,659
投資証券	1,808,509,682	1,671,222,363
派生商品評価勘定	-	293,681
未収入金	-	107,843,265
流動資産合計	1,828,118,880	1,795,701,845
資産合計		
1,828,118,880		
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,861,381	3,654,093
未払解約金	447,478	28,076,741
未払受託者報酬	65,429	64,317
未払委託者報酬	2,290,296	2,251,333
その他未払費用	163,584	160,798
流動負債合計	6,828,168	34,207,282
負債合計		
6,828,168		
純資産の部		
元本等		
元本	1,930,690,878	1,827,046,911
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	109,400,166	65,552,348
(分配準備積立金)	212,884,419	201,897,694
元本等合計	1,821,290,712	1,761,494,563
純資産合計		
1,821,290,712		
負債純資産合計		
1,828,118,880		
1,795,701,845		

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前特定期間 (自 2018年12月21日 至 2019年6月20日)	当特定期間 (自 2019年6月21日 至 2019年12月20日)
営業収益		
受取配当金	32,818,284	34,164,009
受取利息	20,364	9,146
有価証券売買等損益	47,105,830	16,042,630
為替差損益	71,818,836	27,098,585
営業収益合計	8,125,642	77,314,370
営業費用		
受託者報酬	363,494	393,203
委託者報酬	12,723,776	13,763,445
その他費用	1,234,145	1,348,736
営業費用合計	14,321,415	15,505,384
営業利益又は営業損失()	6,195,773	61,808,986
経常利益又は経常損失()	6,195,773	61,808,986
当期純利益又は当期純損失()	6,195,773	61,808,986
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()	692,290	618,295
期首剰余金又は期首欠損金()	69,644,050	109,400,166
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,804,719	6,621,935
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,804,719	6,621,935
剰余金減少額又は欠損金増加額	17,587,711	1,333,589
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	17,587,711	1,333,589
分配金	21,469,641	22,631,219
期末剰余金又は期末欠損金()	109,400,166	65,552,348

(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られ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られ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 (2019年6月20日現在)	当特定期間末 (2019年12月20日現在)
1 当該特定期間の末日における受益権総数	1,930,690,878口	1,827,046,911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 109,400,166円	元本の欠損 65,552,348円
3 1口当たり純資産額	0.9433円	0.9641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 2018年12月21日 至 2019年6月20日)
分配金の計算過程	<p>第160期計算期間(2018年12月21日～2019年1月21日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,557,935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)(147,329,271円)、分配準備積立金(218,889,276円)により、分配対象収益は368,776,482円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,359,219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161期計算期間(2019年1月22日～2019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(4,517,337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)(148,874,257円)、分配準備積立金(218,087,992円)により、分配対象収益は371,479,586円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,373,420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162期計算期間(2019年2月21日～2019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(4,404,277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)(155,295,726円)、分配準備積立金(219,145,474円)により、分配対象収益は378,845,477円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,430,774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163期計算期間(2019年3月21日～2019年4月22日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,824,813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)(187,921,272円)、分配準備積立金(217,127,465円)により、分配対象収益は409,873,550円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,700,354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164期計算期間(2019年4月23日～2019年5月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,172,044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)(192,767,116円)、分配準備積立金(218,251,815円)により、分配対象収益は415,190,975円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,744,493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165期計算期間(2019年5月21日～2019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(3,470,898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)(211,227,758円)、分配準備積立金(213,274,902円)により、分配対象収益は427,973,558円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,861,381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>

項目	当特定期間 (自 2019年6月21日 至 2019年12月20日)
分配金の計算過程	<p>第166期計算期間(2019年6月21日～2019年7月22日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(5,040,573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)(211,589,122円)、分配準備積立金(212,882,078円)により、分配対象収益は429,511,773円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,864,646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167期計算期間(2019年7月23日～2019年8月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,744,361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)(210,795,938円)、分配準備積立金(212,895,796円)により、分配対象収益は427,436,095円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,846,890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168期計算期間(2019年8月21日～2019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(5,134,241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)(211,176,833円)、分配準備積立金(212,783,257円)により、分配対象収益は429,094,331円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,850,254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169期計算期間(2019年9月21日～2019年10月21日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,242,442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)(202,335,221円)、分配準備積立金(204,721,164円)により、分配対象収益は411,298,827円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,685,572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170期計算期間(2019年10月22日～2019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(3,954,615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)(207,326,273円)、分配準備積立金(205,234,937円)により、分配対象収益は416,515,825円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,729,764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171期計算期間(2019年11月21日～2019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(4,431,614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)(203,291,476円)、分配準備積立金(201,120,173円)により、分配対象収益は408,843,263円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,654,093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 (2019年6月20日現在)	当特定期間末 (2019年12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) 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 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) 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 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 (2019年6月20日現在)	当特定期間末 (2019年12月20日現在)
期首元本額	1,640,916,446円	1,930,690,878円
期中追加設定元本額	401,990,606円	30,900,663円
期中一部解約元本額	112,216,174円	134,544,630円

2 有価証券関係

前特定期間末(2019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	19,298,751
合計	19,298,751

当特定期間末(2019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	6,517,082
合計	6,517,082

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

前特定期間末(2019年6月20日現在)

該当事項はありません。

区分	種類	当特定期間末（2019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	108,108,258	-	107,814,577	293,681
合計		108,108,258	-	107,814,577	293,681

(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。

(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	1,483,308.110	15,100,076.550	
		ブラックロック・グローバル・ファンズ U S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	11,124.910	171,991.100	
	アメリカドル 小計	1,494,433.020	15,272,067.650 (1,671,222,363)		
投資証券 合計				1,671,222,363 (1,671,222,363)	
合計				1,671,222,363 (1,671,222,363)	

(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

当該事項はデリバティブ取引関係の注記事項として記載しております。

(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J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、2019年2月28日に終了する中間計算期間(2018年9月1日から2019年2月28日まで)に係る中間財務書類であります。

(2)当該中間財務書類は、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2019年2月28日現在の中間財務書類のうち、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、中間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。なお、ルクセンブルグにおける独立監査人の監査を受けておりません。

純資産計算書 2019年2月28日現在（未監査）

	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		9,026,413,577	1,835,679,455
未実現評価損		(44,635,297)	(13,681,447)
投資有価証券 - 時価	2 (a)	8,981,778,280	1,821,998,008
銀行預金	2 (a)	681,434,937	66,518,451
ブローカーに対する債権	15	76,822,415	1,788,586
未収利息および未収配当金	2 (a)	88,518,872	9,398,141
売却投資有価証券未収金	2 (a)	8,387,746,566*	65,845*
販売投資証券未収金	2 (a)	4,782,455	3,802,203
以下に係る未実現評価益：			
未決済上場先物取引	2 (c)	-	46,649
未決済先渡為替予約	2 (c)	92,183,820	1,705,868
差金決済契約	2 (c)	110,864	-
事後通告証券契約の時価	2 (c)	-	36,751,450
スワップの時価	2 (c)	-	3,379,318
買建オプション / スワップオプションの時価	2 (c)	53,546,379	-
その他の資産	2 (a, c)	11,065	-
資産合計		18,366,935,653	1,945,454,519
負債			
銀行からの借入金	2 (a)	5,014,555	-
ブローカーに対する債務	15	22,419,287	3,379,000
未払収益分配金	2 (a)	1,301,717	168,932
購入投資有価証券未払金	2 (a)	7,408,680,766*	53,313,976*
買戻し投資証券未払金	2 (a)	10,576,864	16,569,338
以下に係る未実現評価損：			
未決済上場先物取引	2 (c)	3,312,078	-
事後通告証券契約の時価	2 (c)	1,018,628,348	-
スワップの時価	2 (c)	25,095,006	-
売建オプション / スワップオプションの時価	2 (c)	41,637,621	-
その他の負債	5, 6, 7, 8	29,656,086	1,094,246
負債合計		8,566,322,328	74,525,492
純資産合計		9,800,613,325	1,870,929,027

* 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 2019年2月28日現在(未監査)

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	2019年	2018年	2017年	2016年
		2月28日現在	8月31日現在	8月31日現在	8月31日現在
純資産合計	米ドル	9,800,613,325	11,829,873,767	9,265,244,959	7,839,045,320
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	9.87 [*]	9.78	9.94	9.80
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.43 [*]	9.50	9.91	9.95
クラスA 毎日分配型投資証券	米ドル	9.91 [*]	9.95	10.11	9.97
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	9.90 [*]	9.94	10.10	9.96
クラスA 毎四半期分配型投資証券	米ドル	9.95 [*]	9.98	10.15	10.01
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	6.87 [*]	7.00	7.31	7.34
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	14.31 [*]	14.43	14.80	14.66
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差分配型投資証券	豪ドル	9.17 [*]	9.29	9.61	9.59
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	94.51 [*]	95.75	99.07	97.07
クラスA 安定分配型投資証券	米ドル	11.96 [*]	12.06	12.40	12.32
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定分配型投資証券	香港ドル	90.53 [*]	91.83	95.54	95.50
クラスA 無分配投資証券	米ドル	14.07 [*]	13.95	13.86	13.34
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	9.80 [*]	9.88	10.12	9.96
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.77 [*]	9.83	10.03	9.83
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,024 [*]	1,030	1,047	1,024
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	15.35 [*]	15.29	15.32	14.69
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	99.24 [*]	99.93	102.02	100.12
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	20.29 [*]	20.21	20.25	19.58
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	10.18 [*]	10.19	10.29	10.00
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	9.91 [*]	9.95	10.11	9.97
クラスC 毎四半期分配型投資証券	米ドル	9.89 [*]	9.92	10.09	9.95
クラスC 無分配投資証券	米ドル	12.12 [*]	12.09	12.16	11.85
クラスD 毎年分配型投資証券	米ドル	13.39 [*]	13.24	13.46	13.27
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	9.77 [*]	9.71	9.94	9.85
クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.45 [*]	9.50	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	4.73 [*]	4.72	4.88	4.86
クラスD 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.46 [*]	10.49	10.67	10.52
クラスD スイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	スイス・フラン	9.40 [*]	9.59	-	-

3 会計年度末における純資産価額の概要 2019年2月28日現在(未監査)(続き)

フィクスト・インカム・グローバル・オパチュニティーズ・ファンド(続き)

	通貨	2019年	2018年	2017年	2016年
		2月28日現在	8月31日現在	8月31日現在	8月31日現在
クラスDユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	6.89*	7.02	7.33	7.36
クラスD無分配投資証券	米ドル	14.51*	14.35	14.18	13.59
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	10.49*	10.55	10.75	10.53
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.33*	10.37	10.53	10.26
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	10.98*	10.96	11.02	10.66
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	15.84*	15.75	15.70	14.98
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	20.94*	20.81	20.74	19.95
クラスE無分配投資証券	米ドル	13.21*	13.13	13.11	12.68
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.20*	9.29	9.52	9.38
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	9.53*	9.61	9.83	9.75
クラスI毎四半期分配型投資証券	米ドル	9.74*	9.77	9.94	9.80
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	9.14*	9.31	9.72	9.76
クラスI英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	英ポンド	9.97*	-	-	-
クラスI日本円ヘッジ毎四半期分配型投資証券	日本円	963*	981	-	-
クラスI無分配投資証券	米ドル	11.53*	11.39	11.25	10.75
クラスI豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	10.01*	9.93	-	-
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	カナダ・ドル	10.81*	10.73	10.66	10.25
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	11.16*	11.23	11.42	11.16
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.63*	10.67	10.81	10.52
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	11.06*	11.03	11.08	10.70
クラスI日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,060*	1,063	1,073	1,043
クラスJ毎月分配型投資証券	米ドル	9.91*	9.95	10.11	9.97
クラスX毎月分配型投資証券	米ドル	9.91*	9.95	10.11	9.97
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	豪ドル	10.42*	10.49	10.67	10.45
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	ユーロ	9.20*	9.38	9.78	9.82
クラスXユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	9.45*	9.63	-	-
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	9.43*	9.55	9.88	9.84
クラスX無分配投資証券	米ドル	11.17*	11.02	10.82	10.29
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	11.75*	11.61	11.41	10.78
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	カナダ・ドル	10.82*	10.72	10.60	10.14
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	11.49*	11.52	11.66	11.35

3 会計年度末における純資産価額の概要 2019年2月28日現在（未監査）（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（続き）

	通貨	2019年	2018年	2017年	2016年
		2月28日現在	8月31日現在	8月31日現在	8月31日現在
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	11.16 [*]	11.17	11.26	10.91
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	10.84 [*]	10.79	10.78	10.36
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	10.37 [*]	10.38	10.48	10.16

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。

* 希薄化調整を含む。詳細については、注記2(g)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 2019年2月28日現在(未監査)(続き)

USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

	通貨	2019年	2018年	2017年	2016年
		2月28日現在	8月31日現在	8月31日現在	8月31日現在
純資産合計	米ドル	1,870,929,027	1,968,227,941	1,693,798,830	1,532,772,836
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	8.42	8.41 [*]	8.57	8.60
クラスA毎月分配型投資証券	米ドル	8.42	8.40 [*]	8.56	8.59
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	9.53	9.56 [*]	9.82	9.90
クラスA無分配投資証券	米ドル	13.37	13.19 [*]	13.18	12.98
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.90	9.92 [*]	10.18	10.20
クラスC毎日分配型投資証券	米ドル	8.44	8.42 [*]	8.58	8.61
クラスC無分配投資証券	米ドル	10.90	10.82 [*]	10.95	10.92
クラスD毎月分配型投資証券	米ドル	9.67	9.64 [*]	9.83	9.86
クラスD無分配投資証券	米ドル	13.66	13.45 [*]	13.40	13.15
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.82	9.82 [*]	10.04	10.03
クラスE無分配投資証券	米ドル	12.23	12.09 [*]	12.15	12.02
クラスI毎四半期分配投資証券	米ドル	10.09	-	-	-
クラスI無分配投資証券	米ドル	10.40	10.24 [*]	10.19	10.00
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.85	9.85 [*]	10.06	10.04
クラスX無分配投資証券	米ドル	14.89	14.63 [*]	14.50	14.16

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。

* 希薄化調整を含む。詳細については、注記2(g)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。

損益および純資産変動計算書 2019年2月28日に終了した会計期間（未監査）

	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
期首純資産		11,829,873,767	1,968,227,941
収益			
預金利息	2 (b)	6,160,454	215,175
債券利息、源泉徴収税控除後	2 (b)	193,281,148	28,827,982
スワップ利息	2 (c)	78,206,038	2,106,828
エクイティ・リンク・ノートによる収益	2 (c)	647	-
短期金融商品預け入れによる利息	2 (b)	656,374	233,343
集団投資スキームによる収益、源泉徴収税控除後	2 (b)	74,066	-
配当金、源泉徴収税控除後	2 (b)	329,205	-
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)	20,595	-
有価証券貸付による収益	2 (b)	799,067	67,385
収益合計	2 (b)	279,527,594	31,450,713
費用			
差金決済契約に係る支払利息	2 (c)	6,713	-
スワップ利息	2 (c)	81,263,227	837,085
差金決済契約に係る配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)	22,879	-
管理事務代行報酬、補助金控除後	7	4,077,353	515,349
保管および預託報酬	2 (h), 8	947,130	133,487
販売報酬	6	2,811,110	423,180
税金	9	1,233,116	277,164
投資運用報酬	5	24,928,165	3,290,187
費用合計		115,289,693	5,476,452
純利益		164,237,901	25,974,261
以下に係る実現純評価益 / (損) :			
投資有価証券	2 (a)	(159,866,699)	(9,174,999)
事後通告証券契約	2 (c)	(6,088,109)	619,831
差金決済取引	2 (c)	(417,247)	-
上場先物取引	2 (c)	(26,085,195)	(906,086)
オプション / スワップション契約	2 (c)	7,140,942	(398,796)
スワップ取引	2 (c)	63,526,531	(1,234,366)
先渡為替予約	2 (c)	(142,130,549)	(5,729,151)
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	11,845,794	236,317
当期実現純評価損		(252,074,532)	(16,587,250)
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)	82,621,610	12,971,046
事後通告証券契約	2 (c)	(7,658,617)	(86,516)
差金決済取引	2 (c)	97,866	-
上場先物取引	2 (c)	(1,754,279)	109,939
オプション / スワップション契約	2 (c)	20,790,352	319,216
スワップ取引	2 (c)	(47,702,953)	(258,422)
先渡為替予約	2 (c)	8,154,127	1,227,936
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	684,658	20,558
当期末実現評価益 / (損) の純変動		55,232,764	14,303,757
運用成績による純資産の増加 / (減少)		(32,603,867)	23,690,768

損益および純資産変動計算書 2019年2月28日に終了した会計期間(未監査)(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		1,270,743,962	298,559,490
投資証券買戻しによる正味支払額		(3,243,595,292)	(418,299,031)
資本の変動による純資産の減少		(1,972,851,330)	(119,739,541)
配当金宣言額	16	(23,805,245)	(1,250,141)
期末純資産		9,800,613,325	1,870,929,027

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 2019年2月28日に終了した会計期間(未監査)

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	83,120	6,626	1,321	88,425
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	1,294,152	92,657	258,631	1,128,178
クラスA 毎日分配型投資証券	4,256,941	402,086	479,121	4,179,906
クラスA 毎月分配型投資証券	492,282	46,750	210,421	328,611
クラスA 毎四半期分配型投資証券	7,960,401	95,447	1,248,886	6,806,962
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	1,642,078	108,905	290,877	1,460,106
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	267,133	34,603	80,412	221,324
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差分配型投資証券	209,577	41,478	132,680	118,375
クラスA 中国人民元・ヘッジ金利差分配型投資証券	47,320	-	-	47,320
クラスA 安定分配型投資証券	215,241	7,103	11,619	210,725
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定分配型投資証券	63,861	-	-	63,861
クラスA 無分配投資証券	55,308,483	3,994,220	12,487,215	46,815,488
クラスA スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	5,102,199	138,824	343,369	4,897,654
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	36,613,655	1,197,226	21,807,986	16,002,895
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	503,464	1,275	504,729	10
クラスA ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	14,566,146	3,554,530	7,963,371	10,157,305
クラスA スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	1,022,891	-	181,937	840,954
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	4,090,766	840,703	221,383	4,710,086
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	403,397	38,749	77,117	365,029
クラスC 毎日分配型投資証券	550,932	1,354	25,408	526,878
クラスC 毎四半期分配型投資証券	1,081,194	8,775	142,579	947,390
クラスC 無分配投資証券	7,636,416	738,113	1,197,095	7,177,434
クラスD 毎年分配型投資証券	128,684	25,077	24,598	129,163
クラスD カナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	1,007,826	68,093	205,170	870,749
クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	2,568,974	97,765	2,003,370	663,369
クラスD 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	3,552,419	265,552	1,108,237	2,709,734
クラスD 毎四半期分配型投資証券	18,005,343	1,877,992	3,966,093	15,917,242
クラスD スイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	736,340	94,236	85,500	745,076
クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	1,379,716	211,387	150,602	1,440,501
クラスD 無分配投資証券	68,631,865	11,253,683	27,574,501	52,311,047
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	10,189,875	318,887	2,661,299	7,847,463
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	55,881,729	3,132,842	18,167,346	40,847,225
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	5,613,080	412,827	2,011,509	4,014,398

発行済投資証券口数変動表 2019年2月28日に終了した会計期間(未監査)(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
(続き)

	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	41,037	-	-	41,037
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	34,598	-	10,070	24,528
クラスE無分配投資証券	21,785,153	1,595,233	3,501,026	19,879,360
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	61,418,087	1,412,372	10,294,109	52,536,350
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	44,930	-	-	44,930
クラスI 毎四半期分配型投資証券	61,957,328	700,832	51,076,778	11,581,382
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	3,273,810	215,526	134,432	3,354,904
クラスI英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	-	114,784	38,388	76,396
クラスI 日本円ヘッジ毎四半期分配型投資証券	535	-	-	535
クラスI無分配投資証券	71,358,948	37,260,454	27,462,865	81,156,537
クラスI豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	655	9,944	-	10,599
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	50,957	-	-	50,957
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	5,800,865	1,503,906	1,363,656	5,941,115
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	88,459,514	18,866,522	39,096,876	68,229,160
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	62,524,426	3,640,944	14,010,220	52,155,150
クラスI 日本円ヘッジ無分配投資証券	53,496,917	5,450,848	3,817,828	55,129,937
クラスJ 毎月分配型投資証券	1,262,380	286,503	121,738	1,427,145
クラスX 毎月分配型投資証券	36,137,863	29,152	179,532	35,987,483
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	1,540,475	27,180	155,050	1,412,605
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	272,757	4,926	6,249	271,434
クラスXユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	4,995,436	8	-	4,995,444
クラスX英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	27,770,065	90,372	14,931,654	12,928,783
クラスX無分配投資証券	34,935,307	3,086	33,145	34,905,248
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	12,470,367	75,912	2,023,646	10,522,633
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	108,785,353	11,131,468	7,970,344	111,946,477
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	3,849,144	-	-	3,849,144
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	5,880,275	57,395	182,041	5,755,629
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	48,084,178	155,856	2,658,961	45,581,073
クラスXスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	99,306,318	5,853,701	6,298,377	98,861,642

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 2019年2月28日に終了した会計期間(未監査)(続き)

US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	3,490,520	459,084	998,507	2,951,097
クラスA 毎月分配型投資証券	1,436,415	2,057,880	1,591,165	1,903,130
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配 型投資証券	28,560	11,639	13,690	26,509
クラスA 無分配投資証券	30,410,346	7,885,507	7,238,044	31,057,809
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	1,717,003	478,813	260,985	1,934,831
クラスC 毎日分配型投資証券	364,556	3,749	146,113	222,192
クラスC 無分配投資証券	722,920	419,988	261,493	881,415
クラスD 毎月分配型投資証券	5,576,303	726,515	2,144,822	4,157,996
クラスD 無分配投資証券	23,038,804	4,163,202	7,054,226	20,147,780
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	539,765	56,117	265,037	330,845
クラスE 無分配投資証券	11,856,720	2,074,319	2,334,573	11,596,466
クラスI 毎四半期分配投資証券	-	2,908,312	-	2,908,312
クラスI 無分配投資証券	2,764,255	2,311,317	1,755,658	3,319,914
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	11,291,151	1,876,168	3,588,514	9,578,805
クラスX 無分配投資証券	56,253,134	14,591	5,954,790	50,312,935

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 2019年2月28日現在(未監査)

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 (%)
普通/優先株式およびワラント			
カナダ			
5,883	Norbord Inc	148,487	0.00
99,749	Northern Graphite Corp (Unit)	16,266	0.00
		164,753	0.00
ケイマン諸島			
19,091	Platinum Eagle Acquisition Corp (Restricted)*	203,319	0.00
147,094	Vantage Drilling Co	2,030	0.00
		205,349	0.00
ドイツ			
124,834	Daimler AG	7,493,235	0.08
ギリシャ			
131,638	Eurobank Ergasias SA	98,152	0.00
イタリア			
162,200	UniCredit SpA	2,221,238	0.02
日本			
3	Wessex Ltd (Wts 24/6/2019)	1,348	0.00
ルクセンブルグ			
59,899	Aroundtown SA	505,262	0.01
オランダ			
78,864	ALTICE EUROPE NV	178,653	0.00
48,200	NXP Semiconductors NV	4,410,300	0.05
		4,588,953	0.05
米国			
17,753	AbbVie Inc	1,407,991	0.01
334,108	Altice USA Inc	7,273,531	0.07
4,279	AT&T Inc	132,991	0.00
4,664	Biogen Inc	1,527,553	0.02
39,260	BorgWarner Inc	1,600,630	0.02
249,200	Caesars Entertainment Corp*	2,115,708	0.02
25,510	Century Communities Inc*	591,832	0.01
158,178	Delta Air Lines Inc	7,894,664	0.08
12,724	Diamondback Energy Inc	1,319,606	0.01
166,190	DR Horton Inc	6,562,843	0.07
87,600	Federal Home Loan Mortgage Corp	840,960	0.01
87,600	Federal National Mortgage Association (Pref)	854,100	0.01
36,600	FedEx Corp	6,634,116	0.07
10,972	Golden Entertainment Inc*	192,559	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)				
57,100	JPMorgan Chase & Co	5,997,213	0.06	
111,557	Leisure Acquisition Corp	1,149,037	0.01	
115,426	Lennar Corp	5,585,464	0.06	
98,546	Liberty Oilfield Services Inc*	1,598,416	0.02	
20,572	M/I Homes Inc	536,929	0.00	
108,306	Matador Resources Co*	2,048,067	0.02	
20,910	Microchip Technology Inc	1,820,425	0.02	
8,800	Mohawk Industries Inc*	1,202,784	0.01	
9,704	Morgan Stanley (Pref)	272,682	0.00	
25,319	PACCAR Inc	1,723,211	0.02	
17,070	Packaging Corp of America	1,655,961	0.02	
144,238	PulteGroup Inc*	3,898,753	0.04	
36,372	Pure Acquisition Corp	361,901	0.00	
39,902	Pure Acquisition Corp	418,173	0.00	
14,550	Scientific Games Corp*	429,371	0.00	
381,859	Sentinel Energy Services Inc	3,948,422	0.04	
33,055	Taylor Morrison Home Corp 'A'	554,002	0.01	
16,226	Texas Instruments Inc	1,710,707	0.02	
44,000	Toll Brothers Inc	1,576,960	0.02	
40,343	Vistra Energy Corp	1,036,815	0.01	
37,683	Westrock Co	1,432,708	0.01	
44,461	William Lyon Homes 'A' *	628,234	0.01	
		78,535,319	0.80	
普通/優先株式およびワラント合計		93,813,609	0.96	
コマーシャル・ペーパー				
米国				
USD	6,340,000	AT&T Inc 7/3/2019 (Zero Coupon)	6,336,282	0.06
USD	5,000,000	Ford Motor Credit Co LLC 1/4/2019 (Zero Coupon)	4,985,796	0.05
USD	5,000,000	Ford Motor Credit Co LLC 1/5/2019 (Zero Coupon)	4,972,473	0.05
USD	10,730,000	General Electric Co 27/3/2019 (Zero Coupon)	10,704,980	0.11
			26,999,531	0.27
コマーシャル・ペーパー合計		26,999,531	0.27	
債券				
アルゼンチン				
ARS	15,983,000	Argentina Bonar Bonds FRN 11/3/2019	451,818	0.00
ARS	31,967,000	Argentina Bonar Bonds FRN 1/3/2020	830,850	0.01
USD	6,882,000	Argentina Bonar Bonds 8% 8/10/2020	6,978,694	0.07
USD	6,804,000	Argentina Bonar Bonds 8.75% 7/5/2024	6,715,548	0.07
CHF	645,000	Argentine Republic Government International Bond 3.375% 12/10/2020	613,569	0.01
USD	11,462,000	Argentine Republic Government International Bond 4.625% 11/1/2023	9,771,355	0.10
USD	9,901,000	Argentine Republic Government International Bond 5.625% 26/1/2022	8,930,702	0.09
USD	8,746,000	Argentine Republic Government International Bond 5.875% 11/1/2028*	6,881,047	0.07
USD	17,542,000	Argentine Republic Government International Bond 6.25% 22/4/2019*	17,612,256	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 (%)
アルゼンチン(続き)				
USD	17,260,000	Argentine Republic Government International Bond 6.875% 22/4/2021	16,440,150	0.17
USD	7,148,000	Argentine Republic Government International Bond 7.625% 22/4/2046*	5,813,647	0.06
ARS	120,373,000	Banco Hipotecario SA '144A' FRN 7/11/2022	3,000,623	0.03
ARS	48,553,000	Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER 4% 6/3/2020	1,826,702	0.02
USD	2,876,000	Generacion Mediterranea SA / Generacion Frias SA / Central Termica Roca SA '144A' 9.625% 27/7/2023*	2,656,705	0.03
USD	5,666,000	Tarjeta Naranja SA '144A' FRN 11/4/2022	2,323,060	0.02
USD	1,618,000	YPF SA 7% 15/12/2047	1,302,490	0.01
			92,149,216	0.94
オーストラリア				
EUR	1,850,000	BHP Billiton Finance Ltd FRN 22/4/2076	2,282,265	0.02
USD	5,000,000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 3.35% 4/6/2024	4,997,916	0.05
EUR	1,400,000	Cromwell SPV Finance Pty Ltd 2.5% 29/3/2025	1,572,048	0.02
USD	187,500	Linc Energy Ltd (Defaulted) 10/4/2018 (Zero Coupon)	65,625	0.00
USD	328,000	Newcastle Coal Infrastructure Group Pty Ltd 4.4% 29/9/2027	297,273	0.00
EUR	1,400,000	Origin Energy Finance Ltd FRN 16/9/2074	1,623,535	0.02
USD	4,200,000	Pacific National Finance Pty Ltd 4.75% 22/3/2028	4,024,146	0.04
USD	777,000	QBE Insurance Group Ltd FRN 17/6/2046	788,033	0.01
USD	922,000	Santos Finance Ltd 4.125% 14/9/2027	857,320	0.01
USD	4,016,000	Westpac Banking Corp 3.3% 26/2/2024	4,011,130	0.04
			20,519,291	0.21
オーストリア				
EUR	2,400,000	BAWAG Group AG FRN 14/5/2025 (Perpetual)	2,581,795	0.03
USD	2,863,000	Eldorado Intl. Finance GmbH '144A' 8.625% 16/6/2021	2,977,276	0.03
EUR	4,000,000	Erste Group Bank AG FRN 15/10/2021 (Perpetual)	5,259,212	0.05
EUR	800,000	Erste Group Bank AG FRN 15/4/2024 (Perpetual)*	989,233	0.01
EUR	3,400,000	Raiffeisen Bank International AG FRN 15/12/2022 (Perpetual)	3,972,014	0.04
EUR	300,000	Sappi Papier Holding GmbH 4% 1/4/2023	349,618	0.00
USD	4,929,000	Suzano Austria GmbH '144A' 6% 15/1/2029	5,264,788	0.06
			21,393,936	0.22
バハマ				
USD	2,631,000	Silversea Cruise Finance Ltd '144A' 7.25% 1/2/2025	2,854,635	0.03
ベルギー				
EUR	400,000	KBC Group NV FRN 5/3/2024 (Perpetual)	455,580	0.01
EUR	2,500,000	KBC Group NV 1% 26/4/2021*	2,893,978	0.03
EUR	100,000	Solvay SA FRN 4/3/2024 (Perpetual)	120,346	0.00
			3,469,904	0.04
バミューダ				
USD	200,000	Binhai Investment Co Ltd 4.45% 30/11/2020	192,970	0.00
USD	200,000	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd (Restricted) (Defaulted) 6.75% 17/10/2018	122,000	0.00
USD	519,000	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd (Defaulted) 7.95% 15/2/2019	316,590	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 (%)
バミューダ(続き)			
USD	874,000 Digicel Group Two Ltd 9.125% 1/4/2024*	305,900	0.00
USD	2,489,000 GCL New Energy Holdings Ltd 7.1% 30/1/2021	2,221,432	0.02
USD	1,571,000 Inkia Energy Ltd '144A' 5.875% 9/11/2027	1,508,160	0.02
HKD	4,062,966 REXLot Holdings Ltd (Restricted) (Defaulted) 4.5% 17/4/2019	439,952	0.01
HKD	348,254 REXLot Holdings Ltd (Defaulted) 6% 28/4/2017	37,027	0.00
USD	331,000 Weatherford International Ltd 5.125% 15/9/2020	281,350	0.00
		5,425,381	0.06
ブラジル			
USD	8,484,000 Brazilian Government International Bond 4.625% 13/1/2028	8,460,754	0.09
USD	1,353,000 Brazilian Government International Bond 5.625% 21/2/2047	1,332,658	0.01
USD	2,238,000 Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island '144A' FRN 12/12/2022 (Perpetual)	2,213,102	0.02
USD	1,554,000 Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island '144A' FRN 19/3/2023 (Perpetual)	1,550,286	0.02
USD	3,448,000 Oi SA 10% 27/7/2025	3,654,880	0.04
USD	2,476,000 Samarco Mineracao SA (Defaulted) 4.125% 1/11/2022	1,485,600	0.01
USD	1,435,000 Samarco Mineracao SA (Defaulted) '144A' 5.375% 26/9/2024*	896,875	0.01
		19,594,155	0.20
英領バージン諸島			
USD	5,070,000 Baoxin Auto Finance I Ltd FRN 30/10/2020 (Perpetual)	4,502,318	0.05
USD	915,000 Baoxin Auto Finance I Ltd 7.9% 9/2/2020	917,305	0.01
USD	2,435,000 Beijing Environment Bvi Co Ltd 5.3% 18/10/2021	2,447,729	0.03
USD	1,315,000 Bi Hai Co Ltd 6.25% 5/3/2022	1,321,017	0.01
USD	5,395,000 CCTI 2017 Ltd 3.625% 8/8/2022	5,175,424	0.05
USD	2,800,000 Chalco Hong Kong Investment Co Ltd 4.875% 7/9/2021*	2,834,069	0.03
USD	2,050,000 Chang Development International Ltd 3.625% 20/1/2020	2,016,358	0.02
USD	2,130,000 China Cinda Finance 2017 I Ltd 4.75% 21/2/2029	2,157,799	0.02
HKD	15,000,000 China Conch Venture Holdings International Ltd 5/9/2023 (Zero Coupon)	1,904,902	0.02
USD	4,176,000 China Reinsurance Finance Corp Ltd 3.375% 9/3/2022*	4,061,703	0.04
USD	3,450,000 Chinalco Capital Holdings Ltd 4.25% 21/4/2022*	3,363,750	0.03
USD	900,000 Easy Tactic Ltd 7% 25/4/2021*	898,265	0.01
USD	2,300,000 Easy Tactic Ltd 8.625% 27/2/2024	2,279,875	0.02
USD	1,800,000 Easy Tactic Ltd 9.125% 28/7/2022	1,859,801	0.02
USD	1,050,000 Greenland Global Investment Ltd 6.75% 22/5/2019	1,055,250	0.01
USD	1,935,000 Guojing Capital BVI Ltd 3.95% 11/12/2022	1,874,289	0.02
EUR	2,875,000 Huarong Universe Investment Holding Ltd 1.625% 5/12/2022	3,023,065	0.03
USD	1,198,000 Knight Castle Investments Ltd 7.99% 23/1/2021	796,798	0.01
USD	2,500,000 Leader Goal International Ltd FRN 19/1/2023 (Perpetual)*	2,439,025	0.02
USD	1,545,000 New Lion Bridge Co Ltd 9.75% 10/10/2020	1,405,950	0.01
USD	741,000 New Metro Global Ltd 6.5% 23/4/2021	743,163	0.01
USD	3,000,000 Poly Real Estate Finance Ltd 4.75% 17/9/2023	3,051,551	0.03
USD	3,218,000 Prime Bloom Holdings Ltd 6.95% 5/7/2022	2,473,636	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 (%)
英領バージン諸島(続き)			
USD	980,000 RKPF Overseas 2019 A Ltd 7.875% 1/2/2023*	996,536	0.01
USD	1,189,000 Rock International Investment Inc 6.625% 27/3/2020	900,665	0.01
USD	657,000 Shandong Iron And Steel Xinheng International Co Ltd 6.5% 14/6/2021	628,253	0.01
USD	4,500,000 Shanghai Port Group BVI Holding Co Ltd 9/8/2022 (Zero Coupon)	4,560,165	0.05
USD	1,370,000 Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd 5.25% 30/4/2022	1,392,047	0.01
USD	2,800,000 Studio City Finance Ltd 7.25% 11/2/2024	2,842,000	0.03
USD	280,000 Studio City Finance Ltd 8.5% 1/12/2020*	281,050	0.00
USD	2,400,000 Tewoo Group NO 5 Ltd FRN 15/3/2021 (Perpetual)	2,085,000	0.02
USD	831,000 Zhaohai Investment BVI Ltd 4% 23/7/2020*	814,914	0.01
		67,103,672	0.68
カナダ			
USD	3,342,657 Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust ' 144A ' 5% 15/12/2023	3,394,594	0.04
EUR	7,043,000 Bank of Montreal 0.25% 17/11/2021	8,055,812	0.08
EUR	1,706,000 Bausch Health Cos Inc 4.5% 15/5/2023	1,962,643	0.02
USD	568,000 Bausch Health Cos Inc ' 144A ' 5.5% 1/11/2025	576,520	0.01
USD	855,000 Bausch Health Cos Inc ' 144A ' 5.625% 1/12/2021	856,817	0.01
USD	4,978,000 Bausch Health Cos Inc ' 144A ' 6.5% 15/3/2022	5,156,461	0.05
USD	7,190,000 Bausch Health Cos Inc ' 144A ' 7% 15/3/2024	7,603,425	0.08
USD	3,379,000 Brookfield Residential Properties Inc ' 144A ' 6.5% 15/12/2020	3,387,447	0.04
USD	422,000 Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US Corp ' 144A ' 6.125% 1/7/2022	421,473	0.00
USD	6,874,000 Canbriam Energy Inc ' 144A ' 9.75% 15/11/2019	5,619,495	0.06
USD	2,975,000 Enbridge Inc 4% 1/10/2023	3,031,740	0.03
USD	2,011,000 Frontera Energy Corp ' 144A ' 9.7% 25/6/2023	2,056,247	0.02
USD	620,000 Largo Resources Ltd ' 144A ' 9.25% 1/6/2021	654,875	0.01
USD	5,112,000 Masonite International Corp ' 144A ' 5.625% 15/3/2023	5,227,020	0.05
USD	110,000 Masonite International Corp ' 144A ' 5.75% 15/9/2026	110,000	0.00
USD	4,250,000 NOVA Chemicals Corp ' 144A ' 4.875% 1/6/2024	4,095,938	0.04
USD	6,147,000 NOVA Chemicals Corp ' 144A ' 5.25% 1/8/2023	6,147,000	0.06
USD	6,943,824 Stoneway Capital Corp ' 144A ' 10% 1/3/2027*	6,934,485	0.07
USD	3,051,775 Stoneway Capital Corp 10% 1/3/2027*	3,047,670	0.03
		68,339,662	0.70
ケイマン諸島			
USD	1,023,000 Agile Group Holdings Ltd FRN 7/3/2023 (Perpetual)	961,491	0.01
USD	1,197,000 Agile Group Holdings Ltd 8.5% 18/7/2021*	1,253,857	0.01
USD	3,810,106 Ambac LSNI LLC ' 144A ' FRN 12/2/2023	3,852,969	0.04
USD	732,000 Anton Oilfield Services Group/Hong Kong 9.75% 5/12/2020	731,493	0.01
HKD	22,000,000 ASM Pacific Technology Ltd 2% 28/3/2019	2,821,770	0.03
USD	2,000,000 Bizlink Holding Inc 1/2/2023 (Zero Coupon)	2,070,828	0.02
USD	3,800,000 Central China Real Estate Ltd 6.875% 23/10/2020	3,795,250	0.04
USD	1,295,000 Central China Real Estate Ltd 7.325% 27/1/2020	1,303,094	0.01
USD	1,270,000 CFLD Cayman Investment Ltd 8.625% 28/2/2021	1,284,287	0.01
USD	1,805,000 China Aoyuan Group Ltd 7.95% 7/9/2021	1,841,100	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 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD	855,000 China Aoyuan Group Ltd 7.95% 19/2/2023	843,179	0.01
USD	1,820,000 China Aoyuan Group Ltd 8.5% 23/1/2022*	1,858,675	0.02
HKD	50,000,000 China Evergrande Group 4.25% 14/2/2023	5,958,006	0.06
USD	3,108,000 China Evergrande Group 7% 23/3/2020	3,059,428	0.03
USD	1,633,000 China Evergrande Group 7.5% 28/6/2023*	1,493,101	0.02
USD	4,065,000 China Evergrande Group 8.75% 28/6/2025	3,658,500	0.04
USD	516,000 China Huiyuan Juice Group Ltd 6.5% 16/8/2020	238,084	0.00
USD	1,230,000 China Resources Land Ltd 4.125% 26/2/2029*	1,219,846	0.01
USD	1,668,000 China SCE Group Holdings Ltd 7.45% 17/4/2021*	1,689,370	0.02
USD	1,195,000 China SCE Group Holdings Ltd 8.75% 15/1/2021	1,227,862	0.01
USD	4,000,000 CIFI Holdings Group Co Ltd 5.5% 23/1/2022	3,825,000	0.04
USD	2,800,000 CIFI Holdings Group Co Ltd 6.375% 2/5/2020	2,817,500	0.03
USD	3,050,000 CIFI Holdings Group Co Ltd 6.875% 23/4/2021*	3,082,993	0.03
USD	682,000 Ctrip.com International Ltd 1.25% 15/9/2022	672,684	0.01
USD	1,431,000 Energuate Trust '144A' 5.875% 3/5/2027	1,371,986	0.01
USD	2,037,000 Fantasia Holdings Group Co Ltd 7.375% 4/10/2021	1,756,913	0.02
USD	1,981,000 Fantasia Holdings Group Co Ltd 7.95% 5/7/2022	1,646,409	0.02
USD	1,780,000 Fantasia Holdings Group Co Ltd 8.375% 8/3/2021	1,620,299	0.02
USD	1,275,000 Future Land Development Holdings Ltd 5% 16/2/2020	1,262,773	0.01
USD	2,500,000 Future Land Development Holdings Ltd 6.5% 12/9/2020	2,526,171	0.03
USD	2,000,000 Future Land Development Holdings Ltd 7.5% 22/1/2021	2,027,500	0.02
USD	733,000 FWD Ltd FRN 1/2/2023 (Perpetual)	665,197	0.01
USD	5,173,000 Gol Finance Inc '144A' 7% 31/1/2025	5,015,223	0.05
HKD	33,000,000 Harvest International Co 21/11/2022 (Zero Coupon)	4,259,834	0.04
USD	2,500,000 Jingrui Holdings Ltd 9.45% 23/4/2021	2,292,581	0.02
USD	1,398,000 Kaisa Group Holdings Ltd 8.5% 30/6/2022	1,195,563	0.01
USD	2,490,000 King Talent Management Ltd FRN 4/12/2022 (Perpetual)	2,132,461	0.02
USD	3,158,000 Latam Finance Ltd '144A' 7% 1/3/2026	3,172,211	0.03
USD	615,000 Logan Property Holdings Co Ltd 6.875% 24/4/2021*	615,000	0.01
USD	970,000 Logan Property Holdings Co Ltd 7.5% 25/8/2022*	968,624	0.01
USD	1,250,000 Neuberger Berman CLO XX Ltd FRN 15/1/2028	1,184,314	0.01
USD	840,000 Neuberger Berman CLO XX Ltd FRN 15/1/2028	808,575	0.01
USD	1,920,388 Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd '144A' 6.35% 1/12/2021	1,862,776	0.02
USD	1,743,978 Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd '144A' 6.72% 1/12/2022	1,643,699	0.02
USD	55,000 Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd '144A' 7.72% 1/12/2026	14,369	0.00
USD	289,000 Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd '144A' 1/4/2019 (Perpetual) (Zero Coupon)	6,864	0.00
USD	4,805,000 Overseas Chinese Town Asia Holdings Ltd FRN 10/10/2020 (Perpetual)	4,728,120	0.05
USD	580,000 Parallel 2015-1 Ltd FRN 20/7/2027	559,008	0.01
USD	3,250,000 Parallel 2015-1 Ltd FRN 20/7/2027	3,149,393	0.03
USD	1,690,000 Parallel 2015-1 Ltd FRN 20/7/2027	1,673,688	0.02
USD	2,200,000 Pearl Holding III Ltd 9.5% 11/12/2022	1,721,522	0.02
USD	2,000,000 Poseidon Finance 1 Ltd 1/2/2025 (Zero Coupon)	1,934,490	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 (%)
	ケイマン諸島(続き)		
USD 1,400,000	Powerlong Real Estate Holdings Ltd 6.95% 17/4/2021	1,381,687	0.01
USD 1,380,000	Redco Group 13.5% 21/1/2020	1,387,328	0.01
USD 1,090,000	Ronshine China Holdings Ltd 10.5% 1/3/2022	1,093,237	0.01
USD 760,000	Ronshine China Holdings Ltd 11.25% 22/8/2021	778,122	0.01
USD 1,500,000	RR 3 Ltd 28/7/2026 (Zero Coupon)	1,079,983	0.01
USD 3,970,000	RR 3 Ltd 28/7/2026 (Zero Coupon)	2,560,094	0.03
USD 2,100,000	Sable International Finance Ltd '144A' 6.875% 1/8/2022	2,186,625	0.02
USD 1,314,000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4 4.222% 27/1/2024	1,333,053	0.01
USD 2,000,000	Shui On Development Holding Ltd FRN 4/6/2020 (Perpetual)	2,075,915	0.02
USD 403,165	SPARC EM SPC Panama Metro Line 2 SP 5/12/2022 (Zero Coupon)	371,263	0.00
USD 1,337,000	Sunac China Holdings Ltd 6.875% 8/8/2020	1,335,683	0.01
USD 1,475,000	Sunac China Holdings Ltd 8.375% 15/1/2021	1,502,453	0.02
USD 1,311,000	Sunac China Holdings Ltd 8.625% 27/7/2020*	1,340,412	0.01
USD 474,000	Times China Holdings Ltd 5.75% 26/4/2022	452,792	0.00
USD 416,000	Times China Holdings Ltd 6.25% 17/1/2021	415,103	0.00
USD 2,300,000	Times China Holdings Ltd 7.625% 21/2/2022	2,309,981	0.02
GBP 800,000	Trafford Centre Finance Ltd/The FRN 28/7/2035	935,762	0.01
USD 1,030,995	Transocean Guardian Ltd '144A' 5.875% 15/1/2024	1,052,904	0.01
USD 7,947,200	Transocean Phoenix 2 Ltd '144A' 7.75% 15/10/2024	8,384,296	0.09
USD 708,800	Transocean Proteus Ltd '144A' 6.25% 1/12/2024	727,406	0.01
EUR 434,700	UPCB Finance IV Ltd 4% 15/1/2027	519,881	0.01
EUR 430,000	UPCB Finance VII Ltd 3.625% 15/6/2029	515,400	0.01
USD 2,296,000	Vale Overseas Ltd 4.375% 11/1/2022*	2,293,130	0.02
USD 1,345,000	VLL International Inc 5.75% 28/11/2024	1,296,849	0.01
USD 500,000	Xinyuan Real Estate Co Ltd 8.125% 30/8/2019	489,852	0.01
USD 1,442,000	Xinyuan Real Estate Co Ltd 9.875% 19/3/2020*	1,344,661	0.01
USD 2,690,000	Yankuang Group Cayman Ltd 4.75% 30/11/2020	2,654,409	0.03
USD 3,884,000	Yuzhou Properties Co Ltd 7.9% 11/5/2021	3,964,438	0.04
USD 2,000,000	Yuzhou Properties Co Ltd 8.625% 23/1/2022	2,057,500	0.02
USD 700,000	Zhen Ding Technology Holding Ltd 26/6/2019 (Zero Coupon)	740,684	0.01
		151,956,833	1.55
	中国		
EUR 2,900,000	Chengdu Xingcheng Investment Group Co Ltd 2.5% 20/3/2021	3,085,006	0.03
USD 2,470,000	China Construction Bank Corp FRN 27/2/2029	2,457,490	0.02
CNH 10,000,000	China Government Bond 3.3% 4/7/2023	1,501,541	0.02
USD 947,000	China Minmetals Corp FRN 13/11/2022 (Perpetual)	901,724	0.01
CNY 15,000,000	China Railway Construction Corp Ltd 1.5% 21/12/2021	2,289,064	0.02
USD 2,000,000	Guangxi Financial Investment Group Co Ltd 5.75% 23/1/2021	1,887,881	0.02
USD 2,362,000	Huachen Energy Co Ltd 6.625% 18/5/2020	1,582,540	0.02
USD 687,000	Inner Mongolia High-Grade High Way Construction And Development Co Ltd 4.375% 4/12/2020	669,928	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 (%)
		中国(続き)		
USD	1,157,000	Union Life Insurance Co Ltd 3% 19/9/2021	997,183	0.01
			15,372,357	0.16
		コロンビア		
USD	11,647,000	Colombia Government International Bond 4.375% 12/7/2021	11,929,440	0.12
USD	8,315,000	Colombia Government International Bond 4.5%15/3/2029	8,502,088	0.09
COP	67,745,200,000	Colombian TES 7% 30/6/2032	22,007,989	0.22
COP	54,087,000,000	Colombian TES 7.5% 26/8/2026	18,719,902	0.19
USD	2,996,000	Credivalores-Crediservicios SAS '144A' 9.75% 27/7/2022	2,667,264	0.03
USD	1,341,000	Ecopetrol SA 5.875% 28/5/2045	1,349,716	0.01
USD	2,397,000	Transportadora de Gas Internacional SA ESP '144A' 5.55% 1/11/2028	2,522,842	0.03
			67,699,241	0.69
		チェコ共和国		
EUR	2,652,000	Residomo SRO 3.375% 15/10/2024	3,060,193	0.03
		デンマーク		
USD	970,000	Danske Bank A/S FRN 26/6/2025 (Perpetual)	886,405	0.01
USD	2,035,000	Danske Bank A/S '144A' 5% 12/1/2022	2,077,625	0.02
USD	500,000	Danske Bank A/S '144A' 5.375% 12/1/2024	516,158	0.01
EUR	5,015,000	DKT Finance ApS 7% 17/6/2023*	6,171,138	0.06
EUR	2,432,000	Nykredit Realkredit A/S 0.75% 14/7/2021*	2,783,753	0.03
EUR	130,000	TDC A/S 5% 2/3/2022	164,007	0.00
			12,599,086	0.13
		ドミニカ共和国		
USD	1,431,000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA '144A' 6.75% 30/3/2029	1,445,310	0.01
USD	6,205,000	Dominican Republic International Bond 6% 19/7/2028	6,431,073	0.07
			7,876,383	0.08
		エクアドル		
USD	5,300,000	Ecuador Government International Bond 7.875% 23/1/2028	5,031,184	0.05
		エジプト		
EUR	2,781,000	Egypt Government International Bond '144A' 4.75% 16/4/2026	3,062,885	0.03
USD	2,078,000	Egypt Government International Bond '144A' 5.577% 21/2/2023*	2,075,402	0.02
USD	7,367,000	Egypt Government International Bond 5.75% 29/4/2020	7,486,714	0.08
USD	3,281,000	Egypt Government International Bond 6.125% 31/1/2022	3,346,620	0.03
USD	4,601,000	Egypt Government International Bond 6.875% 30/4/2040	4,152,402	0.04
USD	2,491,000	Egypt Government International Bond '144A' 7.6% 1/3/2029	2,554,832	0.03
USD	588,000	Egypt Government International Bond '144A' 7.903% 21/2/2048	576,240	0.00
USD	2,999,000	Egypt Government International Bond '144A' 8.7% 1/3/2049	3,115,961	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 (%)
		エジプト(続き)		
EGP	158,900,000	Egypt Treasury Bills 5/3/2019 (Zero Coupon)	9,055,481	0.09
EGP	64,300,000	Egypt Treasury Bills 2/4/2019 (Zero Coupon)	3,616,023	0.04
EGP	51,875,000	Egypt Treasury Bills 30/7/2019 (Zero Coupon)	2,759,922	0.03
EGP	51,875,000	Egypt Treasury Bills 20/8/2019 (Zero Coupon)	2,744,446	0.03
EGP	57,750,000	Egypt Treasury Bills 27/8/2019 (Zero Coupon)	3,034,213	0.03
EGP	51,875,000	Egypt Treasury Bills 5/11/2019 (Zero Coupon)	2,637,922	0.03
			50,219,063	0.51
		フランス		
EUR	100,000	Accor SA 2.625% 5/2/2021	119,191	0.00
EUR	200,000	APRR SA 1.125% 15/1/2021	232,171	0.00
EUR	300,000	BNP Paribas Cardif SA FRN 25/11/2025 (Perpetual)	361,223	0.00
EUR	1,430,000	BNP Paribas SA FRN 17/6/2022 (Perpetual)*	1,768,253	0.02
USD	1,800,000	BNP Paribas SA FRN 19/8/2025 (Perpetual)	1,898,604	0.02
EUR	400,000	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama FRN 28/5/2024 (Perpetual)	513,847	0.01
EUR	600,000	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 6% 23/1/2027	814,747	0.01
EUR	300,000	Capgemini SE 1.75% 1/7/2020	347,830	0.00
EUR	100,000	Casino Guichard Perrachon SA FRN 31/1/2024 (Perpetual)	82,397	0.00
EUR	300,000	Casino Guichard Perrachon SA 4.498% 7/3/2024	346,104	0.00
EUR	400,000	Casino Guichard Perrachon SA 4.561% 25/1/2023	468,152	0.01
EUR	1,340,000	CMA CGM SA 5.25% 15/1/2025*	1,349,740	0.01
EUR	340,000	CMA CGM SA 6.5% 15/7/2022*	381,106	0.00
EUR	100,000	Credit Agricole Assurances SA FRN 14/10/2025 (Perpetual)	121,049	0.00
EUR	1,427,000	Credit Agricole SA FRN 23/6/2021 (Perpetual)	1,756,422	0.02
USD	2,400,000	Credit Agricole SA '144A' FRN 23/9/2024 (Perpetual)	2,409,000	0.02
EUR	1,700,000	Credit Mutuel Arkea SA FRN 25/10/2029	1,817,373	0.02
EUR	1,400,000	Credit Mutuel Arkea SA 3.5% 9/2/2029	1,676,663	0.02
EUR	700,000	Crown European Holdings SA 2.25% 1/2/2023*	827,704	0.01
EUR	434,000	Crown European Holdings SA '144A' 2.25% 1/2/2023	513,093	0.01
EUR	227,000	Crown European Holdings SA 3.375% 15/5/2025	275,958	0.00
EUR	300,000	Electricite de France SA FRN 22/1/2026 (Perpetual)	357,128	0.00
EUR	400,000	Engie SA FRN 2/6/2024 (Perpetual)	481,733	0.01
EUR	2,000,000	Engie SA FRN 28/2/2025 (Perpetual)	2,342,888	0.02
EUR	160,000	Europcar Mobility Group 5.75% 15/6/2022	187,182	0.00
EUR	1,800,000	FCT Noria 2018-1 FRN 25/6/2038	2,047,028	0.02
EUR	1,700,000	FCT Noria 2018-1 FRN 25/6/2038	1,928,579	0.02
EUR	5,850,000	French Republic Government Bond OAT '144A' 1.5% 25/5/2050	6,469,599	0.07
EUR	11,700,000	HSBC France SA 0.2% 4/9/2021	13,363,134	0.14
EUR	167,000	Loxam SAS 3.5% 15/4/2022	194,604	0.00
EUR	200,000	Loxam SAS 3.5% 3/5/2023	233,782	0.00
EUR	200,000	Novafives SAS 5% 15/6/2025*	195,607	0.00
EUR	670,000	Orange SA FRN 7/2/2024 (Perpetual)	859,103	0.01
EUR	750,000	Orano SA 4.875% 23/9/2024	899,667	0.01
EUR	322,000	Paprec Holding SA 4% 31/3/2025*	311,068	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 (%)
フランス(続き)			
EUR	1,203,000 Parts Europe SA FRN 1/5/2022*	1,371,334	0.01
EUR	360,000 Parts Europe SA FRN 1/5/2022*	408,346	0.01
EUR	910,000 Parts Europe SA 4.375% 1/5/2022*	1,027,287	0.01
EUR	100,000 Picard Groupe SAS FRN 30/11/2023	112,898	0.00
EUR	360,000 RCI Banque SA FRN 12/4/2021	408,018	0.01
EUR	380,000 Rexel SA 2.625% 15/6/2024*	445,713	0.01
EUR	511,000 Rexel SA 3.5% 15/6/2023	599,431	0.01
EUR	500,000 Sanofi 21/3/2020 (Zero Coupon)	569,702	0.01
EUR	700,000 Sanofi FRN 21/3/2020	798,356	0.01
EUR	260,496 SMCP Group SAS 5.875% 1/5/2023	308,260	0.00
USD	248,000 Societe Generale SA '144A' FRN 13/9/2021 (Perpetual)	257,300	0.00
EUR	510,000 Solvay Finance SA FRN 2/6/2021 (Perpetual)*	628,081	0.01
EUR	2,000,000 Solvay Finance SA FRN 12/11/2023 (Perpetual)	2,547,781	0.03
EUR	300,000 Solvay Finance SA FRN 3/6/2024 (Perpetual)*	388,748	0.00
EUR	300,000 SPIE SA 3.125% 22/3/2024*	350,619	0.00
EUR	700,000 Teleperformance 1.875% 2/7/2025	803,882	0.01
EUR	1,760,000 TOTAL SA FRN 26/2/2021 (Perpetual)	2,058,511	0.02
EUR	160,000 TOTAL SA FRN 5/5/2023 (Perpetual)	191,033	0.00
EUR	900,000 Unibail-Rodamco SE 0.125% 14/5/2021	1,024,773	0.01
		62,251,802	0.64
ドイツ			
EUR	300,000 ADLER Real Estate AG 1.5% 6/12/2021	342,745	0.00
EUR	600,000 ADLER Real Estate AG 1.875% 27/4/2023	678,418	0.01
EUR	1,796,000 ADLER Real Estate AG 2.125% 6/2/2024*	2,034,942	0.02
EUR	1,600,000 ADLER Real Estate AG 3% 27/4/2026*	1,801,647	0.02
EUR	108,000 ADLER Real Estate AG 4.75% 8/4/2020	123,450	0.00
EUR	7,782,110 Bundesobligation 14/4/2023 (Zero Coupon)*	9,002,956	0.09
EUR	800,000 Commerzbank AG 1% 4/3/2026	902,094	0.01
EUR	360,000 Daimler AG 0.5% 9/9/2019	411,145	0.00
EUR	2,175,000 Deutsche Bank AG 1.125% 30/8/2023*	2,506,245	0.03
USD	1,815,000 Deutsche Bank AG 2.95% 20/8/2020*	1,782,305	0.02
EUR	12,472,000 Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.1% 15/4/2026*	16,143,901	0.16
EUR	2,400,000 Deutsche Pfandbriefbank AG FRN 28/4/2023 (Perpetual)	2,672,567	0.03
EUR	100,000 Deutsche Pfandbriefbank AG 4.6% 22/2/2027	119,821	0.00
EUR	396,423 IHO Verwaltungs GmbH 3.25% 15/9/2023*	458,945	0.00
EUR	6,500,000 IKB Deutsche Industriebank AG FRN 31/1/2028	6,929,245	0.07
EUR	200,000 Mahle GmbH 2.5% 14/5/2021	232,490	0.00
EUR	155,000 Merck Financial Services GmbH 4.5% 24/3/2020	184,964	0.00
EUR	599,000 Nidda BondCo GmbH 7.25% 30/9/2025	696,387	0.01
EUR	1,579,000 Platin 1426 GmbH 5.375% 15/6/2023	1,715,709	0.02
EUR	1,384,000 RWE AG FRN 21/4/2075	1,590,722	0.02
EUR	504,000 Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6% 30/7/2026	590,072	0.01
EUR	800,000 Tele Columbus AG 3.875% 2/5/2025*	810,793	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	1,100,000 thyssenkrupp AG 1.375% 3/3/2022	1,231,999	0.01
EUR	200,000 thyssenkrupp AG 2.5% 25/2/2025*	223,174	0.00
EUR	5,839,000 thyssenkrupp AG 2.875% 22/2/2024	6,664,816	0.07
EUR	3,292,000 Unitymedia GmbH 3.75% 15/1/2027	3,942,079	0.04
USD	400,000 Unitymedia GmbH '144A' 6.125% 15/1/2025	416,540	0.00
EUR	182,000 Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 3.5% 15/1/2027	218,319	0.00
EUR	600,000 Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 4% 15/1/2025	713,771	0.01
USD	7,281,000 Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH '144A' 5% 15/1/2025	7,500,886	0.08
EUR	856,800 Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 6.25% 15/1/2029*	1,081,067	0.01
EUR	2,500,000 Volkswagen Bank GmbH 0.625% 8/9/2021*	2,843,566	0.03
EUR	2,451,000 Volkswagen Financial Services AG 0.375% 12/4/2021*	2,778,175	0.03
EUR	1,250,000 Volkswagen Leasing GmbH 0.25% 16/2/2021	1,417,099	0.01
		80,763,054	0.82
ギリシャ			
EUR	805,000 Hellenic Republic Government Bond '144A' 3.375% 15/2/2025	924,859	0.01
EUR	7,845,000 Hellenic Republic Government Bond '144A' 3.45% 2/4/2024	9,193,728	0.09
EUR	293,760 Hellenic Republic Government Bond 3.5% 30/1/2023	350,475	0.00
EUR	717,658 Hellenic Republic Government Bond 3.75% 30/1/2028*	823,846	0.01
EUR	750,012 Hellenic Republic Government Bond 3.9% 30/1/2033	825,808	0.01
EUR	1,794,193 Hellenic Republic Government Bond 4% 30/1/2037	1,917,671	0.02
EUR	1,678,985 Hellenic Republic Government Bond 4.2% 30/1/2042	1,794,783	0.02
		15,831,170	0.16
ガーンジー			
USD	467,196 Doric Nimrod Air Alpha 2013-1 Class A Pass Through Trust '144A' 5.25% 30/5/2023	467,183	0.00
USD	2,525,000 EFG International Guernsey Ltd FRN 5/4/2027	2,455,205	0.03
EUR	236,000 Summit Properties Ltd 2% 31/1/2025	239,211	0.00
		3,161,599	0.03
香港			
USD	4,600,000 Bagan Capital Ltd 23/9/2021 (Zero Coupon)	4,549,699	0.05
USD	1,550,000 Chalieco Hong Kong Corp Ltd FRN 15/1/2020 (Perpetual)	1,558,796	0.02
CNH	917,253 China City Construction International Co Ltd (Defaulted) 5.35% 3/7/2017	8,565	0.00
USD	2,205,000 Chong Hing Bank Ltd FRN 26/7/2027	2,139,688	0.02
USD	6,425,000 CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.625% 14/3/2023	6,591,457	0.07
USD	607,000 CNAC HK Finbridge Co Ltd 5.125% 14/3/2028	635,860	0.01
USD	6,047,000 CNAC HK Synbridge Co Ltd 5% 5/5/2020	6,103,781	0.06
USD	2,775,000 GLP China Holdings Ltd 4.974% 26/2/2024	2,789,283	0.03
USD	2,443,000 HBIS Group Hong Kong Co Ltd 4.25% 7/4/2020	2,426,131	0.02
USD	1,430,000 Hongkong & Shanghai Banking Corp Ltd/The FRN 27/4/2019 (Perpetual)	1,007,235	0.01
USD	484,000 Hubei Science & Technology Investment Group Hong Kong Ltd 4.375% 5/3/2021	471,772	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 (%)
		香港(続き)		
USD	1,846,000	Weichai International Hong Kong Energy Group Co Ltd FRN 14/9/2022 (Perpetual)	1,740,557	0.02
			30,022,824	0.31
		インド		
USD	985,000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 4% 30/7/2027*	912,041	0.01
USD	2,487,000	Adani Transmission Ltd 4% 3/8/2026	2,239,209	0.02
INR	400,000,000	Food Corp of India 9.95% 7/3/2022	5,934,609	0.06
USD	2,710,000	Oil India Ltd 5.125% 4/2/2029	2,783,508	0.03
USD	6,093,000	Power Finance Corp Ltd 3.75% 6/12/2027	5,395,037	0.06
INR	500,000,000	Power Finance Corp Ltd 7.44% 11/6/2027	6,423,069	0.07
USD	2,462,000	REC Ltd (Restricted) 4.625% 22/3/2028	2,422,863	0.02
USD	1,500,000	Suzlon Energy Ltd (Step-up coupon) 5.75% 16/7/2019	1,215,000	0.01
USD	116,049	Videocon Industries Ltd (Restricted) (Step-up coupon) 2.8% 31/12/2020	37,157	0.00
USD	1,225,000	Yes Bank Ifsc Banking Unit Branch 3.75% 6/2/2023	1,153,337	0.01
			28,515,830	0.29
		インドネシア		
USD	535,000	Bukit Makmur Mandiri Utama PT 7.75% 13/2/2022	547,706	0.01
USD	6,172,000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.71% 15/11/2023	6,531,516	0.07
USD	6,025,000	Indonesia Government International Bond 3.7% 8/1/2022*	6,053,680	0.06
USD	11,647,000	Indonesia Government International Bond 3.75% 25/4/2022*	11,705,235	0.12
USD	10,548,000	Indonesia Government International Bond 4.75% 11/2/2029	11,028,999	0.11
USD	7,462,000	Indonesia Government International Bond 4.875% 5/5/2021	7,706,030	0.08
USD	4,185,000	Indonesia Government International Bond 4.875% 5/5/2021	4,321,013	0.04
USD	2,900,000	Indonesia Government International Bond 5.35% 11/2/2049*	3,112,544	0.03
USD	5,882,000	Indonesia Government International Bond 5.875% 13/3/2020*	6,065,812	0.06
IDR	500,720,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.125% 15/5/2028	31,749,936	0.32
IDR	6,668,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.625% 15/5/2033	413,565	0.01
IDR	327,036,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.5% 15/5/2038	21,593,698	0.22
IDR	271,160,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2029	19,886,191	0.20
IDR	70,374,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2036	5,052,771	0.05
IDR	160,411,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/3/2034	11,662,367	0.12
IDR	162,909,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/4/2039	11,704,932	0.12
IDR	26,400,000,000	Jasa Marga Persero Tbk PT 7.5% 11/12/2020	1,792,685	0.02
USD	5,000,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.45% 20/2/2029	5,010,725	0.05
IDR	28,140,000,000	Wijaya Karya Persero Tbk PT 7.7% 31/1/2021	1,901,528	0.02
			167,840,933	1.71
		国際機関		
EUR	400,000	European Investment Bank 1.375% 15/9/2021	475,039	0.00
		アイルランド		
EUR	1,826,000	Allied Irish Banks Plc FRN 3/12/2020 (Perpetual)	2,241,918	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 (%)
		アイルランド(続き)		
EUR	743,000	Allied Irish Banks Plc FRN 26/11/2025	874,467	0.01
EUR	1,575,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 4.125% 15/5/2023*	1,847,597	0.02
USD	3,206,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.25% 15/9/2022	3,189,970	0.03
USD	6,911,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.625% 15/5/2023*	6,954,194	0.07
GBP	3,192,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 4.75% 15/7/2027	3,934,090	0.04
EUR	805,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 6.75% 15/5/2024	976,941	0.01
USD	250,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 7.25% 15/5/2024	261,250	0.00
EUR	150,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	156,964	0.00
EUR	150,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	148,279	0.00
EUR	550,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	459,107	0.00
EUR	760,000	Avoca CLO XV DAC FRN 15/4/2031	754,727	0.01
EUR	1,400,000	Avoca CLO XVIII DAC FRN 15/4/2031	1,553,862	0.02
EUR	600,000	Avoca CLO XVIII DAC FRN 15/4/2031	614,791	0.01
EUR	1,550,000	Bank of Ireland FRN 18/6/2020 (Perpetual)	1,884,419	0.02
EUR	832,000	Bank of Ireland FRN 11/6/2024	956,139	0.01
GBP	500,000	Bank of Ireland Group Plc FRN 19/9/2027	629,280	0.01
USD	1,950,000	Bank of Ireland Group Plc FRN 19/9/2027*	1,812,554	0.02
EUR	340,000	Cadogan Square CLO XI DAC FRN 15/2/2031	371,617	0.00
EUR	490,000	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO 2014-2 Ltd FRN 17/11/2031	539,970	0.00
EUR	100,000	Caterpillar International Finance DAC 0.75% 13/10/2020	115,149	0.00
EUR	1,120,000	CVC Cordatus Loan Fund VI DAC FRN 15/4/2032	888,459	0.01
EUR	462,000	eircom Finance DAC 4.5% 31/5/2022	538,696	0.00
EUR	700,000	Halcyon Loan Advisors European Funding FRN 18/10/2031	786,543	0.01
EUR	1,350,000	Harvest CLO XVI DAC FRN 15/10/2031	1,446,354	0.01
EUR	710,000	Invesco Euro CLO I DAC FRN 15/7/2031	807,078	0.01
EUR	720,000	OZLME IV DAC FRN 27/7/2032	798,084	0.01
EUR	1,420,000	Rockford Tower Europe CLO 2018-1 DAC FRN 20/12/2031	1,613,658	0.02
EUR	300,000	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2.375% 1/2/2024	356,394	0.00
EUR	574,000	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2.875% 15/1/2026	678,345	0.01
EUR	596,440	Taurus 2016-2 DEU DAC 'Series 2016-DE2 C' FRN 3/1/2027	679,618	0.01
EUR	633,827	Taurus 2016-2 DEU DAC 'Series 2016-DE2 D' FRN 3/1/2027	723,181	0.01
GBP	693,000	Virgin Media Receivables Financing Notes I DAC 5.5% 15/9/2024	925,211	0.01
GBP	1,140,000	Virgin Media Receivables Financing Notes II DAC 5.75% 15/4/2023*	1,545,736	0.02
			42,064,642	0.43
		マン島		
USD	2,713,000	Gohl Capital Ltd 4.25% 24/1/2027	2,635,883	0.03
		イタリア		
GBP	100,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 8/2/2022 (Perpetual)	137,103	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	1,200,000 Assicurazioni Generali SpA FRN 12/12/2042	1,621,908	0.02
EUR	203,000 Assicurazioni Generali SpA FRN 27/10/2047	251,709	0.00
EUR	700,000 Assicurazioni Generali SpA 4.125% 4/5/2026	849,372	0.01
EUR	1,700,000 Banca Carige SpA 0.75% 26/7/2020	1,934,395	0.02
EUR	730,000 Banco BPM SpA 1.75% 24/4/2023	815,470	0.01
EUR	600,000 Banco BPM SpA 2.75% 27/7/2020	700,698	0.01
EUR	800,000 Buzzi Unicem SpA 2.125% 28/4/2023	925,598	0.01
GBP	297,000 Enel SpA FRN 10/9/2075	425,039	0.00
EUR	274,000 Guala Closures SpA/Italy FRN 15/4/2024*	315,140	0.00
EUR	4,700,000 Intesa Sanpaolo SpA FRN 19/1/2021 (Perpetual)*	5,550,916	0.06
EUR	8,410,000 Intesa Sanpaolo SpA FRN 11/1/2027 (Perpetual)*	10,232,441	0.10
EUR	455,000 Intesa Sanpaolo SpA 1.75% 20/3/2028	484,003	0.01
EUR	150,000 Intesa Sanpaolo SpA 5.15% 16/7/2020	180,938	0.00
EUR	7,300,000 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.7% 1/3/2047	7,074,661	0.07
EUR	40,213,000 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.8% 1/12/2028*	45,940,118	0.47
EUR	551,000 LKQ Italia Bondco SpA 3.875% 1/4/2024	666,287	0.01
EUR	562,000 Nexi Capital SpA FRN 1/5/2023*	645,796	0.01
EUR	820,000 Nexi Capital SpA 4.125% 1/11/2023*	958,810	0.01
EUR	1,810,000 Sisal Group SpA 7% 31/7/2023*	2,127,844	0.02
EUR	5,550,000 Taurus 2018-1 IT SRL 'Series 2018-IT1 A' FRN 18/5/2030	6,230,761	0.06
EUR	1,205,000 Taurus 2018-1 IT SRL 'Series 2018-IT1 B' FRN 18/5/2030	1,338,786	0.01
EUR	2,900,000 Telecom Italia SpA/Milano 1.125% 26/3/2022	3,160,109	0.03
EUR	1,155,000 Telecom Italia SpA/Milano 3.25% 16/1/2023	1,353,498	0.01
EUR	954,000 Telecom Italia SpA/Milano 4% 11/4/2024	1,109,706	0.01
EUR	380,000 Telecom Italia SpA/Milano 4.875% 25/9/2020	460,963	0.01
USD	1,218,000 Telecom Italia SpA/Milano '144A' 5.303% 30/5/2024	1,195,162	0.01
GBP	200,000 Telecom Italia SpA/Milano 5.875% 19/5/2023	277,890	0.00
EUR	950,000 UniCredit SpA FRN 10/9/2021 (Perpetual)*	1,061,163	0.01
EUR	2,140,000 UniCredit SpA FRN 3/6/2022 (Perpetual)	2,697,964	0.03
EUR	1,755,000 UniCredit SpA FRN 3/6/2023 (Perpetual)	1,935,386	0.02
EUR	1,512,000 UniCredit SpA FRN 28/10/2025	1,799,804	0.02
EUR	600,000 UniCredit SpA FRN 3/1/2027*	702,836	0.01
EUR	2,270,000 UniCredit SpA FRN 20/2/2029	2,615,791	0.03
USD	7,585,000 UniCredit SpA '144A' 6.572% 14/1/2022	7,781,596	0.08
EUR	2,700,000 Unione di Banche Italiane SpA FRN 4/3/2029	3,083,892	0.03
EUR	300,000 Wind Tre SpA FRN 20/1/2024	321,915	0.00
EUR	800,000 Wind Tre SpA 3.125% 20/1/2025	842,066	0.01
USD	1,100,000 Wind Tre SpA '144A' 5% 20/1/2026	953,562	0.01
		120,761,096	1.23
日本			
JPY	20,000,000 ANA Holdings Inc 16/9/2022 (Zero Coupon)	182,359	0.00
JPY	160,000,000 ANA Holdings Inc 19/9/2024 (Zero Coupon)	1,480,629	0.02
JPY	240,000,000 Daio Paper Corp 17/9/2020 (Zero Coupon)	2,172,792	0.02
JPY	40,000,000 Ezaki Glico Co Ltd 30/1/2024 (Zero Coupon)	367,640	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 (%)
		日本(続き)		
JPY	40,000,000	HIS Co Ltd 30/8/2019 (Zero Coupon)	369,256	0.00
JPY	150,000,000	HIS Co Ltd 15/11/2024 (Zero Coupon)	1,457,359	0.01
JPY	290,000,000	Iida Group Holdings Co Ltd 18/6/2020 (Zero Coupon)	2,594,685	0.03
JPY	11,530,400,000	Japanese Government CPI Linked Bond 0.1% 10/3/2027	109,088,879	1.11
JPY	3,790,600,000	Japanese Government CPI Linked Bond 0.1% 10/3/2028	35,598,995	0.36
JPY	230,000,000	Kansai Paint Co Ltd 17/6/2022 (Zero Coupon)	2,094,023	0.02
JPY	230,000,000	LINE Corp 19/9/2025 (Zero Coupon)	1,907,190	0.02
JPY	230,000,000	LIXIL Group Corp 4/3/2020 (Zero Coupon)	2,026,067	0.02
JPY	100,000,000	LIXIL Group Corp 4/3/2022 (Zero Coupon)	868,876	0.01
JPY	490,000,000	Mitsubishi Chemical Holdings Corp 30/3/2022 (Zero Coupon)	4,427,771	0.05
JPY	140,000,000	Mitsubishi Chemical Holdings Corp 29/3/2024 (Zero Coupon)	1,276,403	0.01
USD	5,815,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3.741% 7/3/2029	5,837,605	0.06
USD	9,270,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3.761% 26/7/2023	9,415,370	0.10
USD	375,000	Mitsui Sumitomo Insurance Co Ltd FRN 6/3/2029 (Perpetual)	376,597	0.00
JPY	230,000,000	Resorttrust Inc 1/12/2021 (Zero Coupon)	2,015,719	0.02
JPY	180,000,000	SBI Holdings Inc/Japan 13/9/2023 (Zero Coupon)	1,676,823	0.02
JPY	150,000,000	Shimizu Corp 16/10/2020 (Zero Coupon)	1,354,031	0.01
USD	600,000	Shizuoka Bank Ltd/The FRN 25/1/2023	570,000	0.01
USD	200,000	SoftBank Group Corp FRN 19/7/2023 (Perpetual)	179,250	0.00
USD	950,000	SoftBank Group Corp FRN 19/7/2027 (Perpetual)*	836,057	0.01
EUR	3,805,000	SoftBank Group Corp 4% 20/4/2023	4,590,254	0.05
EUR	581,000	SoftBank Group Corp 4.75% 30/7/2025	702,663	0.01
EUR	1,355,000	SoftBank Group Corp 5% 15/4/2028	1,599,747	0.02
JPY	240,000,000	T&D Holdings Inc 5/6/2020 (Zero Coupon)	2,146,516	0.02
EUR	2,925,000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd FRN 21/11/2022	3,368,836	0.03
EUR	725,000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 0.375% 21/11/2020	827,538	0.01
EUR	775,000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 1.125% 21/11/2022	894,499	0.01
JPY	320,000,000	Tohoku Electric Power Co Inc 3/12/2020 (Zero Coupon)	2,859,318	0.03
JPY	120,000,000	Transcosmos Inc 22/12/2020 (Zero Coupon)	1,072,876	0.01
USD	3,000,000	Yamaguchi Financial Group Inc FRN 26/3/2020	2,951,250	0.03
			209,187,873	2.13
		ジャージー		
GBP	3,277,000	AA Bond Co Ltd 2.75% 31/7/2023	3,878,854	0.04
GBP	510,000	AA Bond Co Ltd 4.249% 31/7/2020	687,752	0.01
GBP	440,000	AA Bond Co Ltd 4.875% 31/7/2024	567,833	0.01
EUR	1,236,000	Avis Budget Finance Plc 4.75% 30/1/2026	1,426,405	0.01
GBP	6,638,000	CPUK Finance Ltd 4.25% 28/8/2022	8,784,927	0.09
GBP	157,000	CPUK Finance Ltd 4.875% 28/8/2025	204,348	0.00
USD	890,000	EnSCO Jersey Finance Ltd 3% 31/1/2024	728,894	0.01
USD	2,200,000	HBOS Capital Funding LP 6.85% 23/6/2019 (Perpetual)	2,224,750	0.02
GBP	500,000	Intu Jersey 2 Ltd 2.875% 1/11/2022	549,403	0.01
EUR	3,017,501	LHC3 Plc 4.125% 15/8/2024*	3,481,780	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 (%)
		ジャージー(続き)		
EUR	442,000	Lincoln Finance Ltd 6.875% 15/4/2021	516,322	0.00
USD	2,000,000	Tullow Oil Jersey Ltd 6.625% 12/7/2021	2,396,660	0.02
			25,447,928	0.26
		ルクセンブルグ		
USD	13,710,000	Allergan Funding SCS 3.8% 15/3/2025	13,543,145	0.14
EUR	500,000	Altice Financing SA 5.25% 15/2/2023*	585,853	0.01
USD	1,559,000	Altice Financing SA '144A' 6.625% 15/2/2023	1,597,975	0.02
USD	3,970,000	Altice Financing SA '144A' 7.5% 15/5/2026	3,831,050	0.04
EUR	1,510,000	Altice Finco SA 4.75% 15/1/2028	1,458,641	0.02
USD	1,230,000	Altice Finco SA '144A' 7.625% 15/2/2025	1,093,162	0.01
USD	409,000	Altice Luxembourg SA '144A' 7.75% 15/5/2022	406,955	0.01
EUR	210,000	Aramark International Finance Sarl 3.125% 1/4/2025	249,715	0.00
EUR	2,432,000	ArcelorMittal 2.875% 6/7/2020*	2,862,378	0.03
EUR	855,000	ArcelorMittal 3% 9/4/2021	1,025,219	0.01
USD	180,000	ArcelorMittal 5.25% 5/8/2020	184,339	0.00
GBP	700,000	B&M European Value Retail SA 4.125% 1/2/2022*	935,878	0.01
EUR	505,000	BMBG Bond Finance SCA 3% 15/6/2021	582,393	0.01
GBP	100,000	Cabot Financial Luxembourg SA 6.5% 1/4/2021	131,809	0.00
GBP	900,000	Cabot Financial Luxembourg SA 7.5% 1/10/2023	1,162,538	0.01
EUR	282,000	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023*	337,915	0.00
USD	220,000	Codere Finance 2 Luxembourg SA '144A' 7.625% 1/11/2021	207,403	0.00
EUR	1,734,000	ContourGlobal Power Holdings SA 3.375% 1/8/2023*	1,993,019	0.02
EUR	1,780,000	DEA Finance SA 7.5% 15/10/2022	2,126,455	0.02
USD	2,980,780	Dragon Aviation Finance Luxembourg SA 4% 28/11/2022	2,953,402	0.03
EUR	600,000	European TopSoho Sarl 4% 21/9/2021	681,170	0.01
EUR	819,000	Fiat Chrysler Finance Europe SA 4.75% 15/7/2022	1,028,315	0.01
EUR	280,000	Fiat Chrysler Finance Europe SA 6.75% 14/10/2019	331,526	0.00
EUR	150,000	FMC Finance VII SA 5.25% 15/2/2021	186,311	0.00
GBP	300,000	Garfunkelux Holdco 2 SA 11% 1/11/2023*	324,235	0.00
EUR	360,000	Garfunkelux Holdco 3 SA FRN 1/9/2023	340,141	0.00
EUR	850,000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.5% 1/8/2022*	861,530	0.01
GBP	917,000	Garfunkelux Holdco 3 SA 8.5% 1/11/2022	1,076,306	0.01
EUR	300,000	Hanesbrands Finance Luxembourg SCA 3.5% 15/6/2024*	361,474	0.00
USD	2,863,000	Hidrovias International Finance SARL '144A' 5.95% 24/1/2025	2,669,747	0.03
EUR	325,000	Horizon Parent Holdings Sarl 8.25% 15/2/2022	381,169	0.01
EUR	1,050,000	INEOS Group Holdings SA 5.375% 1/8/2024*	1,216,169	0.01
USD	2,143,000	Intelsat Connect Finance SA '144A' 9.5% 15/2/2023*	2,094,783	0.02
USD	139,000	Intelsat Jackson Holdings SA '144A' 8% 15/2/2024	145,429	0.00
USD	458,000	Intelsat SA '144A' 4.5% 15/6/2025	733,452	0.01
USD	4,689,000	Klabin Finance SA '144A' 4.875% 19/9/2027	4,477,995	0.05
EUR	67,000	Matterhorn Telecom SA FRN 1/2/2023	75,984	0.00
EUR	1,000,000	Matterhorn Telecom SA 4% 15/11/2027	1,081,309	0.01
USD	1,800,000	Millicom International Cellular SA '144A' 6.625% 15/10/2026	1,858,932	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 (%)	
ルクセンブルグ(続き)				
EUR	200,000	Monitchem HoldCo 3 SA 5.25% 15/6/2021*	227,283	0.00
USD	4,282,000	Pacific Drilling SA '144A' 8.375% 1/10/2023	4,314,115	0.05
USD	4,682,000	Puma International Financing SA '144A' 5% 24/1/2026	4,025,987	0.04
EUR	3,203,000	Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025*	3,821,940	0.04
USD	3,202,000	Rumo Luxembourg Sarl '144A' 5.875% 18/1/2025	3,262,038	0.03
EUR	2,500,000	SES SA FRN 2/1/2022 (Perpetual)*	2,964,084	0.03
EUR	200,000	SES SA FRN 29/1/2024 (Perpetual)	242,716	0.00
USD	1,020,000	Telecom Italia Capital SA 6.375% 15/11/2033	953,700	0.01
USD	370,000	Telecom Italia Capital SA 7.175% 18/6/2019	374,740	0.00
EUR	353,000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/1/2033	498,373	0.01
EUR	1,764,000	Telenet Finance VI Luxembourg SCA 4.875% 15/7/2027	2,163,165	0.02
USD	1,498,000	Venator Finance Sarl / Venator Materials LLC '144A' ' 5.75% 15/7/2025	1,314,495	0.01
		81,357,857	0.83	
マレーシア				
USD	1,600,000	1MDB Energy Ltd 5.99% 11/5/2022	1,658,000	0.02
USD	8,874,000	Cindai Capital Ltd 8/2/2023 (Zero Coupon)	9,061,095	0.09
USD	472,000	Press Metal Labuan Ltd 4.8% 30/10/2022	455,825	0.00
USD	850,000	TNB Global Ventures Capital Bhd 4.851% 1/11/2028	871,169	0.01
USD	2,800,000	Top Glove Labuan Ltd 2% 1/3/2024	2,740,500	0.03
		14,786,589	0.15	
モルディブ				
USD	2,480,000	Republic of Maldives Ministry of Finance and Treasury Bond 7% 7/6/2022	2,343,600	0.02
モーリシャス				
USD	3,288,000	Greenko Investment Co 4.875% 16/8/2023	3,098,940	0.03
USD	4,445,000	UPL Corp Ltd 4.5% 8/3/2028*	4,190,990	0.04
		7,289,930	0.07	
メキシコ				
USD	1,406,000	Axtel SAB de CV 6.375% 14/11/2024	1,371,201	0.01
USD	4,177,000	Axtel SAB de CV '144A' 6.375% 14/11/2024	4,073,619	0.04
USD	1,529,000	Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman '144A' FRN 6/7/2022 (Perpetual)	1,513,710	0.02
USD	2,381,000	Controladora Mabe SA de CV '144A' 5.6% 23/10/2028	2,374,131	0.02
USD	4,376,000	Cydsa SAB de CV '144A' 6.25% 4/10/2027	4,148,754	0.04
USD	5,122,000	Grupo KUO SAB De CV '144A' 5.75% 7/7/2027	4,996,409	0.05
MXN	634,876	Mexican Bonos 5.75% 5/3/2026	2,898,960	0.03
MXN	1,500,000	Mexican Bonos 6.5% 10/6/2021	7,566,924	0.08
MXN	2,443,142	Mexican Bonos 7.5% 3/6/2027	12,264,532	0.12
MXN	935,505	Mexican Bonos 7.75% 23/11/2034	4,566,991	0.05
MXN	1,386,609	Mexican Bonos 8.5% 31/5/2029	7,369,539	0.07
MXN	1,255,000	Mexican Bonos 8.5% 18/11/2038	6,460,857	0.07
MXN	1,200,000	Mexican Bonos 10% 20/11/2036	7,069,169	0.07
USD	5,682,000	Mexico Government International Bond 3.75% 11/1/2028	5,454,720	0.06
USD	12,352,000	Mexico Government International Bond 4.5% 22/4/2029	12,466,256	0.13

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	7,670,000 Mexico Government International Bond 5.75% 12/10/2110	7,585,630	0.08
USD	11,905,000 Petroleos Mexicanos 5.625% 23/1/2046	9,464,475	0.10
USD	2,945,000 Petroleos Mexicanos 6.375% 4/2/2021*	3,036,295	0.03
USD	1,458,000 Petroleos Mexicanos 6.75% 21/9/2047	1,277,062	0.01
USD	8,750,000 Petroleos Mexicanos 6.875% 4/8/2026	8,758,750	0.09
USD	1,111,000 Unifin Financiera SAB de CV SOFOM ENR '144A' FRN 29/1/2025 (Perpetual)	951,688	0.01
USD	1,529,000 Unifin Financiera SAB de CV SOFOM ENR '144A' 7.25% 27/9/2023	1,497,854	0.02
		117,167,526	1.20
モンゴル			
USD	473,991 Energy Resources LLC FRN 30/9/2022	459,179	0.01
USD	1,100,000 Mongolian Mortgage Corp Hfc LLC 9.75% 29/1/2022	1,109,625	0.01
		1,568,804	0.02
オランダ			
EUR	1,600,000 ABN AMRO Bank NV FRN 22/9/2020 (Perpetual)	1,911,166	0.02
EUR	2,800,000 ABN AMRO Bank NV FRN 22/9/2027 (Perpetual)	3,047,538	0.03
EUR	2,432,000 ABN AMRO Bank NV 6.375% 27/4/2021	3,120,759	0.03
EUR	700,000 ALME Loan Funding V BV FRN 15/7/2031	789,906	0.01
USD	750,000 AT Securities BV FRN 21/7/2023 (Perpetual)	704,062	0.01
EUR	3,000,000 ATF Netherlands BV FRN 20/1/2023 (Perpetual)*	3,427,708	0.04
EUR	700,000 Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/1/2025*	825,824	0.01
GBP	460,000 Cable & Wireless International Finance BV 8.625% 25/3/2019	613,996	0.01
EUR	300,000 Cairn CLO IX BV FRN 21/3/2032	328,412	0.00
EUR	600,000 Cairn CLO IX BV FRN 21/3/2032	652,152	0.01
EUR	907,000 Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/6/2020 (Perpetual)	1,085,034	0.01
EUR	400,000 Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/6/2021 (Perpetual)	503,414	0.01
EUR	1,800,000 Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/12/2025 (Perpetual)	2,108,353	0.02
EUR	220,000 Diamond BC BV 5.625% 15/8/2025*	228,056	0.00
EUR	150,000 E.ON International Finance BV 5.75% 7/5/2020	182,543	0.00
EUR	500,000 Encavis Finance BV FRN 13/9/2023 (Perpetual)	566,048	0.01
USD	415,000 Enel Finance International NV '144A' 3.625% 25/5/2027	384,079	0.00
EUR	1,569,000 Energizer Gamma Acquisition BV 4.625% 15/7/2026	1,825,055	0.02
USD	573,000 Fiat Chrysler Automobiles NV 4.5% 15/4/2020	578,730	0.01
EUR	360,000 Heineken NV 1.25% 10/9/2021	420,917	0.00
EUR	2,136,000 Hertz Holdings Netherlands BV 5.5% 30/3/2023	2,495,603	0.03
EUR	4,000,000 Iberdrola International BV FRN 12/2/2025 (Perpetual)	4,649,644	0.05
USD	420,000 ING Groep NV FRN 16/4/2020 (Perpetual)	420,000	0.00
USD	4,955,000 ING Groep NV FRN 16/4/2024 (Perpetual)	4,948,534	0.05
USD	1,800,000 ING Groep NV FRN 22/3/2028	1,800,828	0.02
EUR	967,000 Intertrust Group BV 3.375% 15/11/2025	1,126,033	0.01
EUR	1,779,000 InterXion Holding NV 4.75% 15/6/2025	2,148,530	0.02
EUR	360,000 Koninklijke Ahold Delhaize NV FRN 19/3/2021*	409,751	0.00
EUR	500,000 LeasePlan Corp NV 1% 25/2/2022	570,585	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)			
USD	2,290,000 Marfrig Holdings Europe BV '144A' 8% 8/6/2023	2,381,600	0.02
EUR	2,100,000 Naturgy Finance BV FRN 18/11/2022 (Perpetual)*	2,526,836	0.03
EUR	1,300,000 Naturgy Finance BV FRN 24/4/2024 (Perpetual)	1,494,885	0.02
EUR	350,000 NN Group NV FRN 13/6/2024 (Perpetual)	421,466	0.00
USD	7,517,000 NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 3.875% 1/9/2022	7,518,729	0.08
USD	7,898,000 NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.125% 15/6/2020	7,975,400	0.08
USD	200,000 NXP BV / NXP Funding LLC 4.125% 15/6/2020*	201,960	0.00
USD	11,690,000 NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.125% 1/6/2021	11,783,239	0.12
USD	200,000 NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.625% 15/6/2022	204,456	0.00
USD	525,000 NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.625% 1/6/2023	536,445	0.01
USD	1,735,000 NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.875% 1/3/2024	1,789,635	0.02
EUR	2,384,000 OCI NV 5% 15/4/2023*	2,866,824	0.03
USD	1,337,000 Petrobras Global Finance BV 5.999% 27/1/2028	1,362,336	0.01
USD	647,000 Petrobras Global Finance BV 6.125% 17/1/2022	683,555	0.01
USD	2,560,000 Petrobras Global Finance BV 7.25% 17/3/2044*	2,739,469	0.03
USD	4,294,000 Petrobras Global Finance BV 7.375% 17/1/2027*	4,731,559	0.05
USD	4,000 Petrobras Global Finance BV 8.75% 23/5/2026	4,719	0.00
EUR	3,936,000 Repsol International Finance BV FRN 25/3/2021 (Perpetual)*	4,692,327	0.05
EUR	804,000 Repsol International Finance BV FRN 25/3/2075*	985,914	0.01
USD	538,000 Royal Capital BV FRN 5/5/2024 (Perpetual)	506,362	0.01
USD	2,951,000 SABIC Capital II BV '144A' 4% 10/10/2023	2,987,887	0.03
USD	1,302,000 SABIC Capital II BV 4.5% 10/10/2028*	1,342,362	0.01
EUR	4,200,000 Telefonica Europe BV FRN 4/12/2019 (Perpetual)	4,917,052	0.05
GBP	400,000 Telefonica Europe BV FRN 26/11/2020 (Perpetual)	564,021	0.01
EUR	900,000 Telefonica Europe BV FRN 18/9/2021 (Perpetual)	1,186,140	0.01
EUR	4,000,000 Telefonica Europe BV FRN 15/3/2022 (Perpetual)*	4,739,256	0.05
EUR	400,000 Telefonica Europe BV FRN 7/6/2023 (Perpetual)	438,395	0.00
EUR	1,900,000 Telefonica Europe BV FRN 31/3/2024 (Perpetual)	2,416,607	0.02
USD	1,107,000 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 1.7% 19/7/2019	1,099,002	0.01
EUR	215,000 Unilever NV 1.75% 5/8/2020	251,203	0.00
EUR	1,274,000 United Group BV FRN 1/7/2023	1,464,176	0.01
EUR	1,071,000 United Group BV 4.375% 1/7/2022*	1,242,089	0.01
EUR	2,444,000 United Group BV 4.875% 1/7/2024	2,835,897	0.03
EUR	2,566,000 UPC Holding BV 3.875% 15/6/2029	3,070,115	0.03
USD	1,980,000 UPC Holding BV '144A' 5.5% 15/1/2028	1,994,850	0.02
EUR	400,000 Volkswagen International Finance NV FRN 30/3/2019	455,409	0.00
EUR	1,400,000 Volkswagen International Finance NV FRN 14/12/2022 (Perpetual)	1,570,464	0.02
EUR	2,500,000 Volkswagen International Finance NV 0.5% 30/3/2021	2,844,699	0.03
EUR	1,105,000 Volkswagen International Finance NV 2% 26/3/2021	1,297,751	0.01
EUR	1,250,000 Ziggo Bond Co BV 4.625% 15/1/2025	1,456,941	0.01
EUR	653,000 Ziggo Bond Co BV 7.125% 15/5/2024	780,024	0.01
EUR	1,520,000 Ziggo BV 4.25% 15/1/2027*	1,785,016	0.02
USD	8,437,000 Ziggo BV '144A' 5.5% 15/1/2027	8,120,612	0.08
		146,140,944	1.49

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 (%)
		ナイジェリア		
NGN	301,280,000	Nigeria Government Bond 2/5/2019 (Zero Coupon)	806,262	0.01
NGN	301,280,000	Nigeria Government Bond 4/7/2019 (Zero Coupon)	788,056	0.01
NGN	602,560,000	Nigeria Government Bond 15/8/2019 (Zero Coupon)	1,549,636	0.01
USD	3,615,000	Nigeria Government International Bond '144A' 9.248% 21/1/2049	4,012,975	0.04
			<hr/> 7,156,929	<hr/> 0.07
		ノルウェー		
USD	400,000	DNB Bank ASA FRN 26/3/2020 (Perpetual)	399,344	0.00
EUR	760,000	SpareBank 1 SMN 0.75% 8/6/2021	874,820	0.01
			<hr/> 1,274,164	<hr/> 0.01
		オマーン		
USD	9,360,000	Oman Sovereign Sukuk SAOC '144A' 5.932% 31/10/2025*	9,361,156	0.10
		パナマ		
USD	624,000	AES Panama SRL '144A' 6% 25/6/2022*	643,644	0.01
USD	499,000	Avianca Holdings SA / Avianca Leasing LLC / Grupo Taca Holdings Ltd 8.375% 10/5/2020	487,772	0.01
USD	3,254,000	Promerica Financial Corp '144A' 9.7% 14/5/2024	3,302,810	0.03
			<hr/> 4,434,226	<hr/> 0.05
		ペルー		
USD	2,863,000	Orazul Energy Egenor S en C por A '144A' 5.625% 28/4/2027	2,684,062	0.03
USD	13,156,000	Peruvian Government International Bond 4.125% 25/8/2027*	13,978,250	0.14
			<hr/> 16,662,312	<hr/> 0.17
		フィリピン		
USD	7,473,000	Philippine Government International Bond 3.75% 14/1/2029	7,583,826	0.08
		ポルトガル		
EUR	200,000	Banco Espirito Santo SA (Restricted) (Defaulted) 2.625% 8/5/2017	69,440	0.00
EUR	20,500,000	Banco Espirito Santo SA (Restricted) (Defaulted) 4% 21/1/2019	6,767,535	0.07
EUR	2,000,000	Banco Espirito Santo SA (Restricted) (Defaulted) 4.75% 15/1/2018	660,247	0.01
EUR	3,100,000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 30/4/2079	3,674,352	0.04
EUR	500,000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No. 1 FRN 20/3/2033	571,968	0.01
EUR	900,000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No. 1 FRN 20/3/2033	1,052,959	0.01
EUR	6,915,630	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta IV 2.423% 12/2/2021	8,007,268	0.08
EUR	14,091,600	TAGUS-Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta V 0.85% 12/2/2022	16,051,706	0.16
			<hr/> 36,855,475	<hr/> 0.38
		カタール		
USD	1,258,000	Qatar Government International Bond 4.5% 23/4/2028	1,330,335	0.01
		ロシア連邦		
RUB	644,652,000	Russian Federal Bond - OFZ 6.9% 23/5/2029	8,887,869	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 (%)
ロシア連邦(続き)			
RUB 863,170,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.05% 19/1/2028	12,241,360	0.12
USD 7,800,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.375% 21/3/2029	7,620,600	0.08
		28,749,829	0.29
サウジアラビア			
USD 17,316,000	Saudi Government International Bond '144A' 4.375% 16/4/2029*	17,688,294	0.18
USD 10,029,000	Saudi Government International Bond '144A' 5.25% 16/1/2050*	10,518,475	0.11
USD 1,319,000	Saudi Government International Bond 5.25% 16/1/2050	1,383,375	0.01
		29,590,144	0.30
シンガポール			
USD 5,333	Eterna Capital Pte Ltd 8% 11/12/2022	4,485	0.00
USD 1,301,000	Global Prime Capital Pte Ltd 7.25% 26/4/2021*	1,341,346	0.01
USD 3,481,000	LLPL Capital Pte Ltd '144A' 6.875% 4/2/2039	3,589,781	0.04
USD 2,000,000	LLPL Capital Pte Ltd 6.875% 4/2/2039	2,062,500	0.02
USD 4,075,000	Medco Straits Services Pte Ltd 8.5% 17/8/2022*	4,263,582	0.04
EUR 6,293,000	Mulhacen Pte Ltd 6.5% 1/8/2023	7,172,639	0.07
USD 2,555,000	SSMS Plantation Holdings Pte Ltd 7.75% 23/1/2023	2,427,250	0.03
USD 3,325,000	United Overseas Bank Ltd FRN 19/10/2023 (Perpetual)	3,145,832	0.03
		24,007,415	0.24
南アフリカ			
ZAR 169,036,000	Republic of South Africa Government Bond 6.25% 31/3/2036*	8,715,237	0.09
ZAR 71,435,400	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030	4,678,162	0.05
ZAR 95,806,000	Republic of South Africa Government Bond 8.75% 31/1/2044	6,168,937	0.06
ZAR 210,825,000	Republic of South Africa Government Bond 8.75% 28/2/2048	13,565,972	0.14
ZAR 151,895,264	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040	10,083,682	0.10
USD 6,459,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.85% 27/9/2027	6,297,687	0.07
USD 17,645,000	Republic of South Africa Government International Bond 6.875% 27/5/2019	17,806,011	0.18
		67,315,688	0.69
韓国			
USD 1,994,000	Heungkuk Life Insurance Co Ltd FRN 9/11/2047	1,853,489	0.02
KRW 1,600,000,000	Kakao Corp 11/5/2021 (Zero Coupon)	1,441,180	0.02
USD 3,200,000	KDB Life Insurance Co Ltd FRN 21/5/2048	3,075,144	0.03
EUR 1,100,000	LG Chem Ltd 16/4/2021 (Zero Coupon)	1,292,915	0.01
USD 2,900,000	Shinhan Financial Group Co Ltd FRN 13/8/2023 (Perpetual)	2,955,800	0.03
USD 1,900,000	Woori Bank 5.125% 6/8/2028	1,970,245	0.02
		12,588,773	0.13
スペイン			
EUR 600,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 18/2/2020 (Perpetual)	705,499	0.01
EUR 4,600,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 14/4/2021 (Perpetual)	5,915,140	0.06
EUR 2,600,000	Banco de Sabadell SA FRN 18/5/2022 (Perpetual)	2,797,300	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 (%)
スペイン(続き)			
EUR	300,000 Banco de Sabadell SA FRN 12/12/2028	343,085	0.00
EUR	3,800,000 Banco de Sabadell SA 5.625% 6/5/2026*	4,508,349	0.05
EUR	800,000 Banco Santander SA FRN 25/4/2022 (Perpetual)	975,982	0.01
EUR	1,600,000 Banco Santander SA FRN 19/3/2025 (Perpetual)	1,547,092	0.02
EUR	1,400,000 Bankia SA FRN 18/7/2022 (Perpetual)	1,566,958	0.02
EUR	2,600,000 Bankia SA FRN 19/9/2023 (Perpetual)*	2,922,082	0.03
EUR	600,000 Bankia SA FRN 22/5/2024	692,262	0.01
EUR	1,100,000 Bankia SA FRN 15/2/2029	1,261,873	0.01
EUR	400,000 Bilbao CLO I DAC FRN 20/7/2031	404,847	0.00
EUR	1,100,000 Bilbao CLO I DAC FRN 20/7/2031	1,209,639	0.01
EUR	6,200,000 CaixaBank SA FRN 13/6/2024 (Perpetual)	7,369,913	0.08
EUR	800,000 CaixaBank SA FRN 23/3/2026 (Perpetual)	796,641	0.01
EUR	200,000 CaixaBank SA FRN 14/7/2028	229,056	0.00
EUR	2,200,000 CaixaBank SA FRN 17/4/2030	2,355,875	0.02
EUR	800,000 CaixaBank SA 1.75% 24/10/2023	910,203	0.01
EUR	1,200,000 Distribuidora Internacional de Alimentacion SA 1% 28/4/2021*	1,012,788	0.01
EUR	1,200,000 El Corte Ingles SA 3% 15/3/2024	1,412,269	0.01
EUR	2,600,000 Hipercor SA 3.875% 19/1/2022	3,110,587	0.03
EUR	400,000 Mapfre SA FRN 7/9/2048*	469,864	0.01
EUR	188,833 NH Hotel Group SA 3.75% 1/10/2023	222,294	0.00
EUR	28,708,000 Spain Government Bond '144A' 1.4% 30/7/2028	33,380,353	0.34
EUR	900,000 SRF 2017-1 FT 'Series 2017-1 B' FRN 26/4/2063	1,040,531	0.01
EUR	200,000 SRF 2017-1 FT 'Series 2017-1 C' FRN 26/4/2063	230,371	0.00
EUR	400,000 SRF 2017-1 FT 'Series 2017-1 D' FRN 26/4/2063	459,067	0.00
USD	1,720,000 Telefonica Emisiones SA 5.52% 1/3/2049	1,716,328	0.02
EUR	402,000 Tendam Brands SAU 5% 15/9/2024*	459,089	0.01
		80,025,337	0.82
スリランカ			
LKR	1,951,000,000 Sri Lanka Government Bonds 11% 1/8/2021	10,865,678	0.11
LKR	828,000,000 Sri Lanka Government Bonds 11.6% 15/12/2023	4,688,484	0.05
USD	300,000 SriLankan Airlines Ltd 5.3% 27/6/2019	298,504	0.00
		15,852,666	0.16
スウェーデン			
EUR	200,000 Akelius Residential Property AB FRN 5/10/2078	230,311	0.00
EUR	1,034,000 Intrum AB 2.75% 15/7/2022*	1,159,264	0.01
EUR	120,000 Intrum AB 3.125% 15/7/2024*	132,069	0.00
USD	400,000 Swedbank AB FRN 17/3/2022 (Perpetual)	392,574	0.00
EUR	300,000 Telefonaktiebolaget LM Ericsson 1.875% 1/3/2024	339,701	0.00
EUR	2,008,000 Telia Co AB 4.75% 16/11/2021*	2,561,420	0.03
EUR	2,115,000 Verisure Holding AB 3.5% 15/5/2023*	2,472,825	0.03
EUR	1,217,000 Verisure Midholding AB 5.75% 1/12/2023	1,410,290	0.02
		8,698,454	0.09
スイス			
USD	3,425,000 Credit Suisse Group AG FRN 29/7/2022 (Perpetual)	3,540,217	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 (%)
	スイス(続き)		
USD	7,730,000 Credit Suisse Group AG '144A' FRN 17/7/2023 (Perpetual)*	7,929,705	0.08
USD	900,000 Credit Suisse Group AG '144A' FRN 11/12/2023 (Perpetual)	964,090	0.01
USD	2,500,000 Credit Suisse Group AG FRN 11/12/2023 (Perpetual)	2,678,028	0.03
USD	400,000 Credit Suisse Group AG FRN 18/12/2024 (Perpetual)*	399,500	0.00
USD	2,098,000 Credit Suisse Group AG '144A' FRN 18/12/2024 (Perpetual)	2,106,165	0.02
USD	1,300,000 Credit Suisse Group AG '144A' FRN 12/9/2025 (Perpetual)	1,301,332	0.01
EUR	1,025,000 UBS AG/London FRN 23/4/2021	1,172,878	0.01
USD	2,300,000 UBS Group Funding Switzerland AG FRN 19/2/2020 (Perpetual)	2,334,132	0.02
USD	400,000 UBS Group Funding Switzerland AG FRN 22/3/2021 (Perpetual)	412,634	0.00
USD	420,000 UBS Group Funding Switzerland AG FRN 10/8/2021 (Perpetual)	431,674	0.01
EUR	1,100,000 UBS Group Funding Switzerland AG FRN 19/2/2022 (Perpetual)	1,371,152	0.01
USD	503,000 UBS Group Funding Switzerland AG FRN 31/1/2023 (Perpetual)	438,571	0.01
USD	24,735,000 UBS Group Funding Switzerland AG '144A' FRN 31/1/2024 (Perpetual)*	25,038,004	0.26
USD	1,565,000 UBS Group Funding Switzerland AG FRN 19/2/2025 (Perpetual)	1,660,856	0.02
		51,778,938	0.53
	台湾		
USD	2,400,000 Hon Hai Precision Industry Co Ltd 6/11/2022 (Zero Coupon)	2,245,099	0.02
	タイ		
USD	2,800,000 PTTEP Treasury Center Co Ltd FRN 17/7/2022 (Perpetual)	2,733,500	0.03
USD	2,900,000 Singha Estate PCL 2% 20/7/2022	2,860,052	0.03
		5,593,552	0.06
	トルコ		
USD	9,224,000 Turkey Government International Bond 5.125% 17/2/2028	8,293,068	0.09
USD	1,593,234 Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust '144A' 4.2% 15/3/2027	1,357,881	0.01
		9,650,949	0.10
	英国		
GBP	200,000 Ardonagh Midco 3 Plc 8.375% 15/7/2023	229,142	0.00
GBP	563,000 Arqiva Broadcast Finance Plc 6.75% 30/9/2023	786,675	0.01
EUR	254,000 Arrow Global Finance Plc FRN 1/4/2025*	275,502	0.00
EUR	174,000 Arrow Global Finance Plc FRN 1/3/2026	191,636	0.00
GBP	3,265,000 Arrow Global Finance Plc 5.125% 15/9/2024*	4,174,918	0.04
EUR	435,000 Barclays Bank Plc 6.625% 30/3/2022	568,124	0.01
EUR	1,150,000 Barclays Plc FRN 11/11/2025	1,315,380	0.01
EUR	2,432,000 Barclays Plc 1.875% 23/3/2021	2,838,588	0.03
EUR	100,000 BAT International Finance Plc 4% 7/7/2020	119,779	0.00
EUR	170,000 Boparan Finance Plc 4.375% 15/7/2021*	145,838	0.00
GBP	125,084 Boparan Finance Plc 5.25% 15/7/2019*	164,301	0.00
GBP	496,000 Boparan Finance Plc 5.5% 15/7/2021*	494,232	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 271,000	Bracken MidCo1 Plc 8.875% 15/10/2023	342,917	0.00
GBP 1,000,000	Canary Wharf Finance II Plc FRN 22/10/2037	1,175,832	0.01
GBP 4,392,000	Canary Wharf Finance II Plc FRN 22/10/2037	5,122,015	0.05
GBP 131,950	Castell 2017-1 Plc 'Series 2017-1 X' FRN 25/10/2044	175,503	0.00
GBP 1,850,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	2,437,150	0.03
EUR 2,625,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	3,023,867	0.03
EUR 3,925,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	4,449,064	0.05
EUR 360,000	Coca-Cola European Partners Plc FRN 16/11/2021	409,958	0.00
EUR 360,000	Diageo Finance Plc 17/11/2020 (Zero Coupon)	410,200	0.00
GBP 1,417,405	Dignity Finance Plc 3.546% 31/12/2034	1,968,784	0.02
GBP 350,000	Dignity Finance Plc 4.696% 31/12/2049	408,527	0.00
EUR 613,000	EC Finance Plc 2.375% 15/11/2022	702,967	0.01
GBP 10,240,000	EI Group Plc 6% 6/10/2023	14,560,014	0.15
GBP 565,000	EI Group Plc 6.375% 15/2/2022	764,657	0.01
GBP 390,000	EI Group Plc 6.875% 15/2/2021	554,573	0.01
GBP 269,132	Eurosail 2006-4np Plc 'Series 2006-4X A3C' FRN 10/12/2044	354,507	0.00
GBP 2,093,836	Eurosail-UK 2007-4bl Plc 'Series 2007-4X A3' FRN 13/6/2045	2,758,942	0.03
GBP 997,564	Eurosail-UK 2007-4bl Plc 'Series 2007-4X A4' FRN 13/6/2045	1,289,864	0.01
EUR 400,000	Experian Finance Plc 4.75% 4/2/2020	475,537	0.01
GBP 1,325,000	Finsbury Square 2016-1 Plc 'Series 2016-1 B' FRN 16/2/2058	1,774,905	0.02
GBP 781,000	Finsbury Square 2016-2 Plc 'Series 2016-2 B' FRN 16/8/2058	1,044,466	0.01
GBP 967,000	Finsbury Square 2016-2 Plc 'Series 2016-2 C' FRN 16/8/2058	1,295,780	0.01
GBP 949,979	Finsbury Square 2017-1 Plc 'Series 2017-1 C' FRN 12/3/2059	1,270,619	0.01
GBP 1,385,970	Finsbury Square 2018-1 Plc FRN 12/9/2065	1,816,778	0.02
GBP 887,981	Finsbury Square 2018-1 Plc FRN 12/9/2065	1,160,722	0.01
GBP 1,297,972	Finsbury Square 2018-1 Plc FRN 12/9/2065	1,699,859	0.02
GBP 950,000	Finsbury Square 2018-2 Plc FRN 12/9/2068	1,259,786	0.01
GBP 5,981,000	Finsbury Square 2018-2 Plc FRN 12/9/2068	7,930,988	0.08
GBP 305,928	Gemgarto 2018-1 Plc FRN 16/9/2065	394,170	0.00
GBP 884,793	Gemgarto 2018-1 Plc FRN 16/9/2065	1,143,625	0.01
GBP 3,000,000	GKN Holdings Ltd 3.375% 12/5/2032	3,852,624	0.04
EUR 400,000	GlaxoSmithKline Capital Plc 12/9/2020 (Zero Coupon)	455,166	0.00
EUR 400,000	GlaxoSmithKline Capital Plc 0.625% 2/12/2019*	457,895	0.00
GBP 378,738	Gosforth Funding 2014-1 Plc 'Series 2014-1 A2' FRN 19/10/2056	503,643	0.01
GBP 5,390,000	Great Hall Mortgages No 1 Plc 'Series 2007-2X BA' FRN 18/6/2039	6,188,689	0.06
GBP 9,796,389	Greene King Finance Plc FRN 15/12/2033	13,000,947	0.13
GBP 2,875,000	Greene King Finance Plc 3.593% 15/3/2035	3,792,147	0.04
GBP 1,293,400	Greene King Finance Plc 4.064% 15/3/2035	1,817,265	0.02
GBP 3,220,000	Hawsmoor Mortgages 2016-1 Plc 'Series 2016-1 B' FRN 25/5/2053	4,297,354	0.04
USD 1,954,000	HSBC Holdings Plc FRN 1/6/2021 (Perpetual)	2,031,124	0.02
USD 400,000	HSBC Holdings Plc FRN 17/9/2024 (Perpetual)	402,630	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)		
USD	1,765,000 HSBC Holdings Plc FRN 30/3/2025 (Perpetual)	1,800,697	0.02
EUR	200,000 Imperial Brands Finance Plc 0.5% 27/7/2021	227,496	0.00
EUR	6,025,000 Imperial Brands Finance Plc 2.125% 12/2/2027	6,770,402	0.07
EUR	561,000 INEOS Finance Plc 4% 1/5/2023	648,963	0.01
EUR	449,000 International Game Technology Plc 3.5% 15/7/2024*	525,807	0.01
EUR	800,000 International Game Technology Plc 4.75% 15/2/2023	994,091	0.01
USD	1,229,000 International Game Technology Plc '144A' 6.25% 15/2/2022	1,299,667	0.01
GBP	490,000 Iron Mountain UK Plc 3.875% 15/11/2025	626,036	0.01
GBP	994,000 Jerrold Finco Plc 6.125% 15/1/2024	1,310,188	0.01
GBP	1,342,000 Jerrold Finco Plc 6.25% 15/9/2021	1,797,086	0.02
EUR	2,067,375 Kensington Mortgage Securities Plc 'Series 2007-1X A3B' FRN 14/6/2040	2,307,205	0.02
GBP	200,000 Ladbroke Group Finance Plc 5.125% 16/9/2022	281,351	0.00
GBP	1,050,000 Ladbroke Group Finance Plc 5.125% 8/9/2023	1,441,600	0.02
EUR	296,000 Leeds Building Society 2.625% 1/4/2021	347,973	0.00
EUR	8,321,000 Lloyds Bank Plc 1% 19/11/2021	9,660,180	0.10
USD	300,000 Lloyds Banking Group Plc '144A' FRN 1/10/2035 (Perpetual)	299,250	0.00
USD	87,000 Lloyds Banking Group Plc FRN 21/5/2037 (Perpetual)	87,652	0.00
USD	513,000 Lloyds Banking Group Plc '144A' FRN 21/5/2037 (Perpetual)*	516,847	0.01
USD	2,490,000 Lloyds Banking Group Plc 3.75% 11/1/2027	2,405,130	0.02
USD	3,325,000 Lloyds Banking Group Plc 4.55% 16/8/2028	3,366,172	0.03
EUR	840,445 Ludgate Funding Plc 'Series 2007-1 BB' FRN 1/1/2061	845,906	0.01
EUR	720,381 Ludgate Funding Plc 'Series 2007-1 MB' FRN 1/1/2061	725,723	0.01
GBP	1,555,000 Mitchells & Butlers Finance Plc FRN 15/6/2036	1,493,785	0.02
GBP	2,137,000 Motor 2016-1 PLC 3.75% 25/11/2025	2,864,172	0.03
GBP	426,000 Motor 2016-1 PLC 4.25% 25/11/2025	569,036	0.01
GBP	355,000 Motor 2016-1 PLC 5.25% 25/11/2025	468,992	0.01
USD	1,000,000 National Westminster Bank Plc FRN 28/5/2019 (Perpetual)	785,080	0.01
GBP	29,213 Nationwide Building Society FRN 20/6/2019 (Perpetual)	5,575,447	0.06
USD	1,400,000 Neptune Energy Bondco Plc '144A' 6.625% 15/5/2025	1,372,000	0.01
GBP	2,200,000 Newday Funding 2017-1 Plc 'Series 2017-1 C' FRN 15/7/2025	2,937,689	0.03
GBP	1,750,000 Newday Funding 2017-1 Plc 'Series 2017-1 D' FRN 15/7/2025	2,344,945	0.02
EUR	1,159,854 Newgate Funding Plc 'Series 2006-1 BB' FRN 1/12/2050	1,200,958	0.01
EUR	300,000 Nomad Foods Bondco Plc 3.25% 15/5/2024	349,594	0.00
EUR	402,000 OTE Plc 3.5% 9/7/2020	476,016	0.01
EUR	101,600 Paragon Mortgages No 10 Plc FRN 15/6/2041	108,497	0.00
EUR	370,151 Paragon Mortgages No 11 Plc FRN 15/10/2041	391,414	0.00
EUR	453,011 Paragon Mortgages No 12 Plc FRN 15/11/2038	475,516	0.01
EUR	1,165,000 Paragon Mortgages No 13 Plc FRN 15/1/2039	1,211,953	0.01
EUR	2,795,000 Paragon Mortgages No 14 Plc FRN 15/9/2039	2,628,362	0.03
EUR	505,167 Paragon Mortgages NO 23 Plc FRN 15/1/2043	575,443	0.01
GBP	545,541 Paragon Mortgages NO 23 Plc FRN 15/1/2043	726,534	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	1,175,000 Paragon Mortgages NO 23 Plc 'C' FRN 15/1/2043	1,567,872	0.02
GBP	2,635,000 Paragon Mortgages No 25 Plc 'B' FRN 15/5/2050	3,404,443	0.04
GBP	2,100,000 Paragon Mortgages No 25 Plc 'C' FRN 15/5/2050	2,692,970	0.03
GBP	282,000 PCL Funding II Plc 'Series 2017-1 B' FRN 15/6/2022	375,990	0.00
GBP	179,000 PCL Funding II Plc 'Series 2017-1 C' FRN 15/6/2022	239,224	0.00
GBP	470,000 PCL Funding III Plc 'Series 2017-2 C' FRN 15/6/2023	604,907	0.01
GBP	1,062,000 PCL Funding III PLC FRN 15/6/2023	1,378,968	0.01
GBP	2,473,000 Pinnacle Bidco Plc 6.375% 15/2/2025*	3,344,149	0.03
GBP	99,730 Precise Mortgage Funding 2014-1 Plc 'Series 2014-1 A' FRN 12/9/2047	132,726	0.00
GBP	200,000 Premier Foods Finance Plc 6.25% 15/10/2023	270,494	0.00
EUR	100,000 Rentokil Initial Plc 3.25% 7/10/2021	121,552	0.00
GBP	799,000 Residential Mortgage Securities 29 Plc FRN 20/12/2046	1,056,255	0.01
GBP	2,981,000 Residential Mortgage Securities 29 Plc 'B' FRN 20/12/2046	3,950,084	0.04
GBP	180,000 Residential Mortgage Securities 30 PLC FRN 20/3/2050	237,229	0.00
GBP	1,070,000 Residential Mortgage Securities 31 PLC FRN 20/9/2065	1,421,819	0.01
GBP	1,480,000 Ripon Mortgages Plc FRN 20/8/2056	1,965,139	0.02
GBP	15,000,000 Ripon Mortgages Plc FRN 20/8/2056	19,917,944	0.20
GBP	420,000 RMAC NO 2 Plc 'Series 2018-2 C' FRN 12/6/2046	550,252	0.01
EUR	64,992 RMAC Securities No 1 Plc 'Series 2006-NS1X M1C' FRN 12/6/2044	67,898	0.00
EUR	954,311 RMAC Securities No 1 Plc 'Series 2007-NS1X M1C' FRN 12/6/2044	1,026,472	0.01
USD	1,400,000 Royal Bank of Scotland Group Plc FRN 15/8/2021 (Perpetual)	1,496,250	0.02
USD	1,535,000 Royal Bank of Scotland Group Plc FRN 18/5/2029	1,552,717	0.02
GBP	300,000 Santander UK Group Holdings Plc FRN 24/6/2022 (Perpetual)	412,347	0.00
USD	2,901,000 Santander UK Plc '144A' 5% 7/11/2023	2,926,186	0.03
GBP	1,600,000 Shop Direct Funding Plc 7.75% 15/11/2022	1,910,859	0.02
GBP	475,000 Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2028	662,555	0.01
GBP	4,567,000 Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2031	5,968,193	0.06
GBP	209,000 Stanlington No 1 Plc 'Series 2017-1 E' FRN 12/6/2046	283,991	0.00
GBP	1,157,000 Stonegate Pub Co Financing Plc FRN 15/3/2022	1,550,505	0.02
GBP	525,000 Stonegate Pub Co Financing Plc 4.875% 15/3/2022*	686,680	0.01
EUR	502,000 Synlab Bondco Plc 6.25% 1/7/2022	594,691	0.01
EUR	283,000 Synlab Unsecured Bondco Plc 8.25% 1/7/2023	344,290	0.00
GBP	3,641,938 Taurus 2017-2 UK DAC 'Series 2017-UK2 B' FRN 17/11/2027	4,774,850	0.05
GBP	1,741,883 Taurus 2017-2 UK DAC 'Series 2017-UK2 C' FRN 17/11/2027	2,268,563	0.02
EUR	800,000 Tesco Corporate Treasury Services Plc 1.375% 24/10/2023	905,608	0.01
GBP	200,000 Tesco Plc 5% 24/3/2023	289,722	0.00
EUR	200,000 Tesco Plc 5.125% 10/4/2047	267,153	0.00
GBP	920,067 Tesco Property Finance 1 Plc 7.623% 13/7/2039	1,656,502	0.02
GBP	2,152,818 Tesco Property Finance 3 Plc 5.744% 13/4/2040	3,366,721	0.03
GBP	975,295 Tesco Property Finance 4 Plc 5.801% 13/10/2040	1,534,286	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 (%)	
英国(続き)				
GBP	360,000	Trinity Square 2015-1 Plc 'Series 2015-1X B' FRN 15/7/2051	481,946	0.01
GBP	1,270,000	Turbo Finance 8 PLC FRN 20/2/2026	1,675,666	0.02
GBP	3,063,552	Unique Pub Finance Co Plc/The 5.659% 30/6/2027	4,434,428	0.05
GBP	4,570,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.464% 30/3/2032	5,873,393	0.06
GBP	2,250,240	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.542% 30/3/2021	3,155,925	0.03
GBP	1,084,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28/3/2024	1,589,562	0.02
USD	2,300,000	Vedanta Resources Plc 6.375% 30/7/2022	2,173,500	0.02
USD	300,000	Virgin Media Finance Plc '144A' 5.75% 15/1/2025	298,935	0.00
GBP	1,550,000	Virgin Media Finance Plc 6.375% 15/10/2024*	2,147,403	0.02
GBP	432,000	Virgin Media Secured Finance Plc 4.875% 15/1/2027*	565,402	0.01
GBP	770,000	Virgin Media Secured Finance Plc 5% 15/4/2027*	1,020,987	0.01
GBP	100,000	Virgin Media Secured Finance Plc 5.125% 15/1/2025	135,913	0.00
GBP	648,000	Virgin Media Secured Finance Plc 5.5% 15/1/2025	883,188	0.01
GBP	2,154,000	Virgin Media Secured Finance Plc 6.25% 28/3/2029	3,003,363	0.03
GBP	600,000	Vodafone Group Plc 26/11/2020 (Zero Coupon)	774,547	0.01
EUR	450,000	Vodafone Group Plc FRN 3/10/2078	493,338	0.01
USD	2,300,000	Vodafone Group Plc FRN 3/10/2078	2,222,375	0.02
GBP	150,000	Vodafone Group Plc FRN 3/10/2078	193,200	0.00
USD	3,487,000	Vodafone Group Plc 3.75% 16/1/2024	3,475,268	0.04
GBP	510,000	Vue International Bidco Plc 7.875% 15/7/2020*	678,392	0.01
GBP	5,241,697	Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc 'A' FRN 21/9/2049	6,980,752	0.07
GBP	6,200,000	Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc 'B' FRN 21/9/2049	8,229,201	0.08
GBP	3,700,000	Warwick Finance Residential Mortgages No Two Plc FRN 21/9/2049	4,923,567	0.05
GBP	4,795,000	Westfield Stratford City Finance Plc FRN 4/11/2019	6,395,844	0.07
			314,706,181	3.21
米国				
USD	992,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 'Series 2017-245P E' '144A' FRN 5/6/2037	924,595	0.01
USD	7,000,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 'Series 2017-245P XA' '144A' FRN 5/6/2037	102,585	0.00
USD	4,875,000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 'Series 2017-280P E' '144A' FRN 15/9/2034	4,883,970	0.05
USD	3,587,993	A Voce CLO Ltd 'Series 2014-1A A1R' '144A' FRN 15/7/2026	3,589,593	0.04
USD	5,254,000	Abbott Laboratories 3.75% 30/11/2026	5,340,880	0.05
USD	4,320,000	AbbVie Inc 2.9% 6/11/2022	4,256,944	0.04
USD	8,265,000	AbbVie Inc 3.75% 14/11/2023	8,331,459	0.09
USD	15,803,000	AbbVie Inc 4.25% 14/11/2028	15,639,842	0.16
USD	320,000	AbbVie Inc 4.45% 14/5/2046	281,046	0.00
USD	4,440,000	Accredited Mortgage Loan Trust 2006-1 'Series 2006-1 M2' FRN 25/4/2036	2,287,397	0.02
USD	1,268,227	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series '2003-MH1 B2' '144A' 15/8/2030 (Zero Coupon)	956,555	0.01
USD	2,377,985	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 2007-HE4 'Series 2007-HE4 A2A' FRN 25/5/2037	675,377	0.01
USD	2,781,000	ACIS CLO 2014-4 Ltd 'Series 2014-4A A' '144A' FRN 1/5/2026	2,781,664	0.03
USD	1,786,443	Adams Mill CLO Ltd 'Series 2014-1A A2R' '144A' FRN 15/7/2026	1,782,399	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	1,154,000	AHS Hospital Corp 5.024% 1/7/2045	1,274,336	0.01
USD	250,000	AIMCO CLO Series 2014-A 'Series 2014-AA DR' '144A' ' FRN 20/7/2026	248,846	0.00
USD	9,855,817	Ajax Mortgage Loan Trust 2017-D 'Series 2017-D A' ' '144A' FRN 25/12/2057	9,871,304	0.10
USD	1,708,271	Ajax Mortgage Loan Trust 2017-D 'Series 2017-D B' ' '144A' FRN 25/12/2057	768,722	0.01
USD	2,600,800	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-A 'Series 2018-A B' ' '144A' FRN 25/4/2058	1,430,440	0.01
USD	7,341,300	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-A 'Series 2018-A A' ' '144A' 3.85% 25/4/2058	7,228,514	0.07
USD	1,348,572	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-B 'Series 2018-B B' ' '144A' 26/2/2057 (Zero Coupon)	377,600	0.00
USD	6,469,968	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-B 'Series 2018-B A' ' '144A' 3.75% 26/2/2057	6,483,058	0.07
USD	4,882,209	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-E FRN 25/6/2058	4,886,091	0.05
USD	17,107,914	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-F 'Series 2018-F A' ' '144A' FRN 25/11/2058	17,281,848	0.18
USD	330,000	Allegro CLO I Ltd 'Series 2013-1A C' '144A' FRN 30/1/2026	330,384	0.00
USD	810,000	Allegro CLO II-S Ltd 'Series 2014-1RA B' '144A' FRN 21/10/2028	800,422	0.01
USD	2,270,000	Allegro CLO II-S Ltd 'Series 2014-1RA C' '144A' FRN 21/10/2028	2,221,680	0.02
USD	250,000	Allegro CLO IV Ltd 'Series 2016-1A D' '144A' FRN 15/1/2029	250,876	0.00
USD	250,000	Allegro CLO VI Ltd 'Series 2017-2A A' '144A' FRN 17/1/2031	247,887	0.00
USD	2,080,000	ALM V Ltd 'Series 2012-5A A1R3' '144A' FRN 18/10/2027	2,070,048	0.02
USD	1,700,000	ALM V Ltd 'Series 2012-5A BR3' '144A' FRN 18/10/2027	1,666,131	0.02
USD	811,000	ALM VI Ltd 'Series 2012-6A A2R3' '144A' FRN 15/7/2026	801,951	0.01
USD	2,620,000	ALM VI Ltd 'Series 2012-6A CR3' '144A' FRN 15/7/2026	2,549,690	0.03
USD	3,100,000	ALM VI Ltd 'Series 2012-6A DR3' '144A' FRN 15/7/2026	2,949,814	0.03
USD	5,070,000	ALM VII Ltd 'Series 2012-7A A1R' '144A' FRN 15/10/2028	5,076,868	0.05
USD	6,275,000	ALM VII Ltd 'Series 2012-7A SUB' '144A' FRN 15/10/2028	2,977,845	0.03
USD	1,440,000	ALM XII Ltd 'Series 2015-12A A1R2' '144A' FRN 16/4/2027	1,434,351	0.01
USD	1,293,000	ALM XII Ltd 'Series 2015-12A BR2' '144A' FRN 16/4/2027	1,274,508	0.01
USD	950,000	ALM XII Ltd 'Series 2015-12A C1R2' '144A' FRN 16/4/2027	914,549	0.01
USD	460,000	ALM XII Ltd 'Series 2015-12A C2R2' '144A' FRN 16/4/2027	444,319	0.00
USD	3,051,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC FRN 15/7/2027	3,031,683	0.03
USD	2,250,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC '144A' FRN 15/7/2027	2,208,835	0.02
USD	340,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC FRN 15/7/2027	325,735	0.00
USD	1,309,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC 'Series 2015-16A BR2' ' '144A' FRN 15/7/2027	1,296,048	0.01
USD	900,000	ALM XVII Ltd 'Series 2015-17A A1AR' '144A' FRN 15/1/2028	894,589	0.01
USD	800,000	ALM XVII Ltd 'Series 2015-17A BR' '144A' FRN 15/1/2028	800,768	0.01
USD	720,000	ALM XVII Ltd 'Series 2015-17A CR' '144A' FRN 15/1/2028	706,545	0.01
USD	620,000	ALM XVIII Ltd 'Series 2016-18A A2R' '144A' FRN 15/1/2028	619,572	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	3,383,132	Alternative Loan Trust 2005-22T1 ' Series 2005-22T1 A1 ' FRN 25/6/2035	3,041,731	0.03
USD	3,153,492	Alternative Loan Trust 2005-72 ' Series 2005-72 A3 ' FRN 25/1/2036	2,700,512	0.03
USD	1,068,724	Alternative Loan Trust 2005-76 ' Series 2005-76 2A1 ' FRN 25/2/2036	985,404	0.01
USD	3,223,500	Alternative Loan Trust 2005-J4 ' Series 2005-J4 B1 ' FRN 25/7/2035	3,272,457	0.03
USD	4,931,208	Alternative Loan Trust 2006-11CB ' Series 2006-11CB 3A1 ' 6.5% 25/5/2036	3,863,867	0.04
USD	1,360,273	Alternative Loan Trust 2006-15CB ' Series 2006-15CB A1 ' 6.5% 25/6/2036	1,029,894	0.01
USD	2,017,850	Alternative Loan Trust 2006-23CB ' Series 2006-23CB 2A5 ' FRN 25/8/2036	764,493	0.01
USD	1,165,354	Alternative Loan Trust 2006-J7 ' Series 2006-J7 2A1 ' FRN 20/11/2046	885,551	0.01
USD	818,911	Alternative Loan Trust 2006-0A11 ' Series 2006-0A11 A4 ' FRN 25/9/2046	742,164	0.01
USD	5,164,068	Alternative Loan Trust 2006-0A14 ' Series 2006-0A14 1A1 ' FRN 25/11/2046	4,504,353	0.05
USD	3,451,673	Alternative Loan Trust 2006-0A16 ' Series 2006-0A16 A4C ' FRN 25/10/2046	2,301,316	0.02
USD	2,557,431	Alternative Loan Trust 2006-0A6 ' Series 2006-0A6 1A2 ' FRN 25/7/2046	2,385,176	0.02
USD	687,676	Alternative Loan Trust 2006-0A8 ' Series 2006-0A8 1A1 ' FRN 25/7/2046	663,687	0.01
USD	1,494,609	Alternative Loan Trust 2006-0C10 ' Series 2006-0C10 2A3 ' FRN 25/11/2036	1,185,281	0.01
USD	6,004,761	Alternative Loan Trust 2006-0C7 ' Series 2006-0C7 2A3 ' FRN 25/7/2046	4,782,745	0.05
USD	4,458,748	Alternative Loan Trust 2007-25 ' Series 2007-25 1A3 ' 6.5% 25/11/2037	3,277,210	0.03
USD	7,494,353	Alternative Loan Trust 2007-3T1 ' Series 2007-3T1 1A1 ' 6% 25/4/2037	5,362,602	0.05
USD	4,267,085	Alternative Loan Trust 2007-9T1 ' Series 2007-9T1 1A1 ' 6% 25/5/2037	3,036,272	0.03
USD	1,482,013	Alternative Loan Trust 2007-0A3 ' Series 2007-0A3 1A1 ' FRN 25/4/2047	1,409,574	0.01
USD	196,465	Alternative Loan Trust 2007-0A3 ' Series 2007-0A3 2A2 ' FRN 25/4/2047	31,717	0.00
USD	371,038	Alternative Loan Trust 2007-0A8 ' Series 2007-0A8 2A1 ' FRN 25/6/2047	288,701	0.00
USD	534,182	Alternative Loan Trust 2007-0H2 ' Series 2007-0H2 A2A ' FRN 25/8/2047	409,421	0.00
USD	8,651,000	Altria Group Inc 2.85% 9/8/2022	8,511,324	0.09
USD	2,922,000	Altria Group Inc 3.8% 14/2/2024	2,924,442	0.03
USD	4,320,000	Altria Group Inc 4% 31/1/2024	4,373,526	0.04
USD	2,998,000	Altria Group Inc 4.4% 14/2/2026	3,019,749	0.03
USD	6,115,000	Altria Group Inc 4.8% 14/2/2029	6,089,742	0.06
USD	3,540,000	Altria Group Inc 5.95% 14/2/2049	3,508,956	0.04
USD	6,380,000	Altria Group Inc 6.2% 14/2/2059	6,340,390	0.06
USD	9,370,000	Amazon.com Inc 3.15% 22/8/2027	9,255,659	0.09
USD	2,980,000	Amazon.com Inc 4.05% 22/8/2047	2,989,237	0.03
USD	671,973	Ambac Assurance Corp ' 144A ' 5.1% 7/6/2020	915,564	0.01
GBP	100,000	AMC Entertainment Holdings Inc 6.375% 15/11/2024	125,608	0.00
USD	2,363,000	American Airlines Group Inc ' 144A ' 4.625% 1/3/2020	2,389,584	0.02
USD	280,000	American Airlines Group Inc ' 144A ' 5.5% 1/10/2019	283,850	0.00
USD	10,525,000	American Express Co 3.4% 22/2/2024*	10,542,089	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	1,190,861	American Home Mortgage Assets Trust 2006-3 'Series 2006-3 2A11' FRN 25/10/2046	1,053,471	0.01
USD	2,641,653	American Home Mortgage Assets Trust 2006-4 'Series 2006-4 1A12' FRN 25/10/2046	1,908,874	0.02
USD	4,101,162	American Home Mortgage Assets Trust 2006-5 'Series 2006-5 A1' FRN 25/11/2046	2,099,647	0.02
USD	779,473	American Home Mortgage Assets Trust 2007-1 'Series 2007-1 A1' FRN 25/2/2047	485,599	0.01
USD	1,876,000	American Homes 4 Rent 2014-SFR2 Trust 'Series 2014-SFR2 E' '144A' 6.231% 17/10/2036	2,050,915	0.02
USD	5,180,650	American Homes 4 Rent 2015-SFR1 'Series 2015-SFR1 XS' '144A' FRN 17/4/2052	52	0.00
USD	725,000	American Municipal Power Inc 6.449% 15/2/2044	946,741	0.01
USD	1,345,000	American Municipal Power Inc 7.834% 15/2/2041	1,969,262	0.02
USD	4,195,000	American Tower Corp 5% 15/2/2024	4,465,750	0.05
USD	550,000	Americold 2010 LLC 'Series 2010-ARTA C' '144A' 6.811% 14/1/2029	580,165	0.01
USD	260,000	Ammc Clo 19 Ltd 'Series 2016-19A C' '144A' FRN 15/10/2028	261,289	0.00
USD	750,000	Ammc Clo 20 Ltd 'Series 2017-20A E' '144A' FRN 17/4/2029	709,124	0.01
USD	530,000	AMMC CLO 21 Ltd 'Series 2017-21A A' '144A' FRN 2/11/2030	528,611	0.01
USD	1,675,000	AMMC CLO XII Ltd 'Series 2013-12A AR' '144A' FRN 10/11/2030	1,666,534	0.02
USD	3,100,000	AMMC CLO XIII Ltd 'Series 2013-13A A1LR' '144A' FRN 24/7/2029	3,098,619	0.03
USD	3,050,000	AMMC CLO XIV Ltd 'Series 2014-14A A1LR' '144A' FRN 25/7/2029	3,047,312	0.03
USD	2,011,417	Amortizing Residential Collateral Trust 2002-BC8 'Series 2002-BC8 A1' FRN 25/11/2032	1,981,548	0.02
USD	2,350,000	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R Ltd 'Series 2018-1RA A1' '144A' FRN 13/4/2031	2,313,272	0.02
USD	1,560,000	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R Ltd 'Series 2018-1RA SUB' '144A' FRN 13/4/2031	1,304,079	0.01
USD	840,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A A1R' '144A' FRN 13/10/2030	837,867	0.01
USD	340,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A BR' '144A' FRN 13/10/2030	334,521	0.00
USD	417,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A CR' '144A' FRN 13/10/2030	412,097	0.00
USD	1,040,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A DR' '144A' FRN 13/10/2030	1,037,011	0.01
USD	1,050,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd 'Series 2014-3RA A' '144A' FRN 28/1/2031	1,041,836	0.01
USD	1,650,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd 'Series 2014-3RA B' '144A' FRN 28/1/2031	1,622,942	0.02
USD	1,000,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd 'Series 2014-3RA D' '144A' FRN 28/1/2031	951,233	0.01
USD	1,560,000	Anchorage Capital CLO 4-R Ltd 'Series 2014-4RA A' '144A' FRN 28/1/2031	1,547,840	0.02
USD	1,830,000	Anchorage Capital CLO 4-R Ltd 'Series 2014-4RA C' '144A' FRN 28/1/2031	1,759,031	0.02
USD	640,000	Anchorage Capital CLO 4-R Ltd 'Series 2014-4RA D' '144A' FRN 28/1/2031	611,734	0.01
USD	5,475,000	Anchorage Capital CLO 5-R Ltd 'Series 2014-5RA B' '144A' FRN 15/1/2030	5,410,267	0.06
USD	1,300,000	Anchorage Capital CLO 5-R Ltd 'Series 2014-5RA C' '144A' FRN 15/1/2030	1,262,488	0.01
USD	1,720,000	Anchorage Capital CLO 5-R Ltd 'Series 2014-5RA E' '144A' FRN 15/1/2030	1,611,761	0.02
USD	1,570,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd 'Series 2015-6A AR' '144A' FRN 15/7/2030	1,569,616	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 590,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd 'Series 2015-6A DR' '144A' FRN 15/7/2030	585,210	0.01
USD 12,950,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd 'Series 2015-7A AR' '144A' FRN 15/10/2027	12,885,929	0.13
USD 1,500,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd 'Series 2015-7A B1R' '144A' FRN 15/10/2027	1,477,317	0.02
USD 3,328,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd 'Series 2015-7A CR' '144A' FRN 15/10/2027	3,249,285	0.03
USD 2,915,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd 'Series 2015-7A DR' '144A' FRN 15/10/2027	2,854,517	0.03
USD 2,250,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd 'Series 2015-7A ER' '144A' FRN 15/10/2027	2,217,349	0.02
USD 1,150,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd 'Series 2016-8A AR' '144A' FRN 28/7/2028	1,142,988	0.01
USD 2,520,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd 'Series 2016-8A BR' '144A' FRN 28/7/2028	2,507,836	0.03
USD 5,810,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd 'Series 2016-8A CR' '144A' FRN 28/7/2028	5,712,836	0.06
USD 1,850,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd 'Series 2016-8A DR' '144A' FRN 28/7/2028	1,830,113	0.02
USD 4,030,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd 'Series 2016-8A ER' '144A' FRN 28/7/2028	3,879,464	0.04
USD 640,000	Anchorage Capital CLO 9 Ltd 'Series 2016-9A D' '144A' FRN 15/1/2029	638,069	0.01
USD 590,000	Anchorage Capital CLO 9 Ltd 'Series 2016-9A E' '144A' FRN 15/1/2029	585,430	0.01
EUR 280,000	Anchorage Capital Europe CLO 2 DAC FRN 15/5/2031	300,202	0.00
USD 3,162,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 5.25% 15/1/2025	3,223,488	0.03
USD 8,721,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 5.5% 15/10/2019	8,804,443	0.09
USD 3,538,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 6.25% 15/10/2022	3,645,024	0.04
USD 190,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 6.375% 1/5/2024	199,737	0.00
USD 9,340,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.15% 23/1/2025*	9,619,642	0.10
USD 12,817,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.75% 23/1/2029	13,261,717	0.14
USD 6,775,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 5.55% 23/1/2049	7,063,110	0.07
USD 1,797,000	Antero Resources Corp 5% 1/3/2025*	1,734,105	0.02
USD 2,663,000	Antero Resources Corp 5.125% 1/12/2022	2,672,986	0.03
USD 5,899,000	Antero Resources Corp 5.375% 1/11/2021	5,965,364	0.06
USD 2,131,000	Antero Resources Corp 5.625% 1/6/2023	2,144,319	0.02
USD 3,320,000	Aon Corp 4.5% 15/12/2028	3,437,562	0.04
USD 1,134,000	Apidos CLO XII 'Series 2013-12A AR' '144A' FRN 15/4/2031	1,124,921	0.01
USD 1,290,000	Apidos CLO XV 'Series 2013-15A A1RR' '144A' FRN 20/4/2031	1,274,966	0.01
USD 1,120,000	Apidos CLO XV 'Series 2013-15A ERR' '144A' FRN 20/4/2031	1,060,902	0.01
USD 475,000	Apidos CLO XVI 'Series 2013-16A CR' '144A' FRN 19/1/2025	475,646	0.01
USD 1,800,000	Apidos CLO XVIII 'Series 2018-18A E' '144A' FRN 22/10/2030	1,696,119	0.02
USD 500,000	Apidos CLO XXI 'Series 2015-21A CR' '144A' FRN 18/7/2027	478,823	0.01
USD 380,000	Apidos CLO XXII 'Series 2015-22A D' '144A' FRN 20/10/2027	380,920	0.00
USD 1,070,000	Apidos CLO XXIII 'Series 2015-23A D2' '144A' FRN 15/1/2027	1,061,994	0.01
USD 640,000	Apidos CLO XXIX 'Series 2018-29A D' '144A' FRN 25/7/2030	588,572	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 4,320,000	Apple Inc 2.4% 3/5/2023	4,245,731	0.04
USD 7,740,000	Apple Inc 2.45% 4/8/2026	7,345,269	0.08
USD 10,315,000	Apple Inc 2.85% 11/5/2024	10,259,318	0.10
USD 2,160,000	Apple Inc 3.85% 4/5/2043	2,097,399	0.02
USD 3,240,000	Apple Inc 4.5% 23/2/2036	3,489,098	0.04
USD 6,180,053	APS Resecuritization Trust 2016-1 'Series 2016-1 1MZ' '144A' FRN 31/7/2057	1,973,062	0.02
USD 5,533,158	APS Resecuritization Trust 2016-3 'Series 2016-3 3A' '144A' FRN 27/9/2046	5,769,731	0.06
USD 1,309,467	APS Resecuritization Trust 2016-3 'Series 2016-3 4A' '144A' FRN 27/4/2047	1,344,769	0.01
USD 3,460,000	Arbor Realty Collateralized Loan Obligation 2017-FL3 Ltd 'Series 2017-FL3 A' '144A' FRN 15/12/2027	3,457,639	0.04
USD 3,160,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2016-FL1 Ltd 'Series 2016-FL1A A' '144A' FRN 15/9/2026	3,187,581	0.03
USD 1,330,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2017-FL2 Ltd 'Series 2017-FL2 A' '144A' FRN 15/8/2027	1,325,096	0.01
USD 280,000	Arconic Inc 5.4% 15/4/2021	288,778	0.00
USD 1,520,000	Arconic Inc 5.87% 23/2/2022	1,599,800	0.02
USD 7,540,000	Arconic Inc 5.9% 1/2/2027	7,521,150	0.08
USD 4,004,000	Arconic Inc 6.15% 15/8/2020	4,149,145	0.04
USD 663,388	AREIT 2018-CRE1 Trust 'Series 2018-CRE1 A' '144A' FRN 14/2/2035	659,671	0.01
USD 3,033,000	Ares Capital Corp 4.25% 1/3/2025	2,879,539	0.03
USD 400,000	Ares XLI Clo Ltd 'Series 2016-41A D' '144A' FRN 15/1/2029	401,979	0.00
USD 200,000	ARES XLIV CLO Ltd 'Series 2017-44A D' '144A' FRN 15/10/2029	195,421	0.00
USD 375,000	ARES XLV CLO Ltd 'Series 2017-45A C' '144A' FRN 15/10/2030	367,515	0.00
USD 380,000	Ares XXXIII CLO Ltd 'Series 2015-1A A2R' '144A' FRN 5/12/2025	380,817	0.00
USD 250,000	Ares XXXIII CLO Ltd 'Series 2015-1A B2R' '144A' FRN 5/12/2025	250,122	0.00
USD 1,125,000	Ares XXXIII CLO Ltd 'Series 2015-1A CR' '144A' FRN 5/12/2025	1,126,712	0.01
USD 800,000	Ares XXXIII CLO Ltd 'Series 2015-1A D' '144A' FRN 5/12/2025	805,406	0.01
USD 840,000	Ares XXXIX CLO Ltd 'Series 2016-39A E' '144A' FRN 18/7/2028	846,953	0.01
USD 1,500,000	Ares XXXVII CLO Ltd 'Series 2015-4A A1R' '144A' FRN 15/10/2030	1,495,900	0.02
USD 2,195,000	Ares XXXVII CLO Ltd 'Series 2015-4A DR' '144A' FRN 15/10/2030	2,106,040	0.02
USD 4,949,201	Argent Mortgage Loan Trust 2005-W1 'Series 2005-W1 A2' FRN 25/5/2035	4,669,093	0.05
USD 2,800,000	ARI Investments LLC 6/1/2025 (Zero Coupon)	2,800,000	0.03
USD 1,905,000	Arizona Health Facilities Authority FRN 1/1/2037	1,825,790	0.02
USD 1,060,000	Arizona State University 5% 1/7/2043	1,210,700	0.01
USD 3,210,000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF 'Series 2018-ASHF D' '144A' FRN 15/4/2035	3,205,792	0.03
USD 896,000	Ashtead Capital Inc '144A' 4.125% 15/8/2025	873,600	0.01
USD 250,000	Ashtead Capital Inc '144A' 4.375% 15/8/2027	241,562	0.00
USD 300,000	Ashtead Capital Inc '144A' 5.25% 1/8/2026	305,250	0.00
USD 1,788,000	Ashtead Capital Inc '144A' 5.625% 1/10/2024	1,852,815	0.02
USD 822,000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 6.75% 1/8/2025	744,157	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	4,832,000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co ' 144A ' 6.875% 15/2/2021	4,662,880	0.05
USD	126,413	Asset Securitization Corp ' Series 1997-D5 B2 ' 6.93% 14/2/2043	126,821	0.00
USD	370,000	ASSURANT CLO III Ltd ' Series 2018-2A C ' ' 144A ' FRN 20/10/2031	363,674	0.00
EUR	2,200,000	AT&T Inc FRN 3/8/2020	2,505,614	0.03
USD	5,910,000	AT&T Inc FRN 12/6/2024	5,847,018	0.06
USD	4,320,000	AT&T Inc 3% 30/6/2022	4,289,208	0.04
USD	9,041,000	AT&T Inc 3.4% 15/5/2025	8,808,179	0.09
USD	2,770,000	AT&T Inc 4.125% 17/2/2026	2,777,543	0.03
USD	23,700,000	AT&T Inc 4.35% 1/3/2029	23,636,088	0.24
USD	820,000	Atlas Senior Loan Fund IV Ltd ' Series 2013-2A A2RR ' ' 144A ' FRN 17/2/2026	812,402	0.01
USD	2,880,000	Atmos Energy Corp 4.125% 15/3/2049	2,850,875	0.03
USD	4,410,000	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM ' Series 2017-ATRM D ' ' 144A ' FRN 15/12/2036	4,390,221	0.04
USD	1,350,000	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM ' Series 2017-ATRM E ' ' 144A ' FRN 15/12/2036	1,344,728	0.01
USD	1,490,000	Atrium Hotel Portfolio Trust 2018-ATRM ' Series 2018-ATRM E ' ' 144A ' FRN 15/6/2035	1,499,324	0.02
USD	1,710,000	Atrium VIII ' 144A ' FRN 23/10/2024	1,712,074	0.02
USD	1,110,000	Atrium VIII ' 144A ' FRN 23/10/2024	1,115,157	0.01
USD	985,000	Atrium XII ' 144A ' FRN 22/4/2027	977,236	0.01
USD	1,385,000	Atrium XII ' 144A ' FRN 22/4/2027	1,347,535	0.01
USD	340,000	Atrium XIII ' 144A ' FRN 21/11/2030	326,621	0.00
USD	5,000,000	Aventura Mall Trust 2013-AVM ' Series 2013-AVM D ' ' 144A ' FRN 5/12/2032	5,057,716	0.05
USD	1,677,913	Avery Point V CLO Ltd ' Series 2014-5A AR ' ' 144A ' FRN 17/7/2026	1,674,945	0.02
USD	520,000	Avery Point V CLO Ltd ' Series 2014-5A BR ' ' 144A ' FRN 17/7/2026	518,348	0.01
USD	2,800,000	Avery Point VI CLO Ltd ' Series 2015-6A AR ' ' 144A ' FRN 5/8/2027	2,791,854	0.03
USD	2,930,000	Avery Point VI CLO Ltd ' Series 2015-6A BR ' ' 144A ' FRN 5/8/2027	2,909,113	0.03
USD	1,330,000	Avery Point VII CLO Ltd ' Series 2015-7A A1 ' ' 144A ' FRN 15/1/2028	1,331,712	0.01
USD	780,000	Aviation Capital Group LLC ' 144A ' 7.125% 15/10/2020	820,547	0.01
USD	389,000	Azul Investments LLP ' 144A ' 5.875% 26/10/2024	372,291	0.00
USD	248,521	B2R Mortgage Trust 2015-1 ' Series 2015-1 A1 ' ' 144A ' 2.524% 15/5/2048	246,599	0.00
USD	8,762,805	B2R Mortgage Trust 2015-2 ' Series 2015-2 XA ' ' 144A ' FRN 15/11/2048	285,711	0.00
USD	731,486	B2R Mortgage Trust 2015-2 ' Series 2015-2 A ' ' 144A ' 3.336% 15/11/2048	729,077	0.01
USD	1,250,000	Babson CLO Ltd 2015-II ' Series 2015-2A AR ' ' 144A ' FRN 20/10/2030	1,247,264	0.01
USD	1,790,000	Bain Capital Credit CLO 2018-2 ' Series 2018-2A A1 ' ' 144A ' FRN 19/7/2031	1,770,942	0.02
USD	777,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2015-200P ' Series 2015-200P F ' ' 144A ' FRN 14/4/2033	745,768	0.01
USD	5,000,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2016-ISQ ' Series 2016-ISQ E ' ' 144A ' FRN 14/8/2034	4,575,347	0.05
USD	5,860,000	BamII Commercial Mortgage Securities Trust 2016-SS1 ' Series 2016-SS1 XA ' ' 144A ' FRN 15/12/2035	210,403	0.00
USD	3,820,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2017-SCH ' Series 2017-SCH CL ' ' 144A ' FRN 15/11/2032	3,837,473	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	1,780,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2017-SCH ' Series 2017-SCH DL ' ' 144A ' FRN 15/11/2032	1,786,889	0.02
USD	2,046,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2018- DSNY ' Series 2018-DSNY D ' ' 144A ' FRN 15/9/2034	2,049,836	0.02
USD	300,321	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2007-1 ' Series 2007-1 AMFX ' FRN 15/1/2049	301,462	0.00
USD	2,030,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016- UBS10 ' Series 2016-UB10 C ' FRN 15/7/2049	2,104,040	0.02
USD	9,780,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 ' Series 2017-BNK3 XB ' FRN 15/2/2050	441,812	0.00
USD	4,000,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 ' Series 2017-BNK3 XD ' ' 144A ' FRN 15/2/2050	342,140	0.00
USD	560,277	Banc of America Funding 2006-A Trust ' Series 2006- A 3A2 ' FRN 20/2/2036	524,815	0.01
USD	16,090,227	Banc of America Funding 2014-R2 Trust ' Series 2014-R2 1C ' ' 144A ' FRN 26/11/2036	2,964,932	0.03
USD	1,982,151	Bancorp Commercial Mortgage 2018-CRE3 Trust/The ' Series 2018-CR3 A ' ' 144A ' FRN 15/1/2033	1,961,770	0.02
EUR	1,770,000	Banff Merger Sub Inc 8.375% 1/9/2026	1,995,439	0.02
USD	1,660,000	BANK 2018-BNK13 ' Series 2018- BN13 A5 ' FRN 15/8/2061	1,751,803	0.02
USD	9,155,000	Bank of America Corp FRN 1/10/2021	9,060,231	0.09
EUR	9,693,000	Bank of America Corp FRN 7/2/2022	11,140,304	0.11
EUR	360,000	Bank of America Corp FRN 4/5/2023	410,714	0.00
USD	2,810,000	Bank of America Corp FRN 5/3/2024	2,821,519	0.03
USD	10,350,000	Bank of America Corp FRN 23/7/2024	10,526,077	0.11
USD	1,904,000	Bank of America Corp FRN 23/10/2024 (Perpetual)	2,069,810	0.02
USD	880,000	Bank of America Corp FRN 10/3/2026 (Perpetual)	955,706	0.01
USD	676,000	Bank of America Corp FRN 21/7/2028	662,223	0.01
USD	1,150,000	Bank of America Corp FRN 20/12/2028	1,110,474	0.01
USD	22,765,000	Bank of America Corp FRN 5/3/2029	22,880,686	0.23
USD	27,807,000	Bank of America Corp FRN 23/7/2029*	28,569,707	0.29
USD	10,467,000	Bank of America Corp FRN 7/2/2030*	10,540,156	0.11
USD	530,000	Bank of America Corp FRN 24/4/2038	529,994	0.01
USD	380,000	Bank of America Corp 3.248% 21/10/2027	364,024	0.00
USD	2,810,000	Bank of America Corp 3.3% 11/1/2023	2,824,115	0.03
USD	13,185,000	Bank of America Corp 4.45% 3/3/2026	13,460,713	0.14
USD	2,160,000	Bank of America Corp 5% 21/1/2044	2,358,495	0.02
USD	1,155,000	Bank of America NA FRN 25/1/2023	1,163,086	0.01
USD	690,000	Bank of America NA 6% 15/10/2036	828,110	0.01
USD	1,500,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust ' Series 1997-2 B1 ' FRN 10/2/2022	1,249,367	0.01
USD	2,380,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust ' Series 1998-2 B1 ' FRN 10/12/2025	1,509,028	0.02
USD	790,000	Barings CLO Ltd 2018-III FRN 20/7/2031	783,316	0.01
EUR	360,000	BAT Capital Corp FRN 16/8/2021	407,422	0.00
USD	11,860,000	BAT Capital Corp 2.764% 15/8/2022	11,534,869	0.12
USD	5,055,000	BAT Capital Corp 3.222% 15/8/2024	4,871,034	0.05
USD	630,000	Battalion CLO VII Ltd ' Series 2014-7A A1RR ' ' 144A ' FRN 17/7/2028	625,829	0.01
USD	2,840,000	Battalion CLO VII Ltd ' Series 2014-7A BRR ' ' 144A ' FRN 17/7/2028	2,836,200	0.03
USD	1,000,000	Battalion CLO X Ltd ' Series 2016-10A C ' ' 144A ' FRN 24/1/2029	1,005,294	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 1,250,000	Battalion CLO X Ltd 'Series 2016-10A D' '144A' FRN 24/1/2029	1,212,843	0.01
USD 1,080,000	Battalion CLO XI Ltd 'Series 2017-11A E' '144A' FRN 24/10/2029	1,030,943	0.01
USD 3,535,000	Bay Area Toll Authority 6.918% 1/4/2040	4,769,829	0.05
USD 2,455,000	Bay Area Toll Authority 7.043% 1/4/2050	3,586,154	0.04
USD 680,000	Bayer US Finance II LLC '144A' 3.5% 25/6/2021	679,393	0.01
USD 8,230,000	Bayer US Finance II LLC '144A' 4.25% 15/12/2025	8,225,849	0.08
USD 1,780,000	Baylor Scott & White Holdings 4.185% 15/11/2045	1,763,634	0.02
USD 281,327	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 'Series 2005-4A A1' '144A' FRN 25/1/2036	269,509	0.00
USD 79,167	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 'Series 2005-4A A2' '144A' FRN 25/1/2036	76,172	0.00
USD 209,228	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 'Series 2005-4A M1' '144A' FRN 25/1/2036	201,419	0.00
USD 306,379	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 'Series 2006-1A A2' '144A' FRN 25/4/2036	296,100	0.00
USD 880,840	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 'Series 2006-1A M2' '144A' FRN 25/4/2036	841,299	0.01
USD 211,956	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 'Series 2006-1A M3' '144A' FRN 25/4/2036	202,262	0.00
USD 1,158,583	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 'Series 2006-1A M4' '144A' FRN 25/4/2036	1,109,667	0.01
USD 1,229,253	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 'Series 2006-3A A1' '144A' FRN 25/10/2036	1,169,186	0.01
USD 551,115	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 'Series 2006-3A A2' '144A' FRN 25/10/2036	525,496	0.01
USD 6,455,986	Bayview Commercial Asset Trust 2006-4 'Series 2006-4A A1' '144A' FRN 25/12/2036	6,245,813	0.06
USD 22,237,480	Bayview Commercial Asset Trust 2007-4 'Series 2007-4A A1' '144A' FRN 25/9/2037	21,039,162	0.21
USD 1,590,000	Bayview Commercial Asset Trust 2007-6 'Series 2007-6A A4A' '144A' FRN 25/12/2037	1,334,250	0.01
USD 7,357,737	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B ' Series 2004-B A1' '144A' FRN 28/5/2039	6,907,630	0.07
USD 2,520,860	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B ' Series 2004-B A2' '144A' FRN 28/5/2039	2,383,882	0.02
USD 4,489,835	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-A ' Series 2005-A A1' '144A' FRN 28/2/2040	4,338,241	0.04
USD 1,046,866	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-E ' Series 2005-E A1' '144A' FRN 28/12/2040	998,732	0.01
USD 880,000	BBCMS 2018-CHRS Mortgage Trust 'Series 2018-CHRS E' ' '144A' FRN 5/8/2038	756,778	0.01
USD 877,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 'Series 2018-TALL A' ' '144A' FRN 15/3/2037	864,244	0.01
USD 1,060,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 'Series 2018-TALL D' ' '144A' FRN 15/3/2037	1,054,510	0.01
USD 20,840,000	BBCMS Trust 2015-SRCH 'Series 2015-SRCH XA' '144A' ' FRN 10/8/2035	1,317,401	0.01
USD 11,710,000	BBCMS Trust 2015-SRCH 'Series 2015-SRCH XB' '144A' ' FRN 10/8/2035	190,463	0.00
USD 100,000	BBCMS Trust 2015-STP 'Series 2015-STP E' '144A' FRN 10/9/2028	97,732	0.00
USD 1,627,547	BCMSC Trust 2000-A 'Series 2000-A A2' FRN 15/6/2030	554,809	0.01
USD 1,510,989	BCMSC Trust 2000-A 'Series 2000-A A3' FRN 15/6/2030	533,346	0.01
USD 2,587,019	BCMSC Trust 2000-A 'Series 2000-A A4' FRN 15/6/2030	966,210	0.01
USD 130,000	Bean Creek CLO Ltd 'Series 2015-1A ER' '144A' FRN 20/4/2031	120,716	0.00
USD 815,668	Bear Stearns ALT-A Trust 2006-6 'Series 2006-6 1A1' ' FRN 25/11/2036	811,156	0.01
USD 141,346	Bear Stearns ARM Trust 2004-5 'Series 2004-5 2A' FRN 25/7/2034	140,627	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 195,834	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-HE7 'Series 2004-HE7 M2' FRN 25/8/2034	196,416	0.00
USD 3,072,043	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-AC9 (Step-up coupon) 'Series 2005-AC9 A5' 6.25% 25/12/2035	2,978,987	0.03
USD 4,100,053	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-AC1 (Step-up coupon) 'Series 2006-AC1 1A2' 6.25% 25/2/2036	3,640,095	0.04
USD 1,512,671	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-HE1 'Series 2006-HE1 1M4' FRN 25/12/2035	1,805,165	0.02
USD 4,448,125	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-HE7 'Series 2006-HE7 1A2' FRN 25/9/2036	5,491,995	0.06
USD 1,237,098	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-FS1 'Series 2007-FS1 1A3' FRN 25/5/2035	1,307,569	0.01
USD 711,659	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE1 'Series 2007-HE1 21A2' FRN 25/1/2037	700,375	0.01
USD 867,432	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 'Series 2007-HE2 1A4' FRN 25/3/2037	646,773	0.01
USD 1,031,781	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 'Series 2007-HE2 22A' FRN 25/3/2037	1,017,704	0.01
USD 2,371,230	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 'Series 2007-HE2 23A' FRN 25/3/2037	2,451,321	0.03
USD 922,357	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE3 'Series 2007-HE3 1A3' FRN 25/4/2037	972,110	0.01
USD 5,301,397	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE3 'Series 2007-HE3 1A4' FRN 25/4/2037	4,438,779	0.05
USD 156,452	Bear Stearns Asset Backed Securities Trust 2005-4 'Series 2005-4 M2' FRN 25/1/2036	156,118	0.00
USD 809,231	Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust 2007-TOP26 'Series 2007-T26 AM' FRN 12/1/2045	809,336	0.01
USD 1,028,255	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2006-SL1 'Series 2006-SL1 A1' FRN 25/8/2036	1,023,852	0.01
USD 612,627	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR2 'Series 2007-AR2 A1' FRN 25/3/2037	560,893	0.01
USD 945,736	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR3 'Series 2007-AR3 1A1' FRN 25/3/2037	914,191	0.01
USD 756,740	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR4 'Series 2007-AR4 2A1' FRN 25/6/2037	718,275	0.01
USD 226,932	Bear Stearns Second Lien Trust 2007-SV1 'Series 2007-SV1A M1' '144A' FRN 25/1/2036	226,384	0.00
USD 3,364,000	Beazer Homes USA Inc 8.75% 15/3/2022	3,506,970	0.04
EUR 320,000	Belden Inc 2.875% 15/9/2025*	368,777	0.00
EUR 1,460,000	Belden Inc 4.125% 15/10/2026	1,747,828	0.02
USD 200,000	BENCHMARK 2018-B3 Mortgage Trust 'Series 2018-B3 D' '144A' 3.057% 10/4/2051	171,206	0.00
USD 1,250,000	Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust 'Series 2018-B5 A4' 4.208% 15/7/2051	1,317,569	0.01
USD 409,000	BENCHMARK 2018-B7 Mortgage Trust 'Series 2018-B7 A4' 4.51% 15/5/2053	440,994	0.00
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO II Ltd 'Series 2013-IIA CR' '144A' FRN 15/7/2029	501,491	0.01
USD 3,415,000	Benefit Street Partners CLO IV Ltd 'Series 2014-IVA A1R' '144A' FRN 20/1/2029	3,419,347	0.04
USD 5,972,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd 'Series 2015-VIA A1R' '144A' FRN 18/10/2029	5,971,816	0.06
USD 1,440,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd 'Series 2015-VIA A2R' '144A' FRN 18/10/2029	1,433,539	0.01
USD 610,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd 'Series 2015-VIA CR' '144A' FRN 18/10/2029	605,936	0.01
USD 1,770,000	Benefit Street Partners CLO VII Ltd 'Series 2015-VIIA A1AR' '144A' FRN 18/7/2027	1,755,938	0.02
USD 2,370,000	Benefit Street Partners CLO VII Ltd 'Series 2015-VIIA D' '144A' FRN 18/7/2027	2,304,217	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	1,110,000	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd 'Series 2015-8A A1AR' '144A' FRN 20/1/2031	1,098,924	0.01
USD	370,000	Benefit Street Partners Clo XII Ltd 'Series 2017-12A D' '144A' FRN 15/10/2030	357,355	0.00
USD	1,630,000	Berks County Industrial Development Authority 5% 1/11/2047	1,781,003	0.02
USD	1,550,000	Berks County Industrial Development Authority 5% 1/11/2050	1,689,702	0.02
USD	1,730,000	Berkshire Hathaway Energy Co 6.125% 1/4/2036	2,097,486	0.02
USD	2,480,000	BHMS 2018-ATLS 'Series 2018-ATLS A' '144A' FRN 15/7/2035	2,478,599	0.03
USD	850,000	BHMS 2018-ATLS 'Series 2018-ATLS C' '144A' FRN 15/7/2035	850,327	0.01
USD	18,000	Blackstone CQP Holdco LP '144A' 6% 18/8/2021	18,000	0.00
USD	2,970,000	BlueMountain CLO 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A A1R' '144A' FRN 22/10/2030	2,957,839	0.03
USD	480,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A C' '144A' FRN 13/4/2027	481,306	0.01
USD	889,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A D' '144A' FRN 13/4/2027	888,941	0.01
USD	530,000	BlueMountain CLO 2015-3 Ltd 'Series 2015-3A A1R' '144A' FRN 20/4/2031	522,962	0.01
USD	250,000	BlueMountain CLO 2016-2 Ltd 'Series 2016-2A D' '144A' FRN 20/8/2028	248,016	0.00
USD	1,827,000	Boeing Co/The 3.825% 1/3/2059	1,737,349	0.02
USD	4,875,000	Boyd Gaming Corp 6.875% 15/5/2023	5,106,855	0.05
USD	3,758,000	Brinker International Inc '144A' 5% 1/10/2024	3,645,260	0.04
USD	750,000	Bristol Park CLO Ltd 'Series 2016-1A E' '144A' FRN 15/4/2029	754,935	0.01
USD	5,704,000	Bristow Group Inc '144A' 8.75% 1/3/2023*	4,563,200	0.05
USD	3,680,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 2.2% 15/1/2021	3,596,517	0.04
USD	11,080,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 2.375% 15/1/2020	11,004,948	0.11
USD	7,154,000	Bruin E&P Partners LLC '144A' 8.875% 1/8/2023	6,993,035	0.07
USD	10,136	BSPRT 2017-FL2 Issuer Ltd 'Series 2017-FL2 A' '144A' FRN 15/10/2034	10,143	0.00
USD	1,142,000	BSPRT 2018-FL3 Issuer Ltd 'Series 2018-FL3 A' '144A' FRN 15/3/2028	1,136,205	0.01
USD	4,430,000	Buckeye Tobacco Settlement Financing Authority 5.875% 1/6/2047	4,164,222	0.04
USD	250,000	Burnham Park Clo Ltd 'Series 2016-1A ER' '144A' FRN 20/10/2029	236,720	0.00
USD	2,810,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 'Series 2013-1515 A2' '144A' 3.454% 10/3/2033	2,833,237	0.03
USD	2,730,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 'Series 2013-1515 D' '144A' 3.633% 10/3/2033	2,668,951	0.03
USD	14,000,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 'Series 2013-1515 E' '144A' 3.717% 10/3/2033	13,604,959	0.14
USD	2,002,000	BWAY 2015-1740 Mortgage Trust 'Series 2015-1740 E' '144A' FRN 10/1/2035	1,997,042	0.02
USD	4,552,000	BWAY Holding Co '144A' 5.5% 15/4/2024	4,489,410	0.05
USD	1,110,000	BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA 'Series 2018-BIOA E' '144A' FRN 15/3/2037	1,109,302	0.01
USD	13,370,474	BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND 'Series 2018-IND H' '144A' FRN 15/11/2035	13,436,500	0.14
USD	600,000	BXP Trust 2017-CC 'Series 2017-CC D' '144A' FRN 13/8/2037	575,117	0.01
USD	2,260,000	BXP Trust 2017-CC 'Series 2017-CC E' '144A' FRN 13/8/2037	2,053,420	0.02
USD	990,000	BXP Trust 2017-GM 'Series 2017-GM E' '144A' FRN 13/6/2039	899,786	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 1,005,000	California Health Facilities Financing Authority 5% 15/8/2033	1,169,614	0.01
USD 1,560,000	California Health Facilities Financing Authority 5% 15/8/2047	1,716,125	0.02
USD 1,970,000	California Pollution Control Financing Authority ' 144A ' 5% 21/11/2045	2,052,041	0.02
USD 1,735,000	California State Public Works Board 8.361% 1/10/2034	2,521,675	0.03
USD 1,520,000	Calpine Corp 5.375% 15/1/2023	1,508,600	0.02
USD 1,930,000	Calpine Corp ' 144A ' 5.875% 15/1/2024	1,978,250	0.02
USD 2,170,000	Calpine Corp ' 144A ' 6% 15/1/2022	2,207,975	0.02
USD 1,540,000	Canaveral Port Authority 5% 1/6/2045	1,688,502	0.02
USD 1,540,000	Canaveral Port Authority 5% 1/6/2048	1,724,361	0.02
USD 70,000	Capital One Financial Corp FRN 1/6/2020 (Perpetual)	70,828	0.00
USD 12,013,000	Capital One Financial Corp 3.9% 29/1/2024	12,099,802	0.12
EUR 400,000	Cargill Inc 1.875% 4/9/2019	459,371	0.00
USD 2,959,000	Carlson Travel Inc ' 144A ' 6.75% 15/12/2023	2,951,602	0.03
USD 210,000	Carlson Travel Inc ' 144A ' 9.5% 15/12/2024	200,550	0.00
USD 870,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2012-4 Ltd ' Series 2012-4X INC ' FRN 20/1/2029	595,680	0.01
USD 2,260,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2013-2 Ltd ' Series 2013-2A AR ' ' 144A ' FRN 18/1/2029	2,238,813	0.02
USD 2,020,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-1 Ltd ' Series 2014-1A A1R2 ' ' 144A ' FRN 17/4/2031	1,991,901	0.02
USD 450,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd ' Series 2015-1A BR ' ' 144A ' FRN 20/4/2027	448,027	0.00
USD 2,044,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd ' Series 2015-1A CR ' ' 144A ' FRN 20/4/2027	2,045,537	0.02
USD 525,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd ' Series 2015-1A DR ' ' 144A ' FRN 20/4/2027	517,007	0.01
USD 485,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd ' Series 2015-1A E1 ' ' 144A ' FRN 20/4/2027	482,858	0.01
USD 250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-2 Ltd ' Series 2015-2A CR ' ' 144A ' FRN 27/4/2027	239,863	0.00
USD 250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-2 Ltd ' Series 2015-2A DR ' ' 144A ' FRN 27/4/2027	236,000	0.00
USD 2,380,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-3 Ltd ' Series 2015-3A A2R ' ' 144A ' FRN 28/7/2028	2,366,472	0.02
USD 470,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-4 Ltd ' Series 2015-4A C ' ' 144A ' FRN 20/10/2027	471,118	0.00
USD 370,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-4 Ltd ' Series 2015-4A D ' ' 144A ' FRN 20/10/2027	369,929	0.00
USD 420,387	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-4 Ltd ' Series 2015-4A SBB1 ' ' 144A ' FRN 20/10/2027	410,230	0.00
USD 1,250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2016-1 Ltd ' Series 2016-1A DR ' ' 144A ' FRN 20/4/2027	1,201,671	0.01
USD 750,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2016-2 Ltd ' Series 2016-2A D2R ' ' 144A ' FRN 15/7/2027	708,525	0.01
USD 260,000	Carlyle US Clo 2017-2 Ltd ' Series 2017-2A D ' ' 144A ' FRN 20/7/2031	251,543	0.00
USD 4,750,000	CARLYLE US CLO 2017-4 Ltd ' Series 2017-4A A1 ' ' 144A ' FRN 15/1/2030	4,734,884	0.05
USD 4,787,000	Carpenter Technology Corp 4.45% 1/3/2023	4,763,846	0.05
USD 1,885,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-FRE1 ' Series 2006-FRE1 A4 ' FRN 25/4/2036	1,557,836	0.02
USD 2,740,189	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-FRE2 ' Series 2006-FRE2 A5 ' FRN 25/3/2035	2,066,539	0.02
USD 1,036,241	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-FRE2 ' Series 2006-FRE2 A2 ' FRN 25/10/2036	784,981	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 2,949,653	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-FRE2 ' Series 2006-FRE2 A3 ' FRN 25/10/2036	2,244,062	0.02
USD 490,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC1 ' Series 2006-NC1 M2 ' FRN 25/1/2036	375,658	0.00
USD 928,658	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC4 ' Series 2006-NC4 A3 ' FRN 25/10/2036	871,920	0.01
USD 1,442,589	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC5 ' Series 2006-NC5 A3 ' FRN 25/1/2037	1,157,147	0.01
USD 1,690,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2007-RFC1 ' Series 2007-RFC1 A4 ' FRN 25/10/2036	1,149,672	0.01
USD 1,044,000	Carrizo Oil & Gas Inc 6.25% 15/4/2023*	1,028,340	0.01
USD 7,500,000	CBAM 2017-1 Ltd ' Series 2017-1A A1 ' ' 144A ' FRN 20/7/2030	7,459,643	0.08
USD 780,000	CBAM 2017-2 Ltd ' Series 2017-2A B1 ' ' 144A ' FRN 17/10/2029	774,540	0.01
USD 250,000	CBAM 2017-3 Ltd ' Series 2017-3A B1 ' ' 144A ' FRN 17/10/2029	247,523	0.00
USD 470,000	CBAM 2017-3 Ltd ' Series 2017-3A E1 ' ' 144A ' FRN 17/10/2029	461,255	0.00
USD 390,000	CBAM 2018-6 Ltd ' Series 2018-6A A ' ' 144A ' FRN 15/7/2031	385,340	0.00
USD 640,000	CBAM 2018-6 Ltd ' Series 2018-6A B1 ' ' 144A ' FRN 15/7/2031	628,016	0.01
USD 360,090	C-BASS 2007-CB1 TRUST (Stepup coupon) ' Series 2007-CB1 AF4 ' 3.562% 25/1/2037	164,984	0.00
USD 276,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.125% 15/2/2023	281,258	0.00
USD 275,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp ' 144A ' 5.125% 1/5/2023	280,522	0.00
USD 3,753,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.25% 30/9/2022	3,821,023	0.04
USD 138,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.75% 15/1/2024	141,795	0.00
USD 530,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust 2016-HEAT ' Series 2016-HEAT D ' ' 144A ' FRN 10/4/2029	528,455	0.01
USD 16,000,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust 2016-HEAT ' Series 2016-HEAT X ' ' 144A ' FRN 10/4/2029	373,408	0.00
USD 572,000	CCUBS Commercial Mortgage Trust 2017-C1 ' Series 2017-C1 A4 ' FRN 15/11/2050	570,147	0.01
USD 1,336,489	CD 2006-CD3 Mortgage Trust ' Series 2006-CD3 AM ' 5.648% 15/10/2048	1,377,516	0.01
USD 1,724,000	CDK Global Inc 3.8% 15/10/2019	1,728,310	0.02
USD 1,157,000	CDK Global Inc 5% 15/10/2024	1,172,296	0.01
USD 1,600,000	Cedar Funding II CLO Ltd ' Series 2013-1A BR ' ' 144A ' FRN 9/6/2030	1,595,260	0.02
USD 1,290,000	Cedar Funding IX CLO Ltd ' Series 2018-9A A1 ' ' 144A ' FRN 20/4/2031	1,272,886	0.01
USD 580,000	Cedar Funding IX CLO Ltd ' Series 2018-9A E ' ' 144A ' FRN 20/4/2031	525,258	0.01
USD 5,210,000	Cedar Funding VI CLO Ltd ' Series 2016-6A AR ' ' 144A ' FRN 20/10/2028	5,186,059	0.05
USD 1,200,000	Cedar Funding VI CLO Ltd ' Series 2016-6A DR ' ' 144A ' FRN 20/10/2028	1,167,091	0.01
USD 9,480,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd ' Series 2017-8A A1 ' ' 144A ' FRN 17/10/2030	9,466,726	0.10
USD 580,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd ' Series 2017-8A B ' ' 144A ' FRN 17/10/2030	573,399	0.01
USD 6,995,000	Celgene Corp 3.875% 15/8/2025	7,031,900	0.07
USD 3,400,000	Cent CLO 17 Ltd ' 144A ' FRN 30/4/2031	3,368,518	0.03
USD 500,000	Cent CLO 17 Ltd ' 144A ' FRN 30/4/2031	475,371	0.01
USD 5,200,000	Cent CLO 24 Ltd ' Series 2015-24A A1R ' ' 144A ' FRN 15/10/2026	5,180,750	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	11,178,000	Centennial Resource Production LLC '144A' 5.375% 15/1/2026	10,619,100	0.11
USD	4,350,000	CenterPoint Energy Inc 3.85% 1/2/2024	4,368,485	0.04
USD	1,650,000	Central Puget Sound Regional Transit Authority 5% 1/11/2050	1,851,465	0.02
USD	740,000	Central Texas Regional Mobility Authority 5% 1/1/2045	805,642	0.01
USD	740,000	Central Texas Regional Mobility Authority 5% 1/1/2046	807,636	0.01
USD	977,000	Century Communities Inc 6.875% 15/5/2022	989,212	0.01
USD	5,430,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C3 'Series 2016-C3 XD' '144A' FRN 10/1/2048	542,593	0.01
USD	330,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C3 'Series 2016-C3 A3' 3.865% 10/1/2048	337,687	0.00
USD	2,270,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 'Series 2016-C4 C' FRN 10/5/2058	2,359,498	0.02
USD	5,524,095	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 'Series 2016-C4 XA' FRN 10/5/2058	521,110	0.01
USD	5,439,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 'Series 2016-C4 XB' FRN 10/5/2058	260,120	0.00
USD	1,080,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2018-TAN 'Series 2018-TAN C' '144A' 5.295% 15/2/2033	1,109,446	0.01
USD	3,990,000	CGBAM Commercial Mortgage Trust 2015-SMRT 'Series 2015-SMRT E' '144A' FRN 10/4/2028	4,022,169	0.04
USD	2,500,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC 'Series 2017-BIOC A' '144A' FRN 15/7/2032	2,498,756	0.03
USD	2,320,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC 'Series 2017-BIOC D' '144A' FRN 15/7/2032	2,323,492	0.02
USD	4,960,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC 'Series 2017-BIOC E' '144A' FRN 15/7/2032	4,953,301	0.05
USD	1,574,000	Chaparral Energy Inc '144A' 8.75% 15/7/2023	1,093,930	0.01
USD	188,000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital FRN 1/2/2024	186,816	0.00
USD	7,014,000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital 4.908% 23/7/2025	7,273,378	0.07
USD	21,452,000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital 5.05% 30/3/2029	22,007,526	0.22
USD	3,495,000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital 5.75% 1/4/2048	3,470,914	0.04
USD	13,922,688	Chase Mortgage Finance Trust Series 2007-S6 'Series 2007-S6 1A1' 6% 25/12/2037	10,298,406	0.11
USD	8,531,000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.125% 30/6/2027	8,722,947	0.09
USD	853,000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.875% 31/3/2025	910,586	0.01
USD	4,511,000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7% 30/6/2024	5,012,849	0.05
USD	14,808,574	Cheniere Energy Inc '144A' 4.875% 28/5/2021	15,412,679	0.16
USD	5,331,000	Cheniere Energy Partners LP 5.25% 1/10/2025	5,397,638	0.06
USD	730,000	Chesapeake Bay Bridge & Tunnel District 5% 1/7/2041	826,955	0.01
USD	575,000	Chesapeake Bay Bridge & Tunnel District 5% 1/7/2051	625,246	0.01
USD	1,908,000	Chesapeake Energy Corp 5.5% 15/9/2026	1,745,820	0.02
USD	238,000	Chesapeake Energy Corp 6.125% 15/2/2021	242,760	0.00
USD	2,922,000	Chesapeake Energy Corp 6.625% 15/8/2020	2,973,135	0.03
USD	2,433,000	Chesapeake Energy Corp 7% 1/10/2024*	2,414,753	0.02
USD	2,726,519	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-OA4 'Series 2006-OA4 A1' FRN 25/4/2046	1,424,606	0.01
USD	656,453	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-OA5 'Series 2006-OA5 3A1' FRN 25/4/2046	610,861	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 7,750,238	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-15 'Series 2007-15 2A2' 6.5% 25/9/2037	5,738,711	0.06
USD 250,000	CIFC Funding 2013-I Ltd 'Series 2013-1A A2R' '144A' FRN 16/7/2030	250,824	0.00
USD 7,500,000	CIFC Funding 2013-II Ltd 'Series 2013-2A A1LR' '144A' FRN 18/10/2030	7,475,315	0.08
USD 250,000	CIFC Funding 2014 Ltd 'Series 2014-1A A1R2' '144A' FRN 18/1/2031	247,134	0.00
USD 950,000	CIFC Funding 2015-II Ltd 'Series 2015-2A AR' '144A' FRN 15/4/2027	943,833	0.01
USD 1,940,000	CIFC Funding 2015-II Ltd 'Series 2015-2A CR' '144A' FRN 15/4/2027	1,893,230	0.02
USD 940,000	CIFC Funding 2016-I Ltd 'Series 2016-1A E' '144A' FRN 21/10/2028	939,846	0.01
USD 1,000,000	CIFC Funding 2017-II Ltd 'Series 2017-2A A' '144A' FRN 20/4/2030	998,745	0.01
USD 2,395,000	Cigna Corp '144A' 3.75% 15/7/2023	2,428,127	0.02
USD 2,558,000	Cigna Corp '144A' 4.125% 15/11/2025	2,601,672	0.03
USD 1,970,063	CIM Trust 2017-6 'Series 2017-6 A1' '144A' FRN 25/6/2057	1,929,994	0.02
USD 2,595,000	Cimarex Energy Co 4.375% 1/6/2024	2,649,608	0.03
USD 10,295,000	Citibank NA FRN 19/2/2022	10,300,189	0.11
USD 25,785,000	Citibank NA 3.65% 23/1/2024	26,257,023	0.27
USD 2,097,257	Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2007-9 'Series 2007-9 1A1' 6.25% 25/12/2037	1,858,048	0.02
USD 2,561,802	Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2008-2 'Series 2008-2 1A1' 6.5% 25/6/2038	2,194,676	0.02
USD 2,290,000	Citicorp Residential Mortgage Trust Series 2007-2 (Step-up coupon) 'Series 2007-2 M1' 5.113% 25/6/2037	2,172,298	0.02
USD 1,700,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 'Series 2014-GC19 C' FRN 10/3/2047	1,786,004	0.02
USD 4,250,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 'Series 2015-GC27 C' FRN 10/2/2048	4,242,830	0.04
USD 300,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-SHP2 'Series 2015-SHP2 F' '144A' FRN 15/7/2027	302,732	0.00
USD 1,190,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C1 'Series 2016-C1 C' FRN 10/5/2049	1,219,046	0.01
USD 100,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P3 'Series 2016-P3 C' FRN 15/4/2049	103,933	0.00
USD 2,182,000	Citigroup Inc FRN 15/11/2020 (Perpetual)	2,221,461	0.02
USD 980,000	Citigroup Inc FRN 15/8/2026 (Perpetual)	1,031,724	0.01
USD 430,000	Citigroup Inc FRN 10/1/2028	429,011	0.00
USD 13,142,000	Citigroup Inc FRN 23/4/2029	13,265,829	0.14
EUR 4,914,000	Citigroup Inc 1.375% 27/10/2021	5,771,752	0.06
USD 4,320,000	Citigroup Inc 2.75% 25/4/2022	4,270,859	0.04
USD 280,000	Citigroup Inc 3.3% 27/4/2025	276,521	0.00
USD 5,861,955	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 'Series 2007-AHL2 A3B' FRN 25/5/2037	4,322,301	0.04
USD 2,009,454	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 'Series 2007-AHL2 A3C' FRN 25/5/2037	1,494,501	0.02
USD 2,791,000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-WFHE2 'Series 2007-WFH2 M3' FRN 25/3/2037	2,608,086	0.03
USD 2,610,000	Citigroup Mortgage Loan Trust Inc 'Series 2006-WFH4 M3' FRN 25/11/2036	2,231,863	0.02
USD 2,117,000	Citizens Bank NA/Providence RI 3.25% 14/2/2022	2,121,607	0.02
USD 2,700,000	City & County of Denver CO 5% 1/8/2044	3,035,178	0.03
USD 1,950,000	City & County of Denver CO 5% 1/8/2048	2,184,605	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 840,000	City of Atlanta GA Water & Wastewater Revenue 5% 1/11/2040	938,414	0.01
USD 1,670,000	City of Atlanta GA Water & Wastewater Revenue 5% 1/11/2041	1,923,114	0.02
USD 3,280,000	City of Aurora CO Water Revenue 5% 1/8/2041	3,735,920	0.04
USD 3,170,000	City of Aurora CO Water Revenue 5% 1/8/2046	3,588,155	0.04
USD 1,560,000	City of Austin TX Water & Wastewater System Revenue 5% 15/11/2043	1,719,120	0.02
USD 840,000	City of Colorado Springs CO Utilities System Revenue 5% 15/11/2042	965,042	0.01
USD 1,240,000	City of Columbia SC Waterworks & Sewer System Revenue 5% 1/2/2042	1,434,017	0.01
USD 1,030,000	City of New York NY 5% 1/4/2040	1,183,722	0.01
USD 500,000	City of Philadelphia PA Airport Revenue 5% 1/7/2042	552,650	0.01
USD 1,105,000	City of Riverside CA Electric Revenue 7.605% 1/10/2040	1,617,510	0.02
USD 800,000	City of San Antonio TX Electric & Gas Systems Revenue 5% 1/2/2048	869,044	0.01
USD 2,020,000	Clark County School District 5% 15/6/2033	2,352,199	0.02
USD 1,375,000	Clear Creek CLO 'Series 2015-1A ER' '144A' FRN 20/10/2030	1,326,888	0.01
USD 522,000	CLNS Trust 2017-IKPR 'Series 2017-IKPR E' '144A' FRN 11/6/2032	525,131	0.01
EUR 1,050,000	Coca-Cola Co/The FRN 8/3/2021	1,197,857	0.01
EUR 1,000,000	Coca-Cola Co/The 0.75% 22/9/2026	1,133,229	0.01
EUR 1,175,000	Coca-Cola Co/The 1.25% 8/3/2031	1,327,104	0.01
EUR 1,850,000	Colfax Corp 3.25% 15/5/2025	2,124,536	0.02
EUR 225,000	Colgate-Palmolive Co 1.375% 6/3/2034	255,303	0.00
USD 720,000	Colorado Health Facilities Authority 5.25% 1/2/2031	756,277	0.01
USD 4,320,000	Comcast Corp 3.7% 15/4/2024	4,412,840	0.05
USD 2,590,000	Comcast Corp 3.95% 15/10/2025	2,675,851	0.03
USD 3,720,000	Comcast Corp 3.999% 1/11/2049	3,453,202	0.04
USD 270,000	Comcast Corp 4% 1/3/2048	253,338	0.00
USD 2,560,000	Comcast Corp 4.15% 15/10/2028	2,639,690	0.03
USD 1,425,000	Comcast Corp 4.25% 15/10/2030	1,479,652	0.02
USD 4,565,000	Comcast Corp 4.7% 15/10/2048	4,746,822	0.05
USD 5,745,000	Comcast Corp 4.95% 15/10/2058	6,062,786	0.06
USD 371,996	COMM 2005-C6 Mortgage Trust 'Series 2005-C6 F' ' 144A' FRN 10/6/2044	377,223	0.00
USD 100,000	COMM 2013-300P Mortgage Trust 'Series 2013-300P D' '144A' FRN 10/8/2030	101,904	0.00
USD 640,000	COMM 2013-GAM 'Series 2013-GAM A2' '144A' 3.367% 10/2/2028	637,335	0.01
USD 1,740,000	COMM 2013-WWP Mortgage Trust 'Series 2013-WWP D' '144A' 3.898% 10/3/2031	1,809,968	0.02
USD 1,500,000	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust 'Series 2014-CR15 C' FRN 10/2/2047	1,563,643	0.02
USD 1,280,000	COMM 2014-LC15 Mortgage Trust 'Series 2014-LC15 A4' '4.006% 10/4/2047	1,331,403	0.01
USD 1,447,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust 'Series 2014-PAT D' '144A' FRN 13/8/2027	1,449,640	0.01
USD 1,020,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust 'Series 2014-PAT E' '144A' FRN 13/8/2027	1,022,866	0.01
USD 8,430,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust 'Series 2014-PAT F' '144A' FRN 13/8/2027	8,399,188	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	3,585,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust ' Series 2014-PAT G ' ' 144A ' FRN 13/8/2027	3,589,141	0.04
USD	1,155,000	COMM 2014-TWC Mortgage Trust ' Series 2014-TWC E ' ' 144A ' FRN 13/2/2032	1,157,921	0.01
USD	1,314,000	COMM 2014-UBS4 Mortgage Trust ' Series 2014-UBS4 C ' FRN 10/8/2047	1,321,160	0.01
USD	210,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust ' Series 2015-CR23 CMC ' ' 144A ' FRN 10/5/2048	210,587	0.00
USD	2,340,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust ' Series 2015-CR23 CMD ' ' 144A ' FRN 10/5/2048	2,331,267	0.02
USD	1,950,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust ' Series 2015-CR23 CME ' ' 144A ' FRN 10/5/2048	1,934,419	0.02
USD	880,000	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust ' Series 2015-CR25 C ' FRN 10/8/2048	881,997	0.01
USD	23,003,283	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust ' Series 2015-CR25 XA ' FRN 10/8/2048	997,865	0.01
USD	2,890,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust ' Series 2015-LC19 C ' FRN 10/2/2048	2,918,144	0.03
USD	1,536,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust ' Series 2015-LC19 D ' ' 144A ' FRN 10/2/2048	1,333,409	0.01
USD	1,631,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust ' Series 2015-LC19 A4 ' 3.183% 10/2/2048	1,628,685	0.02
USD	1,500,000	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust ' Series 2015-LC21 C ' FRN 10/7/2048	1,511,507	0.02
USD	360,000	COMM 2015-LC23 Mortgage Trust ' Series 2015-LC23 A4 ' 3.774% 10/10/2048	369,730	0.00
USD	1,100,000	COMM 2016-667M Mortgage Trust ' Series 2016-667M D ' ' 144A ' FRN 10/10/2036	1,007,721	0.01
USD	116,665,000	COMM 2016-667M Mortgage Trust ' Series 2016-667M XA ' ' 144A ' FRN 10/10/2036	622,991	0.01
USD	740,000	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust ' Series 2017-COR2 D ' ' 144A ' 3% 10/9/2050	626,621	0.01
USD	900,000	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust ' Series 2017-COR2 A3 ' 3.51% 10/9/2050	898,116	0.01
USD	3,050,000	COMM 2018-COR3 Mortgage Trust ' Series 2018-COR3 XD ' ' 144A ' FRN 10/5/2051	391,208	0.00
USD	3,747,000	Commercial Metals Co 4.875% 15/5/2023*	3,704,846	0.04
USD	5,416,000	Commercial Metals Co 5.375% 15/7/2027	5,121,478	0.05
USD	1,634,000	Commercial Metals Co 5.75% 15/4/2026	1,609,490	0.02
USD	81,864	Commercial Mortgage Trust 2006-GG7 ' Series 2006-GG7 AM ' FRN 10/7/2038	82,156	0.00
USD	1,285,000	CommonSpirit Health 4.35% 1/11/2042	1,166,596	0.01
USD	2,100,000	Commonwealth Financing Authority 3.864% 1/6/2038	2,060,247	0.02
USD	1,455,000	Commonwealth Financing Authority 4.144% 1/6/2038*	1,473,020	0.02
USD	8,975,000	Commonwealth of Puerto Rico 8% 1/7/2035	4,453,844	0.05
USD	1,400,000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 5% 1/7/2045	1,489,908	0.02
USD	2,075,000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 5% 1/7/2045	2,304,007	0.02
USD	1,789,257	Conseco Finance Corp ' Series 1997-3 M1 ' FRN 15/3/2028	1,778,306	0.02
USD	1,050,961	Conseco Finance Corp ' Series 1997-6 M1 ' FRN 15/1/2029	1,050,169	0.01
USD	1,382,251	Conseco Finance Corp ' Series 1999-5 A5 ' FRN 1/3/2030	984,402	0.01
USD	1,011,489	Conseco Finance Corp ' Series 1999-5 A6 ' FRN 1/3/2030	697,571	0.01
USD	288,387	Conseco Finance Corp ' Series 1998-4 M1 ' FRN 1/4/2030	259,665	0.00
USD	706,556	Conseco Finance Corp ' Series 1998-6 M1 ' FRN 1/6/2030	662,656	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	2,158,268	Conseco Finance Corp 'Series 1998-8 M1' FRN 1/9/2030	1,871,011	0.02
USD	1,020,421	Conseco Finance Corp 'Series 1998-8 A1' 6.28% 1/9/2030	1,084,326	0.01
USD	1,330,103	Conseco Finance Securitizations Corp 'Series 2000-1 A5' FRN 1/9/2029	615,890	0.01
USD	1,655,592	Conseco Finance Securitizations Corp 'Series 2000-4 A6' FRN 1/5/2032	751,090	0.01
USD	1,948,638	Conseco Finance Securitizations Corp 'Series 2000-5 A6' 7.96% 1/5/2031	1,133,010	0.01
USD	4,616,748	Conseco Finance Securitizations Corp 'Series 2000-4 A5' 7.97% 1/5/2032	2,011,181	0.02
USD	3,546,548	Conseco Finance Securitizations Corp 'Series 2000-5 A7' 8.2% 1/5/2031	2,117,750	0.02
USD	143	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	149	0.00
USD	5,995,000	Continental Resources Inc/OK 4.5% 15/4/2023	6,119,129	0.06
USD	5,106,000	Continental Resources Inc/OK 5% 15/9/2022	5,144,178	0.05
USD	890,000	Contra Costa Community College District 6.504% 1/8/2034	1,131,835	0.01
USD	8,992,000	Core Industrial Trust 2015-CALW 'Series 2015-CALW G' '144A' FRN 10/2/2034	8,888,457	0.09
USD	2,480,000	Core Industrial Trust 2015-TEXW 'Series 2015-TEXW D' '144A' FRN 10/2/2034	2,493,060	0.03
USD	1,269,000	Core Industrial Trust 2015-TEXW 'Series 2015-TEXW E' '144A' FRN 10/2/2034	1,259,773	0.01
USD	3,140,000	Core Industrial Trust 2015-TEXW 'Series 2015-TEXW F' '144A' FRN 10/2/2034	3,089,293	0.03
USD	13,239,906	Core Industrial Trust 2015-TEXW 'Series 2015-TEXW XA' '144A' FRN 10/2/2034	262,481	0.00
USD	424,000	Core Industrial Trust 2015-WEST 'Series 2015-WEST E' '144A' FRN 10/2/2037	423,477	0.00
USD	27,146,221	Core Industrial Trust 2015-WEST 'Series 2015-WEST XA' '144A' FRN 10/2/2037	1,359,347	0.01
USD	4,800,000	Countrywide Asset-Backed Certificates 'Series 2006-BC4 M1' FRN 25/11/2036	4,127,413	0.04
USD	1,641,993	Countrywide Asset-Backed Certificates (Step-up coupon) 'Series 2006-S3 A4' 6.658% 25/1/2029	1,732,532	0.02
USD	1,670,000	County of King WA Sewer Revenue 5% 1/7/2047	1,854,961	0.02
USD	2,015,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 2.504% 1/10/2024	1,954,862	0.02
USD	455,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.354% 1/10/2029	436,061	0.00
USD	835,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.454% 1/10/2030	801,003	0.01
USD	780,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.504% 1/10/2031	745,735	0.01
USD	1,545,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 4.062% 1/10/2031	1,588,461	0.02
USD	1,810,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2038	1,993,778	0.02
USD	1,560,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2040	1,741,046	0.02
USD	1,440,000	County of Wake NC 5% 1/3/2020	1,488,816	0.02
USD	2,040,000	County of Wake NC 5% 1/3/2021	2,177,139	0.02
USD	2,040,000	County of Wake NC 5% 1/3/2022	2,243,663	0.02
USD	2,060,000	County of Wake NC 5% 1/3/2023	2,329,757	0.02
USD	2,810,000	Cox Communications Inc '144A' 3.25% 15/12/2022	2,791,924	0.03
USD	875,000	Cox Communications Inc '144A' 3.5% 15/8/2027	833,487	0.01
USD	1,052,422	Credit Suisse ABS Repackaging Trust 2013-A 'Series 2013-A B' '144A' 2.5% 25/1/2030	991,054	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	1,220,409	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp ' Series 2005-C3 C ' FRN 15/7/2037	1,211,500	0.01
USD	510,000	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp ' Series 2004-C4 F ' ' 144A ' FRN 15/10/2039	510,540	0.01
USD	11,042	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp ' Series 2005-C2 AMFX ' 4.877% 15/4/2037	9,922	0.00
USD	7,509,583	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates ' Series 2009-12R 3A1 ' ' 144A ' 6.5% 27/10/2037	4,317,849	0.04
USD	2,281,472	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC ' Series 2007-CB6 A4 ' ' 144A ' FRN 25/7/2037	1,494,743	0.02
USD	823,088	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC ' Series 2007-RP1 A ' ' 144A ' FRN 25/5/2046	721,958	0.01
USD	406,069	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) ' Series 2006-CB2 AF4 ' 3.465% 25/12/2036	367,389	0.00
USD	3,872,581	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) ' Series 2006-SL1 A2 ' ' 144A ' 5.556% 25/9/2036	625,546	0.01
USD	705,000	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) ' Series 2006-MH1 B1 ' ' 144A ' 6.25% 25/10/2036	707,711	0.01
USD	6,890,000	Crown Castle International Corp 3.65% 1/9/2027	6,623,638	0.07
USD	2,120,000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc ' 144A ' 5.625% 15/10/2025	2,064,392	0.02
USD	19,163,000	CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust FRN 15/11/2027	318,673	0.00
USD	2,990,000	CSAIL 2018-CX11 Commercial Mortgage Trust ' Series 2018-CX11 A5 ' FRN 15/4/2051	3,089,207	0.03
USD	4,500,000	CSC Holdings LLC ' 144A ' 5.375% 15/7/2023	4,635,900	0.05
USD	5,452,000	CSC Holdings LLC ' 144A ' 6.625% 15/10/2025	5,793,731	0.06
USD	6,618,000	CSC Holdings LLC ' 144A ' 10.875% 15/10/2025	7,693,425	0.08
USD	1,095,891	CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Series 2005-10 ' Series 2005-10 10A1 ' FRN 25/11/2035	387,958	0.00
USD	122,260,000	CSMC 2014-USA OA LLC ' Series 2014-USA X2 ' ' 144A ' FRN 15/9/2037	688,324	0.01
USD	409,074	CSMC 2016-MFF ' Series 2016-MFF A ' ' 144A ' FRN 15/11/2033	410,992	0.00
USD	6,565,421	CSMC 2017-1 TR 4.5% 25/3/2021	6,595,985	0.07
USD	770,000	CSMC 2017-TIME ' Series 2017-TIME A ' ' 144A ' 3.646% 13/11/2039	769,993	0.01
USD	10,327,784	CSMC 2018-RPL8 Trust ' Series 2018-RPL8 A1 ' ' 144A ' ' FRN 25/7/2058	10,348,626	0.11
USD	2,233,921	CSMC Mortgage-Backed Trust 2007-5 ' Series 2007-5 1A11 ' FRN 25/8/2037	1,824,776	0.02
USD	1,814,707	CSMC Series 2009-5R ' Series 2009-5R 4A4 ' ' 144A ' FRN 25/6/2036	1,690,183	0.02
USD	3,633,180	CSMC Series 2014-11R ' Series 2014-11R 16A1 ' ' 144A ' ' FRN 27/9/2047	3,702,756	0.04
USD	870,000	CSMC Series 2014-4R ' Series 2014-4R 16A3 ' ' 144A ' FRN 27/2/2036	819,357	0.01
USD	1,512,206	CSMC Series 2014-9R ' Series 2014-9R 9A1 ' ' 144A ' FRN 27/8/2036	1,383,067	0.01
USD	1,650,000	CSMC Series 2015-4R ' Series 2015-4R 1A4 ' ' 144A ' FRN 27/10/2036	1,135,189	0.01
USD	570,000	CSMC Series 2015-4R ' Series 2015-4R 1A2 ' ' 144A ' FRN 27/11/2036	568,146	0.01
USD	274,281	CSMC Series 2015-6R ' Series 2015-6R 5A1 ' ' 144A ' FRN 27/3/2036	274,147	0.00
USD	2,708,147	CSMC Series 2015-6R ' Series 2015-6R 5A2 ' ' 144A ' FRN 27/3/2036	2,046,656	0.02
USD	879,000	CSMC Trust 2017-CHOP ' Series 2017-CHOP E ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	882,515	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 790,000	CSMC Trust 2017-PFHP 'Series 2017-PFHP A' '144A' FRN 15/12/2030	788,473	0.01
USD 1,214,000	CSWF 2018-TOP 'Series 2018-TOP A' '144A' FRN 15/8/2035	1,211,051	0.01
USD 530,000	Cumberland Park CLO Ltd 'Series 2015-2A CR' '144A' FRN 20/7/2028	520,479	0.01
USD 333,500	Cumberland Park CLO Ltd 'Series 2015-2A ER' '144A' FRN 20/7/2028	328,467	0.00
USD 405,316	Cutwater 2014-I Ltd 'Series 2014-1A A1AR' '144A' FRN 15/7/2026	405,109	0.00
USD 286,000	CVR Refining LLC / Coffeyville Finance Inc 6.5% 1/11/2022	292,878	0.00
USD 3,240,000	CVS Health Corp 3.5% 20/7/2022	3,257,963	0.03
USD 4,320,000	CVS Health Corp 3.7% 9/3/2023	4,346,728	0.04
USD 6,206,000	CVS Health Corp 4.1% 25/3/2025	6,298,822	0.06
USD 11,495,000	CVS Health Corp 4.3% 25/3/2028	11,525,407	0.12
USD 7,011,946	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-16 'Series 2005-16 1AF' FRN 25/5/2036	6,846,853	0.07
USD 1,575,612	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-16 'Series 2005-16 2AF3' FRN 25/5/2036	1,590,302	0.02
USD 5,222,712	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-17 (Step-up coupon) 'Series 2005-17 1AF4' 6.047% 25/5/2036	5,117,438	0.05
USD 233,923	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 'Series 2006-11 3AV2' FRN 25/9/2046	230,023	0.00
USD 819,809	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-U 'Series 2004-U 2A' FRN 15/3/2034	783,854	0.01
USD 118,934	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S2 'Series 2006-S2 A3' 5.841% 25/7/2027	197,985	0.00
USD 67,492	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S5 'Series 2006-S5 A4' 5.842% 25/6/2035	121,198	0.00
USD 671,511	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S5 'Series 2006-S5 A5' 6.155% 25/6/2035	720,962	0.01
USD 7,776,003	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 'Series 2006-RES 5B1A' '144A' FRN 15/5/2035	7,249,015	0.07
USD 266,195	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 'Series 2006-RES 5B1B' '144A' FRN 15/5/2035	250,223	0.00
USD 1,252,141	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 'Series 2006-RES 5F1A' '144A' FRN 15/12/2035	1,242,325	0.01
USD 849,899	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005-B 'Series 2005-B 2A' FRN 15/5/2035	822,808	0.01
USD 3,490,176	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-C 'Series 2006-C 2A' FRN 15/5/2036	3,382,813	0.03
USD 1,732,511	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-H 'Series 2006-H 1A' FRN 15/11/2036	1,426,400	0.01
USD 8,465,000	Daimler Finance North America LLC '144A' 3.4% 22/2/2022	8,462,662	0.09
USD 1,460,000	Dallas Area Rapid Transit 5% 1/12/2041	1,653,187	0.02
USD 1,970,000	Dallas Area Rapid Transit 5% 1/12/2046	2,217,777	0.02
USD 340,000	Dallas/Fort Worth International Airport 5% 1/11/2043	352,714	0.00
USD 480,000	Danaher Corp 3.35% 15/9/2025	471,997	0.01
USD 6,195,000	DaVita Inc 5.125% 15/7/2024	6,133,050	0.06
USD 2,150,000	DaVita Inc 5.75% 15/8/2022	2,193,000	0.02
USD 950,000	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 'Series 2018-C1 A4' 4.466% 15/10/2051	1,019,525	0.01
USD 4,600,000	DBJPM 17-C6 Mortgage Trust 'Series 2017-C6 XD' FRN 10/6/2050	289,133	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 900,000	DBUBS 2011-LC1 Mortgage Trust 'Series 2011-LC1A E' '144A' FRN 10/11/2046	932,354	0.01
USD 9,600,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 'Series 2017-BRBK E' '144A' FRN 10/10/2034	9,134,128	0.09
USD 2,040,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 'Series 2017-BRBK F' '144A' FRN 10/10/2034	1,803,153	0.02
USD 1,541,000	DCP Midstream Operating LP 2.7% 1/4/2019	1,539,621	0.02
USD 2,253,000	DCP Midstream Operating LP '144A' 5.35% 15/3/2020	2,302,566	0.02
USD 8,119,160	DCP Rights LLC 'Series 2014-1A A' '144A' 5.463% 25/10/2044	8,141,772	0.08
USD 500,000	Deer Creek Clo Ltd 2017-1 'Series 2017-1A A' '144A' 'FRN 20/10/2030	497,379	0.01
USD 500,000	Deer Creek Clo Ltd 2017-1 'Series 2017-1A E' '144A' 'FRN 20/10/2030	481,786	0.01
USD 693,000	Dell Inc 5.875% 15/6/2019	702,044	0.01
USD 2,370,000	Dell International LLC / EMC Corp '144A' 4.42% 15/6/2021	2,412,924	0.02
USD 411,000	Dell International LLC / EMC Corp '144A' 5.875% 15/6/2021	420,035	0.00
USD 311,000	Dell International LLC / EMC Corp '144A' 7.125% 15/6/2024	330,024	0.00
USD 1,875,000	Dell International LLC / EMC Corp '144A' 8.35% 15/7/2046	2,178,985	0.02
USD 2,217,000	Delta Air Lines Inc 2.875% 13/3/2020	2,210,495	0.02
USD 2,068,000	Delta Air Lines Inc 3.625% 15/3/2022	2,065,073	0.02
USD 192,847	Deutsche ALT-A Securities Inc ALT 'Series 2007-RS1 A2' '144A' FRN 27/1/2037	184,066	0.00
USD 9,016,613	Deutsche Alt-A Securities Mortgage Loan Trust Series 2007-0A4/DE 'Series 2007-0A4 A2A' FRN25/8/2047	6,176,218	0.06
USD 498,916	Deutsche Alt-B Securities Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 'Series 2006-AB3 A3' FRN 25/7/2036	443,154	0.00
USD 318,465	Deutsche Alt-B Securities Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 'Series 2006-AB3 A8' FRN 25/7/2036	282,905	0.00
USD 1,000,000	Dewolf Park Clo Ltd 'Series 2017-1A E' '144A' FRN 15/10/2030	966,937	0.01
USD 880,000	Diamondback Energy Inc 4.75% 1/11/2024	896,500	0.01
USD 324,000	Diamondback Energy Inc '144A' 4.75% 1/11/2024	330,075	0.00
USD 5,966,000	Diamondback Energy Inc 5.375% 31/5/2025	6,182,268	0.06
USD 4,071,000	Dignity Health 2.637% 1/11/2019	4,067,330	0.04
USD 880,000	Discover Bank FRN 9/8/2028	884,770	0.01
USD 2,050,000	Discover Financial Services 4.1% 9/2/2027	1,996,008	0.02
USD 2,688,000	Discovery Communications LLC 2.95% 20/3/2023	2,606,248	0.03
USD 6,640,000	Discovery Communications LLC 5.2% 20/9/2047	6,276,248	0.06
USD 265,000	DISH DBS Corp 7.875% 1/9/2019	270,631	0.00
USD 945,000	District of Columbia 5% 15/7/2034	1,057,526	0.01
USD 945,000	District of Columbia 5% 15/7/2035	1,052,234	0.01
USD 1,507,000	Dorchester Park CLO DAC 'Series 2015-1A BR' '144A' 'FRN 20/4/2028	1,493,206	0.02
USD 640,000	Dorchester Park CLO DAC 'Series 2015-1A CR' '144A' 'FRN 20/4/2028	626,117	0.01
USD 3,010,000	Dow Chemical Co/The '144A' 5.55% 30/11/2048	3,186,418	0.03
USD 1,760,000	DowDuPont Inc 3.766% 15/11/2020	1,782,117	0.02
USD 4,320,000	DowDuPont Inc 4.205% 15/11/2023	4,461,808	0.05
USD 2,785,000	DowDuPont Inc 4.493% 15/11/2025	2,904,021	0.03
USD 3,135,000	DowDuPont Inc 5.419% 15/11/2048	3,363,313	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 250,000	Dryden 36 Senior Loan Fund 'Series 2014-36A CR' '144A' FRN 15/1/2028	250,365	0.00
USD 500,000	Dryden 36 Senior Loan Fund 'Series 2014-36A DR' '144A' FRN 15/1/2028	501,276	0.01
USD 14,541,000	Dryden 53 CLO Ltd 'Series 2017-53A A' '144A' FRN 15/1/2031	14,454,964	0.15
USD 510,000	Dryden 55 CLO Ltd 'Series 2018-55A A1' '144A' FRN 15/4/2031	504,257	0.01
USD 250,000	Dryden Senior Loan Fund 'Series 2017-47A E' '144A' FRN 15/4/2028	243,181	0.00
USD 3,100,000	Dryden XXV Senior Loan Fund 'Series 2012-25A ARR' '144A' FRN 15/10/2027	3,086,623	0.03
USD 500,000	Dryden XXV Senior Loan Fund 'Series 2012-25A CRR' '144A' FRN 15/10/2027	492,507	0.01
USD 530,000	Dryden XXVI Senior Loan Fund 'Series 2013-26A AR' '144A' FRN 15/4/2029	524,863	0.01
USD 6,505,000	Dryden XXVIII Senior Loan Fund 'Series 2013-28A A1LR' '144A' FRN 15/8/2030	6,488,265	0.07
USD 1,875,000	DTE Energy Co 3.7% 1/8/2023	1,884,720	0.02
USD 1,070,000	DuBois Hospital Authority 5% 15/7/2043	1,181,596	0.01
USD 3,190,000	Duke University 3.299% 1/10/2046	2,872,870	0.03
USD 2,175,000	Dutchess County Local Development Corp 5% 1/7/2046	2,385,584	0.02
USD 225,000	Eldorado Resorts Inc 7% 1/8/2023	236,531	0.00
USD 960,000	Eleven Madison Trust 2015-11MD Mortgage Trust 'Series 2015-11MD A' '144A' FRN 10/9/2035	972,142	0.01
USD 4,127,000	Eli Lilly & Co 3.95% 15/3/2049	4,050,439	0.04
USD 3,819,000	Eli Lilly & Co 4.15% 15/3/2059	3,726,504	0.04
USD 260,000	EMC Corp 2.65% 1/6/2020	256,945	0.00
USD 560,000	Emerson Park CLO Ltd 'Series 2013-1A DR' '144A' FRN 15/7/2025	559,980	0.01
USD 11,093,000	Energen Corp 4.625% 1/9/2021	11,203,930	0.11
USD 4,743,000	Energy Transfer LP 7.5% 15/10/2020	5,033,509	0.05
USD 1,946,000	Energy Transfer Operating LP 4.5% 15/4/2024	2,005,830	0.02
USD 14,705,000	Energy Transfer Operating LP 5.25% 15/4/2029	15,401,995	0.16
USD 4,110,000	EnLink Midstream Partners LP FRN 15/12/2022 (Perpetual)	3,370,200	0.03
USD 1,730,000	Enterprise Products Operating LLC 3.35% 15/3/2023	1,735,362	0.02
USD 4,320,000	Enterprise Products Operating LLC 3.75% 15/2/2025	4,385,160	0.04
USD 6,787,000	Enterprise Products Operating LLC 3.9% 15/2/2024	6,933,572	0.07
USD 8,765,000	Enterprise Products Operating LLC 4.15% 16/10/2028	9,020,008	0.09
USD 2,915,000	Enterprise Products Operating LLC 4.8% 1/2/2049	2,976,783	0.03
USD 473,000	EQT Corp 8.125% 1/6/2019	479,244	0.01
EUR 1,632,000	Equinix Inc 2.875% 15/3/2024*	1,915,447	0.02
EUR 785,000	Equinix Inc 2.875% 1/10/2025	917,635	0.01
EUR 100,000	Equinix Inc 2.875% 1/2/2026	116,557	0.00
USD 551,000	Equinix Inc 5.375% 1/1/2022	570,285	0.01
USD 2,661,000	Equinix Inc 5.375% 1/4/2023	2,720,872	0.03
USD 270,000	ESH Hospitality Inc '144A' 5.25% 1/5/2025	270,570	0.00
USD 4,410,000	Exantas Capital Corp 2018-RS06 Ltd 'Series 2018-RS06 A' '144A' FRN 15/6/2035	4,382,573	0.04
USD 2,705,000	Extraction Oil & Gas Inc '144A' 7.375% 15/5/2024	2,461,550	0.03
USD 78,198	Fannie Mae Pool '255113' 5% 1/2/2024	82,059	0.00
USD 21,091	Fannie Mae Pool '255702' 5% 1/5/2025	22,133	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 738,552	Fannie Mae Pool ' 255894 ' 5% 1/10/2025	775,011	0.01
USD 1,223	Fannie Mae Pool ' 256992 ' 5% 1/10/2027	1,283	0.00
USD 15,577	Fannie Mae Pool ' 257057 ' 5% 1/1/2028	16,346	0.00
USD 1,980,696	Fannie Mae Pool ' 890694 ' 4% 1/9/2045	2,053,158	0.02
USD 11,374,847	Fannie Mae Pool ' 890751 ' 4% 1/9/2046	11,748,938	0.12
USD 1,585,987	Fannie Mae Pool ' AB8742 ' 4% 1/3/2043	1,645,101	0.02
USD 2,101,632	Fannie Mae Pool ' AB9076 ' 4% 1/4/2043	2,179,186	0.02
USD 4,020,790	Fannie Mae Pool ' AE0625 ' 4% 1/12/2040	4,151,059	0.04
USD 5,018,812	Fannie Mae Pool ' AL5624 ' 4.5% 1/8/2044	5,314,729	0.05
USD 5,943,886	Fannie Mae Pool ' AL8195 ' 4.5% 1/2/2046	6,294,062	0.06
USD 2,529,227	Fannie Mae Pool ' AL9276 ' 4% 1/9/2046	2,614,815	0.03
USD 4,937,741	Fannie Mae Pool ' AL9281 ' 4.5% 1/9/2046	5,160,643	0.05
USD 6,720,554	Fannie Mae Pool ' AL9520 ' 4% 1/2/2046	6,944,800	0.07
USD 18,493,960	Fannie Mae Pool ' AL9980 ' 4% 1/2/2046	19,104,579	0.20
USD 2,790,790	Fannie Mae Pool ' AP6347 ' 4% 1/9/2042	2,900,342	0.03
USD 1,051,572	Fannie Mae Pool ' AS3707 ' 4% 1/11/2044	1,083,717	0.01
USD 5,979,507	Fannie Mae Pool ' AS4067 ' 4% 1/12/2044	6,210,345	0.06
USD 2,922,904	Fannie Mae Pool ' AS5848 ' 4.5% 1/9/2045	3,095,209	0.03
USD 5,023,105	Fannie Mae Pool ' AS6016 ' 4% 1/10/2045	5,184,998	0.05
USD 2,932,183	Fannie Mae Pool ' AS6220 ' 4% 1/11/2045	3,030,030	0.03
USD 2,970,384	Fannie Mae Pool ' AS6840 ' 4% 1/3/2046	3,059,176	0.03
USD 4,113,080	Fannie Mae Pool ' AS7940 ' 4% 1/9/2046	4,230,007	0.04
USD 4,578,421	Fannie Mae Pool ' AS8376 ' 4% 1/11/2046	4,708,581	0.05
USD 6,848,423	Fannie Mae Pool ' AS8377 ' 4% 1/11/2046	7,043,117	0.07
USD 9,812,094	Fannie Mae Pool ' AS9676 ' 4% 1/5/2047	10,060,678	0.10
USD 10,372,386	Fannie Mae Pool ' AS9920 ' 4% 1/7/2047	10,674,598	0.11
USD 1,723,567	Fannie Mae Pool ' BC0170 ' 4% 1/1/2046	1,775,549	0.02
USD 2,078,060	Fannie Mae Pool ' BC0908 ' 4% 1/5/2046	2,136,888	0.02
USD 4,154,942	Fannie Mae Pool ' BC1222 ' 4% 1/7/2046	4,299,639	0.04
USD 270,264	Fannie Mae Pool ' BD6043 ' 4% 1/8/2046	279,200	0.00
USD 3,040,480	Fannie Mae Pool ' BE3193 ' 4% 1/2/2047	3,133,482	0.03
USD 21,324,793	Fannie Mae Pool ' BE3696 ' 4% 1/6/2047	21,941,060	0.22
USD 771,117	Fannie Mae Pool ' BE3704 ' 5% 1/6/2047	810,305	0.01
USD 430,555	Fannie Mae Pool ' BE3782 ' 5% 1/7/2047	452,357	0.00
USD 3,727,259	Fannie Mae Pool ' BE5013 ' 4% 1/2/2045	3,851,619	0.04
USD 1,490,670	Fannie Mae Pool ' BE5047 ' 4% 1/11/2046	1,545,202	0.02
USD 1,610,715	Fannie Mae Pool ' BE8359 ' 5% 1/4/2048	1,710,801	0.02
USD 466,634	Fannie Mae Pool ' BE8367 ' 5% 1/7/2048	491,278	0.01
USD 2,962,308	Fannie Mae Pool ' BE8818 ' 4% 1/7/2047	3,055,668	0.03
USD 10,665,077	Fannie Mae Pool ' BF0182 ' 4% 1/1/2057	10,974,029	0.11
USD 592,843	Fannie Mae Pool ' BH4013 ' 5% 1/9/2047	622,679	0.01
USD 139	Fannie Mae Pool ' BJ4150 ' 5% 1/5/2048	146	0.00
USD 2,201	Fannie Mae Pool ' BJ4186 ' 5% 1/8/2048	2,311	0.00
USD 112	Fannie Mae Pool ' BJ5732 ' 5% 1/4/2048	118	0.00
USD 1,997,734	Fannie Mae Pool ' BJ5828 ' 5% 1/6/2048	2,107,653	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 921	Fannie Mae Pool 'BJ6232' 5% 1/4/2048	967	0.00
USD 19,632	Fannie Mae Pool 'BJ6234' 5% 1/5/2048	20,674	0.00
USD 127,781	Fannie Mae Pool 'BJ6245' 5% 1/8/2048	134,131	0.00
USD 1,577	Fannie Mae Pool 'BJ6250' 5% 1/9/2048	1,656	0.00
USD 506,753	Fannie Mae Pool 'BJ6254' 5% 1/10/2048	534,165	0.01
USD 748,822	Fannie Mae Pool 'BJ6257' 5% 1/11/2048	788,543	0.01
USD 1,832,958	Fannie Mae Pool 'BJ8292' 5% 1/2/2048	1,930,186	0.02
USD 4,153	Fannie Mae Pool 'BJ9181' 5% 1/5/2048	4,362	0.00
USD 3,003,344	Fannie Mae Pool 'BK0108' 5% 1/5/2048	3,153,818	0.03
USD 4,844	Fannie Mae Pool 'BK0916' 5% 1/7/2048	5,082	0.00
USD 925	Fannie Mae Pool 'BK1163' 5% 1/6/2048	971	0.00
USD 351	Fannie Mae Pool 'BK1168' 5% 1/8/2048	368	0.00
USD 1,685,813	Fannie Mae Pool 'BK1174' 5% 1/1/2049	1,775,236	0.02
USD 2,709	Fannie Mae Pool 'BK1393' 5% 1/8/2048	2,844	0.00
USD 1,086	Fannie Mae Pool 'BK1660' 5% 1/3/2048	1,156	0.00
USD 1,212,666	Fannie Mae Pool 'BK2012' 4% 1/4/2048	1,244,265	0.01
USD 1,372,203	Fannie Mae Pool 'BK2013' 4% 1/4/2048	1,407,107	0.01
USD 11,442	Fannie Mae Pool 'BK2023' 5% 1/4/2048	12,014	0.00
USD 1,568	Fannie Mae Pool 'BK3259' 5% 1/4/2048	1,646	0.00
USD 2,766	Fannie Mae Pool 'BK3909' 5% 1/5/2048	2,903	0.00
USD 1,853,509	Fannie Mae Pool 'BK4213' 4% 1/7/2048	1,906,128	0.02
USD 581,479	Fannie Mae Pool 'BK4484' 5% 1/7/2048	610,321	0.01
USD 1,090,209	Fannie Mae Pool 'BK4910' 5% 1/6/2048	1,144,864	0.01
USD 390	Fannie Mae Pool 'BK4933' 5% 1/6/2048	410	0.00
USD 135	Fannie Mae Pool 'BK5070' 5% 1/5/2048	142	0.00
USD 505	Fannie Mae Pool 'BK5383' 5% 1/5/2048	530	0.00
USD 2,352	Fannie Mae Pool 'BK5443' 5% 1/9/2048	2,469	0.00
USD 1,418	Fannie Mae Pool 'BK5722' 5% 1/5/2048	1,488	0.00
USD 999,900	Fannie Mae Pool 'BK5727' 5% 1/5/2048	1,049,393	0.01
USD 4,914	Fannie Mae Pool 'BK5733' 5% 1/5/2048	5,158	0.00
USD 990,532	Fannie Mae Pool 'BK6110' 5% 1/6/2048	1,052,978	0.01
USD 2,363	Fannie Mae Pool 'BK6558' 5% 1/7/2048	2,479	0.00
USD 1,711,977	Fannie Mae Pool 'BK6561' 5% 1/9/2048	1,804,504	0.02
USD 4,408,003	Fannie Mae Pool 'BK6568' 5% 1/7/2048	4,650,540	0.05
USD 2,811	Fannie Mae Pool 'BK6572' 5% 1/7/2048	2,953	0.00
USD 2,909	Fannie Mae Pool 'BK7097' 5% 1/6/2048	3,053	0.00
USD 2,920	Fannie Mae Pool 'BK7114' 5% 1/7/2048	3,064	0.00
USD 1,039	Fannie Mae Pool 'BK7121' 5% 1/7/2048	1,091	0.00
USD 735	Fannie Mae Pool 'BK7173' 5% 1/6/2048	771	0.00
USD 523,024	Fannie Mae Pool 'BK7264' 5% 1/11/2048	550,768	0.01
USD 1,225,863	Fannie Mae Pool 'BK7481' 4% 1/7/2048	1,263,689	0.01
USD 2,472,926	Fannie Mae Pool 'BK7881' 5% 1/10/2048	2,595,114	0.03
USD 307,980	Fannie Mae Pool 'BK8919' 5% 1/7/2048	323,350	0.00
USD 2,999,706	Fannie Mae Pool 'BK8924' 5% 1/8/2048	3,150,948	0.03
USD 183,250	Fannie Mae Pool 'BK9599' 5% 1/8/2048	192,496	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 1,319	Fannie Mae Pool 'BK9823' 5% 1/9/2048	1,385	0.00
USD 640,006	Fannie Mae Pool 'BK9893' 5% 1/9/2048	673,955	0.01
USD 1,832,226	Fannie Mae Pool 'BK9936' 5% 1/9/2048	1,929,415	0.02
USD 4,631,712	Fannie Mae Pool 'BM1043' 4.5% 1/4/2047	4,889,394	0.05
USD 9,114,205	Fannie Mae Pool 'BM1876' 4.988% 1/9/2044	9,741,136	0.10
USD 4,950,819	Fannie Mae Pool 'BM1907' 4% 1/11/2046	5,135,694	0.05
USD 3,992,945	Fannie Mae Pool 'BM3906' 5% 1/2/2032	4,190,059	0.04
USD 8,688	Fannie Mae Pool 'BM4644' 5% 1/9/2048	9,119	0.00
USD 7,260,496	Fannie Mae Pool 'BM4683' 4.5% 1/10/2048	7,671,949	0.08
USD 22,473,141	Fannie Mae Pool 'BM4855' 4% 1/4/2048	23,084,838	0.24
USD 26,833,962	Fannie Mae Pool 'BM4857' 4% 1/3/2048	27,796,865	0.28
USD 5,623,973	Fannie Mae Pool 'BM4858' 4% 1/8/2048	5,823,307	0.06
USD 17,141,252	Fannie Mae Pool 'BM4859' 4% 1/4/2048	17,727,266	0.18
USD 21,960,655	Fannie Mae Pool 'BM4860' 4.5% 1/5/2047	23,252,838	0.24
USD 28,233,085	Fannie Mae Pool 'BM4861' 4.5% 1/1/2048	29,905,993	0.31
USD 4,506,640	Fannie Mae Pool 'BM4888' 4.5% 1/8/2048	4,777,299	0.05
USD 2,222,539	Fannie Mae Pool 'BM4889' 4.5% 1/1/2047	2,337,063	0.02
USD 30,276,479	Fannie Mae Pool 'BM4890' 4.5% 1/1/2048	31,844,972	0.33
USD 7,749,459	Fannie Mae Pool 'BM4891' 4.5% 1/10/2047	8,098,892	0.08
USD 38,491,634	Fannie Mae Pool 'BM4892' 4.5% 1/1/2048	40,646,255	0.41
USD 237,906,407	Fannie Mae Pool 'BM5108' 3% 1/2/2033	237,919,739	2.43
USD 180,224,924	Fannie Mae Pool 'BM5109' 3% 1/12/2032	180,296,870	1.84
USD 86,107,703	Fannie Mae Pool 'BM5110' 3% 1/9/2032	86,097,372	0.88
USD 71,140,547	Fannie Mae Pool 'BM5111' 3% 1/11/2033	71,189,015	0.73
USD 47,684,779	Fannie Mae Pool 'BM5112' 3% 1/11/2033	47,688,462	0.49
USD 46,515,621	Fannie Mae Pool 'BM5113' 3% 1/11/2033	46,566,305	0.48
USD 28,589,172	Fannie Mae Pool 'BM5114' 3% 1/10/2033	28,591,265	0.29
USD 12,458	Fannie Mae Pool 'BN0628' 5% 1/9/2048	13,086	0.00
USD 2,015,527	Fannie Mae Pool 'BN0754' 5% 1/11/2048	2,122,439	0.02
USD 2,158,141	Fannie Mae Pool 'BN0759' 5% 1/12/2048	2,272,618	0.02
USD 1,496,510	Fannie Mae Pool 'BN0762' 5% 1/1/2049	1,575,891	0.02
USD 3,950,465	Fannie Mae Pool 'BN1047' 5% 1/10/2048	4,149,574	0.04
USD 2,285,880	Fannie Mae Pool 'BN1054' 5% 1/10/2048	2,407,133	0.02
USD 899,066	Fannie Mae Pool 'BN1240' 5% 1/1/2049	944,488	0.01
USD 451,785	Fannie Mae Pool 'BN1453' 5% 1/10/2048	475,749	0.01
USD 2,341,855	Fannie Mae Pool 'BN2979' 5% 1/11/2048	2,466,077	0.03
USD 1,766,542	Fannie Mae Pool 'BN2993' 5% 1/11/2048	1,860,247	0.02
USD 5,276,015	Fannie Mae Pool 'BN3949' 5% 1/1/2049	5,542,565	0.06
USD 299,324	Fannie Mae Pool 'BN4061' 5% 1/12/2048	315,201	0.00
USD 529,370	Fannie Mae Pool 'BN4430' 5% 1/1/2049	557,450	0.01
USD 6,691,492	Fannie Mae Pool 'BN4459' 5% 1/1/2049	7,053,474	0.07
USD 1,251,055	Fannie Mae Pool 'BN4511' 5% 1/1/2049	1,317,416	0.01
USD 1,007,993	Fannie Mae Pool 'BN5441' 5% 1/1/2049	1,061,461	0.01
USD 799,127	Fannie Mae Pool 'BN5586' 5% 1/1/2049	841,516	0.01
USD 90,384	Fannie Mae Pool 'CA0349' 5% 1/9/2047	94,846	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	991,357 Fannie Mae Pool 'CA0562' 5% 1/10/2047	1,040,310	0.01
USD	5,257,805 Fannie Mae Pool 'CA1007' 4% 1/1/2048	5,423,518	0.06
USD	3,766,565 Fannie Mae Pool 'CA1122' 4% 1/2/2048	3,884,524	0.04
USD	10,781 Fannie Mae Pool 'CA2317' 5% 1/6/2048	11,313	0.00
USD	57,645 Fannie Mae Pool 'CA2505' 5% 1/7/2048	60,507	0.00
USD	43,799 Fannie Mae Pool 'CA2653' 5% 1/8/2048	45,961	0.00
USD	7,904,832 Fannie Mae Pool 'CA2958' 4.5% 1/1/2049	8,379,627	0.09
USD	21,112 Fannie Mae Pool 'MA3301' 5% 1/2/2048	22,155	0.00
USD	5,808 Fannie Mae Pool 'MA3348' 5% 1/4/2048	6,101	0.00
USD	44,748 Fannie Mae Pool 'MA3386' 5% 1/6/2048	47,001	0.00
USD	9,637 Fannie Mae Pool 'MA3422' 5% 1/7/2048	10,113	0.00
USD	37,773 Fannie Mae Pool 'MA3448' 5% 1/8/2048	39,641	0.00
USD	5,358 Fannie Mae Pool 'MA3472' 5% 1/9/2048	5,628	0.00
USD	638,775 Fannie Mae Pool 'MA3499' 5% 1/9/2038	673,556	0.01
USD	701,198 Fannie Mae Pool 'MA3501' 5% 1/10/2048	735,941	0.01
USD	1,963,387 Fannie Mae Pool 'MA3506' 5% 1/9/2038	2,075,516	0.02
USD	1,775,346 Fannie Mae Pool 'MA3527' 5% 1/11/2048	1,862,995	0.02
USD	2,454,553 Fannie Mae Pool 'MA3538' 5% 1/12/2048	2,578,245	0.03
USD	183,282,668 Fannie Mae Pool 'MA3565' 5% 1/1/2049	192,542,191	1.96
USD	88,565 Fannie Mae Pool 'MA3579' 5% 1/1/2039	93,389	0.00
USD	63,140,844 Fannie Mae Pool 'MA3594' 5% 1/2/2049	66,330,833	0.68
USD	940,000 Fannie Mae-Aces 'Series 2017-M8 A2' FRN 25/5/2027	936,217	0.01
USD	12,183,350 Fannie Mae-Aces 'Series 2017-M12 X' FRN 25/6/2027	203,888	0.00
USD	2,700,000 Fannie Mae-Aces 'Series 2017-M14 A2' FRN 25/11/2027	2,638,134	0.03
USD	1,453,000 Fannie Mae-Aces 'Series 2018-M1 A2' FRN 25/12/2027	1,422,129	0.01
USD	3,910,000 Fannie Mae-Aces 'Series 2018-M10 A2' FRN 25/7/2028	3,959,739	0.04
USD	2,683,000 Fannie Mae-Aces 'Series 2018-M14 A2' FRN 25/8/2028	2,764,967	0.03
USD	5,255,555 Fannie Mae-Aces 'Series 2016-M4 X2' FRN 25/1/2039	402,865	0.00
USD	1,045,000 FedEx Corp 3.4% 14/1/2022	1,052,009	0.01
USD	400,000 FedEx Corp 4.05% 15/2/2048	347,713	0.00
USD	3,025,000 FedEx Corp 4.4% 15/1/2047	2,769,233	0.03
USD	10,676,000 FedEx Corp 4.95% 17/10/2048	10,641,257	0.11
USD	3,455,000 Fifth Third Bancorp 3.65% 25/1/2024	3,489,196	0.04
USD	10,799,000 First Data Corp '144A' 5% 15/1/2024	11,089,223	0.11
USD	640,000 First Data Corp '144A' 5.375% 15/8/2023	656,640	0.01
USD	799,734 First Franklin Mortgage Loan Trust 2004-FFH3 'Series 2004-FFH3 M3' FRN 25/10/2034	714,616	0.01
USD	2,473,604 First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FFH1 'Series 2006-FFH1 M2' FRN 25/1/2036	1,411,342	0.01
USD	2,885,000 Fiserv Inc 3.8% 1/10/2023	2,900,076	0.03
USD	845,000 Fiserv Inc 4.2% 1/10/2028	836,876	0.01
USD	6,751,000 Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp '144A' 7.875% 15/11/2025	6,565,348	0.07
USD	1,400,000 Flatiron CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A AR' '144A' FRN 15/4/2027	1,392,688	0.01
EUR	1,400,000 Ford Motor Credit Co LLC FRN 14/5/2021	1,528,725	0.02
EUR	200,000 Ford Motor Credit Co LLC FRN 7/12/2022	209,300	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 1,680,000	Ford Motor Credit Co LLC 2.425% 12/6/2020	1,654,803	0.02
USD 1,680,000	Ford Motor Credit Co LLC 3.157% 4/8/2020	1,662,246	0.02
USD 3,400,000	Ford Motor Credit Co LLC 3.815% 2/11/2027	2,889,610	0.03
USD 6,050,000	Ford Motor Credit Co LLC 4.25% 20/9/2022	5,940,794	0.06
USD 540,000	Fox Corp '144A' 3.666% 25/1/2022	546,931	0.01
USD 1,545,000	Fox Corp '144A' 4.03% 25/1/2024	1,578,967	0.02
USD 6,579,956	Freddie Mac Gold Pool 'G07818' 4.5% 1/9/2044	6,975,591	0.07
USD 2,853,181	Freddie Mac Gold Pool 'G60691' 4% 1/6/2046	2,938,568	0.03
USD 954,603	Freddie Mac Gold Pool 'G60871' 4.5% 1/7/2046	1,008,818	0.01
USD 4,305,466	Freddie Mac Gold Pool 'G60884' 4% 1/2/2047	4,439,027	0.05
USD 7,700,637	Freddie Mac Gold Pool 'G60971' 4.5% 1/1/2047	8,106,435	0.08
USD 6,735,703	Freddie Mac Gold Pool 'G61007' 4.5% 1/8/2046	7,118,243	0.07
USD 7,892,271	Freddie Mac Gold Pool 'G61119' 4.5% 1/8/2047	8,308,218	0.08
USD 46,274,392	Freddie Mac Gold Pool 'G67702' 4% 1/1/2047	47,795,540	0.49
USD 18,462,401	Freddie Mac Gold Pool 'G67715' 4.5% 1/8/2048	19,449,246	0.20
USD 10,763,156	Freddie Mac Gold Pool 'G67716' 4.5% 1/10/2048	11,336,503	0.12
USD 21,138,007	Freddie Mac Gold Pool 'G67719' 4.5% 1/1/2049	22,101,839	0.23
USD 2,004,622	Freddie Mac Gold Pool 'Q04688' 4% 1/11/2041	2,065,605	0.02
USD 1,401,810	Freddie Mac Gold Pool 'Q13670' 3.5% 1/11/2042	1,416,936	0.01
USD 759,433	Freddie Mac Gold Pool 'Q29918' 4.5% 1/11/2044	805,097	0.01
USD 873,308	Freddie Mac Gold Pool 'Q38476' 4.5% 1/1/2046	925,778	0.01
USD 1,279,657	Freddie Mac Gold Pool 'Q39445' 4.5% 1/3/2046	1,356,540	0.01
USD 3,630,515	Freddie Mac Gold Pool 'Q42608' 4.5% 1/8/2046	3,848,653	0.04
USD 128,541	Freddie Mac Gold Pool 'Q44955' 4.5% 1/11/2046	136,265	0.00
USD 1,088,681	Freddie Mac Gold Pool 'Q45398' 4.5% 1/4/2046	1,154,084	0.01
USD 1,137,144	Freddie Mac Gold Pool 'Q45755' 4.5% 1/1/2047	1,205,396	0.01
USD 3,187,119	Freddie Mac Gold Pool 'Q47409' 4% 1/4/2047	3,285,986	0.03
USD 1,398,205	Freddie Mac Gold Pool 'Q47958' 4.5% 1/5/2047	1,471,890	0.02
USD 1,953,933	Freddie Mac Gold Pool 'Q48235' 4.5% 1/5/2047	2,065,404	0.02
USD 3,074,946	Freddie Mac Gold Pool 'Q49708' 4.5% 1/8/2047	3,237,006	0.03
USD 687,262	Freddie Mac Gold Pool 'Q49807' 4.5% 1/8/2047	728,513	0.01
USD 773,641	Freddie Mac Gold Pool 'Q49868' 4.5% 1/8/2047	814,418	0.01
USD 295,436	Freddie Mac Gold Pool 'Q50525' 4.5% 1/9/2047	311,008	0.00
USD 4,467,128	Freddie Mac Gold Pool 'Q50686' 4.5% 1/8/2047	4,702,561	0.05
USD 1,870,165	Freddie Mac Gold Pool 'Q50871' 4% 1/9/2047	1,935,696	0.02
USD 1,843,631	Freddie Mac Gold Pool 'Q52318' 4.5% 1/11/2047	1,948,354	0.02
USD 543,736	Freddie Mac Gold Pool 'Q53752' 4.5% 1/1/2048	576,370	0.01
USD 612,820	Freddie Mac Gold Pool 'Q53762' 4.5% 1/1/2048	648,259	0.01
USD 939,408	Freddie Mac Gold Pool 'Q57394' 4% 1/7/2048	963,527	0.01
USD 1,519,409	Freddie Mac Gold Pool 'Q57403' 4% 1/7/2048	1,558,043	0.02
USD 1,779,447	Freddie Mac Gold Pool 'Q60425' 4.5% 1/12/2048	1,882,352	0.02
USD 6,828,533	Freddie Mac Gold Pool 'V83460' 4.5% 1/9/2047	7,188,417	0.07
USD 920,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'Series K040 A2' 3.241% 25/9/2024	935,093	0.01
USD 1,219,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'Series K058 A2' 2.653% 25/8/2026	1,185,684	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	1,400,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K059 A2 ' FRN 25/9/2026	1,403,868	0.01
USD	630,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K061 A2 ' FRN 25/11/2026	640,360	0.01
USD	187,246	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K062 A2 ' 3.413% 25/12/2026	191,558	0.00
USD	2,427,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K064 A2 ' 3.224% 25/3/2027	2,444,469	0.03
USD	630,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K072 A2 ' 3.444% 25/12/2027	642,827	0.01
USD	6,687,036	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K718 X1 ' FRN 25/1/2022	101,452	0.00
USD	824,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K730 A2 ' 3.59% 25/1/2025	851,308	0.01
USD	29,310,687	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series KW01 X1 ' FRN 25/1/2026	1,557,509	0.02
USD	6,231,073	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series KW03 X1 ' FRN 25/6/2027	329,218	0.00
USD	930,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series KW06 A2 ' FRN 25/6/2028	964,924	0.01
USD	392,125	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2015-DN1 B ' FRN 25/1/2025	527,491	0.01
USD	414,013	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2015-HQ2 B ' FRN 25/5/2025	512,249	0.01
USD	1,165,455	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2017-DNA2 B1 ' FRN 25/10/2029	1,322,711	0.01
USD	1,538,279	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2017-DNA3 B1 ' FRN 25/3/2030	1,656,725	0.02
USD	750,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2017-HRP1 M2 ' FRN 25/12/2042	763,567	0.01
USD	104,634,839	FREMF 2015-K718 Mortgage Trust ' Series 2015-K718 X2A ' ' 144A ' FRN 25/2/2048	239,227	0.00
USD	1,150,000	FREMF 2016-K54 Mortgage Trust ' Series 2016-K54 B ' ' 144A ' FRN 25/4/2048	1,146,273	0.01
USD	598,333	FREMF 2017-K64 Mortgage Trust ' Series 2017-K64 B ' ' 144A ' FRN 25/5/2050	588,947	0.01
USD	1,700,000	FREMF 2018-K732 Mortgage Trust FRN 25/5/2025	1,701,225	0.02
USD	390,000	FREMF 2018-K74 Mortgage Trust ' Series 2018-K74 B ' ' 144A ' FRN 25/2/2051	392,178	0.00
USD	700,000	FREMF 2018-K77 Mortgage Trust ' Series 2018-K77 B ' ' 144A ' 4.159% 25/5/2051	697,367	0.01
USD	10,067,747	Fremont Home Loan Trust 2006-3 ' Series 2006-3 1A1 ' FRN 25/2/2037	7,745,670	0.08
USD	2,209,893	FRESB 2018-SB52 Mortgage Trust ' Series 2018-SB52 A10F ' FRN 25/6/2028	2,236,711	0.02
USD	1,332,716	FRESB 2018-SB53 Mortgage Trust ' Series 2018-SB53 A10F ' FRN 25/6/2028	1,354,846	0.01
USD	1,831,000	Frontier Communications Corp ' 144A ' 8.5% 1/4/2026	1,721,140	0.02
USD	3,878,000	GAHR Commercial Mortgage Trust 2015-NRF ' Series 2015-NRF EFX ' ' 144A ' FRN 15/12/2034	3,815,216	0.04
USD	250,000	Galaxy XXIX CLO Ltd ' Series 2018-29A B ' ' 144A ' FRN 15/11/2026	247,617	0.00
USD	850,000	Galaxy XXIX CLO Ltd ' Series 2018-29A C ' ' 144A ' FRN 15/11/2026	837,905	0.01
USD	2,130,000	Galaxy XXIX CLO Ltd ' Series 2018-29A D ' ' 144A ' FRN 15/11/2026	2,049,800	0.02
USD	5,776,711	GAM Resecuritization Trust 2018-B FRN 27/1/2027	5,692,989	0.06
USD	282,000	Gates Global LLC / Gates Global Co ' 144A ' 6% 15/7/2022	284,160	0.00
EUR	360,000	General Electric Co FRN 28/5/2020	408,993	0.00
USD	1,230,000	General Electric Co 3.15% 7/9/2022	1,211,781	0.01
USD	3,285,000	General Motors Co FRN 10/9/2021	3,239,498	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 3,125,000	General Motors Co 5% 1/10/2028	3,070,166	0.03
EUR 360,000	General Motors Financial Co Inc FRN 10/5/2021	408,313	0.00
USD 4,130,000	General Motors Financial Co Inc 3.15% 30/6/2022*	4,049,826	0.04
USD 1,590,000	General Motors Financial Co Inc 3.55% 9/4/2021	1,591,814	0.02
USD 2,060,000	General Motors Financial Co Inc 4.2% 6/11/2021	2,085,549	0.02
USD 15,000	General Motors Financial Co Inc 4.35% 17/1/2027	14,240	0.00
USD 7,480,000	General Motors Financial Co Inc 5.1% 17/1/2024	7,664,238	0.08
USD 1,540,000	General Motors Financial Co Inc 5.65% 17/1/2029	1,570,907	0.02
USD 4,230,000	George Washington University/The 4.126% 15/9/2048	4,266,633	0.04
USD 338,776	GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2005-2 'Series 2005-2 A2C' FRN 25/12/2035	337,236	0.00
USD 4,017,023	GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2005-2 'Series 2005-2 M1' FRN 25/12/2035	2,327,563	0.02
USD 4,753	GE-WMC Mortgage Securities Trust 2006-1 'Series 2006-1 A2B' FRN 25/8/2036	2,912	0.00
USD 1,500,000	Gilbert Park CLO Ltd 'Series 2017-1A E' '144A' FRN 15/10/2030	1,469,337	0.02
USD 2,160,000	Gilead Sciences Inc 3.5% 1/2/2025	2,157,658	0.02
USD 8,005,000	Gilead Sciences Inc 3.65% 1/3/2026	7,900,113	0.08
USD 2,160,000	Gilead Sciences Inc 4.8% 1/4/2044	2,159,212	0.02
USD 987,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4.375% 15/4/2021	998,429	0.01
USD 7,282,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4.875% 1/11/2020	7,408,707	0.08
USD 6,759,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.25% 1/6/2025	7,007,055	0.07
USD 6,530,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.375% 1/11/2023	6,800,603	0.07
USD 367,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.375% 15/4/2026	380,836	0.00
USD 280,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.75% 1/6/2028	292,370	0.00
USD 720,000	GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd 'Series 2014- 9A AR2' '144A' FRN 29/10/2029	716,748	0.01
USD 349,000	Goldentree Loan Opportunities XI Ltd 'Series 2015- 11A AR2' '144A' FRN 18/1/2031	346,098	0.00
USD 2,080,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 5/6/2023	2,039,796	0.02
USD 410,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 24/7/2023	401,559	0.00
USD 7,680,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 1/5/2029	7,697,230	0.08
EUR 4,914,000	Goldman Sachs Group Inc/The 2.5% 18/10/2021	5,910,043	0.06
USD 6,965,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.5% 16/11/2026	6,713,287	0.07
USD 2,930,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.85% 26/1/2027	2,875,817	0.03
USD 310,000	Goldman Sachs Group Inc/The 5.75% 24/1/2022	330,993	0.00
USD 2,533,864	Government National Mortgage Association 'Series 2013-145 SI' FRN 16/4/2040	150,423	0.00
USD 4,931,066	Government National Mortgage Association 'Series 2015-48 IO' FRN 16/2/2050	222,517	0.00
USD 16,355,877	Government National Mortgage Association 'Series 2013-63 IO' FRN 16/9/2051	854,837	0.01
USD 2,803,064	Government National Mortgage Association 'Series 2012-23 IO' FRN 16/6/2053	66,594	0.00
USD 11,767,423	Government National Mortgage Association 'Series 2013-30 IO' FRN 16/9/2053	483,945	0.01
USD 2,310,321	Government National Mortgage Association 'Series 2013-191 IO' FRN 16/11/2053	79,590	0.00
USD 13,559,205	Government National Mortgage Association 'Series 2013-78 IO' FRN 16/10/2054	580,533	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	17,493,491	Government National Mortgage Association ' Series 2015-22 IO ' FRN 16/3/2055	877,873	0.01
USD	5,997,628	Government National Mortgage Association ' Series 2015-173 IO ' FRN 16/9/2055	391,898	0.00
USD	5,781,861	Government National Mortgage Association ' Series 2015-171 IO ' FRN 16/11/2055	340,571	0.00
USD	9,328,765	Government National Mortgage Association ' Series 2016-97 IO ' FRN 16/7/2056	759,770	0.01
USD	12,659,906	Government National Mortgage Association ' Series 2016-128 IO ' FRN 16/9/2056	980,858	0.01
USD	2,451,830	Government National Mortgage Association ' Series 2015-37 IO ' FRN 16/10/2056	146,562	0.00
USD	6,677,593	Government National Mortgage Association ' Series 2016-67 IO ' FRN 16/7/2057	534,132	0.01
USD	10,637,391	Government National Mortgage Association ' Series 2016-36 IO ' FRN 16/8/2057	788,551	0.01
USD	29,298,946	Government National Mortgage Association ' Series 2017-151 IO ' FRN 16/9/2057	1,848,031	0.02
USD	7,475,637	Government National Mortgage Association ' Series 2016-125 IO ' FRN 16/12/2057	587,566	0.01
USD	6,444,805	Government National Mortgage Association ' Series 2016-165 IO ' FRN 16/12/2057	505,226	0.01
USD	15,953,134	Government National Mortgage Association ' Series 2016-96 IO ' FRN 16/12/2057	1,183,171	0.01
USD	8,816,278	Government National Mortgage Association ' Series 2016-34 IO ' FRN 16/1/2058	671,879	0.01
USD	8,079,160	Government National Mortgage Association ' Series 2016-113 IO ' FRN 16/2/2058	730,861	0.01
USD	16,232,746	Government National Mortgage Association ' Series 2016-26 IO ' FRN 16/2/2058	1,128,284	0.01
USD	10,181,362	Government National Mortgage Association ' Series 2016-35 IO ' FRN 16/3/2058	698,798	0.01
USD	10,249,167	Government National Mortgage Association ' Series 2016-119 IO ' FRN 16/4/2058	845,805	0.01
USD	5,143,948	Government National Mortgage Association ' Series 2016-110 IO ' FRN 16/5/2058	396,145	0.00
USD	5,518,770	Government National Mortgage Association ' Series 2016-158 IO ' FRN 16/6/2058	395,048	0.00
USD	13,885,240	Government National Mortgage Association ' Series 2016-152 IO ' FRN 15/8/2058	1,044,903	0.01
USD	22,947,289	Government National Mortgage Association ' Series 2016-87 IO ' FRN 16/8/2058	1,716,379	0.02
USD	24,328,063	Government National Mortgage Association ' Series 2016-162 IO ' FRN 16/9/2058	1,952,938	0.02
USD	8,723,578	Government National Mortgage Association ' Series 2016-175 IO ' FRN 16/9/2058	630,736	0.01
USD	8,120,893	Government National Mortgage Association ' Series 2017-100 IO ' FRN 16/5/2059	531,391	0.01
USD	9,843,960	Government National Mortgage Association ' Series 2018-106 IO ' FRN 16/4/2060	536,649	0.01
USD	619,556	Government National Mortgage Association ' Series 2016-158 VA ' 2% 16/3/2035	567,364	0.01
USD	982,319	Government National Mortgage Association ' Series 2015-97 VA ' 2.25% 16/12/2038	916,557	0.01
USD	10,925,750	Government National Mortgage Association ' Series 2018-85 IO ' FRN 16/6/2060	617,669	0.01
USD	3,240,113	GPMT 2018-FL1 Ltd ' Series 2018-FL1 A ' ' 144A ' FRN 21/11/2035	3,228,330	0.03
USD	9,330,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust ' Series 2014-GRCE E ' ' 144A ' FRN 10/6/2028	9,280,301	0.09
USD	8,844,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust ' Series 2014-GRCE F ' ' 144A ' FRN 10/6/2028	8,723,654	0.09
USD	3,160,000	Grand Parkway Transportation Corp 5% 1/10/2043	3,594,927	0.04
USD	730,000	Grant County Public Utility District No 2 4.584% 1/1/2040	769,559	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 95,000	Graphic Packaging International LLC 4.75% 15/4/2021	96,781	0.00
USD 2,018,000	Great Lakes Dredge & Dock Corp 8% 15/5/2022	2,118,900	0.02
USD 500,000	Great Lakes Water Authority Water Supply System Revenue 5.25% 1/7/2033	583,065	0.01
USD 1,020,000	Greenpoint Manufactured Housing 'Series 1999-5 M1B' FRN 15/12/2029	1,086,582	0.01
USD 1,179,570	Greenpoint Manufactured Housing 'Series 1999-5 M2' FRN 15/12/2029	975,530	0.01
USD 1,716,501	GreenPoint Mortgage Funding Trust 2006-AR2 'Series 2006-AR2 4A1' FRN 25/3/2036	1,657,493	0.02
USD 820,000	Greystone Commercial Real Estate Notes 2017-FL1 Ltd 'Series 2017-FL1A A' '144A' FRN 15/3/2027	818,024	0.01
USD 630,000	Greywolf CLO IV Ltd 'Series 2014-2A BR' '144A' FRN 17/1/2027	630,169	0.01
USD 5,000,000	GS Mortgage Securities Corp II 'Series 2013-KING E' '144A' FRN 10/12/2027	4,962,335	0.05
USD 2,570,000	GS Mortgage Securities Corp II Series 2005-ROCK 'Series 2005-ROCK A' '144A' 5.366% 3/5/2032	2,858,099	0.03
USD 1,055,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2016-RENT 'Series 2016-RENT C' '144A' FRN 10/2/2029	1,061,325	0.01
USD 1,700,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2016-RENT 'Series 2016-RENT E' '144A' FRN 10/2/2029	1,692,402	0.02
USD 1,450,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K 'Series 2017-500K D' '144A' FRN 15/7/2032	1,451,834	0.01
USD 2,000,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K 'Series 2017-500K E' '144A' FRN 15/7/2032	1,991,036	0.02
USD 1,119,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K 'Series 2017-500K F' '144A' FRN 15/7/2032	1,110,083	0.01
USD 675,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K 'Series 2017-500K G' '144A' FRN 15/7/2032	673,087	0.01
USD 2,170,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-GPTX 'Series 2017-GPTX A' '144A' 2.856% 10/5/2034	2,146,776	0.02
USD 680,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-CHILL 'Series 2018-CHLL E' '144A' FRN 15/2/2037	677,935	0.01
USD 1,100,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-HULA 'Series 2018-HULA D' '144A' FRN 15/7/2025	1,094,209	0.01
USD 110,000	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20 'Series 2014-GC20 B' FRN 10/4/2047	110,546	0.00
USD 1,141,264	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20 'Series 2014-GC20 XA' FRN 10/4/2047	43,159	0.00
USD 1,129,000	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS7 'Series 2017-GS7 D' '144A' 3% 10/8/2050	987,972	0.01
USD 780,000	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS7 'Series 2017-GS7 E' '144A' 3% 10/8/2050	659,624	0.01
USD 488,902	GSAA Home Equity Trust 2007-2 'Series 2007-2 AF3' FRN 25/3/2037	170,150	0.00
USD 1,253,375	GSAMP Trust 2007-H1 'Series 2007-H1 A1B' FRN 25/1/2047	783,896	0.01
USD 2,000,000	GSAMP Trust 2007-HSBC1 'Series 2007-HS1 M6' FRN 25/2/2047	2,030,301	0.02
USD 1,311,207	GSMPS Mortgage Loan Trust 2005-RP1 'Series 2005-RP1 1AF' '144A' FRN 25/1/2035	1,222,949	0.01
USD 1,581,046	GSMPS Mortgage Loan Trust 2005-RP2 'Series 2005-RP2 1AF' '144A' FRN 25/3/2035	1,490,894	0.02
USD 1,210,497	GSMPS Mortgage Loan Trust 2006-RP1 'Series 2006-RP1 1AF1' '144A' FRN 25/1/2036	1,082,182	0.01
USD 215,031	Halcyon Loan Advisors Funding 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A A' '144A' FRN 1/8/2025	215,102	0.00
USD 250,000	Halcyon Loan Advisors Funding 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A C' '144A' FRN 1/8/2025	249,670	0.00
USD 1,083,000	Halliburton Co 3.8% 15/11/2025	1,090,460	0.01
USD 6,510,000	Halliburton Co 5% 15/11/2045	6,714,495	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 567,360	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-3 'Series 2007-3 2A1B' FRN 19/5/2047	461,763	0.00
USD 802,025	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-4 'Series 2007-4 2A2' FRN 19/7/2047	713,749	0.01
USD 685,000	HCA Healthcare Inc 6.25% 15/2/2021	718,394	0.01
USD 804,000	HCA Inc 4.25% 15/10/2019	809,268	0.01
USD 275,000	HCA Inc 4.5% 15/2/2027	276,912	0.00
USD 4,098,000	HCA Inc 4.75% 1/5/2023	4,245,958	0.04
USD 8,087,000	HCA Inc 5% 15/3/2024	8,436,030	0.09
USD 3,680,000	HCA Inc 5.25% 15/4/2025	3,892,346	0.04
USD 3,074,000	HCA Inc 5.25% 15/6/2026	3,233,558	0.03
USD 1,062,000	HCA Inc 5.875% 1/2/2029	1,112,445	0.01
USD 16,245,000	HCA Inc 6.5% 15/2/2020	16,727,808	0.17
USD 4,295,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 3.086% 15/9/2051	3,611,494	0.04
USD 1,065,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 3.651% 15/1/2046	1,029,360	0.01
USD 785,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 5% 15/11/2029	904,583	0.01
USD 5,934,000	Herc Rentals Inc '144A' 7.5% 1/6/2022	6,223,282	0.06
USD 5,708,000	Herc Rentals Inc '144A' 7.75% 1/6/2024*	6,100,425	0.06
USD 2,914,000	Hertz Corp/The 7.375% 15/1/2021	2,919,464	0.03
USD 320,000	Highbridge Loan Management 12-2018 Ltd 'Series 12A-18 A1B' '144A' FRN 18/7/2031	318,721	0.00
USD 650,000	Highbridge Loan Management 12-2018 Ltd 'Series 12A-18 D' '144A' FRN 18/7/2031	584,477	0.01
USD 250,000	Highbridge Loan Management 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A DR' '144A' FRN 20/10/2029	244,945	0.00
USD 750,000	Highbridge Loan Management 4-2014 Ltd 'Series 4A-2014 BR' '144A' FRN 28/1/2030	721,996	0.01
USD 360,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd '144A' FRN 5/2/2031	354,836	0.00
USD 2,470,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd 'Series 6A-2015 A1R' '144A' FRN 5/2/2031	2,434,572	0.03
USD 330,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd 'Series 7A-2015 CR' '144A' FRN 15/3/2027	324,274	0.00
USD 340,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd 'Series 7A-2015 DR' '144A' FRN 15/3/2027	320,308	0.00
USD 260,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd 'Series 7A-2015 ER' '144A' FRN 15/3/2027	245,973	0.00
USD 700,000	Hilton Orlando Trust 2018-ORL 'Series 2018-ORL E' '144A' FRN 15/12/2034	695,678	0.01
USD 95,000	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 4.625% 1/4/2025	94,925	0.00
USD 625,000	Home Depot Inc/The 4.875% 15/2/2044	691,956	0.01
USD 1,980,000	Home Equity Asset Trust 2007-1 'Series 2007-1 2A3' FRN 25/5/2037	1,629,723	0.02
USD 9,744,240	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2006-E 'Series 2006-E 2A3' FRN 25/4/2037	7,223,400	0.07
USD 1,985,797	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A 'Series 2007-A 2A2' FRN 25/4/2037	1,470,436	0.02
USD 3,961,671	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-B 'Series 2007-B 2A3' FRN 25/7/2037	2,631,322	0.03
USD 562,054	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series SPMD 2004-A 'Series 2004-A M2' FRN 25/7/2034	556,308	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 3,127,351	Home Equity Mortgage Trust 2006-2 (Step-up coupon) ' Series 2006-2 1A1 ' 5.867% 25/7/2036	1,040,270	0.01
USD 1,320,144	Home Loan Mortgage Loan Trust 2005-1 ' Series 2005-1 A3 ' FRN 15/4/2036	1,222,455	0.01
USD 1,000,000	HPS Loan Management 10-2016 Ltd ' Series 10A-16 D ' ' 144A ' FRN 20/1/2028	974,181	0.01
USD 1,630,000	Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust ' Series 2016-10HY A ' ' 144A ' 2.835% 10/8/2038	1,564,978	0.02
USD 1,706,000	Huntington National Bank/The 3.125% 1/4/2022	1,706,413	0.02
USD 1,595,000	Huntsman International LLC 5.125% 15/11/2022	1,670,762	0.02
USD 5,266,000	Hyundai Capital America ' 144A ' 3.95% 1/2/2022	5,320,503	0.05
USD 1,200,000	ICG US CLO 2015-1 Ltd ' Series 2015-1A A1R ' ' 144A ' FRN 19/10/2028	1,195,343	0.01
USD 970,000	Idaho Health Facilities Authority 5% 1/12/2047	1,083,524	0.01
USD 1,210,000	IMT Trust 2017-APTS ' Series 2017-APTS AFX ' ' 144A ' FRN 15/6/2034	1,222,796	0.01
USD 2,798,000	IMT Trust 2017-APTS ' Series 2017-APTS BFX ' ' 144A ' FRN 15/6/2034	2,778,708	0.03
USD 5,890,000	IMT Trust 2017-APTS ' Series 2017-APTS DFX ' ' 144A ' FRN 15/6/2034	5,753,323	0.06
USD 2,000,000	IMT Trust 2017-APTS ' Series 2017-APTS EFX ' ' 144A ' FRN 15/6/2034	1,877,068	0.02
USD 1,445,000	Indiana Finance Authority 5% 1/2/2035	1,710,064	0.02
USD 2,610,000	Indiana Finance Authority 5% 1/10/2045	2,884,011	0.03
USD 820,000	Indiana Housing & Community Development Authority 3.8% 1/7/2038	827,663	0.01
USD 5,464,348	IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust 2007-HOA1 ' Series 2007-HOA1 AXPP ' FRN 25/7/2047	259,466	0.00
USD 8,357,862	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-AR19 ' Series 2007-AR19 3A1 ' FRN 25/9/2037	5,894,180	0.06
USD 1,059,960	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-FLX5 ' Series 2007-FLX5 2A2 ' FRN 25/8/2037	944,901	0.01
USD 290,000	Intercontinental Exchange Inc 3.75% 1/12/2025	297,530	0.00
USD 1,515,000	Intercontinental Exchange Inc 3.75% 21/9/2028	1,543,355	0.02
USD 2,395,000	Intercontinental Exchange Inc 4.25% 21/9/2048	2,443,075	0.03
EUR 7,220,000	International Business Machines Corp 0.875% 31/1/2025	8,277,419	0.08
EUR 6,060,000	International Business Machines Corp 1.25% 29/1/2027	6,965,361	0.07
EUR 2,820,000	International Business Machines Corp 1.75% 31/1/2031	3,230,633	0.03
USD 3,810,000	Interpublic Group of Cos Inc/The 4.65% 1/10/2028	3,859,666	0.04
USD 560,000	InTown Hotel Portfolio Trust 2018-STAY ' Series 2018-STAY A ' ' 144A ' FRN 15/1/2033	556,110	0.01
USD 1,916,144	Invitation Homes 2018-SFR1 Trust ' Series 2018-SFR1 E ' ' 144A ' FRN 17/3/2037	1,904,658	0.02
USD 3,200,000	Invitation Homes 2018-SFR1 Trust ' Series 2018-SFR1 F ' ' 144A ' FRN 17/3/2037	3,177,487	0.03
USD 2,684,766	Invitation Homes 2018-SFR3 Trust ' Series 2018-SFR3 A ' ' 144A ' FRN 17/7/2037	2,694,264	0.03
USD 2,256,127	Invitation Homes 2018-SFR3 Trust ' Series 2018-SFR3 E ' ' 144A ' FRN 17/7/2037	2,242,055	0.02
EUR 2,350,000	IQVIA Inc 3.25% 15/3/2025	2,745,510	0.03
EUR 1,310,000	Iron Mountain Inc 3% 15/1/2025*	1,488,579	0.02
USD 277,000	Iron Mountain Inc ' 144A ' 4.375% 1/6/2021	277,693	0.00
USD 772,000	Iron Mountain Inc 6% 15/8/2023	796,125	0.01
USD 1,135,000	Iron Mountain US Holdings Inc ' 144A ' 5.375% 1/6/2026	1,103,788	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 1,329,211	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-3 (Step-up coupon) ' Series 2006-3 2A3 ' ' 144A ' 6.53% 25/9/2037	1,298,601	0.01
USD 373,175	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-P1 ' Series 2006-P1 1A ' ' 144A ' FRN 25/12/2036	358,120	0.00
USD 11,503,810	IXIS Real Estate Capital Trust 2007-HE1 ' Series 2007-HE1 A4 ' FRN 25/5/2037	4,083,962	0.04
USD 3,710,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE ' Series 2016-NINE A ' ' 144A ' FRN 6/10/2038	3,581,477	0.04
USD 1,770,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-MAUI ' Series 2017-MAUI D ' ' 144A ' FRN 15/7/2034	1,772,463	0.02
USD 4,170,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-MAUI ' Series 2017-MAUI E ' ' 144A ' FRN 15/7/2034	4,181,312	0.04
USD 2,900,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-MAUI ' Series 2017-MAUI F ' ' 144A ' FRN 15/7/2034	2,861,324	0.03
USD 1,090,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT ' Series 2018-WPT FFX ' ' 144A ' 5.542% 5/7/2033	1,093,087	0.01
USD 2,553,000	Jagged Peak Energy LLC ' 144A ' 5.875% 1/5/2026	2,598,699	0.03
USD 2,605,000	JobsOhio Beverage System 3.985% 1/1/2029	2,703,743	0.03
USD 438,564	JP Morgan Alternative Loan Trust 2007-A2 ' Series 2007-A2 2A1 ' FRN 25/5/2037	394,512	0.00
USD 400,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2012-CIBX ' Series 2012-CBX A4FL ' ' 144A ' FRN 15/6/2045	408,812	0.00
USD 1,910,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C20 ' Series 2014-C20 A5 ' 3.805% 15/7/2047	1,972,203	0.02
USD 2,230,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1 ' Series 2015-JP1 D ' FRN 15/1/2049	2,115,038	0.02
USD 3,100,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-UES ' Series 2015-UES D ' ' 144A ' FRN 5/9/2032	3,093,200	0.03
USD 4,957,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-UES ' Series 2015-UES E ' ' 144A ' FRN 5/9/2032	4,910,491	0.05
USD 10,620,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-JP3 ' Series 2016-JP3 XC ' ' 144A ' FRN 15/8/2049	497,813	0.01
USD 2,889,251	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-JP4 ' Series 2016-JP4 XA ' FRN 15/12/2049	110,326	0.00
USD 969,021	JP Morgan Madison Avenue Securities Trust Series 2014-1 ' Series 2014-CH1 M2 ' ' 144A ' FRN 25/11/2024	1,053,616	0.01
USD 960,000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2006-CW1 ' Series 2006-CW1 M1 ' FRN 25/5/2036	920,197	0.01
USD 16,401,715	JP Morgan Mortgage Trust 2017-3 ' Series 2017-3 1A6 ' ' 144A ' FRN 25/8/2047	16,139,133	0.16
USD 1,391,123	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C22 ' Series 2014-C22 XA ' FRN 15/9/2047	52,724	0.00
USD 450,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C22 ' Series 2014-C22 A4 ' 3.801% 15/9/2047	463,913	0.00
USD 1,213,157	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23 ' Series 2014-C23 XA ' FRN 15/9/2047	32,932	0.00
USD 2,054,347	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C26 ' Series 2014-C26 XA ' FRN 15/1/2048	83,729	0.00
USD 7,006,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C27 ' Series 2015-C27 XD ' ' 144A ' FRN 15/2/2048	177,077	0.00
USD 2,334,122	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C29 ' Series 2015-C29 XA ' FRN 15/5/2048	66,991	0.00
USD 1,480,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C33 ' Series 2015-C33 D1 ' ' 144A ' FRN 15/12/2048	1,412,667	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	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017-JP5 ' Series 2017-JP5 D ' ' 144A ' FRN 15/3/2050	1,340,315	0.01
USD 910,000	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017-JP6 ' Series 2017-JP6 A5 ' 3.49% 15/7/2050	913,807	0.01
USD 4,150,000	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2016-C4 ' Series 2016-C4 XC ' ' 144A ' FRN 15/12/2049	201,918	0.00
USD 1,090,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/5/2020 (Perpetual)	1,104,415	0.01
USD 1,896,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/2/2024 (Perpetual)	2,082,045	0.02
USD 9,825,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/4/2024	9,886,434	0.10
USD 1,620,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/7/2024	1,644,315	0.02
USD 10,715,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/2/2028	10,719,641	0.11
USD 12,715,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/4/2029	12,839,361	0.13
USD 22,011,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/7/2029	22,614,364	0.23
USD 15,512,000	JPMorgan Chase & Co FRN 5/12/2029	16,267,374	0.17
USD 320,000	JPMorgan Chase & Co FRN 22/2/2048	316,558	0.00
EUR 3,622,000	JPMorgan Chase & Co 2.625% 23/4/2021	4,353,831	0.04
USD 4,320,000	JPMorgan Chase & Co 3.25% 23/9/2022	4,355,799	0.04
USD 3,680,000	JPMorgan Chase & Co 4.5% 24/1/2022	3,827,457	0.04
USD 860,000	JPMorgan Chase & Co 5.4% 6/1/2042	987,548	0.01
USD 2,190,000	JPMorgan Chase Bank NA FRN 26/4/2021	2,190,392	0.02
USD 4,033,000	K Hovnanian Enterprises Inc ' 144A ' 10% 15/7/2022	3,296,978	0.03
USD 4,884,000	Kaiser Aluminum Corp 5.875% 15/5/2024	5,006,100	0.05
USD 3,976,000	Kaiser Foundation Hospitals 3.5% 1/4/2022	4,034,172	0.04
USD 526,000	Kaiser Foundation Hospitals 4.15% 1/5/2047	533,461	0.01
USD 2,000,000	Kayne CLO II Ltd ' Series 2018-2A A ' ' 144A ' FRN 15/10/2031	1,978,612	0.02
USD 847,000	KB Home 4.75% 15/5/2019	847,614	0.01
USD 1,362,000	KB Home 7.625% 15/5/2023	1,467,555	0.02
USD 150,000	KB Home 8% 15/3/2020	156,375	0.00
USD 690,000	Kentucky Economic Development Finance Authority 5.25% 1/6/2050	725,797	0.01
USD 1,100,000	Kentucky Turnpike Authority 5% 1/7/2020	1,146,888	0.01
USD 2,730,000	Keurig Dr Pepper Inc ' 144A ' 4.057% 25/5/2023	2,763,705	0.03
USD 4,406,000	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC ' 144A ' 5% 1/6/2024	4,461,075	0.05
USD 2,165,000	Kinder Morgan Energy Partners LP 3.5% 1/3/2021	2,178,472	0.02
USD 1,080,000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.8% 1/3/2021	1,131,801	0.01
USD 3,525,000	Kinder Morgan Inc/DE 5.55% 1/6/2045	3,704,081	0.04
USD 520,000	KKR CLO 12 Ltd ' 144A ' FRN 15/10/2030	498,922	0.01
USD 2,915,000	Kroger Co/The 4.5% 15/1/2029	2,943,023	0.03
USD 940,000	Lam Research Corp 3.75% 15/3/2026	942,566	0.01
USD 1,305,000	Lam Research Corp 4% 15/3/2029	1,306,404	0.01
USD 418,000	Lamar Media Corp 5.375% 15/1/2024	431,585	0.00
USD 950,000	Las Vegas Valley Water District 5% 1/6/2046	1,063,064	0.01
USD 270,444	LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2006-C4 ' Series 2006-C4 F ' FRN 15/6/2038	277,427	0.00
USD 24,837	LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2007-C6 ' Series 2007-C6 AMFL ' ' 144A ' 6.114% 15/7/2040	24,785	0.00
USD 4,030,000	LCCM 2014-909 Mortgage Trust ' Series 2014-909 E ' ' 144A ' FRN 15/5/2031	3,994,449	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	4,770,000	LCM 26 Ltd '144A' FRN 20/1/2031	4,736,256	0.05
USD	730,000	LCM XVIII LP '144A' FRN 20/4/2031	429,109	0.00
USD	1,000,000	LCM XX LP '144A' FRN 20/10/2027	996,252	0.01
USD	1,330,000	LCM XXI LP '144A' FRN 20/4/2028	1,320,634	0.01
USD	530,000	LCM XXI LP '144A' FRN 20/4/2028	519,092	0.01
USD	400,000	LCM XXIV Ltd '144A' FRN 20/3/2030	399,502	0.00
USD	387,092	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust 2002-A 'Series 2002-A C' 15/6/2033 (Zero Coupon)	305,088	0.00
USD	399,992	Lehman ABS Mortgage Loan Trust 'Series 2007-1 2A1' '144A' FRN 25/6/2037	285,707	0.00
USD	530,000	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2006-2 'Series 2006-2A M2' '144A' FRN 25/9/2036	512,830	0.01
USD	1,087,752	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-1 'Series 2007-1A 1A' '144A' FRN 25/3/2037	1,018,827	0.01
USD	1,092,138	Lehman XS Trust Series 2007-20N 'Series 2007-20N A1' FRN 25/12/2037	1,065,222	0.01
USD	10,055,000	Lendmark Funding Trust 2017-1 'Series 2017-1A A' '144A' 2.83% 22/12/2025	9,952,473	0.10
USD	2,200,000	Lendmark Funding Trust 2017-1 'Series 2017-1A B' '144A' 3.77% 22/12/2025	2,194,341	0.02
USD	15,454,000	Lendmark Funding Trust 2017-2 'Series 2017-2A A' '144A' 2.8% 20/5/2026	15,325,415	0.16
USD	620,000	Lendmark Funding Trust 2017-2 'Series 2017-2A B' '144A' 3.38% 20/5/2026	613,863	0.01
USD	1,267,000	Lendmark Funding Trust 2018-1 'Series 2018-1A A' '144A' 3.81% 21/12/2026	1,277,447	0.01
USD	18,000	Lennar Corp 2.95% 29/11/2020	17,707	0.00
USD	1,400,000	Lennar Corp 4.5% 15/6/2019	1,403,500	0.01
USD	1,002,000	Lennar Corp 4.5% 15/11/2019	1,005,757	0.01
USD	221,000	Lennar Corp 4.75% 1/4/2021	224,591	0.00
USD	8,953,000	Lennar Corp 4.75% 15/11/2022	9,154,443	0.09
USD	1,030,000	Lennar Corp 4.875% 15/12/2023	1,053,175	0.01
USD	60,000	Lennar Corp 5.25% 1/6/2026	60,375	0.00
USD	3,962,000	Lennar Corp 5.875% 15/11/2024	4,173,769	0.04
USD	162,000	Leonardo US Holdings Inc '144A' 7.375% 15/7/2039	165,645	0.00
USD	1,860,000	Level 3 Financing Inc 5.375% 15/8/2022	1,871,625	0.02
USD	396,000	Level 3 Financing Inc 6.125% 15/1/2021	398,970	0.00
USD	840,000	Lexington County Health Services District Inc 5% 1/11/2041	904,294	0.01
USD	4,060,815	LFRF '2015-1' '144A' 4% 30/10/2027	4,043,184	0.04
USD	454,000	LGI Homes Inc '144A' 6.875% 15/7/2026	451,730	0.00
USD	1,185,549	Limerock CLO III LLC 'Series 2014-3A A1R' '144A' FRN 20/10/2026	1,186,038	0.01
USD	2,165,000	Limerock CLO III LLC 'Series 2014-3A C' '144A' FRN 20/10/2026	2,101,577	0.02
USD	7,140,000	LoanCore 2018-CRE1 Issuer Ltd 'Series 2018-CRE1 A' '144A' FRN 15/5/2028	7,140,357	0.07
USD	363,791	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-10 'Series 2006-10 2A2' FRN 25/11/2036	148,403	0.00
USD	3,741,634	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-10 'Series 2006-10 2A3' FRN 25/11/2036	1,538,318	0.02
USD	1,331,040	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-10 'Series 2006-10 2A4' FRN 25/11/2036	552,273	0.01
USD	5,724,436	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-2 'Series 2006-2 1A' FRN 25/3/2046	4,283,348	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	5,181,791	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-3 ' Series 2006-3 2A3 ' FRN 25/5/2046	2,085,876	0.02
USD	11,280,785	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-4 ' Series 2006-4 2A3 ' FRN 25/5/2036	5,093,613	0.05
USD	3,641,508	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-5 ' Series 2006-5 2A3 ' FRN 25/6/2036	2,030,082	0.02
USD	5,796,992	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-7 ' Series 2006-7 2A3 ' FRN 25/8/2036	3,049,941	0.03
USD	2,529,000	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-8 ' Series 2006-8 2A3 ' FRN 25/9/2036	988,790	0.01
USD	1,338,594	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-9 ' Series 2006-9 2A2 ' FRN 25/10/2036	576,347	0.01
USD	5,141,178	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-9 ' Series 2006-9 2A3 ' FRN 25/10/2036	2,228,063	0.02
USD	1,629,072	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-9 ' Series 2006-9 2A4 ' FRN 25/10/2036	712,248	0.01
USD	1,660,000	Los Angeles Community College District/CA 6.6% 1/8/2042	2,306,055	0.02
USD	5,000,000	Los Angeles Department of Water 5% 1/7/2043	5,462,875	0.06
USD	1,015,000	Los Angeles Department of Water & Power Power System Revenue 6.603% 1/7/2050	1,463,427	0.02
USD	1,030,000	Louisiana Public Facilities Authority 5% 1/7/2048	1,137,177	0.01
USD	1,500,000	Louisville & Jefferson County Metropolitan Sewer District 5% 15/5/2025	1,772,738	0.02
USD	2,669,186	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5 ' Series 2017-5 X ' ' 144A ' FRN 10/3/2050	122,129	0.00
USD	4,815,035	LSTAR Securities Investment Ltd 2018-1 ' Series 2018-1 A ' ' 144A ' FRN 1/2/2023	4,854,920	0.05
USD	4,200,000	MAD Mortgage Trust 2017-330M ' Series 2017-330M D ' ' 144A ' FRN 15/8/2034	4,138,370	0.04
USD	6,600,000	MAD Mortgage Trust 2017-330M ' Series 2017-330M E ' ' 144A ' FRN 15/8/2034	6,428,103	0.07
USD	1,430,000	Madison Avenue Manufacturing Housing Contract Trust 2002-A ' Series 2002-A B2 ' FRN 25/3/2032	1,458,728	0.02
USD	6,600,000	Madison Avenue Trust 2013-650M ' Series 2013-650M D ' ' 144A ' FRN 12/10/2032	6,637,496	0.07
USD	7,964,000	Madison Park Funding X Ltd ' Series 2012-10A BR ' ' 144A ' FRN 20/1/2029	7,973,512	0.08
USD	2,530,000	Madison Park Funding X Ltd ' Series 2012-10A CR ' ' 144A ' FRN 20/1/2029	2,532,200	0.03
USD	520,000	Madison Park Funding X Ltd ' Series 2012-10A ER ' ' 144A ' FRN 20/1/2029	519,854	0.01
USD	380,000	Madison Park Funding XI Ltd ' Series 2013-11A ER ' ' 144A ' FRN 23/7/2029	369,373	0.00
USD	360,000	Madison Park Funding XII Ltd ' Series 2014-12A E ' ' 144A ' FRN 20/7/2026	359,956	0.00
USD	2,430,000	Madison Park Funding XIII Ltd ' Series 2014-13A AR2 ' ' 144A ' FRN 19/4/2030	2,410,848	0.02
USD	1,500,000	Madison Park Funding XIII Ltd ' Series 2014-13A ER ' ' 144A ' FRN 19/4/2030	1,442,613	0.01
USD	340,000	Madison Park Funding XV Ltd ' Series 2014-15A CR ' ' 144A ' FRN 27/1/2026	340,367	0.00
USD	300,000	Madison Park Funding XVI Ltd ' Series 2015-16A C ' ' 144A ' FRN 20/4/2026	300,407	0.00
USD	1,220,000	Madison Park Funding XVI Ltd ' Series 2015-16A D ' ' 144A ' FRN 20/4/2026	1,219,839	0.01
USD	5,430,000	Madison Park Funding XVIII Ltd ' Series 2015-18A A1R ' ' 144A ' FRN 21/10/2030	5,420,367	0.06
USD	700,000	Madison Park Funding XXX Ltd ' Series 2018-30A E ' ' 144A ' FRN 15/4/2029	660,042	0.01
USD	1,620,000	Marathon CRE 2018 FL1 Ltd FRN 15/6/2028	1,617,744	0.02
USD	1,240,000	Marathon Oil Corp 3.85% 1/6/2025	1,225,681	0.01
USD	815,000	Marsh & McLennan Cos Inc 3.5% 29/12/2020	822,689	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 1,180,000	Marsh & McLennan Cos Inc 3.875% 15/3/2024	1,210,657	0.01
USD 5,185,000	Marsh & McLennan Cos Inc 4.375% 15/3/2029	5,367,800	0.05
USD 2,095,000	Marsh & McLennan Cos Inc 4.9% 15/3/2049	2,219,797	0.02
USD 835,000	Maryland Health & Higher Educational Facilities Authority 5.25% 1/7/2027	945,942	0.01
USD 1,500,000	Maryland Stadium Authority 5% 1/5/2041	1,679,220	0.02
USD 790,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2039	904,443	0.01
USD 835,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2040	953,353	0.01
USD 880,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2041	1,002,588	0.01
USD 920,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2042	1,046,762	0.01
USD 740,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2043	839,959	0.01
USD 810,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2043	895,516	0.01
USD 2,785,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2044	3,042,250	0.03
USD 1,040,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2047	1,146,168	0.01
USD 2,600,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2048	2,859,025	0.03
USD 2,280,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2053	2,488,882	0.03
USD 500,000	Massachusetts Educational Financing Authority 5% 1/1/2022	539,553	0.01
USD 860,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.5% 1/12/2039	887,847	0.01
USD 1,060,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.5% 1/12/2048	1,099,034	0.01
USD 910,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.6% 1/12/2044	938,615	0.01
USD 1,500,000	Massachusetts Port Authority 5% 1/7/2043	1,659,255	0.02
USD 870,000	Massachusetts Water Resources Authority 5% 1/8/2040	988,490	0.01
USD 4,870,380	Mastr Asset Backed Securities Trust 2006-HE2 ' Series 2006-HE2 A3 ' FRN 25/6/2036	2,671,920	0.03
USD 1,401,845	Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE1 ' Series 2007-HE1 A4 ' FRN 25/5/2037	1,192,901	0.01
USD 669,354	MASTR Resecuritization Trust 2008-3 ' Series 2008-3 A1 ' ' 144A ' FRN 25/8/2037	492,005	0.01
USD 581,565	Mastr Specialized Loan Trust ' Series 2006-3 A ' ' 144A ' FRN 25/6/2046	548,958	0.01
EUR 400,000	McDonald ' s Corp 0.5% 15/1/2021	459,569	0.00
USD 4,320,000	McDonald ' s Corp 2.625% 15/1/2022	4,293,595	0.04
USD 4,320,000	McDonald ' s Corp 3.35% 1/4/2023	4,354,354	0.04
USD 4,380,000	McDonald ' s Corp 3.7% 30/1/2026	4,417,287	0.05
USD 2,165,000	McDonald ' s Corp 3.8% 1/4/2028	2,169,350	0.02
USD 475,000	McDonald ' s Corp 4.7% 9/12/2035	490,521	0.01
USD 4,478,000	McDonald ' s Corp 4.875% 9/12/2045	4,610,079	0.05
USD 10,647,290	MCM Capital _ 18-NPL2 4% 25/10/2028	10,508,875	0.11
USD 15,468,402	MCM _ 18-NPL1 4% 1/6/2057	15,440,922	0.16
USD 1,513,000	Mercy Health/OH 4.302% 1/7/2028	1,562,238	0.02
USD 3,074,000	Meritor Inc 6.25% 15/2/2024	3,131,637	0.03
USD 2,202,998	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust Series 2007-OAR2 ' Series 2007-OAR2 A2 ' FRN 25/4/2037	1,892,314	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 6,283,197	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-2 'Series 2007-2 A2C' FRN 25/5/2037	4,214,157	0.04
USD 920,525	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2006-RM3 'Series 2006-RM3 A2B' FRN 25/6/2037	278,862	0.00
USD 944,820	Merrill Lynch Mortgage Trust 2005-CIP1 'Series 2005-CIP1 D' FRN 12/7/2038	960,244	0.01
USD 1,070,000	Merrill Lynch Mortgage Trust 2005-MKB2 'Series 2005-MKB2 F' '144A' FRN 12/9/2042	1,091,198	0.01
USD 1,400,000	Mesquite Independent School District 5% 15/8/2042	1,574,531	0.02
USD 1,290,000	Metropolitan Atlanta Rapid Transit Authority 5% 1/7/2045	1,456,223	0.02
USD 770,000	Metropolitan Government Nashville & Davidson County Health & Educational Facs Bd 5% 1/7/2040	846,738	0.01
USD 1,400,000	Metropolitan Government Nashville & Davidson County Health & Educational Facs Bd 5% 1/7/2046	1,531,754	0.02
USD 1,880,000	Metropolitan Life Global Funding I '144A' 3.375% 11/1/2022	1,892,980	0.02
USD 2,100,000	Metropolitan St Louis Sewer District 5% 1/5/2042	2,406,222	0.02
USD 2,100,000	Metropolitan St Louis Sewer District 5% 1/5/2047	2,396,919	0.02
USD 1,400,000	Metropolitan Transportation Authority 5% 15/11/2042	1,593,487	0.02
USD 740,000	Metropolitan Transportation Authority 5% 15/11/2045	805,642	0.01
USD 1,360,000	Metropolitan Transportation Authority 6.687% 15/11/2040	1,772,753	0.02
USD 2,350,000	Metropolitan Washington Airports Authority 5% 1/10/2032	2,687,354	0.03
USD 2,950,000	Metropolitan Washington Airports Authority 5% 1/10/2048	3,310,475	0.03
USD 1,000,000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 5% 1/10/2053	1,034,660	0.01
USD 1,280,000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 7.462% 1/10/2046	1,838,394	0.02
USD 5,854,000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.625% 1/5/2024	6,066,207	0.06
USD 143,000	MGM Resorts International 5.25% 31/3/2020	145,896	0.00
USD 1,640,000	Miami-Dade County Educational Facilities Authority 5% 1/4/2048	1,834,963	0.02
USD 880,000	Michigan Finance Authority 5% 1/6/2039	964,577	0.01
USD 700,000	Michigan Finance Authority 5% 15/11/2041	760,410	0.01
USD 1,220,000	Michigan Finance Authority 5% 1/12/2047	1,308,578	0.01
USD 937,000	Micron Technology Inc 4.64% 6/2/2024	943,543	0.01
USD 5,780,000	Micron Technology Inc 5.327% 6/2/2029	5,781,073	0.06
USD 1,985,000	Microsoft Corp 2.875% 6/2/2024	1,988,557	0.02
USD 1,360,000	Microsoft Corp 3.95% 8/8/2056	1,342,041	0.01
USD 5,645,000	Microsoft Corp 4.25% 6/2/2047	6,018,717	0.06
USD 3,197,000	Mid-America Apartments LP 3.95% 15/3/2029	3,184,961	0.03
USD 1,170,000	MidAmerican Energy Co 4.25% 15/7/2049	1,202,243	0.01
USD 1,370,000	MidOcean Credit CLO III 'Series 2014-3A A3A2' '144A' FRN 21/4/2031	1,343,895	0.01
USD 500,000	Mill Creek II CLO Ltd 'Series 2016-1A C' '144A' FRN 20/4/2028	501,139	0.01
USD 500,000	Mill Creek II CLO Ltd 'Series 2016-1A E' '144A' FRN 20/4/2028	502,364	0.01
USD 1,330,000	Mississippi Hospital Equipment & Facilities Authority 5% 1/9/2046	1,426,711	0.01
EUR 360,000	Molson Coors Brewing Co FRN 15/3/2019	409,880	0.00
EUR 200,000	Mondelez International Inc 2.375% 26/1/2021	237,520	0.00
USD 3,440,000	Montefiore Obligated Group 5.246% 1/11/2048	3,461,926	0.04
USD 1,740,000	Morgan Stanley FRN 15/7/2020 (Perpetual)	1,747,543	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 11,325,000	Morgan Stanley FRN 24/4/2024	11,429,453	0.12
USD 27,890,000	Morgan Stanley FRN 24/1/2029*	27,476,174	0.28
USD 26,164,000	Morgan Stanley FRN 23/1/2030	27,039,849	0.28
EUR 9,698,000	Morgan Stanley 2.375% 31/3/2021	11,561,864	0.12
USD 4,320,000	Morgan Stanley 2.75% 19/5/2022	4,260,912	0.04
USD 2,380,000	Morgan Stanley 3.125% 23/1/2023	2,364,491	0.02
EUR 2,400,000	Morgan Stanley 5.375% 10/8/2020	2,945,060	0.03
USD 3,308,877	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2005-HE5 'Series 2005-HE5 M4' FRN 25/9/2035	1,451,336	0.01
USD 11,100,071	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2007-NC1 'Series 2007-NC1 A1' FRN 25/11/2036	6,585,161	0.07
USD 11,026,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 'Series 2014-C19 XD' '144A' FRN 15/12/2047	677,670	0.01
USD 3,830,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 'Series 2014-C19 XF' '144A' FRN 15/12/2047	203,890	0.00
USD 1,300,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C16 'Series 2014-C16 A5' 3.892% 15/6/2047	1,343,417	0.01
USD 3,510,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C21 'Series 2015-C21 XB' '144A' FRN 15/3/2048	64,208	0.00
USD 25,169,988	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C22 'Series 2015-C22 XA' FRN 15/4/2048	1,206,944	0.01
USD 204,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C23 'Series 2015-C23 D' '144A' FRN15/7/2050	189,692	0.00
USD 973,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C23 'Series 2015-C23 A4' 3.719% 15/7/2050	998,756	0.01
USD 220,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 'Series 2015-C25 C' FRN 15/10/2048	224,033	0.00
USD 5,350,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 'Series 2015-C26 XD' '144A' FRN 15/10/2048	416,417	0.00
USD 1,023,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 'Series 2015-C26 D' '144A' 3.06% 15/10/2048	890,316	0.01
USD 2,182,676	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C31 'Series 2016-C31 XA' FRN 15/11/2049	172,901	0.00
USD 660,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C33 'Series 2017-C33 C' FRN 15/5/2050	654,669	0.01
USD 780,000	Morgan Stanley Capital Barclays Bank Trust 2016-MART 'Series 2016-MART A' '144A' 2.2% 13/9/2031	765,828	0.01
USD 380,000	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 'Series 2017-HR2 D' 2.73% 15/12/2050	312,286	0.00
USD 1,460,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2006-IQ11 'Series 2006-IQ11 C' FRN 15/10/2042	1,502,689	0.02
USD 127,030	Morgan Stanley Capital I Trust 2006-TOP21 'Series 2006-T21 AJ' FRN 12/10/2052	127,520	0.00
USD 471,899	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-TOP27 'Series 2007-T27 AJ' FRN 11/6/2042	497,121	0.01
USD 1,400,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-150E 'Series 2014-150E F' '144A' FRN 9/9/2032	1,395,031	0.01
USD 200,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-CPT 'Series 2014-CPT E' '144A' FRN 13/7/2029	198,460	0.00
USD 3,500,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-CPT 'Series 2014-CPT F' '144A' FRN 13/7/2029	3,444,502	0.04
USD 1,750,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-CPT 'Series 2014-CPT G' '144A' FRN 13/7/2029	1,707,023	0.02
USD 360,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2015-MS1 'Series 2015-MS1 C' FRN 15/5/2048	358,659	0.00
USD 250,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2015-MS1 'Series 2015-MS1 D' '144A' FRN 15/5/2048	229,541	0.00
USD 5,480,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-CLS 'Series 2017-CLS F' '144A' FRN 15/11/2034	5,390,813	0.06

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 510,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 'Series 2017-H1 C' FRN 15/6/2050	495,987	0.01
USD 2,640,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 'Series 2017-H1 XD' '144A' FRN 15/6/2050	398,152	0.00
USD 580,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 'Series 2017-H1 A5' 3.53% 15/6/2050	581,949	0.01
USD 920,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-JWDR 'Series 2017-JWDR D' '144A' FRN 15/11/2034	920,560	0.01
USD 1,710,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-JWDR 'Series 2017-JWDR E' '144A' FRN 15/11/2034	1,714,310	0.02
USD 1,280,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 'Series 2018-H3 C' FRN 15/7/2051	1,296,031	0.01
USD 880,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 'Series 2018-H3 D' '144A' 3% 15/7/2051	733,235	0.01
USD 1,510,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 'Series 2018-H3 A5' 4.177% 15/7/2051	1,583,744	0.02
USD 1,470,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 'Series 2018-MP E' '144A' FRN 11/7/2040	1,356,767	0.01
USD 2,010,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 'Series 2018-SUN F' '144A' FRN 15/7/2035	1,981,368	0.02
USD 1,099,257	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2007-9SL 'Series 2007-9SL A' FRN 25/7/2037	1,047,907	0.01
USD 8,000,995	Mortgage Loan Resecuritization Trust 'Series 2009-RS1 A85' '144A' FRN 16/4/2036	7,118,203	0.07
USD 4,643,520	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS 'Series 2018-2GS A' '144A' 4.2% 22/2/2044	4,659,443	0.05
USD 10,000,000	Mosaic Solar Loan Trust 2019-1 'Series 2019-1A A' '144A' 4.37% 21/12/2043	10,089,069	0.10
USD 3,920,000	Mountain Hawk II CLO Ltd 'Series 2013-2A BR' '144A' FRN 20/7/2024	3,925,642	0.04
USD 2,904,324	Mountain Hawk III CLO Ltd 'Series 2014-3A AR' '144A' FRN 18/4/2025	2,905,800	0.03
USD 1,895,000	MP CLO VII Ltd 'Series 2015-1A ARR' '144A' FRN 18/10/2028	1,884,432	0.02
EUR 750,000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.325% 24/3/2025	887,206	0.01
USD 1,305,000	National Retail Properties Inc 4.3% 15/10/2028	1,331,206	0.01
USD 3,545,000	National Retail Properties Inc 4.8% 15/10/2048	3,552,437	0.04
USD 204,103	Nationstar Home Equity Loan Trust 2007-C 'Series 2007-C 2AV3' FRN 25/6/2037	203,272	0.00
USD 740,000	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2018-FL1 'Series 2018-FL1 A' '144A' FRN 15/6/2035	736,548	0.01
USD 3,020,000	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-AA B' '144A' 3.5% 15/8/2044	2,949,091	0.03
USD 4,895,000	Navient Private Education Loan Trust 2014-CT 'Series 2014-CTA B' '144A' FRN 17/10/2044	4,956,303	0.05
USD 2,278,000	Navient Private Education Loan Trust 2015-A 'Series 2015-AA B' '144A' 3.5% 15/12/2044	2,218,283	0.02
USD 5,000,000	Navient Private Education Loan Trust 2015-B 'Series 2015-BA A3' '144A' FRN 16/7/2040	5,054,351	0.05
USD 1,573,534	Navient Private Education Loan Trust 2015-C 'Series 2015-CA B' '144A' 3.25% 15/5/2040	1,573,165	0.02
USD 6,630,000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2018-D 'Series 2018-DA A2A' '144A' 4% 15/12/2059	6,805,891	0.07
USD 4,689,000	Navient Student Loan Trust 2018-EA 'Series 2018-EA A2' '144A' 4% 15/12/2059	4,817,128	0.05
USD 1,425,000	NBCUniversal Enterprise Inc '144A' 5.25% 19/3/2021 (Perpetual)	1,440,084	0.01
USD 2,160,000	NBCUniversal Media LLC 4.45% 15/1/2043	2,148,372	0.02
USD 1,119,000	NCR Corp 5% 15/7/2022	1,120,813	0.01
USD 4,355,000	Nestle Holdings Inc '144A' 3.5% 24/9/2025	4,437,530	0.05
USD 2,875,000	Nestle Holdings Inc '144A' 3.625% 24/9/2028	2,934,474	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 780,000	Neuberger Berman CLO XVI-S Ltd 'Series 2017-16SA A' '144A' FRN 15/1/2028	774,570	0.01
USD 350,000	Neuberger Berman CLO XVI-S Ltd 'Series 2017-16SA D' '144A' FRN 15/1/2028	335,435	0.00
USD 439,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd 'Series 2015-20A AR' '144A' FRN 15/1/2028	434,569	0.00
USD 260,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd 'Series 2015-20A ER' '144A' FRN 15/1/2028	247,834	0.00
USD 7,100,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 Ltd 'Series 2017-26A A' '144A' FRN 18/10/2030	7,057,060	0.07
USD 300,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 28 Ltd 'Series 2018-28A E' '144A' FRN 20/4/2030	278,845	0.00
USD 7,240,000	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B 'Series 2005-B M1' FRN 25/10/2035	6,996,524	0.07
USD 1,150,000	New Hope Cultural Education Facilities Finance Corp 5% 15/8/2047	1,289,110	0.01
USD 780,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5% 15/6/2029	878,307	0.01
USD 3,615,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 6.104% 15/12/2028	3,740,187	0.04
USD 1,360,000	New Orleans Aviation Board 5% 1/1/2040	1,483,937	0.02
USD 770,000	New York City Transitional Finance Authority Building Aid Revenue 5% 15/7/2040	863,878	0.01
USD 3,695,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.05% 1/5/2027	3,593,036	0.04
USD 4,740,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.55% 1/5/2025	4,795,861	0.05
USD 2,180,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.9% 1/8/2031	2,206,400	0.02
USD 400,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5% 1/8/2031	467,462	0.00
USD 860,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5% 1/2/2035	983,208	0.01
USD 820,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5% 1/5/2036	937,112	0.01
USD 3,410,000	New York City Water & Sewer System 5% 15/6/2039	3,953,707	0.04
USD 4,245,000	New York City Water & Sewer System 5% 15/6/2047	4,791,777	0.05
USD 1,590,000	New York City Water & Sewer System 5.44% 15/6/2043	1,961,988	0.02
USD 1,570,000	New York City Water & Sewer System 5.75% 15/6/2041	1,995,760	0.02
USD 780,000	New York Convention Center Development Corp 5% 15/11/2040	883,221	0.01
USD 1,950,000	New York Convention Center Development Corp 5% 15/11/2046	2,199,834	0.02
USD 2,000,000	New York Liberty Development Corp '144A' 5% 15/11/2044	2,086,500	0.02
USD 1,600,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2036	1,854,992	0.02
USD 760,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2037	877,222	0.01
USD 740,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2038	850,556	0.01
USD 740,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2039	847,792	0.01
USD 2,590,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2039	2,995,801	0.03
USD 700,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2040	798,959	0.01
USD 1,600,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2041	1,822,104	0.02
USD 1,640,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2041	1,885,131	0.02
USD 2,160,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2042	2,454,710	0.03
USD 1,640,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2042	1,880,990	0.02
USD 1,640,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2043	1,877,136	0.02
USD 940,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2043	1,062,703	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 2,500,000	New York State Urban Development Corp 2.86% 15/3/2024	2,489,875	0.03
USD 2,400,000	New York State Urban Development Corp 3.12% 15/3/2025	2,393,352	0.02
USD 3,655,000	New York State Urban Development Corp 3.32% 15/3/2029	3,560,281	0.04
USD 1,800,000	New York Transportation Development Corp 5% 1/8/2020	1,860,291	0.02
USD 620,000	New York Transportation Development Corp 5% 1/7/2046	657,383	0.01
USD 4,940,000	New York Transportation Development Corp 5.25% 1/1/2050	5,285,874	0.05
USD 3,640,000	Newfield Exploration Co 5.375% 1/1/2026	3,844,750	0.04
USD 2,805,000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 3.342% 1/9/2020	2,820,033	0.03
USD 1,532,000	NGPL PipeCo LLC '144A' 4.375% 15/8/2022	1,558,810	0.02
USD 169,000	NGPL PipeCo LLC '144A' 4.875% 15/8/2027	170,901	0.00
USD 6,570,000	NGPL PipeCo LLC '144A' 7.768% 15/12/2037	7,875,788	0.08
USD 100,000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co 4.5% 1/10/2020	100,250	0.00
USD 4,639,000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A' 5% 15/4/2022	4,662,195	0.05
USD 359,557	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2001-R1A 'Series 2001-R1A A' '144A' FRN 19/2/2030	363,434	0.00
USD 538,048	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2006-AF1 (Step-up coupon) 'Series 2006-AF1 1A4' 6.634% 25/5/2036	200,006	0.00
USD 326,665	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2006-S5 'Series 2006-S5 A1' '144A' FRN 25/10/2036	293,820	0.00
USD 2,415,165	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2007-2 'Series 2007-2 A4' FRN 25/6/2037	2,061,337	0.02
USD 1,070,000	North Carolina Turnpike Authority 5% 1/1/2035	1,242,184	0.01
USD 1,090,000	North Texas Tollway Authority 5% 1/1/2043	1,228,812	0.01
USD 1,357,385	Northern Oil and Gas Inc 9.5% 15/5/2023	1,394,985	0.01
USD 67,013	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	69,504	0.00
USD 2,734,000	NRG Energy Inc '144A' 2.75% 1/6/2048	3,037,676	0.03
USD 142,000	NRG Energy Inc 6.25% 1/5/2024	147,502	0.00
USD 1,870,000	Oaktree CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A A1R' '144A' ' FRN 20/10/2027	1,855,318	0.02
USD 2,000,000	Oaktree CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A DR' '144A' ' FRN 20/10/2027	1,926,644	0.02
USD 733,233	Oakwood Mortgage Investors Inc (Defaulted) 'Series 2001-D A2' FRN 15/1/2019	548,393	0.01
USD 605,408	Oakwood Mortgage Investors Inc 'Series 2001-D A4' FRN 15/9/2031	514,940	0.01
USD 5,313,000	Oasis Petroleum Inc 6.875% 15/3/2022*	5,319,641	0.05
USD 1,471,000	Ochsner Clinic Foundation 5.897% 15/5/2045	1,783,116	0.02
USD 460,000	OCP CLO 2014-5 Ltd 'Series 2014-5A A1R' '144A' FRN 26/4/2031	453,255	0.00
USD 1,750,000	OCP CLO 2015-10 Ltd 'Series 2015-10A BR' '144A' FRN 26/10/2027	1,695,731	0.02
USD 2,057,000	OCP CLO 2016-12 Ltd FRN 18/10/2028	2,043,638	0.02
USD 440,000	OCP CLO 2016-12 Ltd FRN 18/10/2028	421,382	0.00
USD 920,000	OCP CLO 2017-13 Ltd 'Series 2017-13A D' '144A' FRN 15/7/2030	881,737	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	5,200,000	Octagon Investment Partners 18-R Ltd 'Series 2018-18A A1A' '144A' FRN 16/4/2031	5,123,367	0.05
USD	7,960,000	Octagon Investment Partners 24 Ltd 'Series 2015-1A A1R' '144A' FRN 21/5/2027	7,925,097	0.08
USD	2,220,000	Octagon Investment Partners 24 Ltd 'Series 2015-1A A2AR' '144A' FRN 21/5/2027	2,218,968	0.02
USD	940,000	Octagon Investment Partners 24 Ltd 'Series 2015-1A D' '144A' FRN 21/5/2027	939,679	0.01
USD	250,000	Octagon Investment Partners 30 Ltd 'Series 2017-1A D' '144A' FRN 17/3/2030	244,270	0.00
USD	1,000,000	OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 31 LLC 'Series 2017-1A E' '144A' FRN 20/7/2030	976,954	0.01
USD	448,000	OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 31 LLC 'Series 2017-1A F' '144A' FRN 20/7/2030	422,931	0.00
USD	1,625,000	Octagon Investment Partners 33 Ltd 'Series 2017-1A A1' '144A' FRN 20/1/2031	1,620,532	0.02
USD	4,335,000	Octagon Investment Partners XVII Ltd 'Series 2013-1A A1R2' '144A' FRN 25/1/2031	4,285,963	0.04
USD	882,578	Octagon Investment Partners XX Ltd 'Series 2014-1A AR' '144A' FRN 12/8/2026	882,789	0.01
USD	1,120,000	Octagon Investment Partners XXIII Ltd FRN 15/7/2027	1,103,207	0.01
USD	530,000	Octagon Investment Partners XXIII Ltd '144A' FRN 15/7/2027	520,819	0.01
USD	7,105,000	OFSI Fund VI Ltd '144A' FRN 20/3/2025	7,042,789	0.07
USD	670,000	OFSI Fund VI Ltd 'Series 2014-6A CR' '144A' FRN 20/3/2025	656,288	0.01
USD	262,561	OHA Credit Partners IX Ltd 'Series 2013-9A A1R' '144A' FRN 20/10/2025	262,590	0.00
USD	260,000	OHA Credit Partners XIII Ltd 'Series 2016-13A E' '144A' FRN 21/1/2030	261,271	0.00
USD	1,360,000	OHA Loan Funding 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A AR' '144A' FRN 23/5/2031	1,341,193	0.01
USD	1,158,000	OHA Loan Funding 2016-1 Ltd 'Series 2016-1A B1' '144A' FRN 20/1/2028	1,153,051	0.01
USD	6,395,000	OHA Loan Funding 2016-1 Ltd 'Series 2016-1A C' '144A' FRN 20/1/2028	6,410,819	0.07
USD	7,920,000	OHA Loan Funding 2016-1 Ltd 'Series 2016-1A D' '144A' FRN 20/1/2028	7,919,259	0.08
USD	1,662,000	OHA Loan Funding 2016-1 Ltd 'Series 2016-1A E' '144A' FRN 20/1/2028	1,630,749	0.02
USD	1,780,000	Ohio Turnpike & Infrastructure Commission 5% 15/2/2048	1,913,509	0.02
USD	1,000,000	Oklahoma Development Finance Authority 5.25% 15/8/2043	1,100,380	0.01
USD	500,000	Oklahoma Development Finance Authority 5.25% 15/8/2048	548,088	0.01
USD	4,480,000	Oklahoma Development Finance Authority 5.5% 15/8/2057	4,949,078	0.05
USD	3,000,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 'Series 2017-OT E' '144A' FRN 10/5/2039	2,789,359	0.03
USD	29,500,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 'Series 2017-OT XA' '144A' FRN 10/5/2039	885,737	0.01
USD	43,880,000	One Market Plaza Trust 2017-1MKT 'Series 2017-1MKT XCP' '144A' FRN 10/2/2032	186,929	0.00
USD	8,776,000	One Market Plaza Trust 2017-1MKT 'Series 2017-1MKT XNCP' '144A' FRN 10/2/2032	88	0.00
USD	2,733,000	OneMain Financial Issuance Trust 2015-1 'Series 2015-1A C' '144A' 5.12% 18/3/2026	2,763,764	0.03
USD	320,531	OneMain Financial Issuance Trust 2015-2 'Series 2015-2A B' '144A' 3.1% 18/7/2025	320,875	0.00
USD	8,170,000	OneMain Financial Issuance Trust 2015-2 'Series 2015-2A C' '144A' 4.32% 18/7/2025	8,177,023	0.08
USD	810,000	OneMain Financial Issuance Trust 2016-1 'Series 2016-1A B' '144A' 4.57% 20/2/2029	820,592	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 1,600,000	OneMain Financial Issuance Trust 2016-2 'Series 2016-2A B' '144A' 5.94% 20/3/2028	1,616,089	0.02
USD 1,362,438	Option One Mortgage Loan Trust 2006-3 'Series 2006-3 1A1' FRN 25/2/2037	959,388	0.01
USD 1,950,000	Option One Mortgage Loan Trust 2007-CP1 'Series 2007-CP1 2A3' FRN 25/3/2037	1,302,757	0.01
USD 2,782,079	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 (Step-up coupon) 'Series 2007-FXD1 1A1' 5.866% 25/1/2037	2,613,979	0.03
USD 7,450,975	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 (Step-up coupon) 'Series 2007-FXD1 2A1' 5.866% 25/1/2037	7,019,009	0.07
USD 10,587,715	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD2 (Step-up coupon) 'Series 2007-FXD2 1A1' 5.82% 25/3/2037	10,505,205	0.11
EUR 300,000	Oracle Corp 2.25% 10/1/2021	355,994	0.00
USD 4,320,000	Oracle Corp 2.5% 15/5/2022	4,271,666	0.04
USD 650,000	Oracle Corp 2.65% 15/7/2026	618,668	0.01
USD 5,130,000	Oracle Corp 2.95% 15/11/2024	5,088,587	0.05
USD 2,160,000	Oracle Corp 5.375% 15/7/2040	2,491,327	0.03
USD 2,160,000	Oracle Corp 6.125% 8/7/2039	2,675,085	0.03
USD 3,255,000	Orange County Local Transportation Authority 6.908% 15/2/2041	4,308,139	0.04
USD 3,695,000	Oregon School Boards Association 4.759% 30/6/2028	3,977,002	0.04
USD 1,995,000	Oregon School Boards Association 5.49% 30/6/2023	2,213,792	0.02
USD 680,468	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2001-A 'Series 2001-A M1' FRN 15/3/2032	672,422	0.01
USD 1,996,420	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2007-B 'Series 2007-B A1' '144A' FRN 15/10/2037	1,979,664	0.02
USD 449,000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp 5.25% 15/2/2022	456,296	0.00
USD 168,000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp 5.625% 15/2/2024	173,250	0.00
USD 1,590,000	Ownit Mortgage Loan Trust Series 2006-2 (Step-up coupon) 'Series 2006-2 A2C' 6% 25/1/2037	1,454,461	0.02
USD 2,060,000	OZLM Funding III Ltd 'Series 2013-3A BR' '144A' FRN 22/1/2029	2,065,021	0.02
USD 2,850,000	OZLM Funding IV Ltd 'Series 2013-4A A1R' '144A' FRN 22/10/2030	2,831,126	0.03
USD 290,000	OZLM Funding IV Ltd 'Series 2013-4A A2R' '144A' FRN 22/10/2030	287,364	0.00
USD 1,640,000	OZLM Funding Ltd 'Series 2012-1X SUB' FRN 22/7/2029	636,805	0.01
USD 3,200,000	OZLM VI Ltd 'Series 2014-6A SUB' '144A' FRN 17/4/2031	1,504,826	0.02
USD 1,250,000	OZLM VIII Ltd 'Series 2014-8A BRR' '144A' FRN 17/10/2029	1,250,735	0.01
USD 1,065,000	OZLM VIII Ltd 'Series 2014-8A CRR' '144A' FRN 17/10/2029	1,062,603	0.01
USD 1,630,000	OZLM XIV Ltd 'Series 2015-14A B1R' '144A' FRN 15/1/2029	1,617,616	0.02
USD 2,190,000	OZLM XIV Ltd 'Series 2015-14A CR' '144A' FRN 15/1/2029	2,130,956	0.02
USD 660,000	OZLM XIV Ltd 'Series 2015-14A DR' '144A' FRN 15/1/2029	621,117	0.01
USD 2,250,000	OZLM XIX Ltd 'Series 2017-19A A1' '144A' FRN 22/11/2030	2,248,616	0.02
USD 2,120,000	OZLM XV Ltd 'Series 2016-15A A1' '144A' FRN 20/1/2029	2,122,661	0.02
USD 830,000	OZLM XV Ltd 'Series 2016-15A A2A' '144A' FRN 20/1/2029	830,770	0.01
USD 440,000	OZLM XV Ltd 'Series 2016-15A C' '144A' FRN 20/1/2029	440,708	0.00
USD 440,000	OZLM XV Ltd 'Series 2016-15A D' '144A' FRN 20/1/2029	439,924	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 250,000	OZLM XVIII Ltd 'Series 2018-18A SUB' '144A' FRN 15/4/2031	220,429	0.00
USD 2,815,000	PacifiCorp 3.5% 15/6/2029	2,820,564	0.03
USD 2,830,000	PacifiCorp 4.15% 15/2/2050	2,801,381	0.03
USD 580,000	Palmer Square CLO 2014-1 Ltd 'Series 2014-1A A1R2' '144A' FRN 17/1/2031	575,204	0.01
USD 250,000	Palmer Square CLO 2015-2 Ltd 'Series 2015-2A CR' '144A' FRN 20/7/2030	249,196	0.00
USD 630,000	Palmer Square CLO 2015-2 Ltd 'Series 2015-2A DR' '144A' FRN 20/7/2030	618,721	0.01
USD 2,090,000	Palmer Square CLO 2018-1 Ltd 'Series 2018-1A A1' '144A' FRN 18/4/2031	2,061,777	0.02
USD 3,502,000	Palmer Square CLO 2018-3 Ltd 'Series 2018-3A A2' '144A' FRN 15/8/2026	3,447,277	0.04
USD 1,280,000	Palmer Square Loan Funding 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A A2' '144A' FRN 15/10/2025	1,266,880	0.01
USD 1,100,000	Palmer Square Loan Funding 2018-4 Ltd 'Series 2018-4A A1' '144A' FRN 15/11/2026	1,094,281	0.01
USD 1,780,000	Palmer Square Loan Funding 2018-4 Ltd 'Series 2018-4A B' '144A' FRN 15/11/2026	1,740,676	0.02
USD 1,550,000	Palmer Square Loan Funding 2018-4 Ltd 'Series 2018-4A C' '144A' FRN 15/11/2026	1,476,240	0.02
USD 3,512,000	Palmer Square Loan Funding 2018-5 Ltd FRN 20/1/2027	3,432,810	0.04
USD 2,245,000	Palmer Square Loan Funding 2018-5 Ltd FRN 20/1/2027	2,238,895	0.02
USD 350,000	Palmer Square Loan Funding 2018-5 Ltd 'Series 2018-5A D' '144A' FRN 20/1/2027	349,048	0.00
USD 98,592	Paragon Mortgages No 13 Plc FRN 15/1/2039	90,459	0.00
USD 1,350,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2016-1 'Series 2016-1A DR' '144A' FRN 23/8/2031	1,253,683	0.01
USD 2,525,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 'Series 2017-1A A1' '144A' FRN 14/11/2029	2,511,209	0.03
USD 1,500,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 'Series 2017-1A A2' '144A' FRN 14/11/2029	1,486,344	0.02
USD 2,830,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 'Series 2017-1A D' '144A' FRN 14/11/2029	2,723,770	0.03
USD 1,230,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp '144A' 5.25% 15/8/2025	1,226,925	0.01
USD 5,597,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp '144A' 5.375% 15/1/2025	5,624,985	0.06
USD 4,860,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp '144A' 6.25% 1/6/2024	5,005,800	0.05
USD 1,000,000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2022	1,092,265	0.01
USD 400,000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2038	432,892	0.00
USD 915,000	Pennsylvania Turnpike Commission 5% 1/12/2046	1,001,760	0.01
USD 2,470,000	Pennsylvania Turnpike Commission 5% 1/12/2048	2,752,000	0.03
USD 4,071,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 3.65% 29/7/2021	4,097,457	0.04
USD 3,750,000	Pepperdine University 3.948% 1/12/2057	3,660,263	0.04
USD 800,000	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 2.6% 15/12/2019	797,033	0.01
USD 2,585,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.458% 1/10/2062	2,748,553	0.03
USD 260,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.926% 1/10/2051	300,219	0.00
USD 710,000	Port Authority of New York & New Jersey 5% 15/11/2047	793,329	0.01
USD 830,000	Port of Seattle WA 5% 1/5/2043	918,893	0.01
USD 5,548,000	Post Holdings Inc '144A' 5.5% 1/3/2025	5,596,545	0.06

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 850,000	Prima Capital CRE Securitization 2015-IV Ltd ' Series 2015-4A C ' ' 144A ' 4% 24/8/2049	847,705	0.01
USD 319,089	Prime Mortgage Trust 2006-DR1 ' Series 2006-DR1 2A1 ' ' 144A ' 5.5% 25/5/2035	264,036	0.00
USD 590,000	Progress Residential 2015-SFR3 Trust ' Series 2015-SFR3 F ' ' 144A ' 6.643% 12/11/2032	601,732	0.01
USD 696,000	Progress Residential 2016-SFR2 Trust ' Series 2016-SFR2 E ' ' 144A ' FRN 17/1/2034	697,883	0.01
USD 2,083,307	Progress Residential 2017-SFR1 Trust ' Series 2017-SFR1 A ' ' 144A ' 2.768% 17/8/2034	2,032,152	0.02
USD 1,480,000	Progress Residential 2018-SFR1 Trust ' Series 2018-SFR1 F ' ' 144A ' 4.778% 17/3/2035	1,472,297	0.02
USD 920,000	Progress Residential 2018-SFR2 Trust ' Series 2018-SFR2 F ' ' 144A ' 4.953% 17/8/2035	919,535	0.01
USD 2,653,000	Providence St Joseph Health Obligated Group 3.93% 1/10/2048	2,512,204	0.03
USD 174,824	PRPM 2017-1 LLC (Step-up coupon) ' Series 2017-1A A1 ' ' 144A ' 4.25% 25/1/2022	174,883	0.00
USD 1,078,000	Prudential Financial Inc FRN 15/9/2042	1,139,403	0.01
USD 880,000	Public Power Generation Agency 5% 1/1/2035	985,248	0.01
USD 134,000	PulteGroup Inc 4.25% 1/3/2021	135,206	0.00
USD 192,000	PulteGroup Inc 5% 15/1/2027	186,000	0.00
USD 2,765,000	PulteGroup Inc 5.5% 1/3/2026	2,792,650	0.03
USD 43,000	PulteGroup Inc 6% 15/2/2035	39,452	0.00
USD 3,255,000	PulteGroup Inc 7.875% 15/6/2032	3,531,675	0.04
EUR 868,000	PVH Corp 3.125% 15/12/2027	985,170	0.01
USD 11,390,000	Quicken Loans Inc ' 144A ' 5.75% 1/5/2025	11,276,100	0.12
USD 630,000	Race Point IX CLO Ltd ' Series 2015-9A A1AR ' ' 144A ' FRN 15/10/2030	629,495	0.01
USD 430,000	RAIT 2017-FL7 Trust ' Series 2017-FL7 C ' ' 144A ' FRN 15/6/2037	421,234	0.00
USD 1,132,433	RALI Series 2007-QH9 Trust ' Series 2007-QH9 A1 ' FRN 25/11/2037	1,018,554	0.01
USD 5,539,767	RAMP Series 2006-RS6 Trust ' Series 2006-RS6 A4 ' FRN 25/11/2036	4,686,705	0.05
USD 1,851,408	RAMP Series 2007-RS1 Trust ' Series 2007-RS1 A3 ' FRN 25/2/2037	958,660	0.01
EUR 1,073,000	Refinitiv US Holdings Inc 4.5% 15/5/2026	1,220,242	0.01
EUR 1,638,000	Refinitiv US Holdings Inc 6.875% 15/11/2026*	1,796,412	0.02
USD 683,000	Refinitiv US Holdings Inc ' 144A ' 8.25% 15/11/2026	669,340	0.01
USD 1,530,000	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue 5% 15/5/2047	1,708,788	0.02
USD 3,420,000	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue 6.583% 15/5/2049	4,579,842	0.05
USD 161,953	Reperforming Loan REMIC Trust 2005-R3 ' Series 2005-R3 AF ' ' 144A ' FRN 25/9/2035	150,994	0.00
USD 1,533,261	Residential Asset Securitization Trust 2005-A5 ' Series 2005-A5 A5 ' FRN 25/5/2035	1,295,751	0.01
USD 11,654,000	Resolute Energy Corp 8.5% 1/5/2020	11,700,616	0.12
USD 690,683	Resource Capital Corp 2017-CRE5 Ltd ' Series 2017-CRE5 A ' ' 144A ' FRN 15/7/2034	685,958	0.01
USD 1,109,532	Resource Capital Corp 2017-CRE5 Ltd ' Series 2017-CRE5 B ' ' 144A ' FRN 15/7/2034	1,097,958	0.01
USD 10,945,000	Reynolds American Inc 4.45% 12/6/2025	11,048,562	0.11
USD 7,211,130	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu 5.75% 15/10/2020	7,238,172	0.07
USD 244,655	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu 6.875% 15/2/2021	245,573	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 141,000	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu '144A' 7% 15/7/2024	143,732	0.00
USD 1,881,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd 'Series 2017-2A B' '144A' FRN 15/10/2029	1,873,250	0.02
USD 1,250,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd 'Series 2017-2A C' '144A' FRN 15/10/2029	1,226,019	0.01
USD 4,390,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd 'Series 2017-2A D' '144A' FRN 15/10/2029	4,302,532	0.04
USD 3,490,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd 'Series 2017-2A E' '144A' FRN 15/10/2029	3,417,203	0.04
USD 9,005,000	Rockford Tower CLO 2017-3 Ltd 'Series 2017-3A A' '144A' FRN 20/10/2030	8,940,782	0.09
USD 3,015,000	Rockford Tower CLO 2017-3 Ltd 'Series 2017-3A E' '144A' FRN 20/10/2030	2,858,863	0.03
USD 260,000	Rockford Tower CLO 2018-1 Ltd 'Series 2018-1A E' '144A' FRN 20/5/2031	247,335	0.00
USD 560,000	Rockford Tower CLO 2018-2 Ltd 'Series 2018-2A E' '144A' FRN 20/10/2031	538,229	0.01
USD 1,320,000	Rockford Tower CLO Ltd 'Series 2017-1A B' '144A' FRN 15/4/2029	1,314,922	0.01
USD 2,140,000	Rockford Tower CLO Ltd 'Series 2017-1A D' '144A' FRN 15/4/2029	2,122,222	0.02
USD 2,450,000	Rockford Tower CLO Ltd 'Series 2017-1A E' '144A' FRN 15/4/2029	2,253,370	0.02
USD 10,248,000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 5.625% 15/4/2020	10,517,522	0.11
USD 1,645,000	Rockwell Automation Inc 3.5% 1/3/2029	1,645,732	0.02
USD 3,100,000	Romark WM-R Ltd 'Series 2018-1A A1' '144A' FRN 20/4/2031	3,047,008	0.03
USD 2,201,000	Roslyn Portfolio Trust 2017-ROSS 'Series 2017-ROSS E' '144A' FRN 15/6/2033	2,190,862	0.02
USD 960,000	Royal Oak Hospital Finance Authority 5% 1/9/2039	1,039,382	0.01
USD 250,000	RR 2 Ltd 'Series 2017-2A B' '144A' FRN 15/10/2029	243,739	0.00
USD 410,000	RR 2 Ltd 'Series 2017-2A D' '144A' FRN 15/10/2029	395,193	0.00
USD 250,000	RR 3 Ltd 'Series 2018-3A A1R2' '144A' FRN 15/1/2030	247,431	0.00
USD 2,510,000	Ryder System Inc 3.65% 18/3/2024	2,512,757	0.03
USD 761,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 15/4/2023	811,533	0.01
USD 3,192,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 1/3/2025	3,445,952	0.04
USD 8,705,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15/5/2024	9,423,491	0.10
USD 4,430,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.875% 30/6/2026	4,835,317	0.05
USD 254,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 6.25% 15/3/2022	271,966	0.00
USD 7,115,000	Sable Permian Resources Land LLC / AEPB Finance Corp '144A' 13% 30/11/2020	7,399,600	0.08
USD 2,245,000	Sabre GLBL Inc '144A' 5.25% 15/11/2023	2,312,350	0.02
USD 2,500,000	Sabre GLBL Inc '144A' 5.375% 15/4/2023	2,569,200	0.03
USD 455,791	SACO I Trust 2006-9 'Series 2006-9 A1' FRN 25/8/2036	445,972	0.00
USD 1,760,000	Sacramento County Sanitation Districts Financing Authority FRN 1/12/2035	1,722,864	0.02
USD 900,000	Salt Lake City Corp Airport Revenue 5% 1/7/2047	1,014,557	0.01
USD 2,405,000	Salt Lake City Corp Airport Revenue 5% 1/7/2047	2,664,800	0.03
USD 1,620,000	Salt River Project Agricultural Improvement & Power District 5% 1/1/2036	1,915,666	0.02
USD 6,010,000	Salt River Project Agricultural Improvement & Power District 5% 1/12/2045	6,717,798	0.07
USD 2,050,000	San Antonio Water System 5% 15/5/2039	2,284,008	0.02
USD 1,500,000	San Diego County Regional Airport Authority 5% 1/7/2047	1,696,778	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 1,000,000	San Diego Public Facilities Financing Authority 5% 15/5/2039	1,147,920	0.01
USD 3,150,000	San Francisco City & County Airport Comm-San Francisco International Airport 5% 1/5/2046	3,470,308	0.04
USD 3,425,000	San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 2.958% 1/8/2024	3,407,207	0.03
USD 1,109,917	Saxon Asset Securities Trust 2007-1 'Series 2007-1 M1' FRN 25/1/2047	731,102	0.01
USD 3,188,000	Schlumberger Holdings Corp '144A' 3.75% 1/5/2024	3,214,893	0.03
EUR 200,000	Scientific Games International Inc 3.375% 15/2/2026	218,854	0.00
USD 7,489,000	Scientific Games International Inc 10% 1/12/2022	7,910,256	0.08
USD 5,248,000	SEACOR Holdings Inc 3.25% 15/5/2030	4,792,080	0.05
EUR 218,000	Sealed Air Corp 4.5% 15/9/2023	276,326	0.00
USD 3,865,266	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 'Series 2017-3 B' '144A' 25/7/2056 (Zero Coupon)	395,494	0.00
USD 5,240,327	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 'Series 2017-3 B10' '144A' FRN 25/7/2056	793,338	0.01
USD 519,282	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1 'Series 2018-1 BX' FRN 25/5/2057	214,591	0.00
USD 470,000	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1 'Series 2018-1 M' FRN 25/5/2057	463,864	0.00
USD 2,390,000	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3 'Series 2018-3 M' '144A' FRN 25/8/2057	2,255,393	0.02
USD 5,355,650	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2006-WM4 'Series 2006-WM4 A1' '144A' FRN 25/11/2036	3,150,271	0.03
USD 1,320,556	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2006-WM4 'Series 2006-WM4 A2A' FRN 25/11/2036	512,144	0.01
USD 3,954,654	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2006-WM4 'Series 2006-WM4 A2C' FRN 25/11/2036	1,550,025	0.02
USD 641,820	Security National Mortgage Loan Trust 2007-1 'Series 2007-1A 2A' '144A' FRN 25/4/2037	633,480	0.01
USD 1,750,000	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 'Series 2014-1A CR' '144A' FRN 17/7/2026	1,754,946	0.02
USD 1,590,000	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 'Series 2014-1A D' '144A' FRN 17/7/2026	1,589,808	0.02
USD 250,000	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 'Series 2014-1A SUB' '144A' FRN 17/7/2026	41,336	0.00
USD 1,405,340	SG Mortgage Securities Trust 2006-FRE2 'Series 2006-FRE2 A2C' FRN 25/7/2036	440,691	0.00
USD 1,310,000	SG Mortgage Securities Trust 2006-OPT2 'Series 2006-OPT2 A3D' FRN 25/10/2036	1,109,085	0.01
USD 3,120,000	Shackleton 2013-III CLO Ltd 'Series 2013-3A AR' '144A' FRN 15/7/2030	3,095,685	0.03
USD 44,000	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp '144A' 5.875% 1/4/2023	42,570	0.00
EUR 640,000	Silgan Holdings Inc 3.25% 15/3/2025	753,589	0.01
USD 3,750,000	Silver Creek CLO Ltd 'Series 2014-1A AR' '144A' FRN 20/7/2030	3,734,718	0.04
USD 500,000	Silver Creek CLO Ltd 'Series 2014-1A DR' '144A' FRN 20/7/2030	496,602	0.01
USD 500,000	Silver Creek CLO Ltd 'Series 2014-1A E1R' '144A' FRN 20/7/2030	464,812	0.00
USD 3,416,528	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-A 'Series 2004-A A3' FRN 15/6/2033	3,377,982	0.03
USD 5,899,244	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-B 'Series 2004-B A3' FRN 15/3/2024	5,856,129	0.06
USD 2,076,857	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-B 'Series 2004-B B' FRN 15/9/2033	2,058,074	0.02
USD 4,828,357	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B 'Series 2005-B B' FRN 15/6/2039	4,740,548	0.05
USD 4,692,269	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B 'Series 2006-B A5' FRN 15/12/2039	4,604,053	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 958,376	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B ' Series 2006-BW A5 ' FRN 15/12/2039	941,177	0.01
USD 204,144	SLM Private Education Loan Trust 2011-C 4.54% 17/10/2044	205,721	0.00
USD 261,327	SLM Private Education Loan Trust 2013-A ' Series 2013-A A2B ' ' 144A ' FRN 17/5/2027	261,401	0.00
USD 4,235,000	SLM Private Education Loan Trust 2013-A ' Series 2013-A B ' ' 144A ' 2.5% 15/3/2047	4,227,228	0.04
USD 2,690,000	SLM Private Education Loan Trust 2013-B ' Series 2013-B B ' ' 144A ' 3% 16/5/2044	2,683,705	0.03
USD 2,475,000	SLM Private Education Loan Trust 2013-C ' Series 2013-C B ' ' 144A ' FRN 15/6/2044	2,471,397	0.03
USD 4,740,000	SLM Private Education Loan Trust 2014-A ' Series 2014-A B ' ' 144A ' 3.5% 15/11/2044	4,745,552	0.05
USD 910,270	SMB Private Education Loan Trust 2014-A ' Series 2014-A A2B ' ' 144A ' FRN 15/5/2026	917,458	0.01
USD 2,960,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-B ' Series 2015-B B ' ' 144A ' 3.5% 17/12/2040	2,936,667	0.03
USD 1,910,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-C ' Series 2015-C B ' ' 144A ' 3.5% 15/9/2043	1,894,121	0.02
USD 1,110,000	SMB Private Education Loan Trust 2017-B ' Series 2017-B A2B ' ' 144A ' FRN 15/10/2035	1,110,335	0.01
USD 10,170,000	SMB Private Education Loan Trust 2017-B ' Series 2017-B A2A ' ' 144A ' 2.82% 15/10/2035	9,994,324	0.10
USD 9,000,000	SMB Private Education Loan Trust 2018-A ' Series 2018-A A2B ' ' 144A ' FRN 15/2/2036	8,980,074	0.09
USD 700,000	Sound Point CLO IX Ltd ' Series 2015-2A DR ' ' 144A ' FRN 20/7/2027	685,900	0.01
USD 700,000	Sound Point CLO IX Ltd ' Series 2015-2A E ' ' 144A ' FRN 20/7/2027	699,908	0.01
USD 1,380,000	Sound Point CLO X Ltd ' Series 2015-3A ER ' ' 144A ' FRN 20/1/2028	1,334,643	0.01
USD 1,300,000	Sound Point Clo XII Ltd ' Series 2016-2A A ' ' 144A ' FRN 20/10/2028	1,301,078	0.01
USD 650,000	Sound Point Clo XII Ltd ' Series 2016-2A E ' ' 144A ' FRN 20/10/2028	649,910	0.01
USD 440,000	Sound Point Clo XIV Ltd ' Series 2016-3A C ' ' 144A ' FRN 23/1/2029	441,158	0.00
USD 540,000	Sound Point Clo XIV Ltd ' Series 2016-3A E ' ' 144A ' FRN 23/1/2029	538,535	0.01
USD 49,551	Soundview Home Loan Trust 2004-WMC1 ' Series 2004-WMC1 M2 ' FRN 25/1/2035	47,632	0.00
USD 800,000	South Carolina Ports Authority 5% 1/7/2055	874,464	0.01
USD 2,090,000	South Carolina Public Service Authority 2.388% 1/12/2023	2,000,903	0.02
USD 2,090,000	South Carolina Public Service Authority 3.722% 1/12/2023	2,108,591	0.02
USD 3,567,000	South Carolina Public Service Authority 6.454% 1/1/2050	4,662,640	0.05
USD 1,500,000	Southern Baptist Hospital of Florida Inc 4.857% 15/7/2045	1,610,116	0.02
USD 570,000	Spartanburg County School District No 7 5% 1/3/2048	659,747	0.01
USD 4,255,000	Spectra Energy Partners LP 4.75% 15/3/2024	4,453,509	0.05
USD 6,667,513	SpringCastle America Funding LLC ' Series 2016-AA A ' ' 144A ' 3.05% 25/4/2029	6,640,368	0.07
USD 11,187,000	Springleaf Funding Trust 2015-A ' Series 2015-AA B ' ' 144A ' 3.62% 15/11/2024	11,196,667	0.11
USD 1,200,000	Springleaf Funding Trust 2015-A ' Series 2015-AA D ' ' 144A ' 6.31% 15/11/2024	1,208,921	0.01
USD 480,000	Springleaf Funding Trust 2016-A ' Series 2016-AA B ' ' 144A ' 3.8% 15/11/2029	480,149	0.01
USD 1,734,000	Springleaf Funding Trust 2017-A ' Series 2017-AA A ' ' 144A ' 2.68% 15/7/2030	1,712,910	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 607,000	Sprint Capital Corp 6.9% 1/5/2019	612,615	0.01
USD 2,889,000	Sprint Communications Inc '144A' 7% 1/3/2020	2,990,115	0.03
USD 142,000	Sprint Corp 7.125% 15/6/2024	146,793	0.00
USD 3,448,000	Sprint Corp 7.875% 15/9/2023	3,708,755	0.04
USD 17,570,438	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 3.36% 20/9/2021	17,466,775	0.18
USD 2,160,000	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 4.738% 20/3/2025	2,168,100	0.02
USD 4,631,000	SSM Health Care Corp 3.688% 1/6/2023	4,711,947	0.05
USD 1,296,615	STACR Trust 2018-DNA2 'Series 2018-DNA2 M2' '144A' ' FRN 25/12/2030	1,285,749	0.01
USD 9,838,000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 6% 15/10/2025	10,317,603	0.11
USD 3,504,000	Stanley Black & Decker Inc 3.4% 1/3/2026	3,501,810	0.04
USD 7,381,733	Stanwich Mortgage Loan Co 2017-NPL-B-1 LLC (Step-up coupon) 'Series 2017-NPB1 A1' '144A' 3.598% 17/5/2022	7,356,487	0.08
USD 2,395,000	State of California 7.3% 1/10/2039	3,376,423	0.03
USD 660,000	State of California 7.35% 1/11/2039	935,867	0.01
USD 2,575,000	State of California 7.5% 1/4/2034	3,642,672	0.04
USD 1,360,000	State of California 7.55% 1/4/2039	1,998,234	0.02
USD 4,315,000	State of Connecticut 3.31% 15/1/2026	4,201,041	0.04
USD 1,300,000	State of Illinois 5% 1/5/2020	1,336,946	0.01
USD 1,580,000	State of Illinois 5% 1/11/2022	1,685,631	0.02
USD 4,060,000	State of Illinois 5% 1/11/2024	4,376,639	0.04
USD 820,000	State of Illinois 5% 1/12/2024	884,591	0.01
USD 9,650,000	State of Illinois 5% 1/11/2025	10,463,447	0.11
USD 4,430,000	State of Minnesota 5% 1/8/2036	5,283,107	0.05
USD 1,960,000	State of Ohio 5% 15/3/2032	2,217,799	0.02
USD 900,000	State of Ohio 5% 1/5/2034	1,028,412	0.01
USD 900,000	State of Ohio 5% 1/5/2035	1,025,653	0.01
USD 2,150,000	State of Ohio 5% 1/5/2036	2,442,292	0.03
USD 1,630,000	State of Ohio 5% 1/5/2037	1,844,647	0.02
USD 5,035,000	State of South Carolina 5% 1/10/2022	5,629,684	0.06
USD 1,230,000	State of Texas 5% 1/4/2040	1,395,841	0.01
USD 1,970,000	State of Texas 5% 1/4/2043	2,223,736	0.02
USD 1,980,000	State of Washington 5% 1/7/2030	2,270,189	0.02
USD 930,000	State of Washington 5% 1/8/2040	1,066,515	0.01
USD 2,400,000	State of Washington 5% 1/8/2040	2,695,620	0.03
USD 1,670,000	State of Washington 5% 1/2/2041	1,900,243	0.02
USD 980,000	State of Washington 5% 1/8/2041	1,121,443	0.01
USD 2,240,000	State of West Virginia 5% 1/6/2040	2,588,286	0.03
USD 1,050,000	State of West Virginia 5% 1/12/2040	1,211,815	0.01
USD 1,505,000	State of Wisconsin 3.154% 1/5/2027	1,487,211	0.02
USD 1,390,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2025	1,645,885	0.02
USD 920,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2032	1,061,501	0.01
USD 830,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2033	954,571	0.01
USD 1,080,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2034	1,236,757	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	State of Wisconsin 5% 1/5/2036	1,525,449	0.02
USD 1,350,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2038	1,534,356	0.02
USD 5,150,000	State Street Corp FRN 3/12/2024	5,284,399	0.05
USD 1,070,000	State Street Corp 3.7% 20/11/2023	1,101,844	0.01
USD 57,000	Steel Dynamics Inc 4.125% 15/9/2025	55,931	0.00
USD 1,859,000	Steel Dynamics Inc 5% 15/12/2026	1,905,475	0.02
USD 5,367,000	Steel Dynamics Inc 5.125% 1/10/2021	5,427,379	0.06
USD 283,000	Steel Dynamics Inc 5.25% 15/4/2023	288,306	0.00
USD 5,216,000	Steel Dynamics Inc 5.5% 1/10/2024	5,365,960	0.05
USD 330,000	Steele Creek Clo 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A A' '144A' FRN 15/1/2030	328,110	0.00
USD 510,000	Strata CLO I Ltd FRN 15/1/2031	474,449	0.01
USD 2,320,000	Strata CLO I Ltd FRN 15/1/2031	1,872,785	0.02
USD 1,624,934	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 'Series 2006-3 4A' FRN 25/4/2036	1,413,671	0.01
USD 1,953,627	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR2 'Series 2006-AR2 A1' FRN 25/2/2036	1,883,275	0.02
USD 560,193	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR5 'Series 2006-AR5 2A1' FRN 25/5/2046	477,757	0.01
USD 1,359,000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp 6.125% 15/7/2023	1,396,372	0.01
USD 795,000	Sumter Landing Community Development District 4.172% 1/10/2047	779,430	0.01
USD 1,080,000	Sunoco Logistics Partners Operations LP 4.25% 1/4/2024	1,099,280	0.01
USD 5,608,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.875% 15/1/2023	5,697,560	0.06
USD 169,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.5% 15/2/2026	168,290	0.00
USD 3,489,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.875% 15/3/2028	3,436,665	0.04
USD 1,975,000	SunTrust Bank/Atlanta GA FRN 2/8/2024	2,002,499	0.02
USD 8,746,000	Sutter Health 3.695% 15/8/2028	8,828,353	0.09
USD 3,947,727	Symphony CLO XII Ltd 'Series 2013-12A AR' '144A' FRN 15/10/2025	3,948,298	0.04
USD 310,000	Symphony CLO XIX Ltd 'Series 2018-19A A' '144A' FRN 16/4/2031	304,578	0.00
USD 1,830,000	Symphony CLO XVII Ltd 'Series 2016-17A AR' '144A' FRN 15/4/2028	1,814,282	0.02
USD 250,000	Symphony CLO XVIII Ltd 'Series 2016-18A D' '144A' FRN 23/1/2028	244,353	0.00
USD 4,733,000	Talen Energy Supply LLC 6.5% 1/6/2025	4,212,370	0.04
USD 2,470,000	Talen Energy Supply LLC '144A' 9.5% 15/7/2022	2,642,900	0.03
USD 1,702,000	Talen Energy Supply LLC '144A' 10.5% 15/1/2026	1,778,590	0.02
USD 4,520,000	Talos Production LLC / Talos Production Finance Inc 11% 3/4/2022*	4,717,750	0.05
USD 131,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.125% 1/2/2025	132,638	0.00
USD 520,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp '144A' 6.5% 15/7/2027	551,200	0.01
USD 111,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.75% 15/3/2024	116,795	0.00
USD 2,113,000	Taylor Morrison Communities Inc / Taylor Morrison Holdings II Inc '144A' 5.25% 15/4/2021	2,128,721	0.02
USD 579,000	TCI-Symphony CLO 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A E' '144A' FRN 15/7/2030	557,665	0.01
USD 174,000	Tenet Healthcare Corp 4.5% 1/4/2021	177,480	0.00
USD 180,000	Tenet Healthcare Corp 4.75% 1/6/2020	183,375	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 497,000	Tenet Healthcare Corp 5.5% 1/3/2019	497,000	0.01
USD 10,625,000	Tenet Healthcare Corp 6% 1/10/2020	11,010,156	0.11
USD 865,000	Tennessee Housing Development Agency 3.75% 1/7/2038	874,571	0.01
USD 415,000	Tennessee Housing Development Agency 3.85% 1/7/2043	415,743	0.00
USD 325,000	Tennessee Housing Development Agency 3.95% 1/1/2049	326,331	0.00
USD 1,780,000	Texas A&M University 2.836% 15/5/2027	1,739,621	0.02
USD 670,000	Texas Municipal Gas Acquisition & Supply Corp I 6.25% 15/12/2026	775,585	0.01
USD 570,000	Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp 5% 31/12/2055	604,807	0.01
USD 2,340,000	Texas Water Development Board 5% 15/10/2038	2,743,919	0.03
USD 2,450,000	Texas Water Development Board 5% 15/10/2043	2,819,619	0.03
USD 1,410,000	Thacher Park CLO Ltd 'Series 2014-1A D1R' '144A' FRN 20/10/2026	1,412,701	0.01
USD 260,000	Thayer Park CLO Ltd 'Series 2017-1A D' '144A' FRN 20/4/2029	251,028	0.00
USD 2,500,000	THL Credit Wind River 2012-1 CLO Ltd 'Series 2012- 1A DR' '144A' FRN 15/1/2026	2,502,840	0.03
USD 500,000	THL Credit Wind River 2016-1 CLO Ltd 'Series 2016- 1A AR' FRN 15/7/2028	497,435	0.01
USD 527,294	Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-3 'Series 2007-3 4A1' FRN 25/6/2047	478,660	0.01
USD 250,000	TIAA CLO II Ltd 'Series 2017-1A E' '144A' FRN 20/4/2029	236,136	0.00
USD 263,000	Tiaa Clo III Ltd 'Series 2017-2A A' '144A' FRN 16/1/2031	260,250	0.00
USD 750,000	Tiaa Clo III Ltd 'Series 2017-2A B' '144A' FRN 16/1/2031	738,041	0.01
USD 520,000	TICP CLO VI 2016-2 Ltd 'Series 2016-6A E' '144A' FRN 15/1/2029	509,430	0.01
USD 3,220,000	TICP CLO VII Ltd 'Series 2017-7A E' '144A' FRN 15/7/2029	3,148,072	0.03
USD 6,025,000	Tobacco Settlement Finance Authority 7.467% 1/6/2047	5,857,836	0.06
USD 3,765,000	Tobacco Settlement Financing Corp/VA 6.706% 1/6/2046	3,568,147	0.04
USD 2,700,000	Toll Brothers Finance Corp 4.375% 15/4/2023	2,706,750	0.03
USD 1,298,000	Toll Brothers Finance Corp 4.875% 15/11/2025	1,299,622	0.01
USD 2,800,000	Total System Services Inc 3.8% 1/4/2021	2,811,812	0.03
USD 1,810,000	TransDigm Inc 5.5% 15/10/2020	1,812,263	0.02
USD 3,909,000	TransDigm Inc 6% 15/7/2022	3,957,862	0.04
USD 5,435,000	TransDigm Inc '144A' 6.25% 15/3/2026	5,562,451	0.06
USD 1,840,000	Treman Park CLO Ltd FRN 20/10/2028	1,793,845	0.02
USD 640,000	TRESTLES CLO II Ltd 'Series 2018-2A D' '144A' FRN 25/7/2031	607,563	0.01
USD 1,130,000	TRI Pointe Group Inc 4.875% 1/7/2021	1,127,175	0.01
USD 860,000	TRI Pointe Group Inc / TRI Pointe Homes Inc 4.375% 15/6/2019	861,075	0.01
USD 11,930,000	Triaxx Prime CDO 2006-1 Ltd 'Series 2006-1A A2' ' 144A' FRN 3/3/2039	842,509	0.01
USD 730,000	Tricon American Homes 2017-SFR2 Trust 'Series 2017-SFR2 F' '144A' 5.104% 17/1/2036	733,397	0.01
USD 850,000	Tricon American Homes 2018-SFR1 Trust 'Series 2018-SFR1 E' '144A' 4.564% 17/5/2037	849,073	0.01
USD 580,000	Tricon American Homes 2018-SFR1 Trust 'Series 2018-SFR1 F' '144A' 4.96% 17/5/2037	576,882	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 2,000,000	Tri-County Metropolitan Transportation District of Oregon 5% 1/9/2043	2,300,260	0.02
USD 1,330,000	Trinity Health Corp 4.125% 1/12/2045	1,281,194	0.01
USD 1,400,000	TSASC Inc/NY 5% 1/6/2041	1,486,352	0.02
USD 1,780,000	Tyson Foods Inc 4% 1/3/2026	1,780,042	0.02
USD 9,026,000	Tyson Foods Inc 4.35% 1/3/2029	9,077,771	0.09
USD 154,043	UAL 2007-1 Pass Through Trust 6.636% 2/7/2022	160,821	0.00
EUR 483,000	UGI International LLC 3.25% 1/11/2025	569,098	0.01
USD 2,165,000	Union Pacific Corp 3.15% 1/3/2024	2,164,761	0.02
USD 3,975,000	Union Pacific Corp 3.7% 1/3/2029	3,971,517	0.04
USD 1,502,000	Union Pacific Corp 4.3% 1/3/2049	1,468,604	0.02
USD 2,113,092	United Airlines 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/8/2021	2,164,249	0.02
USD 3,951,000	United Airlines 2019-1 Class AA Pass Through Trust 4.15% 25/8/2031	3,980,856	0.04
USD 180,000	United Rentals North America Inc 4.625% 15/7/2023	183,600	0.00
USD 2,150,000	United Rentals North America Inc 5.5% 15/7/2025	2,198,375	0.02
USD 3,482,000	United Rentals North America Inc 5.75% 15/11/2024	3,599,517	0.04
USD 20,824,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.375% 15/1/2027* †	21,089,092	0.22
USD 69,158,900	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/4/2023	69,876,395	0.71
USD 595,000	United States Treasury Note/Bond 3% 15/8/2048	586,400	0.01
USD 16,130,000	United States Treasury Note/Bond 3.375% 15/11/2048 †	17,100,320	0.17
EUR 400,000	United Technologies Corp FRN 18/5/2020	455,111	0.00
USD 1,020,000	United Technologies Corp 2.65% 1/11/2026	948,912	0.01
USD 2,100,000	United Technologies Corp 2.8% 4/5/2024	2,041,013	0.02
USD 4,320,000	United Technologies Corp 3.1% 1/6/2022	4,314,693	0.04
USD 12,725,000	United Technologies Corp 3.65% 16/8/2023	12,896,408	0.13
USD 4,845,000	United Technologies Corp 3.95% 16/8/2025	4,962,036	0.05
USD 8,180,000	United Technologies Corp 4.125% 16/11/2028	8,295,480	0.08
USD 3,645,000	United Technologies Corp 4.625% 16/11/2048	3,681,299	0.04
USD 2,380,000	UnitedHealth Group Inc 3.7% 15/12/2025	2,440,216	0.03
USD 2,985,000	UnitedHealth Group Inc 4.25% 15/6/2048	3,034,466	0.03
USD 1,480,000	University of California 3.063% 1/7/2025	1,481,510	0.02
USD 1,665,000	University of California 4.601% 15/5/2031	1,800,015	0.02
USD 790,000	University of Houston 5% 15/2/2033	906,059	0.01
USD 720,000	University of Houston 5% 15/2/2034	822,787	0.01
USD 1,630,000	University of Houston 5% 15/2/2035	1,855,600	0.02
USD 2,110,000	University of Houston 5% 15/2/2036	2,392,360	0.02
USD 2,500,000	University of Michigan 5% 1/4/2047	2,860,162	0.03
USD 2,296,000	University of Notre Dame du Lac 3.394% 15/2/2048	2,151,782	0.02
USD 1,220,000	University of Oregon 5% 1/4/2046	1,363,234	0.01
USD 256,000	University of Southern California 3.028% 1/10/2039	234,438	0.00
USD 2,075,000	University of Vermont & State Agricultural College 5% 1/10/2043	2,340,320	0.02
USD 1,300,000	US 2018-USDC 'Series 2018-USDC F' '144A' FRN 9/5/2038	1,242,553	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 2,344,688	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.95% 15/11/2025	2,348,834	0.02
USD 722,386	US Airways 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/11/2021	741,764	0.01
USD 5,265,000	US Bancorp 3.375% 5/2/2024	5,320,014	0.05
USD 2,741,000	Valvoline Inc 5.5% 15/7/2024	2,758,131	0.03
GBP 800,000	Vantiv LLC / Vantiv Issuer Corp 3.875% 15/11/2025*	1,040,443	0.01
USD 310,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 ‘ Series 2016-2 M1’ FRN 25/10/2046	313,230	0.00
USD 170,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 ‘ Series 2016-2 M2’ FRN 25/10/2046	168,952	0.00
USD 710,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 ‘ Series 2016-2 M3’ FRN 25/10/2046	714,896	0.01
USD 310,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 ‘ Series 2016-2 M4’ FRN 25/10/2046	320,132	0.00
USD 330,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-1 ‘ Series 2017-1 M2’ ‘144A’ FRN 25/5/2047	326,011	0.00
USD 330,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-1 ‘ Series 2017-1 M3’ ‘144A’ FRN 25/5/2047	330,961	0.00
USD 2,121,262	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 ‘ Series 2017-2 M3’ ‘144A’ FRN 25/11/2047	2,100,448	0.02
USD 352,525	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 ‘ Series 2017-2 M4’ ‘144A’ FRN 25/11/2047	348,379	0.00
USD 338,989	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2018-1 ‘ Series 2018-1 M2’ ‘144A’ 4.26% 25/4/2048	337,600	0.00
USD 6,028,000	Ventas Realty LP 3.5% 15/4/2024	6,017,110	0.06
USD 1,205,000	Ventas Realty LP 4.4% 15/1/2029	1,230,840	0.01
USD 282,000	Venture XXIV CLO Ltd ‘Series 2016-24A A1D’ ‘144A’ FRN 20/10/2028	282,353	0.00
USD 804,000	Venture XXIV CLO Ltd ‘Series 2016-24A E’ ‘144A’ FRN 20/10/2028	798,353	0.01
USD 16,296,000	VeriSign Inc 4.625% 1/5/2023	16,572,706	0.17
USD 4,320,000	Verizon Communications Inc 3.125% 16/3/2022	4,340,364	0.04
USD 1,085,000	Verizon Communications Inc 3.875% 8/2/2029	1,085,020	0.01
USD 600,000	Verizon Communications Inc 4.125% 16/3/2027	613,008	0.01
USD 1,080,000	Verizon Communications Inc 4.272% 15/1/2036	1,054,346	0.01
USD 11,810,000	Verizon Communications Inc 4.329% 21/9/2028	12,220,971	0.12
USD 17,865,000	Verizon Communications Inc 4.672% 15/3/2055	17,329,055	0.18
USD 3,795,000	Verizon Communications Inc 5.012% 15/4/2049	3,976,172	0.04
USD 4,320,000	Verizon Communications Inc 5.15% 15/9/2023	4,704,755	0.05
USD 2,129,000	Viacom Inc FRN 28/2/2057	2,097,179	0.02
USD 1,310,000	Vibrant Clo IV Ltd ‘Series 2016-4A C’ ‘144A’ FRN 20/7/2028	1,316,242	0.01
USD 470,000	Vibrant Clo IV Ltd ‘Series 2016-4A D’ ‘144A’ FRN 20/7/2028	472,903	0.01
USD 830,000	Vibrant Clo V Ltd ‘Series 2016-5A A’ ‘144A’ FRN 20/1/2029	831,441	0.01
USD 1,254,000	Vibrant Clo VII Ltd ‘Series 2017-7A A1’ ‘144A’ FRN 15/9/2030	1,248,240	0.01
USD 2,270,000	Virginia Small Business Financing Authority 5% 31/12/2052	2,446,039	0.03
USD 1,002,000	Vistra Energy Corp 5.875% 1/6/2023	1,030,807	0.01
USD 9,918,000	Vistra Energy Corp 7.375% 1/11/2022	10,314,720	0.11
USD 1,340,000	Vistra Energy Corp 7.625% 1/11/2024	1,428,775	0.01
USD 450,000	VNDO 2013-PENN Mortgage Trust ‘Series 2013-PENN D’ ‘144A’ FRN 13/12/2029	450,239	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 885,000	VNDO 2013-PENN Mortgage Trust 'Series 2013-PENN E ' '144A' FRN 13/12/2029	868,774	0.01
USD 1,855,000	Voya CLO 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A A1R' '144A' FRN 25/4/2031	1,829,487	0.02
USD 275,000	Voya CLO 2016-2 Ltd 'Series 2016-2A D' '144A' FRN 19/7/2028	274,042	0.00
USD 250,000	Voya CLO 2016-4 Ltd 'Series 2016-4A E2' '144A' FRN 20/7/2029	248,132	0.00
USD 3,500,000	Voya Clo 2017-4 Ltd 'Series 2017-4A A1' '144A' FRN 15/10/2030	3,482,253	0.04
EUR 422,000	Voya Euro CLO I DAC FRN 15/10/2030	425,142	0.00
USD 2,212,543	Wachovia Asset Securitization Issuance II LLC 2007-HE2 Trust 'Series 2007-HE2A A' '144A' FRN 25/7/2037	2,118,522	0.02
USD 755,000	Waldorf Astoria Boca Raton Trust 2016-BOCA 'Series 2016-BOCA A' '144A' FRN 15/6/2029	756,098	0.01
USD 2,998,000	Walgreens Boots Alliance Inc 3.8% 18/11/2024	3,014,041	0.03
USD 8,985,000	Walmart Inc 2.65% 15/12/2024	8,855,681	0.09
USD 4,320,000	Walmart Inc 3.4% 26/6/2023	4,411,430	0.05
USD 2,325,000	Walmart Inc 3.55% 26/6/2025	2,385,801	0.02
USD 4,275,000	Walmart Inc 3.7% 26/6/2028	4,403,586	0.05
USD 2,030,000	Walmart Inc 4.05% 29/6/2048	2,053,632	0.02
USD 8,610,513	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007-HE2 Trust 'Series 2007-HE2 2A3' FRN 25/4/2037	4,444,336	0.05
USD 922,555	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007-HE2 Trust 'Series 2007-HE2 2A4' FRN 25/4/2037	481,539	0.01
USD 576,135	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR2 Trust 'Series 2005-AR2 B1' FRN 25/1/2045	376,114	0.00
USD 715,158	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust 'Series 2007-OA5 1A' FRN 25/6/2047	675,822	0.01
USD 870,000	Washington Metropolitan Area Transit Authority 5% 1/7/2036	1,010,809	0.01
USD 6,271,269	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 'Series 2006-4 1A1' 6% 25/4/2036	5,716,695	0.06
USD 393,639	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust (Step-up coupon) 'Series 2006-4 3A5' 6.35% 25/5/2036	340,858	0.00
USD 1,722,011	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust (Step-up coupon) 'Series 2006-4 3A1' 6.5% 25/5/2036	1,490,930	0.02
USD 1,616,354	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2007-OA1 Trust 'Series 2007-OA1 2A' FRN 25/12/2046	1,404,832	0.01
USD 4,760,810	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE4 Trust 'Series 2006-HE4 2A2' FRN 25/9/2036	2,247,168	0.02
USD 4,042,365	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust 'Series 2006-HE5 1A' FRN 25/10/2036	3,304,026	0.03
USD 3,574,143	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust 'Series 2006-HE5 2A2' FRN 25/10/2036	1,750,656	0.02
USD 4,585,970	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2007-HE2 Trust 'Series 2007-HE2 2A2' FRN 25/2/2037	1,959,740	0.02
USD 2,120,000	Washington State Convention Center Public Facilities District 5% 1/7/2058	2,331,523	0.02
USD 1,820,000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp 6% 1/2/2023	1,738,100	0.02
USD 1,821,000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp 6.625% 15/8/2025	1,739,055	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 1,240,000	Weld County School District No RE-4 5.25% 1/12/2041	1,436,900	0.01
USD 5,500,000	Wellfleet CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A DR' '144A' FRN 20/10/2027	5,417,858	0.06
USD 1,931,000	Wells Fargo & Co FRN 15/6/2025 (Perpetual)	2,052,112	0.02
USD 3,900,000	Wells Fargo & Co 3% 22/4/2026	3,744,098	0.04
USD 4,320,000	Wells Fargo & Co 3.5% 8/3/2022	4,363,281	0.04
USD 9,530,000	Wells Fargo & Co 3.55% 29/9/2025	9,548,434	0.10
USD 44,730,000	Wells Fargo & Co 3.75% 24/1/2024	45,525,185	0.46
USD 2,120,000	Wells Fargo & Co 3.9% 1/5/2045	2,036,037	0.02
USD 17,786,000	Wells Fargo & Co 4.15% 24/1/2029	18,222,886	0.19
USD 10,680,000	Wells Fargo Bank NA 3.625% 22/10/2021	10,814,452	0.11
USD 530,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014-LC18 'Series 2014-LC18 A5' 3.405% 15/12/2047	533,562	0.01
USD 1,329,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C27 'Series 2015-C27 C' 3.894% 15/2/2048	1,277,591	0.01
USD 720,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28 'Series 2015-C28 A4' 3.54% 15/5/2048	729,805	0.01
USD 2,500,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C31 'Series 2015-C31 A4' 3.695% 15/11/2048	2,551,587	0.03
USD 3,400,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1 'Series 2015-NXS1 XB' FRN 15/5/2048	99,268	0.00
USD 443,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 'Series 2015-NXS4 D' FRN 15/12/2048	420,821	0.00
USD 570,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 'Series 2015-NXS4 A4' 3.718% 15/12/2048	582,962	0.01
USD 480,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-P2 'Series 2015-P2 D' '144A' 3.241% 15/12/2048	397,889	0.00
USD 2,760,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1 'Series 2016-BNK1 XD' '144A' FRN 15/8/2049	207,428	0.00
USD 730,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C34 'Series 2016-C34 C' FRN 15/6/2049	754,522	0.01
USD 800,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 'Series 2016-NXS5 C' FRN 15/1/2059	818,599	0.01
USD 1,730,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 'Series 2017-C39 D' '144A' FRN 15/9/2050	1,591,512	0.02
USD 1,940,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 'Series 2017-C39 C' 4.118% 15/9/2050	1,880,124	0.02
USD 1,356,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-HSDB 'Series 2017-HSDB A' '144A' FRN 13/12/2031	1,359,261	0.01
USD 9,842,345	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RC1 'Series 2017-RC1 XA' FRN 15/1/2060	853,155	0.01
USD 850,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 'Series 2018-1745A' '144A' FRN 15/6/2036	865,319	0.01
USD 810,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-BX1 'Series 2018-BX1 E' '144A' FRN 15/12/2036	807,850	0.01
USD 13,249,051	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C44 'Series 2018-C44 XA' FRN 15/5/2051	721,851	0.01
USD 1,050,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C44 'Series 2018-C44 D' '144A' 3% 15/5/2051	834,486	0.01
USD 490,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C45 'Series 2018-C45 C' 4.727% 15/6/2051	493,775	0.01
USD 1,669,000	Welltower Inc 3.625% 15/3/2024	1,672,476	0.02
USD 3,087,000	Welltower Inc 4.125% 15/3/2029	3,081,336	0.03
USD 430,000	WESCO Distribution Inc 5.375% 15/12/2021	435,590	0.00
USD 2,053,000	Wesleyan University 4.781% 1/7/2116	2,012,039	0.02
USD 1,215,729	West CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A A1AR' '144A' FRN 7/11/2025	1,215,344	0.01
USD 320,000	West CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A C' '144A' FRN 7/11/2025	320,462	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 830,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2019	836,711	0.01
USD 895,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2020	928,522	0.01
USD 890,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2021	948,549	0.01
USD 975,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2022	1,067,332	0.01
USD 810,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2023	906,370	0.01
USD 860,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2024	981,604	0.01
USD 330,000	Westcott Park CLO Ltd 'Series 2016-1A D' '144A' FRN 20/7/2028	331,039	0.00
USD 4,330,000	Westcott Park CLO Ltd 'Series 2016-1A E' '144A' FRN 20/7/2028	4,337,846	0.04
USD 65,661	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2011-C3 'Series 2011-C3 A3FL' '144A' FRN 15/3/2044	65,889	0.00
USD 360,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012-C8 'Series 2012-C8 C' FRN 15/8/2045	370,668	0.00
EUR 400,000	Whirlpool Corp 0.625% 12/3/2020	457,754	0.00
USD 937,000	Whiting Petroleum Corp 1.25% 1/4/2020	901,916	0.01
USD 886,000	Williams Cos Inc/The 3.75% 15/6/2027	861,732	0.01
USD 2,220,000	Williams Cos Inc/The 4% 15/9/2025	2,235,086	0.02
USD 2,165,000	Williams Cos Inc/The 8.75% 15/3/2032	2,913,822	0.03
USD 650,000	Wisconsin Health & Educational Facilities Authority 5% 15/12/2044	696,494	0.01
EUR 2,700,000	WMG Acquisition Corp 4.125% 1/11/2024	3,238,431	0.03
USD 670,000	World Financial Network Credit Card Master Trust ' Series 2012-D B' 3.34% 17/4/2023	670,248	0.01
USD 226,000	XPO Logistics Inc '144A' 6.125% 1/9/2023	226,000	0.00
USD 90,000	XPO Logistics Inc '144A' 6.5% 15/6/2022	92,025	0.00
USD 2,087,418	Yale Mortgage Loan Trust 2007-1 'Series 2007-1 A' '144A' FRN 25/6/2037	872,233	0.01
USD 960,000	York Clo-3 Ltd 'Series 2016-1A AR' '144A' FRN 20/10/2029	957,428	0.01
USD 1,170,000	York Clo-3 Ltd 'Series 2016-1A BR' '144A' FRN 20/10/2029	1,162,506	0.01
USD 2,990,000	York Clo-3 Ltd 'Series 2016-1A DR' '144A' FRN 20/10/2029	2,996,521	0.03
USD 1,520,000	York Clo-3 Ltd 'Series 2016-1A ER' '144A' FRN 20/10/2029	1,476,661	0.02
USD 730,000	York Clo-3 Ltd 'Series 2016-1A FR' '144A' FRN 20/10/2029	646,971	0.01
USD 2,740,000	York Clo-3 Ltd 'Series 2016-1A SUB' '144A' FRN 20/10/2029	2,148,322	0.02
USD 610,000	York Clo-4 Ltd 'Series 2016-2A D' '144A' FRN 20/1/2030	615,165	0.01
USD 1,820,000	York Clo-4 Ltd 'Series 2016-2A E' '144A' FRN 20/1/2030	1,813,674	0.02
USD 2,010,000	York Clo-4 Ltd 'Series 2016-2A SUB' '144A' FRN 20/1/2030	1,447,272	0.01
USD 3,115,000	Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc 6% 1/4/2023	3,181,194	0.03
USD 1,085,000	Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc 6.375% 15/5/2025	1,075,506	0.01
USD 63,000	Zekelman Industries Inc '144A' 9.875% 15/6/2023	67,391	0.00
USD 2,409,000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.5% 29/4/2022	2,433,609	0.03
USD 4,364,000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.75% 29/4/2025	4,269,641	0.04
		6,333,288,629	64.62

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 (%)
		ウルグアイ		
USD	9,633,948	Uruguay Government International Bond 4.375% 27/10/2027	9,947,051	0.10
		ベトナム		
USD	5,200,000	No Va Land Investment Group Corp 5.5% 27/4/2023	4,764,500	0.05
USD	3,000,000	Vinpearl JSC 3.5% 14/6/2023	3,224,330	0.03
			7,988,830	0.08
	債券合計		8,860,965,073	90.41
	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		8,981,778,213	91.64

その他の譲渡可能な有価証券

債券

		米国		
USD	2,391	Lehman Brothers Holdings Inc 31/12/2049 (Zero Coupon)**	67	0.00
USD	2,391	Lehman Brothers Special Finance 31/12/2049 (Zero Coupon)**	-	0.00
USD	3,780,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 4/2/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	7,220,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) FRN 1/5/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	630,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 16/6/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	3,399,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 16/6/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	10,740,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 6/11/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
			67	0.00
	債券合計		67	0.00
	その他の譲渡可能な有価証券合計		67	0.00
	投資有価証券合計		8,981,778,280	91.64
	その他の純資産		818,835,045	8.36
	純資産合計(米ドル)		9,800,613,325	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。

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 2019年2月28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)
COP	9,765,225,000	USD	3,105,000	Credit Suisse	1/3/2019	71,819
USD	3,515,000	COP	11,119,702,500	BNP Paribas	1/3/2019	(102,457)
USD	5,554,733	CAD	7,319,000	State Street	5/3/2019	3,412
USD	568,343,329	EUR	493,223,000	UBS	5/3/2019	6,830,593
USD	253,020,846	GBP	192,630,000	State Street	5/3/2019	(3,190,666)
USD	137,871,145	JPY	15,025,769,000	Deutsche Bank	5/3/2019	2,796,895
USD	12,212,697	JPY	1,326,189,000	Commonwealth Bank of Australia	5/3/2019	290,912
USD	120,314	JPY	13,329,000	Citibank	5/3/2019	493
USD	10,159,573	MXN	194,750,000	HSBC Bank Plc	5/3/2019	19,161
USD	6,184,783	ZAR	82,448,000	Standard Chartered Bank	5/3/2019	295,827
AUD	4,149,500	USD	2,943,162	Goldman Sachs	6/3/2019	9,531
AUD	4,149,500	USD	2,944,243	Morgan Stanley	6/3/2019	8,450
BRL	9,951,829	USD	2,682,000	Goldman Sachs	6/3/2019	(12,062)
BRL	20,691,921	USD	5,618,000	HSBC Bank Plc	6/3/2019	(66,645)
BRL	17,235,776	USD	4,545,000	Royal Bank of Canada	6/3/2019	79,119
BRL	63,203,265	USD	16,765,014	RBS Plc	6/3/2019	191,544
BRL	4,866,737	USD	1,305,000	Deutsche Bank	6/3/2019	678
BRL	16,190,804	USD	4,340,000	Citibank	6/3/2019	3,768
BRL	73,491,749	USD	19,699,003	UBS	6/3/2019	17,812
BRL	28,218,395	USD	7,558,000	Morgan Stanley	6/3/2019	12,603
BRL	8,140,400	USD	2,165,000	JP Morgan	6/3/2019	18,956
BRL	40,165,657	USD	10,796,000	BNP Paribas	6/3/2019	(20,112)
USD	3,934,267	AUD	5,451,000	Morgan Stanley	6/3/2019	55,456
USD	33,961,158	BRL	126,675,119	UBS	6/3/2019	(24,018)
USD	9,119,770	BRL	34,030,951	Goldman Sachs	6/3/2019	(10,261)
USD	10,125,000	BRL	37,334,717	Morgan Stanley	6/3/2019	108,614
USD	5,454,710	BRL	20,252,465	JP Morgan	6/3/2019	21,256
USD	14,884,000	BRL	55,622,653	BNP Paribas	6/3/2019	(38,785)
USD	1,931,000	BRL	7,220,588	RBS Plc	6/3/2019	(6,184)
ARS	21,357,742	USD	506,708	BNP Paribas	7/3/2019	40,584
AUD	10,341,000	JPY	818,450,801	Goldman Sachs	7/3/2019	(135)
JPY	808,595,984	AUD	10,341,000	Goldman Sachs	7/3/2019	(88,469)
USD	253,354	ARS	10,220,300	Goldman Sachs	7/3/2019	(8,541)
USD	253,354	ARS	10,420,450	Citibank	7/3/2019	(13,670)
AUD	23,949,960	USD	17,192,000	Morgan Stanley	8/3/2019	(149,149)
CAD	22,541,978	USD	17,192,000	JP Morgan	8/3/2019	(93,028)
EUR	15,115,922	USD	17,192,000	HSBC Bank Plc	8/3/2019	21,285
GBP	13,131,643	USD	17,192,000	Citibank	8/3/2019	276,798
ARS	74,970,000	USD	1,800,000	BNP Paribas	11/3/2019	113,741
USD	1,800,000	ARS	72,450,000	BNP Paribas	11/3/2019	(49,414)
USD	4,921,000	CLP	3,229,160,200	Credit Suisse	11/3/2019	(26,551)
CLP	2,235,668,750	USD	3,425,000	Citibank	14/3/2019	322

未決済先渡為替予約 2019年2月28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)
CNH	58,836,635	USD	8,573,020	HSBC Bank Plc	14/3/2019	217,613
COP	30,577,960,000	USD	9,800,000	Credit Suisse	14/3/2019	142,668
EUR	3,234,000	USD	3,674,513	BNP Paribas	14/3/2019	10,125
HKD	21,582,000	USD	2,755,337	Bank of America	14/3/2019	(4,963)
HKD	15,696,000	USD	2,004,494	HSBC Bank Plc	14/3/2019	(4,223)
HKD	4,000,000	USD	510,511	RBS Plc	14/3/2019	(758)
HKD	21,800,000	USD	2,779,799	UBS	14/3/2019	(1,643)
HKD	28,597,800	USD	3,646,876	JP Morgan	14/3/2019	(2,420)
IDR	41,270,514,000	USD	2,946,000	JP Morgan	14/3/2019	(18,108)
JPY	80,000,000	USD	710,683	Morgan Stanley	14/3/2019	9,014
JPY	89,720,000	USD	800,526	JP Morgan	14/3/2019	6,615
JPY	1,247,669,293	USD	11,330,447	BNP Paribas	14/3/2019	(106,137)
JPY	306,347,000	USD	2,800,663	ANZ	14/3/2019	(44,697)
MXN	92,919,758	USD	4,872,000	Deutsche Bank	14/3/2019	(40,760)
MXN	188,440,252	USD	9,880,000	Citibank	14/3/2019	(82,297)
RUB	649,845,270	USD	9,771,000	BNP Paribas	14/3/2019	82,286
TRY	51,706,801	USD	9,640,000	JP Morgan	14/3/2019	15,983
USD	11,610,000	BRL	43,845,165	Standard Chartered Bank	14/3/2019	(146,457)
USD	8,337,000	CLP	5,491,919,500	BNP Paribas	14/3/2019	(77,303)
USD	2,232,644	CNH	15,115,000	Citibank	14/3/2019	(25,650)
USD	1,119,099	CNH	7,557,163	HSBC Bank Plc	14/3/2019	(9,998)
USD	3,617,395	CNH	24,803,393	Bank of America	14/3/2019	(88,417)
USD	410,000	COP	1,264,522,000	Nomura	14/3/2019	(1,169)
USD	16,617,772	EUR	14,456,006	Barclays	14/3/2019	147,409
USD	26,925,456	HKD	209,770,845	Morgan Stanley	14/3/2019	192,613
USD	1,034,243	HKD	8,067,112	Goldman Sachs	14/3/2019	6,184
USD	5,892,000	IDR	83,460,180,000	JP Morgan	14/3/2019	(28,993)
USD	18,707,194	JPY	2,097,140,000	Goldman Sachs	14/3/2019	(159,142)
USD	18,705,099	JPY	2,097,140,882	Bank of America	14/3/2019	(161,245)
USD	13,209,000	MXN	255,259,051	BNP Paribas	14/3/2019	(62,859)
USD	3,919,000	MXN	75,472,827	JP Morgan	14/3/2019	(5,110)
USD	1,471,000	MXN	28,261,087	Commonwealth Bank of Australia	14/3/2019	1,602
USD	9,819,000	MXN	191,466,572	Citibank	14/3/2019	(136,053)
USD	9,771,000	RUB	643,127,220	Bank of America	14/3/2019	19,577
USD	1,471,750	RUB	97,058,233	State Street	14/3/2019	104
USD	4,800,000	TRY	25,871,520	Deutsche Bank	14/3/2019	(31,375)
USD	13,548,000	TRY	72,645,142	Citibank	14/3/2019	(18,112)
USD	9,844,000	ZAR	135,884,274	Goldman Sachs	14/3/2019	148,803
ZAR	88,223,648	USD	6,255,000	BNP Paribas	14/3/2019	39,663
ZAR	139,426,478	USD	9,844,000	Barclays	14/3/2019	103,930
ZAR	135,335,878	USD	9,744,000	Citibank	14/3/2019	(87,930)
ZAR	49,460,774	USD	3,513,000	Goldman Sachs	14/3/2019	15,973

未決済先渡為替予約 2019年2月28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)
ARS	57,308,700	USD	1,445,000	JP Morgan	15/3/2019	12,272
IDR	70,154,610,814	USD	4,971,451	Deutsche Bank	15/3/2019	4,643
IDR	4,951,188,561	USD	350,204	JP Morgan	15/3/2019	985
IDR	979,538,199	USD	67,322	Bank of America	15/3/2019	2,157
IDR	56,592,143,180	USD	4,036,898	HSBC Bank Plc	15/3/2019	(22,796)
IDR	2,003,808,773	USD	138,547	UBS	15/3/2019	3,584
INR	1,009,335,250	USD	14,028,100	JP Morgan	15/3/2019	152,531
INR	367,724,602	USD	5,099,142	RBS Plc	15/3/2019	67,196
INR	442,195,000	USD	6,156,990	Citibank	15/3/2019	55,619
INR	508,356,908	USD	7,150,892	Deutsche Bank	15/3/2019	(8,743)
INR	573,250,000	USD	8,063,722	HSBC Bank Plc	15/3/2019	(9,860)
KRW	6,201,007,741	USD	5,526,006	Nomura	15/3/2019	(10,373)
TWD	201,189,783	USD	6,549,147	Nomura	15/3/2019	(12,685)
USD	8,662,398	IDR	122,468,977,523	JP Morgan	15/3/2019	(24,375)
USD	1,284,940	IDR	18,465,874,912	Deutsche Bank	15/3/2019	(24,852)
USD	3,346,272	IDR	49,652,099,681	HSBC Bank Plc	15/3/2019	(175,571)
USD	4,686,059	IDR	71,438,969,627	Morgan Stanley	15/3/2019	(381,135)
USD	49,229,911	INR	3,462,955,043	HSBC Bank Plc	15/3/2019	577,206
USD	4,756,135	INR	338,888,888	UBS	15/3/2019	(5,076)
USD	1,348,976	KRW	1,504,580,000	HSBC Bank Plc	15/3/2019	10,691
USD	673,433	KRW	752,291,539	Goldman Sachs	15/3/2019	4,289
USD	1,605,599	KRW	1,771,457,538	Bank of America	15/3/2019	29,934
USD	2,621,227	THB	85,438,878	BNY Mellon	15/3/2019	(90,673)
USD	1,121,674	TWD	34,483,612	Deutsche Bank	15/3/2019	1,334
USD	2,207,799	TWD	68,088,529	Goldman Sachs	15/3/2019	(4,331)
USD	5,497,217	TWD	167,192,848	JP Morgan	15/3/2019	65,282
USD	5,087,000	ZAR	72,379,108	Citibank	19/3/2019	(74,058)
ZAR	35,869,073	USD	2,543,500	Goldman Sachs	19/3/2019	14,177
ARS	20,330,400	USD	516,000	Citibank	20/3/2019	(1,528)
AUD	9,640,000	CAD	9,153,643	Bank of America	20/3/2019	(84,263)
AUD	855,000	CAD	811,852	Citibank	20/3/2019	(7,465)
AUD	10,708,000	CAD	10,115,848	Goldman Sachs	20/3/2019	(54,208)
AUD	4,288,000	CHF	3,049,766	Morgan Stanley	20/3/2019	(13,864)
AUD	8,433,000	CHF	6,025,861	Citibank	20/3/2019	(55,450)
AUD	10,301,405	EUR	6,455,000	Barclays	20/3/2019	(26,265)
AUD	19,376,160	EUR	11,848,000	Citibank	20/3/2019	285,014
AUD	6,826,879	EUR	4,290,000	Goldman Sachs	20/3/2019	(31,297)
AUD	10,271,968	EUR	6,455,000	JP Morgan	20/3/2019	(47,217)
AUD	7,116,000	JPY	555,797,638	Goldman Sachs	20/3/2019	62,244
AUD	7,496,000	JPY	593,908,080	Bank of America	20/3/2019	(10,312)
AUD	2,165,000	JPY	169,174,182	Deutsche Bank	20/3/2019	18,252
AUD	2,575,000	JPY	199,964,612	JP Morgan	20/3/2019	32,934
AUD	13,445,000	JPY	1,057,308,077	Barclays	20/3/2019	52,963

未決済先渡為替予約 2019年2月28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)
AUD	5,354,000	JPY	423,884,706	BNP Paribas	20/3/2019	(4,551)
AUD	2,380,000	JPY	187,293,624	Standard Chartered Bank	20/3/2019	8,191
AUD	7,495,000	JPY	590,206,280	Morgan Stanley	20/3/2019	22,295
AUD	12,873,000	NZD	13,525,931	JP Morgan	20/3/2019	(54,656)
AUD	24,704,000	NZD	26,007,067	Citibank	20/3/2019	(138,997)
AUD	6,470,000	USD	4,710,186	BNP Paribas	20/3/2019	(105,164)
AUD	4,500,000	USD	3,267,333	Deutsche Bank	20/3/2019	(64,459)
AUD	20,049,983	USD	14,160,000	Morgan Stanley	20/3/2019	110,573
AUD	11,277,000	USD	8,024,746	Citibank	20/3/2019	1,656
AUD	4,500,000	USD	3,249,405	Toronto Dominion	20/3/2019	(46,531)
AUD	15,276,000	USD	10,951,425	JP Morgan	20/3/2019	(78,735)
AUD	7,518,000	USD	5,403,210	Goldman Sachs	20/3/2019	(52,274)
AUD	17,535,000	USD	12,580,020	RBS Plc	20/3/2019	(99,486)
AUD	2,082,000	USD	1,506,179	Bank of America	20/3/2019	(24,316)
BRL	66,489,191	USD	17,493,000	Citibank	20/3/2019	327,627
BRL	27,008,100	USD	7,256,000	Goldman Sachs	20/3/2019	(17,210)
CAD	9,211,935	AUD	9,640,000	Citibank	20/3/2019	128,494
CAD	813,682	AUD	855,000	JP Morgan	20/3/2019	8,853
CAD	10,182,943	AUD	10,708,000	Morgan Stanley	20/3/2019	105,119
CAD	18,606,218	EUR	11,848,000	BNP Paribas	20/3/2019	611,919
CAD	10,708,000	NOK	68,879,328	JP Morgan	20/3/2019	63,154
CAD	10,832,000	NOK	70,308,432	Barclays	20/3/2019	(10,024)
CAD	10,720,000	SEK	74,373,834	Morgan Stanley	20/3/2019	51,975
CAD	6,888,100	USD	5,194,000	JP Morgan	20/3/2019	32,501
CAD	14,252,478	USD	10,708,000	Standard Chartered Bank	20/3/2019	106,386
CAD	8,467,448	USD	6,425,000	Morgan Stanley	20/3/2019	(135)
CAD	8,539,157	USD	6,480,000	RBS Plc	20/3/2019	(723)
CAD	1,747,907	USD	1,326,000	Bank of America	20/3/2019	263
CAD	21,362,547	USD	16,258,500	Citibank	20/3/2019	(49,189)
CAD	26,142,077	USD	19,658,000	HSBC Bank Plc	20/3/2019	177,886
CAD	6,546,726	USD	4,985,000	BNP Paribas	20/3/2019	(17,525)
CAD	20,430,790	USD	15,493,000	Goldman Sachs	20/3/2019	9,318
CAD	6,173,254	USD	4,630,000	State Street	20/3/2019	54,095
CAD	38,477,758	USD	28,617,000	Royal Bank of Canada	20/3/2019	578,859
CAD	31,478,730	USD	23,360,000	Toronto Dominion	20/3/2019	525,190
CHF	6,171,122	AUD	8,576,000	JP Morgan	20/3/2019	99,697
CHF	2,999,509	AUD	4,145,000	Citibank	20/3/2019	65,122
CHF	12,219,749	EUR	10,720,000	Morgan Stanley	20/3/2019	64,069
CHF	8,835,005	NZD	12,850,000	JP Morgan	20/3/2019	125,183
CHF	4,424,319	NZD	6,425,000	Deutsche Bank	20/3/2019	69,445
CHF	5,375,000	SEK	48,778,829	JP Morgan	20/3/2019	102,639
CHF	12,216,889	SEK	111,299,897	Citibank	20/3/2019	186,559
CHF	8,566,000	SEK	78,798,206	Barclays	20/3/2019	48,316

未決済先渡為替予約 2019年2月28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)
CHF	925,246	USD	954,000	Barclays	20/3/2019	(23,874)
CHF	10,547,762	USD	10,755,000	Bank of America	20/3/2019	(151,618)
CHF	22,598,250	USD	22,854,000	UBS	20/3/2019	(136,586)
CHF	5,342,483	USD	5,405,000	Goldman Sachs	20/3/2019	(34,346)
CLP	2,957,710,000	USD	4,340,000	BNP Paribas	20/3/2019	191,444
CNH	79,833,320	USD	11,844,000	HSBC Bank Plc	20/3/2019	83,751
CNH	26,478,911	USD	3,910,000	Morgan Stanley	20/3/2019	46,166
CNH	14,502,770	USD	2,141,000	JP Morgan	20/3/2019	25,833
CNH	9,469,048	USD	1,416,000	Royal Bank of Canada	20/3/2019	(1,247)
CNH	98,292,756	USD	14,608,000	Bank of America	20/3/2019	77,741
CNY	122,530,000	USD	18,079,605	Bank of America	20/3/2019	238,244
CNY	32,790,000	USD	4,852,027	Citibank	20/3/2019	49,974
EUR	6,455,000	AUD	10,240,212	Goldman Sachs	20/3/2019	69,819
EUR	11,848,000	AUD	19,292,331	JP Morgan	20/3/2019	(225,349)
EUR	93,955	AUD	150,045	Citibank	20/3/2019	308
EUR	10,614,045	AUD	16,982,143	RBS Plc	20/3/2019	12,297
EUR	11,848,000	CAD	18,502,314	Morgan Stanley	20/3/2019	(533,080)
EUR	1,800,000	CHF	2,047,155	Toronto Dominion	20/3/2019	(6,065)
EUR	8,920,000	CHF	10,155,982	JP Morgan	20/3/2019	(41,305)
EUR	2,145,000	GBP	1,891,178	JP Morgan	20/3/2019	(72,242)
EUR	2,575,000	GBP	2,286,330	Bank of America	20/3/2019	(108,068)
EUR	875,000	GBP	761,223	Citibank	20/3/2019	(15,843)
EUR	4,319,909	GBP	3,790,000	HSBC Bank Plc	20/3/2019	(120,564)
EUR	6,124,000	JPY	763,527,009	Deutsche Bank	20/3/2019	108,691
EUR	6,634,000	JPY	827,814,402	HSBC Bank Plc	20/3/2019	111,428
EUR	2,575,000	JPY	320,777,972	Citibank	20/3/2019	48,110
EUR	2,165,000	JPY	272,805,588	Royal Bank of Canada	20/3/2019	12,521
EUR	7,590,000	JPY	966,884,028	Goldman Sachs	20/3/2019	(50,517)
EUR	7,590,000	JPY	944,948,169	ANZ	20/3/2019	146,921
EUR	4,283,000	MXN	93,249,048	Barclays	20/3/2019	38,663
EUR	3,610,000	NZD	5,960,612	Barclays	20/3/2019	53,414
EUR	7,227,000	NZD	11,923,358	Citibank	20/3/2019	113,354
EUR	4,046,000	USD	4,667,466	Goldman Sachs	20/3/2019	(55,283)
EUR	257,000	USD	294,187	RBS Plc	20/3/2019	(1,223)
EUR	12,288,104	USD	14,160,000	Deutsche Bank	20/3/2019	(152,345)
EUR	7,583,000	USD	8,667,624	Citibank	20/3/2019	(23,488)
EUR	23,673,000	USD	27,074,519	JP Morgan	20/3/2019	(88,808)
EUR	7,584,000	USD	8,642,550	Barclays	20/3/2019	2,727
EUR	21,868,000	USD	25,089,929	Morgan Stanley	20/3/2019	(161,802)
EUR	2,581,993	USD	2,934,649	Bank of America	20/3/2019	8,659
GBP	5,060,000	EUR	5,771,114	HSBC Bank Plc	20/3/2019	156,819
GBP	650,000	EUR	741,063	RBS Plc	20/3/2019	20,470
GBP	1,121,394	EUR	1,285,000	Citibank	20/3/2019	27,904

未決済先渡為替予約 2019年2月28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	750,505	EUR	860,000	Morgan Stanley	20/3/2019	18,675
GBP	2,530,000	EUR	2,864,330	Goldman Sachs	20/3/2019	102,607
GBP	1,250,000	EUR	1,434,144	Barclays	20/3/2019	29,080
GBP	2,936,440	EUR	3,315,323	JP Morgan	20/3/2019	129,529
GBP	1,240,000	EUR	1,412,195	Royal Bank of Canada	20/3/2019	40,790
GBP	954,000	USD	1,233,734	Morgan Stanley	20/3/2019	36,165
GBP	1,074,000	USD	1,417,742	Goldman Sachs	20/3/2019	11,893
GBP	11,025,513	USD	14,160,000	RBS Plc	20/3/2019	516,398
GBP	2,160,000	USD	2,734,728	UBS	20/3/2019	140,514
GBP	1,575,000	USD	1,988,346	Royal Bank of Canada	20/3/2019	108,185
GBP	2,215,000	USD	2,808,157	Citibank	20/3/2019	140,297
GBP	1,586,000	USD	2,095,669	Bank of America	20/3/2019	15,504
GBP	3,440,000	USD	4,456,638	Barclays	20/3/2019	122,451
IDR	94,010,000,000	USD	6,690,627	Morgan Stanley	20/3/2019	(29,075)
JPY	197,548,091	AUD	2,605,000	Standard Chartered Bank	20/3/2019	(76,037)
JPY	325,036,800	AUD	4,320,000	Citibank	20/3/2019	(149,200)
JPY	416,940,400	AUD	5,540,000	JP Morgan	20/3/2019	(190,338)
JPY	658,055,445	AUD	8,574,000	Morgan Stanley	20/3/2019	(179,583)
JPY	287,050,893	AUD	3,554,000	RBS Plc	20/3/2019	54,100
JPY	360,398,767	AUD	4,489,000	Nomura	20/3/2019	48,796
JPY	471,719,913	AUD	6,070,000	Goldman Sachs	20/3/2019	(74,512)
JPY	359,733,688	EUR	2,788,000	RBS Plc	20/3/2019	59,713
JPY	950,259,927	EUR	7,590,000	Citibank	20/3/2019	(99,111)
JPY	578,269,300	EUR	4,625,000	Morgan Stanley	20/3/2019	(67,376)
JPY	1,681,831,885	EUR	13,436,000	JP Morgan	20/3/2019	(178,519)
JPY	408,648,789	EUR	3,227,000	Deutsche Bank	20/3/2019	(449)
JPY	202,025,250	EUR	1,575,000	Bank of America	20/3/2019	22,969
JPY	4,620,934,697	USD	42,790,500	Goldman Sachs	20/3/2019	(1,198,850)
JPY	3,519,710,755	USD	32,507,670	Citibank	20/3/2019	(827,808)
JPY	570,769,762	USD	5,237,330	Barclays	20/3/2019	(100,002)
JPY	221,017,226	USD	2,052,000	Royal Bank of Canada	20/3/2019	(62,690)
JPY	3,002,540,211	USD	27,850,500	Bank of America	20/3/2019	(825,534)
JPY	376,469,360	USD	3,436,000	Morgan Stanley	20/3/2019	(47,512)
JPY	7,093,327,224	USD	65,131,000	Deutsche Bank	20/3/2019	(1,286,086)
JPY	1,321,877,588	USD	12,302,000	BNP Paribas	20/3/2019	(404,176)
JPY	326,730,167	USD	2,964,000	Standard Chartered Bank	20/3/2019	(23,200)
JPY	3,366,169,079	USD	30,692,000	JP Morgan	20/3/2019	(394,121)
KRW	2,396,395,280	USD	2,146,000	RBS Plc	20/3/2019	(14,088)
KRW	5,267,598,000	USD	4,715,000	JP Morgan	20/3/2019	(28,773)
KRW	7,335,000,000	USD	6,520,348	HSBC Bank Plc	20/3/2019	5,108
MXN	94,182,000	EUR	4,281,000	Citibank	20/3/2019	12,078
MXN	42,374,235	USD	2,169,000	Deutsche Bank	20/3/2019	32,067

未決済先渡為替予約 2019年2月28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	50,945,263	USD	2,605,000	Barclays	20/3/2019	41,276
MXN	126,593,239	USD	6,473,000	Goldman Sachs	20/3/2019	102,699
MXN	1,119,223,133	USD	55,187,000	Citibank	20/3/2019	2,949,393
MXN	13,980,228	USD	730,000	JP Morgan	20/3/2019	(3,818)
NOK	68,947,532	CAD	10,708,000	Morgan Stanley	20/3/2019	(55,171)
NOK	70,032,190	CAD	10,832,000	JP Morgan	20/3/2019	(22,308)
NOK	66,714,681	NZD	11,220,000	Nomura	20/3/2019	162,751
NOK	91,018,000	SEK	94,812,904	JP Morgan	20/3/2019	349,796
NOK	25,815,000	SEK	27,253,670	Deutsche Bank	20/3/2019	59,836
NOK	23,020,022	USD	2,700,000	JP Morgan	20/3/2019	(5,688)
NOK	753,561	USD	89,000	Goldman Sachs	20/3/2019	(802)
NOK	45,987,164	USD	5,380,000	Barclays	20/3/2019	2,434
NOK	20,379,596	USD	2,369,500	Citibank	20/3/2019	15,770
NOK	21,827,583	USD	2,595,000	RBS Plc	20/3/2019	(40,254)
NOK	27,354,234	USD	3,250,000	Morgan Stanley	20/3/2019	(48,403)
NZD	17,098,144	AUD	16,125,000	Bank of America	20/3/2019	174,268
NZD	22,560,157	AUD	21,452,000	Citibank	20/3/2019	104,770
NZD	12,850,000	CHF	8,799,320	JP Morgan	20/3/2019	(89,310)
NZD	6,425,000	CHF	4,400,520	Citibank	20/3/2019	(45,520)
NZD	4,875,000	JPY	371,738,250	Bank of America	20/3/2019	(23,920)
NZD	11,220,000	NOK	66,380,941	JP Morgan	20/3/2019	(123,690)
NZD	1,981,000	USD	1,349,754	Barclays	20/3/2019	164
NZD	4,281,000	USD	2,915,400	Citibank	20/3/2019	1,813
NZD	5,300,000	USD	3,564,765	JP Morgan	20/3/2019	46,828
RUB	34,210,800	USD	516,000	Deutsche Bank	20/3/2019	2,280
RUB	33,768,775	USD	510,000	RBS Plc	20/3/2019	1,583
RUB	142,612,400	USD	2,170,000	Citibank	20/3/2019	(9,479)
SEK	73,790,852	CAD	10,720,000	JP Morgan	20/3/2019	(115,326)
SEK	13,775,291	CHF	1,508,889	Bank of America	20/3/2019	(19,911)
SEK	48,989,363	CHF	5,375,000	BNP Paribas	20/3/2019	(79,761)
SEK	78,554,503	CHF	8,566,000	JP Morgan	20/3/2019	(74,799)
SEK	97,944,106	CHF	10,708,000	Barclays	20/3/2019	(121,062)
SEK	12,590,620	EUR	1,201,870	UBS	20/3/2019	(1,856)
SEK	103,397,973	EUR	9,854,047	BNP Paribas	20/3/2019	3,078
SEK	20,109,380	EUR	1,918,991	Citibank	20/3/2019	(2,279)
SEK	136,468,827	EUR	12,929,000	Morgan Stanley	20/3/2019	91,576
SEK	15,000,000	EUR	1,419,321	Royal Bank of Canada	20/3/2019	12,087
SEK	26,888,388	NOK	25,815,000	Citibank	20/3/2019	(99,531)
SEK	95,439,084	NOK	91,018,000	JP Morgan	20/3/2019	(281,751)
SEK	100,231,264	USD	11,290,000	Bank of America	20/3/2019	(398,056)
SEK	8,443,269	USD	954,000	JP Morgan	20/3/2019	(36,486)
SEK	50,154,789	USD	5,640,000	Royal Bank of Canada	20/3/2019	(189,773)
SEK	145,816,695	USD	16,192,000	Morgan Stanley	20/3/2019	(346,372)

未決済先渡為替予約 2019年2月28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)
SEK	44,574,959	USD	4,938,000	Goldman Sachs	20/3/2019	(94,122)
SEK	48,956,511	USD	5,460,000	Citibank	20/3/2019	(139,987)
TRY	40,230,508	USD	7,213,000	BNP Paribas	20/3/2019	273,263
TRY	5,815,541	USD	1,086,000	Citibank	20/3/2019	(3,820)
TWD	220,036,350	USD	7,179,000	JP Morgan	20/3/2019	(30,560)
TWD	468,303,000	USD	15,180,000	Standard Chartered Bank	20/3/2019	34,014
USD	1,387,277	AUD	1,944,000	Deutsche Bank	20/3/2019	3,636
USD	7,963,171	AUD	10,970,000	Citibank	20/3/2019	155,275
USD	4,993,593	AUD	7,012,000	RBS Plc	20/3/2019	2,804
USD	5,549,290	AUD	7,777,000	JP Morgan	20/3/2019	14,012
USD	10,868,422	AUD	15,123,000	Barclays	20/3/2019	104,628
USD	5,884,019	AUD	8,259,000	Goldman Sachs	20/3/2019	5,677
USD	9,652,794	AUD	13,610,573	Bank of America	20/3/2019	(34,530)
USD	3,235,153	AUD	4,530,000	Morgan Stanley	20/3/2019	10,926
USD	10,620,000	AUD	15,090,747	HSBC Bank Plc	20/3/2019	(120,837)
USD	2,166,500	CAD	2,868,901	Standard Chartered Bank	20/3/2019	(10,343)
USD	11,261,500	CAD	14,941,981	Toronto Dominion	20/3/2019	(76,062)
USD	30,199,000	CAD	40,620,917	JP Morgan	20/3/2019	(623,031)
USD	8,566,000	CAD	11,452,978	Barclays	20/3/2019	(124,203)
USD	2,175,000	CAD	2,866,759	Bank of America	20/3/2019	(217)
USD	1,007,000	CAD	1,330,905	RBS Plc	20/3/2019	(2,854)
USD	21,618,500	CAD	28,665,272	Royal Bank of Canada	20/3/2019	(131,915)
USD	20,528,000	CAD	27,676,701	Goldman Sachs	20/3/2019	(472,315)
USD	8,418,000	CAD	11,106,364	Citibank	20/3/2019	(9,202)
USD	13,443,000	CAD	17,796,197	Morgan Stanley	20/3/2019	(60,263)
USD	17,202,000	CAD	22,921,768	BNP Paribas	20/3/2019	(190,404)
USD	8,566,000	CHF	8,598,992	UBS	20/3/2019	(78,336)
USD	3,035,000	CHF	3,032,232	Deutsche Bank	20/3/2019	(13,222)
USD	5,377,500	CHF	5,237,986	RBS Plc	20/3/2019	111,893
USD	4,435,500	CHF	4,331,270	Goldman Sachs	20/3/2019	81,390
USD	2,370,000	CHF	2,324,761	Royal Bank of Canada	20/3/2019	32,980
USD	11,848,000	CHF	11,542,227	Citibank	20/3/2019	244,909
USD	3,991,000	CHF	3,929,056	Bank of America	20/3/2019	41,226
USD	9,805,000	CHF	9,741,935	Toronto Dominion	20/3/2019	11,695
USD	4,340,000	CLP	2,932,321,000	RBS Plc	20/3/2019	(152,546)
USD	5,390,000	CNH	36,565,622	Standard Chartered Bank	20/3/2019	(73,203)
USD	23,213,000	CNH	156,840,256	HSBC Bank Plc	20/3/2019	(220,216)
USD	5,316,000	CNH	35,657,793	Royal Bank of Canada	20/3/2019	(11,566)
USD	19,174,060	EUR	16,844,000	JP Morgan	20/3/2019	(27,026)
USD	70,842,881	EUR	61,708,283	RBS Plc	20/3/2019	499,372
USD	3,343,570	EUR	2,900,000	Citibank	20/3/2019	37,755
USD	23,875,590	EUR	20,788,347	Morgan Stanley	20/3/2019	178,199

未決済先渡為替予約 2019年2月28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	354,479	EUR	310,000	Royal Bank of Canada	20/3/2019	1,099
USD	111,643,331	EUR	97,433,760	Bank of America	20/3/2019	575,057
USD	16,402,995	EUR	14,225,071	Deutsche Bank	20/3/2019	187,321
USD	4,623,377	EUR	4,028,000	Barclays	20/3/2019	31,714
USD	42,543,837	EUR	37,089,904	Goldman Sachs	20/3/2019	263,711
USD	3,056,788	GBP	2,366,000	Goldman Sachs	20/3/2019	(92,667)
USD	6,130,250	GBP	4,688,000	JP Morgan	20/3/2019	(110,090)
USD	2,777,483	GBP	2,160,000	BNP Paribas	20/3/2019	(97,759)
USD	1,990,628	GBP	1,570,000	Royal Bank of Canada	20/3/2019	(99,247)
USD	3,540,000	GBP	2,783,437	RBS Plc	20/3/2019	(165,118)
USD	10,620,000	GBP	8,374,373	Morgan Stanley	20/3/2019	(527,384)
USD	2,832,240	GBP	2,220,000	Bank of America	20/3/2019	(122,870)
USD	16,065,746	IDR	225,739,790,291	Morgan Stanley	20/3/2019	69,816
USD	42,742,000	JPY	4,644,113,189	Citibank	20/3/2019	941,728
USD	4,535,000	JPY	497,141,533	Royal Bank of Canada	20/3/2019	60,378
USD	1,126,000	JPY	122,178,994	Deutsche Bank	20/3/2019	26,303
USD	18,396,000	JPY	1,992,494,082	JP Morgan	20/3/2019	462,158
USD	27,557,908	JPY	3,045,187,878	Morgan Stanley	20/3/2019	149,084
USD	2,600,000	JPY	287,717,040	Standard Chartered Bank	20/3/2019	10,345
USD	10,506,000	JPY	1,154,943,439	Bank of America	20/3/2019	110,700
USD	25,420,000	JPY	2,762,213,590	Goldman Sachs	20/3/2019	558,142
USD	2,146,000	KRW	2,403,090,800	HSBC Bank Plc	20/3/2019	8,132
USD	1,735,000	KRW	1,945,802,500	JP Morgan	20/3/2019	3,951
USD	7,315,000	KRW	8,189,974,804	Citibank	20/3/2019	28,930
USD	2,803,000	MXN	53,974,568	BNP Paribas	20/3/2019	(629)
USD	442,000	MXN	8,586,638	RBS Plc	20/3/2019	(4,020)
USD	2,145,000	MXN	41,205,150	Goldman Sachs	20/3/2019	4,659
USD	11,437,000	MXN	231,318,377	Citibank	20/3/2019	(578,491)
USD	2,715,000	MXN	52,687,290	Morgan Stanley	20/3/2019	(21,763)
USD	3,250,000	NOK	27,442,039	Morgan Stanley	20/3/2019	38,126
USD	3,210,000	NOK	27,298,269	Barclays	20/3/2019	14,954
USD	89,000	NOK	769,575	JP Morgan	20/3/2019	(1,073)
USD	2,700,000	NOK	23,023,389	Deutsche Bank	20/3/2019	5,294
USD	2,170,000	NOK	18,763,339	Citibank	20/3/2019	(26,100)
USD	2,369,500	NOK	20,223,131	HSBC Bank Plc	20/3/2019	2,542
USD	2,595,000	NOK	22,451,029	Royal Bank of Canada	20/3/2019	(32,715)
USD	1,395,814	NZD	2,085,000	RBS Plc	20/3/2019	(24,973)
USD	11,924,881	NZD	17,425,633	Citibank	20/3/2019	50,485
USD	2,170,000	RUB	145,042,800	Citibank	20/3/2019	(27,340)
USD	2,170,000	RUB	145,324,900	BNP Paribas	20/3/2019	(31,614)
USD	3,245,000	SEK	29,185,452	Deutsche Bank	20/3/2019	73,472
USD	2,605,000	SEK	23,179,355	Royal Bank of Canada	20/3/2019	86,143

未決済先渡為替予約 2019年2月28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	4,170,000	SEK	37,404,006	Goldman Sachs	20/3/2019	105,377
USD	20,099,000	SEK	178,442,923	Barclays	20/3/2019	707,942
USD	11,105,000	SEK	99,597,112	Citibank	20/3/2019	281,968
USD	8,299,000	TRY	47,185,682	BNP Paribas	20/3/2019	(481,512)
USD	7,179,000	TWD	220,790,145	Barclays	20/3/2019	6,071
USD	4,320,000	ZAR	60,402,672	BNY Mellon	20/3/2019	13,452
USD	1,713,917	ZAR	25,022,155	Morgan Stanley	20/3/2019	(70,096)
USD	5,354,000	ZAR	79,632,719	Barclays	20/3/2019	(323,598)
USD	12,671,000	ZAR	177,184,439	Citibank	20/3/2019	38,227
USD	26,775,000	ZAR	374,673,168	BNP Paribas	20/3/2019	61,812
USD	5,870,000	ZAR	82,499,995	JP Morgan	20/3/2019	(12,027)
USD	4,038,405	ZAR	58,023,182	Goldman Sachs	20/3/2019	(98,491)
ZAR	169,403,595	USD	12,146,000	Citibank	20/3/2019	(67,980)
ZAR	99,298,333	USD	7,126,000	BNP Paribas	20/3/2019	(46,297)
ZAR	36,456,454	USD	2,605,000	JP Morgan	20/3/2019	(5,753)
ZAR	36,697,887	USD	2,600,000	RBS Plc	20/3/2019	16,461
ZAR	37,692,035	USD	2,710,000	HSBC Bank Plc	20/3/2019	(22,659)
ZAR	12,215,234	USD	870,000	Bank of America	20/3/2019	913
ZAR	34,458,227	USD	2,372,405	Standard Chartered Bank	20/3/2019	84,374
ZAR	202,473,052	USD	14,585,000	Morgan Stanley	20/3/2019	(149,217)
ZAR	70,638,119	USD	5,183,000	Deutsche Bank	20/3/2019	(146,693)
ZAR	55,414,128	USD	4,008,917	Goldman Sachs	20/3/2019	(58,038)
ARS	39,690,000	USD	980,000	JP Morgan	21/3/2019	23,401
AUD	4,272,000	USD	3,063,784	JP Morgan	29/3/2019	(22,716)
BRL	126,943,752	USD	33,961,158	UBS	2/4/2019	31,607
USD	4,340,000	BRL	16,222,920	Citibank	2/4/2019	(4,144)
USD	2,682,635	BRL	10,027,448	UBS	2/4/2019	(2,497)
BRL	132,000	USD	33,416	BNP Paribas	4/4/2019	1,926
USD	7,128,492	KRW	8,000,000,000	Morgan Stanley	4/4/2019	7,648
USD	2,957,958	MXN	57,018,000	Goldman Sachs	4/4/2019	3,396
COP	12,187,944,000	USD	3,924,000	Citibank	5/4/2019	34,717
USD	13,036,789	IDR	188,199,083,100	Citibank	12/4/2019	(244,190)
ARS	46,107,000	USD	1,090,000	BNP Paribas	22/4/2019	36,619
ARS	80,891,250	USD	1,961,000	RBS Plc	25/4/2019	8,841
USD	4,071,000	ARS	165,282,600	Deutsche Bank	25/4/2019	46,084
EGP	71,442,260	USD	3,973,000	Citibank	30/4/2019	41,794
IDR	194,118,815,595	USD	13,627,154	Bank of America	29/5/2019	(25,558)
USD	1,181,625	CHF	1,174,133	HSBC Bank Plc	29/5/2019	(6,609)
USD	3,573,682	EUR	3,135,785	Goldman Sachs	29/5/2019	(22,291)
USD	13,677,081	IDR	194,118,815,595	Citibank	29/5/2019	75,485
ARS	119,776,800	USD	2,860,000	Deutsche Bank	30/5/2019	(54,798)
ARS	204,378,400	USD	4,912,000	BNP Paribas	30/5/2019	(125,407)
MXN	217,717,409	USD	11,059,174	Barclays	30/5/2019	128,121

未決済先渡為替予約 2019年2月28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	31,669,674	COP	99,126,079,106	Credit Suisse	30/5/2019	(454,485)
USD	33,160,240	MXN	646,070,898	Barclays	30/5/2019	(37,777)
USD	32,626,906	ZAR	454,160,000	Deutsche Bank	30/5/2019	527,253
ZAR	213,748,456	USD	14,886,547	Bank of America	30/5/2019	221,017
USD	4,070,000	ARS	168,986,400	BNP Paribas	31/5/2019	116,743
MXN	85,946,400	USD	4,320,000	Barclays	14/6/2019	86,493
USD	4,320,000	MXN	85,060,800	Barclays	14/6/2019	(41,088)
TRY	18,047,377	USD	3,370,110	JP Morgan	19/6/2019	(174,478)
EUR	31,760,000	USD	38,858,995	JP Morgan	13/12/2019	(1,816,169)
USD	41,192,720	EUR	31,760,000	Deutsche Bank	13/12/2019	4,149,894
EUR	31,760,000	USD	39,139,277	JP Morgan	25/2/2020	(1,860,737)
USD	41,459,504	EUR	31,760,000	Deutsche Bank	25/2/2020	4,180,963
JPY	4,230,950,000	USD	39,204,503	JP Morgan	16/3/2020	40,859
USD	42,233,480	JPY	4,230,950,000	HSBC Bank Plc	16/3/2020	2,988,117
未実現純評価益						15,956,239
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	139,908,893	USD	99,189,334	BNY Mellon	14/3/2019	380,419
USD	402,418	AUD	563,879	BNY Mellon	14/3/2019	1,119
未実現純評価益						381,538
ヘッジを使用したカナダ・ドル建投資証券クラス						
CAD	1,215,083,337	USD	916,736,371	BNY Mellon	14/3/2019	5,092,221
USD	1,493,664	CAD	1,968,441	BNY Mellon	14/3/2019	295
未実現純評価益						5,092,516
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	249,294,980	USD	247,896,346	BNY Mellon	14/3/2019	2,563,342
USD	2,233,141	CHF	2,235,447	BNY Mellon	14/3/2019	(12,759)
未実現純評価益						2,550,583
ヘッジを使用した中国人民元建投資証券クラス						
CNY	4,470,292	USD	659,666	BNY Mellon	14/3/2019	8,229
未実現純評価益						8,229
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	1,989,815,648	USD	2,250,396,183	BNY Mellon	14/3/2019	16,673,711
USD	33,823,963	EUR	29,807,175	BNY Mellon	14/3/2019	(136,543)
未実現純評価益						16,537,168

未決済先渡為替予約 2019年2月28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	1,253,421,633	USD	1,613,527,508	BNY Mellon	14/3/2019	54,379,213
USD	5,647,320	GBP	4,342,466	BNY Mellon	14/3/2019	(131,157)
未実現純評価益						54,248,056
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	5,772,868	USD	736,378	BNY Mellon	14/3/2019	(693)
未実現純評価損						(693)
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	58,210,858,852	USD	527,731,141	BNY Mellon	14/3/2019	(4,050,029)
USD	9,070	JPY	1,000,000	BNY Mellon	14/3/2019	74
未実現純評価損						(4,049,955)
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	159,815,156	USD	41,703,773	BNY Mellon	14/3/2019	540,836
USD	965,351	PLN	3,677,663	BNY Mellon	14/3/2019	(6,783)
未実現純評価益						534,053
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	1,109,100,298	USD	119,901,999	BNY Mellon	14/3/2019	561,982
USD	732,692	SEK	6,806,000	BNY Mellon	14/3/2019	(6,533)
未実現純評価益						555,449
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	99,014,952	USD	72,966,130	BNY Mellon	14/3/2019	370,950
USD	79,795	SGD	108,157	BNY Mellon	14/3/2019	(313)
未実現純評価益						370,637
未実現純評価益合計						92,183,820

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 2019年2月28日現在

契約数	通貨	契約 / 摘要	満期日	未実現評価益 / (損) (米ドル)
901	AUD	Australian 3 Year Bond	2019年3月	247,096
(522)	AUD	Australian 10 Year Bond	2019年3月	(774,025)
3,922	EUR	Euro Schatz	2019年3月	(304,341)
901	EUR	Euro-BTP	2019年3月	411,769
161	EUR	Euro BOBL	2019年3月	(43,986)
107	EUR	EURO STOXX 50 Index	2019年3月	120,343
23	EUR	EURO STOXX 600 Bank Index	2019年3月	10,211
6	EUR	Euro BUXL	2019年3月	(12,045)
(409)	EUR	Euro-OAT	2019年3月	117,671
(1,647)	EUR	Euro Bund	2019年3月	167,320
(1,761)	EUR	Euro-BTP	2019年3月	(1,146,861)
47	JPY	TOPIX Index	2019年3月	162,652
(31)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2019年3月	(26,607)
(529)	KRW	Korean 10 Year Bond	2019年3月	(11,497)
592	USD	MSCI Emerging Markets Index	2019年3月	983,465
8	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	2019年3月	61,522
(109)	USD	CBOE Volatility Index	2019年3月	242,054
(422)	USD	S&P 500 E-Mini Index	2019年3月	21,653
66	USD	CBOE Volatility Index	2019年4月	(108,047)
(5)	CAD	Canadian 10 Year Bond	2019年6月	1,009
(380)	GBP	Long Gilt	2019年6月	856,560
6,787	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2019年6月	(1,426,170)
6,340	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2019年6月	(1,429,724)
3,385	USD	US Ultra Bond (CBT)	2019年6月	(3,971,333)
(1,120)	USD	US Long Bond (CBT)	2019年6月	903,965
(3,204)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2019年6月	1,557,875
(8,779)	USD	US Ultra 10 Year Note	2019年6月	3,692,573
2,869	USD	90 Day Euro \$	2019年12月	160,725
(4,554)	USD	90 Day Euro \$	2020年3月	(3,358,575)
(729)	USD	90 Day Euro \$	2020年6月	(91,125)
(1,510)	USD	90 Day Euro \$	2020年12月	(22,548)
(630)	USD	90 Day Euro \$	2021年3月	(303,657)
合計				(3,312,078)

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 2019年2月28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	EUR 740,000	ファンドはThomas Cook Group 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	Bank of America	20/6/2020	102,321	58,601
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%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2020	301,045	91,065
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	(178,768)	(101,524)
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	(37,149)	(49,558)
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	(22,753)	(30,974)
CDS	EUR (760,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2023	(26,649)	(108,033)
CDS	EUR (107,914)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2023	1,672	(15,340)
CDS	EUR (9,250)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2023	143	(1,315)
CDS	USD 2,615,000	ファンドはColombia 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	20/12/2023	(20,409)	7,529
CDS	EUR 89,844	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	Bank of America	20/12/2023	(2,180)	(20,244)
CDS	EUR 455,000	ファンドはTelecom Italia SpA/Milano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	20/12/2023	(6,354)	42,469
CDS	EUR 444,000	ファンドはLANXESS 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	Bank of America	20/12/2023	3,034	(5,435)
CDS	USD 1,980,000	ファンドはBeazer Homes USA Inc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	20/6/2020	10,426	(97,333)
CDS	USD (3,000,000)	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/9/2020	63,206	38,715

スワップ 2019年2月28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	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	(13,392)	(20,958)
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	(11,905)	(10,695)
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	(13,503)	(18,584)
CDS	USD (1,980,000)	ファンドはBeazer Homes USA Inc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	20/6/2023	(71,320)	94,200
CDS	EUR (130,000)	ファンドはBoparan Finance 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	20/6/2023	(19,858)	(32,051)
CDS	EUR (197,984)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(2,314)	(28,143)
CDS	EUR (1,350,000)	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria SA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	20/6/2023	12,461	29,601
CDS	EUR (36,367)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(425)	(5,170)
CDS	EUR 100,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitions ULC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	20/6/2023	1,058	(20,570)
CDS	EUR 180,000	ファンドはUnitymedia 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	Barclays	20/6/2023	(468)	(38,218)
CDS	EUR (412,016)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(5,985)	(58,568)
CDS	EUR (275,799)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(2,836)	(39,205)
CDS	EUR (3,633)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(53)	(516)

スワップ 2019年2月28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 4,356,000	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(81,842)	102,312
CDS	EUR 730,000	ファンドはINEOS Group Holdings 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	Barclays	20/12/2023	(18,318)	(72,003)
CDS	USD 4,392,000	ファンドはColombia 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	20/12/2023	(69,212)	12,645
CDS	USD 8,713,000	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(167,294)	204,648
CDS	USD 3,801,000	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	Barclays	20/12/2023	9,551	37,937
CDS	EUR 580,000	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	Barclays	20/12/2023	(10,885)	(13,213)
CDS	USD 4,393,000	ファンドはColombia 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	20/12/2023	(69,228)	12,648
CDS	EUR 3,600,000	ファンドはVolkswagen 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	Barclays	20/12/2023	(48,290)	1,257
CDS	EUR 3,970,000	ファンドはEnel SpA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	20/12/2023	(38,762)	(32,140)
CDS	EUR 200,000	ファンドはMatterhorn Telecom Holding 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	Barclays	20/12/2023	(394)	(18,074)
CDS	USD 4,356,000	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(81,842)	102,312
CDS	USD 4,356,000	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(79,302)	102,312
CDS	USD 8,714,000	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(167,313)	204,672
CDS	USD 4,357,000	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(81,860)	102,336

スワップ 2019年2月28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 4,357,000	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(81,860)	102,336
CDS	USD 4,356,000	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(86,472)	102,312
CDS	USD 4,357,000	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(79,321)	102,336
CDS	USD 4,357,000	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(85,451)	102,336
CDS	USD 4,357,000	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(80,218)	102,336
CDS	USD 1,950,000	ファンドはInternational Paper 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	Barclays	20/12/2023	(25,909)	(39,362)
CDS	EUR 370,000	ファンドはNext 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	20/12/2023	(7,494)	2,681
CDS	EUR 900,000	ファンドはTelia Co AB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	20/12/2023	(1,649)	(30,048)
CDS	EUR 700,000	ファンドはRepsol 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	Barclays	20/12/2023	(14,977)	(16,385)
CDS	USD 4,357,000	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(81,860)	102,336
CDS	USD 4,356,718	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(91,890)	102,329
CDS	EUR 62,000	ファンドはAltice Luxembourg 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	Barclays	20/12/2023	(4,467)	1,601
CDS	USD 5,144,282	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(107,443)	120,827
CDS	EUR 290,000	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	Barclays	20/12/2023	(5,792)	(6,606)

スワップ 2019年2月28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 2,300,000	ファンドはNext 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	20/12/2023	(3,315)	16,667
CDS	EUR 760,000	ファンドはAnglo American 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	20/12/2023	(26,125)	(162,073)
CDS	EUR 773,333	ファンドはTelia Co AB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	20/12/2023	(4,067)	(25,819)
CDS	USD 4,356,000	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(85,432)	102,312
CDS	EUR 1,111,000	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	20/12/2023	5,099	34,131
CDS	USD 8,339,000	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	Barclays	20/12/2023	20,955	83,229
CDS	EUR (300,000)	ファンドはTesco 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	20/12/2025	(2,306)	(11,545)
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	(63,472)	(41,263)
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	(36,263)	(23,315)
CDS	USD 9,506,000	ファンドはCDX.NA.HY.29.V3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	20/12/2022	(136,772)	(641,522)
CDS	EUR (70,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(2,669)	(9,950)
CDS	EUR (228,538)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(8,715)	(32,486)
CDS	EUR (310,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	3,350	(44,066)
CDS	EUR (70,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(2,669)	(9,950)

スワップ 2019年2月28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 (590,000)	ファンドはIntesa Sanpaolo 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	20/6/2023	20,073	(8,706)
CDS	EUR (254,908)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	2,200	(36,235)
CDS	EUR (237,328)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(9,050)	(33,736)
CDS	EUR (10,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(381)	(1,422)
CDS	EUR 300,000	ファンドはOI European Group BV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	20/12/2023	5,492	(52,543)
CDS	EUR (759,000)	ファンドはUniCredit 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	20/12/2023	18,799	(12,588)
CDS	USD 3,561,000	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	BNP Paribas	20/12/2023	(41,071)	35,541
CDS	USD 1,709,331	ファンドはColombia 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	BNP Paribas	20/12/2023	(21,013)	4,921
CDS	EUR 705,000	ファンドはCarlsberg 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	20/12/2023	(923)	(25,725)
CDS	EUR 160,000	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	BNP Paribas	20/12/2023	(4,529)	4,915
CDS	EUR 1,260,000	ファンドはTOTAL 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	BNP Paribas	20/12/2023	(10,524)	(53,588)
CDS	USD 30,346,000	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	BNP Paribas	20/12/2023	(387,607)	(525,698)
CDS	USD 1,379,000	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	BNP Paribas	20/12/2023	2,865	13,763

スワップ 2019年2月28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 740,000	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria 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	BNP Paribas	20/12/2023	(27,944)	25,405
CDS	EUR 1,530,000	ファンドはDeutsche Lufthansa 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	20/12/2023	(29,536)	(43,107)
CDS	USD 4,332,000	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	BNP Paribas	20/12/2023	(49,963)	43,236
CDS	EUR 460,000	ファンドはDanske Bank 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	20/12/2023	(11,182)	7,623
CDS	USD 3,093,000	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	BNP Paribas	20/12/2023	6,425	30,870
CDS	USD 2,059,000	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	BNP Paribas	20/12/2023	4,277	20,550
CDS	USD 2,761,000	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	BNP Paribas	20/12/2023	1,837	27,557
CDS	EUR 400,000	ファンドはElis 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	20/12/2023	(6,708)	(85,269)
CDS	EUR 9,000,000	ファンドはBanco Santander 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	BNP Paribas	20/12/2023	(186,794)	230,914
CDS	EUR 225,000	ファンドはArdagh Packaging Finance 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	BNP Paribas	20/12/2023	(10,628)	(30,182)
CDS	EUR 3,750,000	ファンドはBP 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	20/12/2023	(13,130)	(119,965)
CDS	EUR 210,000	ファンドはNXP BV / NXP Funding LLC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	20/12/2023	8,909	(37,540)
CDS	EUR 2,185,000	ファンドはCarlsberg 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	20/12/2023	(1,115)	(79,728)
CDS	USD 1,270,000	ファンドはInternational Paper 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	BNP Paribas	20/12/2023	(19,001)	(25,636)

スワップ 2019年2月28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 8,310,000	ファンドはTurkey 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	BNP Paribas	20/12/2023	(215,233)	703,598
CDS	USD 4,332,000	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	BNP Paribas	20/12/2023	(49,963)	43,236
CDS	EUR 900,000	ファンドはHeineken 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	BNP Paribas	20/12/2023	(3,803)	(35,678)
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	(39,984)	(43,431)
CDS	EUR 200,000	ファンドはWind Tre SpA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	20/12/2021	(4,365)	(17,889)
CDS	EUR (105,195)	ファンドはThomas Cook Group 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	Citibank	20/6/2023	(36,602)	(22,494)
CDS	EUR 100,000	ファンドはNovafives SAS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	20/6/2023	6,707	2,554
CDS	EUR 230,000	ファンドはUPC Holding BV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	20/6/2023	(9,132)	(45,995)
CDS	EUR (570,000)	ファンドはThomas Cook Group 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	Citibank	20/6/2023	(198,326)	(121,884)
CDS	EUR (600,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(542)	(85,289)
CDS	EUR (242,086)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	1,577	(34,412)
CDS	EUR (51,043)	ファンドはIntrum AB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	20/6/2023	1,963	4,482
CDS	EUR (400,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(4,027)	(56,860)
CDS	EUR (350,000)	ファンドはBoparan Finance 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	Citibank	20/6/2023	(59,678)	(86,290)

スワップ 2019年2月28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 (247,704)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	296	(35,211)
CDS	EUR (760,000)	ファンドはCommerzbank AG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	20/6/2023	2,252	(30,357)
CDS	EUR (106,488)	ファンドはIntrum AB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	20/6/2023	4,046	9,351
CDS	EUR (78,540)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	94	(11,164)
CDS	EUR (20,750)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	135	(2,950)
CDS	EUR (1,400,000)	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria SA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	20/6/2023	12,841	30,697
CDS	EUR (6,655)	ファンドはIntrum AB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	20/6/2023	253	584
CDS	EUR (382,000)	ファンドはThomas Cook Group 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	Citibank	20/6/2023	(131,424)	(81,683)
CDS	EUR 100,000	ファンドはNovafives SAS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	20/6/2023	8,421	2,554
CDS	EUR (7,854)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	9	(1,116)
CDS	EUR (200,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	751	(28,430)
CDS	EUR (253,054)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(3,676)	(35,971)
CDS	EUR 950,000	ファンドはINEOS Group Holdings 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	Citibank	20/12/2023	(28,026)	(93,702)
CDS	EUR 370,000	ファンドはUPC Holding BV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	20/12/2023	(23,260)	(79,684)

スワップ 2019年2月28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 1,160,000	ファンドはStandard Chartered 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	Citibank	20/12/2023	(72,919)	18,181
CDS	USD 4,290,000	ファンドはColombia 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	20/12/2023	(67,618)	12,351
CDS	USD 6,950,000	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	Citibank	20/12/2023	4,664	69,366
CDS	USD 4,291,000	ファンドはColombia 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	20/12/2023	(72,183)	12,354
CDS	EUR 3,289,700	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	Citibank	20/12/2023	(103,722)	(741,233)
CDS	USD 11,148,000	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	20/12/2023	(115,200)	357,794
CDS	EUR 5,725,000	ファンドはBP 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	Citibank	20/12/2023	(21,623)	(183,147)
CDS	EUR 480,000	ファンドはArdagh Packaging Finance 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	20/12/2023	(17,547)	(64,388)
CDS	EUR 153,000	ファンドはRenault 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	20/12/2023	(2,918)	1,264
CDS	EUR 670,000	ファンドはSunrise Communications Holdings 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	Citibank	20/12/2023	10,353	(148,904)
CDS	EUR 850,000	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	Citibank	20/12/2023	(2,185)	26,113
CDS	USD 1,370,000	ファンドはColombia 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	20/12/2023	(21,008)	3,944
CDS	EUR 103,180	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	Citibank	20/12/2023	(2,746)	(23,248)

スワップ 2019年2月28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 20,000	ファンドはNext 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	Citibank	20/12/2023	(395)	145
CDS	USD 3,702,000	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	Citibank	20/12/2023	10,097	36,948
CDS	USD 4,291,000	ファンドはColombia 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	20/12/2023	(70,364)	12,354
CDS	USD 3,750,000	ファンドはColombia 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	20/12/2023	(17,031)	10,796
CDS	USD 2,700,000	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	Citibank	20/12/2023	(12,919)	(55,852)
CDS	EUR 430,000	ファンドはAltice Luxembourg 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	Citibank	20/12/2023	(30,385)	11,105
CDS	EUR 760,000	ファンドはStandard Chartered 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	Citibank	20/12/2023	(44,043)	11,911
CDS	USD 5,133,616	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	Citibank	20/12/2023	(66,325)	51,237
CDS	EUR 1,520,000	ファンドはAirbus SE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	20/12/2023	(10,882)	(58,286)
CDS	USD 9,500,000	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	Citibank	20/12/2023	(106,852)	94,816
CDS	EUR 510,000	ファンドはAirbus SE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	20/12/2023	(4,061)	(19,556)
CDS	EUR 160,000	ファンドはArdagh Packaging Finance 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	20/12/2023	(6,232)	(21,463)
CDS	USD 4,253,000	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	Citibank	20/12/2023	(50,992)	42,448
CDS	USD 4,291,000	ファンドはColombia 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	20/12/2023	(65,813)	12,354

スワップ 2019年2月28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 (900,000)	ファンドはUniCredit 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	Citibank	20/12/2023	35,148	(14,926)
CDS	EUR 700,000	ファンドはStandard Chartered 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	Citibank	20/12/2023	(34,054)	10,971
CDS	USD 4,252,000	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	Citibank	20/12/2023	(47,384)	42,438
CDS	USD 4,252,000	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	Citibank	20/12/2023	(39,294)	42,438
CDS	USD 4,252,000	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	Citibank	20/12/2023	(36,585)	42,438
CDS	EUR (240,000)	ファンドはThomas Cook Group 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	Citibank	20/12/2023	8,984	(55,198)
CDS	USD 8,034,594	ファンドはTurkey 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	20/12/2023	(232,921)	680,279
CDS	USD 8,030,000	ファンドはTurkey 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	20/12/2023	(208,301)	679,890
CDS	EUR 400,000	ファンドはPeugeot 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	Citibank	20/12/2023	(3,153)	(81,451)
CDS	USD 8,075,000	ファンドはTurkey 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	20/12/2023	(203,165)	683,701
CDS	EUR 1,295,000	ファンドはCarlsberg 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	Citibank	20/12/2023	(1,095)	(47,253)
CDS	EUR 1,910,000	ファンドはHeineken 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	Citibank	20/12/2023	(9,255)	(75,716)
CDS	EUR 440,000	ファンドはUniCredit SpA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	20/12/2023	(492)	50,458
CDS	EUR (700,000)	ファンドはZiggo Bond Co 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	Citibank	20/12/2026	33,179	123,915

スワップ 2019年2月28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 11,148,000	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	Citigroup	20/12/2023	(114,933)	357,794
CDS	EUR 600,000	ファンドはWind Tre SpA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	20/12/2020	(8,950)	(44,934)
CDS	EUR 70,000	ファンドはUnitymedia 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	20/12/2022	(1,744)	(13,492)
CDS	EUR (67,193)	ファンドはIntrum AB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	20/6/2023	(2,340)	5,900
CDS	EUR (200,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 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	Credit Suisse	20/6/2023	(42,084)	(42,795)
CDS	USD 12,641,820	ファンドはCDX.NA.IG.30.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	20/6/2023	(76,301)	(238,628)
CDS	EUR 200,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitions ULC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	20/6/2023	(1,019)	(41,139)
CDS	EUR (4,335)	ファンドはIntrum AB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	20/6/2023	(151)	381
CDS	EUR (9,483)	ファンドはIntrum AB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	20/6/2023	(168)	833
CDS	EUR (350,000)	ファンドはBoparan Finance 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	20/6/2023	(55,964)	(86,290)
CDS	EUR 380,000	ファンドはUnitymedia 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	20/6/2023	3,040	(80,683)
CDS	EUR (300,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 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	Credit Suisse	20/6/2023	(67,960)	(64,193)
CDS	EUR (284,487)	ファンドはIntrum AB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	20/6/2023	(6,290)	24,981
CDS	EUR 200,000	ファンドはUPC Holding BV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	20/6/2023	(5,894)	(39,995)
CDS	EUR 400,000	ファンドはUPC Holding BV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	20/6/2023	(17,113)	(79,991)
CDS	USD 2,102,100	ファンドはCDX.NA.HY.30.V3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	20/6/2023	(25,231)	(144,774)

スワップ 2019年2月28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 580,000	ファンドはUnitymedia 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	20/6/2023	(2,656)	(123,147)
CDS	EUR (86,922)	ファンドはIntrum AB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	20/6/2023	(1,536)	7,633
CDS	EUR 1,000,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitions ULC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	20/6/2023	(14,725)	(205,696)
CDS	EUR 150,000	ファンドはArdagh Packaging Finance 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	Credit Suisse	20/12/2023	(9,273)	(20,121)
CDS	EUR 950,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2023	(8,802)	69,640
CDS	EUR 540,000	ファンドはMatterhorn Telecom Holding 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	Credit Suisse	20/12/2023	(14,312)	(48,800)
CDS	EUR (482,047)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 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	Credit Suisse	20/12/2023	(121,423)	(112,093)
CDS	EUR 360,000	ファンドはCellnex Telecom 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	Credit Suisse	20/12/2023	5,942	(64,359)
CDS	EUR (52,726)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 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	Credit Suisse	20/12/2023	(13,281)	(12,261)
CDS	EUR (57,836)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 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	Credit Suisse	20/12/2023	(14,568)	(13,449)
CDS	EUR 810,000	ファンドはUPC Holding BV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	20/12/2023	(17,971)	(174,443)
CDS	EUR 201,724	ファンドはUPC Holding BV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	20/12/2023	(1,902)	(43,444)
CDS	EUR (710,000)	ファンドはVirgin Media Finance 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	20/6/2025	1,151	127,857
CDS	EUR (30,000)	ファンドはVirgin Media Finance 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	20/12/2025	414	5,487

スワップ 2019年2月28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 (400,000)	ファンドはVirgin Media Finance 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	20/12/2025	5,514	73,166
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	67,314	12,820
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	(79,700)	(37,590)
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	(26,173)	(83,117)
CDS	USD 2,871,400	ファンドはCDX.NA.HY.29.V3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	Deutsche Bank	20/12/2022	(40,756)	(193,779)
CDS	USD 3,536,000	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	Deutsche Bank	20/12/2023	1,597	35,292
CDS	USD 4,382,000	ファンドはColombia 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	Deutsche Bank	20/12/2023	(69,055)	12,616
CDS	USD 6,650,000	ファンドはTurkey 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	Deutsche Bank	20/12/2023	(159,912)	563,047
CDS	USD 3,536,000	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	Deutsche Bank	20/12/2023	1,597	35,292
CDS	USD 3,325,000	ファンドはTurkey 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	Deutsche Bank	20/12/2023	(83,656)	281,524
CDS	USD (974,000)	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	49,511	(57,569)
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	(64,516)	(30,199)
CDS	USD 3,290,834	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	(28,364)	(27,735)
CDS	USD 4,626,525	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	(37,387)	(38,992)
CDS	USD 5,304,050	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	(46,379)	(44,702)
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	64,628	38,715

スワップ 2019年2月28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	(37,833)	(30,528)
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	(22,304)	(25,539)
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	(11,109)	(12,630)
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	(10,658)	(12,630)
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	(11,606)	(12,769)
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	(11,446)	(13,793)
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	(8,802)	(12,919)
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	(10,539)	(12,630)
CDS	USD (5,750,000)	ファンドはITRAXX.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	250,264	82,938
CDS	EUR (237,328)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(8,756)	(33,736)
CDS	EUR 100,000	ファンドはUPC Holding BV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	20/6/2023	(3,330)	(19,998)
CDS	USD (562,981)	ファンドはBeazer Homes USA Inc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	20/6/2023	1,095	26,784
CDS	EUR (103,805)	ファンドはThomas Cook Group 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	Goldman Sachs	20/6/2023	(35,854)	(22,197)
CDS	USD (938,301)	ファンドはBeazer Homes USA Inc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	20/6/2023	2,823	44,640
CDS	EUR (240,000)	ファンドはThomas Cook Group 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	Goldman Sachs	20/6/2023	(82,999)	(51,319)
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	20/6/2023	(1,296)	(38,478)

スワップ 2019年2月28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 (80,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(2,951)	(11,372)
CDS	EUR 200,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitions ULC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	20/6/2023	(3,045)	(41,139)
CDS	EUR (610,000)	ファンドはThomas Cook Group 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	Goldman Sachs	20/6/2023	(209,763)	(130,437)
CDS	EUR 150,000	ファンドはUPC Holding BV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	20/6/2023	(6,287)	(29,997)
CDS	EUR 200,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitions ULC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	20/6/2023	(2,530)	(41,139)
CDS	EUR (170,000)	ファンドはThomas Cook Group 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	Goldman Sachs	20/6/2023	(58,090)	(36,351)
CDS	JPY 179,346,181	ファンドはSoftBank Group 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	20/12/2023	(6,961)	72,234
CDS	EUR 400,000	ファンドはHellenic Telecommunications Organisation 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	Goldman Sachs	20/12/2023	(18,224)	(94,460)
CDS	JPY 95,300,000	ファンドはSoftBank Group 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	20/12/2023	(18,299)	38,383
CDS	EUR 400,000	ファンドはArcelorMittal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	20/12/2023	315	(72,403)
CDS	EUR (400,000)	ファンドはCMA CGM 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	20/12/2023	10,067	(29,716)
CDS	USD 8,035,000	ファンドはTurkey 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	20/12/2023	(198,006)	680,314
CDS	USD 8,070,000	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	Goldman Sachs	20/12/2023	(49,893)	259,006
CDS	EUR 670,000	ファンドはLeonardo SpA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	20/12/2023	(12,146)	(127,282)

スワップ 2019年2月28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 9,610,000	ファンドはWeyerhaeuser 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	Goldman Sachs	20/12/2023	(77,869)	(221,861)
CDS	EUR 200,000	ファンドはHellenic Telecommunications Organisation 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	Goldman Sachs	20/12/2023	(9,373)	(47,230)
CDS	EUR 200,000	ファンドはMatterhorn Telecom Holding 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	Goldman Sachs	20/12/2023	(1,749)	(18,074)
CDS	EUR 110,000	ファンドはNXP BV / NXP Funding LLC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	20/12/2023	3,617	(19,664)
CDS	EUR 1,160,000	ファンドはRepsol 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	Goldman Sachs	20/12/2023	(13,703)	(27,153)
CDS	USD 1,650,000	ファンドはDISH DBS Corp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	20/12/2023	(11,336)	46,670
CDS	USD 7,113,000	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	Goldman Sachs	20/12/2023	(49,809)	228,291
CDS	EUR 370,000	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	20/12/2023	8,859	(65,424)
CDS	USD 10,960,000	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(642,661)	257,425
CDS	EUR 360,000	ファンドはHellenic Telecommunications Organisation 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	Goldman Sachs	20/12/2023	(17,838)	(85,014)
CDS	EUR 680,000	ファンドはPeugeot 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	Goldman Sachs	20/12/2023	1,167	(138,466)
CDS	EUR (600,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/12/2023	1,326	(98,369)
CDS	EUR 89,043,105	ファンドはITRAXX.X0.30.V2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	20/12/2023	(3,259,416)	(10,016,197)
CDS	EUR 185,000	ファンドはArcelorMittal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	20/12/2023	(9,138)	(33,486)

スワップ 2019年2月28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 16,406,180	ファンドはCDX.NA.HY.31.V3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	20/12/2023	(345,456)	(1,050,233)
CDS	EUR 95,000	ファンドはArcelorMittal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	20/12/2023	(4,267)	(17,196)
CDS	USD 7,192,000	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	Goldman Sachs	20/12/2023	(47,638)	230,827
CDS	EUR 384,615	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	20/12/2023	6,069	(68,008)
CDS	EUR 1,370,000	ファンドはAirbus SE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	20/12/2023	(11,116)	(52,534)
CDS	USD 8,004,406	ファンドはTurkey 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	20/12/2023	(195,453)	677,723
CDS	EUR 500,000	ファンドはNext 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	20/12/2023	(989)	3,623
CDS	USD 1,650,305	ファンドはDISH DBS Corp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	20/12/2023	(47,942)	35,057
CDS	USD 3,099,000	ファンドはBrazilian 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	20/12/2023	(60,461)	72,788
CDS	EUR 188,000	ファンドはRenault 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	Goldman Sachs	20/12/2023	(2,951)	1,553
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	(54,714)	(12,820)
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	44,040	(1,230)
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	76,496	(4,005)
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	141,523	(134,762)
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	50,795	(66,731)
CDS	USD (220,000)	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	11,590	(13,003)

スワップ 2019年2月28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 54,753,754	ファンドはBrazilian 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	HSBC Bank Plc	20/12/2023	(3,221,232)	1,286,039
CDS	EUR (91,000)	ファンドはUniCredit 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	HSBC Bank Plc	20/12/2023	2,489	(1,509)
CDS	EUR 900,000	ファンドはUniCredit SpA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	20/12/2023	(44,202)	103,209
CDS	USD 858,527	ファンドはFrontier Communications Corp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	20/12/2019	(17,468)	54,590
CDS	USD 810,000	ファンドはHCA-The Healthcare 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	JP Morgan	20/6/2020	(1,100)	(50,128)
CDS	USD 2,700,000	ファンドはHCA-The Healthcare 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	JP Morgan	20/6/2020	(4,414)	(167,094)
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	(139,986)	(91,065)
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	333,122	101,524
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	(45,065)	(49,636)
CDS	USD 3,614,314	ファンドはAustralia And New Zealand Banking Group 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	JP Morgan	20/12/2020	(45,934)	(52,032)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはAustralia And New Zealand Banking Group 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	JP Morgan	20/12/2020	(42,797)	(43,188)
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	(12,913)	(10,857)
CDS	USD 2,385,686	ファンドはAustralia And New Zealand Banking Group 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	JP Morgan	20/12/2020	(29,910)	(34,344)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはNational Australia Bank 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	JP Morgan	20/12/2020	(42,021)	(43,502)

スワップ 2019年2月28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	(40,230)	(43,162)
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	(11,141)	(15,487)
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	(22,282)	(30,974)
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	(10,207)	(15,487)
CDS	EUR 1,000,000	ファンドはAltice Luxembourg 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	20/12/2022	(33,796)	(6,269)
CDS	EUR (250,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/12/2022	(19,186)	(29,800)
CDS	EUR (7,862)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	9	(1,118)
CDS	EUR (3,144)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(25)	(447)
CDS	EUR (760,000)	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria SA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	20/6/2023	8,463	(17,758)
CDS	EUR (247,944)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	296	(35,245)
CDS	EUR (47,170)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(376)	(6,705)
CDS	EUR (360,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	18,195	(51,174)
CDS	EUR (78,616)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	94	(11,175)

スワップ 2019年2月28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 (10,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(391)	(1,422)
CDS	EUR (154,527)	ファンドはIntrum AB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	20/6/2023	5,911	13,569
CDS	USD (12,641,820)	ファンドはCDX.NA.IG.30.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	JP Morgan	20/6/2023	42,423	238,628
CDS	EUR (31,447)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(251)	(4,470)
CDS	EUR 400,000	ファンドはIntesa Sanpaolo SpA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	20/6/2023	(2,032)	36,559
CDS	EUR 280,000	ファンドはIntesa Sanpaolo SpA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	20/6/2023	(1,748)	25,591
CDS	EUR 500,000	ファンドはIntesa Sanpaolo SpA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	20/6/2023	(2,322)	45,698
CDS	EUR 100,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitions ULC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	20/6/2023	(11)	(20,570)
CDS	EUR (4,717)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(38)	(671)
CDS	EUR (246,118)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(9,634)	(34,985)
CDS	EUR 520,000	ファンドはIntesa Sanpaolo SpA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	20/6/2023	(2,188)	47,526
CDS	EUR (210,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(986)	(29,851)
CDS	EUR (80,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	(3,131)	(11,372)
CDS	EUR (132,762)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 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	JP Morgan	20/12/2023	(29,787)	(30,872)

スワップ 2019年2月28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 670,000	ファンドはSuedzucker 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	20/12/2023	(10,795)	8,027
CDS	USD (742,000)	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	JP Morgan	20/12/2023	(618)	121,321
CDS	USD (741,000)	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	JP Morgan	20/12/2023	(617)	121,157
CDS	USD (756,000)	ファンドはFord Motor Credit Co LLC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	20/12/2023	(426)	91,912
CDS	USD (757,000)	ファンドはFord Motor Credit Co LLC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	20/12/2023	(427)	92,034
CDS	EUR 9,140,000	ファンドはUniCredit SpA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	20/12/2023	(436,332)	1,048,144
CDS	EUR 455,000	ファンドはTelecom Italia SpA/Milano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	20/12/2023	(1,921)	42,469
CDS	EUR (9,140,000)	ファンドはIntesa Sanpaolo 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	JP Morgan	20/12/2023	527,483	(991,751)
CDS	EUR 435,000	ファンドはIntesa Sanpaolo SpA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	20/12/2023	(3,549)	9,322
CDS	EUR (251,282)	ファンドはMonitchem HoldCo 3 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	JP Morgan	20/12/2023	4,321	10,132
CDS	USD 4,035,000	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	JP Morgan	20/12/2023	(27,411)	129,503
CDS	USD 8,075,000	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	JP Morgan	20/12/2023	(57,660)	259,166
CDS	EUR 740,000	ファンドはRenault 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	20/12/2023	(8,956)	6,111
CDS	EUR 4,820,000	ファンドはAviva 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	JP Morgan	20/12/2023	(157,912)	19,808

スワップ 2019年2月28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 (1,361,000)	ファンドはFord Motor Credit Co LLC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	20/12/2023	1,908	165,466
CDS	USD (1,088,000)	ファンドはFord Motor Credit Co LLC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	20/12/2023	(1,629)	132,276
CDS	USD 3,000,000	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(26,606)	(67,623)
CDS	EUR 160,000	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	JP Morgan	20/12/2023	4,152	(28,291)
CDS	USD 822,410	ファンドはRealogy Group LLC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	20/12/2023	(10,178)	(17,509)
CDS	USD (1,177,000)	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	JP Morgan	20/12/2023	7,530	192,445
CDS	USD 1,644,000	ファンドはKB Home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	20/12/2023	(59,465)	(191,606)
CDS	USD (742,000)	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	JP Morgan	20/12/2023	3,621	121,321
CDS	EUR (670,000)	ファンドはCMA CGM SAI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	20/12/2023	362	(49,775)
CDS	USD (588,000)	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	JP Morgan	20/12/2023	4,531	96,141
CDS	EUR (448,718)	ファンドはMonitchem HoldCo 3 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	JP Morgan	20/12/2023	7,715	18,093
CDS	USD 820,000	ファンドはRR Donnelley & Sons 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	JP Morgan	20/12/2023	18,959	59,602
CDS	USD 8,035,000	ファンドはTurkey 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	20/12/2023	(199,496)	680,314
CDS	USD (756,000)	ファンドはFord Motor Credit Co LLC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	20/12/2023	3,053	91,912

スワップ 2019年2月28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 (544,000)	ファンドはFord Motor Credit Co LLC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	20/12/2023	3,190	66,138
CDS	EUR 180,000	ファンドはNXP BV / NXP Funding LLC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	20/12/2023	5,690	(32,177)
CDS	USD (588,651)	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	JP Morgan	20/12/2023	3,066	96,247
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	79,189	(67,972)
CDS	USD (507,000)	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	25,615	(29,967)
CDS	USD (857,000)	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	26,650	(50,654)
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	1,392	(1,771)
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	18,230	83,117
CDS	EUR (50,871,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.28.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	Merrill Lynch	20/12/2022	199,415	1,078,885
CDS	USD 23,686,600	ファンドはCDX.NA.HY.30.V3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	20/6/2023	(215,674)	(1,631,329)
CDS	EUR (2,530,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.29.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	Merrill Lynch	20/6/2023	(377)	48,482
CDS	EUR 1,290,000	ファンドはAirbus SE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	20/12/2023	(9,949)	(49,466)
CDS	EUR (50,570,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.30.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	Merrill Lynch	20/12/2023	617,234	746,675
CDS	EUR 72,960,500	ファンドはITRAXX.EUR.30.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	20/12/2023	(615,861)	(1,539,472)
CDS	USD 173,518,000	ファンドはCDX.NA.IG.31.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	20/12/2023	(626,812)	(3,128,846)
CDS	EUR (10,160,000)	ファンドはITRAXX.FINSUB.30.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	Merrill Lynch	20/12/2023	221,092	(261,563)

スワップ 2019年2月28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 795,000	ファンドはAirbus SE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	20/12/2023	(9,349)	(30,485)
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	(18,918)	(12,077)
CDS	EUR (241,408)	ファンドはIntrum AB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	Morgan Stanley	20/6/2023	(8,394)	21,198
CDS	EUR (370,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 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	Morgan Stanley	20/6/2023	(75,515)	(79,171)
CDS	EUR (284,487)	ファンドはIntrum AB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	Morgan Stanley	20/6/2023	(9,147)	24,981
CDS	EUR (760,000)	ファンドはUniCredit 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	Morgan Stanley	20/6/2023	(13,094)	(73,509)
CDS	EUR (630,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SA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	20/6/2023	3,292	(89,554)
CDS	EUR 1,514,200	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	Morgan Stanley	20/12/2023	(51,363)	(341,178)
CDS	EUR 10,000	ファンドはArcelorMittal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	Morgan Stanley	20/12/2023	(414)	(1,810)
CDS	EUR 2,695,000	ファンドはBP 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	Morgan Stanley	20/12/2023	(7,736)	(86,215)
CDS	USD 1,549,600	ファンドはTurkey 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	20/12/2023	(36,754)	131,203
CDS	USD 730,000	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	Morgan Stanley	20/12/2023	(15,577)	23,429
CDS	EUR (300,000)	ファンドはTesco 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	20/12/2023	(2,293)	(1,106)
CDS	USD 8,075,000	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	Morgan Stanley	20/12/2023	(63,296)	259,166
CDS	USD 8,065,000	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	Morgan Stanley	20/12/2023	(50,037)	258,845
CDS	USD 2,500,000	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	Morgan Stanley	20/12/2023	(144)	24,952

スワップ 2019年2月28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 4,035,000	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	Morgan Stanley	20/12/2023	(25,401)	129,503
CDS	USD 8,120,000	ファンドはTurkey 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	20/12/2023	(206,060)	687,511
CDS	USD 4,035,000	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	Morgan Stanley	20/12/2023	(29,656)	129,503
CDS	EUR 1,370,000	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	Morgan Stanley	20/6/2024	(6,443)	56,550
CDS	EUR 5,430,000	ファンドはAnglo American 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	Morgan Stanley	20/6/2024	(22,823)	(1,215,430)
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	23,119	(772)
CDS	USD 4,020,000	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	(95,144)	(42,447)
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	(81,269)	(38,329)
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	(44,775)	(21,118)
CDS	USD (1,290,000)	ファンドはCMBX.NA.6.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	11/5/2063	19,030	(27,639)
CDS	EUR 730,000	ファンドはRepsol 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	Societe Generale	20/12/2023	(12,843)	(17,088)
CDS	EUR 730,000	ファンドはTOTAL 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	Societe Generale	20/12/2023	(9,247)	(31,047)
CDS	EUR 370,000	ファンドはPeugeot 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	Societe Generale	20/12/2023	(8,633)	(75,342)
CS	TRY (18,047,376)	ファンドはTRY 16.77%の固定金利を支払い、3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取る	JP Morgan	19/6/2024	(194,490)	(194,490)
IFS	GBP 2,000,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.423%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	15/3/2048	(40,118)	(40,118)
IFS	GBP 3,395,000	ファンドはUKRPI + 0bps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	120,071	120,071
IRS	MXN 1,157,956,000	ファンドは8.2062%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIIIEの変動金利を支払う	Bank of America	7/10/2020	(6,911)	(6,911)

スワップ 2019年2月28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 1,750,000,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの 変動金利を受け取り、8.505%の固 定金利を支払う	Bank of America	4/11/2020	439,460	439,460
IRS	DKK 76,930,000	ファンドは0.12%の固定金利を受 け取り、6ヶ月DKK CIBORの変動金 利を支払う	Bank of America	6/12/2021	20,460	22,304
IRS	NOK 103,219,000	ファンドは1.673%の固定金利を受 け取り、6ヶ月NOK NIBORの変動金 利を支払う	Bank of America	6/12/2021	2,676	2,676
IRS	TWD 213,503,400	ファンドは3ヶ月TWD TAIBORの変 動金利を受け取り、1.055%の固定 金利を支払う	Bank of America	19/9/2023	(82,894)	(82,894)
IRS	DKK 46,473,000	ファンドは0.422%の固定金利を受 け取り、6ヶ月DKK CIBORの変動金 利を支払う	Bank of America	6/12/2023	48,061	51,834
IRS	SEK 64,897,000	ファンドは0.505%の固定金利を受 け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動 金利を支払う	Bank of America	6/12/2023	18,301	20,382
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	437,201	437,201
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	437,200	437,200
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	(52,846)	(52,846)
IRS	EUR 51,420,000	ファンドは0.815%の固定金利を受 け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動 金利を支払う	Bank of America	15/2/2028	1,118,785	1,118,785
IRS	EUR 3,229,000	ファンドは0.884%の固定金利を受 け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動 金利を支払う	Bank of America	4/12/2028	73,617	74,116
IRS	DKK 23,964,000	ファンドは1.026%の固定金利を受 け取り、6ヶ月DKK CIBORの変動金 利を支払う	Bank of America	6/12/2028	74,520	81,210
IRS	ZAR 99,060,000	ファンドは3ヶ月ZAR JIBARの変動 金利を受け取り、8.7915%の固定 金利を支払う	Bank of America	20/3/2029	(366,141)	(366,141)
IRS	USD 17,890,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動 金利を受け取り、3.30994%の固定 金利を支払う	Bank of America	9/11/2048	(1,715,621)	(1,715,621)
IRS	GBP 946,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動 金利を受け取り、1.732%の固定金 利を支払う	Bank of America	4/12/2048	(26,874)	(25,540)
IRS	DKK 9,291,000	ファンドは1.5325%の固定金利を 受け取り、6ヶ月DKK CIBORの変動 金利を支払う	Bank of America	6/12/2048	59,022	59,552
IRS	USD 12,975,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動 金利を受け取り、3.04459%の固定 金利を支払う	Bank of America	6/12/2048	(535,163)	(535,163)
IRS	EUR 82,605,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変 動金利を受け取り、0.143%の固定 金利を支払う	Barclays	18/6/2021	(453,087)	(453,087)
IRS	JPY 1,866,000,000	ファンドは0.14%の固定金利を受 け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金 利を支払う	Barclays	20/9/2023	119,599	119,599

スワップ 2019年2月28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	EUR 137,810,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.54%の固定金利を支払う	Barclays	28/6/2024	(2,405,680)	(2,405,680)
IRS	JPY 906,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.3535%の固定金利を支払う	Barclays	20/9/2028	(159,278)	(159,278)
IRS	EUR 27,200,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、1.37%の固定金利を支払う	Barclays	20/2/2029	(2,058,734)	(2,058,734)
IRS	EUR 1,470,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、1.38%の固定金利を支払う	Barclays	22/2/2029	(112,884)	(112,884)
IRS	CAD 131,310,000	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.19%の固定金利を支払う	BNP Paribas	6/2/2020	(65,932)	(65,932)
IRS	CAD 258,655,000	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.1575%の固定金利を支払う	BNP Paribas	19/2/2020	(80,833)	(80,833)
IRS	CAD 325,000,000	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.13%の固定金利を支払う	BNP Paribas	27/2/2020	(49,934)	(49,934)
IRS	EUR 70,710,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.1687%の固定金利を支払う	BNP Paribas	11/12/2020	25,739	25,739
IRS	EUR 73,040,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.1692%の固定金利を支払う	BNP Paribas	11/12/2020	27,317	27,317
IRS	EUR 9,830,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.172%の固定金利を支払う	BNP Paribas	11/12/2020	4,227	4,227
IRS	USD 85,585,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.7375%の固定金利を支払う	BNP Paribas	11/1/2021	(185,663)	(185,663)
IRS	CAD 32,400,000	ファンドは2.215%の固定金利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	BNP Paribas	30/1/2021	30,498	30,498
IRS	CAD 133,500,000	ファンドは2.23%の固定金利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	BNP Paribas	6/2/2021	52,508	52,508
IRS	USD 31,840,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.6105%の固定金利を支払う	BNP Paribas	18/2/2021	(27,015)	(27,015)
IRS	USD 50,840,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.612%の固定金利を支払う	BNP Paribas	18/2/2021	(43,868)	(43,868)
IRS	CAD 266,995,000	ファンドは2.1925%の固定金利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	BNP Paribas	19/2/2021	28,676	28,676
IRS	USD 724,730,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9465%の固定金利を支払う	BNP Paribas	22/2/2021	(4,748,539)	(4,748,539)
IRS	CAD 331,095,000	ファンドは2.1712%の固定金利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	BNP Paribas	27/2/2021	(17,715)	(17,715)
IRS	USD 575,260,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.576%の固定金利を支払う	BNP Paribas	15/3/2021	(52,819)	(62,362)

スワップ 2019年2月28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	EUR 306,110,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.14%の固定金利を支払う	BNP Paribas	9/4/2021	128,474	147,788
IRS	USD 248,794,000	ファンドは2.585%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	2/8/2021	219,968	219,968
IRS	USD 86,935,000	ファンドは2.521%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	6/1/2022	32,408	32,408
IRS	USD 115,170,000	ファンドは2.528%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	6/1/2022	58,276	58,276
IRS	USD 130,250,000	ファンドは2.34%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	7/1/2022	(399,432)	(399,432)
IRS	USD 162,890,000	ファンドは2.44%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	8/1/2022	(26,775)	(26,775)
IRS	EUR 11,230,000	ファンドは0.0025%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	28/1/2022	(3,420)	(3,420)
IRS	EUR 40,650,000	ファンドは0.0255%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	7/2/2022	3,033	3,033
IRS	USD 16,190,000	ファンドは2.474%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	11/2/2022	(5,867)	(5,867)
IRS	USD 16,190,000	ファンドは2.499%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	11/2/2022	1,819	1,819
IRS	EUR 26,950,000	ファンドは-0.0155%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	13/2/2022	(25,242)	(25,242)
IRS	USD 16,065,000	ファンドは2.4885%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	24/2/2022	(1,104)	(1,104)
IRS	USD 8,310,000	ファンドは2.4975%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	27/2/2022	891	891
IRS	USD 32,050,000	ファンドは2.454%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	28/2/2022	(20,959)	(20,959)
IRS	BRL 21,530,833	ファンドは8.375%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	BNP Paribas	2/1/2023	63,376	63,376
IRS	USD 166,070,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.49%の固定金利を支払う	BNP Paribas	10/1/2023	18,156	18,156
IRS	USD 38,290,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.5347%の固定金利を支払う	BNP Paribas	16/2/2023	(35,693)	(35,693)
IRS	EUR 142,330,000	ファンドは0.3185%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	23/2/2023	(95,055)	(95,055)
IRS	MXN 489,941,250	ファンドは8.58%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	18/1/2024	343,072	343,072

スワップ 2019年2月28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 209,917,750	ファンドは8.22%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	23/1/2024	71,407	71,407
IRS	AUD 7,800,000	ファンドは6ヶ月AUD BBSWの変動金利を受け取り、2.145%の固定金利を支払う	BNP Paribas	1/2/2024	(26,022)	(26,022)
IRS	MXN 257,104,355	ファンドは8.125%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	2/2/2024	35,520	35,520
IRS	MXN 73,882,458	ファンドは8.165%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	2/2/2024	16,519	16,519
IRS	MXN 184,788,602	ファンドは8.135%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	5/2/2024	29,495	29,495
IRS	USD 27,510,000	ファンドは2.563%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	13/2/2024	11,074	11,074
IRS	USD 381,576,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.7285%の固定金利を支払う	BNP Paribas	25/2/2024	(3,127,800)	(3,127,800)
IRS	CNY 94,890,000	ファンドは3ヶ月CNY CNRRの変動金利を受け取り、2.86%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/3/2024	67,951	67,951
IRS	CNY 49,570,000	ファンドは3ヶ月CNY CNRRの変動金利を受け取り、2.898%の固定金利を支払う	BNP Paribas	19/6/2024	35,145	35,145
IRS	USD 78,275,000	ファンドは2.626%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	26/7/2024	286,376	286,376
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	433,079	433,079
IRS	EUR 75,590,000	ファンドは0.565%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	15/2/2028	(429,792)	(430,370)
IRS	MXN 128,100,000	ファンドは8.75%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	3/1/2029	163,763	163,763
IRS	USD 111,463,000	ファンドは2.6725%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	8/1/2029	(209,041)	(209,041)
IRS	USD 19,735,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.774%の固定金利を支払う	BNP Paribas	11/1/2029	(137,591)	(137,591)
IRS	JPY 124,920,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.159%の固定金利を支払う	BNP Paribas	29/1/2029	486	486
IRS	USD 12,660,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.7825%の固定金利を支払う	BNP Paribas	29/1/2029	(97,915)	(97,915)
IRS	USD 73,920,000	ファンドは2.8925%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	31/1/2029	118,904	118,904
IRS	USD 7,303,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.739%の固定金利を支払う	BNP Paribas	31/1/2029	(27,563)	(27,563)

スワップ 2019年2月28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 14,250,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.687%の固定金利を支払う	BNP Paribas	13/2/2029	12,838	12,838
IRS	USD 7,130,000	ファンドは2.7015%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	14/2/2029	2,557	2,557
IRS	USD 441,900,000	ファンドは2.691%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	21/2/2029	(228,734)	(228,734)
IRS	USD 140,600,000	ファンドは2.726%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	21/2/2029	362,080	362,080
IRS	USD 114,890,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.791%の固定金利を支払う	BNP Paribas	21/2/2029	(955,786)	(955,786)
IRS	USD 39,770,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.826%の固定金利を支払う	BNP Paribas	21/2/2029	(453,855)	(453,855)
IRS	USD 39,169,000	ファンドは2.6665%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	26/2/2029	(107,388)	(107,388)
IRS	SEK 32,870,000	ファンドは0.975%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	20/3/2029	(16,264)	(16,264)
IRS	SEK 17,760,000	ファンドは1.096%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	20/3/2029	13,358	13,658
IRS	USD 20,812,500	ファンドは2.6715%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	19/6/2029	(66,421)	(66,421)
IRS	USD 13,875,000	ファンドは2.6715%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	19/6/2029	(44,280)	(44,280)
IRS	USD 20,812,500	ファンドは2.673%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	19/6/2029	(63,678)	(63,678)
IRS	USD 55,754,000	ファンドは2.705%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	2/8/2029	(21,015)	(21,015)
IRS	JPY 287,470,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.355%の固定金利を支払う	BNP Paribas	4/2/2034	1,741	1,741
IRS	JPY 622,590,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.336%の固定金利を支払う	BNP Paribas	8/2/2034	19,815	19,815
IRS	USD 25,230,000	ファンドは2.83%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	15/2/2036	4,400	15,548
IRS	JPY 2,780,500,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.6979%の固定金利を支払う	BNP Paribas	18/6/2038	(928,125)	(928,125)
IRS	USD 770,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.815%の固定金利を支払う	BNP Paribas	15/5/2044	4,578	4,578
IRS	EUR 1,310,000	ファンドは1.3975%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	4/7/2044	38,674	38,674

スワップ 2019年2月28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 17,990,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.814%の固定金利を支払う	BNP Paribas	9/1/2049	122,944	122,944
IRS	USD 115,310,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.571%の固定金利を支払う	Citibank	18/2/2022	(171,658)	(171,658)
IRS	BRL 163,850,000	ファンドは8.5305%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	796,998	796,998
IRS	USD 69,760,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.5138%の固定金利を支払う	Citibank	8/2/2023	(39,378)	(39,378)
IRS	CNY 47,360,000	ファンドは3ヶ月CNY CNRRの変動金利を受け取り、2.93%の固定金利を支払う	Citibank	20/3/2024	10,877	10,877
IRS	CNY 45,540,000	ファンドは3ヶ月CNY CNRRの変動金利を受け取り、2.96%の固定金利を支払う	Citibank	19/6/2024	12,813	12,813
IRS	BRL 64,351,074	ファンドは8.67%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2025	117,458	117,458
IRS	USD 61,200,000	ファンドは2.603%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Citibank	18/2/2025	140,268	140,268
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	(411,434)	(411,434)
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	(1,663,526)	(1,663,526)
IRS	MXN 414,800,000	ファンドは7.481%の固定金利を受け取り、3ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	14/4/2027	(1,001,632)	(1,001,632)
IRS	USD 10,990,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.84%の固定金利を支払う	Citibank	24/12/2028	(142,354)	(142,354)
IRS	USD 140,355,000	ファンドは3.1135%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Citibank	4/1/2029	5,151,956	5,151,956
IRS	USD 599,645,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.0435%の固定金利を支払う	Citigroup	10/12/2020	(4,476,582)	(4,476,582)
IRS	USD 220,844,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.6365%の固定金利を支払う	Citigroup	5/3/2023	(830,205)	(830,205)
IRS	USD 314,485,000	ファンドは3.054%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	20/12/2023	7,202,081	7,202,081
IRS	USD 112,867,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.92%の固定金利を支払う	Citigroup	31/12/2023	(1,910,404)	(1,910,404)
IRS	USD 46,904,900	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.8839%の固定金利を支払う	Citigroup	19/12/2024	(215,478)	(215,478)
IRS	USD 24,645,700	ファンドは3.0157%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	17/12/2026	89,794	89,794

スワップ 2019年2月28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 65,085,195	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、6.4%の固定金利を支払う	Credit Suisse	2/1/2020	1,199,195	1,199,195
IRS	EUR 50,005,000	ファンドは0.364%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	21/12/2022	173,229	173,229
IRS	USD 109,478,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.0079%の固定金利を支払う	Credit Suisse	3/12/2024	(2,281,846)	(2,281,846)
IRS	USD 275,700,000	ファンドは2.222%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	1/11/2021	(1,630,189)	(1,630,189)
IRS	MXN 253,592,767	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.105%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	14/10/2022	399,215	399,215
IRS	MXN 193,289,233	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.11%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	14/10/2022	302,688	302,688
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	1,625,375	1,625,375
IRS	USD 748,305,000	ファンドは2.4125%の固定金利を受け取り、1日USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	20/3/2019	9,013	9,013
IRS	USD 873,380,000	ファンドは1日USD LIBORの変動金利を受け取り、2.4625%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	1/5/2019	(59,939)	(59,939)
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	Goldman Sachs	14/7/2019	938,175	938,175
IRS	USD 305,570,000	ファンドは2.765%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	16/2/2021	901,749	901,749
IRS	USD 185,485,000	ファンドは2.54355%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	15/3/2021	(78,765)	(78,765)
IRS	USD 185,485,000	ファンドは2.5463%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	15/3/2021	(70,386)	(70,386)
IRS	JPY 1,230,000,000	ファンドは0.135%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	22/1/2023	70,519	70,519
IRS	USD 251,289,000	ファンドは3.045%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	28/12/2023	5,658,734	5,658,734
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	(1,249,550)	(1,249,550)
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	Goldman Sachs	13/1/2027	207,976	208,090
IRS	JPY 510,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.355%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	22/1/2028	(95,198)	(95,198)
IRS	JPY 863,940,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.1915%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	4/1/2029	(23,261)	(23,261)

スワップ 2019年2月28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 67,625,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.0035%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	16/2/2029	(1,825,435)	(1,825,435)
IRS	SEK 32,870,000	ファンドは1.2775%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	20/3/2029	87,590	87,590
IRS	ZAR 18,960,000	ファンドは3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を受け取り、8.4996%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/3/2029	(42,798)	(42,798)
IRS	JPY 2,739,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.6945%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	18/6/2038	(898,367)	(898,366)
IRS	USD 53,395,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.145%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	19/12/2048	(3,313,800)	(3,313,800)
IRS	USD 3,430,000	ファンドは3.0335%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	20/2/2053	83,821	83,821
IRS	BRL 16,868,978	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	964,964	964,964
IRS	EUR 62,060,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.42%の固定金利を支払う	JP Morgan	17/12/2022	(298,415)	(298,415)
IRS	BRL 8,497,537	ファンドは6.4%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	729,265	729,265
IRS	BRL 29,228,390	ファンドは9.45%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	669,510	669,510
IRS	BRL 6,194,622	ファンドは9.45%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	141,895	141,895
IRS	USD 15,210,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.2055%の固定金利を支払う	JP Morgan	22/1/2023	193,159	193,159
IRS	TWD 307,236,600	ファンドは3ヶ月TWD TAIBORの変動金利を受け取り、1.055%の固定金利を支払う	JP Morgan	19/9/2023	(119,286)	(119,286)
IRS	USD 373,357,000	ファンドは2.922%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	JP Morgan	25/2/2024	6,446,736	6,446,736
IRS	CNY 48,400,000	ファンドは3ヶ月CNY CNRRの変動金利を受け取り、2.7625%の固定金利を支払う	JP Morgan	19/6/2024	78,715	78,715
IRS	USD 1,840,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.21033%の固定金利を支払う	JP Morgan	15/5/2044	(123,231)	(123,231)
IRS	USD 266,440,000	ファンドは3.0475%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	22/2/2021	2,263,748	2,263,748
IRS	USD 79,558,000	ファンドは2.6975%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	15/3/2021	171,849	171,849
IRS	AUD 9,058,000	ファンドは3ヶ月AUD BBSWの変動金利を受け取り、2.1005%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	23/8/2021	(51,478)	(51,478)

スワップ 2019年2月28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	CAD 13,047,000	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.25%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	3/12/2021	(118,595)	(118,595)
IRS	SEK 107,005,000	ファンドは0.166%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	6/12/2021	(7,274)	(5,873)
IRS	USD 9,883,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	7/12/2021	(115,266)	(116,970)
IRS	USD 160,164,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.123%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	16/11/2023	(4,071,040)	(4,071,040)
IRS	USD 58,580,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.0405%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	29/11/2023	(1,294,940)	(1,294,940)
IRS	CAD 8,010,000	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.25%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	3/12/2023	(114,388)	(115,239)
IRS	EUR 6,246,000	ファンドは0.281%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	4/12/2023	46,274	47,100
IRS	USD 6,097,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.992%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	7/12/2023	(118,956)	(122,234)
IRS	USD 212,270,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.896%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	19/7/2024	(1,182,042)	(1,182,042)
IRS	USD 111,870,000	ファンドは2.927%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	19/7/2026	310,418	310,418
IRS	USD 3,246,500	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.8885%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	23/8/2026	(60,448)	(60,448)
IRS	EUR 32,500,000	ファンドは0.81%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	15/2/2028	690,741	690,737
IRS	USD 289,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9025%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	14/3/2028	(5,580)	(5,580)
IRS	USD 141,480,000	ファンドは3.005%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	26/4/2028	3,867,862	3,867,862
IRS	USD 3,930,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.035%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	13/9/2028	(118,035)	(118,035)
IRS	USD 19,220,000	ファンドは3.143%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	20/11/2028	754,615	754,615
IRS	USD 3,314,000	ファンドは3.1285%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	29/11/2028	126,386	126,386
IRS	USD 399,959,000	ファンドは3.109%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	30/11/2028	14,930,490	14,546,280
IRS	CAD 4,262,000	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.25%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	3/12/2028	(99,762)	(101,669)

スワップ 2019年2月28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	SEK 33,823,000	ファンドは1.156%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	6/12/2028	51,830	57,666
IRS	USD 3,266,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.06%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	7/12/2028	(103,725)	(105,301)
IRS	SEK 6,150,000	ファンドは1.293%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	15/2/2029	18,063	18,267
IRS	SEK 34,230,000	ファンドは1.195%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	20/3/2029	56,172	61,718
IRS	SEK 32,110,000	ファンドは1.212%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	20/3/2029	60,992	63,597
IRS	USD 27,695,000	ファンドは3.32%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	26/4/2029	1,508,368	1,508,368
IRS	USD 9,528,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.2%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	26/4/2029	(418,112)	(418,112)
IRS	USD 39,370,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.23%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	26/4/2029	(1,831,798)	(1,831,798)
IRS	USD 15,573,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.91%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	12/6/2029	(277,419)	(277,419)
IRS	EUR 1,260,000	ファンドは1.415%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	4/7/2044	43,371	42,860
IRS	USD 9,610,000	ファンドは3.238%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	20/11/2048	779,847	779,847
IRS	USD 312,230,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.189%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	30/11/2048	(22,799,015)	(22,188,716)
IRS	CAD 1,805,000	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.25%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	3/12/2048	(77,650)	(78,105)
IRS	EUR 1,266,000	ファンドは1.46%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	4/12/2048	62,621	62,649
IRS	SEK 13,474,000	ファンドは1.681%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	6/12/2048	46,839	48,828
IRS	USD 1,414,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.152%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	7/12/2048	(88,501)	(89,821)
IRS	CAD 131,310,000	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.18%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	6/2/2020	(56,093)	(56,093)
IRS	CAD 258,655,000	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.16%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	21/2/2020	(90,372)	(90,372)
IRS	CAD 133,495,000	ファンドは2.235%の固定金利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	6/2/2021	57,459	57,459

スワップ 2019年2月28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	CAD 266,995,000	ファンドは2.2%の固定金利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	21/2/2021	43,256	43,256
IRS	USD 140,210,000	ファンドは2.51%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	13/2/2022	45,594	45,594
IRS	USD 119,380,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.5207%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	13/2/2022	(63,105)	(63,105)
IRS	USD 65,010,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.472%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	2/3/2022	20,174	20,174
IRS	USD 16,340,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.4863%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	8/2/2023	(877)	(877)
IRS	JPY 907,000,000	ファンドは0.146%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	9/8/2023	60,136	60,136
IRS	PLN 26,900,000	ファンドは2.075%の固定金利を受け取り、6ヶ月PLN WIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	19/6/2024	(21,733)	(21,733)
IRS	PLN 25,910,000	ファンドは2.145%の固定金利を受け取り、6ヶ月PLN WIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	19/6/2024	1,536	1,536
IRS	USD 64,240,000	ファンドは2.4938%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	13/2/2025	(173,256)	(173,256)
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	(828,029)	(828,029)
IRS	EUR 9,141,000	ファンドは0.82168%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	15/2/2028	205,047	205,047
IRS	JPY 451,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.3835%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	9/8/2028	(91,920)	(91,920)
IRS	JPY 2,780,500,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.702%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	18/6/2038	(947,596)	(947,596)
IRS	AUD 4,407,000	ファンドは6ヶ月AUD BBSWの変動金利を受け取り、2.29%の固定金利を支払う	Toronto Dominion	2/11/2021	(29,733)	(29,733)
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	253,926	253,926
IRS	AUD 3,900,000	ファンドは6ヶ月AUD BBSWの変動金利を受け取り、2.486%の固定金利を支払う	UBS	1/2/2029	(23,743)	(23,743)
IRS	JPY 224,900,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.6165%の固定金利を支払う	UBS	14/12/2038	(40,136)	(40,136)
IRS	EUR 2,090,000	ファンドは1.92%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	UBS	20/1/2048	96,777	96,777

スワップ 2019年2月28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	EUR 2,100,000	ファンドは3ヶ月EUR EURIBOR + 0bpsを受け取り、IBOXX EUR Liquid High Yield + 0bpsを支払 う	Bank of America	20/3/2019	(97,891)	(97,902)
TRS	USD (2,566)	ファンドは1ヶ月USD BBA LIBOR + 5bpsを受け取り、Charter Communications Inc Class A + 0bpsを支払う	BNP Paribas	27/8/2019	(138,615)	(138,615)
TRS	USD (129,513)	ファンドは1ヶ月USD BBA LIBOR + 7.5bpsを受け取り、Weatherford International Plc + 0bpsを支払 う	BNP Paribas	30/8/2019	3,963	3,963
TRS	USD (47,688)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 75bpsを受け取り、Superior Energy Services Inc + 0bpsを支 払う	BNP Paribas	19/11/2019	41,489	41,489
TRS	USD (14,525)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 150bpsを受け取り、Bristow Group Inc + 0bpsを支払う	BNP Paribas	19/11/2019	8,425	8,425
TRS	USD (4,733)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 150bpsを受け取り、Bristow Group Inc + 0bpsを支払う	BNP Paribas	19/11/2019	2,745	2,745
TRS	USD (4,620)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 75bpsを受け取り、Superior Energy Services Inc + 0bpsを支 払う	BNP Paribas	19/11/2019	4,019	4,019
TRS	USD (19,258)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 45bpsを受け取り、Canadian Natural Resources + 0bpsを支払 う	BNP Paribas	27/11/2019	(66,896)	(66,897)
TRS	USD (61,905)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 45bpsを受け取り、Superior Energy Services Inc + 0bpsを支 払う	BNP Paribas	31/1/2020	(24,762)	(24,762)
TRS	USD (1,294)	ファンドは1ヶ月USD BBA LIBOR + 10bpsを受け取り、Charter Communications Inc Class A + 0bpsを支払う	Citibank	6/8/2019	(1,773)	(1,773)
TRS	EUR 3,500,000	ファンドは3ヶ月EUR EURIBOR + 0bpsを受け取り、IBOXX EUR Liquid High Yield + 0bpsを支払 う	JP Morgan	20/3/2019	(134,908)	(135,417)
TRS	USD 68,398,000	ファンドはIBOXX US\$ Liquid Investment + 0bpsを受け取り、 3ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支 払う	JP Morgan	20/3/2019	(236,408)	(455,361)
TRS	EUR 3,450,000	ファンドは3ヶ月EUR EURIBOR + 0bpsを受け取り、IBOXX EUR Liquid High Yield + 0bpsを支払 う	JP Morgan	20/3/2019	(146,022)	(146,568)
TRS	EUR 1,300,000	ファンドは3ヶ月EUR EURIBOR + 0bpsを受け取り、Markit iBoxx EUR Contingent Conver + 0bpsを 支払う	JP Morgan	20/3/2019	(95,026)	(95,254)
合計					(29,697,581)	(25,095,006)

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 2019年2月28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)
21,675,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.14	8/3/2019	9,203	42,370
21,416,000	コール	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 6.85	13/3/2019	(108,718)	3,716
21,416,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 110	15/3/2019	(120,881)	32,029
21,675,000	プット	OTC NZD/JPY	Bank of America	NZD 75	25/3/2019	15,779	81,643
510,000	プット	OTC USD/TRY	Bank of America	USD 5.32	29/4/2019	(17,789)	142,096
43,349,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.175	24/6/2019	(1,021)	236,793
10,710,000	コール	OTC USD/CAD	Barclays	USD 1.3225	5/3/2019	2,488	23,051
21,660,000	プット	OTC AUD/USD	Barclays	AUD 0.7	8/8/2019	17,463	133,573
23,696,000	プット	OTC GBP/USD	BNP Paribas	GBP 1.44	1/3/2019	(59,192)	-
23,696,000	プット	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.25	5/3/2019	(121,560)	-
17,772,000	コール	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.25	5/3/2019	(165,990)	-
496,000	コール	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 3.6	7/3/2019	(95,995)	8,165
26,770,000	プット	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.3	8/3/2019	(14,740)	13,690
10,831,000	コール	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.3188	11/3/2019	(4,553)	48,303
10,831,000	プット	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.3188	11/3/2019	(1,684)	51,171
10,837,000	プット	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 13.6	22/3/2019	(9,546)	38,137
7,630,500	プット	OTC USD/KRW	BNP Paribas	USD 1,110	27/3/2019	(21,821)	16,331
28,705,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.2	29/3/2019	(136,914)	218
21,416,000	プット	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 13.6	8/4/2019	(20,940)	135,032
80,310,000	コール	OTC EUR/JPY	BNP Paribas	EUR 130	12/4/2019	(124,745)	125,746
28,630,000	プット	OTC USD/TRY	BNP Paribas	USD 5	30/4/2019	(113,699)	25,729
1,239,000	コール	OTC EUR/GBP	BNP Paribas	EUR 0.81	2/5/2019	(70,577)	137,690
21,599,000	プット	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 13.5	6/5/2019	(141,878)	185,131
27,897,000	コール	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 4	17/5/2019	(89,237)	165,462
64,798,000	コール	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 113	5/6/2019	40,544	240,121
9,648,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.12	26/7/2019	(17,880)	63,708
7,689,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.133	5/3/2019	(18,465)	9,569
7,689,000	コール	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.1385	5/3/2019	(4,848)	24,668
7,302,000	コール	OTC AUD/JPY	Citibank	AUD 76	6/3/2019	104,624	207,094
8,676,667	プット	OTC AUD/JPY	Citibank	AUD 76.5	7/3/2019	(4,201)	955
21,510,000	プット	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.685	12/3/2019	(26,618)	2,294
21,425,000	コール	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.73	12/3/2019	(77,110)	7,660
26,890,000	コール	OTC USD/MXN	Citibank	USD 20.5	14/3/2019	(46,160)	897
7,300,000	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 14	15/3/2019	(9,831)	83,061
19,310,000	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 13.35	21/3/2019	(109,617)	22,653
1,005,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 104	8/4/2019	(144,699)	12,200
32,253,000	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 15	8/4/2019	(382,712)	142,570
10,175,000	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 13.6	10/4/2019	(145,407)	67,349
57,684,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 105	12/4/2019	(472,873)	16,287
22,155,000	コール	OTC USD/INR	Citibank	USD 74	18/4/2019	(8,722)	32,749
43,328,000	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 12.5	14/5/2019	(146,288)	43,562
21,664,000	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 14.25	14/5/2019	205,951	517,581
580,000	コール	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.115	24/5/2019	42,540	140,894
58,795,000	プット	OTC USD/CNH	Citibank	USD 6.6175	24/5/2019	(86,990)	303,703
59,240,000	コール	OTC AUD/JPY	Citibank	AUD 85	5/6/2019	(12,834)	57,567

買建オプション 2019年2月28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)
21,416,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 98	6/6/2019	(59,786)	3,669
27,075,000	プット	OTC EUR/CZK	Citibank	EUR 25	25/7/2019	13,588	49,738
7,302,000	コール	OTC AUD/JPY	Deutsche Bank	AUD 75.5	5/3/2019	151,369	239,940
29,385,000	プット	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.131	5/3/2019	(83,338)	25,441
29,385,000	コール	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.1365	5/3/2019	(7,679)	127,380
15,474,000	プット	OTC AUD/JPY	Deutsche Bank	AUD 75	7/3/2019	(39,719)	52
15,130,000	プット	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 13.25	11/3/2019	(195,769)	1,783
6,490,000	プット	OTC AUD/USD	Deutsche Bank	AUD 0.7	12/3/2019	(21,821)	7,259
6,514,000	コール	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 67.5	18/3/2019	(47,434)	18,650
21,457,000	プット	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 13.1	21/3/2019	(96,894)	6,873
16,095,000	プット	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 3.6	26/3/2019	(43,962)	32,940
28,627,000	プット	OTC EUR/JPY	Deutsche Bank	EUR 122	25/4/2019	(163,193)	76,162
290,000	プット	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 5.2	3/5/2019	(44,847)	41,718
25,047,000	コール	OTC USD/TWD	Deutsche Bank	USD 31	19/7/2019	(180,416)	143,943
26,785,000	コール	OTC AUD/USD	Goldman Sachs	AUD 0.74	12/3/2019	(17,392)	1,323
16,080,750	プット	OTC AUD/USD	Goldman Sachs	AUD 0.715	12/3/2019	(25,099)	101,479
7,585,000	コール	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 19.25	14/3/2019	(81,738)	53,260
74,574,000	プット	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 1.05	20/3/2019	(281,127)	-
1,431,000	プット	OTC EUR/JPY	Goldman Sachs	EUR 120	2/4/2019	(334,272)	43,531
24,388,000	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 106.5	12/4/2019	(289,735)	19,407
21,459,000	プット	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 3.5	17/4/2019	(59,304)	28,086
43,365,000	プット	OTC USD/CHF	Goldman Sachs	USD 0.95	9/5/2019	(22,153)	42,895
21,416,000	プット	OTC AUD/USD	Goldman Sachs	AUD 0.65	10/5/2019	(20,990)	5,240
28,075,000	コール	OTC USD CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.6	15/3/2019	(16,026)	20,471
9,771,000	プット	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,118	15/3/2019	(15,044)	23,796
32,190,000	プット	OTC USD/BRL	HSBC Bank Plc	USD 3.4	12/4/2019	(75,175)	5,783
21,697,000	プット	OTC USD/ZAR	HSBC Bank Plc	USD 13	14/5/2019	(152,340)	76,151
42,832,000	プット	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,085	16/5/2019	(33,103)	88,883
21,326,000	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 13	11/3/2019	(171,444)	230
16,060,000	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 12.75	11/3/2019	(50,466)	9
42,738,000	プット	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0.685	12/3/2019	(6,949)	4,558
37,788,000	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 107.5	15/3/2019	(233,497)	4,190
37,788,000	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 107.5	15/3/2019	(265,617)	4,190
1,830,000	プット	OTC EUR/GBP	JP Morgan	EUR 0.862	20/3/2019	9,964	23,662
23,075,000	コール	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 7.5	21/3/2019	(72,686)	-
17,660,000	プット	OTC USD/TRY	JP Morgan	USD 5.4	21/3/2019	(74,426)	261,644
12,362,000	コール	OTC USD/TRY	JP Morgan	USD 5.75	21/3/2019	(49,357)	13,442
16,080,000	プット	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0.71	2/4/2019	36,804	97,531
28,710,000	プット	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.5	3/4/2019	(135,283)	17,454
7,545,000	コール	OTC USD/CLP	JP Morgan	USD 660	4/4/2019	(32,024)	54,364
21,535,200	コール	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 15.5	8/4/2019	(4,902)	45,189
21,416,000	プット	OTC USD/SEK	JP Morgan	USD 8.8	9/5/2019	(17,580)	42,920
21,416,000	プット	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,085	16/5/2019	(20,312)	44,442
22,155,000	プット	OTC USD/INR	JP Morgan	USD 75	14/6/2019	(100,857)	129,998
23,696,000	コール	OTC GBP/USD	Morgan Stanley	GBP 1.4	1/3/2019	(198,302)	-

買建オプション 2019年2月28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)
7,545,000	プット	OTC USD/KRW	Morgan Stanley	USD 1,110	6/3/2019	(37,318)	1,999
33,174,000	コール	OTC USD/SEK	Morgan Stanley	USD 8.6	6/3/2019	(484,848)	1,018
21,326,000	コール	OTC USD/SEK	Morgan Stanley	USD 8.6	6/3/2019	(193,775)	654
12,960,000	プット	OTC AUD/JPY	Morgan Stanley	AUD 70	7/3/2019	(47,323)	-
12,960,000	プット	OTC AUD/JPY	Morgan Stanley	AUD 75	7/3/2019	(88,586)	44
3,250,000	コール	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 20	14/3/2019	(19,422)	1,573
4,920,000	コール	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 14	14/3/2019	25,748	60,188
6,863,000	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.79	21/3/2019	24,559	149,692
9,100,000	プット	OTC USD/KRW	Morgan Stanley	USD 1,105	4/4/2019	(75,285)	18,390
19,361,000	コール	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 20.5	12/4/2019	(102,155)	33,372
16,095,000	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.5	17/4/2019	(33,819)	21,065
287,000	プット	OTC USD/TRY	Morgan Stanley	USD 5.19	1/5/2019	(47,493)	37,499
43,199,000	コール	OTC AUD/JPY	Morgan Stanley	AUD 83	5/6/2019	10,992	101,384
34,542,000	プット	OTC AUD/JPY	Nomura	AUD 78	7/3/2019	(207,200)	33,887
23,360,000	コール	OTC USD/CNH	Nomura	USD 7.2	10/4/2019	(72,650)	-
10,297,000	プット	OTC USD/NOK	RBS Plc	USD 8.25	11/4/2019	(134,180)	11,728
35,542,000	プット	OTC USD/CAD	Royal Bank of Canada	USD 1.35	5/3/2019	(272,658)	1,264
10,708,000	プット	OTC USD/CAD	Royal Bank of Canada	USD 1.325	5/3/2019	29,462	69,062
10,708,000	コール	OTC USD/CAD	Royal Bank of Canada	USD 1.325	5/3/2019	(38,821)	16,822
16,890,000	プット	OTC USD/CAD	Royal Bank of Canada	USD 1.3	19/3/2019	(24,194)	21,193
11,080,000	プット	OTC USD/CHF	Royal Bank of Canada	USD 0.95	19/3/2019	(38,038)	33
21,416,000	プット	OTC USD/JPY	Royal Bank of Canada	USD 105	8/4/2019	(165,296)	4,319
16,090,000	プット	OTC USD/JPY	Royal Bank of Canada	USD 104	8/4/2019	(35,411)	1,300
23,696,000	プット	OTC EUR/USD	Royal Bank of Canada	EUR 1.2	11/4/2019	(109,368)	1,432
10,708,000	コール	OTC USD/CAD	Toronto Dominion	USD 1.325	22/2/2019	(6,425)	-
150	コール	The Hang Seng China Enterprises Index	Morgan Stanley	HKD 11,854.92	28/3/2019	(32,344)	83,134
117	コール	The Hang Seng China Enterprises Index	Morgan Stanley	HKD 11,734.67	28/3/2019	(6,264)	87,145
8,676	コール	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98	15/3/2019	(295,300)	54,225
3,173	コール	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.5	15/3/2019	(211,002)	178,481
1,455	プット	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.25	12/4/2019	(11,465)	63,656
2,195	コール	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.75	13/12/2019	(167,983)	740,813
2,255	プット	2 Year Sterling MIDCV	Exchange Traded	GBP 98	14/6/2019	(151,173)	9,372
605	プット	Anheuser-Busch InBev SA/NV	Exchange Traded	USD 65	15/3/2019	(67,881)	3,025
342	コール	Caesars Entertainment Corp	Exchange Traded	USD 9	21/6/2019	(24,179)	21,717
173	プット	Casino Guichard Perrachon SA	Exchange Traded	EUR 37	15/3/2019	(23,885)	5,514

買建オプション 2019年2月28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)
161	プット	Casino Guichard Perrachon SA	Exchange Traded	EUR 40	15/3/2019	(17,377)	10,355
68	プット	Euro Bund	Exchange Traded	EUR 163.5	22/3/2019	43,860	78,569
68	プット	Euro Bund	Exchange Traded	EUR 164	22/3/2019	56,336	107,211
402	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,200	15/3/2019	(153,171)	33,635
273	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 2,975	15/3/2019	(13,460)	3,108
182	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,200	15/3/2019	164,221	208,735
182	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,250	15/3/2019	50,027	120,890
105	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 90	15/3/2019	21,623	51,098
7,024	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 100	21/6/2019	236,178	1,049,452
5,847	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.625	17/6/2019	(46,074)	73,088
3,421	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.75	17/6/2019	(229,737)	32,072
2,920	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.5	17/6/2019	(41,260)	91,250
1,123	プット	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97	12/7/2019	(33,415)	10,528
374	プット	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.25	12/7/2019	(7,622)	21,037
374	プット	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.125	12/7/2019	(30,997)	7,013
5,787	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.75	16/12/2019	(571,293)	542,531
2,195	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.25	16/12/2019	92,673	1,001,469
1,339	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.5	16/12/2019	(144,453)	267,800
3,421	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.75	16/3/2020	101,672	684,200
686	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.5	16/3/2020	(56,787)	252,962
450	プット	General Electric Co	Exchange Traded	USD 9	15/3/2019	(26,415)	1,125
1,932	プット	iShares USD High Yield Corporate Bond UCITS ETF	Exchange Traded	USD 100	18/4/2019	(83,462)	15,456
35	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,520	15/3/2019	(13,731)	3,850
35	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,740	15/3/2019	(86,086)	39,025
12	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,700	15/3/2019	(21,131)	7,800
7	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,710	15/3/2019	(27,612)	5,180
4,302	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 278	1/3/2019	(76,145)	174,231
1,461	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 275	1/3/2019	(10,885)	10,958
9,128	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 282	15/3/2019	(345,644)	1,067,976
3,235	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 300	20/12/2019	(2,533,320)	1,562,505
731	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 295	20/12/2019	(15,497)	491,963
681	コール	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Exchange Traded	USD 115.25	24/5/2019	(62,258)	156,949
合計						(13,364,698)	15,691,915

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 2019年2月28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)
(10,837,500)	コール	OTC NZD/JPY	Bank of America	NZD 77	11/3/2019	14,413	(6,272)
(26,770,000)	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 109	15/3/2019	88,080	(17,394)
(7,300,000)	プット	OTC USD/ZAR	Bank of America	USD 14	15/3/2019	40,966	(83,061)
(21,416,000)	コール	OTC AUD/JPY	Bank of America	AUD 80	19/3/2019	25,574	(59,435)
(10,835,000)	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.13	19/3/2019	26,678	(24,780)
(5,877,000)	コール	OTC USD/MXN	Bank of America	USD 19.3	20/3/2019	20,943	(45,819)
(27,080,000)	プット	OTC NZD/JPY	Bank of America	NZD 74	25/3/2019	(8,900)	(49,764)
(32,512,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.14	5/4/2019	(41,602)	(283,348)
(10,708,000)	コール	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 113	5/6/2019	474	(39,681)
(10,708,000)	コール	OTC USD/CAD	Barclays	USD 1.325	5/3/2019	(2,045)	(16,822)
(17,345,000)	プット	OTC AUD/JPY	Barclays	AUD 78	7/3/2019	178,781	(17,016)
(10,837,000)	コール	OTC EUR/NZD	Barclays	EUR 1.6575	11/3/2019	(82,871)	(127,410)
(5,610,000)	プット	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.365	5/3/2019	36,881	(5)
(10,708,000)	プット	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.325	5/3/2019	23,991	(69,062)
(4,335,000)	プット	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 13.8	8/3/2019	9,873	(13,103)
(5,419,000)	コール	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 14.08	8/3/2019	15,689	(36,333)
(15,163,000)	コール	OTC AUD/CAD	BNP Paribas	AUD 0.9466	11/3/2019	38,871	(18,920)
(15,163,000)	プット	OTC AUD/CAD	BNP Paribas	AUD 0.9466	11/3/2019	(56,640)	(114,431)
(5,470,000)	コール	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 110	15/3/2019	(20,477)	(65,156)
(14,991,200)	コール	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 14.9	19/3/2019	60,873	(24,363)
(7,630,500)	コール	OTC USD/KRW	BNP Paribas	USD 1,130	27/3/2019	(14,256)	(31,348)
(5,354,000)	コール	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 15	8/4/2019	(7,642)	(23,667)
(29,983,000)	プット	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 13.3	8/4/2019	58,767	(80,654)
(5,405,000)	プット	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 13.5	6/5/2019	117,768	(46,328)
(38,627,000)	コール	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 4.13	17/5/2019	76,837	(120,934)
(9,648,000)	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.08	26/7/2019	8,901	(18,358)
(7,302,000)	コール	OTC AUD/JPY	Citibank	AUD 78.5	6/3/2019	(17,035)	(54,122)
(26,785,000)	コール	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.74	12/3/2019	42,952	(1,323)
(48,000)	コール	OTC EUR/GBP	Citibank	EUR 0.875	12/3/2019	23,008	(5,520)
(3,250,000)	コール	OTC USD/MXN	Citibank	USD 20	14/3/2019	13,344	(1,573)
(5,615,000)	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 110	15/3/2019	28,296	(8,398)
(5,087,000)	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 14.2	15/3/2019	65,753	(37,056)
(5,633,333)	プット	OTC USD/CAD	Citibank	USD 1.3	19/3/2019	22,343	(7,069)
(11,256,667)	プット	OTC USD/CAD	Citibank	USD 1.3	19/3/2019	10,471	(14,124)
(27,892,000)	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 13.1	21/3/2019	86,512	(8,933)
(21,414,000)	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 104	8/4/2019	116,768	(1,730)
(26,919,000)	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 15.5	8/4/2019	224,877	(56,486)
(5,087,000)	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 13.95	10/4/2019	(29,729)	(119,824)
(7,631,000)	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 13.15	10/4/2019	45,862	(13,977)
(1,239,000)	プット	OTC EUR/GBP	Citibank	EUR 0.81	2/5/2019	100,917	(137,690)
(8,652,000)	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 13.5	6/5/2019	162,477	(74,159)
(29,247,000)	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 14.9	14/5/2019	(129,854)	(342,555)
(58,795,000)	プット	OTC USD/CNH	Citibank	USD 6.4825	24/5/2019	17,484	(111,277)
(5,465,000)	コール	OTC USD/INR	Citibank	USD 75	14/6/2019	7,210	(32,067)
(22,155,000)	コール	OTC USD/INR	Citibank	USD 76.5	14/6/2019	12,392	(85,645)

売建オプション 2019年2月28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)
(7,302,000)	コール	OTC AUD/JPY	Deutsche Bank	AUD 78	5/3/2019	(49,133)	(80,580)
(8,568,000)	プット	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.3175	5/3/2019	(3,285)	(25,733)
(10,710,000)	コール	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.3225	5/3/2019	20,581	(23,051)
(21,326,000)	プット	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 13	11/3/2019	130,306	(230)
(8,580,000)	プット	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 13.35	21/3/2019	75,452	(10,065)
(26,770,000)	プット	OTC USD/CAD	Goldman Sachs	USD 1.3	8/3/2019	14,686	(13,690)
(6,490,000)	プット	OTC AUD/USD	Goldman Sachs	AUD 0.7	12/3/2019	17,980	(7,259)
(8,568,000)	コール	OTC AUD/USD	Goldman Sachs	AUD 0.73	12/3/2019	48,151	(3,063)
(12,857,000)	コール	OTC AUD/USD	Goldman Sachs	AUD 0.73	12/3/2019	7,216	(4,596)
(64,248,000)	プット	OTC AUD/USD	Goldman Sachs	AUD 0.685	12/3/2019	106,354	(6,852)
(11,375,000)	コール	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 19.75	14/3/2019	91,054	(14,592)
(16,080,000)	プット	OTC AUD/USD	Goldman Sachs	AUD 0.71	2/4/2019	26,496	(97,531)
(24,388,000)	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 103.5	12/4/2019	134,088	(1,899)
(19,527,000)	プット	OTC USD/ZAR	HSBC Bank Plc	USD 13.25	11/3/2019	152,255	(2,301)
(6,430,000)	コール	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.85	13/3/2019	13,455	(1,116)
(56,966,560)	プット	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,062	16/5/2019	17,477	(33,001)
(25,047,000)	コール	OTC USD/TWD	HSBC Bank Plc	USD 31	19/7/2019	102,520	(143,943)
(11,388,000)	プット	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.72	1/3/2019	31,168	(19,565)
(21,416,000)	プット	OTC USD/SEK	JP Morgan	USD 9	8/3/2019	15,523	(8,035)
(16,080,750)	プット	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0.715	12/3/2019	(50,578)	(101,479)
(4,920,000)	コール	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 14	14/3/2019	50,240	(60,188)
(37,788,000)	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 104.5	15/3/2019	67,252	(11)
(37,788,000)	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 104.5	15/3/2019	59,694	(11)
(17,660,000)	コール	OTC USD/TRY	JP Morgan	USD 5.9	21/3/2019	217,927	(5,825)
(5,087,000)	コール	OTC USD/COP	JP Morgan	USD 3,105	27/3/2019	14,300	(41,657)
(11,317,000)	コール	OTC USD/CLP	JP Morgan	USD 678	4/4/2019	28,669	(23,144)
(333)	コール	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 15	8/4/2019	-	(1)
(22,155,000)	コール	OTC USD/INR	JP Morgan	USD 74	18/4/2019	130,312	(32,749)
(2,142,000)	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 13.5	6/5/2019	49,250	(18,360)
(5,400,000)	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 13.5	6/5/2019	67,655	(46,285)
(28,697,440)	プット	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,062	16/5/2019	10,179	(16,624)
(29,620,000)	プット	OTC GBP/USD	Morgan Stanley	GBP 1.44	1/3/2019	106,834	-
(4,292,000)	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.78	6/3/2019	12,715	(8,041)
(5,365,000)	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.66	6/3/2019	20,282	(4,875)
(7,545,000)	コール	OTC USD/KRW	Morgan Stanley	USD 1,135	6/3/2019	14,001	(5,322)
(12,960,000)	コール	OTC AUD/JPY	Morgan Stanley	AUD 75	7/3/2019	(284,799)	(483,397)
(12,960,000)	プット	OTC AUD/JPY	Morgan Stanley	AUD 78	7/3/2019	408,229	(12,714)
(17,087,000)	プット	OTC AUD/JPY	Morgan Stanley	AUD 78	7/3/2019	276,096	(16,763)
(6,516,000)	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.75	7/3/2019	30,777	(26,890)
(7,510,650)	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.62	7/3/2019	20,555	(2,269)
(21,720,000)	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.73	7/3/2019	(68,064)	(152,012)
(26,890,000)	コール	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 20.5	14/3/2019	84,613	(897)
(28,075,000)	プット	OTC USD/CNH	Morgan Stanley	USD 6.6	15/3/2019	44,944	(20,471)
(10,294,500)	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.66	21/3/2019	19,240	(42,424)
(13,650,000)	プット	OTC USD/KRW	Morgan Stanley	USD 1,090	4/4/2019	59,129	(604)

売建オプション 2019年2月28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)
(21,512,000)	コール	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 21	12/4/2019	80,988	(13,020)
(14,217,000)	コール	OTC AUD/JPY	Nomura	AUD 75	7/3/2019	40,115	(48)
(14,217,000)	コール	OTC AUD/JPY	Nomura	AUD 75	7/3/2019	36,026	(6)
(11,848,000)	プット	OTC USD/NOK	RBS Plc	USD 8	11/4/2019	61,852	(2,838)
(10,835,000)	コール	OTC EUR/JPY	Royal Bank of Canada	EUR 126	8/3/2019	(46,164)	(87,380)
(32,124,000)	プット	OTC USD/JPY	Royal Bank of Canada	USD 102.5	8/4/2019	122,566	(469)
(16,200,000)	コール	OTC USD/JPY	Royal Bank of Canada	USD 113	5/6/2019	(11,513)	(60,032)
(2,195)	コール	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.625	13/12/2019	147,548	(946,594)
(586)	プット	Anheuser-Busch InBev SA/NV	Exchange Traded	USD 60	15/3/2019	45,590	(4,688)
(172)	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 18	19/3/2019	17,424	(9,030)
(344)	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 17	19/3/2019	8,531	(24,080)
(516)	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 16	19/3/2019	1,961	(49,020)
(968)	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 17	19/3/2019	(104,322)	(208,120)
(971)	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 20	17/4/2019	8,620	(80,107)
(68)	プット	Euro Bund	Exchange Traded	EUR 162	22/3/2019	(15,214)	(24,383)
(68)	プット	Euro Bund	Exchange Traded	EUR 162.5	22/3/2019	(21,440)	(36,769)
(182)	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,350	15/3/2019	(6,915)	(14,399)
(273)	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,100	15/3/2019	36,781	(7,458)
(273)	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,075	15/3/2019	29,484	(6,060)
(7,024)	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 110	21/6/2019	(53,848)	(259,864)
(3,421)	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.875	17/6/2019	144,435	(21,381)
(1,022)	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.125	16/12/2019	(14,441)	(677,075)
(2,195)	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.375	16/12/2019	(3,358)	(658,500)
(3,421)	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.875	16/3/2020	(47,997)	(513,150)
(1,932)	プット	iShares USD High Yield Corporate Bond UCITS ETF	Exchange Traded	USD 98.5	18/4/2019	53,710	(1,932)
(35)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,620	15/3/2019	29,502	(9,363)
(35)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,640	15/3/2019	35,208	(11,550)
(258)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 282	1/3/2019	12,526	(1,677)
(258)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 268	1/3/2019	15,751	(258)
(4,302)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 276	1/3/2019	44,309	(53,775)
(602)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 285	8/3/2019	14,026	(8,729)
(602)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 268	8/3/2019	11,016	(12,943)
(2,150)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 280	29/3/2019	(404,633)	(629,950)
(426)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 265	18/4/2019	21,390	(76,254)
(643)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 280	18/4/2019	12,881	(273,597)

売建オプション 2019年2月28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)
(643)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 274	18/4/2019	34,803	(220,549)
(1,458)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 290	18/4/2019	80,625	(94,041)
(1,459)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 260	18/4/2019	4,542	(187,481)
(731)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 250	20/12/2019	23,970	(480,998)
(1,363)	コール	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Exchange Traded	USD 116	24/5/2019	77,785	(143,753)
合計						4,279,891	(10,078,428)

シンセティック・キャップ・オプション 2019年2月28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)
609,000,000	プット	USD - 5 Year Constant Maturity Swap	Goldman Sachs	USD 0.35	26/7/2019	(65,869)	241,676
(609,000,000)	コール	USD - 5 Year Constant Maturity Swap	Goldman Sachs	USD 0.45	26/7/2019	47,179	(92,891)
1,079,632,000	コール	USD - 5 Year Constant Maturity Swap	Goldman Sachs	USD 0.21	29/5/2020	155,845	1,829,274
(1,079,632,000)	コール	USD - 5 Year Constant Maturity Swap	Goldman Sachs	USD 0.71	29/5/2020	218,086	(267,749)
234,100,000	コール	USD - 2 Year Constant Maturity Swap	Morgan Stanley	USD 99.00	10/4/2019	(79,367)	130,153
341,000,000	コール	USD - 5 Year Constant Maturity Swap	Morgan Stanley	USD 0.07	22/6/2020	388,112	950,763
合計						663,986	2,791,226

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 2019年2月28日現在

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価 益/(損) (米ドル)
	ベルギー		
5,694	Telenet Group Holding NV	Merrill Lynch	8,038
			<u>8,038</u>
	フランス		
14,301	BNP Paribas SA	Merrill Lynch	51,118
(10,560)	Casino Guichard-Perrachon SA	Merrill Lynch	(15,748)
16,423	Credit Agricole SA	Merrill Lynch	19,854
38,902	Europcar Mobility Group	Merrill Lynch	(1,328)
			<u>53,896</u>
	ドイツ		
124,586	Tele Columbus AG	Merrill Lynch	5,389
			<u>5,389</u>
	ギリシャ		
41,378	National Bank of Greece SA	Merrill Lynch	22,704
			<u>22,704</u>
	アイルランド		
17,756	Smurfit Kappa Group Plc	Merrill Lynch	(35,170)
			<u>(35,170)</u>
	イタリア		
238,033	Telecom Italia SpA/Milano	Merrill Lynch	4,769
			<u>4,769</u>
	ルクセンブルグ		
19,197	Aroundtown SA	Merrill Lynch	(3,824)
			<u>(3,824)</u>
	オランダ		
120,617	ALTICE EUROPE NV	Merrill Lynch	25,333
28,997	Constellium NV	Merrill Lynch	13,919
			<u>39,252</u>
	スペイン		
59,305	CaixaBank SA	Merrill Lynch	9,924
			<u>9,924</u>
	英国		
(84,854)	Barclays Plc	Merrill Lynch	(6,342)
24,789	Liberty Global Plc	Merrill Lynch	3,470
(166,656)	Tullow Oil Plc	Merrill Lynch	21,057
163,101	Vodafone Group PLC	Merrill Lynch	(15,532)
			<u>2,653</u>
	米国		
11,147	AMC Entertainment Holdings Inc	Merrill Lynch	3,233
			<u>3,233</u>
合計			<u>110,864</u>

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 2019年2月28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 29,000,000	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2.62%の固定金利を11/12/2019より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を11/9/2019より四半期毎に支払う。	Bank of America	7/6/2019	(26,725)	190,775
USD 50,235,000	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2.7%の固定金利を12/12/2019より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/9/2019より四半期毎に支払う。	Barclays	10/6/2019	86,544	484,657
JPY 1,354,500,000	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16/3/2021より6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を半年毎に受け取り、0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Barclays	14/9/2020	(262,995)	81,462
JPY 1,354,500,000	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0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に受け取り、6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Barclays	14/9/2020	78,717	423,175
EUR 48,265,000	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0.551%の固定金利を17/8/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/5/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	15/2/2021	(78,719)	561,021
EUR 48,265,000	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17/8/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、0.551%の固定金利を17/2/2022より毎年支払う。	Barclays	15/2/2021	34,848	674,588
USD 39,820,000	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9/9/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.8%の固定金利を9/12/2021より半年毎に支払う。	Barclays	7/6/2021	(1,069,572)	483,875
USD 9,000,000	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3.0825%の固定金利を31/7/2029より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を30/4/2029より四半期毎に支払う。	Barclays	29/1/2029	(5,112)	506,088
USD 9,000,000	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30/4/2029より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.0825%の固定金利を31/7/2029より半年毎に支払う。	Barclays	29/1/2029	(40,368)	470,832
USD 25,970,000	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2.6%の固定金利を26/9/2019より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を26/6/2019より四半期毎に支払う。	Citibank	22/3/2019	(3,116)	37,587
USD 17,050,000	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2.7%の固定金利を26/9/2019より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を26/6/2019より四半期毎に支払う。	Citibank	22/3/2019	2,417	76,724

買建スワップション 2019年2月28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 17,050,000	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26/6/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.7%の固定金利を26/9/2019より半年毎に支払う。	Citibank	22/3/2019	(15,483)	74,914
USD 170,955,000	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26/7/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.77%の固定金利を26/10/2019より半年毎に支払う。	Citibank	24/4/2019	(570,562)	-
USD 120,933,000	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2.47%の固定金利を9/1/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を9/10/2019より四半期毎に支払う。	Citibank	5/7/2019	(573,352)	508,229
USD 761,040,000	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2.35%の固定金利を12/1/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/10/2019より四半期毎に支払う。	Citibank	10/7/2019	(567,135)	669,555
USD 83,180,000	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28/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.521%の固定金利を28/8/2020より半年毎に支払う。	Citibank	26/2/2020	60,864	975,844
USD 83,180,000	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2.521%の固定金利を28/8/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を28/5/2020より四半期毎に支払う。	Citibank	26/2/2020	(59,682)	855,298
USD 4,810,000	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2.97%の固定金利を31/7/2024より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を30/4/2024より四半期毎に支払う。	Citibank	29/1/2024	1,266	489,962
USD 4,810,000	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30/4/2024より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.97%の固定金利を31/7/2024より半年毎に支払う。	Citibank	29/1/2024	(48,501)	440,195
USD 20,387,000	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3.05%の固定金利を29/12/2028より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/9/2028より四半期毎に支払う。	Citibank	27/6/2028	(38,804)	1,113,179
EUR 9,130,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/12/2018よりITRAXX.XO.30.V2の変動金利を四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Citigroup	20/3/2019	(56,472)	12,874
USD 162,951,000	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2.65%の固定金利を13/2/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を13/11/2019より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	9/8/2019	34,398	168,037

買建スワップション 2019年2月28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 128,520,000	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2.59%の固定金利を25/1/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を25/10/2019より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	23/7/2019	112,693	1,015,546
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5/5/2020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5/8/2020より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	3/2/2020	(354,943)	6,571
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	(717,982)	1,131,837
USD 10,840,000	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16/5/2023より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.4%の固定金利を16/8/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	14/2/2023	(368,288)	518,197
USD 5,880,000	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3.1125%の固定金利を28/10/2023より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を28/7/2023より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	26/4/2023	48,959	647,837
USD 5,880,000	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28/7/2023より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.1125%の固定金利を28/10/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	26/4/2023	(177,981)	420,897
USD 384,818,000	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18/6/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.2%の固定金利を18/9/2019より半年毎に支払う。	JP Morgan	14/3/2019	(2,594,199)	-
AUD 102,505,000	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1.94%の固定金利を25/5/2020より半年毎に受け取り、6ヶ月AUD BBSWの変動金利を25/5/2020より半年毎に支払う。	JP Morgan	22/11/2019	148,492	199,704
JPY 1,184,200,000	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0.78%の固定金利を20/10/2021より半年毎に受け取り、6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を20/10/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	16/4/2021	109,053	479,185
JPY 1,184,200,000	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20/10/2021より6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を半年毎に受け取り、0.78%の固定金利を20/10/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	16/4/2021	(189,021)	181,266
USD 28,838,000	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3.1825%の固定金利を4/11/2028より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/8/2028より四半期毎に支払う。	JP Morgan	2/5/2028	127,365	1,706,246

買建スワップション 2019年2月28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 28,838,000	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4/8/2028より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.1825%の固定金利を4/11/2028より半年毎に支払う。	JP Morgan	2/5/2028	(174,129)	1,404,752
USD 2,255,000	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29/7/2038より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、29/10/2038より2.985%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	27/4/2038	14,292	120,277
USD 2,255,000	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29/10/2038より2.985%の固定金利を半年毎に受け取り、29/7/2038より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	27/4/2038	4,605	110,590
USD 8,077,500	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24/5/2039より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.86%の固定金利を24/8/2039より半年毎に支払う。	JP Morgan	22/2/2039	35,585	435,219
USD 8,077,500	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2.86%の固定金利を24/8/2039より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を24/5/2039より四半期毎に支払う。	JP Morgan	22/2/2039	32,693	432,327
USD 114,785,000	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2.7%の固定金利を13/9/2019より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を13/6/2019より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	11/3/2019	(211,457)	375,120
USD 114,785,000	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15/10/2019より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/7/2019より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	11/4/2019	(79,701)	129,278
USD 186,700,000	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3.09%の固定金利を2/6/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を2/3/2020より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	27/11/2019	2,453,335	4,857,098
USD 186,700,000	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2/3/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.09%の固定金利を2/6/2020より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	27/11/2019	(2,144,724)	259,039
USD 692,910,000	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2.95%の固定金利を14/7/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/4/2020より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	10/1/2020	1,169,273	2,991,798
USD 692,910,000	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2.95%の固定金利を23/7/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を23/4/2020より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	21/1/2020	1,260,962	3,061,359

買建スワップション 2019年2月28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 337,560,000	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2.95%の固定金利を3/8/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を3/5/2020より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	30/1/2020	757,448	1,506,723
JPY 1,354,500,000	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16/3/2021より6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を半年毎に受け取り、0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	14/9/2020	(261,269)	79,821
JPY 1,354,500,000	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0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に受け取り、6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	14/9/2020	82,085	423,175
USD 8,940,000	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16/4/2029より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.0366%の固定金利を16/7/2029より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	11/1/2029	(27,439)	481,470
USD 8,940,000	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3.0366%の固定金利を16/7/2029より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/4/2029より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	11/1/2029	(21,161)	487,748
USD 8,940,000	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3.04%の固定金利を12/7/2029より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/4/2029より四半期毎に支払う。	Nomura	10/1/2029	(19,837)	488,626
USD 8,940,000	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12/4/2029より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.04%の固定金利を12/7/2029より半年毎に支払う。	Nomura	10/1/2029	(28,073)	480,390
EUR 25,190,000	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20/7/2028より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、3%の固定金利を20/1/2029より毎年支払う。	UBS	18/1/2028	(699,104)	971,631
合計				(4,830,012)	34,702,598

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 2019年2月28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 (43,500,000)	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11/9/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、11/12/2019より2.42%の固定金利を半年毎に支払う。	Bank of America	7/6/2019	40,959	(100,416)
USD (182,960,000)	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21/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、21/10/2020より2.944%の固定金利を半年毎に支払う。	Bank of America	17/4/2020	(604,593)	(1,876,165)
USD (182,960,000)	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21/10/2020より2.944%の固定金利を半年毎に受け取り、21/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Bank of America	17/4/2020	1,007,742	(263,830)
USD (784,851,000)	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7/4/2021より3.55%の固定金利を半年毎に受け取り、7/1/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Bank of America	5/10/2020	3,520,041	(453,267)
USD (627,070,000)	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15/4/2021より3.75%の固定金利を半年毎に受け取り、15/1/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Bank of America	13/10/2020	2,028,897	(244,231)
EUR (78,200,000)	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14/3/2020より0.025%の固定金利を毎年受け取り、14/9/2019より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	12/3/2019	56,671	(17)
EUR (183,570,000)	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18/6/2020より0.143%の固定金利を毎年受け取り、18/12/2019より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	14/6/2019	443,024	(6,209)
EUR (44,631,000)	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27/6/2020より0.6%の固定金利を毎年受け取り、27/12/2019より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	25/6/2019	323,475	(10,197)
EUR (500,468,000)	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28/6/2020より0.78%の固定金利を毎年受け取り、28/12/2019より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	26/6/2019	2,166,937	(37,555)
USD (150,085,000)	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3/1/2020より2.9%の固定金利を半年毎に受け取り、3/10/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	1/7/2019	158,887	(28,719)
USD (150,085,000)	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3/10/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3/1/2020より2.1%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	1/7/2019	131,402	(27,688)

売建スワップション 2019年2月28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 (105,490,000)	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6/5/2020より2.7%の固定金利を半年毎に受け取り、6/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	4/11/2019	162,804	(206,411)
EUR (91,060,000)	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27/1/2021より0.2%の固定金利を毎年受け取り、27/7/2020より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	23/1/2020	40,953	(65,658)
USD (366,760,000)	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5/8/2020より3.15%の固定金利を半年毎に受け取り、5/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	3/2/2020	1,468,426	(174,658)
USD (167,860,000)	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26/2/2021より3.5%の固定金利を半年毎に受け取り、26/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	24/8/2020	480,498	(86,030)
EUR (72,540,000)	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23/12/2021より0.55%の固定金利を毎年受け取り、23/6/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	21/12/2020	145,883	(116,928)
EUR (148,810,000)	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17/8/2021より0.209%の固定金利を半年毎に受け取り、17/5/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	15/2/2021	(44,405)	(695,722)
EUR (148,810,000)	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17/5/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、17/8/2021より0.209%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	15/2/2021	96,704	(554,612)
EUR (28,200,000)	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6/5/2022より2%の固定金利を毎年受け取り、6/11/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	4/5/2021	570,080	(133,029)
USD (84,340,000)	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9/12/2021より3.87%の固定金利を半年毎に受け取り、9/9/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	7/6/2021	1,218,861	(433,424)
USD (285,120,000)	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25/1/2020より2.96%の固定金利を半年毎に受け取り、25/10/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	23/7/2019	312,740	(43,660)
USD (285,120,000)	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25/10/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、25/1/2020より2.46%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	23/7/2019	1,517	(468,931)

売建スワップション 2019年2月28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 (285,025,000)	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26/10/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、26/1/2020より2.34%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	24/7/2019	187,390	(860,077)
USD (200,940,000)	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28/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、28/8/2020より2.46%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	26/2/2020	50,713	(834,930)
USD (200,940,000)	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28/8/2020より2.46%の固定金利を半年毎に受け取り、28/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	26/2/2020	(57,792)	(943,435)
USD (126,680,000)	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30/6/2021より3.25%の固定金利を半年毎に受け取り、31/3/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	29/12/2020	262,461	(199,921)
EUR (9,130,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5%の固定金利を受け取り、20/12/2018よりITRAXX.XO.30.V2の変動金利を四半期毎に支払う。	Citigroup	20/3/2019	13,090	(2,716)
USD (588,780,000)	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16/3/2020より3.35%の固定金利を半年毎に受け取り、16/12/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	12/9/2019	1,594,122	(11,911)
USD (116,035,000)	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12/5/2020より3.295%の固定金利を半年毎に受け取り、12/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	7/11/2019	560,298	(12,625)
USD (116,035,000)	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12/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、12/5/2020より3.295%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	7/11/2019	(1,137,723)	(1,710,646)
USD (111,070,000)	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11/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、11/8/2020より2.2%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	7/2/2020	38,008	(253,551)
USD (111,070,000)	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11/8/2020より3.2%の固定金利を半年毎に受け取り、11/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	7/2/2020	380,589	(44,254)
USD (112,110,000)	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19/8/2020より3.35%の固定金利を半年毎に受け取り、19/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	14/2/2020	429,485	(24,928)

売建スワップション 2019年2月28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 (112,110,000)	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19/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、19/8/2020より2.35%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	14/2/2020	8,265	(362,833)
USD (186,800,000)	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16/10/2020より2.8775%の固定金利を半年毎に受け取り、16/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	14/4/2020	1,022,280	(329,685)
USD (186,800,000)	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16/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、16/10/2020より2.8775%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	14/4/2020	(394,178)	(1,746,143)
USD (97,150,000)	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2/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2/12/2020より2.9%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	29/5/2020	(251,797)	(965,850)
USD (97,150,000)	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2/12/2020より2.9%の固定金利を半年毎に受け取り、2/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	29/5/2020	527,424	(186,628)
USD (677,115,000)	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27/9/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、27/12/2019より2.7%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	25/6/2019	(694,009)	(2,449,755)
USD (125,270,000)	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10/3/2020より3.3%の固定金利を半年毎に受け取り、10/12/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	6/9/2019	293,837	(3,053)
USD (78,940,000)	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7/7/2020より2.8%の固定金利を半年毎に受け取り、7/4/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	3/1/2020	56,932	(126,998)
USD (98,900,000)	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7/11/2020より3.15%の固定金利を半年毎に受け取り、7/8/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	5/5/2020	463,577	(82,846)
USD (136,590,000)	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2/12/2020より3.35%の固定金利を半年毎に受け取り、2/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	29/5/2020	427,061	(69,785)
USD (135,940,000)	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10/12/2020より3.45%の固定金利を半年毎に受け取り、10/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	8/6/2020	509,623	(53,169)

売建スワップション 2019年2月28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 (86,390,000)	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17/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、17/12/2020より3.35%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	15/6/2020	375,577	(48,598)
USD (245,526,525)	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3.065%の固定金利を1/6/2021より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/3/2021より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	27/11/2020	(1,208,288)	(3,226,516)
USD (245,526,525)	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1/3/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.065%の固定金利を1/6/2021より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	27/11/2020	1,498,542	(519,686)
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	908,796	(917,840)
USD (499,485,000)	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8/1/2020より2.9%の固定金利を半年毎に受け取り、8/10/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	3/7/2019	450,441	(96,495)
USD (499,485,000)	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8/10/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、8/1/2020より2.1%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	3/7/2019	449,277	(97,659)
USD (265,540,000)	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10/1/2020より2.95%の固定金利を半年毎に受け取り、10/10/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	8/7/2019	283,809	(34,839)
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	41,814	(19)
USD (265,540,000)	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10/10/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、10/1/2020より2.15%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	8/7/2019	118,510	(77,989)
USD (829,312,000)	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2/11/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2/2/2020より2.34%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	31/7/2019	263,680	(876,624)
USD (185,846,000)	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2/11/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2/2/2020より2.48%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	31/7/2019	153,131	(1,003,760)

売建スワップション 2019年2月28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 (74,400,000)	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18/6/2020より2.7%の固定金利を半年毎に受け取り、18/3/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	16/12/2019	67,563	(166,080)
USD (186,800,000)	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23/7/2020より2.85%の固定金利を半年毎に受け取り、23/4/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	21/1/2020	511,841	(268,049)
EUR (165,700,000)	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16/12/2021より0.6%の固定金利を毎年受け取り、16/6/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	14/12/2020	398,270	(227,671)
EUR (46,800,000)	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21/4/2022より2.15%の固定金利を半年毎に受け取り、21/10/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	19/4/2021	853,844	(148,851)
USD (114,785,000)	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13/6/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、13/9/2019より2.6%の固定金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	11/3/2019	73,284	(67,375)
USD (1,039,365,000)	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14/4/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、14/7/2020より2.45%の固定金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	10/1/2020	(177,922)	(1,466,149)
USD (1,039,365,000)	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23/4/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、23/7/2020より2.45%の固定金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	21/1/2020	(334,136)	(1,548,612)
USD (506,340,000)	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3/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3/8/2020より2.45%の固定金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	30/1/2020	(292,121)	(781,475)
USD (166,495,000)	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8/1/2020より2.9%の固定金利を半年毎に受け取り、8/10/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Nomura	3/7/2019	134,330	(32,165)
USD (166,495,000)	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8/10/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、8/1/2020より2.1%の固定金利を半年毎に支払う。	Nomura	3/7/2019	179,728	(32,553)
USD (101,640,000)	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28/2/2020より2.7%の固定金利を半年毎に受け取り、28/11/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Nomura	26/8/2019	(16,746)	(130,075)

売建スワップション 2019年2月28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 (836,400,000)	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20/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、20/10/2020より2.45%の固定金利を半年毎に支払う。	Nomura	16/4/2020	(1,084,133)	(1,728,161)
USD (113,300,000)	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25/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、25/8/2020より2.35%の固定金利を半年毎に支払う。	UBS	21/2/2020	(37,319)	(371,554)
USD (113,300,000)	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25/8/2020より3.35%の固定金利を半年毎に受け取り、25/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	UBS	21/2/2020	415,208	(26,662)
合計				<u>22,044,139</u>	<u>(31,198,553)</u>

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 2019年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
	米国		
USD (400,119,000)	Fannie Mae ' 3 3/19 ' 3% TBA	(399,767,335)	(4.08)
USD (1,605,449,000)	Fannie Mae ' 3.5 3/19 ' 3.5% TBA	(1,608,427,750)	(16.41)
USD (1,295,552,000)	Fannie Mae ' 4 3/19 ' 4% TBA	(1,322,022,006)	(13.49)
USD 1,981,762,000	Fannie Mae ' 4.5 4/19 ' 4.5% TBA	2,051,010,610	20.93
USD 184,810,000	Fannie Mae ' 5 3/19 ' 5% TBA	193,783,496	1.98
USD (327,058,572)	Ginnie Mae ' 3 3/19 ' 3% TBA	(323,417,488)	(3.30)
USD 23,338,000	Ginnie Mae ' 3.5 3/19 ' 3.5% TBA	23,576,849	0.24
USD 27,410,000	Ginnie Mae ' 4 3/19 ' 4% TBA	28,156,814	0.29
USD 306,220,000	Ginnie Mae ' 4 4/19 ' 4% TBA	314,324,051	3.21
USD 23,338,000	Ginnie Mae ' 4.5 3/19 ' 4.5% TBA	24,154,411	0.24
T B A合計		(1,018,628,348)	(10.39)

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。

USダラー・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 2019年2月28日現在(未監査)

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 4,500,000	BNZ International Funding Ltd FRN 16/4/2019	4,500,835	0.24
コマーシャル・ペーパー合計		4,500,835	0.24
預託証書			
フランス			
USD 11,000,000	BNP Paribas SA (New York Branch) FRN 8/4/2019	11,002,941	0.59
預託証書合計		11,002,941	0.59
債券			
オーストラリア			
AUD 63,294	Apollo Series 2009-1 Trust 'Series 2009-1 A3' FRN 3/10/2040	45,136	0.00
USD 1,705,000	Commonwealth Bank of Australia '144A' 2.05% 18/9/2020	1,681,962	0.09
AUD 190,566	National Rmbs Trust 2012-2 'Series 2012-2 A1' FRN 20/6/2044	136,234	0.01
AUD 1,178,356	TORRENS Series 2013-1 Trust 'Series 2013-1 A' FRN 12/4/2044	835,368	0.05
USD 831,925	Virgin Australia 2013-1A Pass Through Trust '144A' 5% 23/10/2023	847,190	0.05
USD 596,796	Virgin Australia 2013-1B Pass Through Trust '144A' 6% 23/10/2020	606,792	0.03
USD 8,450,000	Westpac Banking Corp '144A' 3.15% 16/1/2024	8,499,497	0.45
		12,652,179	0.68
ブラジル			
USD 3,600,000	Centrais Eletricas Brasileiras SA '144A' 5.75% 27/10/2021	3,699,000	0.20
カナダ			
USD 1,539,683	Air Canada 2013-1 Class B Pass Through Trust '144A' 5.375% 15/5/2021	1,562,690	0.08
USD 1,385,000	Bank of Montreal 1.75% 11/9/2019	1,378,421	0.07
USD 175,000	Enbridge Inc 2.9% 15/7/2022	172,401	0.01
USD 2,900,000	Encana Corp 3.9% 15/11/2021	2,924,145	0.16
USD 2,232,000	Province of Alberta Canada 3.35% 1/11/2023	2,278,331	0.12
USD 8,000,000	Province of Ontario Canada 3.4% 17/10/2023	8,174,252	0.44
USD 475,000	TransCanada PipeLines Ltd 3.75% 16/10/2023	484,200	0.03
		16,974,440	0.91
ケイマン諸島			
USD 2,780,000	Baidu Inc 2.875% 6/7/2022*	2,724,025	0.15
USD 577,120	Resource Capital Corp 2017-CRE5 Ltd FRN 15/7/2034	573,172	0.03
		3,297,197	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 (%)
		チリ		
USD	2,000,000	Empresa Nacional del Petroleo '144A' 5.25% 10/8/2020	2,047,380	0.11
		コロンビア		
USD	3,635,000	Bancolombia SA 5.95% 3/6/2021	3,812,206	0.20
		キプロス		
EUR	1,996,000	Cyprus Government International Bond '144A' 4.625% 3/2/2020	2,367,797	0.13
EUR	3,230,000	Cyprus Government International Bond 4.75% 25/6/2019	3,730,982	0.20
			6,098,779	0.33
		フィンランド		
USD	1,915,000	Nordea Bank Abp '144A' 1.625% 30/9/2019	1,902,160	0.10
USD	2,090,000	Nordea Bank Abp '144A' 2.25% 27/5/2021	2,052,003	0.11
			3,954,163	0.21
		ドイツ		
EUR	525,106	Compartment VCL 24 FRN 21/8/2022	599,047	0.03
USD	3,695,000	Deutsche Bank AG/New York NY 4.25% 4/2/2021	3,682,284	0.20
			4,281,331	0.23
		ガーンジー		
USD	2,065,000	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd 3.125% 10/12/2020	2,061,641	0.11
		アイルランド		
USD	1,160,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.3% 23/1/2023	1,124,250	0.06
USD	1,000,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.5% 26/5/2022	987,382	0.05
USD	3,000,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.95% 1/2/2022	3,011,828	0.16
USD	1,010,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.25% 1/7/2020	1,016,581	0.05
USD	1,189,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.5% 15/5/2021	1,205,584	0.07
USD	3,700,000	GE Capital International Funding Co Unlimited Co 2.342% 15/11/2020	3,637,562	0.19
USD	16,935,000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 1.9% 23/9/2019	16,814,482	0.90
USD	7,385,000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.4% 23/9/2021	7,215,627	0.39
USD	3,845,000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.875% 23/9/2023	3,730,147	0.20
USD	754,000	Willis Towers Watson Plc 5.75% 15/3/2021	788,434	0.04
			39,531,877	2.11
		イタリア		
EUR	8,300,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.1% 15/4/2019	9,451,112	0.51
EUR	20,405,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.5% 1/3/2019	23,231,364	1.24
			32,682,476	1.75

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			
USD 3,441,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.95% 1/3/2021	3,427,041	0.18
USD 3,270,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3.218% 7/3/2022	3,270,814	0.17
USD 705,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3.535% 26/7/2021	711,525	0.04
USD 2,595,000	Mizuho Bank Ltd '144A' 2.65% 25/9/2019	2,595,423	0.14
USD 5,395,000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.846% 11/1/2022	5,345,225	0.29
USD 1,390,000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd '144A' 3.8% 26/11/2020	1,402,991	0.07
		16,753,019	0.89
ルクセンブルグ			
USD 9,759,000	Allergan Funding SCS 3.45% 15/3/2022	9,725,535	0.52
メキシコ			
MXN 2,623,000	Mexico Cetes 21/3/2019 (Zero Coupon)	1,359,700	0.07
オランダ			
USD 2,810,000	ING Groep NV 4.1% 2/10/2023	2,851,457	0.15
USD 1,214,000	Mylan NV 2.5% 7/6/2019	1,212,343	0.06
USD 3,393,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 3.875% 1/9/2022	3,393,780	0.18
USD 5,840,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.125% 15/6/2020	5,897,232	0.32
USD 2,357,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.125% 1/6/2021	2,375,799	0.13
USD 1,195,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.625% 15/6/2022	1,221,625	0.07
		16,952,236	0.91
パナマ			
USD 1,380,000	Carnival Corp 3.95% 15/10/2020	1,400,617	0.07
スウェーデン			
USD 2,190,000	Svenska Handelsbanken AB 3.35% 24/5/2021	2,207,490	0.12
スイス			
USD 5,745,000	Credit Suisse Group AG '144A' 3.574% 9/1/2023	5,698,993	0.30
USD 675,000	UBS AG/Stamford CT 2.375% 14/8/2019	674,026	0.04
USD 2,215,000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' FRN 15/8/2023	2,163,274	0.12
USD 1,395,000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' 2.65% 1/2/2022	1,368,470	0.07
		9,904,763	0.53
英国			
USD 677,000	Anglo American Capital Plc '144A' 4.125% 15/4/2021	680,757	0.04
USD 1,665,000	Aon Plc 2.8% 15/3/2021	1,653,875	0.09
USD 3,219,000	AXIS Specialty Finance Plc 2.65% 1/4/2019	3,217,325	0.17
USD 2,125,000	Barclays Plc FRN 15/2/2023	2,143,154	0.11
USD 2,200,000	Barclays Plc 2.875% 8/6/2020	2,185,240	0.12
GBP 2,166,905	Compartment Driver UK Four FRN 25/3/2025	2,881,951	0.15
GBP 117,666	First Flexible No 7 Plc FRN 15/9/2033	155,602	0.01
USD 3,625,000	HSBC Holdings Plc FRN 13/3/2023	3,595,636	0.19
USD 3,830,000	Lanark Master Issuer Plc 'Series 2019-1X 1A1' FRN 22/12/2069	3,834,133	0.20
GBP 5,484,947	Oat Hill No 1 Plc FRN 25/2/2046	7,277,456	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 (%)
英国(続き)			
USD 2,650,000	Royal Bank of Scotland Group Plc 3.875% 12/9/2023	2,629,438	0.14
USD 2,235,000	Santander UK Group Holdings Plc FRN 5/1/2024	2,158,867	0.12
USD 475,000	Santander UK Group Holdings Plc 3.571% 10/1/2023	468,903	0.03
USD 4,426,000	Santander UK Plc '144A' 5% 7/11/2023	4,464,427	0.24
USD 7,370,000	Sky Ltd '144A' 2.625% 16/9/2019	7,353,950	0.39
EUR 1,358,850	Turbo Finance 7 Plc FRN 20/6/2023	1,547,892	0.08
GBP 351,600	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.542% 30/3/2021	493,113	0.03
GBP 1,080,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28/3/2024	1,583,696	0.08
		48,325,415	2.58
米国			
USD 3,000,000	Abbott Laboratories 2.9% 30/11/2021	2,999,350	0.16
USD 5,619,000	AbbVie Inc 3.75% 14/11/2023	5,664,183	0.30
USD 4,036,840	Adams Mill CLO Ltd 'Series 2014- 1A A2R' '144A' FRN 15/7/2026	4,027,702	0.22
USD 550,000	Aetna Inc 2.2% 15/3/2019	549,957	0.03
USD 950,000	AIG Global Funding '144A' 1.95% 18/10/2019	945,154	0.05
USD 855,000	Air Lease Corp 2.625% 1/7/2022	823,808	0.04
USD 1,565,000	Allergan Finance LLC 3.25% 1/10/2022	1,546,018	0.08
USD 2,815,000	Alliant Energy Finance LLC '144A' 3.75% 15/6/2023	2,838,259	0.15
USD 6,209,137	Ally Auto Receivables Trust 2018-3 'Series 2018-3 A2' 2.72% 17/5/2021	6,209,471	0.33
USD 4,500,000	ALM V Ltd 'Series 2012-5A A1R3' '144A' FRN 18/10/2027	4,478,470	0.24
USD 2,525,000	ALM XII Ltd 'Series 2015-12A A1R2' '144A' FRN 16/4/2027	2,515,094	0.13
USD 8,000,000	ALM XVII Ltd 'Series 2015-17A A1AR' '144A' FRN 15/1/2028	7,951,903	0.43
USD 985,000	Altria Group Inc 3.49% 14/2/2022	991,740	0.05
USD 863,290	American Airlines 2013-2 Class B Pass Through Trust '144A' 5.6% 15/7/2020	874,771	0.05
USD 3,405,000	American Electric Power Co Inc 2.15% 13/11/2020	3,362,289	0.18
USD 1,556,000	American Electric Power Co Inc 2.95% 15/12/2022	1,539,723	0.08
USD 1,610,000	American Electric Power Co Inc 3.65% 1/12/2021	1,629,514	0.09
USD 580,000	American Express Co 2.2% 30/10/2020	572,630	0.03
USD 3,315,000	American Express Co 2.5% 1/8/2022	3,250,996	0.17
USD 8,380,000	American Express Credit Account Master Trust 'Series 2017-4 A' 1.64% 15/12/2021	8,367,402	0.45
USD 370,000	American Tower Corp 3.5% 31/1/2023	370,334	0.02
USD 2,528,196	Americold 2010 LLC 'Series 2010- ARTA A1' '144A' 3.847% 14/1/2029	2,549,413	0.14
USD 609,987	Americredit Automobile Receivables Trust 2014-4 'Series 2014-4 C' 2.47% 9/11/2020	609,818	0.03
USD 2,071,886	Americredit Automobile Receivables Trust 2016-3 'Series 2016-3 A3' 1.46% 10/5/2021	2,066,793	0.11
USD 757,215	Americredit Automobile Receivables Trust 2017-1 'Series 2017-1 A3' 1.87% 18/8/2021	754,343	0.04
USD 1,740,000	Americredit Automobile Receivables Trust 2017-2 'Series 2017-2 A3' 1.98% 20/12/2021	1,733,097	0.09
USD 4,600,000	Americredit Automobile Receivables Trust 2018-1 'Series 2018-1 A3' 3.07% 19/12/2022	4,615,316	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 3,400,000	AMMC CLO XIII Ltd 'Series 2013-13A A1LR' '144A' FRN 24/7/2029	3,398,485	0.18
USD 1,855,000	Amphenol Corp 2.2% 1/4/2020	1,873,387	0.10
USD 1,150,000	Analog Devices Inc 2.5% 5/12/2021	1,126,869	0.06
USD 335,000	Analog Devices Inc 2.85% 12/3/2020	335,563	0.02
USD 1,995,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 3.5% 1/12/2022	1,987,623	0.11
USD 1,435,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 6.25% 15/10/2022	1,478,409	0.08
USD 1,110,000	Anthem Inc 3.125% 15/5/2022	1,108,999	0.06
USD 1,729,000	Apache Corp 3.25% 15/4/2022	1,715,073	0.09
USD 460,000	Apache Corp 3.625% 1/2/2021	463,253	0.02
USD 202,226	Apidos CLO XVI 'Series 2013-16A A1R' '144A' FRN 19/1/2025	202,276	0.01
USD 2,580,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2016-FL1 Ltd 'Series 2016-FL1A A' '144A' FRN 15/9/2026	2,602,518	0.14
USD 7,690,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2017-FL1 Ltd 'Series 2017-FL1 A' '144A' FRN 15/4/2027	7,705,417	0.41
USD 3,006,312	ARI Fleet Lease Trust 2017-A 'Series 2017-A A2' '144A' '1.91% 15/4/2026	2,991,214	0.16
USD 5,245,000	ARI Fleet Lease Trust 2017-A 'Series 2017-A A3' '144A' '2.28% 15/4/2026	5,185,968	0.28
USD 3,585,000	AT&T Inc 3.6% 17/2/2023	3,615,367	0.19
USD 2,325,000	AT&T Inc 3.8% 15/3/2022	2,363,872	0.13
USD 15,000,000	Aventura Mall Trust 2013-AVM 'Series 2013-AVM A' '144A' FRN 5/12/2032	15,173,148	0.81
USD 3,405,000	Aviation Capital Group LLC '144A' 2.875% 20/1/2022	3,319,127	0.18
USD 480,000	AXA Equitable Holdings Inc 3.9% 20/4/2023	482,353	0.03
USD 991,763	B2R Mortgage Trust 2015-1 'Series 2015-1 A1' '144A' 2.524% 15/5/2048	984,091	0.05
USD 3,206,515	B2R Mortgage Trust 2015-2 'Series 2015-2 A' '144A' 3.336% 15/11/2048	3,195,952	0.17
USD 2,685,000	Baker Hughes a GE Co LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 2.773% 15/12/2022	2,643,325	0.14
USD 7,425,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 'Series 2016-UB10 A2' 2.723% 15/7/2049	7,389,875	0.39
USD 35,776	Banc of America Mortgage 2003-J Trust 'Series 2003-J 2A1' FRN 25/11/2033	35,982	0.00
USD 3,555,000	Bank of America Corp FRN 21/7/2021	3,519,219	0.19
USD 975,000	Bank of America Corp FRN 23/1/2022	968,141	0.05
USD 3,410,000	Bank of America Corp FRN 24/4/2023	3,372,468	0.18
USD 5,365,000	Bank of America Corp 2.503% 21/10/2022	5,249,957	0.28
USD 6,535,000	Bank of America Corp 3.3% 11/1/2023	6,567,826	0.35
USD 1,800,000	Bank of America Corp 5.49% 15/3/2019	1,801,872	0.10
USD 405,000	Bank of America NA FRN 25/1/2023	407,835	0.02
USD 6,055,000	BAT Capital Corp 2.764% 15/8/2022	5,889,008	0.31
USD 2,020,000	Bayer US Finance LLC '144A' 2.375% 8/10/2019	2,011,045	0.11
USD 2,025,000	BB&T Corp 3.2% 3/9/2021	2,040,198	0.11
USD 5,200	Bear Stearns ALT-A Trust 2004-13 'Series 2004-13 A1' FRN 25/11/2034	5,191	0.00
USD 9,575,000	Becton Dickinson and Co FRN 29/12/2020*	9,547,498	0.51

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 2,040,000	Becton Dickinson and Co 2.404% 5/6/2020	2,020,006	0.11
USD 940,000	Berkshire Hathaway Energy Co 2.375% 15/1/2021	933,028	0.05
USD 955,000	BP Capital Markets America Inc 3.79% 6/2/2024	981,374	0.05
USD 2,410,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 2.375% 15/1/2020	2,393,675	0.13
USD 564,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3% 15/1/2022	552,585	0.03
USD 6,820,000	BSPRT 2018-FL3 Issuer Ltd 'Series 2018-FL3 A' '144A' FRN 15/3/2028	6,785,395	0.36
USD 3,724,912	BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND 'Series 2018-IND A' '144A' FRN 15/11/2035	3,724,430	0.20
USD 3,659,000	Caesars Palace Las Vegas Trust 2017-VICI 'Series 2017-VICI A' '144A' 3.531% 15/10/2034	3,703,951	0.20
USD 4,035,000	Capital One Bank USA NA 2.3% 5/6/2019	4,031,372	0.22
USD 1,485,000	Capital One Financial Corp 2.4% 30/10/2020	1,468,099	0.08
USD 955,000	Capital One Financial Corp 3.05% 9/3/2022	951,577	0.05
USD 1,410,000	Capital One NA 1.85% 13/9/2019	1,401,761	0.07
USD 1,750,000	Catamaran CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A AR' '144A' FRN 22/4/2027	1,737,759	0.09
USD 930,000	Caterpillar Financial Services Corp 3.15% 7/9/2021	936,100	0.05
USD 1,095,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust 2016-HEAT 'Series 2016- HEAT A' '144A' 3.357% 10/4/2029	1,093,204	0.06
USD 8,580,000	Cedar Funding VI CLO Ltd 'Series 2016-6A AR' '144A' FRN 20/10/2028	8,540,574	0.46
USD 1,820,000	CenterPoint Energy Inc 2.5% 1/9/2022	1,755,162	0.09
USD 1,500,000	CenterPoint Energy Inc 3.6% 1/11/2021	1,512,237	0.08
USD 3,150,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC 'Series 2017-BIOC A' '144A' FRN 15/7/2032	3,148,433	0.17
USD 3,568,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.464% 23/7/2022	3,662,710	0.20
USD 3,803,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.5% 1/2/2024	3,892,103	0.21
USD 5,065,466	Chesapeake Funding II LLC 'Series 2017-2A A2' '144A' FRN 15/5/2029	5,060,801	0.27
USD 2,025,322	Chesapeake Funding II LLC 'Series 2017-3A A2' '144A' FRN 15/8/2029	2,024,329	0.11
USD 250,194	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-HYB8 'Series 2005-HYB8 2A1' FRN 20/12/2035	219,102	0.01
USD 7,350,000	CIFC Funding 2015-II Ltd 'Series 2015-2A AR' '144A' FRN 15/4/2027	7,302,290	0.39
USD 3,750,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P 'Series 2013- 375P A' '144A' 3.251% 10/5/2035	3,771,148	0.20
USD 4,293,282	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC11 'Series 2013- GC11 A3' 2.815% 10/4/2046	4,265,257	0.23
USD 7,044,988	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 'Series 2014- GC19 AAB' 3.552% 10/3/2047	7,161,653	0.38
USD 115,000	Citigroup Inc FRN 24/1/2023	114,692	0.01
USD 3,365,000	Citigroup Inc FRN 24/7/2023	3,316,944	0.18
USD 2,000,000	Citigroup Inc 2.65% 26/10/2020	1,988,444	0.11
USD 850,000	Citigroup Inc 2.75% 25/4/2022	840,331	0.04
USD 1,615,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.25% 2/3/2020	1,603,284	0.09
USD 6,640,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.25% 30/10/2020	6,547,129	0.35

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 5,806,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.5% 14/3/2019	5,806,216	0.31
USD 4,776,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.55% 13/5/2021	4,722,083	0.25
USD 1,515,000	Citizens Bank NA/Providence RI 3.25% 14/2/2022	1,518,297	0.08
USD 6,510,000	CLNS Trust 2017-IKPR ' Series 2017-IKPR A ' ' 144A ' FRN 11/6/2032	6,486,494	0.35
USD 2,579,168	CNH Equipment Trust 2016-B ' Series 2016-B A3 ' 1.63% 15/8/2021	2,565,390	0.14
USD 1,485,000	Comcast Corp 3.7% 15/4/2024	1,516,914	0.08
USD 2,873,906	COMM 2005-C6 Mortgage Trust ' Series 2005-C6 F ' ' 144A ' FRN 10/6/2044	2,914,292	0.16
USD 4,896,963	COMM 2013-CCRE7 Mortgage Trust ' Series 2013-CR7 ASB ' 2.739% 10/3/2046	4,874,809	0.26
USD 800,150	COMM 2013-GAM ' Series 2013-GAM A1 ' ' 144A ' 1.705% 10/2/2028	788,590	0.04
USD 1,281,385	COMM 2013-LC6 Mortgage Trust ' Series 2013-LC6 ASB ' 2.478% 10/1/2046	1,268,196	0.07
USD 758,308	COMM 2013-SFS Mortgage Trust ' Series 2013-SFS A1 ' ' 144A ' 1.873% 12/4/2035	740,591	0.04
USD 5,238,000	COMM 2014-TWC Mortgage Trust ' Series 2014-TWC A ' ' 144A ' FRN 13/2/2032	5,243,429	0.28
USD 7,410,000	COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust ' Series 2014-UBS3 ASB ' 3.367% 10/6/2047	7,492,655	0.40
USD 2,770,000	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust ' Series 2014-UBS5 ASB ' 3.548% 10/9/2047	2,813,924	0.15
USD 5,500,000	COMM 2015-CCRE22 Mortgage Trust ' Series 2015-CR22 A2 ' 2.856% 10/3/2048	5,494,823	0.29
USD 10,714,442	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust ' Series 2015-CR23 XA ' FRN 10/5/2048	405,762	0.02
USD 2,655,000	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust ' Series 2015-CR24 ASB ' 3.445% 10/8/2048	2,688,294	0.14
USD 10,533,118	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust ' Series 2015-LC21 A2 ' 2.976% 10/7/2048	10,518,786	0.56
USD 4,100,000	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust ' Series 2015-LC21 ASB ' 3.421% 10/7/2048	4,153,590	0.22
USD 3,935,000	Conagra Brands Inc FRN 22/10/2020	3,919,566	0.21
USD 5,075,000	Concho Resources Inc 4.375% 15/1/2025	5,141,889	0.27
USD 258	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	268	0.00
USD 4,351,000	Continental Resources Inc/OK 4.5% 15/4/2023	4,441,090	0.24
USD 8,149,087	Core Industrial Trust 2015-CALW ' Series 2015-CALW A ' ' 144A ' 3.04% 10/2/2034	8,167,683	0.44
USD 6,401,604	Core Industrial Trust 2015-TEXW ' Series 2015-TEXW A ' ' 144A ' 3.077% 10/2/2034	6,415,688	0.34
USD 3,585,000	Cox Communications Inc ' 144A ' 3.15% 15/8/2024	3,499,614	0.19
USD 1,775,000	Cox Communications Inc ' 144A ' 3.25% 15/12/2022	1,763,582	0.09
USD 1,359,654	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2016-2 ' Series 2016-2A A ' ' 144A ' 2.42% 15/11/2023	1,359,172	0.07
USD 5,027,486	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2016-3 ' Series 2016-3A A ' ' 144A ' 2.15% 15/4/2024	5,015,620	0.27
USD 5,150,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2017-1 ' Series 2017-1A A ' ' 144A ' 2.56% 15/10/2025	5,140,589	0.27
USD 8,160,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-1 ' Series 2018-1A A ' ' 144A ' 3.01% 16/2/2027	8,130,844	0.43

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 9,890,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-2 'Series 2018-2A A' '144A' 3.47% 17/5/2027	9,929,051	0.53
USD 4,760,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-3 'Series 2018-3A A' '144A' 3.55% 15/8/2027	4,798,487	0.26
USD 1,375,000	Crown Castle International Corp 3.2% 1/9/2024	1,336,570	0.07
USD 870,000	Crown Castle International Corp 4.875% 15/4/2022	905,379	0.05
USD 2,215,000	CSX Corp 3.7% 30/10/2020	2,237,259	0.12
USD 8,595,000	CVS Health Corp 3.7% 9/3/2023	8,648,179	0.46
USD 3,615,000	Daimler Finance North America LLC '144A' 1.5% 5/7/2019	3,598,568	0.19
USD 1,540,000	Daimler Finance North America LLC '144A' 2.7% 3/8/2020	1,531,017	0.08
USD 465,000	Dell International LLC / EMC Corp '144A' 4.42% 15/6/2021	473,422	0.03
USD 7,060,000	Dell International LLC / EMC Corp '144A' 5.45% 15/6/2023	7,413,172	0.40
USD 442,104	Delta Air Lines 2012-1 Class B Pass Through Trust '144A' 6.875% 7/5/2019	445,491	0.02
USD 1,575,000	Delta Air Lines Inc 2.6% 4/12/2020	1,556,396	0.08
USD 2,115,000	Delta Air Lines Inc 2.875% 13/3/2020	2,108,794	0.11
USD 2,870,000	Devon Energy Corp 3.25% 15/5/2022	2,862,790	0.15
USD 1,000,000	Discover Bank 3.35% 6/2/2023	989,441	0.05
USD 5,000,000	Discover Card Execution Note Trust 'Series 2014-A4 A4' 2.12% 15/12/2021	4,991,686	0.27
USD 2,800,000	Discovery Communications LLC 3.3% 15/5/2022	2,780,141	0.15
USD 1,265,000	Discovery Communications LLC 4.375% 15/6/2021	1,293,062	0.07
USD 830,000	Dominion Energy Inc 2.579% 1/7/2020	822,212	0.04
USD 1,315,000	Dow Chemical Co/The 4.25% 15/11/2020	1,339,499	0.07
USD 1,270,000	Drive Auto Receivables Trust 'Series 2018-4 A3' 3.04% 15/11/2021	1,269,296	0.07
USD 1,560,000	DTE Energy Co 3.7% 1/8/2023	1,568,087	0.08
USD 2,835,000	Duke Energy Corp 3.95% 15/10/2023	2,907,353	0.16
USD 1,435,000	Emera US Finance LP 2.15% 15/6/2019	1,431,603	0.08
USD 2,005,000	Enbridge Energy Partners LP 5.2% 15/3/2020	2,049,670	0.11
USD 1,250,000	Energy Transfer Operating LP 3.6% 1/2/2023	1,246,037	0.07
USD 7,620,000	Energy Transfer Operating LP 4.15% 1/10/2020	7,706,366	0.41
USD 435,000	Energy Transfer Operating LP 4.5% 15/4/2024	448,374	0.02
USD 3,386,341	Enterprise Fleet Financing LLC 'Series 2016-2 A2' '144A' 1.74% 22/2/2022	3,375,806	0.18
USD 3,840,000	Enterprise Fleet Financing LLC 'Series 2016-2 A3' '144A' 2.04% 22/2/2022	3,805,913	0.20
USD 953,757	Enterprise Fleet Financing LLC 'Series 2017-1 A2' '144A' 2.13% 20/7/2022	949,597	0.05
USD 8,757,777	Enterprise Fleet Financing LLC 'Series 2018-1 A2' '144A' 2.87% 20/10/2023	8,752,089	0.47
USD 1,890,000	Enterprise Products Operating LLC 3.35% 15/3/2023	1,895,857	0.10
USD 2,090,000	EOG Resources Inc 2.45% 1/4/2020	2,078,015	0.11
USD 2,910,000	Exantas Capital Corp 2018-RS06 Ltd 'Series 2018-RS06 A' '144A' FRN 15/6/2035	2,891,902	0.15
USD 2,125,000	Exelon Corp 2.45% 15/4/2021	2,084,265	0.11
USD 1,800,000	Exelon Generation Co LLC 5.2% 1/10/2019	1,820,962	0.10

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 85,253	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2014-C02 1M1 ' FRN 25/5/2024	85,285	0.00
USD 2,359,250	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2017-C02 2M1 ' FRN 25/9/2029	2,367,355	0.13
USD 3,519,071	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2017-C04 2M1 ' FRN 25/11/2029	3,522,562	0.19
USD 2,284,110	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2017-C07 1M1 ' FRN 25/5/2030	2,282,738	0.12
USD 1,909,762	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2017-C07 2M1 ' FRN 25/5/2030	1,909,299	0.10
USD 1,155	Fannie Mae Pool ' 255316 ' 5% 1/7/2019	1,177	0.00
USD 73,680	Fannie Mae Pool ' AB4997 ' 3% 1/4/2027	73,952	0.00
USD 4,915	Fannie Mae Pool ' AD0454 ' 5% 1/11/2021	5,009	0.00
USD 29,921	Fannie Mae Pool ' AE0812 ' 5% 1/7/2025	30,492	0.00
USD 1,809,007	Fannie Mae Pool ' AL4364 ' FRN 1/9/2042	1,832,716	0.10
USD 86,373	Fannie Mae Pool ' AL7139 ' 3% 1/7/2030	86,400	0.00
USD 59,363	Fannie Mae Pool ' AL7227 ' 3% 1/8/2030	59,382	0.00
USD 737,581	Fannie Mae Pool ' AL9376 ' 3% 1/8/2031	737,694	0.04
USD 69,495	Fannie Mae Pool ' AL9378 ' 3% 1/9/2031	69,517	0.00
USD 421,072	Fannie Mae Pool ' AL9899 ' 3% 1/3/2032	421,203	0.02
USD 32,953	Fannie Mae Pool ' AS5622 ' 3% 1/8/2030	32,963	0.00
USD 111,956	Fannie Mae Pool ' AS5728 ' 3% 1/9/2030	112,024	0.01
USD 1,040,696	Fannie Mae Pool ' AS5794 ' 3% 1/9/2030	1,041,014	0.06
USD 104,173	Fannie Mae Pool ' AS8604 ' 3% 1/1/2032	104,205	0.01
USD 82,699	Fannie Mae Pool ' AU0967 ' 3% 1/8/2028	82,826	0.00
USD 3,428,602	Fannie Mae Pool ' AX0000 ' FRN 1/9/2044	3,455,025	0.18
USD 720,138	Fannie Mae Pool ' AX5552 ' 3% 1/10/2031	721,113	0.04
USD 392,958	Fannie Mae Pool ' AY4218 ' 3% 1/5/2030	393,079	0.02
USD 972,909	Fannie Mae Pool ' AY6268 ' 3% 1/3/2030	973,211	0.05
USD 130,397	Fannie Mae Pool ' AZ4080 ' 3% 1/12/2031	130,422	0.01
USD 722,866	Fannie Mae Pool ' AZ5005 ' 3% 1/12/2030	723,087	0.04
USD 111,302	Fannie Mae Pool ' AZ5798 ' 3% 1/9/2030	111,337	0.01
USD 40,504	Fannie Mae Pool ' BA0776 ' 3% 1/9/2030	40,510	0.00
USD 33,341	Fannie Mae Pool ' BA2882 ' 3% 1/11/2030	33,351	0.00
USD 759,062	Fannie Mae Pool ' BA5803 ' 3% 1/12/2030	759,250	0.04
USD 679,623	Fannie Mae Pool ' BC0853 ' 3% 1/4/2031	679,833	0.04
USD 121,459	Fannie Mae Pool ' BC1707 ' 3% 1/1/2031	121,496	0.01
USD 46,438	Fannie Mae Pool ' BC1774 ' 3% 1/1/2031	46,453	0.00
USD 103,740	Fannie Mae Pool ' BC4017 ' 3% 1/3/2031	103,772	0.01
USD 106,630	Fannie Mae Pool ' BC4263 ' 3% 1/5/2031	106,663	0.01
USD 80,788	Fannie Mae Pool ' BC7657 ' 3% 1/4/2031	80,812	0.00
USD 32,498	Fannie Mae Pool ' BD1996 ' 3% 1/8/2031	32,508	0.00
USD 93,726	Fannie Mae Pool ' BD4404 ' 3% 1/7/2031	93,715	0.01
USD 720,858	Fannie Mae Pool ' BD6154 ' 3% 1/11/2031	721,037	0.04
USD 731,541	Fannie Mae Pool ' BE3155 ' 3% 1/1/2032	731,484	0.04
USD 863,610	Fannie Mae Pool ' BE6942 ' 3% 1/2/2032	863,853	0.05
USD 58,387	Fannie Mae Pool ' BH2512 ' 3% 1/7/2032	58,405	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 796,831	Fannie Mae Pool 'BH4308' 3% 1/6/2032	797,080	0.04
USD 33,723	Fannie Mae Pool 'BH5232' 3% 1/7/2032	33,734	0.00
USD 831,264	Fannie Mae Pool 'BH5623' 3% 1/6/2032	831,497	0.04
USD 470,474	Fannie Mae Pool 'BH6399' 3% 1/11/2032	470,418	0.03
USD 775,493	Fannie Mae Pool 'BH6518' 3% 1/9/2032	775,685	0.04
USD 29,077	Fannie Mae Pool 'BJ2995' 3% 1/1/2033	29,095	0.00
USD 140,598	Fannie Mae Pool 'BJ3883' 3% 1/1/2033	140,581	0.01
USD 128,315	Fannie Mae Pool 'BJ4268' 3% 1/12/2032	128,300	0.01
USD 36,593	Fannie Mae Pool 'BJ4734' 3% 1/12/2032	36,588	0.00
USD 68,654	Fannie Mae Pool 'BJ5289' 3% 1/2/2033	68,645	0.00
USD 72,691	Fannie Mae Pool 'BK7893' 3% 1/10/2033	72,682	0.00
USD 419,913	Fannie Mae Pool 'BM3947' 3% 1/1/2033	420,045	0.02
USD 963,467	Fannie Mae Pool 'CA0780' 3% 1/11/2032	964,396	0.05
USD 491,175	Fannie Mae Pool 'CA1095' 3% 1/2/2033	491,116	0.03
USD 38,279	Fannie Mae Pool 'MA0909' 3% 1/11/2021	38,275	0.00
USD 734,930	Fannie Mae Pool 'MA2561' 3% 1/3/2031	735,155	0.04
USD 131,561	Fannie Mae Pool 'MA2684' 3% 1/7/2031	131,602	0.01
USD 45,500	Fannie Mae Pool 'MA3090' 3% 1/8/2032	45,514	0.00
USD 3,552,469	Fannie Mae-Aces 'Series 2013-M5 X2' FRN 25/1/2022	102,795	0.01
USD 227,468,631	Fannie Mae-Aces 'Series 2014- M13 X2' FRN 25/8/2024	1,435,464	0.08
USD 990,000	Fifth Third Bancorp 2.6% 15/6/2022	970,001	0.05
USD 1,330,000	FirstEnergy Corp 2.85% 15/7/2022	1,302,483	0.07
USD 1,895,000	Fiserv Inc 3.8% 1/10/2023	1,904,902	0.10
USD 8,500,000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A 'Series 2016-3 A2' FRN 15/7/2021	8,512,198	0.45
USD 9,590,000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A 'Series 2016-3 A1' 1.55% 15/7/2021	9,546,986	0.51
USD 3,000,000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A 'Series 2016-5 A1' 1.95% 15/11/2021	2,980,987	0.16
USD 1,015,000	Ford Motor Credit Co LLC 1.897% 12/8/2019	1,009,777	0.05
USD 4,500,000	Ford Motor Credit Co LLC 2.262% 28/3/2019	4,498,029	0.24
USD 5,515,000	Ford Motor Credit Co LLC 2.597% 4/11/2019	5,488,884	0.29
USD 3,500,000	Ford Motor Credit Co LLC 3.157% 4/8/2020	3,463,013	0.19
USD 3,235,000	Ford Motor Credit Co LLC 3.336% 18/3/2021	3,174,972	0.17
USD 408,000	Ford Motor Credit Co LLC 3.339% 28/3/2022	391,834	0.02
USD 1,517,000	Ford Motor Credit Co LLC 3.813% 12/10/2021	1,499,730	0.08
USD 2,510,000	Ford Motor Credit Co LLC 4.14% 15/2/2023	2,421,039	0.13
USD 1,895,000	Ford Motor Credit Co LLC 5.085% 7/1/2021	1,927,753	0.10
USD 7,343,531	Freddie Mac Gold Pool 'G15602' 2.5% 1/11/2027	7,255,314	0.39
USD 108,215,776	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'Series K040 X1' FRN 25/9/2024	3,675,473	0.20
USD 3,346,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'Series KJ05 A2' 2.158% 25/10/2021	3,307,136	0.18
USD 2,890,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'Series KJ18 A2' 3.065% 25/8/2022	2,903,944	0.16
USD 1,699,771	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'Series KP03 A2' 1.78% 25/7/2019	1,691,770	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 13,522,399	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'Series KW01 X1' FRN 25/1/2026	718,552	0.04
USD 7,198,333	Freddie Mac Non Gold Pool '849692' FRN 1/5/2045	7,210,417	0.39
USD 3,574,209	Freddie Mac REMICS 'Series 4459 BN' 3% 15/8/2043	3,561,017	0.19
USD 4,326,342	Freddie Mac REMICS 'Series 4748 HC' 3% 15/1/2044	4,349,781	0.23
USD 3,330,868	Freddie Mac REMICS 'Series 4286 MP' 4% 15/12/2043	3,447,118	0.18
USD 138,212	Freddie Mac REMICS 'Series 3817 MA' 4.5% 15/10/2037	140,888	0.01
USD 289,821	Freddie Mac REMICS 'Series 3986 M' 4.5% 15/9/2041	302,314	0.02
USD 224,751	Freddie Mac REMICS 'Series 3959 MA' 4.5% 15/11/2041	236,309	0.01
USD 5,989,642	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 'Series 2017-DNA2 M1' FRN 25/10/2029	6,028,392	0.32
USD 4,662,971	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 'Series 2017-HQA3 M1' FRN 25/4/2030	4,657,246	0.25
USD 635,000	General Motors Financial Co Inc 2.4% 9/5/2019	634,516	0.03
USD 3,470,000	General Motors Financial Co Inc 3.2% 6/7/2021	3,433,258	0.18
USD 2,295,000	General Motors Financial Co Inc 3.25% 5/1/2023	2,244,243	0.12
USD 2,435,000	General Motors Financial Co Inc 3.7% 24/11/2020	2,447,306	0.13
USD 1,535,000	General Motors Financial Co Inc 4.15% 19/6/2023	1,537,076	0.08
USD 3,190,000	General Motors Financial Co Inc 4.2% 1/3/2021	3,227,212	0.17
USD 1,610,000	General Motors Financial Co Inc 4.2% 6/11/2021	1,629,968	0.09
USD 1,764,000	Gilead Sciences Inc 2.5% 1/9/2023	1,708,504	0.09
USD 380,000	Goldman Sachs Group Inc/The 2.6% 23/4/2020	378,354	0.02
USD 6,620,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3% 26/4/2022	6,570,363	0.35
USD 4,471,458	Gosforth Funding 2018-1 plc 'Series 2018-1A A1' '144A' FRN 25/8/2060	4,455,159	0.24
USD 8,681,122	Government National Mortgage Association 'Series 2012-120 IO' FRN 16/2/2053	417,136	0.02
USD 4,821,011	Government National Mortgage Association 'Series 2018-36 AM' 3% 20/7/2045	4,815,153	0.26
USD 12,350,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust 'Series 2014-GRCE A' '144A' 3.369% 10/6/2028	12,441,843	0.67
USD 2,130,000	Great Wolf Trust 2017-WOLF 'Series 2017-WOLF A' '144A' FRN 15/9/2034	2,126,439	0.11
USD 4,530,000	Greystone Commercial Real Estate Notes 2017-FL1 Ltd 'Series 2017-FL1A A' '144A' FRN 15/3/2027	4,519,082	0.24
USD 3,375,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K 'Series 2017-500K A' '144A' FRN 15/7/2032	3,369,219	0.18
USD 5,211,339	GS Mortgage Securities Trust 2012-GCJ7 'Series 2012-GCJ7 A4' 3.377% 10/5/2045	5,246,411	0.28
USD 3,222,272	GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16 'Series 2013-GC16 AAB' 3.813% 10/11/2046	3,282,530	0.18
USD 3,495,242	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC18 'Series 2014-GC18 A4' 4.074% 10/1/2047	3,631,532	0.19
USD 4,290,000	Halcyon Loan Advisors Funding 2015-2 Ltd 'Series 2015-2A AR' '144A' FRN 25/7/2027	4,281,128	0.23
USD 1,940,000	Harley-Davidson Financial Services Inc '144A' 2.15% 26/2/2020	1,921,974	0.10
USD 1,293,000	Hartford Financial Services Group Inc/The 5.125% 15/4/2022	1,363,012	0.07
USD 3,350,000	Hewlett Packard Enterprise Co 3.6% 15/10/2020	3,373,442	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 4,731,000	Holmes Master Issuer Plc 'Series 2018-2A A2' '144A' FRN 15/10/2054	4,723,208	0.25
USD 2,475,000	Huntington National Bank/The 2.375% 10/3/2020	2,461,901	0.13
USD 3,260,000	Huntington National Bank/The 2.875% 20/8/2020	3,254,563	0.17
USD 1,290,000	Huntington National Bank/The 3.125% 1/4/2022	1,290,312	0.07
USD 1,710,000	Hyundai Capital America '144A' 1.75% 27/9/2019	1,695,123	0.09
USD 220,000	Hyundai Capital America '144A' 2.5% 18/3/2019	219,958	0.01
USD 1,575,000	Hyundai Capital America '144A' 2.55% 3/4/2020	1,559,589	0.08
USD 1,170,000	Hyundai Floorplan Master Owner Trust Series 2016-1 ' Series 2016-1A A2' '144A' 1.81% 15/3/2021	1,169,498	0.06
USD 3,151,000	International Lease Finance Corp 4.625% 15/4/2021	3,206,266	0.17
USD 4,190,000	International Lease Finance Corp 5.875% 1/4/2019	4,197,308	0.22
USD 1,455,000	Interpublic Group of Cos Inc/The 3.5% 1/10/2020	1,463,270	0.08
USD 500,000	Interpublic Group of Cos Inc/The 3.75% 1/10/2021	505,446	0.03
USD 900,000	ITC Holdings Corp 2.7% 15/11/2022	872,365	0.05
USD 3,780,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018- BCON 'Series 2018-BCON A' '144A' 3.735% 5/1/2031	3,866,203	0.21
USD 6,610,000	John Deere Owner Trust 2017-B 'Series 2017-B A3' 1.82% 15/10/2021	6,557,555	0.35
USD 5,000,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2012- CIBX 'Series 2012-CBX A4' 3.483% 15/6/2045	5,054,294	0.27
USD 3,907,108	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2013- C16 'Series 2013-C16 ASB' 3.674% 15/12/2046	3,966,848	0.21
USD 6,023,319	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2013- LC11 'Series 2013-LC11 ASB' 2.554% 15/4/2046	5,976,686	0.32
USD 4,862,221	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C20 'Series 2014-C20 A2' 2.872% 15/7/2047	4,856,110	0.26
USD 12,520,086	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016- JP4 'Series 2016-JP4 XA' FRN 15/12/2049	478,079	0.03
USD 4,704,776	JP Morgan Mortgage Trust 2016-2 'Series 2016-2 A1' ' 144A' FRN 25/6/2046	4,684,774	0.25
USD 5,123,615	JP Morgan Mortgage Trust 2017-1 'Series 2017-1 A4' ' 144A' FRN 25/1/2047	5,143,971	0.27
USD 13,156,223	JP Morgan Mortgage Trust 2017-3 'Series 2017-3 1A6' ' 144A' FRN 25/8/2047	12,945,600	0.69
USD 7,999,667	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17 ' Series 2013-C17 ASB' 3.705% 15/1/2047	8,152,738	0.44
USD 3,830,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23 ' Series 2014-C23 ASB' 3.657% 15/9/2047	3,905,932	0.21
USD 1,055,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C26 ' Series 2014-C26 ASB' 3.288% 15/1/2048	1,064,972	0.06
USD 3,380,000	JPMorgan Chase & Co FRN 18/6/2022	3,382,684	0.18
USD 6,115,000	JPMorgan Chase & Co FRN 25/4/2023	6,044,434	0.32
USD 2,305,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/4/2024	2,319,413	0.12
USD 3,700,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/7/2024	3,755,533	0.20
USD 1,100,000	JPMorgan Chase & Co 2.972% 15/1/2023	1,094,101	0.06
USD 1,410,000	JPMorgan Chase Bank NA FRN 1/2/2021	1,404,298	0.08
USD 7,100,000	JPMorgan Chase Bank NA FRN 26/4/2021	7,101,271	0.38
USD 2,355,000	Keurig Dr Pepper Inc '144A' 4.057% 25/5/2023	2,384,075	0.13
USD 3,000,000	KeyBank NA/Cleveland OH 2.25% 16/3/2020	2,979,856	0.16

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 1,030,000	Kinder Morgan Energy Partners LP 4.15% 1/2/2024	1,052,380	0.06
USD 1,500,000	Kinder Morgan Inc/DE 3.15% 15/1/2023	1,487,012	0.08
USD 2,715,000	Kinder Morgan Inc/DE '144A' 5% 15/2/2021	2,797,963	0.15
USD 5,320,000	Lam Research Corp 2.8% 15/6/2021	5,286,456	0.28
USD 6,790,000	Lendmark Funding Trust 2018-1 'Series 2018-1A A' '144A' 3.81% 21/12/2026	6,845,986	0.37
USD 2,432,974	LFRF '2015-1' '144A' 4% 30/10/2027	2,422,411	0.13
USD 1,385,000	Madison Avenue Trust 2013-650M 'Series 2013-650M A' '144A' 3.843% 12/10/2032	1,399,161	0.07
USD 1,624,000	Marriott International Inc/MD 3% 1/3/2019	1,624,000	0.09
USD 7,042,000	Mercedes-Benz Master Owner Trust 2016-B 'Series 2016-BA A' '144A' FRN 17/5/2021	7,053,785	0.38
USD 9,820,000	Mercedes-Benz Master Owner Trust 2017-B 'Series 2017-BA A' '144A' FRN 16/5/2022	9,838,211	0.53
USD 4,595,000	Mercedes-Benz Master Owner Trust 2018-BA 'Series 2018-BA A' '144A' FRN 15/5/2023	4,591,764	0.25
USD 2,565,000	Micron Technology Inc 4.64% 6/2/2024	2,582,911	0.14
USD 4,690,771	Mill City Mortgage Loan Trust 2016-1 'Series 2016-1 A1' '144A' FRN 25/4/2057	4,621,552	0.25
USD 2,000,000	Moody's Corp 2.625% 15/1/2023	1,942,540	0.10
USD 325,000	Moody's Corp 2.75% 15/12/2021	320,861	0.02
USD 3,740,000	Morgan Stanley FRN 24/4/2024	3,774,495	0.20
USD 3,710,000	Morgan Stanley 2.375% 23/7/2019	3,703,882	0.20
USD 3,000,000	Morgan Stanley 2.625% 17/11/2021	2,957,499	0.16
USD 4,580,000	Morgan Stanley 2.75% 19/5/2022	4,517,356	0.24
USD 1,741,258	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C10 'Series 2013-C10 ASB' FRN 15/7/2046	1,777,087	0.09
USD 3,480,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C13 'Series 2013-C13 A4' 4.039% 15/11/2046	3,625,227	0.19
USD 4,184,499	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C9 'Series 2013-C9 AAB' 2.657% 15/5/2046	4,166,141	0.22
USD 6,585,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C19 'Series 2014-C19 A2' 3.101% 15/12/2047	6,586,935	0.35
USD 3,740,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18 'Series 2014-C18 ASB' 3.621% 15/10/2047	3,802,243	0.20
USD 5,385,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 'Series 2015-C25 ASB' 3.383% 15/10/2048	5,456,906	0.29
USD 1,715,996	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-TOP27 'Series 2007-T27 AJ' FRN 11/6/2042	1,807,711	0.10
USD 4,940,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-MP 'Series 2014-MP A' '144A' 3.469% 11/8/2033	4,999,569	0.27
USD 1,395,000	MPLX LP 3.375% 15/3/2023	1,392,874	0.07
USD 1,071,541	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-AA A2B' '144A' FRN 15/2/2029	1,084,546	0.06
USD 1,730,538	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-AA A2A' '144A' 2.74% 15/2/2029	1,720,483	0.09
USD 120,665	Navient Private Education Loan Trust 2014-CT 'Series 2014-CTA A' '144A' FRN 16/9/2024	120,881	0.01
USD 6,946,657	Navient Private Education Loan Trust 2018-B 'Series 2018-BA A1' '144A' FRN 15/12/2059	6,947,298	0.37
USD 897,000	Navient Student Loan Trust 2018-EA 'Series 2018-EA A2' '144A' 4% 15/12/2059	921,511	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 2,795,000	NetApp Inc 2% 27/9/2019	2,780,828	0.15
USD 12,870,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 Ltd ' Series 2017-26A A ' ' 144A ' FRN 18/10/2030	12,792,164	0.68
USD 949,885	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3 ' Series 2016-3A A1B ' ' 144A ' FRN 25/9/2056	939,976	0.05
USD 8,200,000	Newfield Exploration Co 5.75% 30/1/2022	8,651,000	0.46
USD 4,110,630	NewResidential Mortgage Loan Trust 2018-1 ' Series 2018-1A A1A ' ' 144A ' FRN 25/12/2057	4,184,313	0.22
USD 8,200,000	Nissan Master Owner Trust Receivables ' Series 2017-B A ' FRN 18/4/2022	8,214,205	0.44
USD 7,610,000	Nissan Master Owner Trust Receivables ' Series 2016-A A2 ' 1.54% 15/6/2021	7,586,142	0.41
USD 2,925,000	Nissan Motor Acceptance Corp ' 144A ' 2.125% 3/3/2020	2,893,685	0.15
USD 111,212	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	115,346	0.01
USD 7,525,000	OneMain Direct Auto Receivables Trust 2018-1 ' Series 2018-1A A ' ' 144A ' 3.43% 16/12/2024	7,567,659	0.40
USD 1,415,000	Onemain Financial Issuance Trust 2018-1 ' Series 2018-1A A ' ' 144A ' 3.3% 14/3/2029	1,416,602	0.08
USD 2,520,000	Oracle Corp 3.4% 8/7/2024	2,554,725	0.14
USD 1,450,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ' 144A ' 2.7% 14/3/2023	1,391,432	0.07
USD 4,635,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ' 144A ' 4.125% 1/8/2023	4,680,480	0.25
USD 1,075,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ' 144A ' 4.25% 17/1/2023	1,092,085	0.06
USD 9,405,000	PFS Financing Corp ' Series 2017- C A ' ' 144A ' FRN 15/10/2021	9,401,462	0.50
USD 1,490,000	PFS Financing Corp ' Series 2016- BA A ' ' 144A ' 1.87% 15/10/2021	1,480,774	0.08
USD 3,630,000	PFS Financing Corp ' Series 2018- B A ' ' 144A ' 2.89% 15/2/2023	3,608,685	0.19
USD 9,430,000	PFS Financing Corp ' Series 2018- F A ' ' 144A ' 3.52% 16/10/2023	9,536,222	0.51
USD 2,399,000	Pioneer Natural Resources Co 3.45% 15/1/2021	2,403,551	0.13
USD 1,445,000	Pricoa Global Funding I ' 144A ' 2.45% 21/9/2022	1,413,539	0.08
USD 3,080,000	QUALCOMM Inc 2.9% 20/5/2024	2,985,940	0.16
USD 827,543	RAIT 2017-FL7 Trust ' Series 2017- FL7 A ' ' 144A ' FRN 15/6/2037	828,331	0.04
USD 2,400,000	Ryder System Inc 2.65% 2/3/2020	2,391,193	0.13
USD 885,000	Ryder System Inc 2.875% 1/9/2020	882,938	0.05
USD 1,640,000	Ryder System Inc 3.75% 9/6/2023	1,652,399	0.09
USD 2,810,000	Santander Drive Auto Receivables Trust 2018-1 ' Series 2018-1 A3 ' 2.32% 16/8/2021	2,806,193	0.15
USD 1,340,000	Santander Drive Auto Receivables Trust 2018-3 ' Series 2018-3 A3 ' 3.03% 15/2/2022	1,341,366	0.07
USD 550,000	Santander Holdings USA Inc 3.4% 18/1/2023	540,243	0.03
USD 1,535,000	Santander Holdings USA Inc 3.7% 28/3/2022	1,531,972	0.08
USD 5,290,000	Santander Holdings USA Inc 4.45% 3/12/2021	5,407,648	0.29
USD 2,755,000	Sempra Energy FRN 15/1/2021	2,725,165	0.15
USD 2,755,000	Sempra Energy 1.625% 7/10/2019	2,731,097	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	3,745,435	Sequoia Mortgage Trust 2017-CH1 'Series 2017-CH1 A2' '144A' FRN 25/8/2047	3,720,222	0.20
USD	1,966,002	Sequoia Mortgage Trust 2017-CH2 'Series 2017-CH2 A10' '144A' FRN 25/12/2047	1,983,165	0.11
USD	1,600,000	SLM Private Education Loan Trust 2011-B 'Series 2011-B A3' '144A' FRN 16/6/2042	1,625,120	0.09
USD	453,389	SLM Private Education Loan Trust 2011-C 'Series 2011-C A2B' '144A' 4.54% 17/10/2044	455,961	0.02
USD	160,015	SLM Private Education Loan Trust 2012-A 'Series 2012-A A2' '144A' 3.83% 17/1/2045	160,177	0.01
USD	411,209	SLM Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-A A2B' '144A' FRN 15/1/2026	411,893	0.02
USD	295,414	SLM Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-A A2A' '144A' 2.59% 15/1/2026	295,148	0.02
USD	1,425,060	SLM Student Loan Trust 2013-4 'Series 2013-4 A' FRN 25/6/2043	1,426,271	0.08
USD	2,429,031	SMB Private Education Loan Trust 2015-C 'Series 2015-C A2A' '144A' 2.75% 15/7/2027	2,419,354	0.13
USD	1,800,452	SMB Private Education Loan Trust 2016-A 'Series 2016-A A2A' '144A' 2.7% 15/5/2031	1,784,404	0.10
USD	2,095,550	SMB Private Education Loan Trust 2016-B 'Series 2016-B A2A' '144A' 2.43% 17/2/2032	2,054,766	0.11
USD	42,684	SMB Private Education Loan Trust 2017-A 'Series 2017-A A1' '144A' FRN 17/6/2024	42,684	0.00
USD	5,260,000	SMB Private Education Loan Trust 2017-A 'Series 2017-A A2B' '144A' FRN 15/9/2034	5,270,802	0.28
USD	545,700	SoFi Professional Loan Program 2014-B LLC 'Series 2014-B A2' '144A' 2.55% 27/8/2029	543,198	0.03
USD	781,408	SoFi Professional Loan Program 2015-A LLC 'Series 2015-A A1' '144A' FRN 25/3/2033	785,103	0.04
USD	3,693,048	SoFi Professional Loan Program 2015-d LLC 'Series 2015-D A2' '144A' 2.72% 27/10/2036	3,657,255	0.20
USD	1,487,673	Sofi Professional Loan Program 2016-A LLC 'Series 2016-A A2' '144A' 2.76% 26/12/2036	1,469,468	0.08
USD	1,103,774	SoFi Professional Loan Program 2016-C LLC 'Series 2016-C A2B' '144A' 2.36% 27/12/2032	1,084,351	0.06
USD	996,605	SoFi Professional Loan Program 2016-D LLC 'Series 2016-D A2B' '144A' 2.34% 25/4/2033	976,018	0.05
USD	6,390,000	Sofi Professional Loan Program 2016-E LLC 'Series 2016-E A2B' '144A' 2.49% 25/1/2036	6,301,328	0.34
USD	1,465,936	Sofi Professional Loan Program 2017-C LLC 'Series 2017-C A2A' '144A' 1.75% 25/7/2040	1,455,649	0.08
USD	21,000,000	SoFi Professional Loan Program 2017-D LLC 'Series 2017-D A2FX' '144A' 2.65% 25/9/2040	20,667,244	1.10
USD	4,819,952	Sofi Professional Loan Program 2018-B Trust 'Series 2018-B A1FX' '144A' 2.64% 25/8/2047	4,807,516	0.26
USD	670,000	Sound Point Clo XII Ltd 'Series 2016-2A A' '144A' FRN 20/10/2028	670,556	0.04
USD	86,764	Soundview Home Loan Trust 2003-2 'Series 2003-2 A2' FRN 25/11/2033	88,004	0.00
USD	4,570,000	South Carolina Public Service Authority 2.388% 1/12/2023	4,375,181	0.23
USD	2,700,000	South Carolina Public Service Authority 3.722% 1/12/2023	2,724,016	0.15
USD	620,000	Spectra Energy Partners LP 4.75% 15/3/2024	648,925	0.03
USD	455,620	Springleaf Funding Trust 2015-A 'Series 2015-AA A' '144A' 3.16% 15/11/2024	455,654	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 2,625,000	Springleaf Funding Trust 2017-A 'Series 2017-AA A' '144A' 2.68% 15/7/2030	2,593,072	0.14
USD 635,938	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 3.36% 20/9/2021	632,186	0.03
USD 2,975,000	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 4.738% 20/3/2025	2,986,156	0.16
USD 1,375,000	Stryker Corp 2% 8/3/2019	1,374,815	0.07
USD 960,000	Sunoco Logistics Partners Operations LP 5.5% 15/2/2020	977,646	0.05
USD 390,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.875% 15/1/2023	396,228	0.02
USD 5,560,000	SunTrust Bank/Atlanta GA FRN 26/10/2021	5,600,631	0.30
USD 3,730,000	SunTrust Banks Inc 2.7% 27/1/2022	3,696,145	0.20
USD 2,515,000	Texas Eastern Transmission LP '144A' 2.8% 15/10/2022	2,442,786	0.13
USD 695,000	Time Warner Cable LLC 8.25% 1/4/2019	698,121	0.04
USD 420,000	Total System Services Inc 3.75% 1/6/2023	419,216	0.02
USD 1,350,000	Total System Services Inc 4% 1/6/2023	1,359,076	0.07
USD 2,830,135	Towd Point Mortgage Trust 2016-3 'Series 2016-3 A1' '144A' FRN 25/4/2056	2,781,733	0.15
USD 3,828,000	Towd Point Mortgage Trust 2016-4 'Series 2016-4 A1' '144A' FRN 25/7/2056	3,745,622	0.20
USD 3,810,000	Toyota Auto Receivables 2016-B Owner Trust 'Series 2016-B A4' 1.52% 16/8/2021	3,779,831	0.20
USD 1,080,000	Union Pacific Corp 2.95% 1/3/2022	1,080,214	0.06
USD 1,359,000	Union Pacific Corp 2.95% 15/1/2023	1,352,651	0.07
USD 1,951,000	Union Pacific Corp 3.5% 8/6/2023	1,979,307	0.11
USD 59,000,000	United States Treasury Note/Bond 1% 30/11/2019*	58,329,336	3.12
USD 20,000,000	United States Treasury Note/Bond 1.25% 31/1/2020*	19,768,359	1.06
USD 75,000,000	United States Treasury Note/Bond 1.25% 29/2/2020	74,052,246	3.96
USD 40,000,000	United States Treasury Note/Bond 1.375% 29/2/2020	39,541,406	2.11
USD 35,000,000	United States Treasury Note/Bond 1.5% 30/11/2019*	34,732,715	1.86
USD 19,000,000	United States Treasury Note/Bond 1.75% 30/11/2019*	18,889,414	1.01
USD 13,855,000	United States Treasury Note/Bond 2.5% 15/1/2022	13,848,506	0.74
USD 21,570,000	United States Treasury Note/Bond 2.5% 15/2/2022	21,565,787	1.15
USD 21,900,000	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/11/2021	22,101,035	1.18
USD 5,190,000	United Technologies Corp 3.35% 16/8/2021	5,240,077	0.28
USD 6,415,000	United Technologies Corp 3.65% 16/8/2023	6,501,411	0.35
USD 1,354,289	US Airways 2012-1 Class B Pass Through Trust 8% 1/10/2019	1,383,906	0.07
USD 2,560,000	US Bank NA/Cincinnati OH 2.125% 28/10/2019	2,550,782	0.14
USD 1,282,000	Verizon Communications Inc 5.15% 15/9/2023	1,396,179	0.07
USD 1,240,000	Virginia Electric & Power Co 5% 30/6/2019*	1,248,734	0.07
USD 4,288,586	Voya CLO 2014-3 Ltd 'Series 2014-3A A1R' '144A' FRN 25/7/2026	4,284,000	0.23
USD 1,030,000	Waldorf Astoria Boca Raton Trust 2016-BOCA 'Series 2016-BOCA A' '144A' FRN 15/6/2029	1,031,497	0.06
USD 2,520,000	Walgreen Co 3.1% 15/9/2022	2,514,710	0.13
USD 1,220,000	Warner Media LLC 4.7% 15/1/2021	1,256,991	0.07
USD 2,825,000	Wells Fargo & Co 2.5% 4/3/2021	2,798,214	0.15
USD 1,195,000	Wells Fargo & Co 3.069% 24/1/2023	1,188,583	0.06

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 2,215,000	Wells Fargo & Co 3.75% 24/1/2024	2,254,377	0.12
USD 4,065,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014-LC16 'Series 2014-LC16 ASB' 3.477% 15/8/2050	4,114,439	0.22
USD 500,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC22 'Series 2015-LC22 ASB' 3.571% 15/9/2058	509,696	0.03
USD 4,345,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012-C7 'Series 2012-C7 AFL' '144A' FRN 15/6/2045	4,431,097	0.24
USD 4,060,370	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012-C8 'Series 2012-C8 AFL' '144A' FRN 15/8/2045	4,116,545	0.22
USD 5,550,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 'Series 2014-C21 ASB' 3.393% 15/8/2047	5,589,434	0.30
USD 81,683	Wheels SPV 2 LLC 'Series 2016- 1A A2' '144A' 1.59% 20/5/2025	81,561	0.00
USD 665,946	Wheels SPV 2 LLC 'Series 2017- 1A A2' '144A' 1.88% 20/4/2026	662,547	0.04
USD 2,400,000	Williams Cos Inc/The 3.7% 15/1/2023	2,404,678	0.13
USD 1,765,000	Williams Cos Inc/The 4% 15/11/2021	1,795,238	0.10
USD 2,275,000	Williams Cos Inc/The 4.55% 24/6/2024	2,357,848	0.13
USD 1,670,000	Willis North America Inc 3.6% 15/5/2024	1,657,015	0.09
USD 2,000,000	WRKCo Inc 3.75% 15/3/2025	1,967,072	0.11
USD 3,205,000	Xerox Corp 3.5% 20/8/2020	3,176,956	0.17
USD 2,345,000	Xilinx Inc 2.125% 15/3/2019	2,344,498	0.13
USD 719,000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.5% 29/4/2022	726,345	0.04
		1,568,772,788	83.85
債券合計		1,806,494,232	96.56
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		1,821,998,008	97.39

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 350,000	Structured Asset Receivables Trust Series '2003-2' 0.649% 31/12/2049	-	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		1,821,998,008	97.39
その他の純資産		48,931,019	2.61
純資産合計(米ドル)		1,870,929,027	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

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 2019年2月28日現在

契約数	通貨	契約 / 摘要	満期日	未実現評価益 / (損) (米ドル)
58	EUR	Euro Bund	2019年3月	(75,268)
3,832	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2019年6月	(688,793)
1	USD	US Ultra Bond (CBT)	2019年6月	(2,008)
(24)	USD	US Long Bond (CBT)	2019年6月	11,079
(83)	USD	US Ultra 10 Year Note	2019年6月	60,952
(200)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2019年6月	116,105
(1,936)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2019年6月	624,582
合計				46,649

未決済先渡為替予約 2019年2月28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)
USD	9,377,832	EUR	8,000,000	Nomura	1/3/2019	270,972
USD	14,389,222	EUR	12,405,000	BNP Paribas	1/3/2019	267,897
USD	1,054,542	AUD	1,448,000	HSBC Bank Plc	5/3/2019	24,195
USD	9,027,157	EUR	7,834,000	UBS	5/3/2019	108,492
USD	12,055,632	GBP	9,177,000	State Street	5/3/2019	(150,426)
AUD	3,320,000	CAD	3,185,694	Goldman Sachs	20/3/2019	(54,207)
AUD	13,420,000	NZD	14,304,913	BNP Paribas	20/3/2019	(196,153)
CAD	3,176,683	AUD	3,320,000	Goldman Sachs	20/3/2019	47,370
CAD	3,321,179	NZD	3,700,000	ANZ	20/3/2019	(1,282)
CAD	12,771,715	USD	9,600,000	Royal Bank of Canada	20/3/2019	90,824
CAD	6,389,405	USD	4,800,000	Bank of America	20/3/2019	48,104
CHF	2,630,000	NOK	22,985,176	Goldman Sachs	20/3/2019	(46,365)
EUR	2,060,000	NOK	20,274,275	Royal Bank of Canada	20/3/2019	(24,675)
EUR	4,130,000	NZD	6,831,759	Royal Bank of Canada	20/3/2019	52,553
EUR	2,070,000	SEK	21,277,447	Royal Bank of Canada	20/3/2019	47,488
JPY	537,498,240	USD	4,800,000	Citibank	20/3/2019	37,861
NOK	22,328,997	CHF	2,630,000	Morgan Stanley	20/3/2019	(30,436)
NOK	19,905,424	EUR	2,060,000	HSBC Bank Plc	20/3/2019	(18,496)
NZD	7,188,062	AUD	6,820,000	ANZ	20/3/2019	44,046
NZD	6,944,236	AUD	6,600,000	Citibank	20/3/2019	34,481
NZD	3,700,000	CAD	3,373,142	Bank of America	20/3/2019	(38,146)
SEK	21,249,691	EUR	2,070,000	Goldman Sachs	20/3/2019	(50,504)
USD	9,600,000	CAD	12,716,131	Bank of America	20/3/2019	(48,649)
USD	4,800,000	CAD	6,366,566	Toronto Dominion	20/3/2019	(30,775)
USD	4,800,000	JPY	529,923,024	State Street	20/3/2019	30,321
USD	19,480	MXN	373,710	Citibank	21/3/2019	71
USD	1,347,985	MXN	25,856,290	Toronto Dominion	21/3/2019	5,135
USD	9,799,874	EUR	8,300,000	Nomura	15/4/2019	316,848
未実現純評価益						736,544

未決済先渡為替予約 2019年2月28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	119,818,606	USD	135,523,568	BNY Mellon	14/3/2019	990,173
USD	3,543,106	EUR	3,128,932	BNY Mellon	14/3/2019	(21,804)
未実現純評価益						968,369
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	252,819	USD	186,301	BNY Mellon	14/3/2019	955
未実現純評価益						955
未実現純評価益合計						1,705,868

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 2019年2月28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	10,446	3,160
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	(6,204)	(3,523)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはHess 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	BNP Paribas	20/6/2024	(12,455)	44,681
CDS	USD (3,000,000)	ファンドはAnadarko Petroleum 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	BNP Paribas	20/6/2024	12,586	(37,556)
CDS	USD (147,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.V3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	20/12/2022	(755)	9,920
CDS	USD (8,820,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.V3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	20/12/2022	(100,867)	595,227
CDS	USD (10,040,100)	ファンドはCDX.NA.HY.29.V3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	Deutsche Bank	20/12/2022	80,738	677,567
CDS	USD (23,618,000)	ファンドはCDX.NA.HY.31.V3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	20/12/2023	215,261	1,511,894
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	(4,858)	(3,160)
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	20/9/2020	11,559	3,523
CDS	USD (704,335)	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	JP Morgan	20/12/2023	3,669	115,162
CDS	USD (704,000)	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	JP Morgan	20/12/2023	5,425	115,107
CDS	USD (637,000)	ファンドはFord Motor Credit Co LLC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	20/12/2023	3,735	77,444
CDS	EUR 993,000	ファンドはBritish American Tobacco 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	JP Morgan	20/12/2023	(8,467)	(8,931)
CDS	USD (1,059,000)	ファンドはAltria Group Inc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	20/12/2023	3,991	13,872
CDS	USD (885,000)	ファンドはFord Motor Credit Co LLC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	20/12/2023	3,574	107,595
CDS	EUR 1,489,000	ファンドはBritish American Tobacco 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	JP Morgan	20/12/2023	(12,696)	(13,393)
CDS	USD (1,274,000)	ファンドはFord Motor Credit Co LLC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	20/12/2023	(1,907)	154,889
CDS	USD (1,590,000)	ファンドはAltria Group Inc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	20/12/2023	5,980	20,827

スワップ 2019年2月28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 (885,000)	ファンドはFord Motor Credit Co LLC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	20/12/2023	(499)	107,596
CDS	USD (887,000)	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	JP Morgan	20/12/2023	(739)	145,029
CDS	USD (887,000)	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	JP Morgan	20/12/2023	4,329	145,029
CDS	USD (1,060,000)	ファンドはAltria Group Inc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	20/12/2023	1,228	13,885
CDS	USD (888,000)	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	JP Morgan	20/12/2023	(740)	145,192
CDS	USD (1,593,000)	ファンドはFord Motor Credit Co LLC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	20/12/2023	2,234	193,672
CDS	USD (1,408,000)	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	JP Morgan	20/12/2023	9,008	230,215
CDS	EUR 993,000	ファンドはBritish American Tobacco 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	JP Morgan	20/12/2023	(3,118)	(6,701)
CDS	USD (885,000)	ファンドはFord Motor Credit Co LLC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	20/12/2023	(499)	107,596
CDS	USD 19,007,100	ファンドはCDX.NA.HY.29.V3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	20/12/2022	73,683	(1,282,714)
CDS	USD 34,449,000	ファンドはCDX.NA.IG.31.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	20/12/2023	(54,114)	(621,178)
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	823,020	823,020
IRS	USD 102,080,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.576%の固定金利を支払う	BNP Paribas	15/3/2021	(9,373)	(11,066)
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	90,929	90,929
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	(85,491)	(85,491)
合計					<u>1,058,613</u>	<u>3,379,318</u>

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。

事後通告証券契約 2019年2月28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 ' 2 3/19 ' 2% TBA	5,044,330	0.27
USD 1,302,000	Fannie Mae ' 2.5 3/19 ' 2.5% TBA	1,278,153	0.07
USD 6,853,000	Fannie Mae ' 3 3/19 ' 3% TBA	6,846,977	0.36
USD 5,855,000	Fannie Mae ' 4 3/19 ' 4% TBA	6,007,779	0.32
USD 5,000,000	Fannie Mae ' 4.5 3/19 ' 4.5% TBA	5,075,781	0.27
USD 12,500,000	Freddie Mac ' 3 3/19 ' 3% TBA	12,498,430	0.67
T B A 合計		36,751,450	1.96

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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(2019年12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	1,768,048,595円
負債総額	816,692円
純資産総額(-)	1,767,231,903円
発行済数量	1,828,432,451口
1 単位当たり純資産額(/)	0.9665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た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当た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、利益処分の承認、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いません。

<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いません。

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いません。

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2019年12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(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	156	8,413,522
単位型株式投資信託	16	161,401
合計	172	8,574,923

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」(1963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」(2007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32期事業年度(自2018年1月1日 至2018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31期 (2017年12月31日現在)	第32期 (2018年12月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	19,097	23,891
立替金	11	2
前払費用	171	151
未収入金	3	11
未収委託者報酬	1,585	1,588
未収運用受託報酬	2,642	2,291
未収収益	2 1,384	1,402
為替予約	0	-
その他流動資産	33	18
流動資産計	24,928	29,359
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1 946	1,484
器具備品	1 411	380
有形固定資産計	1,358	1,864
無形固定資産		
ソフトウェア	4	8
のれん	42	-
無形固定資産計	47	8
投資その他の資産		
投資有価証券	3	11
長期差入保証金	1,124	1,119
前払年金費用	588	696
長期前払費用	25	27
繰延税金資産	786	848
投資その他の資産計	2,528	2,702
固定資産計	3,934	4,575
資産合計	28,863	33,935

	第31期 (2017年12月31日現在)	第32期 (2018年12月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	119	97
未払金	2	
未払収益分配金	4	4
未払償還金	74	74
未払手数料	593	515
その他未払金	1,737	1,184
未払費用	2	
未払消費税等	150	97
未払法人税等	438	440
為替予約	-	3
前受金	79	78
前受収益	15	-
賞与引当金	1,886	1,939
役員賞与引当金	144	142
早期退職慰労引当金	9	42
流動負債計	6,500	5,661
固定負債		
退職給付引当金	55	60
資産除去債務	262	781
固定負債計	318	842
負債合計	6,818	6,503
純資産の部		
株主資本		
資本金	3,120	3,120
資本剰余金		
資本準備金	3,001	3,001
その他資本剰余金	3,846	3,846
資本剰余金合計	6,847	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	11,739	17,127
利益剰余金合計	12,076	17,464
株主資本合計	22,044	27,432
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	22,044	27,431
負債・純資産合計	28,863	33,935

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

		第31期 (自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)	第32期 (自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)
営業収益			
委託者報酬		5,202	5,639
運用受託報酬	1	8,890	8,523
その他営業収益	1	12,257	13,511
営業収益計		26,350	27,674
営業費用			
支払手数料		1,830	1,856
広告宣伝費		208	191
調査費			
調査費		380	363
委託調査費	1	4,313	4,164
調査費計		4,693	4,528
委託計算費		86	84
営業雑経費			
通信費		50	59
印刷費		62	11
諸会費		32	34
営業雑経費計		145	106
営業費用計		6,964	6,767
一般管理費			
給料			
役員報酬		353	406
給料・手当		3,960	4,213
賞与		2,232	2,359
給料計		6,546	6,979
退職給付費用		287	275
福利厚生費		892	940
事務委託費	1	2,433	2,568
交際費		69	66
寄付金		2	3
旅費交通費		243	238
租税公課		231	245
不動産賃借料		735	804
水道光熱費		65	72
固定資産減価償却費		262	315
のれん償却額		56	42
資産除去債務利息費用		3	3
諸経費		363	424
一般管理費計		12,194	12,980
営業利益		7,191	7,926

	第31期 (自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)	第32期 (自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)
営業外収益		
受取利息	0	0
有価証券売却益	0	0
雑益	0	0
営業外収益計	1	1
営業外費用		
為替差損	34	26
営業外費用計	34	26
経常利益	7,158	7,901
特別利益		
特別利益計	-	-
特別損失		
特別退職金	119	84
特別損失計	119	84
税引前当期純利益	7,039	7,817
法人税、住民税及び事業税	2,223	2,491
法人税等調整額	29	61
当期純利益	4,786	5,387

(3) 【株主資本等変動計算書】

第31期（自 2017年1月1日 至 2017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				
2017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
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
2017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

第32期（自 2018年1月1日 至 2018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				
2018年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	11,739	12,076	22,044	0	0	22,044
事業年度中の変動額											
当期純利益						5,387	5,387	5,387			5,387
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	-	-	-	-	-	5,387	5,387	5,387	0	0	5,387
2018年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	17,127	17,464	27,432	0	0	27,431

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。

(未適用の会計基準等)

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2018年3月30日）

「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2018年3月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足したときに又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年12月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の早期適用に伴う変更)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準28号 2018年2月16日。以下「税効果会計基準一部改正」）という。）が当事業年度の期末から適用できるようになったことに伴い、当事業年度から税効果会計基準一部改正を適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更するとともに、税効果会計関係注記を変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」860百万円及び「固定負債」の「繰延税金負債」74百万円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」786百万円に含めて表示しております。

(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 (2017年12月31日)	当事業年度 (2018年12月31日)
建物附属設備	1,346 百万円	1,525 百万円
器具備品	821 百万円	950 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 (2017年12月31日)	当事業年度 (2018年12月31日)
未収収益	508 百万円	554 百万円
未払金	1,713 百万円	1,168 百万円
未払費用	356 百万円	385 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 (2017年12月31日)	当事業年度 (2018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 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
その他営業収益	4,670 百万円	5,680 百万円
委託調査費	438 百万円	704 百万円
事務委託費	824 百万円	864 百万円
運用受託報酬	48 百万円	149 百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2017年1月1日 至 2017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	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。

当事業年度(自 2018年1月1日 至 2018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)	15,000	-	-	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（2017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	-

当事業年度(2018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	23,891	23,891	-
(2) 未収委託者報酬	1,588	1,588	-
(3) 未収運用受託報酬	2,291	2,291	-
(4) 未収収益	1,402	1,402	-
(5) 長期差入保証金	1,119	1,112	6
資産計	30,293	30,287	6
(1) 未払手数料	515	515	-
(2) 未払費用	1,039	1,039	-
負債計	1,554	1,554	-

(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(2017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

当事業年度（2018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	23,891	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,588	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,291	-	-	-
(4) 未収収益	1,402	-	-	-
(5) 長期差入保証金	-	1,051	56	11
合計	29,174	1,051	56	11

（有価証券関係）

前事業年度（2017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

当事業年度（2018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ないもの	その他 投資信託	11	12	0
合計		11	12	0

（退職給付関係）

前事業年度（自 2017年1月1日 至 2017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 2017年 1月 1日 至 2017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)

	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017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)

	前事業年度 (2017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)

	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017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。

	前事業年度 (2017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 2017年 1月 1日 至 2017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、71百万円であります。

当事業年度（自 2018年1月1日 至 2018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 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,832
勤務費用	269
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	11
退職給付の支払額	138
過去勤務費用の発生額	47
退職給付債務の期末残高	1,934

(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 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
年金資産の期首残高	2,621
期待運用収益	23
数理計算上の差異の発生額	113
事業主からの拠出額	303
退職給付の支払額	138
年金資産の期末残高	2,696

(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 (2018年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,874
年金資産	2,696
	821
非積立型制度の退職給付債務	60
未積立退職給付債務	761
未認識数理計算上の差異	73
未認識過去勤務費用	52
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635
退職給付引当金	60
前払年金費用	696
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635

(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 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
勤務費用	269
利息費用	7
期待運用収益	23
数理計算上の差異の費用処理額	44
過去勤務費用の処理額	8
確定給付制度に係る退職給付費用合計	200
特別退職金	84
合計	285

(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 (2018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77%、株式20%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

	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
割引率	0.6%
長期期待運用収益率	1.0%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、75百万円でありました。

(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 (2017年12月31日)	当事業年度 (2018年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	206	167
賞与引当金	537	591
資産除去債務	80	239
資産調整勘定	4	-
未払事業税	74	83
早期退職慰労引当金	2	13
退職給付引当金	17	18
有形固定資産	4	3
その他	44	96
繰延税金資産合計	973	1,213
繰延税金負債		
退職給付引当金	180	213
資産除去債務に対応する除去費用	6	152
繰延税金負債合計	186	365
繰延税金資産の純額	786	848

(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 (2017年12月31日)	当事業年度 (2018年12月31日)
固定資産 - 繰延税金資産	786	848

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 (2017年12月31日)	当事業年度 (2018年12月31日)
法定実効税率	30.9 %	30.9 %
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	2.1	1.0
損金不算入ののれん償却額	0.2	0.2
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.2	0.1
所得拡大促進税制による税額控除	1.8	1.9
その他	0.4	0.8
税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.0 %	31.1 %

(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約5年と見積り、割引率は0.16%~0.18%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。当事業年度において、資産の除去時点において必要とされる除去費用の見積額が、固定資産の取得時における見積額を大幅に超過することが明らかになったことから、見積もりの変更による増加額を0.16%で割り引き、資産除去債務残高が440百万円増加しております。

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 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
期首残高	258	262
有形固定資産の取得に伴う増加額	-	75
見積りの変更による増加額	-	440
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	262	781

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 (2017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	うち1年超	時価	評価損益
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。

当事業年度 (2018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	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	164	-	3	3
合計		164	-	3	3

(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 2017年1月1日 至 2017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。

当事業年度（自 2018年1月1日 至 2018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	5,639	8,523	13,511	27,674

(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
13,237	11,293	3,143	27,674

（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	5,830	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	3,458	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 2017年1月1日 至 2017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	その他未払金	67
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

当事業年度(自 2018年1月1日 至 2018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	73 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	149	未収収益	554
							受入手数料	5,680		
							委託調査費	704	未払費用	385
							事務委託費	864	その他未払金	165
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	-	その他未払金	1,002

(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 2017年1月1日 至 2017年12月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2018年1月1日 至 2018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 2017年1月1日 至 2017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	314百万米ドル	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

当事業年度 (自 2018年1月1日 至 2018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	3,458	未収収益	330
							委託調査費	37	未払費用	4
							事務委託費	8		

(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。

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 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
1株当たり純資産額	1,469,634 円 10 銭	1,828,761 円 92 銭
1株当たり当期純利益金額	456,306 円 62 銭	359,180 円 40 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 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
当期純利益 (百万円)	4,786	5,387
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)	4,786	5,387
普通株式の期中平均株式数 (株)	10,490	15,000

独立監査人の監査報告書は、当事業年度(自 2018年1月1日 至2018年12月31日)を対象としております。

【中間財務諸表】

1．中間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。)の中間財務諸表すなわち中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(1977年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(2007年内閣府令第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、中間会計期間(自2019年1月1日 至2019年6月30日)の中間財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる中間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) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

	中間会計期間末 (2019年6月30日)	
資産の部		
流動資産		
現金・預金	2	17,608
立替金		18
前払費用		174
未収入金		10
未収委託者報酬		1,616
未収運用受託報酬		1,755
未収収益		1,273
流動資産計		22,456
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1	1,361
器具備品	1	448
有形固定資産計		1,809
無形固定資産		
ソフトウェア		7
無形固定資産計		7
投資その他の資産		
投資有価証券		22
長期差入保証金		1,118
前払年金費用		748
長期前払費用		11
繰延税金資産		449
投資その他の資産計		2,351
固定資産計		4,168
資産合計		26,625

(単位：百万円)

中間会計期間末
(2019年6月30日)

負債の部	
流動負債	
預り金	101
未払金	
未払収益分配金	4
未払償還金	74
未払手数料	494
その他未払金	638
未払費用	1,152
未払消費税等	98
未払法人税等	313
為替予約	1
前受金	22
前受収益	14
賞与引当金	611
役員賞与引当金	30
早期退職慰労引当金	0
流動負債計	3,559
固定負債	
退職給付引当金	67
資産除去債務	782
固定負債計	849
負債合計	4,408
純資産の部	
株主資本	
資本金	3,120
資本剰余金	
資本準備金	3,001
その他資本剰余金	3,846
資本剰余金合計	6,847
利益剰余金	
利益準備金	336
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	11,912
利益剰余金合計	12,249
株主資本合計	22,216
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
評価・換算差額等合計	0
純資産合計	22,216
負債・純資産合計	26,625

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

	中間会計期間 (自 2019年1月1日 至 2019年6月30日)
営業収益	
委託者報酬	2,783
運用受託報酬	3,793
その他営業収益	6,446
営業収益計	13,023
営業費用	
支払手数料	830
広告宣伝費	49
調査費	
調査費	191
委託調査費	1,844
調査費計	2,036
委託計算費	39
営業雑経費	
通信費	27
印刷費	38
諸会費	20
営業雑経費計	87
営業費用計	3,043
一般管理費	
給料	
役員報酬	307
給料・手当	2,221
賞与	955
給料計	3,483
退職給付費用	161
福利厚生費	465
事務委託費	1,017
交際費	24
寄付金	0
旅費交通費	116
租税公課	142
不動産賃借料	437
水道光熱費	36
固定資産減価償却費	200
資産除去債務利息費用	0
諸経費	173
一般管理費計	6,261
営業利益	3,718

(単位：百万円)

中間会計期間
(自 2019年1月1日
至 2019年6月30日)

営業外収益	
受取利息	0
有価証券売却益	0
雑益	0
営業外収益計	0
営業外費用	
為替差損	25
固定資産除却損	0
営業外費用計	26
経常利益	3,692
税引前中間純利益	3,692
法人税、住民税及び事業税	808
法人税等調整額	398
中間純利益	2,484

(3) 中間株主資本等変動計算書

中間会計期間 (自 2019年1月1日 至 2019年6月30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				
当期首残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	17,127	17,464	27,432	0	0	27,431
当中間期変動額											
剰余金の配当						7,700	7,700	7,700			7,700
中間純利益						2,484	2,484	2,484			2,484
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)									0	0	0
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	5,215	5,215	5,215	0	0	5,214
当中間期末残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	11,912	12,249	22,216	0	0	22,216

注 記 事 項

(重要な会計方針)

項 目	中間会計期間 自 2019年1月 1日 至 2019年6月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p>
2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	<p>時価法を採用しております。</p>
3. 固定資産の減価償却方法	<p>(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5～18年、器具備品3～15年であります。</p> <p>(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。</p>
4. 引当金の計上基準	<p>(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。</p> <p>(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、旧退職制度に基づく給付額を保証しているため、中間会計期間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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

項 目	中間会計期間 自 2019年1月 1日 至 2019年6月30日
5. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	<p>(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中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(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中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(5) 早期退職慰労引当金の計上方法 早期退職慰労金の支払に備えて、早期退職慰労金支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>外貨建金銭債権債務は、中間会計期間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。</p>
6. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 消費税等の会計処理 税抜方式によっております。</p> <p>(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。</p>

(中間貸借対照表関係)

中間会計期間末 2019年6月30日	
1 有形固定資産の減価償却累計額	
建物附属設備	1,648百万円
器具備品	1,027百万円
2 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当中間会計期間末の借入未実行残高は次のとおりであります。	
当座貸越極度額	1,000百万円
借入実行残高	-
差引額	1,000百万円

(中間損益計算書関係)

中間会計期間 自 2019年1月 1日 至 2019年6月30日	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	199百万円
無形固定資産	1百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

中間会計期間
自 2019年1月 1日
至 2019年6月30日

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	前事業年度末 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計 期間末株式数
発行済株式				
普通株式	15,000	-	-	15,000
合計	15,000	-	-	15,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(1) 配当金支払額

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
2019年3月28日 株主総会決議	普通株式	7,700	513,333	2018年12月31日	2019年3月29日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

(金融商品関係)

中間会計期間
自 2019年1月 1日
至 2019年6月30日

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。

中間会計期間
自 2019年1月 1日
至 2019年6月30日

2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年6月30日(中間期の決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	17,608	17,608	-
未収委託者報酬	1,616	1,616	-
未収運用受託報酬	1,755	1,755	-
未収収益	1,273	1,273	-
投資有価証券 その他有価証券	22	22	-
長期差入保証金	1,118	1,117	1
資産計	23,395	23,393	1
未払手数料	494	494	-
未払費用	1,152	1,152	-
負債計	1,647	1,647	-
デリバティブ取引 ヘッジ会計が適用されていない もの	(1)	(1)	-
デリバティブ計	(1)	(1)	-

(注)

金融商品の時価の算定方法に関する事項

現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未収収益

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。

投資有価証券

投資有価証券は、投資信託であり、決算日の基準価格によっています。

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。

但し、上記レートがマイナスとなる場合は、割引率はゼロを使用しております。

未払手数料、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。

デリバティブ取引

デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、()で示しております。

(有価証券関係)

中間会計期間				
自 2019年1月 1日				
至 2019年6月30日				
その他有価証券				
(単位：百万円)				
	種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
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	12	12	0
貸借対照表計上額が取得原 価を超えないもの	その他 投資信託	10	11	0
合計		22	23	0

(資産除去債務関係)

中間会計期間	
自 2019年1月 1日	
至 2019年6月30日	
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	当社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5年と見積り、割引率は0.16%～0.18%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。
3. 当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減	
期首残高	781 百万円
有形固定資産の取得に伴う増加額	- 百万円
時の経過による調整額	0 百万円
中間会計期間末残高	<u>782 百万円</u>

(セグメント情報等)

中間会計期間
自 2019年1月 1日
至 2019年6月30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) 製品及びサービスに関する情報

(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	2,783	3,793	6,446	13,023

(2) 地域に関する情報

売上高

(単位：百万円)

日本	北米	その他	合計
6,263	5,398	1,361	13,023

(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中間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) 主要な顧客に関する情報

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	2,809	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	1,663	投資運用業

(デリバティブ取引関係)

中間会計期間 自 2019年1月 1日 至 2019年6月30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	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	201	-	1	1
	合計	201	-	1	1

(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。

(1株当たり情報)

中間会計期間 自 2019年1月 1日 至 2019年6月30日	
1株当たり純資産額	1,481,128円23銭
1株当たり中間純利益	165,661円62銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間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いません。	
1株当たり中間純利益の算定上の基礎 損益計算書上の中間純利益	2,484百万円
1株当たり中間純利益の算定に 用いられた普通株式に係る中間純利益	2,484百万円
期中平均株式数	15,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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) 通常の見積り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(2019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(2019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) (2019年3月末現在)	事業の内容
藍澤證券株式会社	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	
松井証券株式会社	11,945	
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は行ないません。

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・連絡等を行ないます。

(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ないます。

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

2019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 田 中 素 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2018年1月1日から2018年12月31日までの第32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2018年12月31日現在の財政状態並びに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

2020年2月12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 和田 渉

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2019年6月21日から2019年12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2019年12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。

独立監査人の中間監査報告書

2019年8月30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 田 中 素 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2019年1月1日から2019年12月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（2019年1月1日から2019年6月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ブラックロック・ジャパン株式会社の2019年6月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年1月1日から2019年6月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を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。