

【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】 2023年9月15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】 代表取締役社長 有田 浩之

【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】 坂井 瑛美

【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 W i n)

【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】

2023年9月16日から2024年3月15日まで

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

(8)【申込取扱場所】

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(9)【払込期日】

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

振替受益権に係る各購入受付日の発行価額の総額は、販売会社によって追加信託が行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

行いません。

購入不可日

ルクセンブルグの銀行の休業日、12月24日、その他投資対象ファンドの受付不可日のいずれかに該当する場合には、販売会社の営業日であっても購入は受付けません。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われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
投資対象地域による 区分	海外	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資対象資産による 区分	債券	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

・属性区分

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

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

- b. 投資対象とする投資信託証券（以下「投資対象ファンド」ということがあります。）は以下の通りです。

- ・ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラスJ投資証券(ルクセンブルグ籍証券投資法人、以下「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」といいます。)
- ・ブラックロック・グローバル・ファンズ USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスX投資証券(ルクセンブルグ籍証券投資法人、以下「BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド」といいます。)

投資対象ファンドは、委託会社の判断により、変更することがあります。

c．当ファンドはファンド・オブ・ファンズ形式で運用します。

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

d．原則として、毎月分配を行います。

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

【イメージ図】



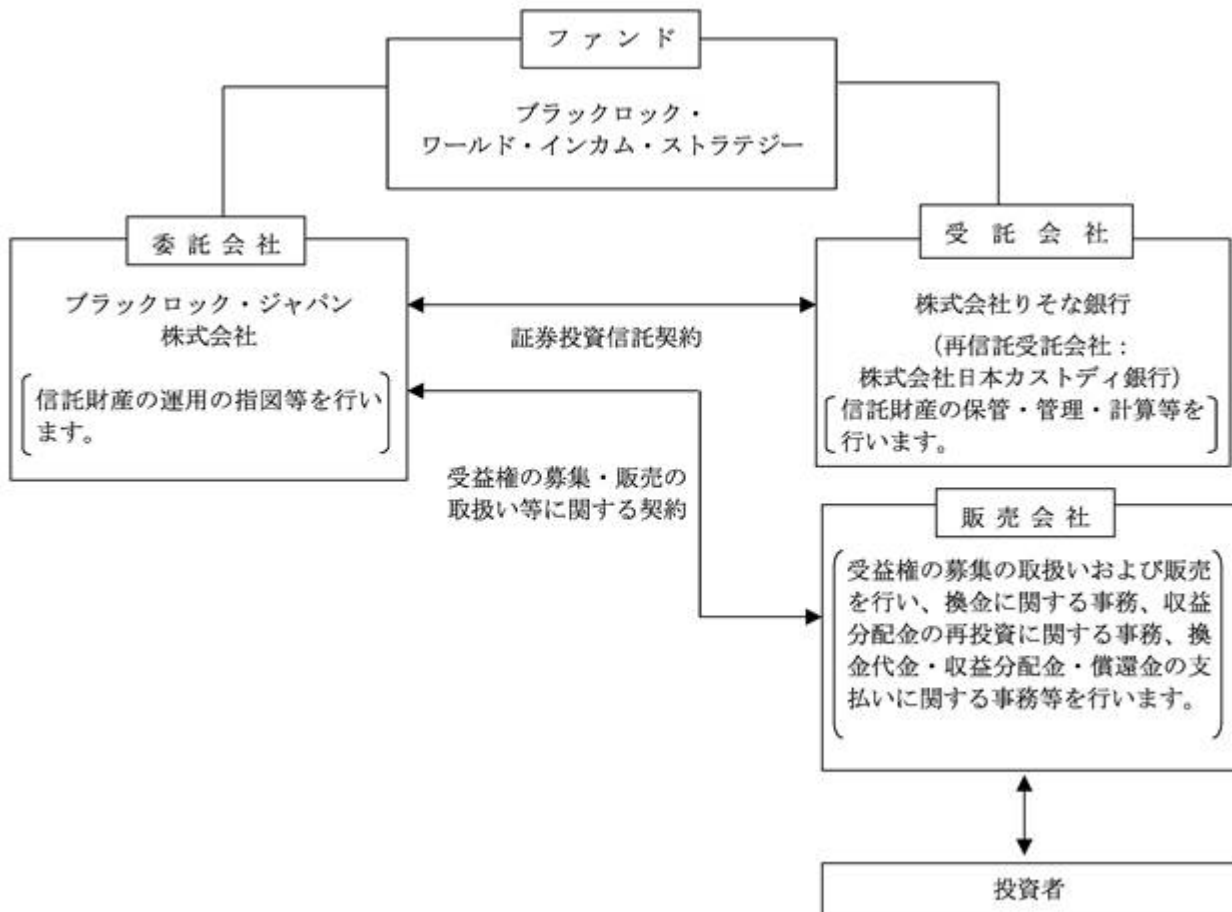
※上図はイメージであり、将来の分配金のお支払いおよび金額について示唆、保証するものではありません。

e．外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】



< 契約等の概要 >

a. 「証券投資信託契約」

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

b. 「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」

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

< ファンド・オブ・ファンズの仕組み >

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



< 委託会社の概況 >

2023年6月末現在の委託会社の概況は、以下のとおりです。

a . 資本金 3,120百万円

b . 沿革

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

c . 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

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

別に定める投資信託証券は、委託会社の判断により、変更することがあります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

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

委託会社は、自己または第三者の利益を図るために投資者の利益を害することとなる潜在的なおそれのある取引を行いまは行うことがある場合、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 フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ取得される投資信託証券）

形態	ルクセンブルグ籍（オープン・エンド型）会社型外国投資証券（米ドル建て）
投資目的および投資態度	<p>ファンドはトータル・リターンの最大化を目指します。ファンドは、少なくとも純資産の70%を世界各国の政府、政府関連機関、企業が様々な通貨建てで発行する譲渡性のある債券に投資をします。非投資適格債を含むあらゆる種別の有価証券を投資対象とし、これらを有効利用します。通貨エクスポージャーについては柔軟に運用します。</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）に決算を行います。
収益分配方針	毎月（原則として毎月末営業日）に分配を行います。
申込手数料	ありません。
管理会社	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミテッド、ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク、ブラックロック（シンガポール）リミテッド（副投資顧問会社：ブラックロック・インベストメント・マネジメント（オーストラリア）リミテッド）
保管会社	ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・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ドル・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)に決算を行います。
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
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】

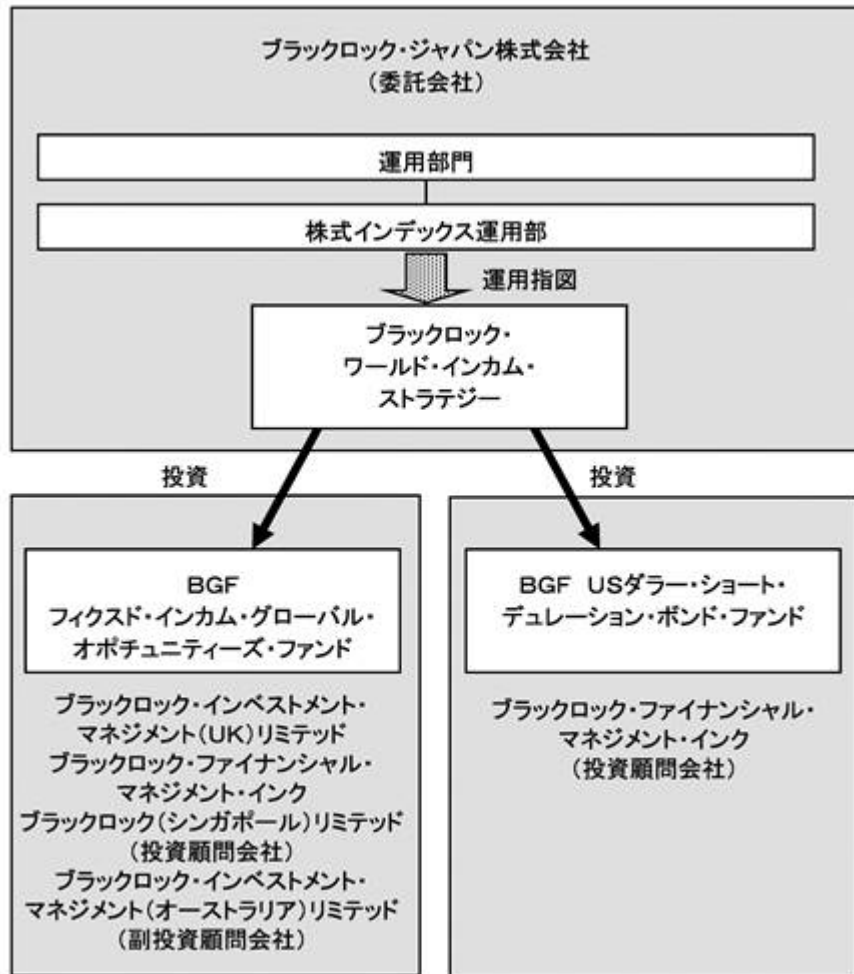
ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

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います。

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

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

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



ブラックロック・グループ

ブラックロック・グループは、運用資産残高約9.42兆ドル^{*}（約1,362兆円）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っております。

* 2023年6月末現在。(円換算レートは1ドル=144.535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。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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います。

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。

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

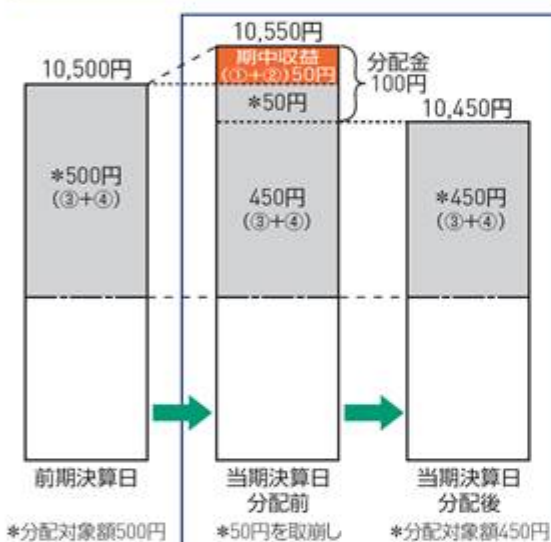
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



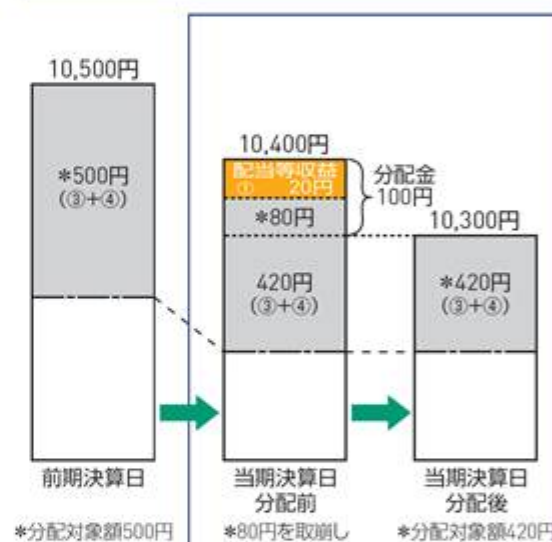
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

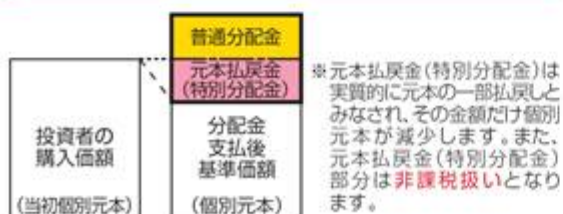


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※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率が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

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

(5) 【投資制限】

当ファンドの約款で定める投資制限です。

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

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す。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、主要投資対象ファンドの取引停止、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。

d. 流動性リスクに関する事項

当ファンドが保有する資産の市場環境等の状況により、保有有価証券の流動性が低下し、投資者からの換金請求に制約がかかる等のリスク（流動性リスク）があります。当ファンドにおいて流動性リスクが顕在化すると考えられる状況は以下の通りです。

- ・金利の急激な変動または信用リスク不安が高まる等の影響により、債券価格の変動が大きくなるまたは取引量が著しく少なくなる等、債券市場動向が不安定になった場合
- ・デリバティブ市場において価格変動が大きくなるまたは取引量が著しく少なくなる等、デリバティブ市場動向が不安定になった場合
- ・主要投資対象とするファンドの購入・換金に制限がかかった場合

金融商品取引所等における取引の停止時、決済機能の停止時または大口の換金請求については、換金請求に制限がかかる場合があります。

(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、運用担当部門から独立したリスク管理担当部門においてファンドの投資リスクおよび流動性リスクの計測・分析、投資・流動性制限のモニタリングなどを行うことにより、ファンドの投資リスク（流動性リスクを含む）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

(2018年7月～2023年6月)



※上記グラフは、過去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(TOPIX)(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・マーケット指数(配当込み、円ベース)

日本国債→NOMURA-BPI国債

先進国国債→FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

(2018年7月～2023年6月)



※上記グラフは、過去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(TOPIX)(配当込み)は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有する我が国を代表する指数です。東証株価指数(TOPIX)(配当込み)の指数値および東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

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・マーケット指数(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・マーケット指数(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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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国債を用いて行われるブラックロック・ジャパン株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額に3.30%（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われます。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われます。原則として、申告は不要です。

また、確定申告を行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。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度です。

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など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が、2024年1月1日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

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。また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。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2023年6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2023年6月末現在のものです。

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」

(1)【投資状況】

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	1,484,064,728	99.11
内 ルクセンブルグ	1,484,064,728	99.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	13,276,025	0.89
純資産総額	1,497,340,753	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	1,053,308	1,397.70	1,472,212,899	1,394.80	1,469,158,515	98.12
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	6,552	2,277.79	14,925,214	2,274.89	14,906,213	1.00

(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	99.11

(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】

2023年6月末現在、同日前1年以内における各月末および直近20特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第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

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24特定期間	第136期(2017年1月20日)	2,345,704,373	2,350,332,348	1.0137	1.0157
	第137期(2017年2月20日)	2,223,820,787	2,228,289,084	0.9954	0.9974
	第138期(2017年3月21日)	2,191,165,925	2,195,583,001	0.9921	0.9941
	第139期(2017年4月20日)	2,021,218,544	2,025,426,520	0.9607	0.9627
	第140期(2017年5月22日)	2,049,029,165	2,053,204,866	0.9814	0.9834
	第141期(2017年6月20日)	1,923,838,255	1,927,733,743	0.9877	0.9897
第25特定期間	第142期(2017年7月20日)	1,751,647,392	1,755,183,621	0.9907	0.9927
	第143期(2017年8月21日)	1,694,543,009	1,698,050,221	0.9663	0.9683
	第144期(2017年9月20日)	1,678,331,145	1,681,718,526	0.9909	0.9929
	第145期(2017年10月20日)	1,652,233,908	1,655,536,528	1.0006	1.0026
	第146期(2017年11月20日)	1,588,029,359	1,591,236,903	0.9902	0.9922
	第147期(2017年12月20日)	1,596,544,272	1,599,736,181	1.0004	1.0024
第26特定期間	第148期(2018年1月22日)	1,507,949,613	1,511,000,100	0.9887	0.9907
	第149期(2018年2月20日)	1,463,089,728	1,466,167,490	0.9507	0.9527
	第150期(2018年3月20日)	1,450,640,831	1,453,732,320	0.9385	0.9405
	第151期(2018年4月20日)	1,471,975,699	1,475,085,877	0.9466	0.9486
	第152期(2018年5月21日)	1,506,549,465	1,509,660,796	0.9684	0.9704
	第153期(2018年6月20日)	1,476,791,897	1,479,878,953	0.9568	0.9588
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
第30特定期間	第172期(2020年1月20日)	1,784,825,600	1,788,480,365	0.9767	0.9787
	第173期(2020年2月20日)	1,802,381,006	1,806,010,696	0.9931	0.9951
	第174期(2020年3月23日)	1,574,240,198	1,577,749,073	0.8973	0.8993
	第175期(2020年4月20日)	1,595,635,917	1,599,094,529	0.9227	0.9247
	第176期(2020年5月20日)	1,602,094,600	1,605,555,871	0.9257	0.9277
	第177期(2020年6月22日)	1,617,172,884	1,620,637,956	0.9334	0.9354
第31特定期間	第178期(2020年7月20日)	1,642,151,355	1,645,623,123	0.9460	0.9480
	第179期(2020年8月20日)	1,618,039,078	1,621,467,601	0.9439	0.9459
	第180期(2020年9月23日)	1,587,777,596	1,591,178,078	0.9339	0.9359
	第181期(2020年10月20日)	1,574,559,931	1,577,915,086	0.9386	0.9406
	第182期(2020年11月20日)	1,564,473,101	1,567,830,925	0.9318	0.9338
	第183期(2020年12月21日)	1,566,109,052	1,569,458,866	0.9350	0.9370

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32特定期間	第184期(2021年1月20日)	1,574,812,701	1,578,165,535	0.9394	0.9414
	第185期(2021年2月22日)	1,509,549,594	1,512,712,127	0.9546	0.9566
	第186期(2021年3月22日)	1,537,277,475	1,540,425,713	0.9766	0.9786
	第187期(2021年4月20日)	1,504,415,492	1,507,509,255	0.9725	0.9745
	第188期(2021年5月20日)	1,499,662,229	1,502,734,989	0.9761	0.9781
	第189期(2021年6月21日)	1,547,362,977	1,550,498,697	0.9869	0.9889
第33特定期間	第190期(2021年7月20日)	1,487,465,174	1,490,515,757	0.9752	0.9772
	第191期(2021年8月20日)	1,492,593,633	1,495,644,271	0.9785	0.9805
	第192期(2021年9月21日)	1,465,240,160	1,468,245,661	0.9750	0.9770
	第193期(2021年10月20日)	1,619,886,533	1,623,082,250	1.0138	1.0158
	第194期(2021年11月22日)	1,614,832,418	1,618,043,134	1.0059	1.0079
	第195期(2021年12月20日)	1,594,999,653	1,598,210,520	0.9935	0.9955
第34特定期間	第196期(2022年1月20日)	1,592,906,085	1,596,113,803	0.9932	0.9952
	第197期(2022年2月21日)	1,572,880,215	1,576,068,974	0.9865	0.9885
	第198期(2022年3月22日)	1,608,126,781	1,611,300,371	1.0134	1.0154
	第199期(2022年4月20日)	1,744,490,133	1,747,707,603	1.0844	1.0864
	第200期(2022年5月20日)	1,665,671,229	1,668,825,389	1.0562	1.0582
	第201期(2022年6月20日)	1,727,998,775	1,731,133,867	1.1024	1.1044
第35特定期間	第202期(2022年7月20日)	1,764,797,353	1,767,947,495	1.1205	1.1225
	第203期(2022年8月22日)	1,765,582,648	1,768,724,657	1.1239	1.1259
	第204期(2022年9月20日)	1,936,020,711	1,939,384,927	1.1509	1.1529
	第205期(2022年10月20日)	1,883,694,178	1,886,895,973	1.1766	1.1786
	第206期(2022年11月21日)	1,767,998,837	1,771,182,379	1.1107	1.1127
	第207期(2022年12月20日)	1,718,188,648	1,721,380,487	1.0766	1.0786
第36特定期間	第208期(2023年1月20日)	1,589,805,650	1,592,855,228	1.0426	1.0446
	第209期(2023年2月20日)	1,642,756,664	1,645,810,750	1.0758	1.0778
	第210期(2023年3月20日)	1,566,809,990	1,569,772,877	1.0576	1.0596
	第211期(2023年4月20日)	1,589,618,770	1,592,574,262	1.0757	1.0777
	第212期(2023年5月22日)	1,571,887,256	1,574,755,230	1.0962	1.0982
	第213期(2023年6月20日)	1,472,592,740	1,475,187,410	1.1351	1.1371
	2022年6月末現在	1,743,001,764		1.1101	
	2022年7月末現在	1,741,215,022		1.1035	
	2022年8月末現在	1,771,108,983		1.1285	
	2022年9月末現在	1,899,932,750		1.1437	
	2022年10月末現在	1,850,264,933		1.1652	
	2022年11月末現在	1,757,752,068		1.1042	
	2022年12月末現在	1,683,922,832		1.0572	
	2023年1月末現在	1,607,687,603		1.0563	
	2023年2月末現在	1,662,704,938		1.0881	
	2023年3月末現在	1,568,645,252		1.0649	
	2023年4月末現在	1,585,938,371		1.0724	
	2023年5月末現在	1,589,480,701		1.1084	
	2023年6月末現在	1,497,340,753		1.1540	

【分配の推移】

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第17特定期間	第94期	0.0010
	第95期	0.0010
	第96期	0.0010
	第97期	0.0010
	第98期	0.0010
	第99期	0.0010
第18特定期間	第100期	0.0010
	第101期	0.0010
	第102期	0.0010
	第103期	0.0010
	第104期	0.0010
	第105期	0.0010
第19特定期間	第106期	0.0010
	第107期	0.0010
	第108期	0.0020
	第109期	0.0020
	第110期	0.0020
第20特定期間	第111期	0.0020
	第112期	0.0020
	第113期	0.0020
	第114期	0.0020
	第115期	0.0020
	第116期	0.0020
第21特定期間	第117期	0.0020
	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22特定期間	第123期	0.0020
	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23特定期間	第129期	0.0020
	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24特定期間	第135期	0.0020
	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25特定期間	第141期	0.0020
	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26特定期間	第147期	0.0020
	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

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
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
第30特定期間	第172期	0.0020
	第173期	0.0020
	第174期	0.0020
	第175期	0.0020
	第176期	0.0020
	第177期	0.0020
第31特定期間	第178期	0.0020
	第179期	0.0020
	第180期	0.0020
	第181期	0.0020
	第182期	0.0020
	第183期	0.0020
第32特定期間	第184期	0.0020
	第185期	0.0020
	第186期	0.0020
	第187期	0.0020
	第188期	0.0020
	第189期	0.0020
第33特定期間	第190期	0.0020
	第191期	0.0020
	第192期	0.0020
	第193期	0.0020
	第194期	0.0020
	第195期	0.0020
第34特定期間	第196期	0.0020
	第197期	0.0020
	第198期	0.0020
	第199期	0.0020
	第200期	0.0020
	第201期	0.0020
第35特定期間	第202期	0.0020
	第203期	0.0020
	第204期	0.0020
	第205期	0.0020
	第206期	0.0020
	第207期	0.0020
第36特定期間	第208期	0.0020
	第209期	0.0020
	第210期	0.0020
	第211期	0.0020
	第212期	0.0020
	第213期	0.0020

【収益率の推移】

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

特定期間	計算期間	収益率(%)
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29特定期間	第165期	0.9
	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30特定期間	第171期	1.3
	第172期	1.5
	第173期	1.9
	第174期	9.4
	第175期	3.1
	第176期	0.5
第31特定期間	第177期	1.0
	第178期	1.6
	第179期	0.0
	第180期	0.8
	第181期	0.7
	第182期	0.5
第32特定期間	第183期	0.6
	第184期	0.7
	第185期	1.8
	第186期	2.5
	第187期	0.2
	第188期	0.6
第33特定期間	第189期	1.3
	第190期	1.0
	第191期	0.5
	第192期	0.2
	第193期	4.2
	第194期	0.6
第34特定期間	第195期	1.0
	第196期	0.2
	第197期	0.5
	第198期	2.9
	第199期	7.2
	第200期	2.4
第35特定期間	第201期	4.6
	第202期	1.8
	第203期	0.5
	第204期	2.6
	第205期	2.4
	第206期	5.4
第36特定期間	第207期	2.9
	第208期	3.0
	第209期	3.4
	第210期	1.5
	第211期	1.9
	第212期	2.1
	第213期	3.7

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

(4)【設定及び解約の実績】

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

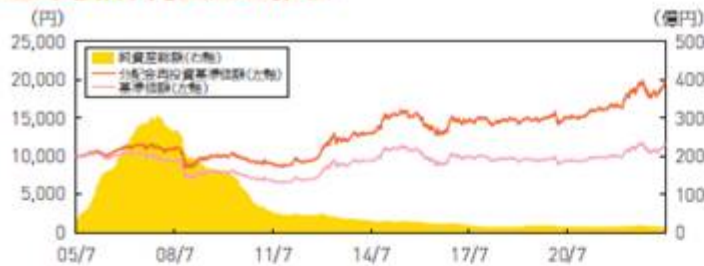
特定期間	計算期間	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第27特定期間	第154期	1,520,868	2,518,683	1,542,530,539
	第155期	2,523,420	28,829,809	1,516,224,150
	第156期	26,234,878	2,023,647	1,540,435,381
	第157期	1,583,740	31,746,269	1,510,272,852
	第158期	1,517,491	37,628,983	1,474,161,360
	第159期	198,343,463	31,588,377	1,640,916,446
第28特定期間	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
第30特定期間	第172期	1,501,915	1,166,200	1,827,382,626
	第173期	1,829,400	14,366,903	1,814,845,123
	第174期	1,408,185	61,815,586	1,754,437,722
	第175期	1,373,625	26,505,312	1,729,306,035
	第176期	1,339,736	9,784	1,730,635,987
	第177期	1,910,792	10,744	1,732,536,035
第31特定期間	第178期	3,543,598	195,529	1,735,884,104
	第179期	1,375,485	22,997,979	1,714,261,610
	第180期	1,830,669	15,851,258	1,700,241,021
	第181期	1,348,777	24,012,126	1,677,577,672
	第182期	1,399,236	64,732	1,678,912,176
	第183期	1,324,009	5,329,080	1,674,907,105
第32特定期間	第184期	1,576,791	66,540	1,676,417,356
	第185期	1,406,803	96,557,247	1,581,266,912
	第186期	3,591,011	10,738,554	1,574,119,369
	第187期	1,593,571	28,831,137	1,546,881,803
	第188期	1,371,196	11,872,937	1,536,380,062
	第189期	51,965,224	20,484,808	1,567,860,478
第33特定期間	第190期	1,117,052	43,685,772	1,525,291,758
	第191期	2,262,453	2,234,852	1,525,319,359
	第192期	1,179,634	23,748,005	1,502,750,988
	第193期	95,188,123	80,358	1,597,858,753
	第194期	20,906,110	13,406,590	1,605,358,273
	第195期	1,128,806	1,053,290	1,605,433,789
第34特定期間	第196期	1,176,927	2,751,586	1,603,859,130
	第197期	3,547,785	13,026,944	1,594,379,971
	第198期	1,063,747	8,648,372	1,586,795,346
	第199期	22,019,440	79,546	1,608,735,240
	第200期	2,296,606	33,951,527	1,577,080,319
	第201期	2,148,882	11,682,934	1,567,546,267
第35特定期間	第202期	16,909,779	9,384,665	1,575,071,381
	第203期	4,397,494	8,464,226	1,571,004,649
	第204期	113,791,038	2,687,241	1,682,108,446
	第205期	7,781,242	88,992,074	1,600,897,614
	第206期	24,060,197	33,186,402	1,591,771,409
	第207期	6,939,149	2,790,970	1,595,919,588
第36特定期間	第208期	1,731,838	72,862,200	1,524,789,226
	第209期	6,436,625	4,182,641	1,527,043,210
	第210期	5,332,058	50,931,693	1,481,443,575
	第211期	6,108,248	9,805,758	1,477,746,065
	第212期	1,505,577	45,264,261	1,433,987,381
	第213期	1,647,616	138,299,597	1,297,335,400

(参考情報)

運用実績

2023年6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		5,020円
直近1年間累計		240円
第209期	2023年2月	20円
第210期	2023年3月	20円
第211期	2023年4月	20円
第212期	2023年5月	20円
第213期	2023年6月	20円

※ 分配金は税引前、1万口当たり

主要な資産の状況

資産構成比率



※ 比率は対純資産総額。

組入上位10銘柄*(%)

	銘柄名	比率
1	UMBS 30YR TBA(REG A)	6.2
2	TREASURY NOTE 2.875 05/15/2032	4.8
3	TREASURY BOND 2.875 05/15/2052	3.0
4	FNMA 30YR UMBS SUPER	2.3
5	GNMA2 30YR TBA(REG C)	2.2
6	TREASURY NOTE 1.25 11/30/2026	2.0
7	TREASURY (CPI) NOTE 0.625 01/15/2024	1.9
8	TREASURY (CPI) NOTE 0.5 04/15/2024	1.7
9	SPAIN (KINGDOM OF) 2.55 10/31/2032	1.5
10	TREASURY NOTE 2.625 05/31/2027	1.4

債券種別構成比率*(%)

債券	比率
国債	45.5
証券化商品	16.2
新興国債	15.2
ハイ・イールド債	14.2
投資適格社債	13.6
政府系モーゲージ	12.0
地方債	1.1
現金等	1.0
その他	0.1

通貨構成比率*(%)

通貨	比率
米国・ドル	96.1
メキシコ・ペソ	1.2
インドネシア・ルピア	0.5
ブラジル・レアル	0.4
チェコ・コルナ	0.4
その他	2.1
台湾・ドル	-0.1
チリ・ペソ	-0.2
英国・ポンド	-0.5

※ 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。
 ※ 上記各構成比率については四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

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、主要投資対象ファンドの取引停止、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うものとします。換金の申込の受付は、午後3時までとなっております。ただし、受付時間は販売会社により異なる場合があります。詳細は販売会社にお問い合わせください。受付時間を過ぎての換金の申込は翌営業日の取扱とします。

(2) 換金不可日

ルクセンブルグの銀行の休業日、12月24日、その他投資対象ファンドの受付不可日のいずれかに該当する場合には、販売会社の営業日であっても換金は受け付けません。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、主要投資対象ファンドの取引停止、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30億口を下回ることとなった場合には、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．の規定にしがたがいます。

運用報告書の作成

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

信託事務の委託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務の処理の一部について株式会社日本カストディ銀行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す。

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われた受益権にかかる投資者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で購入代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として投資者とします。）にお支払いを開始します。

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

<累積投資コース>

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

販売会社は、累積投資契約に基づき、投資者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。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われます。

償還金の支払いは、販売会社において行います。

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

(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(2022年12月21日から2023年6月20日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前特定期間末 (2022年12月20日現在)	当特定期間末 (2023年6月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	2,815	3,987
金銭信託	17,502,448	18,681,988
投資証券	1,706,234,877	1,458,829,257
流動資産合計	1,723,740,140	1,477,515,232
資産合計	1,723,740,140	1,477,515,232
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,191,839	2,594,670
未払解約金	1,603	321,756
未払受託者報酬	61,242	52,098
未払委託者報酬	2,143,697	1,823,712
その他未払費用	153,111	130,256
流動負債合計	5,551,492	4,922,492
負債合計	5,551,492	4,922,492
純資産の部		
元本等		
元本	1,595,919,588	1,297,335,400
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	122,269,060	175,257,340
(分配準備積立金)	324,063,952	270,134,813
元本等合計	1,718,188,648	1,472,592,740
純資産合計	1,718,188,648	1,472,592,740
負債純資産合計	1,723,740,140	1,477,515,232

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前特定期間 (自 2022年6月21日 至 2022年12月20日)	当特定期間 (自 2022年12月21日 至 2023年6月20日)
営業収益		
受取配当金	28,385,219	35,993,362
受取利息	8,591	22,337
有価証券売買等損益	33,707,225	9,498,671
為替差損益	1,522,847	84,018,505
営業収益合計	6,836,262	110,535,533
営業費用		
受託者報酬	396,924	349,928
委託者報酬	13,893,979	12,249,242
その他費用	1,397,159	1,244,508
営業費用合計	15,688,062	13,843,678
営業利益又は営業損失()	22,524,324	96,691,855
経常利益又は経常損失()	22,524,324	96,691,855
当期純利益又は当期純損失()	22,524,324	96,691,855
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	1,591,487	966,466
期首剰余金又は期首欠損金()	160,452,508	122,269,060
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,895,917	1,660,211
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	23,895,917	1,660,211
剰余金減少額又は欠損金増加額	21,912,985	26,912,633
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,912,985	26,912,633
分配金	19,233,543	17,484,687
期末剰余金又は期末欠損金()	122,269,060	175,257,340

(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礎となる事項

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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当特定期間の翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前特定期間末 (2022年12月20日現在)	当特定期間末 (2023年6月20日現在)
1 当該特定期間の末日における受益権総数	1,595,919,588口	1,297,335,400口
2 1口当たり純資産額	1.0766円	1.1351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 2022年6月21日 至 2022年12月20日)
分配金の計算過程	<p>第202期（自2022年6月21日 至2022年7月20日） 当計算期間末における、費用控除後の配当等収益（3,794,587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(27,745,165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）（199,889,757円）、分配準備積立金(232,943,894円)により、分配対象収益は464,373,403円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,150,142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203期（自2022年7月21日 至2022年8月22日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（3,273,960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(5,239,161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）（200,101,853円）、分配準備積立金(259,932,382円)により、分配対象収益は468,547,356円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,142,009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204期（自2022年8月23日 至2022年9月20日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（5,008,816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(42,209,627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）（233,831,193円）、分配準備積立金(264,851,158円)により、分配対象収益は545,900,794円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,364,216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205期（自2022年9月21日 至2022年10月20日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（4,570,348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(39,737,638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）（223,948,524円）、分配準備積立金(292,406,595円)により、分配対象収益は560,663,105円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,201,795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206期（自2022年10月21日 至2022年11月21日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（2,057,211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）（227,666,432円）、分配準備積立金(326,654,088円)により、分配対象収益は556,377,731円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,183,542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207期（自2022年11月22日 至2022年12月20日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（2,297,374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）（229,679,280円）、分配準備積立金(324,958,417円)により、分配対象収益は556,935,071円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,191,839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 2022年12月21日 至 2023年 6月20日)
分配金の計算過程	<p>第208期（自2022年12月21日 至2023年1月20日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（2,403,746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）（219,779,034円）、分配準備積立金(309,283,124円)により、分配対象収益は531,465,904円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,049,578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209期（自2023年 1月21日 至2023年 2月20日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（5,313,077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）（221,423,896円）、分配準備積立金(307,791,424円)により、分配対象収益は534,528,397円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,054,086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210期（自2023年 2月21日 至2023年 3月20日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（2,487,328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）（215,868,500円）、分配準備積立金(299,744,436円)により、分配対象収益は518,100,264円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,962,887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211期（自2023年 3月21日 至2023年 4月20日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（7,249,966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）（216,585,056円）、分配準備積立金(297,289,717円)により、分配対象収益は521,124,739円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,955,492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212期（自2023年 4月21日 至2023年 5月22日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（7,342,389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）（210,471,182円）、分配準備積立金(292,356,014円)により、分配対象収益は510,169,585円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,867,974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213期（自2023年 5月23日 至2023年 6月20日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（4,504,601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）（190,734,882円）、分配準備積立金(268,224,882円)により、分配対象収益は463,464,365円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,594,670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 (2022年12月20日現在)	当特定期間末 (2023年6月20日現在)
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	<p>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 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</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>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 同左</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</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>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</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>4 金銭債権の特定期間末日後の償還予定額 同左</p>

金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」附則（令和3年9月24日改正内閣府令第61号）第2条第5項に従い、記載を省略しております。

(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 (2022年12月20日現在)	当特定期間末 (2023年6月20日現在)
期首元本額	1,567,546,267円	1,595,919,588円
期中追加設定元本額	173,878,899円	22,761,962円
期中一部解約元本額	145,505,578円	321,346,150円

2 有価証券関係

前特定期間末(2022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	19,374,539
合計	19,374,539

当特定期間末(2023年6月20日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	4,466,401
合計	4,466,401

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・ オポチュニティーズ・ファンド クラスJ 投資証券	1,053,308.370	10,153,892.680	
		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	6,552.490	102,939.610	
	アメリカドル 小計	1,059,860.860	10,256,832.290 (1,458,829,257)		
投資証券 合計			1,458,829,257 (1,458,829,257)		
合計			1,458,829,257 (1,458,829,257)		

(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
おります。

3 外貨建有価証券の内訳

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考情報)

当ファンドは、「ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラス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、2022年8月31日に終了する計算期間(2021年9月1日から2022年8月31日まで)に係る財務書類であります。

(2)当該財務書類は、同ファンドを含む「ブラックロック・グローバル・ファンズ」の2022年8月31日現在の財務書類のうち、同ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。

純資産計算書 2022年8月31日現在

	注記	フィクスト・ インカム・グローバル ・オポチュニティーズ ・ファンド	USダラー・ショート ・デュレーション・ ボンド・ファンド
		米ドル	米ドル
資産			
投資有価証券 - 取得原価		8,498,348,233	1,586,813,860
未実現評価損		(858,735,301)	(114,208,956)
投資有価証券 - 時価	2 (a)	7,639,612,932	1,472,604,904
銀行預金	2 (a)	1,256,228,685	89,284,229
ブローカーに対する債権	14	126,849,253	1,199,292
未収利息および未収配当金	2 (a)	68,936,602	7,280,977
売却投資有価証券未収金	2 (a)	3,322,001,006*	19,513,372*
販売投資証券未収金	2 (a)	11,493,820	1,400,466
以下に係る未実現評価益：			
未決済上場先物取引	2 (c)	11,193,784	282,519
未決済先渡為替予約	2 (c)	-	11,280,640
事後通告証券契約の時価	2 (c)	-	15,194,602
買建オプション/スワップオプションの時価	2 (c)	59,043,012	-
その他の資産	2 (a,c)	11,028	-
資産合計		12,495,370,122	1,618,041,001
負債			
ブローカーに対する債務	14	16,702,948	136,011
未払収益分配金	2 (a)	2,727,669	313,565
購入投資有価証券未払金	2 (a)	2,650,647,474*	32,009,531*
買戻し投資証券未払金	2 (a)	5,560,721	1,934,636
以下に係る未実現評価損：			
未決済先渡為替予約	2 (c)	33,887,552	-
差金決済契約	2 (c)	192,019	-
事後通告証券契約の時価	2 (c)	645,727,848	-
スワップの時価	2 (c)	14,922,666	49,721
売建オプション/スワップオプションの時価	2 (c)	113,290,639	-
その他の負債	4, 5, 6, 7, 8	14,620,080	1,340,718
負債合計		3,498,279,616	35,784,182
純資産合計		8,997,090,506	1,582,256,819

* 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 2022年 8月31日現在

フィクスト・インカム・グローバル・
オポチュニティーズ・ファンド

	通貨	2022年	2021年	2020年
		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	8,997,090,506	10,990,274,596	9,746,939,332
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	9.65	10.43	10.20
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	8.64	9.48	9.37
クラスA 毎日分配型投資証券	米ドル	9.81	10.59	10.37
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	9.80	10.58	10.36
クラスA 毎四半期分配型投資証券	米ドル	9.82	10.60	10.38
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	6.37	6.98	6.89
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	13.97	15.10	14.78
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	豪ドル	8.49	9.35	9.28
クラスA オフショア中国人民元ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	オフショア中国人民元	89.54	98.44	96.85
クラスA 安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	11.18	12.27	12.21
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	香港ドル	83.78	92.45	92.03
クラスA 無分配投資証券	米ドル	14.81	15.79	15.22
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	9.59	10.39	10.13
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.64	10.43	10.15
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,023	1,103	1,068
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	16.22	16.91	16.37
クラスA スウェーデン・クローナ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローナ	99.10	106.80	103.69
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	21.10	22.52	21.72
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	10.36	11.09	10.72
クラスA I 無分配投資証券	米ドル	11.76	12.53	12.09
クラスA I ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.83	10.63	10.35
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	9.80	10.59	10.37
クラスC 毎四半期分配型投資証券	米ドル	9.77	10.55	10.32
クラスC 無分配投資証券	米ドル	12.20	13.17	12.86
クラスD 毎年分配型投資証券	米ドル	13.06	14.11	13.82
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	9.37	10.15	9.95
クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	8.64	9.48	9.36
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	4.46	4.84	4.75
クラスD 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.33	11.15	10.91

3 会計年度末における純資産価額の概要 2022年8月31日現在(続き)

	通貨	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)		
		2022年 8月31日現在	2021年 8月31日現在	2020年 8月31日現在
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	8.63	9.47	9.38
クラスDユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	6.39	7.00	6.91
クラスD無分配投資証券	米ドル	15.54	16.48	15.81
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	10.45	11.26	10.93
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.37	11.17	10.81
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	11.38	12.11	11.66
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	17.04	17.67	17.02
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	22.16	23.53	22.59
クラスE無分配投資証券	米ドル	13.66	14.63	14.18
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	8.93	9.71	9.49
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	9.27	10.03	9.84
クラスI毎四半期分配型投資証券	米ドル	9.62	10.38	10.16
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	8.46	9.27	9.16
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	9.52	10.32	10.13
クラスI日本円ヘッジ毎四半期分配型投資証券	日本円	903	985	969
クラスI無分配投資証券	米ドル	12.41	13.15	12.59
クラスI豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	10.49	11.17	10.73
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	カナダ・ドル	11.46	12.15	11.66
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	11.19	12.04	11.67
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.74	11.55	11.16
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	11.52	12.25	11.77
クラスI日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,084	1,160	1,117
クラスJ毎月分配型投資証券	米ドル	9.80	10.59	10.37
クラスSユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.30	10.21	10.08
クラスS毎四半期分配型投資証券	米ドル	9.89	10.68	10.45
クラスS無分配投資証券	米ドル	10.59	11.22	10.75
クラスSスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	9.95	10.71	10.39
クラスSユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.02	10.78	10.42
クラスX毎月分配型投資証券	米ドル	9.80	10.59	10.37
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	豪ドル	10.03	10.90	10.70
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	ユーロ	8.53	9.36	9.25

3 会計年度末における純資産価額の概要 2022年8月31日現在（続き）

	通貨	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）		
		2022年 8月31日現在	2021年 8月31日現在	2020年 8月31日現在
クラスXユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	8.75	9.59	9.47
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	9.01	9.76	9.59
クラスX無分配投資証券	米ドル	12.24	12.90	12.29
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	12.52	13.27	12.68
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	カナダ・ドル	11.67	12.32	11.76
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	11.70	12.54	12.10
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	11.47	12.27	11.81
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	11.50	12.16	11.63
クラスXスウェーデン・クローナ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローナ	10.79	11.49	11.02

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

3 会計年度末における純資産価額の概要 2022年8月31日現在(続き)

U S ダラー・ショート・デュレーション・ボンド・
ファンド

	通貨	2022年	2021年	2020年
		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	1,582,256,819	1,799,880,962	1,640,867,085
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	8.07	8.64	8.63
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	8.07	8.64	8.63
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	9.04	9.69	9.68
クラスA 無分配投資証券	米ドル	13.48	14.26	14.10
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.40	10.09	10.07
クラスA I 無分配投資証券	米ドル	10.01	10.59	10.48
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	8.05	8.62	8.64
クラスC 無分配投資証券	米ドル	10.52	11.27	11.29
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	9.26	9.92	9.90
クラスD 無分配投資証券	米ドル	13.94	14.70	14.49
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.44	10.09	10.04
クラスE 無分配投資証券	米ドル	12.11	12.88	12.81
クラスI 毎四半期分配型投資証券	米ドル	9.66	10.32	10.31
クラスI 無分配投資証券	米ドル	10.64	11.21	11.04
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.50	10.15	10.08
クラスX 無分配投資証券	米ドル	15.46	16.21	15.91

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

損益および純資産変動計算書 2021年9月1日から2022年8月31日までの会計年度

	注記	フィクスト・ インカム・グローバル ・オポチュニティーズ ・ファンド	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		10,990,274,596	1,799,880,962
収益			
預金利息	2 (b)	1,917,409	216,785
債券利息、源泉徴収税控除後	2 (b)	255,923,595	34,284,593
スワップ利息	2 (c)	66,123,453	451,396
短期金融商品預け入れによる利息	2 (b)	57,146	273,995
集団投資スキームによる収益、源泉徴収税控除後	2 (b)	252,125	1,277,074
配当金、源泉徴収税控除後	2 (b)	4,469,949	-
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)	104,175	-
有価証券貸付による収益	2 (b)	1,524,349	181,051
投資運用報酬リベート	4	-	147,170
その他の払戻し		14,069	2,940
収益合計	2 (b)	330,386,270	36,835,004
費用			
差金決済契約に係る支払利息	2 (c)	3,295	-
スワップ利息	2 (c)	70,301,644	358,157
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)	132,374	-
年間サービス費用	6	6,465,591	1,152,981
ローン・コミットメント・フィー	16	70,430	11,679
保管および預託報酬	2 (h), 7	1,852,123	214,519
販売報酬	5	3,030,105	757,277
税金	8	2,081,930	722,043
投資運用報酬	4	36,531,006	8,897,694
費用合計		120,468,498	12,114,350
純利益		209,917,772	24,720,654
以下に係る実現純評価益 / (損) :			
投資有価証券	2 (a)	(353,251,329)	(43,735,275)
事後通告証券契約	2 (c)	(22,934,554)	(14,942)
差金決済取引	2 (c)	30,710	-
上場先物取引	2 (c)	285,960,242	3,567,595
オプション / スワップション契約	2 (c)	(3,792,651)	-
スワップ取引	2 (c)	89,823,659	898,364
先渡為替予約	2 (c)	(351,833,740)	7,916,490
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(2,462,118)	(314,249)
当期実現純評価損		(358,459,781)	(31,682,017)
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)	(1,079,488,219)	(128,641,194)
事後通告証券契約	2 (c)	14,012,405	5,652
差金決済取引	2 (c)	(145,132)	-
上場先物取引	2 (c)	16,683,269	1,227,181
オプション / スワップション契約	2 (c)	(29,448,222)	-
スワップ取引	2 (c)	(1,452,839)	150,223
先渡為替予約	2 (c)	(53,399,964)	5,160,684
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(8,653,423)	(8,897)
当期末実現評価益 / (損) の純変動		(1,141,892,125)	(122,106,351)
運用成績による純資産の減少		(1,290,434,134)	(129,067,714)

損益および純資産変動計算書 2021年9月1日から2022年8月31日までの会計年度(続き)

	注記	フィクスト・ インカム・グローバル ・オポチュニティーズ ・ファンド	USダラー・ショート ・デュレーション・ ボンド・ファンド
		米ドル	米ドル
資本の変動			
投資証券発行による正味受取額		1,997,532,850	842,990,604
投資証券買戻しによる正味支払額		(2,665,511,192)	(928,812,827)
資本の変動による純資産の減少		(667,978,342)	(85,822,223)
配当金宣言額	15	(34,771,614)	(2,734,206)
期末純資産		8,997,090,506	1,582,256,819

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 2021年9月1日から2022年8月31日までの会計年度

フィクスト・インカム・グローバル・
オポチュニティーズ・ファンド

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA 毎年分配型投資証券	107,110	31,961	38,655	100,416
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	870,235	110,701	521,288	459,648
クラスA 毎日分配型投資証券	3,841,744	726,504	1,504,151	3,064,097
クラスA 毎月分配型投資証券	437,634	108,841	134,346	412,129
クラスA 毎四半期分配型投資証券	6,270,382	475,760	1,644,304	5,101,838
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	767,344	40,250	145,976	661,618
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	609,704	179,325	173,692	615,337
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	501,398	115,470	43,454	573,414
クラスA オフショア中国人民元ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	118,309	1	118,002	308
クラスA 安定毎月総収益分配型投資証券	1,122,495	283,497	419,731	986,261
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	61,152	1	24,971	36,182
クラスA 無分配投資証券	43,761,698	6,047,332	15,424,805	34,384,225
クラスA スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	3,325,739	148,175	1,187,174	2,286,740
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	9,479,252	1,636,344	3,933,347	7,182,249
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	1,377	-	811	566
クラスA ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	7,291,030	10,540,550	12,415,301	5,416,279
クラスA スウェーデン・クローナ・ヘッジ無分配投資証券	169,318	19,631	78,717	110,232
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	5,190,795	814,306	1,443,369	4,561,732
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	284,291	64,302	103,255	245,338
クラスA I 無分配投資証券	8,924	53,827	7,775	54,976
クラスA I ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	275,865	49,542	150,203	175,204
クラスC 毎日分配型投資証券	221,760	15,850	42,336	195,274
クラスC 毎四半期分配型投資証券	674,682	380	84,611	590,451
クラスC 無分配投資証券	6,403,597	843,671	2,085,376	5,161,892
クラスD 毎年分配型投資証券	65,037	13,300	7,014	71,323
クラスD カナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	1,286,909	8,186	170,938	1,124,157
クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	407,061	5,997	33,377	379,681
クラスD 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	4,331,221	585,507	3,148,502	1,768,226
クラスD 毎四半期分配型投資証券	16,879,135	1,684,544	6,190,981	12,372,698
クラスD スイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	1,591,904	76,900	17,150	1,651,654
クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	737,440	11,973	185,928	563,485
クラスD 無分配投資証券	44,696,070	10,541,295	13,688,399	41,548,966
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	3,691,505	963,922	1,321,431	3,333,996

発行済投資証券口数変動表 2021年9月1日から2022年8月31日までの会計年度（続き）

フィクスト・インカム・グローバル・
オポチュニティーズ・ファンド（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ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	28,292,345	4,259,102	6,500,656	26,050,791
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	3,290,173	572,471	1,523,075	2,339,569
クラスDポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	280,038	95,000	192,792	182,246
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	59,130	1,189	36,513	23,806
クラスE無分配投資証券	11,975,320	1,995,603	3,035,044	10,935,879
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	26,201,951	2,190,075	7,234,256	21,157,770
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	44,930	20,246,161	44,320	20,246,771
クラスI毎四半期分配型投資証券	10,375,795	479,704	1,056,859	9,798,640
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	1,923,005	34,928	726,885	1,231,048
クラスI英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	4,707,374	818,765	829,869	4,696,270
クラスI日本円ヘッジ毎四半期分配型投資証券	468,412	149,401	17,955	599,858
クラスI無分配投資証券	57,076,060	57,661,251	28,027,960	86,709,351
クラスI豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	24,307	8,871	7,934	25,244
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	17,288,914	4,100	17,288,344	4,670
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	10,359,027	231,372	516,654	10,073,745
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	44,431,965	19,371,177	16,221,135	47,582,007
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	37,203,755	1,908,970	9,007,219	30,105,506
クラスI日本円ヘッジ無分配投資証券	47,431,561	4,753,481	6,925,085	45,259,957
クラスJ毎月分配型投資証券	1,261,543	158,615	142,392	1,277,766
クラスSユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	73,753	4,010	15,986	61,777
クラスS毎四半期分配型投資証券	884,022	208,718	347,829	744,911
クラスS無分配投資証券	1,615,477	2,496,231	772,127	3,339,581
クラスSスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	2,703,285	151,195	527,160	2,327,320
クラスSユーロ・ヘッジ無分配投資証券	640,552	1,105,591	227,337	1,518,806
クラスX毎月分配型投資証券	79,345,741	53,301	19,907,541	59,491,501
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	1,201,574	27,623	312,135	917,062
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	198,900	4,885	18,181	185,604
クラスXユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	13,074,246	1,469,056	-	14,543,302
クラスX英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	15,519,286	31,731	11,087,271	4,463,746
クラスX無分配投資証券	97,809,346	7,358,981	1,370,687	103,797,640
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	6,831,090	609,893	1,201,335	6,239,648
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	139,750,383	6,295,812	26,773,292	119,272,903
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	13	-	-	13
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	4,493,839	3,017,905	7,455,415	56,329

発行済投資証券口数変動表 2021年9月1日から2022年8月31日までの会計年度(続き)

フィクスト・インカム・グローバル・
オポチュニティーズ・ファンド(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X英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	46,748,691	29,678	189,586	46,588,783
クラスXスウェーデン・クローナ・ヘッジ無分配 投資証券	115	-	-	115

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 2021年9月1日から2022年8月31日までの会計年度（続き）

U S 달러・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	4,348,396	714,089	1,754,305	3,308,180
クラスA 毎月分配型投資証券	2,468,538	7,206,784	8,052,599	1,622,723
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型 投資証券	43,002	110,011	19,099	133,914
クラスA 無分配投資証券	37,437,776	8,737,218	16,965,462	29,209,532
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	3,944,251	11,673,535	4,073,075	11,544,711
クラスA I 無分配投資証券	9,001	160,270	84,095	85,176
クラスC 毎日分配型投資証券	80,225	2,705	2,955	79,975
クラスC 無分配投資証券	2,200,850	1,129,585	1,451,709	1,878,726
クラスD 毎月分配型投資証券	9,497,812	8,597,773	6,372,623	11,722,962
クラスD 無分配投資証券	36,387,356	17,306,904	15,262,919	38,431,341
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	1,182,894	789,424	990,292	982,026
クラスE 無分配投資証券	7,852,500	4,363,649	5,369,791	6,846,358
クラスI 毎四半期分配型投資証券	3,763,952	54,581	3,818,033	500
クラスI 無分配投資証券	7,280,126	3,014,059	3,725,604	6,568,581
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	8,366,575	7,394,720	9,967,757	5,793,538
クラスX 無分配投資証券	10,438,852	173,827	486,192	10,126,487

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 2022年8月31日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
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			
ファンド			
ルクセンブルグ			
955,110	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Bond Fund	18,806,116	0.21
122,600	BlackRock Strategic Funds - Emerging Markets Short Duration Bond Fund~	13,454,124	0.15
ファンド合計		32,260,240	0.36
普通/優先株式およびワラント			
ベルギー			
32,829	Anheuser-Busch InBev	1,605,045	0.02
バミューダ			
27,078	Bunge	2,669,349	0.03
11,612	Signet Jewelers	761,631	0.01
		3,430,980	0.04
英領バージン諸島			
36,400	Capri*	1,767,584	0.02
カナダ			
140,905	Lions Gate Entertainment*	1,471,048	0.02
99,749	Northern Graphite	47,092	0.00
		1,518,140	0.02
ケイマン諸島			
13,501	OPAL Fuels (Wts 21/7/2027)	21,061	0.00
115,110	TPB Acquisition I	1,120,020	0.01
38,370	TPB Acquisition I (Wts 19/2/2023)	11,515	0.00
26,880	TPG Pace Beneficial Finance (Wts 9/10/2027)	1,613	0.00
147,094	Vantage Drilling	15	0.00
		1,154,224	0.01
キュラソー島			
33,382	Schlumberger	1,266,179	0.01
フランス			
4,388	BNP Paribas	205,052	0.00
151	Hermes International	196,838	0.00
943	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton	620,478	0.01
1,054	Pernod Ricard	196,023	0.00
1,500	Schneider Electric	181,278	0.00
4,057	TotalEnergies	205,576	0.01
		1,605,245	0.02
ドイツ			
27,746	Commerzbank	183,425	0.00
23,082	Covestro	691,835	0.01
10,909	Deutsche Telekom	206,313	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ドイツ(続き)		
37,574	Evonik Industries	704,064	0.01
181,632	Fresenius	4,497,329	0.05
18,675	KION	754,795	0.01
51,652	Mercedes-Benz	2,931,997	0.03
21,292	Porsche Automobil	1,514,514	0.02
5,017	RWE	195,245	0.00
2,860	Volkswagen	410,930	0.00
		12,090,447	0.13
	ガーンジー		
297,095	Genius Sports	1,244,828	0.02
64,379	Genius Sports (Wts 31/12/2028)	50,866	0.00
		1,295,694	0.02
	アイルランド		
1,388	Eaton	192,418	0.00
3,259	ICON	692,244	0.01
		884,662	0.01
	イタリア		
255,713	Enel	1,218,742	0.01
	ジャージー		
56,602	Glencore	310,989	0.00
	ルクセンブルグ		
33,760	HomeToGo (Wts 31/12/2025)	10,132	0.00
	オランダ		
1,485	ASML	734,852	0.01
979	Ferrari	190,644	0.00
2,266	NXP Semiconductors	374,774	0.00
		1,300,270	0.01
	スウェーデン		
55,962	Telia	198,402	0.00
	スイス		
1,238	Cie Financiere Richemont	140,755	0.00
	台湾		
6,419	Taiwan Semiconductor Manufacturing	541,764	0.01
	英国		
1,563	AstraZeneca	196,101	0.00
22,010	BAE Systems	199,395	0.00
107,824	Barclays	207,227	0.00
23,900	BP	727,994	0.01
2,725,082	Lloyds Banking	1,392,534	0.02
74,791	Shell	1,968,225	0.02

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
30,039	Standard Chartered	208,667	0.00
		4,900,143	0.05
	米国		
2,582	2020 Cash Mandatory Exchangeable Trust	3,161,049	0.04
5,549	Abbott Laboratories	574,155	0.01
19,355	Activision Blizzard	1,527,690	0.02
1,100	Adobe	417,032	0.01
2,198	Advanced Micro Devices	188,457	0.00
34,763	Alcoa	1,730,502	0.02
1,443	Align Technology	359,249	0.00
9,140	Alphabet	1,015,362	0.01
1,800	Alphabet	198,252	0.00
180,700	Altus Power	1,906,385	0.02
27,502	Altus Power (Wts 12/1/2027)	78,381	0.00
6,874	Applied Materials	646,843	0.01
26,416	Archer-Daniels-Midland	2,306,645	0.03
303,507	Astra Space	273,156	0.00
12,672	Aurora Innovation (Wts 31/12/2028)	4,055	0.00
59,157	Blend Labs	182,795	0.00
264	Booking	504,768	0.01
1,577	Broadcom	796,322	0.01
14,455	Caesars Entertainment	634,575	0.01
177,419	California Resources	8,682,886	0.10
106,424	Cano Health (Wts 3/6/2026)	159,636	0.00
1,038	Caterpillar	193,286	0.00
19,919	Century Communities	938,982	0.01
23,824	CF Industries	2,454,587	0.03
1,878	CH Robinson Worldwide	213,998	0.00
32,343	Chesapeake Energy	3,154,736	0.04
1,323	Chesapeake Energy (Wts 9/2/2026)	98,590	0.00
5,066	Chevron	796,324	0.01
5,559	Climate Real Impact Solutions II Acquisition (Wts 31/12/2027)	584	0.00
2,074	Consolidated Edison	204,227	0.00
32,427	Coupang	555,474	0.01
6,847	CrowdStrike	1,312,228	0.01
11,973	Datadog	1,301,525	0.01
23,948	Devon Energy	1,669,894	0.02
228,398	DiamondRock Hospitality	2,028,174	0.02
6,090	Domino's Pizza	2,302,446	0.02
3,838	Dow	194,702	0.00
68,245	Dynatrace	2,645,176	0.03
3,057	Edison International	210,841	0.01
73,253	Element Solutions	1,371,296	0.02
3,597	Eli Lilly	1,106,797	0.01
9,128	Embark Technology (Wts 31/12/2027)	1,044	0.00
40,560	EQT	1,906,320	0.02

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
60,140	Evgo (Wts 15/9/2025)	129,301	0.01
191,837	Excellerate Energy	4,747,966	0.05
21,461	Exxon Mobil	2,025,489	0.02
48,550	Ford Motor	748,156	0.01
34,018	Forestar	431,348	0.00
45,112	Freeport-McMoRan	1,324,940	0.01
5,572	Generac	1,244,729	0.01
13,401	General Motors	522,505	0.01
20,031	Gores VIII (Wts 31/12/2027)	12,024	0.00
87,166	Green Plains	3,147,564	0.04
62,128	Halliburton	1,852,657	0.02
4,655	HCA Healthcare	935,003	0.01
687	Home Depot	199,450	0.00
888	Humana	433,078	0.00
84,000	Informatica	1,879,080	0.02
5,359	Intuit	2,341,508	0.03
3,322	IQVIA	723,598	0.01
7,367	Juniper Networks	213,459	0.00
11,486	Kinder Morgan	208,184	0.00
134,037	Latch (4/6/2026)	20,106	0.00
7,134	McDonald's	1,813,819	0.02
5,624	Microchip Technology	364,773	0.00
5,088	Micron Technology	286,353	0.00
171	Morgan Stanley	14,487	0.00
25,880	Mr Cooper	1,096,018	0.01
2,892	NetApp	208,976	0.00
1,521	Nucor	200,437	0.00
5,992	NVIDIA	917,315	0.01
298,087	Offerpad	465,016	0.01
92,223	Offerpad Solutions (Wts 1/9/2026)	17,716	0.00
5,173	Otis Worldwide	375,922	0.01
107,759	Park Hotels & Resorts	1,528,023	0.02
32,025	Pear Therapeutics (Wts 1/12/2026)	4,810	0.00
77,818	Pivotal Investment III	766,507	0.01
232,160	Planet Labs PBC	1,286,166	0.01
18,445	Raymond James Financial	1,930,823	0.02
180,213	Rocket Lab USA	1,030,818	0.01
14,854	Salesforce	2,382,136	0.03
154,796	Sarcos Technology and Robotics	509,279	0.01
375,884	Sarcos Technology and Robotics (Wts 24/9/2026)	135,356	0.00
614	SBA Communications	201,429	0.00
28,124	Science Strategic Acquisition Alpha (Wts 31/12/2027)	1,969	0.00
1,244	Sempra Energy	206,840	0.00
227,107	Service Properties Trust	1,560,225	0.02
1,255	ServiceNow	557,659	0.01
325,291	Sonder	600,162	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
79,119	Starwood Property Trust	1,816,572	0.02
98,314	Sunstone Hotel Investors	1,087,353	0.01
82,145	Symbotic	1,010,384	0.01
6,596	Target Hospitality (15/3/2024)	25,988	0.00
51,669	Taylor Morrison Home	1,330,993	0.01
2,772	Tesla	773,139	0.01
50,007	Tishman Speyer Innovation II	492,569	0.01
10,001	Tishman Speyer Innovation II (Wts 31/12/2027)	1,200	0.00
56,257	Toast	1,073,946	0.01
6,054	United Rentals	1,773,035	0.02
3,053	UnitedHealth	1,604,138	0.02
1,866	Valero Energy	215,486	0.00
61,950	Volta (Wts 26/8/2026)	37,158	0.00
22,214	Western Digital	941,651	0.01
5,700	Weyerhaeuser	195,054	0.00
57,220	WillScot Mobile Mini	2,316,266	0.03
125,921	Xenia Hotels & Resorts	2,039,920	0.03
4,439	XPO Logistics	236,377	0.00
		108,583,834	1.22
普通/優先株式およびワラント合計		143,823,231	1.60
債券			
	アンゴラ		
USD 2,246,000	Angolan Government International Bond 8.75% 14/4/2032	1,841,720	0.02
	アルゼンチン		
USD 2,325,496	Argentine Republic Government International Bond 1.5% 9/7/2035	520,911	0.01
USD 4,449,085	Generacion Mediterraneo / Central Termica Roca 9.875% 1/12/2027	2,969,542	0.03
USD 1,012,820	Genneia 8.75% 2/9/2027	951,149	0.01
USD 3,003,000	YPF 7% 15/12/2047	1,636,635	0.02
		6,078,237	0.07
	オーストラリア		
USD 78,000	FMG Resources August 2006 Pty 4.5% 15/9/2027	71,094	0.00
USD 3,310,000	FMG Resources August 2006 Pty 6.125% 15/4/2032	3,073,368	0.03
USD 187,500	Linc Energy 0% 10/4/2018***	5,625	0.00
USD 282,000	National Australia Bank 3.375% 14/1/2026	274,739	0.00
		3,424,826	0.03
	オーストリア		
EUR 2,200,000	ams-OSRAM 0% 5/3/2025	1,755,234	0.02
EUR 2,400,000	ams-OSRAM 2.125% 3/11/2027	1,717,700	0.02
EUR 1,346,000	ams-OSRAM 6% 31/7/2025*	1,260,924	0.01
EUR 2,600,000	BAWAG 2.375% 26/3/2029*	2,506,414	0.03
USD 3,036,000	BRF 4.35% 29/9/2026	2,776,741	0.03
EUR 600,000	Erste Bank 6.5% 15/10/2170	592,005	0.01
USD 1,355,000	Klabin Austria 3.2% 12/1/2031	1,075,328	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オーストリア(続き)			
EUR 4,500,000	Lenzing 5.75% 7/12/2170	4,288,547	0.05
EUR 15,091,000	Republic of Austria Government Bond 2.1% 20/9/2117	12,887,229	0.14
USD 2,335,000	Suzano Austria 3.125% 15/1/2032	1,849,343	0.02
USD 780,000	Suzano Austria 3.75% 15/1/2031	663,002	0.01
USD 1,109,000	Suzano Austria 5% 15/1/2030	1,039,743	0.01
USD 699,000	Suzano Austria 5.75% 14/7/2026	713,183	0.01
		33,125,393	0.37
ベルギー			
EUR 1,400,000	House of Finance 4.375% 15/7/2026*	1,401,304	0.02
EUR 3,900,000	Solvay 2.5% 2/3/2171*	3,361,493	0.04
EUR 7,700,000	Solvay 4.25% 4/3/2171	7,551,948	0.08
		12,314,745	0.14
バミューダ			
USD 1,486,246	Digicel 8% 1/4/2025	964,856	0.01
USD 900,000	Geopark 5.5% 17/1/2027	788,733	0.01
USD 600,000	Li & Fung 4.375% 4/10/2024	558,492	0.01
HKD 4,062,966	REXLot 4.5% 17/4/2019***	64,709	0.00
HKD 348,254	REXLot 6% 28/4/2017***	14,792	0.00
USD 655,000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4.85% 14/10/2038*	555,500	0.01
		2,947,082	0.04
ブラジル			
USD 205,000	Banco Bradesco 3.2% 27/1/2025	197,774	0.00
USD 1,419,000	Banco Votorantim 4% 24/9/2022	1,418,305	0.01
USD 1,326,000	Oi 10% 27/7/2025	609,960	0.01
		2,226,039	0.02
英領バージン諸島			
USD 624,000	Champion Path 4.85% 27/1/2028	419,144	0.00
USD 489,426	Easy Tactic 7.5% 11/7/2028	58,702	0.00
USD 338,000	Fortune Star BVI 5% 18/5/2026	173,411	0.00
USD 400,000	Fortune Star BVI 5.95% 19/10/2025	215,884	0.00
USD 200,000	Greenland Global Investment 6.125% 22/4/2023	96,000	0.00
USD 1,853,000	Knight Castle Investments 7.99% 23/1/2023	1,336,013	0.02
USD 282,000	New Metro Global 4.8% 15/12/2024	143,945	0.00
USD 920,000	NWD Finance BVI 4.125% 10/12/2170	712,512	0.01
USD 840,000	NWD MTN 4.125% 18/7/2029	705,587	0.01
USD 242,000	RKPF Overseas 2019 A 6% 4/9/2025	104,060	0.00
USD 369,000	RKPF Overseas 2019 A 6.7% 30/9/2024	212,092	0.00
USD 164,540	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6.75% 24/4/2033	160,218	0.00
USD 493,620	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6.75% 24/4/2033	480,654	0.00
USD 850,000	Studio City Finance 5% 15/1/2029	459,000	0.01
USD 1,080,000	TSMC Global 4.625% 22/7/2032	1,085,000	0.01
		6,362,222	0.06
カナダ			
USD 98,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 3.875% 15/1/2028	87,882	0.00
USD 1,830,395	Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust 5% 15/6/2025	1,779,648	0.02

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	カナダ(続き)		
USD 1,378,000	Bausch Health 4.875% 1/6/2028	972,027	0.01
USD 563,000	Bausch Health 5.5% 1/11/2025	469,733	0.01
USD 65,000	Bausch Health 5.75% 15/8/2027	47,782	0.00
USD 3,452,000	Bausch Health 6.125% 1/2/2027	2,645,388	0.03
USD 778,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 5% 15/6/2029	619,413	0.01
USD 1,159,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 6.25% 15/9/2027	1,036,022	0.01
USD 3,500,000	Canadian National Railway 2.75% 1/3/2026	3,359,797	0.04
USD 1,504,000	Canadian National Railway 4.4% 5/8/2052	1,465,210	0.01
EUR 2,834,000	Clarios Global / Clarios US Finance 4.375% 15/5/2026	2,633,212	0.03
USD 1,250,000	First Quantum Minerals 6.875% 1/3/2026	1,214,760	0.01
USD 800,000	First Quantum Minerals 7.5% 1/4/2025	793,875	0.01
USD 2,310,000	Frontera Energy 7.875% 21/6/2028	1,884,775	0.02
USD 162,000	Masonite International 5.375% 1/2/2028	150,321	0.00
USD 2,099,000	Mattamy 4.625% 1/3/2030	1,697,202	0.02
USD 1,813,000	Mattamy 5.25% 15/12/2027	1,599,042	0.02
USD 500,000	MEGlobal Canada 5.875% 18/5/2030	524,200	0.00
USD 1,629,000	NOVA Chemicals 4.875% 1/6/2024	1,566,404	0.02
USD 2,078,000	Rockpoint Gas Storage Canada 7% 31/3/2023	2,063,194	0.02
USD 5,106,000	Rogers Communications 2.95% 15/3/2025	4,943,308	0.06
USD 317,000	Royal Bank of Canada 0.65% 29/7/2024	297,786	0.00
USD 819,000	Royal Bank of Canada 0.75% 7/10/2024	763,781	0.01
USD 155,000	Royal Bank of Canada 1.2% 27/4/2026	139,703	0.00
USD 1,696,000	Royal Bank of Canada 3.97% 26/7/2024	1,693,437	0.02
USD 175,000	Thomson Reuters 3.35% 15/5/2026	170,012	0.00
USD 3,540,000	Toronto-Dominion Bank/The 1.95% 12/1/2027	3,217,236	0.04
USD 612,000	Toronto-Dominion Bank/The 2% 10/9/2031	499,633	0.01
USD 2,750,000	Toronto-Dominion Bank/The 2.35% 8/3/2024	2,687,758	0.03
USD 325,000	Toronto-Dominion Bank/The 2.8% 10/3/2027	305,651	0.00
		41,328,192	0.46
	ケイマン諸島		
USD 500,000	522 Funding CLO 2018-3A 4.76% 20/10/2031	471,827	0.01
USD 3,337,525	ACAS CLO 2015-1 3.63% 18/10/2028	3,286,825	0.04
USD 500,000	ACAS CLO 2015-1 4.34% 18/10/2028	481,493	0.01
USD 3,870,000	ACAS CLO 2015-1 4.94% 18/10/2028	3,673,102	0.04
USD 299,000	Agile 5.75% 2/1/2025	122,590	0.00
USD 322,000	Agile 7.875% 31/1/2171	83,720	0.00
USD 250,000	AGL CLO 11 8.872% 15/4/2034	233,499	0.00
USD 375,000	AGL CLO 3 5.812% 15/1/2033	352,814	0.00
USD 410,000	AGL CLO 5 4.11% 20/7/2034	391,794	0.00
USD 4,700,000	AGL CLO 5 4.41% 20/7/2034	4,517,192	0.05
USD 2,150,000	AGL CLO 5 9.16% 20/7/2034	2,002,268	0.02
USD 1,460,000	AGL CLO 7 5.612% 15/7/2034	1,375,251	0.02
USD 500,000	AGL CLO 7 8.862% 15/7/2034	466,061	0.01
USD 250,000	AGL CLO 9 6.41% 20/1/2034	237,141	0.00
USD 1,030,000	AGL CLO 9 9.97% 20/1/2034	945,350	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ケイマン諸島(続き)		
USD 700,000	Ahli United Sukuk 3.875% 17/12/2170	642,517	0.01
USD 250,000	AIMCO CLO Series 2015-A 4.34% 17/10/2034	240,720	0.00
USD 250,000	AIMCO CLO Series 2017-A 5.86% 20/4/2034	233,379	0.00
USD 1,560,000	Allegro CLO II-S 4.882% 21/10/2028	1,509,117	0.02
USD 2,270,000	Allegro CLO II-S 5.732% 21/10/2028	2,160,610	0.02
USD 370,000	Allegro CLO IV 4.062% 15/1/2030	361,044	0.00
USD 250,000	Allegro CLO VI 3.87% 17/1/2031	248,357	0.00
USD 500,000	Allegro CLO XI 4.588% 19/1/2033	489,346	0.01
USD 690,000	Allegro CLO XI 5.738% 19/1/2033	664,350	0.01
USD 4,065,000	ALM VII 0% 15/10/2116	2,642	0.00
USD 530,000	AMMC CLO 21 4.038% 2/11/2030	526,452	0.01
USD 2,350,000	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R 3.445% 13/4/2031	2,318,807	0.03
USD 840,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 3.705% 13/10/2030	834,670	0.01
USD 1,070,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 4.105% 13/10/2030	1,045,956	0.01
USD 340,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 4.605% 13/10/2030	330,637	0.00
USD 417,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 5.655% 13/10/2030	391,740	0.00
USD 795,223	Anchorage Capital CLO 3-R 3.843% 28/1/2031	786,618	0.01
USD 1,650,000	Anchorage Capital CLO 3-R 4.293% 28/1/2031	1,611,338	0.02
USD 1,420,000	Anchorage Capital CLO 4-R 3.843% 28/1/2031	1,404,631	0.02
USD 1,500,000	Anchorage Capital CLO 4-R 4.643% 28/1/2031	1,421,228	0.02
USD 5,223,000	Anchorage Capital CLO 5-R 3.962% 15/1/2030	5,114,090	0.06
USD 1,300,000	Anchorage Capital CLO 5-R 4.362% 15/1/2030	1,263,015	0.01
USD 700,000	Apidos CLO XII 3.592% 15/4/2031	690,666	0.01
USD 1,040,000	Apidos CLO XV 3.72% 20/4/2031	1,022,580	0.01
USD 250,000	Apidos CLO XXXI 4.062% 15/4/2031	239,448	0.00
USD 250,000	Apidos CLO XXXII 5.11% 20/1/2033	238,257	0.00
USD 300,000	Apidos CLO XXXII 6.21% 20/1/2033	293,274	0.00
USD 375,000	Apidos CLO XXXV 8.46% 20/4/2034	345,114	0.00
USD 1,570,000	Apidos CLO XXXVII 9.059% 22/10/2034	1,463,030	0.02
USD 1,280,000	Apidos CLO XXXVIII 10.482% 21/1/2034	1,208,962	0.01
USD 1,745,000	Arabian Centres Sukuk 5.375% 26/11/2024	1,668,028	0.02
USD 1,036,000	Arabian Centres Sukuk II 5.625% 7/10/2026	941,615	0.01
USD 375,000	ARES XLV CLO 4.562% 15/10/2030	361,672	0.00
USD 1,500,000	Ares XXXVII CLO 3.682% 15/10/2030	1,486,956	0.02
USD 250,000	ASSURANT CLO 3.75% 20/4/2031	246,203	0.00
USD 1,790,000	Bain Capital Credit CLO 2018-2 3.818% 19/7/2031	1,766,170	0.02
USD 2,740,000	Bain Capital Credit CLO 2021-3 5.883% 24/7/2034	2,547,564	0.03
USD 430,000	Bain Capital Credit CLO 2021-4 3.88% 20/10/2034	419,134	0.00
USD 250,000	Ballyrock CLO 14 5.01% 20/1/2034	238,787	0.00
USD 1,410,000	Ballyrock CLO 2020-2 8.86% 20/10/2031	1,297,005	0.01
USD 1,060,000	Bardot CLO 5.759% 22/10/2032	993,416	0.01
USD 1,000,000	Barings Clo 2015-II 3.9% 20/10/2030	990,945	0.01
USD 508,651	Barings CLO 2018-III 3.66% 20/7/2029	503,045	0.01
USD 30,000	Bean Creek CLO 8.46% 20/4/2031	26,505	0.00
USD 750,000	Benefit Street Partners CLO V-B 3.8% 20/4/2031	739,402	0.01
USD 2,010,000	Benefit Street Partners CLO VIII 3.81% 20/1/2031	1,992,473	0.02

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ケイマン諸島(続き)		
USD 2,666,649	BlueMountain CLO 2013-2 3.939% 22/10/2030	2,640,781	0.03
USD 530,000	BlueMountain CLO 2015-3 3.71% 20/4/2031	522,867	0.01
USD 1,000,000	Brookside Mill CLO 2013-1 4.09% 17/1/2028	996,244	0.01
USD 500,000	Brookside Mill CLO 2013-1 5.39% 17/1/2028	484,120	0.01
USD 250,000	Canyon CLO 2018-1 3.582% 15/7/2031	245,748	0.00
USD 370,000	Canyon CLO 2020-3 9.762% 15/1/2034	339,330	0.00
USD 500,000	Carbone Clo 3.85% 20/1/2031	493,125	0.01
USD 2,013,877	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-1 3.71% 17/4/2031	1,980,145	0.02
USD 10,400	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-4 11.21% 20/7/2032	10,308	0.00
USD 4,500,000	CARLYLE US CLO 2017-4 3.692% 15/1/2030	4,459,041	0.05
USD 750,000	CarVal CLO I 5.63% 16/7/2031	694,059	0.01
USD 790,000	CarVal CLO I 8.51% 16/7/2031	711,343	0.01
USD 350,000	Cayuga Park CLO 4.39% 17/7/2034	330,883	0.00
USD 7,155,000	CBAM 2017-1 3.96% 20/7/2030	7,097,354	0.08
USD 750,000	CBAM 2017-1 5.11% 20/7/2030	728,128	0.01
USD 200,000	Central China Real Estate 7.25% 13/8/2024	69,000	0.00
USD 590,000	China Aoyuan 5.98% 18/8/2025	39,464	0.00
USD 1,027,000	China Aoyuan 6.2% 24/3/2026	69,322	0.00
USD 1,300,000	China Aoyuan 6.35% 8/2/2024	87,750	0.00
USD 2,842,000	China Aoyuan 7.95% 19/2/2023	194,059	0.00
USD 341,000	China Aoyuan 8.5% 23/1/2022***	23,018	0.00
USD 1,264,000	China Evergrande 7.5% 28/6/2023	94,114	0.00
USD 800,000	China Evergrande 8.25% 23/3/2022***	58,550	0.00
USD 663,000	China SCE 7.375% 9/4/2024	201,855	0.01
USD 750,000	CIFC Funding 2012-II-R 3.96% 20/1/2028	738,669	0.01
USD 850,000	CIFC Funding 2013-III-R 4.633% 24/4/2031	813,637	0.01
USD 250,000	CIFC Funding 2014 3.84% 18/1/2031	247,106	0.00
USD 250,000	CIFC Funding 2014-II-R 5.583% 24/4/2030	235,286	0.00
USD 3,530,000	CIFC Funding 2017-I 4.432% 23/4/2029	3,474,366	0.04
USD 2,730,000	CIFC Funding 2017-I 5.182% 23/4/2029	2,671,960	0.03
USD 1,000,000	CIFC Funding 2017-II 3.66% 20/4/2030	989,068	0.01
USD 250,000	CIFC Funding 2017-IV 4.333% 24/10/2030	242,700	0.00
USD 250,000	CIFC Funding 2017-V 3.92% 16/11/2030	247,903	0.00
USD 600,000	CIFC Funding 2017-V 5.59% 16/11/2030	551,271	0.01
USD 5,640,000	CIFC Funding 2018-II 3.75% 20/4/2031	5,567,837	0.06
USD 250,000	CIFC Funding 2018-II 4.31% 20/4/2031	243,538	0.00
USD 250,000	CIFC Funding 2018-V 5.512% 15/1/2032	239,205	0.00
USD 383,000	CIFI 5.95% 20/10/2025	197,245	0.00
USD 300,000	CIFI 6.45% 7/11/2024	169,500	0.00
USD 250,000	Clear Creek CLO 3.91% 20/10/2030	247,108	0.00
USD 1,400,000	Clear Creek CLO 5.66% 20/10/2030	1,314,755	0.01
USD 1,375,000	Clear Creek CLO 9.01% 20/10/2030	1,215,921	0.01
USD 430,000	Country Garden 2.7% 12/7/2026	197,800	0.00
USD 4,500,000	Deer Creek Clo 2017-1 3.89% 20/10/2030	4,456,800	0.05
USD 500,000	Deer Creek Clo 2017-1 4.36% 20/10/2030	482,658	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ケイマン諸島(続き)		
USD 500,000	Deer Creek Clo 2017-1 9.06% 20/10/2030	447,400	0.01
USD 1,105,000	DP World Salaam 6% 1/1/2171	1,102,940	0.01
USD 10,667,000	Dryden 53 CLO 3.632% 15/1/2031	10,551,378	0.12
USD 482,663	Dryden XXVI Senior Loan Fund 3.412% 15/4/2029	476,564	0.01
USD 6,206,000	Dryden XXVIII Senior Loan Fund 4.105% 15/8/2030	6,147,715	0.07
USD 1,000,000	Eaton Vance CLO 2018-1 4.712% 15/10/2030	953,949	0.01
USD 1,577,000	Elevation CLO 2018-10 4.61% 20/10/2031	1,527,761	0.02
USD 1,781,000	Fantasia 0% 5/7/2022***	166,390	0.00
USD 925,000	Fantasia 6.95% 17/12/2021***	86,894	0.00
USD 794,000	Fantasia 9.25% 28/7/2023	77,415	0.00
USD 2,580,000	Fantasia 11.75% 17/4/2022***	239,566	0.01
USD 411,000	Fantasia 11.875% 1/6/2023	40,073	0.00
USD 250,000	Galaxy XXII CLO 3.94% 16/4/2034	244,129	0.00
USD 441,555	Galaxy XXIII CLO 3.653% 24/4/2029	436,816	0.00
USD 250,000	Generate CLO 2 3.909% 22/1/2031	246,713	0.00
USD 928,021	Generate CLO 3 3.96% 20/10/2029	920,862	0.01
USD 5,995,000	Generate CLO 3 4.46% 20/10/2029	5,759,024	0.06
USD 4,240,000	Generate CLO 3 6.31% 20/10/2029	4,032,517	0.04
USD 1,520,000	Generate CLO 3 9.11% 20/10/2029	1,427,516	0.02
USD 730,000	Generate CLO 3 9.96% 20/10/2029	594,921	0.01
USD 2,090,000	Gilbert Park CLO 4.462% 15/10/2030	2,006,615	0.02
USD 2,717,000	Gilbert Park CLO 5.462% 15/10/2030	2,582,948	0.03
USD 500,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 3.73% 20/4/2034	484,503	0.01
USD 460,000	Goldentree Loan Management US CLO 5 4.26% 20/10/2032	441,835	0.01
USD 691,086	GoldenTree Loan Opportunities IX 3.916% 29/10/2029	686,722	0.01
USD 1,166,000	Goldentree Loan Opportunities X 3.83% 20/7/2031	1,151,422	0.01
USD 1,255,000	Goldentree Loan Opportunities XI 3.81% 18/1/2031	1,244,535	0.01
USD 2,510,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 7.46% 20/1/2033	2,158,002	0.02
USD 2,610,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 8.06% 20/10/2034	2,336,305	0.03
USD 1,400,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 10.46% 20/10/2034	1,343,821	0.02
USD 500,000	GoLub Capital Partners CLO 53B 9.41% 20/7/2034	457,300	0.01
USD 2,900,000	GoLub Capital Partners CLO 55B 9.27% 20/7/2034	2,637,527	0.03
USD 3,590,000	Great Lakes CLO 2019-1 4.072% 15/7/2031	3,537,582	0.04
USD 364,391	Grippen Park CLO 3.97% 20/1/2030	361,473	0.00
USD 4,901,000	Grupo Aval 4.375% 4/2/2030	3,968,352	0.04
USD 1,235,000	Grupo Aval 4.75% 26/9/2022	1,233,277	0.01
USD 320,000	Highbridge Loan Management 12-2018 3.99% 18/7/2031	310,707	0.00
USD 650,000	Highbridge Loan Management 12-2018 7.89% 18/7/2031	584,940	0.01
USD 80,000	Highbridge Loan Management 7-2015 4.605% 15/3/2027	78,241	0.00
USD 997,000	Hilong 9.75% 18/11/2024	418,740	0.01
USD 2,810,790	HPS Loan Management 6-2015 3.832% 5/2/2031	2,786,200	0.03
USD 1,924,000	IHS 5.625% 29/11/2026	1,663,870	0.02
USD 1,210,000	IHS 6.25% 29/11/2028	1,031,525	0.01
USD 424,000	KWG 5.875% 10/11/2024	63,600	0.00
USD 300,000	KWG 7.4% 5/3/2024	46,500	0.00
USD 750,000	LCM XIV 3.75% 20/7/2031	736,189	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ケイマン諸島(続き)		
USD 418,700	LCM XXI 3.59% 20/4/2028	413,483	0.00
USD 130,391	LoanCore 2018-CRE1 Issuer 3.521% 15/5/2028	130,469	0.00
USD 2,794,132	Loanpal Solar Loan 2021-1 2.29% 20/1/2048	2,395,671	0.03
USD 600,000	Madison Park Funding XIII 4.638% 19/4/2030	582,982	0.01
USD 618,898	Madison Park Funding XLI 3.589% 22/4/2027	612,113	0.01
USD 1,385,000	Madison Park Funding XLI 4.409% 22/4/2027	1,344,763	0.02
USD 700,000	Madison Park Funding XXX 7.462% 15/4/2029	621,770	0.01
USD 250,000	Marble Point CLO XVII 6.46% 20/4/2033	228,786	0.00
USD 256,000	Melco Resorts Finance 5.375% 4/12/2029	169,600	0.00
USD 200,000	Melco Resorts Finance 5.625% 17/7/2027	143,127	0.00
USD 648,000	MGM China 4.75% 1/2/2027	509,684	0.01
USD 1,851,000	Modern Land China 9.8% 11/4/2023	305,415	0.01
USD 850,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 4.227% 20/1/2035	824,446	0.01
USD 250,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 9.91% 20/1/2032	242,626	0.00
USD 250,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 46 4.36% 20/1/2036	236,734	0.00
USD 250,000	Ocean Trails Clo X 4.312% 15/10/2034	239,321	0.00
USD 460,000	OCP CLO 2014-5 3.846% 26/4/2031	453,879	0.01
USD 1,320,000	OCP CLO 2014-5 5.666% 26/4/2031	1,183,166	0.01
USD 1,100,000	OCP CLO 2014-7 4.36% 20/7/2029	1,072,193	0.01
USD 1,170,000	OCP CLO 2014-7 5.106% 20/7/2029	1,085,596	0.01
USD 360,000	OCP CLO 2017-14 4.934% 20/11/2030	344,549	0.00
USD 250,000	Octagon Investment Partners 18-R 3.7% 16/4/2031	246,319	0.00
USD 1,144	Odebrecht Offshore Drilling Finance 7.72% 1/12/2026	277	0.00
USD 1,433,000	OHA Loan Funding 2013-2 3.998% 23/5/2031	1,416,355	0.02
USD 290,000	OZLM Funding IV 4.459% 22/10/2030	284,546	0.00
USD 3,200,000	OZLM VI 0% 17/4/2031	460,160	0.01
USD 300,000	OZLM VI 4.49% 17/4/2031	289,731	0.00
USD 500,000	OZLM VII 4.34% 17/7/2029	482,594	0.01
USD 815,000	OZLM VIII 5.89% 17/10/2029	782,665	0.01
USD 250,000	OZLM XII 4.382% 30/4/2027	248,373	0.00
USD 250,000	OZLM XX 4.36% 20/4/2031	240,314	0.00
USD 580,000	Palmer Square CLO 2014-1 3.87% 17/1/2031	574,600	0.01
USD 1,840,000	Palmer Square CLO 2018-1 3.77% 18/4/2031	1,814,217	0.02
USD 500,000	Palmer Square CLO 2018-2 4.39% 16/7/2031	487,571	0.01
USD 460,000	Palmer Square CLO 2020-3 4.505% 15/11/2031	443,263	0.01
USD 330,000	Parallel 2015-1 4.46% 20/7/2027	324,508	0.00
USD 1,350,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO 2016-1 8.808% 23/8/2031	1,210,858	0.01
USD 1,049,714	Pearl II 6% 29/12/2049	40,750	0.00
USD 836,000	Pearl III 9% 22/10/2025	313,868	0.01
USD 500,000	Pikes Peak CLO 1 3.963% 24/7/2031	492,662	0.01
USD 375,000	Pikes Peak Clo 4 5.762% 15/7/2034	351,377	0.00
USD 500,000	Pikes Peak CLO 6 9.391% 18/5/2034	468,807	0.01
USD 1,290,000	Prima Capital CRE Securitization 2015-IV 4% 24/8/2049	1,254,665	0.01
USD 565,000	Redsun Properties 7.3% 13/1/2025	37,855	0.00
USD 785,000	Redsun Properties 9.7% 16/4/2023	66,725	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ケイマン諸島(続き)		
USD 1,000,000	Regatta IX Funding 4.54% 17/4/2030	986,186	0.01
USD 2,180,000	Regatta IX Funding 5.19% 17/4/2030	2,130,127	0.02
USD 500,000	Regatta IX Funding 6.64% 17/4/2030	495,414	0.01
USD 1,230,000	Regatta VIII Funding 4.44% 17/10/2030	1,202,043	0.01
USD 910,000	Regatta VIII Funding 5.94% 17/10/2030	842,407	0.01
USD 250,000	Regatta XVI Funding 4.562% 15/1/2033	245,924	0.00
USD 500,000	Regatta XVI Funding 6.412% 15/1/2033	469,430	0.01
USD 10,872,992	Rockford Tower CLO 2017-3 3.9% 20/10/2030	10,785,342	0.12
USD 1,000,000	Rockford Tower CLO 2018-1 4.084% 20/5/2031	986,858	0.01
USD 1,250,000	Rockford Tower CLO 2018-1 4.704% 20/5/2031	1,212,781	0.01
USD 341,000	Rockford Tower CLO 2018-2 3.87% 20/10/2031	335,940	0.00
USD 813,000	Rockford Tower CLO 2018-2 4.51% 20/10/2031	788,103	0.01
USD 836,000	Ronshine China 7.1% 25/1/2025	58,520	0.00
USD 200,000	Ronshine China 7.35% 15/12/2023	14,000	0.00
USD 1,500,000	RR 19 9.012% 15/10/2035	1,384,757	0.02
USD 250,000	RR 3 3.602% 15/1/2030	246,982	0.00
USD 2,000,000	RR 4 4.062% 15/4/2030	1,938,717	0.02
USD 719,000	Sands China 4.875% 18/6/2030*	578,795	0.01
USD 300,000	Seazen 6% 12/8/2024	131,759	0.00
USD 250,000	Seneca Park CLO 2014-1 0% 17/7/2026	388	0.00
USD 3,103,015	Shackleton 2013-III CLO 3.632% 15/7/2030	3,059,413	0.03
USD 220,000	Shelf Drilling 8.875% 15/11/2024	220,000	0.00
USD 787,000	Shimao 3.45% 11/1/2031	108,213	0.00
USD 1,719,000	Shimao 4.6% 13/7/2030	236,362	0.00
USD 200,000	Shui On Development 5.5% 3/3/2025	150,608	0.00
USD 300,000	Shui On Development 5.75% 12/11/2023	271,500	0.01
USD 3,146,358	Silver Creek CLO 3.95% 20/7/2030	3,122,618	0.03
USD 750,000	Silver Creek CLO 6.06% 20/7/2030	710,434	0.01
USD 774,000	Sinic 0% 18/6/2022***	22,489	0.00
USD 2,680,000	Sitka 6.75% 6/7/2026	2,551,891	0.03
USD 58,539	SPARC EM SPC Panama Metro Line 2 SP 0% 5/12/2022	57,606	0.00
USD 330,000	Steele Creek Clo 2017-1 3.762% 15/10/2030	324,967	0.00
USD 2,213,000	Strata CLO I 0% 15/1/2118	1,201,438	0.01
USD 410,000	Strata CLO I 9.592% 15/1/2031	386,860	0.00
USD 624,000	Sunac China 6.5% 10/1/2025	90,480	0.00
USD 490,000	Symphony CLO XXIII 4.512% 15/1/2034	468,600	0.01
USD 490,000	Symphony CLO XXIII 8.662% 15/1/2034	459,045	0.01
USD 263,000	Tiaa Clo III 3.89% 16/1/2031	260,662	0.00
USD 750,000	Tiaa Clo III 4.24% 16/1/2031	719,475	0.01
USD 2,750,000	TICP CLO IX 3.85% 20/1/2031	2,725,714	0.03
USD 500,000	TICP CLO XI 3.89% 20/10/2031	491,571	0.01
USD 334,000	Times China 5.75% 14/1/2027*	50,100	0.00
USD 200,000	Times China 6.75% 16/7/2023	47,000	0.00
GBP 800,000	Trafford Centre Finance 2.561% 28/7/2035	752,231	0.01
USD 4,470,300	Transocean Phoenix 2 7.75% 15/10/2024	4,342,494	0.05
USD 398,700	Transocean Proteus 6.25% 1/12/2024	384,062	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ケイマン諸島(続き)		
USD 351,000	TRESTLES CLO II 4.453% 25/7/2031	339,823	0.00
USD 11,930,000	Triaxx Prime CDO 2006-1 2.061% 3/3/2039	78,046	0.00
USD 950,000	TRINITAS CLO IV 4.14% 18/10/2031	925,565	0.01
USD 590,000	Trinitas CLO XIV 4.783% 25/1/2034	570,477	0.01
USD 625,000	Trinitas CLO XIV 5.783% 25/1/2034	613,297	0.01
USD 1,855,000	Voya CLO 2013-2 3.773% 25/4/2031	1,830,641	0.02
USD 1,040,000	Voya CLO 2016-1 5.389% 20/1/2031	928,536	0.01
USD 3,500,000	Voya Clo 2017-4 3.642% 15/10/2030	3,452,932	0.04
USD 234,000	Wynn Macau 5.125% 15/12/2029	164,385	0.00
USD 280,000	Wynn Macau 5.5% 15/1/2026*	219,100	0.00
USD 200,000	Wynn Macau 5.5% 1/10/2027	146,500	0.00
USD 1,000,000	York CLO 1 4.409% 22/10/2029	965,825	0.01
USD 250,000	York CLO 1 5.769% 22/10/2029	236,691	0.00
USD 760,000	Yuzhou 6% 25/10/2023	57,000	0.00
USD 810,000	Yuzhou 8.375% 30/10/2024	60,750	0.00
USD 720,000	Yuzhou 8.5% 4/2/2023	54,000	0.00
USD 1,955,000	Yuzhou 8.5% 26/2/2024	146,625	0.00
USD 517,000	Zhenro Properties 6.63% 7/1/2026	25,850	0.00
USD 3,429,000	ZTO Express Cayman 1.5% 1/9/2027	3,514,725	0.04
		268,765,164	2.97
	チリ		
USD 2,630,000	VTR Comunicaciones 4.375% 15/4/2029	1,591,150	0.02
USD 1,326,000	VTR Comunicaciones 5.125% 15/1/2028	902,794	0.01
		2,493,944	0.03
	中国		
CNY 48,000,000	China Development Bank 3.3% 1/2/2024	7,082,098	0.08
USD 2,018,000	Prime Bloom 0% 5/7/2022***	338,015	0.00
USD 529,000	ZhongAn Online P&C Insurance 3.5% 8/3/2026	433,515	0.01
		7,853,628	0.09
	コロンビア		
USD 1,261,000	Colombia Government International Bond 4.125% 22/2/2042	796,952	0.01
USD 2,031,000	Colombia Government International Bond 4.125% 15/5/2051	1,206,262	0.01
USD 8,237,000	Colombia Government International Bond 4.5% 15/3/2029	7,228,235	0.08
USD 1,303,000	Colombia Telecomunicaciones 4.95% 17/7/2030	1,091,566	0.01
COP 18,146,000,000	Colombian TES 7% 26/3/2031	3,027,350	0.03
COP 15,809,000,000	Colombian TES 7.25% 18/10/2034	2,520,214	0.03
USD 8,547,000	Ecopetrol 6.875% 29/4/2030	7,927,342	0.09
USD 1,818,000	Empresas Publicas de Medellin 4.25% 18/7/2029	1,503,613	0.02
USD 1,428,000	Empresas Publicas de Medellin 4.375% 15/2/2031	1,148,362	0.01
USD 1,303,000	Oleoducto Central 4% 14/7/2027	1,130,353	0.01
USD 1,590,000	Promigas / Gases del Pacifico 3.75% 16/10/2029	1,363,027	0.02
USD 1,499,000	Promigas / Gases del Pacifico 3.75% 16/10/2029*	1,285,018	0.01
USD 1,951,000	Transportadora de Gas Internacional 5.55% 1/11/2028	1,879,764	0.02
		32,108,058	0.35

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	コートジボワール		
EUR 2,003,000	Ivory Coast Government International Bond 6.625% 22/3/2048	1,386,708	0.02
	キプロス		
EUR 725,000	Bank of Cyprus 2.5% 24/6/2027	574,368	0.01
	デンマーク		
EUR 3,842,000	Danske Bank 1.5% 2/9/2030	3,469,860	0.04
EUR 400,000	Nykredit Realkredit 4.125% 15/4/2171	366,738	0.00
		3,836,598	0.04
	エクアドル		
USD 95,484	Ecuador Government International Bond 0% 31/7/2030	33,369	0.00
USD 534,131	Ecuador Government International Bond 1.5% 31/7/2040	188,674	0.00
USD 1,165,440	Ecuador Government International Bond 2.5% 31/7/2035	459,005	0.01
USD 444,717	Ecuador Government International Bond 5.5% 31/7/2030	238,455	0.00
		919,503	0.01
	フィンランド		
EUR 231,000	Citycon 4.496% 22/2/2171	174,573	0.00
EUR 1,525,000	Finnair 4.25% 19/5/2025	1,234,302	0.02
EUR 200,000	SBB Treasury 0.75% 14/12/2028	128,834	0.00
EUR 1,200,000	SBB Treasury 1.125% 26/11/2029	771,019	0.01
		2,308,728	0.03
	フランス		
EUR 7,771	Accor 0.7% 7/12/2027	330,728	0.00
EUR 1,500,000	Air France-KLM 3.875% 1/7/2026*	1,294,382	0.01
EUR 1,468,000	Altice France 2.125% 15/2/2025	1,329,112	0.01
EUR 2,739,000	Altice France 2.5% 15/1/2025*	2,497,756	0.03
EUR 592,000	Altice France 4.125% 15/1/2029	471,361	0.01
EUR 952,000	Altice France 4.25% 15/10/2029*	757,080	0.01
EUR 6,484,000	Altice France 5.875% 1/2/2027*	5,901,945	0.07
EUR 700,000	Arkema 1.5% 21/1/2171	612,414	0.01
EUR 3,300,000	Banque Federative du Credit Mutuel 3.875% 16/6/2032	3,194,225	0.03
USD 800,000	BNP Paribas 6.625% 25/9/2170	774,247	0.01
USD 800,000	BNP Paribas 7.375% 19/2/2171*	805,871	0.01
USD 1,600,000	BNP Paribas 7.75% 16/2/2171	1,598,000	0.02
EUR 825,000	Burger King France 5.017% 1/11/2026	790,472	0.01
EUR 879,000	CAB SELAS 3.375% 1/2/2028	736,418	0.01
USD 800,000	Carrefour 0% 14/6/2023	774,820	0.01
EUR 1,300,000	Casino Guichard Perrachon 3.992% 31/1/2171	487,788	0.01
EUR 1,358,000	Casino Guichard Perrachon 5.25% 15/4/2027	770,216	0.01
EUR 700,000	Casino Guichard Perrachon 6.625% 15/1/2026	432,919	0.01
EUR 1,399,000	CGG 7.75% 1/4/2027*	1,240,461	0.01
EUR 1,344,000	Chrome Bidco 3.5% 31/5/2028	1,182,342	0.01
EUR 1,715,000	CMA CGM 7.5% 15/1/2026	1,777,042	0.02
USD 300,000	Credit Agricole 4.75% 23/3/2171	235,636	0.00
USD 2,000,000	Danone 2.589% 2/11/2023	1,968,838	0.02

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	フランス(続き)		
EUR 8,202,000	d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement 0.625% 16/9/2028	6,631,426	0.07
EUR 800,000	Electricite de France 2.625% 1/6/2171	593,043	0.01
EUR 1,600,000	Electricite de France 2.875% 15/3/2171	1,278,551	0.02
EUR 200,000	Electricite de France 3% 3/12/2170	149,664	0.00
EUR 4,600,000	Electricite de France 3.375% 15/9/2170	3,423,875	0.04
EUR 2,100,000	Electricite de France 4% 4/10/2170	1,944,387	0.02
EUR 400,000	Electricite de France 5% 22/1/2171	359,255	0.00
EUR 3,000,000	Electricite de France 5.375% 29/1/2171*	2,830,219	0.03
GBP 2,600,000	Electricite de France 6% 29/7/2171	2,664,325	0.03
EUR 3,364,000	Faurecia 2.75% 15/2/2027*	2,778,414	0.03
EUR 600,000	Faurecia 3.125% 15/6/2026	534,176	0.01
EUR 783,000	Faurecia 3.75% 15/6/2028	648,110	0.01
EUR 160,306	FCT Autonoria 2019 1.259% 25/9/2035	157,765	0.00
EUR 96,328	FCT Autonoria 2019 1.659% 25/9/2035	94,177	0.00
EUR 192,079	FCT Autonoria 2019 2.759% 25/9/2035	187,542	0.00
EUR 160,306	FCT Autonoria 2019 3.759% 25/9/2035	156,226	0.00
EUR 46,916	FCT E-Carat 10 1.503% 20/12/2028	46,679	0.00
EUR 70,374	FCT E-Carat 10 2.353% 20/12/2028	69,257	0.00
EUR 263,344	FCT Noria 2018-1 1.559% 25/6/2038	258,078	0.00
EUR 263,344	FCT Noria 2018-1 2.709% 25/6/2038	256,779	0.00
EUR 278,173	FCT Noria 2021 0.759% 25/10/2049	270,955	0.01
EUR 278,173	FCT Noria 2021 1.159% 25/10/2049	268,185	0.00
EUR 834,519	FCT Noria 2021 1.559% 25/10/2049	796,717	0.01
EUR 300,000	FCT Pixel 2021 2.218% 25/2/2038	287,212	0.01
EUR 1,338,000	Goldstory 5.375% 1/3/2026	1,181,106	0.01
EUR 675,000	Goldstory 6.12% 1/3/2026*	627,798	0.01
EUR 300,000	Harmony French Home Loans FCT 2021-1 1.468% 27/5/2061	286,901	0.00
EUR 400,000	iliad 1.5% 14/10/2024	381,602	0.00
EUR 800,000	iliad 1.875% 11/2/2028	669,877	0.01
EUR 300,000	iliad 2.375% 17/6/2026	279,044	0.00
EUR 920,000	Iliad 5.125% 15/10/2026	873,811	0.01
EUR 300,000	Iliad 5.625% 15/10/2028	277,174	0.00
EUR 12,306	Korian 0.875% 6/3/2027	545,625	0.01
GBP 1,800,000	Korian 4.125% 15/6/2171	1,640,009	0.02
EUR 1,100,000	La Financiere Atalian 4% 15/5/2024	1,047,943	0.01
EUR 1,436,000	La Financiere Atalian 5.125% 15/5/2025	1,371,748	0.02
GBP 2,570,000	La Financiere Atalian 6.625% 15/5/2025	2,856,322	0.03
EUR 1,900,000	La Poste 3.125% 29/1/2171	1,768,332	0.02
EUR 528,000	Loxam 3.25% 14/1/2025	492,102	0.01
EUR 2,157,000	Loxam 3.75% 15/7/2026*	1,962,335	0.02
EUR 400,000	Loxam 4.25% 15/4/2024*	390,700	0.00
EUR 1,306,000	Loxam 4.5% 15/2/2027*	1,195,329	0.01
EUR 200,000	Loxam 5.75% 15/7/2027*	168,635	0.00
EUR 575,000	Midco GB 7.75% 1/11/2027	554,562	0.01
EUR 400,000	Novafives 5% 15/6/2025*	267,995	0.00
EUR 1,800,000	Orano 2.75% 8/3/2028	1,623,570	0.02

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	フランス(続き)		
EUR 100,000	Orano 3.375% 23/4/2026	96,549	0.00
EUR 1,712,000	Paprec 3.5% 1/7/2028	1,422,146	0.02
EUR 1,635,000	Picard Groupe 3.875% 1/7/2026*	1,454,468	0.02
EUR 300,000	Quatrim 5.875% 15/1/2024	274,099	0.00
EUR 5,400,000	RCI Banque 2.625% 18/2/2030	4,756,074	0.05
EUR 500,000	Renault 2.375% 25/5/2026	438,979	0.00
EUR 900,000	Societe Generale 1% 24/11/2030	792,634	0.01
EUR 11,900,000	Societe Generale 1.125% 30/6/2031	10,245,196	0.11
USD 1,600,000	Societe Generale 7.375% 4/4/2171*	1,559,512	0.02
USD 1,800,000	Societe Generale 7.875% 18/6/2171	1,787,798	0.02
USD 1,600,000	Societe Generale 8% 29/3/2171	1,616,696	0.02
USD 200,000	Societe Generale 8% 29/3/2171	202,087	0.00
EUR 1,300,000	Solvay Finance 5.425% 12/11/2170	1,295,293	0.01
EUR 3,889,000	Solvay Finance 5.869% 3/6/2171*	3,913,242	0.04
EUR 2,700,000	Suez 2.875% 19/4/2171*	2,627,557	0.03
EUR 5,900,000	Teleperformance 3.75% 24/6/2029*	5,967,205	0.07
EUR 176,000	Tereos Finance Groupe I 7.5% 30/10/2025	178,601	0.00
EUR 1,190,000	TotalEnergies 1.625% 25/1/2171	984,256	0.01
EUR 700,000	TotalEnergies 1.75% 4/4/2171	663,545	0.01
EUR 2,700,000	TotalEnergies 2.625% 26/2/2171	2,554,533	0.03
EUR 1,264,000	Vallourec 8.5% 30/6/2026*	1,210,625	0.01
		121,152,705	1.34
	ドイツ		
USD 2,600,000	Allianz 3.2% 30/4/2171*	1,986,356	0.02
EUR 9,300,000	Bayer 2.375% 12/11/2079	8,411,344	0.09
EUR 2,343,000	Bayer 3.75% 1/7/2074	2,267,230	0.02
EUR 8,000,000	Bertelsmann 3% 23/4/2075	7,879,794	0.09
EUR 17,920,000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.7% 15/8/2032*	18,254,544	0.20
EUR 1,259,000	Cheplapharm Arzneimittel 3.5% 11/2/2027	1,135,011	0.01
EUR 5,032,000	Cheplapharm Arzneimittel 4.375% 15/1/2028	4,551,744	0.05
EUR 2,600,000	Commerzbank 6.125% 9/4/2171	2,371,962	0.03
EUR 2,800,000	DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate 1.875% 15/10/2024	2,335,394	0.03
EUR 2,100,000	Deutsche Bahn Finance 0.95% 22/4/2171*	1,913,130	0.02
EUR 2,995,000	Deutsche Bahn Finance 1.125% 29/5/2051	1,948,777	0.02
EUR 2,700,000	Deutsche Bank 3.25% 24/5/2028	2,524,413	0.03
EUR 2,300,000	Deutsche Bank 4% 24/6/2032	2,085,503	0.02
EUR 2,200,000	Deutsche Bank 4.5% 30/4/2171	1,732,476	0.02
EUR 200,000	Deutsche Bank 6.75% 30/4/2171	178,927	0.00
EUR 11,900,641	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.1% 15/4/2026*	14,947,451	0.17
EUR 500,000	Deutsche Lufthansa 1.625% 16/11/2023	484,719	0.01
EUR 1,300,000	Deutsche Lufthansa 2% 14/7/2024	1,239,948	0.01
EUR 1,800,000	Deutsche Lufthansa 2.875% 16/5/2027	1,459,655	0.02
EUR 2,000,000	Deutsche Lufthansa 3.5% 14/7/2029	1,560,122	0.02
EUR 1,200,000	Deutsche Lufthansa 3.75% 11/2/2028	995,781	0.01
EUR 900,000	DIC Asset 2.25% 22/9/2026	694,424	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ドイツ (続き)		
EUR 700,000	Douglas 6% 8/4/2026*	576,569	0.01
EUR 700,000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg 1.125% 5/11/2079	630,825	0.01
EUR 200,000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg 1.625% 5/8/2079*	160,797	0.00
EUR 8,900,000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg 2.125% 31/8/2081	6,206,886	0.07
EUR 1,270,000	Fraport Frankfurt Airport Services Worldwide 1.875% 31/3/2028	1,115,687	0.01
EUR 660,000	Gruenenthal 3.625% 15/11/2026*	612,734	0.01
EUR 1,638,000	Gruenenthal 4.125% 15/5/2028*	1,506,814	0.02
EUR 284,000	HT Troplast 9.25% 15/7/2025	249,758	0.00
EUR 779,000	IHO Verwaltungs 3.75% 15/9/2026	689,985	0.01
EUR 969,715	IHO Verwaltungs 3.875% 15/5/2027	804,681	0.01
USD 200,000	IHO Verwaltungs 6% 15/5/2027	178,104	0.00
EUR 10,908,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.375% 7/6/2032*	10,141,281	0.11
EUR 2,568,000	LANXESS 4.5% 6/12/2076	2,533,525	0.03
EUR 10,394,000	Nidda Healthcare 3.5% 30/9/2024*	9,601,695	0.11
EUR 642,000	Nidda Healthcare 3.5% 30/9/2024	595,442	0.01
EUR 401,000	Novelis Sheet Ingot 3.375% 15/4/2029	340,417	0.01
EUR 1,781,000	PCF 4.75% 15/4/2026*	1,535,883	0.02
EUR 1,144,000	PCF 4.75% 15/4/2026	949,969	0.01
EUR 2,200,000	ProGroup 3% 31/3/2026*	1,882,119	0.02
EUR 200,000	Red & Black Auto Germany 8 UG 0.723% 15/9/2030	195,073	0.00
EUR 400,000	Red & Black Auto Germany 8 UG 0.923% 15/9/2030	384,911	0.01
EUR 100,000	Red & Black Auto Germany 8 UG 1.323% 15/9/2030	95,266	0.00
EUR 1,539,000	Renk 5.75% 15/7/2025	1,446,575	0.02
EUR 2,550,000	RWE 2.75% 24/5/2030	2,418,378	0.02
EUR 467,000	Schenck Process 5.375% 15/6/2023	454,201	0.00
EUR 565,000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2% 15/7/2025	523,088	0.01
EUR 1,281,871	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 6% 30/7/2026*	1,205,388	0.01
EUR 766,000	Tele Columbus 3.875% 2/5/2025	654,499	0.00
EUR 952,000	thyssenkrupp 1.875% 6/3/2023	934,576	0.01
EUR 95,000	thyssenkrupp 2.5% 25/2/2025*	89,143	0.00
EUR 3,017,000	thyssenkrupp 2.875% 22/2/2024*	2,922,137	0.03
EUR 1,260,000	TK Elevator Holdco 6.625% 15/7/2028	1,086,197	0.01
EUR 2,719,000	TK Elevator Midco 4.375% 15/7/2027	2,416,628	0.03
EUR 1,652,000	TK Elevator Midco 4.75% 15/7/2027	1,580,464	0.02
EUR 5,200,000	Volkswagen Leasing 0.625% 19/7/2029	4,175,604	0.05
EUR 1,600,000	ZF Finance 2% 6/5/2027	1,284,169	0.01
EUR 400,000	ZF Finance 2.25% 3/5/2028	305,830	0.00
EUR 800,000	ZF Finance 2.75% 25/5/2027	660,669	0.01
EUR 2,200,000	ZF Finance 3% 21/9/2025*	2,003,754	0.02
EUR 5,900,000	ZF Finance 3.75% 21/9/2028*	4,841,560	0.05
		150,949,986	1.68
	ガーナ		
USD 1,489,000	Ghana Government International Bond 7.625% 16/5/2029	597,461	0.01
	ギリシャ		
EUR 2,820,000	Hellenic Republic Government Bond 0% 12/2/2026	2,541,605	0.03

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ギリシャ(続き)		
EUR 5,548,000	Hellenic Republic Government Bond 1.875% 24/1/2052*	3,283,722	0.03
EUR 1,549,000	Public Power 3.375% 31/7/2028	1,239,633	0.01
EUR 480,000	Public Power 3.875% 30/3/2026	427,015	0.01
		7,491,975	0.08
	ガーンジー		
USD 111,822	Doric Nimrod Air Alpha 2013-1 Class A Pass Through Trust 5.25% 30/5/2025	110,199	0.00
	香港		
USD 847,000	Bank of East Asia 5.825% 21/4/2171	808,004	0.01
USD 402,000	Bank of East Asia 5.875% 19/3/2171	392,374	0.00
USD 941,000	Yango Justice International 7.5% 15/4/2024	61,165	0.00
USD 680,000	Yango Justice International 7.5% 17/2/2025	44,200	0.00
USD 490,000	Yango Justice International 7.875% 4/9/2024	31,850	0.00
		1,337,593	0.01
	インド		
USD 699,000	Adani Green Energy 4.375% 8/9/2024	632,595	0.01
USD 500,000	Adani Transmission Step-One 4% 3/8/2026	470,505	0.00
USD 400,000	Bharti Airtel 3.25% 3/6/2031*	346,818	0.00
USD 375,000	GMR Hyderabad International Airport 4.75% 2/2/2026	348,281	0.01
USD 400,000	Oil India 5.125% 4/2/2029*	394,260	0.00
USD 400,000	Power Finance 4.5% 18/6/2029	379,583	0.01
USD 285,000	Shriram Transport Finance 5.1% 16/7/2023*	280,012	0.00
USD 445,000	Summit Digital Infrastructure 2.875% 12/8/2031	346,370	0.00
		3,198,424	0.03
	インドネシア		
USD 690,000	Bank Negara Indonesia Persero 3.75% 30/3/2026	646,875	0.01
USD 1,360,000	Freeport Indonesia 4.763% 14/4/2027	1,326,000	0.01
USD 600,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 3.8% 23/6/2050	496,500	0.01
		2,469,375	0.03
	国際機関(International)		
EUR 5,490,000	European Union 0.7% 6/7/2051	3,531,394	0.04
	アイルランド		
GBP 999,626	Agora UK 2021 2.787% 22/7/2031	1,109,329	0.01
EUR 2,900,000	AIB 1.875% 19/11/2029	2,682,292	0.03
EUR 4,675,000	AIB 2.875% 30/5/2031	4,278,954	0.05
EUR 1,000,000	AIB 5.25% 9/4/2171	920,897	0.01
EUR 5,149,000	AIB 6.25% 23/12/2170	4,909,111	0.05
EUR 800,000	AlbaCore EURO CLO I 5.962% 18/10/2034	675,685	0.01
EUR 2,680,000	Alme Loan Funding V 5.41% 15/7/2031	2,339,999	0.03
EUR 838,000	Anchorage Capital Europe CLO 2 1.6% 15/4/2034	795,669	0.01
EUR 180,000	Anchorage Capital Europe CLO 2 6.45% 15/4/2034	160,596	0.00
EUR 200,000	Anchorage Capital Europe CLO 2021-4 5.855% 25/4/2034	171,432	0.00
EUR 1,000,000	Aqueduct European CLO 5-2020 2.047% 20/4/2034	919,071	0.01
EUR 400,000	ARBOUR CLO VIII 6.11% 15/10/2034	342,832	0.00
EUR 1,200,000	Ares European CLO VII 1.5% 15/10/2030	1,151,076	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	アイルランド(続き)		
EUR 250,000	Ares European CLO VII 5.26% 15/10/2030	218,299	0.00
EUR 405,000	Ares European CLO VIII 3.802% 17/4/2032	382,095	0.00
EUR 2,150,000	Ares European CLO X 2.8% 15/10/2031	1,945,035	0.02
EUR 858,000	Ares European CLO XII 1.747% 20/4/2032	816,587	0.01
EUR 875,000	Ares European CLO XII 3.047% 20/4/2032	799,097	0.01
EUR 2,100,000	Armada Euro CLO III 3.3% 15/7/2031	1,962,718	0.02
USD 3,778,000	ASG Finance Designated Activity 7.875% 3/12/2024	3,485,205	0.04
GBP 1,906,199	Atom Mortgage 3.487% 22/7/2031	2,112,128	0.02
GBP 2,158,089	Atom Mortgage 4.387% 22/7/2031	2,293,402	0.03
EUR 300,000	Aurium CLO II 6.08% 22/6/2034	255,401	0.00
EUR 550,000	Avoca CLO XIV 0% 12/1/2031	239,010	0.00
EUR 150,000	Avoca CLO XIV 4.7% 12/1/2031	126,298	0.00
EUR 150,000	Avoca CLO XIV 6.35% 12/1/2031	111,726	0.00
EUR 380,000	Avoca CLO XV 4.13% 15/4/2031	321,013	0.00
EUR 350,000	Avoca CLO XVIII 1.75% 15/4/2031	331,329	0.00
EUR 270,000	Avoca CLO XX 5.75% 15/7/2032	235,535	0.00
EUR 290,000	Avoca CLO XXII 1.3% 15/4/2035	267,285	0.00
EUR 280,000	Avoca CLO XXII 2.9% 15/4/2035	248,204	0.00
EUR 280,000	Avoca CLO XXII 5.23% 15/4/2035	232,138	0.00
EUR 400,000	Avoca CLO XXII 5.23% 15/4/2035	331,626	0.00
EUR 1,000,000	Avoca CLO XXIII 3.05% 15/4/2034	913,707	0.01
EUR 1,020,000	Avoca CLO XXV 6.14% 15/10/2034	891,476	0.01
EUR 2,850,000	Bank of Ireland 1.375% 11/8/2031*	2,435,191	0.03
GBP 2,000,000	Bank of Ireland 3.125% 19/9/2027	2,323,151	0.02
EUR 300,000	BBAM European CLO I 6.035% 22/7/2034	255,836	0.00
EUR 800,000	BBAM European CLO II 6.11% 15/10/2034	683,295	0.01
EUR 701,299	Bilbao CLO I 4.777% 20/7/2031	592,145	0.01
EUR 800,000	Bilbao CLO II 6.361% 20/8/2035	680,637	0.01
EUR 300,000	BlueMountain 2021-1 CLO 5.41% 15/4/2034	249,732	0.00
EUR 250,000	BlueMountain Euro 2021-2 CLO 1.75% 15/10/2035	237,359	0.00
EUR 900,000	BlueMountain Fuji CLO III 2.9% 15/1/2031	830,960	0.01
EUR 800,000	BlueMountain Fuji CLO IV 6.678% 25/2/2034	697,277	0.01
EUR 500,000	BlueMountain Fuji CLO V 2.45% 15/1/2033	470,258	0.01
EUR 800,000	Cairn CLO XIV 6.348% 29/10/2034	685,037	0.01
EUR 300,000	Capital Four CLO II 5.91% 15/1/2034	257,755	0.00
EUR 582,000	Capital Four CLO III 6.06% 15/10/2034	495,261	0.01
EUR 650,000	CIFC European Funding CLO I 5.86% 15/7/2032	565,643	0.01
EUR 400,000	CIFC European Funding CLO II 1.6% 15/4/2033	379,145	0.00
EUR 500,000	CIFC European Funding CLO III 2.5% 15/1/2034	476,276	0.01
EUR 200,000	CIFC European Funding CLO III 5.61% 15/1/2034	170,672	0.00
EUR 1,580,000	Clontarf Park CLO 3.302% 5/8/2030	1,498,940	0.02
EUR 539,000	Contego CLO IX 6.155% 24/1/2034	460,494	0.01
EUR 800,000	Contego CLO VIII 6.205% 25/1/2034	691,273	0.01
EUR 330,000	CVC Cordatus Loan Fund IV 1.691% 22/2/2034	306,982	0.00
EUR 400,000	CVC Cordatus Loan Fund V 1.542% 21/7/2030	384,207	0.00
EUR 400,000	CVC Cordatus Loan Fund XIX 3.8% 23/12/2033	372,744	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	アイルランド(続き)		
EUR 930,000	CVC Cordatus Loan Fund XVII 6.453% 18/11/2033	805,243	0.01
EUR 522,000	CVC Cordatus Loan Fund XVIII 6.298% 29/7/2034	444,988	0.01
EUR 1,550,000	CVC Cordatus Loan Fund XX 3% 22/6/2034	1,396,462	0.02
EUR 158,000	CVC Cordatus Loan Fund XX 5.61% 22/6/2034	132,123	0.00
EUR 840,000	CVC Cordatus Loan Fund XX 5.61% 22/6/2034	702,425	0.01
EUR 480,000	CVC Cordatus Loan Fund XXI 5.93% 22/9/2034	404,729	0.01
EUR 250,000	Dartry Park CLO 3.562% 28/1/2034	231,271	0.00
EUR 200,000	eircom Finance 1.75% 1/11/2024	192,740	0.00
EUR 250,000	Euro-Galaxy III CLO 2.495% 24/4/2034	237,457	0.00
EUR 510,000	Euro-Galaxy III CLO 3.395% 24/4/2034	477,001	0.01
EUR 1,210,000	Euro-Galaxy V CLO 6.141% 15/2/2034	1,042,718	0.01
EUR 593,000	Fair Oaks Loan Funding III 6.11% 15/10/2034	503,663	0.01
EUR 1,510,000	Fidelity Grand Harbour CLO 2021-1 3.6% 15/10/2034	1,407,319	0.02
GBP 460,221	Frost CMBS 2021-1 3.043% 20/11/2033	522,513	0.01
EUR 800,000	Glencore Capital Finance 1.25% 1/3/2033	583,135	0.01
EUR 260,000	Harvest CLO XIX 2.55% 14/4/2031	239,174	0.00
EUR 700,000	Harvest CLO XVIII 1.2% 15/10/2030	666,158	0.01
EUR 390,000	Harvest CLO XXIII 3.047% 20/10/2032	359,370	0.00
EUR 714,793	Haus European Loan Conduit No 39 0.917% 28/7/2051	689,607	0.01
EUR 210,939	Haus European Loan Conduit No 39 1.367% 28/7/2051	199,065	0.00
EUR 840,757	Haus European Loan Conduit No 39 1.667% 28/7/2051	771,130	0.01
EUR 1,977,429	Haus European Loan Conduit No 39 2.267% 28/7/2051	1,811,472	0.02
EUR 130,000	Henley CLO IV 1.495% 25/4/2034	120,651	0.00
EUR 250,000	Henley CLO IV 3.145% 25/4/2034	225,385	0.00
EUR 300,000	Henley CLO IV 5.395% 25/4/2034	246,472	0.00
EUR 385,000	Invesco Euro CLO 5.99% 15/7/2034	331,164	0.00
EUR 450,000	Invesco Euro Clo III 1.75% 15/7/2032	430,552	0.01
EUR 229,414	Invesco Euro Clo III 8.07% 15/7/2032	199,840	0.00
EUR 625,000	Invesco Euro CLO IV 1.7% 15/4/2033	590,853	0.01
EUR 450,000	Invesco Euro CLO V 3.8% 15/1/2034	426,330	0.01
EUR 200,000	Invesco Euro CLO V 5.81% 15/1/2034	173,379	0.00
EUR 573,428	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 1.089% 17/8/2033	547,379	0.01
EUR 349,434	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 1.389% 17/8/2033	331,375	0.00
EUR 1,349,951	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 1.739% 17/8/2033	1,270,041	0.01
EUR 1,045,316	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 2.239% 17/8/2033	1,020,406	0.01
EUR 938,803	Last Mile PE 2021 1.539% 17/8/2031	895,440	0.01
EUR 1,060,777	Last Mile PE 2021 1.939% 17/8/2031	981,642	0.01
EUR 1,160,000	Madison Park Euro Funding XIV 3.6% 15/7/2032	1,108,457	0.01
EUR 1,250,000	Madison Park Euro Funding XVI 3.2% 25/5/2034	1,137,294	0.01
EUR 1,050,000	Man GLG Euro CLO 3.5% 15/10/2032	992,605	0.01
EUR 150,000	Marino Park CLO 5.672% 16/1/2034	130,884	0.00
EUR 188,000	Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO 5.522% 17/4/2034	158,310	0.00
EUR 699,000	Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO 2 6.06% 15/4/2034	599,360	0.01
EUR 120,000	North Westerly VII ESG CLO 5.981% 15/5/2034	100,406	0.00
EUR 250,000	Northwoods Capital 19 Euro 2.5% 25/11/2033	240,596	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	アイルランド(続き)		
EUR 300,000	Northwoods Capital 21 Euro 6.185% 22/7/2034	257,596	0.00
EUR 200,000	Northwoods Capital 23 Euro 6.21% 15/3/2034	175,905	0.00
EUR 425,000	OAK Hill European Credit Partners V Designated Activity 1.942% 21/1/2035	407,273	0.01
EUR 450,000	OAK Hill European Credit Partners VI 1.247% 20/1/2032	427,639	0.01
EUR 800,000	OCP Euro CLO 2017-2 1.35% 15/1/2032	765,267	0.01
EUR 250,000	OCP Euro CLO 2019-3 2.347% 20/4/2033	235,154	0.00
EUR 250,000	OCP Euro CLO 2019-3 3.347% 20/4/2033	235,648	0.00
EUR 200,000	OCP Euro CLO 2019-3 6.067% 20/4/2033	172,674	0.00
EUR 1,128,144	Pearl Finance 2020 2.239% 17/11/2032	1,133,449	0.01
EUR 1,354,717	Pearl Finance 2020 2.839% 17/11/2032	1,338,359	0.02
EUR 650,000	Penta CLO 11 2.45% 15/11/2034	633,131	0.01
EUR 470,000	Penta CLO 11 4.8% 15/11/2034	450,443	0.01
EUR 500,000	Penta CLO 6 1.845% 25/7/2034	468,077	0.01
EUR 500,000	Penta CLO 6 2.445% 25/7/2034	468,625	0.01
EUR 930,000	Penta CLO 8 5.93% 15/1/2034	895,561	0.01
EUR 1,750,000	Penta Clo 9 3.245% 25/7/2036	1,567,714	0.02
USD 2,232,800	Prodigy Finance CM2021-1 3.694% 25/7/2051	2,182,836	0.02
USD 1,210,000	Prodigy Finance CM2021-1 4.944% 25/7/2051	1,215,860	0.01
USD 710,000	Prodigy Finance CM2021-1 6.194% 25/7/2051	702,181	0.01
USD 480,000	Prodigy Finance CM2021-1 8.344% 25/7/2051	482,516	0.01
EUR 400,000	Providus Clo III 6.262% 18/7/2034	353,070	0.00
EUR 171,000	Providus CLO V 5.611% 15/2/2035	139,497	0.00
EUR 800,000	Providus Clo VI 6.501% 20/5/2034	683,237	0.01
EUR 443,625	River Green Finance 2020 1.122% 22/1/2032	434,916	0.01
EUR 321,750	River Green Finance 2020 1.472% 22/1/2032	309,243	0.00
EUR 1,339,000	Rockfield Park CLO 5.952% 16/7/2034	1,148,458	0.01
EUR 2,657,000	Rockford Tower Europe CLO 2018-1 1.85% 20/12/2031	2,549,394	0.03
EUR 710,000	Rockford Tower Europe CLO 2018-1 2.47% 20/12/2031	669,031	0.01
EUR 1,300,000	Rockford Tower Europe CLO 2018-1 5.36% 20/12/2031	1,124,994	0.01
EUR 2,480,000	Rockford Tower Europe CLO 2019-1 1.647% 20/1/2033	2,346,591	0.03
EUR 300,000	Rockford Tower Europe CLO 2021-1 6.007% 20/4/2034	259,527	0.00
EUR 976,000	RRE 5 Loan Management 1.75% 15/1/2037	927,897	0.01
EUR 700,000	RRE 6 Loan Management 6.25% 15/4/2035	619,010	0.01
EUR 430,000	RRE 9 Loan Management 1.7% 15/10/2036	401,673	0.00
GBP 2,751,882	Scorpio European Loan Conduit No. 34 3.913% 17/5/2029	3,180,457	0.04
EUR 700,000	Sound Point Euro CLO II Funding 6.382% 26/1/2036	612,970	0.01
EUR 250,000	Sound Point Euro CLO III Funding 2.3% 15/4/2033	232,633	0.00
EUR 300,000	Sound Point Euro CLO V Funding 5.985% 25/7/2035	251,049	0.00
EUR 500,000	St Paul 's CLO X 3.875% 22/4/2035	470,273	0.01
EUR 1,350,000	St Paul 's CLO XII 1.6% 15/4/2033	1,275,735	0.01
EUR 2,020,000	St Paul 's CLO XII 3.2% 15/4/2033	1,881,077	0.02
EUR 650,000	Sutton Park CLO 2.021% 15/11/2031	626,454	0.01
EUR 750,000	Sutton Park CLO 2.671% 15/11/2031	712,029	0.01
EUR 357,825	Taurus 2019-1 FR 1.717% 2/2/2031	348,643	0.00
EUR 382,717	Taurus 2019-1 FR 2.217% 2/2/2031	369,527	0.00
GBP 3,206,283	Taurus 2019-2 UK 3.613% 17/11/2029	3,662,525	0.04

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	アイルランド(続き)		
GBP 1,887,447	Taurus 2019-2 UK 3.913% 17/11/2029	2,147,894	0.02
GBP 879,540	Taurus 2021-1 UK 2.993% 17/5/2031	971,062	0.01
GBP 536,063	Taurus 2021-1 UK 3.343% 17/5/2031	581,753	0.01
GBP 546,983	Taurus 2021-1 UK 4.293% 17/5/2031	587,939	0.01
GBP 553,888	Taurus 2021-4 UK 2.643% 17/8/2031	620,456	0.01
GBP 5,295,359	Taurus 2021-4 UK 3.443% 17/8/2031	5,734,523	0.06
GBP 1,756,595	Taurus 2021-4 UK 3.793% 17/8/2031	1,866,142	0.02
GBP 2,057,000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.875% 15/7/2028	2,034,010	0.03
EUR 250,000	Voya Euro CLO II 1.67% 15/7/2035	237,713	0.00
EUR 500,000	Voya Euro CLO II 2.15% 15/7/2035	460,198	0.01
EUR 446,000	Voya Euro CLO II 6.02% 15/7/2035	380,238	0.00
EUR 439,000	Voya Euro CLO III 1.65% 15/4/2033	413,358	0.01
EUR 840,000	Voya Euro CLO V 3.1% 15/4/2035	760,571	0.01
		137,856,786	1.54
	マン島		
USD 1,085,000	AngloGold Ashanti 3.75% 1/10/2030	929,807	0.01
	イタリア		
EUR 675,000	ASTM 1.5% 25/1/2030*	535,151	0.01
EUR 500,000	ASTM 2.375% 25/11/2033	376,717	0.00
EUR 321,000	Autoflorence 2 0.796% 24/12/2044	307,602	0.00
EUR 414,000	Autoflorence 2 1.196% 24/12/2044	388,437	0.01
EUR 222,000	Autoflorence 2 2.396% 24/12/2044	210,045	0.00
EUR 1,781,000	Banca Monte dei Paschi di Siena 1.875% 9/1/2026*	1,456,844	0.02
EUR 1,100,000	Banca Monte dei Paschi di Siena 2.625% 28/4/2025	946,430	0.01
EUR 200,000	Banca Monte dei Paschi di Siena 3.625% 24/9/2024	181,080	0.00
EUR 1,600,000	Banco BPM 2.875% 29/6/2031	1,327,572	0.02
EUR 400,000	Banco BPM 3.25% 14/1/2031	353,652	0.00
EUR 1,350,000	Banco BPM 3.375% 19/1/2032*	1,117,931	0.01
EUR 294,000	Banco BPM 5% 14/9/2030*	282,037	0.00
EUR 137,000	Brignole 2021 0.846% 24/7/2036	132,194	0.00
EUR 100,000	Brignole 2021 1.646% 24/7/2036	95,376	0.00
EUR 5,978,852	Cassia 2022-1 2.891% 22/5/2034	5,809,462	0.07
EUR 2,857,839	Cassia 2022-1 3.891% 22/5/2034	2,860,314	0.03
EUR 1,698,000	Cedacri Mergeco 4.946% 15/5/2028*	1,645,392	0.02
EUR 2,212,000	Centurion Bidco 5.875% 30/9/2026*	2,052,957	0.02
EUR 406,155	Diocle 3.875% 30/6/2026	404,390	0.00
EUR 1,719,000	doValue 3.375% 31/7/2026*	1,492,340	0.02
EUR 400,000	doValue 5% 4/8/2025	385,470	0.00
EUR 5,554,000	Enel 1.375% 8/9/2170	4,400,557	0.05
EUR 849,000	Enel 3.375% 24/11/2170*	761,684	0.01
EUR 2,023,000	Eni 2% 11/5/2171	1,666,658	0.02
EUR 6,200,000	Eni 2.625% 13/1/2171	5,622,422	0.06
EUR 500,000	Fabric BC 4.707% 31/8/2026	497,099	0.01
EUR 300,000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici 5.625% 1/8/2027	263,000	0.00
EUR 700,000	Gamma Bidco 5.125% 15/7/2025*	660,171	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	イタリア(続き)		
EUR 2,070,000	Hera 2.5% 25/5/2029	1,935,394	0.02
EUR 454,000	IMA Industria Macchine Automatiche 3.75% 15/1/2028	376,035	0.01
EUR 531,000	Inter Media and Communication 6.75% 9/2/2027	489,201	0.00
GBP 350,000	Intesa Sanpaolo 5.148% 10/6/2030	345,544	0.00
EUR 500,000	Intesa Sanpaolo 5.5% 1/3/2171	411,052	0.01
EUR 400,000	Intesa Sanpaolo 5.875% 4/3/2029*	405,675	0.00
EUR 2,550,000	Intesa Sanpaolo 5.875% 1/3/2171*	2,020,151	0.02
EUR 1,773,000	Intesa Sanpaolo 5.875% 20/6/2171	1,652,926	0.02
EUR 800,000	Intesa Sanpaolo 6.375% 30/9/2170*	683,294	0.01
EUR 2,527,000	Intesa Sanpaolo 7.75% 11/7/2171*	2,450,666	0.03
EUR 185,000	Leather 2 4.5% 30/9/2028	144,326	0.00
EUR 1,800,000	Nexi 0% 24/2/2028	1,340,263	0.01
EUR 1,625,000	Poste Italiane 2.625% 24/6/2171	1,180,665	0.01
EUR 312,030	Progetto Quinto 0.469% 27/10/2036	308,775	0.00
EUR 599,000	Red & Black Auto Italy 2.935% 28/12/2031	575,490	0.01
EUR 2,681,000	Rekeep 7.25% 1/2/2026	2,418,057	0.03
EUR 1,132,000	TeamSystem 3.75% 15/2/2028*	1,057,245	0.01
EUR 1,843,000	Telecom Italia 1.625% 18/1/2029*	1,378,549	0.02
EUR 699,000	Telecom Italia 2.75% 15/4/2025	664,854	0.01
EUR 400,000	Telecom Italia 2.875% 28/1/2026	369,619	0.01
EUR 200,000	Telecom Italia 3% 30/9/2025	189,583	0.00
EUR 200,000	Telecom Italia 3.25% 16/1/2023	199,464	0.00
EUR 1,254,000	Telecom Italia 4% 11/4/2024*	1,241,305	0.01
EUR 1,000,000	UniCredit 2% 23/9/2029	910,692	0.01
EUR 4,000,000	UniCredit 2.731% 15/1/2032	3,371,452	0.04
EUR 300,000	UniCredit 4.875% 20/2/2029	297,203	0.00
EUR 1,200,000	UniCredit 5.375% 3/6/2171*	1,030,944	0.01
EUR 2,200,000	UniCredit 6.625% 3/12/2170	2,121,164	0.02
EUR 1,600,000	UniCredit 7.5% 3/6/2171	1,537,462	0.02
EUR 475,000	Unipol Gruppo 3.25% 23/9/2030	431,153	0.01
EUR 215,000	Verde Bidco 4.625% 1/10/2026	181,390	0.00
		67,952,577	0.75
	ジャマイカ		
USD 553,557	Digicel International Finance/Digicel international 8% 31/12/2026	361,196	0.00
USD 1,386,646	Digicel International Finance/Digicel international 8.75% 25/5/2024	1,316,239	0.02
USD 815,040	Digicel International Finance/Digicel international 13% 31/12/2025	679,540	0.01
		2,356,975	0.03
	日本		
JPY 200,000,000	Medipal 0% 7/10/2022	1,445,013	0.02
USD 2,256,000	Mitsubishi UFJ Financial 2.341% 19/1/2028	2,031,335	0.02
USD 3,000,000	Mizuho Financial 3.261% 22/5/2030	2,675,363	0.03
USD 2,205,000	Nomura 5.099% 3/7/2025	2,223,352	0.03
EUR 1,634,000	Rakuten 4.25% 22/4/2171	1,082,665	0.01
EUR 2,288,000	SoftBank 2.125% 6/7/2024	2,096,459	0.02
EUR 1,700,000	SoftBank 2.875% 6/1/2027	1,358,060	0.02

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	日本(続き)		
EUR 1,950,000	SoftBank 3.125% 19/9/2025*	1,717,013	0.02
EUR 2,947,000	SoftBank 4% 19/9/2029	2,209,492	0.03
EUR 400,000	SoftBank 4.5% 20/4/2025	370,726	0.00
USD 300,000	SoftBank 4.75% 19/9/2024	282,750	0.00
EUR 1,281,000	SoftBank 4.75% 30/7/2025*	1,174,632	0.01
EUR 3,200,000	SoftBank 5% 15/4/2028	2,667,197	0.03
USD 300,000	SoftBank 6% 30/7/2025	285,750	0.00
USD 3,791,000	SoftBank 6% 19/1/2171*	3,514,560	0.04
USD 2,487,000	Sumitomo Mitsui Financial 2.472% 14/1/2029	2,152,027	0.02
EUR 174,000	Takeda Pharmaceutical 2% 9/7/2040	134,697	0.00
USD 1,718,000	Takeda Pharmaceutical 2.05% 31/3/2030	1,445,530	0.02
USD 1,139,000	Takeda Pharmaceutical 3.175% 9/7/2050	846,863	0.01
USD 3,600,000	Takeda Pharmaceutical 5% 26/11/2028	3,662,098	0.04
		33,375,582	0.37
	ジャージー		
USD 1,508,000	Aptiv 3.1% 1/12/2051	956,682	0.01
USD 2,835,000	Aptiv / Aptiv 2.396% 18/2/2025	2,704,685	0.03
EUR 500,000	Avis Budget Finance 4.125% 15/11/2024*	490,801	0.01
EUR 600,000	Avis Budget Finance 4.75% 30/1/2026	566,194	0.01
GBP 392,000	CPUK Finance 4.5% 28/8/2027	410,244	0.00
GBP 457,000	CPUK Finance 4.875% 28/2/2047	500,381	0.01
GBP 400,000	CPUK Finance 6.5% 28/8/2026	438,068	0.01
GBP 4,051,000	Galaxy Bidco 6.5% 31/7/2026	4,095,196	0.05
USD 800,000	Galaxy Pipeline Assets Bidco 2.625% 31/3/2036	674,778	0.01
GBP 3,105,000	Heathrow Funding 2.625% 16/3/2028	3,067,896	0.03
GBP 1,300,000	Heathrow Funding 2.75% 13/10/2031	1,306,922	0.01
GBP 1,600,000	Intu Jersey 2 2.875% 1/11/2022	376,115	0.00
GBP 1,769,000	Kane Bidco 6.5% 15/2/2027	1,829,636	0.02
		17,417,598	0.20
	ルクセンブルグ		
EUR 400,000	ADLER 2.25% 14/1/2029*	211,727	0.00
EUR 2,100,000	ADLER 2.75% 13/11/2026	1,171,927	0.01
EUR 4,800,000	ADLER 3.25% 5/8/2025*	2,881,481	0.03
EUR 1,877,000	Allied Universal Holdco /Allied Universal Finance /Atlas Luxco 4 3.625% 1/6/2028	1,524,227	0.02
GBP 883,000	Allied Universal Holdco /Allied Universal Finance /Atlas Luxco 4 4.875% 1/6/2028	839,269	0.01
EUR 1,922,000	Altice Financing 2.25% 15/1/2025	1,742,025	0.02
EUR 300,000	Altice Financing 3% 15/1/2028	240,058	0.00
EUR 2,156,000	Altice Financing 4.25% 15/8/2029	1,752,289	0.02
EUR 438,000	Altice France 8% 15/5/2027	360,095	0.00
EUR 400,000	Aroundtown 3.375% 23/12/2170	316,636	0.01
GBP 1,381,000	Aroundtown 4.75% 25/6/2171*	1,292,527	0.02
USD 1,897,000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	908,725	0.01
EUR 3,927,000	Becton Dickinson Euro Finance 1.336% 13/8/2041	2,526,974	0.03
EUR 452,000	BK LC Lux Finco1 5.25% 30/4/2029	389,195	0.01
EUR 528,000	BL Consumer Credit 2021 1.159% 25/9/2038	512,905	0.01

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 681,000	BL Consumer Credit 2021 1.709% 25/9/2038	645,475	0.01
EUR 356,000	BL Consumer Credit 2021 2.909% 25/9/2038	334,864	0.00
EUR 1,070,000	Cidron Aida Finco 5% 1/4/2028	944,671	0.01
GBP 2,134,000	Cidron Aida Finco 6.25% 1/4/2028	2,124,406	0.02
EUR 1,489,000	Cirsa Finance International 4.5% 15/3/2027	1,258,017	0.01
EUR 1,965,000	Cirsa Finance International 4.75% 22/5/2025	1,823,421	0.02
EUR 1,403,679	Cirsa Finance International 6.25% 20/12/2023	1,383,374	0.02
USD 1,197,000	CSN Resources 5.875% 8/4/2032	993,510	0.01
EUR 1,097,000	Cullinan Holdco 4.625% 15/10/2026	925,191	0.01
EUR 650,000	Dana Financing Luxembourg 3% 15/7/2029	496,362	0.01
USD 548,796	Dragon Aviation Finance Luxembourg 4% 28/11/2022	549,822	0.01
USD 7,193,000	EIG Pearl 4.387% 30/11/2046	5,844,313	0.06
EUR 1,400,000	Eliott Capital 0% 30/12/2022	1,394,259	0.02
EUR 2,300,000	European TopSoho 4% 18/10/2021***	1,769,724	0.02
EUR 400,000	FACT Master 0.953% 20/7/2028	385,847	0.01
EUR 500,000	FACT SA/LU 0.873% 20/11/2025	497,384	0.01
EUR 3,949,000	Garfunkelux Holdco 3 6.75% 1/11/2025*	3,507,532	0.04
GBP 1,814,000	Garfunkelux Holdco 3 7.75% 1/11/2025	1,871,724	0.02
EUR 2,873,298	Germany Compartment Consumer 2020-1 1.723% 14/11/2034	2,851,623	0.03
EUR 1,044,835	Germany Compartment Consumer 2020-1 2.473% 14/11/2034	1,021,355	0.01
USD 765,000	GOL Equity Finance 3.75% 15/7/2024	484,614	0.00
USD 1,788,000	GoI Finance 7% 31/1/2025	1,095,731	0.01
EUR 200,000	Hanesbrands Finance Luxembourg 3.5% 15/6/2024	190,932	0.00
EUR 2,111,000	Herens Midco 5.25% 15/5/2029	1,548,273	0.02
USD 1,280,000	Kenbourne Invest 4.7% 22/1/2028	1,041,126	0.01
USD 4,039,000	Kenbourne Invest 6.875% 26/11/2024	3,921,263	0.04
EUR 1,015,702	LHMC Finco 2 7.25% 2/10/2025	874,266	0.01
EUR 2,800,000	Lincoln Financing 3.625% 1/4/2024	2,739,580	0.03
EUR 200,000	Lincoln Financing 3.875% 1/4/2024	198,980	0.00
EUR 395,000	Lion/Polaris Lux 4 4% 1/7/2026*	368,661	0.00
EUR 500,000	Lune 5.625% 15/11/2028	423,722	0.00
EUR 1,235,000	Matterhorn Telecom 4% 15/11/2027	1,094,126	0.01
USD 2,909,000	MC Brazil Downstream Trading 7.25% 30/6/2031	2,443,560	0.03
USD 1,620,000	Millicom International Cellular 6.625% 15/10/2026	1,592,201	0.02
EUR 2,048,000	Monitchem HoldCo 3 5.25% 15/3/2025*	1,934,637	0.02
USD 699,000	Movida Europe 5.25% 8/2/2031	572,238	0.01
USD 917,000	Puma International Financing 5% 24/1/2026	817,354	0.01
USD 2,064,000	Puma International Financing 5.125% 6/10/2024*	1,950,480	0.02
EUR 400,000	Rossini 4.142% 30/10/2025	391,613	0.00
EUR 4,230,000	Rossini 6.75% 30/10/2025	4,231,823	0.05
EUR 11,678,000	SES 2.875% 27/8/2171	9,619,224	0.11
EUR 5,140,000	SES 3.5% 14/1/2029	4,819,258	0.05
EUR 1,700,000	SES 5.625% 29/1/2171*	1,663,657	0.02
EUR 300,000	Silver Arrow Compartment 10 1.323% 15/3/2027	299,512	0.00
EUR 300,000	Silver Arrow Compartment 10 2.573% 15/3/2027	299,793	0.00
USD 1,903,000	Simpar Europe 5.2% 26/1/2031	1,553,338	0.02

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 1,079,461	Summer BC Holdco A 9.25% 31/10/2027	934,892	0.01
EUR 5,814,000	Summer BC Holdco B 5.75% 31/10/2026	5,373,258	0.06
USD 973,000	Telecom Italia Capital 6.375% 15/11/2033	814,236	0.01
EUR 673,000	Telecom Italia Finance 7.75% 24/1/2033*	703,622	0.01
EUR 2,700,000	Traton Finance Luxembourg 1.25% 24/3/2033*	1,965,164	0.02
		103,254,068	1.15
	マレーシア		
USD 2,350,000	Cindai Capital 0% 8/2/2023	2,313,575	0.03
USD 500,000	TNB Global Ventures Capital 3.244% 19/10/2026	475,470	0.01
		2,789,045	0.04
	マーシャル諸島		
USD 530,000	Danaos 8.5% 1/3/2028	532,316	0.00
	モーリシャス		
USD 1,016,663	Azure Power Energy 3.575% 19/8/2026	655,748	0.01
USD 303,000	Azure Power Solar Energy Pvt 5.65% 24/12/2024	202,380	0.00
USD 333,000	CA Magnum 5.375% 31/10/2026	301,365	0.00
USD 200,000	Greenko Solar Mauritius 5.55% 29/1/2025*	183,000	0.00
USD 2,110,000	HTA 7% 18/12/2025	1,991,882	0.02
USD 292,000	India Green Power 4% 22/2/2027	234,330	0.01
USD 481,000	Network i2i 5.65% 15/4/2171	463,332	0.01
USD 257,000	UPL 5.25% 27/11/2170*	191,736	0.00
		4,223,773	0.05
	メキシコ		
USD 2,986,000	Axtel 6.375% 14/11/2024	2,306,028	0.03
USD 1,735,000	Banco Mercantil del Norte 5.875% 24/1/2171	1,507,281	0.02
USD 1,373,000	Banco Mercantil del Norte 5.875% 24/1/2171*	1,192,794	0.01
USD 1,580,000	Banco Mercantil del Norte 6.625% 24/1/2171	1,350,687	0.02
USD 1,373,000	Banco Mercantil del Norte 6.625% 24/1/2171	1,173,730	0.01
USD 1,373,000	Banco Mercantil del Norte 6.75% 27/9/2170*	1,328,103	0.02
USD 909,000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/2/2032	718,110	0.01
USD 913,000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/2/2032*	715,889	0.00
EUR 998,000	Cemex 3.125% 19/3/2026*	961,084	0.01
USD 623,000	Grupo Televisa SAB 6.625% 15/1/2040	674,002	0.01
USD 926,000	Industrias Penoles 4.75% 6/8/2050*	746,009	0.01
USD 926,000	Industrias Penoles 5.65% 12/9/2049	845,401	0.01
USD1,207,000	Metalsa S A P I De 3.75% 4/5/2031	917,030	0.01
MXN 184,000,000	Mexican Bonos 8.5% 31/5/2029	8,856,022	0.10
MXN 233,600,000	Mexican Bonos 8.5% 18/11/2038	11,036,156	0.12
MXV 65,903	Mexican Udibonos 4.5% 22/11/2035	2,527,397	0.03
USD 1,303,000	Minera Mexico de 4.5% 26/1/2050	1,024,614	0.01
USD 1,207,000	Nemak 3.625% 28/6/2031	922,751	0.01
USD 2,856,000	Operadora de Servicios Mega de Sofom ER 8.25% 11/2/2025	1,696,500	0.02
USD 926,000	Orbia Advance 5.5% 15/1/2048	796,344	0.01
USD 926,000	Orbia Advance 5.875% 17/9/2044	842,079	0.01
USD 1,303,000	Petroleos Mexicanos 5.5% 27/6/2044	778,543	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	メキシコ(続き)		
USD 19,301,000	Petroleos Mexicanos 6.7% 16/2/2032	15,023,898	0.17
USD 1,776,000	Petroleos Mexicanos 6.75% 21/9/2047	1,114,262	0.01
USD 1,383,000	Petroleos Mexicanos 6.875% 16/10/2025*	1,345,521	0.01
MXN 62,256,000	Petroleos Mexicanos 7.19% 12/9/2024	2,810,690	0.03
USD 7,694,000	Petroleos Mexicanos 8.75% 2/6/2029	7,088,117	0.08
USD 244,000	Trust Fibra Uno 5.25% 30/1/2026*	232,877	0.00
USD 551,000	Trust Fibra Uno 6.39% 15/1/2050	449,884	0.01
		70,981,803	0.80
	モンゴル		
USD 837,000	Mongolia Government International Bond 5.125% 7/4/2026*	773,179	0.01
	オランダ		
EUR 1,100,000	Abertis Infraestructuras Finance 3.248% 24/2/2171	948,609	0.01
EUR 900,000	Ashland Services 2% 30/1/2028	768,389	0.01
EUR 4,200,000	ATF Netherlands 3.75% 20/1/2171*	3,913,776	0.04
EUR 500,000	Axalta Coating Systems Dutch B 3.75% 15/1/2025*	475,065	0.01
USD 854,000	Braskem Netherlands Finance 8.5% 23/1/2081	867,134	0.01
USD 978,000	Braskem Netherlands Finance 8.5% 23/1/2081	993,042	0.01
EUR 800,000	Cooperatieve Rabobank 4.625% 29/12/2170	745,921	0.01
EUR 683,936	Domi 2021-1 0.349% 15/6/2053	673,326	0.01
EUR 290,000	Dutch Property Finance 2020-2 1.562% 28/1/2058	281,263	0.00
EUR 740,000	Dutch Property Finance 2021-1 1.312% 28/7/2058	706,797	0.01
EUR 724,820	Dutch Property Finance 2021-2 0.912% 28/4/2059	714,297	0.01
EUR 820,000	Dutch Property Finance 2021-2 1.012% 28/4/2059	768,661	0.01
EUR 504,000	Dutch Property Finance 2021-2 1.262% 28/4/2059	458,058	0.00
USD 1,215,000	Embraer Netherlands Finance 6.95% 17/1/2028	1,216,005	0.01
EUR 1,311,000	Energizer Gamma Acquisition 3.5% 30/6/2029	1,042,694	0.01
EUR 800,000	Ferrovial Netherlands 2.124% 14/5/2171	670,769	0.01
EUR 3,000,000	IMCD 2.125% 31/3/2027*	2,716,230	0.03
EUR 4,400,000	ING Groep 1% 13/11/2030	3,906,443	0.05
EUR 2,000,000	ING Groep 1.25% 16/2/2027	1,850,797	0.02
USD 296,000	ING Groep 1.4% 1/7/2026	267,880	0.00
USD 1,968,000	ING Groep 3.869% 28/3/2026	1,917,922	0.02
USD 676,000	ING Groep 4.625% 6/1/2026	673,358	0.01
EUR 1,043,000	Intertrust 3.375% 15/11/2025*	1,044,076	0.01
EUR 413,000	IPD 3 5.5% 1/12/2025	375,583	0.01
EUR 202,000	Jubilee Place 1.602% 17/1/2059	180,262	0.00
EUR 1,300,000	Koninklijke KPN 2% 8/2/2171	1,214,788	0.01
EUR 527,000	Louis Dreyfus Finance 1.625% 28/4/2028	444,464	0.01
USD 4,013,000	LyondellBasell Industries 5.75% 15/4/2024	4,105,186	0.05
EUR 74,812	Magoi 2019 1.385% 27/7/2039	72,670	0.00
EUR 37,497	Magoi 2019 1.785% 27/7/2039	37,159	0.00
EUR 37,498	Magoi 2019 2.585% 27/7/2039	37,351	0.00
USD 200,000	Metinvest 7.65% 1/10/2027	88,970	0.00
USD 207,000	Metinvest 7.75% 17/10/2029	90,002	0.00
USD 606,000	Metinvest 8.5% 23/4/2026	270,382	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	オランダ(続き)		
USD 485,000	Metinvest 8.5% 23/4/2026	216,395	0.00
USD 227,000	Mondelez International Netherlands 1.25% 24/9/2026	202,096	0.00
USD 450,000	Mong Duong Finance 5.125% 7/5/2029	373,665	0.00
EUR 1,500,000	Naturgy Finance 2.374% 23/2/2171	1,177,632	0.01
EUR 200,000	Naturgy Finance 3.375% 24/4/2171	187,331	0.00
EUR 400,000	Naturgy Finance 4.125% 18/11/2170	397,271	0.01
EUR 133,000	Nobel Bidco 3.125% 15/6/2028	93,210	0.00
USD 946,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3.25% 30/11/2051	644,114	0.01
USD 3,862,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3.875% 18/6/2026	3,747,347	0.04
USD 1,300,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4.3% 18/6/2029	1,234,188	0.01
EUR 601,200	OCI 3.625% 15/10/2025	602,860	0.01
EUR 858,000	OI European 2.875% 15/2/2025	792,769	0.01
EUR 220,000	OI European 3.125% 15/11/2024	209,786	0.00
EUR 900,000	Phoenix PIB Dutch Finance 2.375% 5/8/2025	848,111	0.01
EUR 664,000	Q-Park I 1.5% 1/3/2025*	605,836	0.01
EUR 447,000	Q-Park I 2% 1/3/2027	371,608	0.00
EUR 652,000	Q-Park I 2.62% 1/3/2026*	590,999	0.01
EUR 5,943,000	Repsol International Finance 2.5% 22/3/2171	4,979,407	0.05
EUR 658,000	Repsol International Finance 3.75% 11/6/2171	608,089	0.01
EUR 600,000	Repsol International Finance 4.247% 11/12/2170*	526,877	0.00
EUR 1,170,000	Stellantis 3.375% 7/7/2023	1,179,698	0.01
EUR 272,769	Summer BidCo 9% 15/11/2025	222,565	0.00
EUR 581,510	Summer BidCo 9% 15/11/2025	473,960	0.01
EUR 6,300,000	Telefonica Europe 2.376% 12/5/2171	4,719,851	0.05
EUR 1,800,000	Telefonica Europe 2.625% 7/6/2171	1,766,961	0.02
EUR 2,900,000	Telefonica Europe 3% 4/12/2170	2,794,048	0.03
EUR 1,400,000	Telefonica Europe 3.875% 22/9/2170	1,265,445	0.02
EUR 2,800,000	Telefonica Europe 4.375% 14/3/2171	2,689,158	0.03
EUR 800,000	Telefonica Europe 5.875% 31/3/2171*	803,386	0.01
EUR 1,200,000	TenneT 2.374% 22/10/2170	1,132,988	0.01
EUR 308,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1.25% 31/3/2023	301,417	0.00
EUR 300,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1.625% 15/10/2028	223,611	0.00
EUR 1,100,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1.875% 31/3/2027	895,912	0.01
EUR 2,420,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 3.75% 9/5/2027*	2,129,428	0.02
EUR 887,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 4.375% 9/5/2030	735,720	0.01
EUR 4,037,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 4.5% 1/3/2025	3,888,226	0.04
EUR 660,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 6% 31/1/2025	654,893	0.01
EUR 854,000	Titan II 5.125% 15/7/2029	728,447	0.01
EUR 1,000,000	Trivium Packaging Finance 3.75% 15/8/2026	948,478	0.01
USD 977,000	Trivium Packaging Finance 5.5% 15/8/2026	939,571	0.01
EUR 1,400,000	United 3.625% 15/2/2028	1,107,177	0.01
EUR 3,279,000	United 4% 15/11/2027	2,652,739	0.03
EUR 1,431,000	United 4.625% 15/8/2028	1,173,668	0.01
EUR 4,457,000	United 4.875% 1/7/2024	4,218,139	0.05

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ(続き)			
EUR 596,000	United 5.142% 1/2/2029	538,229	0.01
EUR 3,100,000	Viterra Finance 0.375% 24/9/2025*	2,731,967	0.03
EUR 9,640,000	Viterra Finance 1% 24/9/2028	7,441,719	0.08
USD 252,000	Vivo Energy Investments 5.125% 24/9/2027	236,628	0.00
EUR 1,400,000	Volkswagen International Finance 2.7% 14/12/2170*	1,384,847	0.02
EUR 7,900,000	Volkswagen International Finance 3.375% 27/6/2171	7,582,058	0.09
EUR 1,900,000	Volkswagen International Finance 3.5% 17/6/2171	1,789,507	0.02
EUR 900,000	Volkswagen International Finance 3.748% 28/12/2170*	783,873	0.01
EUR 200,000	Volkswagen International Finance 4.375% 28/3/2171	168,701	0.00
EUR 849,000	VZ Secured Financing 3.5% 15/1/2032	668,629	0.01
USD 350,000	VZ Secured Financing 5% 15/1/2032	285,805	0.00
EUR 4,600,000	Wintershall Dea Finance 0.84% 25/9/2025	4,231,922	0.05
EUR 3,000,000	Wintershall Dea Finance 1.332% 25/9/2028	2,546,853	0.03
EUR 9,900,000	Wintershall Dea Finance 2 2.499% 20/7/2171	7,881,320	0.09
EUR 400,000	ZF Europe Finance 2% 23/2/2026	339,732	0.00
EUR 500,000	ZF Europe Finance 2.5% 23/10/2027	398,642	0.01
EUR 200,000	Ziggo 2.875% 15/1/2030	160,429	0.00
		129,763,267	1.44
ノルウェー			
EUR 359,000	Adevinta 2.625% 15/11/2025	341,019	0.01
EUR 228,000	Adevinta 3% 15/11/2027*	206,223	0.00
EUR 3,800,000	Aker BP 1.125% 12/5/2029	3,176,724	0.04
EUR 1,300,000	Nassa Topco 2.875% 6/4/2024	1,236,078	0.01
		4,960,044	0.06
オマーン			
USD 3,515,000	Oman Government International Bond 4.75% 15/6/2026	3,431,519	0.04
USD 3,402,000	Oman Government International Bond 6.75% 28/10/2027	3,555,090	0.04
USD 1,257,000	OQ SAOC 5.125% 6/5/2028	1,220,993	0.01
		8,207,602	0.09
パナマ			
EUR 434,000	Carnival 7.625% 1/3/2026*	369,719	0.00
EUR 6,186,000	Carnival 10.125% 1/2/2026*	6,438,193	0.07
		6,807,912	0.07
パラグアイ			
USD 1,565,000	Frigorifico Concepcion 7.7% 21/7/2028	1,264,903	0.01
ペルー			
USD 2,015,000	InRetail Consumer 3.25% 22/3/2028	1,738,643	0.02
フィリピン			
USD 695,000	Globe Telecom 3% 23/7/2035	514,135	0.00
USD 675,000	Globe Telecom 4.2% 2/5/2171	633,398	0.01
USD 400,000	Philippine Government International Bond 2.65% 10/12/2045	287,000	0.00
		1,434,533	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ポルトガル		
EUR 236,350	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 2.309% 25/1/2035	226,474	0.00
EUR 1,024,185	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 4.309% 25/1/2035	959,712	0.01
EUR 200,000	Banco Espirito Santo 2.625% 8/5/2017***	35,015	0.00
EUR 20,500,000	Banco Espirito Santo 4% 21/1/2019***	3,589,046	0.04
EUR 2,000,000	Banco Espirito Santo 4.75% 15/1/2018***	350,151	0.00
EUR 1,900,000	EDP - Energias de Portugal 1.7% 20/7/2080	1,710,737	0.02
EUR 1,000,000	EDP - Energias de Portugal 1.875% 2/8/2081	853,868	0.01
EUR 1,000,000	EDP - Energias de Portugal 4.496% 30/4/2079	988,425	0.01
EUR 500,000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No.1 1.603% 20/3/2033	499,176	0.01
EUR 900,000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No.1 3.753% 20/3/2033	891,954	0.01
EUR 900,000	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No.2 2.876% 23/9/2038	867,556	0.01
EUR 200,000	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Viriato Finance No 1 1.035% 28/10/2040	191,812	0.00
EUR 700,000	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Viriato Finance No 1 1.635% 28/10/2040	659,233	0.01
EUR 2,613,907	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta VII 0.7% 12/2/2024	2,572,170	0.03
		14,395,329	0.16
	プエルトリコ		
USD 590,000	Puerto Rico Sales Tax Financing Sales Tax Revenue 4.75% 1/7/2053	566,897	0.01
	カタール		
USD 675,000	Qatar Energy 3.125% 12/7/2041	551,097	0.01
	ロシア連邦		
RUB 881,274,000	Russian Federal Bond - OFZ 6.1% 18/7/2035	4,662,783	0.05
	サウジアラビア		
USD 129,000	Saudi Government International Bond 3.25% 26/10/2026	127,452	0.00
	シンガポール		
USD 343,000	ABJA Investment 5.45% 24/1/2028*	339,570	0.00
USD 1,117,463	Continuum Energy Levanter 4.5% 9/2/2027	933,081	0.01
USD 203,175	Continuum Energy Levanter 4.5% 9/2/2027	169,651	0.00
USD 600,000	DBS 3.3% 27/8/2171*	571,035	0.01
USD 511,920	LLPL Capital 6.875% 4/2/2039	494,798	0.01
USD 788,000	Theta Capital 8.125% 22/1/2025	672,877	0.01
USD 200,000	TML 4.35% 9/6/2026	175,650	0.00
		3,356,662	0.04
	南アフリカ		
USD 1,040,000	Eskom SOC 7.125% 11/2/2025	981,113	0.01
	韓国		
USD 1,300,000	Heungkuk Life Insurance 4.475% 9/5/2171	1,256,044	0.02
USD 1,310,000	KDB Life Insurance 7.5% 21/11/2170	1,211,750	0.01
USD 1,000,000	Kookmin Bank 4.35% 2/1/2171	979,837	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	韓国(続き)		
USD 360,000	LG Chem 2.375% 7/7/2031	302,197	0.00
USD 1,124,000	Tongyang Life Insurance 5.25% 22/3/2171	1,005,047	0.01
		4,754,875	0.05
	スペイン		
EUR 376,070	Autonoría Spain 2021 FT 0.859% 31/1/2039	367,458	0.00
EUR 1,910,302	Autonoría Spain 2021 FT 1.109% 31/1/2039	1,834,066	0.02
EUR 818,701	Autonoría Spain 2021 FT 1.609% 31/1/2039	776,968	0.01
EUR 470,088	Autonoría Spain 2021 FT 2.709% 31/1/2039	443,528	0.01
EUR 188,035	Autonoría Spain 2021 FT 3.959% 31/1/2039	177,558	0.00
EUR 200,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6% 15/10/2170	189,344	0.00
EUR 800,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6% 29/6/2171	776,302	0.01
EUR 700,000	Banco de Sabadell 2% 17/1/2030	618,699	0.01
EUR 3,600,000	Banco de Sabadell 2.5% 15/4/2031*	3,080,039	0.03
EUR 3,400,000	Banco Santander 4.375% 14/4/2171*	2,899,103	0.03
EUR 2,200,000	CaixaBank 6.375% 19/12/2170	2,186,862	0.03
EUR 600,000	CaixaBank 6.75% 13/9/2170	579,751	0.01
EUR 3,300,000	Cellnex Finance 0.75% 15/11/2026	2,848,582	0.03
EUR 3,400,000	Cellnex Finance 2% 15/9/2032	2,477,270	0.03
EUR 900,000	Cellnex Finance 2% 15/2/2033	649,082	0.00
EUR 2,800,000	Cellnex Finance 2.25% 12/4/2026	2,618,218	0.03
EUR 11,000,000	Cellnex Telecom 0.75% 20/11/2031	8,361,621	0.09
EUR 2,100,000	Cellnex Telecom 1.75% 23/10/2030*	1,601,436	0.02
EUR 1,357,000	Food Service Project 5.5% 21/1/2027*	1,188,966	0.01
EUR 577,089	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 0.778% 20/3/2033	566,401	0.01
EUR 173,127	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 1.778% 20/3/2033	167,375	0.00
EUR 346,253	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 3.5% 20/3/2033	327,610	0.00
EUR 1,672,000	Grupo Antolin-Irausa 3.375% 30/4/2026*	1,375,712	0.02
EUR 729,000	Grupo Antolin-Irausa 3.5% 30/4/2028	534,996	0.01
EUR 1,200,000	International Consolidated Airlines 0.625% 17/11/2022	1,193,722	0.01
EUR 6,000,000	International Consolidated Airlines 1.125% 18/5/2028	3,951,442	0.05
EUR 3,200,000	International Consolidated Airlines 2.75% 25/3/2025	2,809,114	0.03
EUR 2,000,000	International Consolidated Airlines 3.75% 25/3/2029*	1,482,298	0.02
EUR 1,253,000	Kaixo Bondco Telecom 5.125% 30/9/2029*	1,028,617	0.01
EUR 3,672,000	Lorca Telecom Bondco 4% 18/9/2027	3,307,069	0.04
EUR 8,423,000	Spain Government Bond 3.45% 30/7/2066	8,517,004	0.09
EUR 2,173,000	Tendam Brands 5% 15/9/2024*	2,070,511	0.02
EUR 250,000	Tendam Brands 5.517% 15/9/2024	239,961	0.00
		61,246,685	0.68
	スリランカ		
USD 306,000	Sri Lanka Government International Bond 5.75% 18/4/2023	104,130	0.00
USD 821,000	Sri Lanka Government International Bond 6.35% 28/6/2024	276,180	0.01
USD 677,000	Sri Lanka Government International Bond 6.85% 14/3/2024	228,575	0.00
		608,885	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
スウェーデン			
EUR 1,850,000	Fastighets Balder 2.873% 2/6/2081	1,309,069	0.01
EUR 3,076,000	Heimstaden Bostad 2.625% 1/5/2171	2,229,522	0.03
EUR 634,000	Intrum 3.5% 15/7/2026	568,747	0.01
EUR 3,062,000	Intrum 4.875% 15/8/2025	2,929,146	0.03
USD 1,000,000	Skandinaviska Enskilda Banken 5.125% 13/5/2171	955,000	0.01
USD 200,000	Svenska Handelsbanken 4.375% 1/3/2171	173,521	0.00
USD 200,000	Svenska Handelsbanken 4.75% 1/3/2171	165,322	0.00
EUR 1,524,000	Verisure 3.25% 15/2/2027	1,314,361	0.01
EUR 2,237,000	Verisure 3.5% 15/5/2023*	2,216,278	0.03
EUR 1,498,000	Verisure 3.875% 15/7/2026	1,345,769	0.02
EUR 1,993,000	Verisure 5% 15/4/2025*	1,979,393	0.02
EUR 305,000	Verisure Midholding 5.25% 15/2/2029	248,035	0.00
EUR 874,000	Volvo Car 2.5% 7/10/2027	780,468	0.01
		16,214,631	0.18
スイス			
EUR 2,000,000	Credit Suisse 2.125% 13/10/2026	1,835,721	0.02
USD 200,000	Credit Suisse 5.25% 11/2/2171	150,745	0.00
USD 3,554,000	Credit Suisse 6.25% 18/12/2170	3,202,054	0.04
USD 3,200,000	Credit Suisse 6.25% 18/12/2170	2,883,110	0.03
USD 600,000	Credit Suisse 7.25% 12/3/2171	495,365	0.01
USD 900,000	Credit Suisse 7.25% 12/3/2171	743,048	0.01
USD 200,000	Credit Suisse 7.5% 17/1/2171	176,705	0.00
USD 200,000	Credit Suisse 7.5% 11/6/2171	190,442	0.00
USD 4,513,000	UBS 1.375% 13/1/2025	4,227,475	0.05
USD 614,000	UBS 2.095% 11/2/2032	482,563	0.00
USD 1,836,000	UBS 4.488% 12/5/2026	1,818,795	0.02
USD 2,496,000	UBS 4.703% 5/8/2027	2,455,581	0.03
USD 600,000	UBS 5.125% 29/7/2171	554,730	0.01
USD 800,000	UBS 7% 19/2/2171	806,800	0.01
USD 3,000,000	UBS 7% 31/7/2171	2,937,462	0.03
		22,960,596	0.26
タイ			
USD 429,000	Bangkok Bank Hong Kong 3.733% 25/9/2034	374,399	0.00
USD 690,000	Bangkok Bank Hong Kong 5% 23/3/2171	648,483	0.01
USD 1,090,000	GC Treasury Center 2.98% 18/3/2031	911,344	0.01
USD 524,000	Kasikornbank Hong Kong 3.343% 2/10/2031	469,904	0.01
USD 690,000	Krung Thai Bank 4.4% 25/9/2170	593,400	0.01
USD 700,000	Thaioil Treasury Center 3.75% 18/6/2050	465,150	0.00
USD 790,000	TMBThanachart Bank 4.9% 2/6/2171	733,712	0.01
		4,196,392	0.05
トルコ			
USD 5,428,000	Turkey Government International Bond 4.875% 16/4/2043	3,087,175	0.03
USD 1,259,533	Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust 4.2% 15/9/2028	1,046,324	0.01
		4,133,499	0.04

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ウクライナ		
USD 1,990,000	Ukraine Government International Bond 7.253% 15/3/2035	393,025	0.01
USD 1,582,000	Ukraine Government International Bond 7.375% 25/9/2034	312,445	0.00
		705,470	0.01
	アラブ首長国連邦		
USD 2,853,000	Emirates NBD Bank 6.125% 20/9/2170*	2,838,913	0.03
USD 2,563,000	NBK Tier 1 3.625% 24/8/2171	2,247,431	0.03
		5,086,344	0.06
	英国		
USD 612,000	AstraZeneca 1.375% 6/8/2030	504,737	0.01
USD 946,000	AstraZeneca 2.125% 6/8/2050	624,709	0.01
USD 500,000	AstraZeneca 3.375% 16/11/2025	490,852	0.01
GBP 125,000	Atlas Funding 2021-1 3.301% 25/7/2058	141,358	0.00
GBP 110,000	Atlas Funding 2021-1 3.851% 25/7/2058	123,778	0.00
USD 4,093,231	Avianca Midco 2 9% 1/12/2028	3,458,780	0.04
GBP 1,699,000	Azure Finance NO 2 4.691% 20/7/2030	1,964,651	0.02
EUR 5,800,000	Barclays 0.577% 9/8/2029	4,669,962	0.05
EUR 3,100,000	Barclays 0.877% 28/1/2028	2,685,943	0.03
USD 1,590,000	Barclays 5.304% 9/8/2026	1,585,270	0.02
USD 1,100,000	Barclays 6.125% 15/12/2170	1,017,452	0.01
GBP 800,000	Barclays 6.375% 15/3/2171	848,581	0.01
GBP 400,000	Barclays 7.125% 15/9/2170	442,723	0.00
GBP 400,000	Barclays 7.25% 15/6/2171	460,277	0.00
USD 600,000	Barclays 8% 15/9/2170	591,545	0.01
USD 1,600,000	Barclays 8% 15/12/2170	1,558,954	0.02
GBP 520,000	Barley Hill NO 2 3.391% 27/8/2058	574,872	0.01
EUR 1,300,000	BCP V Modular Services Finance II 4.75% 30/11/2028	1,084,375	0.01
GBP 400,000	BCP V Modular Services Finance II 6.125% 30/11/2028*	378,254	0.00
GBP 3,858,000	Bellis Acquisition 3.25% 16/2/2026	3,549,505	0.04
GBP 2,628,000	Bellis Acquisition 4.5% 16/2/2026	2,453,887	0.03
EUR 5,140,000	British American Tobacco 3% 27/12/2170	3,979,303	0.04
EUR 7,675,000	British Telecommunications 1.874% 18/8/2080	6,626,763	0.07
USD 1,000,000	British Telecommunications 4.25% 23/11/2081	877,539	0.01
USD 2,200,000	British Telecommunications 4.875% 23/11/2081	1,870,241	0.02
GBP 225,000	Canada Square Funding 2021-2 2.584% 17/6/2058	252,794	0.00
GBP 102,000	Canada Square Funding 2021-2 2.984% 17/6/2058	112,960	0.00
GBP 318,000	Canada Square Funding 6 3.011% 17/1/2059	342,147	0.00
GBP 178,000	Canada Square Funding 6 3.411% 17/1/2059	186,092	0.00
GBP 1,000,000	Canary Wharf Finance II 3.081% 22/10/2037	950,736	0.01
GBP 4,190,000	Canary Wharf Finance II 3.806% 22/10/2037	3,893,828	0.04
EUR 1,071,000	Chanel Ceres 0.5% 31/7/2026	967,578	0.01
EUR 2,404,000	Channel Link Enterprises Finance 2.706% 30/6/2050	2,256,513	0.02
GBP 1,850,000	Channel Link Enterprises Finance 3.043% 30/6/2050	1,898,927	0.02
GBP 220,000	CMF 2020-1 2.691% 16/1/2057	251,932	0.00
GBP 105,000	CMF 2020-1 2.941% 16/1/2057	118,914	0.00
GBP 2,097,000	Constellation Automotive Financing 4.875% 15/7/2027*	1,933,530	0.02

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 1,102,412	Dignity Finance 3.546% 31/12/2034	1,222,403	0.01
GBP 350,000	Dignity Finance 4.696% 31/12/2049	365,566	0.00
GBP 394,209	Dowson 2021-2 2.371% 20/10/2028	456,041	0.01
GBP 400,000	Dowson 2021-2 2.891% 20/10/2028	455,076	0.00
GBP 1,300,000	Dowson 2021-2 3.291% 20/10/2028	1,452,287	0.02
GBP 1,143,000	Dowson 2022-1 3.941% 20/1/2029	1,294,781	0.01
GBP 725,000	Dowson 2022-1 4.391% 20/1/2029	805,223	0.01
EUR 3,498,000	EC Finance 3% 15/10/2026	3,233,422	0.04
EUR 2,259,000	eG Global Finance 3.625% 7/2/2024	2,123,482	0.02
EUR 1,163,000	eG Global Finance 4.375% 7/2/2025	1,078,950	0.01
EUR 1,871,000	eG Global Finance 6.25% 30/10/2025	1,757,574	0.02
GBP 549,335	Finsbury Square 2.019% 16/12/2067	622,573	0.01
GBP 544,000	Finsbury Square 2.369% 16/12/2067	612,229	0.01
GBP 1,045,000	Finsbury Square 2.619% 16/12/2067	1,172,189	0.01
GBP 235,000	Finsbury Square 2019-2 3.419% 16/9/2069	272,843	0.00
GBP 215,000	Finsbury Square 2019-2 3.719% 16/9/2069	249,593	0.00
GBP 927,908	Finsbury Square 2021-2 2.169% 16/12/2071	1,053,499	0.01
GBP 435,000	Finsbury Square 2021-2 2.619% 16/12/2071	471,995	0.01
GBP 371,000	Finsbury Square 2021-2 2.769% 16/12/2071	389,287	0.01
GBP 201,000	Finsbury Square 2021-2 3.069% 16/12/2071	219,063	0.00
USD 2,202,000	Fresnillo 4.25% 2/10/2050*	1,700,296	0.02
GBP 537,000	Funding IV 3.891% 15/9/2024	623,252	0.01
GBP 116,000	Funding V 3.391% 15/10/2025	130,204	0.00
GBP 736,000	Funding VI 4.791% 15/7/2026	843,364	0.01
GBP 884,793	Gemgarto 2018-1 2.722% 16/9/2065	1,026,307	0.01
GBP 205,952	Gemgarto 2018-1 3.022% 16/9/2065	238,725	0.00
GBP 218,000	Gemgarto 2021-1 2.669% 16/12/2067	240,570	0.00
GBP 858,049	Gemgarto 2021-1 6.369% 16/12/2067	996,303	0.01
GBP 1,880,000	Great Hall Mortgages No 1 1.925% 18/6/2039	2,011,399	0.02
GBP 300,000	Greene King Finance 3.28% 15/12/2034	284,987	0.00
GBP 300,000	Greene King Finance 3.56% 15/3/2036	285,569	0.00
GBP 2,565,066	Greene King Finance 3.593% 15/3/2035	2,720,596	0.03
GBP 7,873,034	Greene King Finance 3.98% 15/12/2033	8,543,065	0.09
GBP 1,053,425	Greene King Finance 4.064% 15/3/2035	1,127,631	0.01
USD 80,000	GSK Consumer Healthcare Capital UK 3.125% 24/3/2025	77,162	0.00
GBP 741,000	Harben Finance 2.604% 28/9/2055	786,386	0.01
GBP 441,000	Harben Finance 2.954% 28/9/2055	456,441	0.01
GBP 200,000	Heathrow Finance 3.875% 1/3/2027	202,322	0.00
GBP 517,000	Heathrow Finance 4.125% 1/9/2029	508,089	0.01
GBP 500,000	Heathrow Finance 4.75% 1/3/2024	572,897	0.01
GBP 199,992	Hops Hill No 1 3.541% 27/5/2054	225,068	0.00
GBP 99,997	Hops Hill No 1 4.041% 27/5/2054	112,629	0.00
USD 3,393,000	HSBC 0.976% 24/5/2025	3,166,904	0.04
GBP 3,760,000	HSBC 1.75% 24/7/2027	3,787,744	0.04
EUR 1,800,000	HSBC 3.019% 15/6/2027	1,751,362	0.02
USD 3,000,000	HSBC 3.033% 22/11/2023	2,990,567	0.03

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
USD 840,000	HSBC Bank 3.127% 19/12/2170	644,406	0.01
GBP 660,000	Iceland Bondco 4.375% 15/5/2028	496,212	0.01
GBP 1,200,000	Iceland Bondco 4.625% 15/3/2025*	1,017,253	0.01
EUR 5,470,000	Informa 2.125% 6/10/2025	5,264,161	0.06
USD 404,000	International Game Technology 6.25% 15/1/2027	394,389	0.00
USD 365,000	International Game Technology 6.5% 15/2/2025	363,633	0.00
GBP 790,000	Iron Mountain UK 3.875% 15/11/2025	837,176	0.01
EUR 1,582,000	Jaguar Land Rover Automotive 4.5% 15/7/2028*	1,140,441	0.01
EUR 300,000	Jaguar Land Rover Automotive 6.875% 15/11/2026	261,638	0.00
USD 1,400,000	Jaguar Land Rover Automotive 7.75% 15/10/2025	1,288,171	0.01
GBP 1,205,000	Jerrold Finco 4.875% 15/1/2026*	1,197,981	0.01
GBP 1,794,000	Jerrold Finco 5.25% 15/1/2027	1,821,359	0.02
GBP 370,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 3.591% 12/6/2057	418,817	0.01
GBP 320,946	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 2.224% 20/7/2058	364,429	0.00
GBP 173,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 2.524% 20/7/2058	192,292	0.00
GBP 158,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 2.824% 20/7/2058	168,558	0.00
GBP 102,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 3.224% 20/7/2058	108,999	0.00
USD 2,016,000	Liquid Telecommunications Financing 5.5% 4/9/2026	1,727,309	0.02
USD 729,000	Lloyds Bank 3.5% 14/5/2025	713,584	0.01
USD 1,400,000	Lloyds Banking 7.5% 27/6/2171	1,386,182	0.02
GBP 503,454	London Wall Mortgage Capital 2.443% 15/5/2051	571,501	0.01
GBP 280,256	London Wall Mortgage Capital 2.493% 15/5/2052	318,677	0.00
GBP 4,575,000	Market Bidco Finco 5.5% 4/11/2027	4,394,760	0.05
USD 250,000	McLaren Finance 7.5% 1/8/2026	211,921	0.00
GBP 1,483,000	Mitchells & Butlers Finance 3.724% 15/6/2036	1,392,836	0.02
GBP 757,481	Mortimer BTL 2021-1 2.11% 23/6/2053	859,296	0.01
GBP 198,000	Mortimer BTL 2021-1 2.51% 23/6/2053	218,600	0.00
GBP 111,000	Mortimer BTL 2021-1 2.86% 23/6/2053	120,945	0.00
GBP 266,625	Motor 2016-1 5.25% 25/11/2025	308,693	0.00
GBP 550,000	National Express 4.25% 26/2/2171	575,642	0.01
GBP 800,000	Nationwide Building Society 5.75% 20/12/2170*	822,787	0.01
GBP 400,000	Nationwide Building Society 5.875% 20/12/2170	438,086	0.00
EUR 3,900,000	NatWest 1.043% 14/9/2032*	3,186,541	0.04
USD 4,797,000	Neptune Energy Bondco 6.625% 15/5/2025	4,645,573	0.05
GBP 775,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 3.241% 15/3/2029	881,321	0.01
GBP 595,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 2.591% 15/11/2029	675,673	0.01
GBP 677,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 3.041% 15/11/2029	756,294	0.01
GBP 1,212,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2022-2 0% 15/7/2030	1,407,302	0.02
EUR 639,443	Newgate Funding 0.9% 1/12/2050	627,102	0.01
EUR 6,000,000	NGG Finance 1.625% 5/12/2079	5,538,970	0.06
GBP 1,300,000	NGG Finance 5.625% 18/6/2073	1,448,741	0.02
GBP 1,524,000	Ocado 3.875% 8/10/2026	1,405,967	0.02
EUR 305,289	Paragon Mortgages No 12 0.801% 15/11/2038	280,506	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 2,405,000	Paragon Mortgages No 25 2.763% 15/5/2050	2,771,556	0.03
GBP 2,100,000	Paragon Mortgages No 25 3.113% 15/5/2050	2,392,574	0.03
GBP 565,034	Pierpont BTL 2021-1 2.21% 22/12/2053	640,735	0.01
GBP 802,000	Pierpont BTL 2021-1 2.66% 22/12/2053	899,580	0.01
GBP 3,748,000	Pinewood Finance 3.25% 30/9/2025*	3,930,572	0.04
GBP 421,000	Polaris 2022-1 3.191% 23/10/2059	463,109	0.01
GBP 307,000	Polaris 2022-1 3.691% 23/10/2059	336,866	0.00
GBP 538,000	Polaris 2022-1 5.091% 23/10/2059	582,347	0.01
GBP 115,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 3.141% 16/10/2056	130,929	0.00
GBP 100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 3.641% 16/10/2056	111,592	0.00
GBP 1,464,000	Premier Foods Finance 3.5% 15/10/2026	1,507,732	0.02
GBP 1,197,000	Residential Mortgage 32 3.602% 20/6/2070	1,368,931	0.02
EUR 44,555	RMAC No 1 0% 12/6/2044	41,414	0.00
EUR 638,156	RMAC No 1 0% 12/6/2044	573,242	0.01
GBP 334,794	RMAC No 1 1.61% 12/6/2044	367,305	0.00
GBP 420,000	RMAC NO 2 3.31% 12/6/2046	484,961	0.01
EUR 400,000	Rolls-Royce 1.625% 9/5/2028	311,284	0.00
EUR 442,000	Rolls-Royce 4.625% 16/2/2026	425,241	0.01
USD 200,000	Rolls-Royce 5.75% 15/10/2027	182,228	0.00
GBP 176,000	Rolls-Royce 5.75% 15/10/2027	192,260	0.00
USD 880,000	Royalty Pharma 1.2% 2/9/2025	800,079	0.01
USD 600,000	Royalty Pharma 1.75% 2/9/2027	522,548	0.01
USD 612,000	Royalty Pharma 2.15% 2/9/2031	487,206	0.01
USD 842,000	Royalty Pharma 3.55% 2/9/2050	597,309	0.01
GBP 535,000	Sage AR Funding No 1 3.843% 17/11/2030	601,740	0.01
GBP 369,000	Satus 2021-1 2.891% 17/8/2028	419,130	0.00
GBP 453,000	Satus 2021-1 3.291% 17/8/2028	503,918	0.01
GBP 122,000	Satus 2021-1 3.591% 17/8/2028	131,689	0.00
GBP 247,000	Satus 2021-1 4.891% 17/8/2028	263,129	0.00
USD 3,458,440	SCC Power 4% 17/5/2032	354,490	0.00
USD 6,384,812	SCC Power 8% 31/12/2028	2,617,773	0.04
EUR 1,432,000	Sherwood Financing 4.5% 15/11/2026*	1,208,198	0.01
EUR 458,000	Sherwood Financing 4.946% 15/11/2027	426,708	0.00
GBP 624,000	Sherwood Financing 6% 15/11/2026	587,432	0.01
USD 477,000	Sky 3.75% 16/9/2024	474,467	0.00
GBP 453,000	Spirit Issuer 5.472% 28/12/2034	544,513	0.01
EUR 1,659,000	SSE 4% 21/4/2171	1,531,824	0.02
EUR 9,750,000	Standard Chartered 1.2% 23/9/2031	8,431,522	0.09
GBP 535,000	Stanlington No 2 3.091% 12/6/2056	591,078	0.01
GBP 329,000	Stanlington No 2 3.541% 12/6/2056	359,028	0.00
GBP 450,000	Stanlington No 2 4.641% 12/6/2056	502,117	0.01
GBP 3,930,000	Stonegate Pub Financing 2019 8% 13/7/2025	4,194,523	0.05
GBP 2,321,000	Stonegate Pub Financing 2019 8.25% 31/7/2025	2,478,005	0.03
EUR 801,000	Synthomer 3.875% 1/7/2025*	743,240	0.01
GBP 844,882	Tesco Property Finance 1 7.623% 13/7/2039	1,128,686	0.01
GBP 2,055,061	Tesco Property Finance 3 5.744% 13/4/2040	2,387,715	0.03

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 937,382	Tesco Property Finance 4 5.801% 13/10/2040	1,087,950	0.01
GBP 2,024,000	Thames Water Kemble Finance 4.625% 19/5/2026*	2,078,832	0.02
GBP 378,506	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 2.23% 12/7/2063	432,644	0.01
GBP 157,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 2.48% 12/7/2063	172,111	0.00
GBP 107,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 2.78% 12/7/2063	114,727	0.00
GBP 145,000	Tower Bridge Funding 2020-1 3.852% 20/9/2063	167,670	0.00
GBP 115,000	Tower Bridge Funding 2020-1 4.852% 20/9/2063	133,122	0.00
GBP 364,999	Tower Bridge Funding 2021-1 3.429% 21/7/2064	415,888	0.01
GBP 252,000	Tower Bridge Funding 2021-1 3.729% 21/7/2064	282,650	0.00
GBP 264,000	Tower Bridge Funding 2022-1 2.652% 20/12/2063	280,170	0.00
GBP 1,590,000	Turbo Finance 9 3.341% 20/8/2028	1,825,812	0.02
GBP 488,000	Twin Bridges 2018-1 3.51% 12/9/2050	557,802	0.01
GBP 390,000	Twin Bridges 2020-1 3.591% 12/12/2054	445,627	0.01
GBP 225,000	Twin Bridges 2020-1 4.341% 12/12/2054	256,971	0.00
GBP 436,000	Twin Bridges 2021-1 2.941% 12/3/2055	475,173	0.01
GBP 220,000	Twin Bridges 2021-1 3.441% 12/3/2055	234,382	0.00
GBP 670,099	Twin Bridges 2021-2 2.001% 12/9/2055	753,435	0.01
GBP 274,000	Twin Bridges 2021-2 2.241% 12/9/2055	294,639	0.00
GBP 435,000	Twin Bridges 2021-2 2.491% 12/9/2055	464,528	0.01
GBP 187,000	Twin Bridges 2021-2 2.841% 12/9/2055	194,075	0.00
GBP 192,841	Twin Bridges 2021-2 4.241% 12/9/2055	223,347	0.00
GBP 830,000	Twin Bridges 2022-1 2.641% 1/12/2055	848,367	0.01
GBP 365,000	Twin Bridges 2022-1 3.041% 1/12/2055	359,899	0.00
GBP 2,791,000	Twin Bridges 2022-2 0% 12/6/2055	3,176,596	0.04
GBP 1,884,626	Unique Pub Finance 5.659% 30/6/2027	2,229,497	0.02
GBP 1,997,000	Unique Pub Finance 6.464% 30/3/2032	2,749,742	0.03
GBP 599,846	Unique Pub Finance 7.395% 28/3/2024	706,825	0.01
GBP 4,506,336	United Kingdom Gilt 1.25% 31/7/2051	3,419,073	0.04
USD 1,316,000	Vedanta Resources 6.125% 9/8/2024	913,870	0.01
USD 3,693,000	Vedanta Resources Finance II 8.95% 11/3/2025	2,880,540	0.03
USD 557,000	Vedanta Resources Finance II 13.875% 21/1/2024	482,654	0.01
GBP 1,577,000	Very Funding 6.5% 1/8/2026*	1,367,156	0.02
EUR 1,075,000	Virgin Media Finance 3.75% 15/7/2030	844,217	0.01
GBP 200,000	Virgin Media Secured Finance 4.125% 15/8/2030	195,977	0.00
GBP 1,625,000	Virgin Media Secured Finance 4.25% 15/1/2030*	1,591,464	0.02
USD 443,000	Virgin Media Secured Finance 4.5% 15/8/2030	368,037	0.00
GBP 500,000	Virgin Media Secured Finance 5.25% 15/5/2029	516,921	0.01
USD 1,600,000	Virgin Media Secured Finance 5.5% 15/5/2029	1,428,210	0.02
EUR 4,484,000	Vmed 02 UK Financing I 3.25% 31/1/2031	3,795,368	0.04
GBP 438,000	Vmed 02 UK Financing I 4% 31/1/2029	432,281	0.00
GBP 2,408,000	Vmed 02 UK Financing I 4.5% 15/7/2031	2,324,678	0.03
EUR 975,000	Vodafone 2.625% 27/8/2080	876,561	0.01
EUR 2,150,000	Vodafone 3% 27/8/2080*	1,727,302	0.02
EUR 8,200,000	Vodafone 3.1% 3/1/2079	7,966,861	0.09
EUR 800,000	Vodafone 4.2% 3/10/2078*	731,355	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
USD 735,000	Vodafone 4.25% 17/9/2050	608,037	0.01
USD 2,200,000	Vodafone 6.25% 3/10/2078	2,142,250	0.02
		267,520,719	2.98
	米国		
USD 460,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4.28% 10/8/2035	432,664	0.01
USD 1,500,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4.28% 10/8/2035	1,305,597	0.01
USD 300,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4.28% 10/8/2035	277,514	0.00
USD 7,000,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 0.271% 5/6/2037	55,860	0.00
USD 320,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 3.779% 5/6/2037	269,790	0.00
USD 1,708,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 3.779% 5/6/2037	1,402,517	0.02
USD 1,070,000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 3.906% 15/9/2034	1,020,660	0.01
USD 4,871,133	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 4.489% 15/9/2034	4,621,324	0.05
USD 1,500,000	AbbVie 2.95% 21/11/2026	1,417,952	0.02
USD 365,000	AbbVie 3.2% 14/5/2026	350,704	0.00
USD 1,750,000	AbbVie 3.2% 21/11/2029	1,607,099	0.02
USD 182,000	AbbVie 3.8% 15/3/2025	179,823	0.00
USD 3,162,000	AbbVie 4.25% 21/11/2049	2,820,803	0.03
USD 828,200	AccessLex Institute 3.297% 25/5/2036	800,737	0.01
USD 2,119,612	ACE Home Equity Loan Trust Series 2007-HE4 2.704% 25/5/2037	449,140	0.01
USD 107,624	ACE Home Equity Loan Trust Series 2007-HE4 3.044% 25/5/2037	23,270	0.00
USD 1,151,000	Aetna 3.5% 15/11/2024	1,137,222	0.01
USD 1,297,000	Affinity Gaming 6.875% 15/12/2027	1,130,877	0.01
USD 340,000	Agate Bay Mortgage Trust 2015-1 3.693% 25/1/2045	318,896	0.00
USD 391,000	Agate Bay Mortgage Trust 2015-3 3.544% 25/4/2045	362,515	0.00
USD 273,000	Agate Bay Mortgage Trust 2015-4 3.522% 25/6/2045	248,957	0.00
USD 2,811,000	AIG Global Funding 0.65% 17/6/2024	2,644,352	0.03
USD 36,231	Ajax Mortgage Loan Trust 2017-D 0% 25/12/2057	13,770	0.00
USD 59,280	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-A 0% 25/4/2058	60,889	0.00
USD 38,133	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-B 0% 26/2/2057	27,598	0.00
USD 11,540,633	Ajax Mortgage Loan Trust 2019-G 3% 25/9/2059	11,375,408	0.13
USD 3,076,768	Ajax Mortgage Loan Trust 2019-H 3% 25/11/2059	3,033,822	0.03
USD 14,255,051	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-A 2.375% 25/12/2059	13,939,370	0.16
USD 1,291,352	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-C 2.25% 27/9/2060	1,272,405	0.01
USD 5,013,348	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-D 2.25% 25/6/2060	4,863,369	0.05
USD 16,903,227	Ajax Mortgage Loan Trust 2021-C 2.115% 25/1/2061	15,986,354	0.18
USD 31,188,837	Ajax Mortgage Loan Trust 2021-F 1.875% 25/6/2061	29,013,082	0.32
USD 2,589,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.5% 15/3/2029	2,139,161	0.02
USD 176,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.625% 15/1/2027	161,220	0.00
USD 130,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.875% 15/2/2030	113,653	0.00
USD 489,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 5.875% 15/2/2028	465,862	0.01
USD 78,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 7.5% 15/3/2026	79,592	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 612,000	Alexandria Real Estate Equities 1.875% 1/2/2033	466,526	0.01
USD 1,327,000	Alexandria Real Estate Equities 2.95% 15/3/2034	1,123,799	0.01
USD 900,000	Alexandria Real Estate Equities 4.5% 30/7/2029	879,209	0.01
USD 1,830,000	Allegheny County Airport Authority 4% 1/1/2046	1,705,493	0.02
USD 1,043,000	Allegiant Travel 7.25% 15/8/2027	1,037,121	0.01
USD 9,893,000	Allegiant Travel 8.5% 5/2/2024	10,041,494	0.11
USD 612,000	Allstate 1.45% 15/12/2030	493,672	0.01
USD 500,000	Ally Financial 1.45% 2/10/2023	485,199	0.01
USD 621,000	Alphabet 1.1% 15/8/2030	510,368	0.01
USD 961,000	Alphabet 2.25% 15/8/2060	624,786	0.01
USD 3,700,074	Alternative Loan Trust 2004-22CB 6.25% 25/10/2034	3,595,628	0.04
USD 2,099,302	Alternative Loan Trust 2005-22T1 2.794% 25/6/2035	1,805,362	0.02
USD 586,012	Alternative Loan Trust 2005-76 1.859% 25/2/2036	528,770	0.01
USD 2,827,470	Alternative Loan Trust 2005-J4 4.469% 25/7/2035	2,864,348	0.03
USD 3,564,917	Alternative Loan Trust 2006-11CB 6.5% 25/5/2036	2,093,841	0.02
USD 948,677	Alternative Loan Trust 2006-15CB 6.5% 25/6/2036	531,639	0.01
USD 1,518,120	Alternative Loan Trust 2006-23CB 2.844% 25/8/2036	334,681	0.00
USD 677,120	Alternative Loan Trust 2006-J7 3.873% 20/11/2046	497,968	0.01
USD 2,838,913	Alternative Loan Trust 2006-J7 6.25% 25/11/2036	1,652,694	0.02
USD 413,859	Alternative Loan Trust 2006-0A11 2.824% 25/9/2046	369,953	0.00
USD 2,954,181	Alternative Loan Trust 2006-0A14 2.589% 25/11/2046	2,383,423	0.03
USD 3,248,655	Alternative Loan Trust 2006-0A16 3.124% 25/10/2046	2,573,919	0.03
USD 343,333	Alternative Loan Trust 2006-0A8 2.824% 25/7/2046	298,909	0.00
USD 1,419,786	Alternative Loan Trust 2006-0C10 2.904% 25/11/2036	1,314,555	0.02
USD 2,854,947	Alternative Loan Trust 2006-0C7 2.944% 25/7/2046	2,639,887	0.03
USD 3,192,973	Alternative Loan Trust 2007-25 6.5% 25/11/2037	1,722,470	0.02
USD 4,689,856	Alternative Loan Trust 2007-3T1 6% 25/4/2037	2,527,091	0.03
USD 2,771,978	Alternative Loan Trust 2007-9T1 6% 25/5/2037	1,565,104	0.02
USD 10,719	Alternative Loan Trust 2007-0A3 2.804% 25/4/2047	1,323	0.00
USD 181,931	Alternative Loan Trust 2007-0A8 2.804% 25/6/2047	138,845	0.00
USD 236,995	Alternative Loan Trust 2007-0H2 2.924% 25/8/2047	203,288	0.00
USD 568,000	Altria 3.7% 4/2/2051	373,065	0.00
USD 1,371,000	Amazon.com 2.5% 3/6/2050	970,571	0.01
USD 946,000	Amazon.com 2.7% 3/6/2060	645,973	0.01
USD 3,500,000	Amazon.com 3% 13/4/2025	3,444,694	0.04
USD 938,000	Amazon.com 3.1% 12/5/2051	743,424	0.01
USD 1,750,000	Amazon.com 3.45% 13/4/2029	1,702,719	0.02
USD 671,973	Ambac Assurance 5.1% 7/6/2171	677,853	0.01
USD 104,000	AMC Networks 4.75% 1/8/2025	96,707	0.00
USD 1,748,000	American Express 2.25% 4/3/2025	1,670,121	0.02
USD 2,570,000	American Express 3.95% 1/8/2025	2,546,542	0.03
USD 3,171,000	American Express 4.05% 3/5/2029	3,095,130	0.03
USD 781,621	American Home Mortgage Assets Trust 2006-3 1.799% 25/10/2046	574,040	0.01
USD 1,618,905	American Home Mortgage Assets Trust 2006-4 2.654% 25/10/2046	924,808	0.01
USD 572,597	American Home Mortgage Assets Trust 2007-1 1.559% 25/2/2047	249,446	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,876,000	American Homes 4 Rent 2014-SFR2 Trust 6.231% 17/10/2036	1,902,934	0.02
USD 4,749,572	American Homes 4 Rent 2015-SFR1 Trust 0% 17/4/2052	48	0.00
USD 3,580,000	American Honda Finance 2.25% 12/1/2029	3,160,853	0.04
USD 1,285,000	American Municipal Power 7.834% 15/2/2041	1,687,174	0.02
USD 2,000,000	American Tower 1.3% 15/9/2025	1,817,321	0.02
USD 4,137,000	American Tower 1.875% 15/10/2030	3,281,036	0.04
USD 2,755,000	American Tower 2.7% 15/4/2031	2,309,623	0.03
USD 1,000,000	American Tower 2.75% 15/1/2027	918,702	0.01
USD 905,000	American Tower 2.95% 15/1/2051	624,034	0.01
USD 2,701,000	American Tower 3.1% 15/6/2050	1,906,188	0.02
USD 1,710,000	American Tower 5% 15/2/2024	1,724,088	0.02
USD 2,739,000	American University/The 3.672% 1/4/2049	2,325,022	0.03
USD 2,000,000	Amgen 1.65% 15/8/2028	1,734,787	0.02
USD 303,000	Amgen 1.9% 21/2/2025	288,708	0.00
USD 3,382,000	Amgen 2% 15/1/2032	2,765,202	0.03
USD 800,000	Amgen 2.6% 19/8/2026	758,873	0.01
USD 946,000	Amgen 2.77% 1/9/2053	636,162	0.01
USD 562,000	Amgen 3% 15/1/2052	402,194	0.00
USD 1,755,000	Amgen 3.125% 1/5/2025	1,721,654	0.02
USD 3,260,000	Amgen 4.05% 18/8/2029	3,190,129	0.04
USD 1,550,000	Amgen 4.875% 1/3/2053	1,524,800	0.02
USD 750,000	Amkor Technology 6.625% 15/9/2027	741,382	0.01
USD 959,000	AMN Healthcare 4.625% 1/10/2027	888,963	0.01
USD 612,000	Amphenol 2.2% 15/9/2031	509,593	0.01
USD 164,000	Amphenol 4.35% 1/6/2029	163,491	0.00
USD 8,500,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 3.5% 1/6/2030	8,050,061	0.09
USD 1,097,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 4.5% 1/6/2050	1,013,100	0.01
USD 377,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 4.6% 15/4/2048	348,763	0.00
USD 1,160,000	Apple 1.65% 11/5/2030	991,778	0.01
USD 3,941,000	Apple 2.4% 20/8/2050	2,777,673	0.03
USD 466,000	Apple 2.65% 11/5/2050	345,666	0.00
USD 876,000	Apple 2.65% 8/2/2051	649,484	0.01
USD 2,075,000	Apple 3% 13/11/2027	2,002,302	0.02
USD 2,680,000	Applied Materials 1.75% 1/6/2030	2,274,375	0.02
USD 7,086,521	APS Resecuritization Trust 2016-1 3.188% 31/7/2057	2,736,435	0.03
USD 1,245,995	APS Resecuritization Trust 2016-3 5.294% 27/9/2046	1,261,387	0.01
USD 150,000	Aramark Services 5% 1/2/2028	138,423	0.00
EUR 541,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 2% 1/9/2028	448,596	0.00
EUR 416,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3% 1/9/2029	329,200	0.00
USD 2,271,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3.25% 1/9/2028	1,943,179	0.02
USD 225,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 4% 1/9/2029	183,781	0.00
USD 918,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	905,676	0.01
EUR 1,200,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2.125% 15/8/2026	976,675	0.01
GBP 1,320,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 4.75% 15/7/2027	1,196,284	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,848,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 5.25% 30/4/2025	2,705,637	0.03
USD 10,110,000	AREIT 2022-CRE7 4.538% 17/6/2039	10,050,829	0.11
USD 3,251,403	Argent Mortgage Loan Trust 2005-W1 2.924% 25/5/2035	2,878,982	0.03
USD 1,820,000	Arizona Health Facilities Authority 2.336% 1/1/2037	1,719,533	0.02
USD 935,000	Arizona State University 5% 1/7/2041	1,014,403	0.01
USD 2,200,000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF 4.491% 15/4/2035	2,088,445	0.02
USD 6,712,000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF 5.491% 15/4/2035	6,229,429	0.07
USD 578,000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4.625% 1/8/2029	466,961	0.01
USD 1,520,000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4.625% 1/4/2030	1,201,135	0.01
USD 3,604,000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 6.625% 15/1/2028	3,227,874	0.04
USD 2,000,000	Astrazeneca Finance 1.75% 28/5/2028	1,770,994	0.02
USD 1,935,000	AT&T 0.9% 25/3/2024	1,847,632	0.02
USD 2,652,000	AT&T 1.7% 25/3/2026	2,428,902	0.03
USD 1,780,000	AT&T 2.25% 1/2/2032	1,444,648	0.02
USD 2,965,000	AT&T 2.3% 1/6/2027	2,712,301	0.03
USD 563,000	AT&T 3.5% 15/9/2053	422,992	0.00
USD 562,000	AT&T 3.65% 15/9/2059	416,550	0.00
USD 8,115,000	AT&T 4.1% 15/2/2028	7,952,863	0.09
USD 1,615,000	AT&T 4.3% 15/2/2030	1,571,993	0.02
USD 1,700,000	AT&T 4.35% 1/3/2029	1,665,498	0.02
USD 4,207,972	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM 4.341% 15/12/2036	3,931,193	0.04
USD 514,447	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM 5.441% 15/12/2036	478,536	0.01
EUR 1,100,000	Avantor Funding 2.625% 1/11/2025	1,048,058	0.01
USD 1,111,000	Avaya 6.125% 15/9/2028	610,283	0.01
USD 1,265,000	Azul Investments 5.875% 26/10/2024	983,538	0.01
USD 1,451,000	Azul Investments 7.25% 15/6/2026	1,036,068	0.01
USD 1,867,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2015-200P 3.716% 14/4/2033	1,675,412	0.02
USD 5,860,000	BamII Commercial Mortgage Trust 2016-SS1 0.702% 15/12/2035	93,174	0.00
USD 100,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 3.392% 15/11/2033	94,653	0.00
USD 3,273,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 3.792% 15/11/2033	3,132,097	0.04
USD 3,645,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 3.892% 15/11/2032	3,481,417	0.04
USD 1,780,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 4.392% 15/11/2032	1,702,496	0.02
USD 160,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 3.742% 15/9/2034	153,784	0.00
USD 2,553,409	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 4.092% 15/9/2034	2,444,348	0.03
USD 246,603	Banc of America Funding 2006-A Trust 3.176% 20/2/2036	232,097	0.00
USD 13,421,525	Banc of America Funding 2014-R2 Trust 0% 26/11/2036	4,625,939	0.05
USD 1,180,000	BANK 2017-BNK5 4.331% 15/6/2060	1,074,653	0.01
EUR 1,800,000	Bank of America 0.583% 24/8/2028	1,568,908	0.02
USD 3,750,000	Bank of America 1.486% 19/5/2024	3,674,699	0.04
USD 698,000	Bank of America 1.53% 6/12/2025	652,012	0.01
USD 341,000	Bank of America 1.658% 11/3/2027	306,285	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,658,000	Bank of America 1.843% 4/2/2025	2,555,365	0.03
USD 612,000	Bank of America 1.922% 24/10/2031	487,418	0.01
USD 1,127,000	Bank of America 2.456% 22/10/2025	1,079,625	0.01
USD 1,905,000	Bank of America 2.651% 11/3/2032	1,595,639	0.02
USD 2,072,000	Bank of America 2.972% 21/7/2052	1,471,457	0.02
USD 5,500,000	Bank of America 3.004% 20/12/2023	5,480,200	0.06
USD 4,009,000	Bank of America 3.384% 2/4/2026	3,878,293	0.04
USD 466,000	Bank of America 3.458% 15/3/2025	458,818	0.00
USD 1,650,000	Bank of America 3.483% 13/3/2052	1,300,321	0.01
USD 361,000	Bank of America 3.5% 19/4/2026	352,244	0.00
USD 1,881,000	Bank of America 3.705% 24/4/2028	1,792,262	0.02
USD 775,000	Bank of America 3.824% 20/1/2028	744,207	0.01
USD 5,735,000	Bank of America 3.841% 25/4/2025	5,681,424	0.06
USD 811,000	Bank of America 4.083% 20/3/2051	702,749	0.01
USD 3,742,000	Bank of America 4.376% 27/4/2028	3,663,633	0.04
USD 4,720,000	Bank of America 4.827% 22/7/2026	4,735,535	0.05
USD 3,415,995	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 5.005% 15/7/2049	3,258,179	0.04
USD 9,780,000	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 0.736% 15/2/2050	231,780	0.00
USD 4,000,000	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 1.393% 15/2/2050	192,040	0.00
USD 612,000	Bank of New York Mellon 1.65% 28/1/2031	497,691	0.01
USD 1,700,000	Bank of New York Mellon 2.05% 26/1/2027	1,564,871	0.02
USD 5,750,000	Bank of New York Mellon 3.35% 25/4/2025	5,678,228	0.06
USD 5,750,000	Bank of New York Mellon 3.85% 26/4/2029	5,554,078	0.06
USD 3,047,000	Bank of New York Mellon 4.414% 24/7/2026	3,066,151	0.03
USD 1,500,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust 7.07% 10/2/2022***	512,598	0.01
USD 2,380,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust 7.366% 10/12/2025	670,213	0.01
USD 1,690,000	Bay Area Toll Authority 2.425% 1/4/2026	1,611,291	0.02
USD 3,375,000	Bay Area Toll Authority 6.918% 1/4/2040	4,128,002	0.05
USD 1,058,434	Bayview Commercial Asset Trust 2005-3 2.924% 25/11/2035	969,604	0.01
USD 1,894,404	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 2.894% 25/1/2036	1,731,120	0.02
USD 46,005	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 3.029% 25/1/2036	42,228	0.00
USD 121,584	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 3.119% 25/1/2036	110,871	0.00
USD 160,824	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 2.984% 25/4/2036	153,728	0.00
USD 462,370	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 3.044% 25/4/2036	411,515	0.01
USD 111,260	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 3.074% 25/4/2036	98,793	0.00
USD 608,163	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 3.224% 25/4/2036	541,362	0.01
USD 313,083	Bayview Commercial Asset Trust 2006-2 2.864% 25/7/2036	288,491	0.00
USD 532,377	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 2.819% 25/10/2036	499,081	0.01
USD 2,784,752	Bayview Commercial Asset Trust 2006-4 2.789% 25/12/2036	2,587,861	0.03
USD 2,169,990	Bayview Commercial Asset Trust 2007-1 2.714% 25/3/2037	1,999,781	0.02

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,044,767	Bayview Commercial Asset Trust 2007-2 2.714% 25/7/2037	2,712,367	0.03
USD 4,956,387	Bayview Commercial Asset Trust 2007-4 2.894% 25/9/2037	4,537,536	0.05
USD 1,789,662	Bayview Commercial Asset Trust 2007-6 3.944% 25/12/2037	1,659,960	0.02
USD 2,057,969	Bayview Commercial Asset Trust 2008-2 4.944% 25/4/2038	2,020,415	0.02
USD 5,418,028	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 3.493% 28/5/2039	4,645,959	0.05
USD 1,382,593	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 3.793% 28/5/2039	1,049,188	0.01
USD 4,561,224	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-A 3.493% 28/2/2040	4,379,161	0.05
USD 425,466	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-E 3.493% 28/12/2040	417,578	0.01
USD 371,582	Bayview Opportunity Master Fund IVa Trust 2017-RT5 3.5% 28/5/2069	361,812	0.00
USD 8,312,000	BBCMS 2017-DELC Mortgage Trust 5.016% 15/8/2036	8,003,698	0.09
USD 3,451,000	BBCMS 2017-DELC Mortgage Trust 6.016% 15/8/2036	3,287,277	0.04
USD 840,000	BBCMS 2018-CHRS Mortgage Trust 4.409% 5/8/2038	632,956	0.01
USD 877,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 3.113% 15/3/2037	837,342	0.01
USD 11,710,000	BBCMS Trust 2015-SRCH 0.295% 10/8/2035	111,128	0.00
USD 19,674,351	BBCMS Trust 2015-SRCH 1.083% 10/8/2035	673,453	0.01
USD 1,268,970	BCAP 2011-RR5-I Trust 2.559% 28/5/2036	1,213,220	0.01
USD 2,093,435	BCAP Trust 2007-AA4 3.89% 25/6/2047	1,144,313	0.01
USD 1,627,547	BCMSC Trust 2000-A 7.575% 15/6/2030	255,870	0.00
USD 1,510,989	BCMSC Trust 2000-A 7.83% 15/6/2030	245,279	0.00
USD 1,089,739	BCMSC Trust 2000-A 8.29% 15/6/2030	186,958	0.00
USD 456,104	Bear Stearns ALT-A Trust 2006-6 2.764% 25/11/2036	382,739	0.00
USD 1,820,361	Bear Stearns ALT-A Trust 2007-1 2.764% 25/1/2047	1,620,294	0.02
USD 53,566	Bear Stearns ARM Trust 2004-5 3.175% 25/7/2034	50,446	0.00
USD 40,950	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2004-HE7 4.169% 25/8/2034	40,215	0.00
USD 1,864,657	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2005-AC9 6.25% 25/12/2035	1,371,605	0.02
USD 2,007,121	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2005-HE8 4.394% 25/8/2035	1,960,733	0.02
USD 2,867,903	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-AC1 6.25% 25/2/2036	2,122,432	0.02
USD 1,350,964	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE1 3.464% 25/12/2035	1,954,082	0.02
USD 1,951,335	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE7 2.784% 25/9/2036	1,891,036	0.02
USD 720,000	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE8 2.704% 25/10/2036	631,322	0.01
USD 479,164	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 2.584% 25/3/2037	449,544	0.01
USD 965,335	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 2.584% 25/3/2037	903,937	0.01
USD 932,242	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 2.764% 25/3/2037	853,656	0.01
USD 428,234	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE3 2.694% 25/4/2037	570,199	0.01
USD 5,208,289	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE3 2.794% 25/4/2037	5,110,250	0.06
USD 133,671	Bear Stearns Commercial Mortgage Trust 2005-PWR7 5.214% 11/2/2041	132,020	0.00
USD 251,082	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2006-SL1 2.724% 25/8/2036	244,793	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 262,774	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR2 2.614% 25/3/2037	243,669	0.00
USD 472,002	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR3 2.584% 25/3/2037	411,268	0.01
USD 315,370	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR4 2.654% 25/6/2037	297,548	0.00
USD 3,142,000	Beazer Homes USA 7.25% 15/10/2029	2,704,693	0.03
USD 612,000	Becton Dickinson 1.957% 11/2/2031	502,921	0.01
USD 1,750,000	Becton Dickinson 3.7% 6/6/2027	1,704,111	0.02
EUR 1,061,000	Belden 3.375% 15/7/2031*	851,363	0.01
EUR 300,000	Belden 3.875% 15/3/2028	278,292	0.00
USD 2,000,000	Belton Independent School District 4% 15/2/2047	1,935,663	0.02
USD 200,000	Benchmark 2018-B3 Mortgage Trust 3.188% 10/4/2051	159,893	0.00
USD 719,000	Berry Global 4.875% 15/7/2026	701,535	0.01
USD 5,012,995	BHMS 2018-ATLS 3.641% 15/7/2035	4,870,848	0.05
USD 4,161,000	BHMS 2018-ATLS 4.291% 15/7/2035	3,992,698	0.04
USD 612,000	Blackstone Finance 2% 30/1/2032	484,242	0.01
USD 464,000	Blue Racer Midstream / Blue Racer Finance 7.625% 15/12/2025	462,508	0.01
USD 2,710,000	Boston Properties 2.55% 1/4/2032	2,167,324	0.02
USD 830,000	Boston Properties 2.75% 1/10/2026	775,029	0.01
EUR 5,244,000	Boxer Parent 6.5% 2/10/2025	5,090,603	0.06
USD 4,109,000	Boyd Gaming 4.75% 1/12/2027	3,840,764	0.04
USD 568,000	BP Capital Markets America 3.001% 17/3/2052	417,602	0.01
USD 612,000	Bristol-Myers Squibb 1.45% 13/11/2030	502,481	0.01
USD 946,000	Bristol-Myers Squibb 2.55% 13/11/2050	662,120	0.01
USD 599,000	Bristol-Myers Squibb 3.25% 27/2/2027	588,021	0.01
USD 1,000,000	Bristol-Myers Squibb 3.9% 20/2/2028	995,631	0.01
USD 752,000	Broadcom 1.95% 15/2/2028	647,428	0.01
USD 5,412,000	Broadcom 2.45% 15/2/2031	4,359,206	0.05
USD 2,077,000	Broadcom 3.75% 15/2/2051	1,549,991	0.02
USD 82,000	Buckeye Partners 3.95% 1/12/2026	73,377	0.00
USD 1,477,000	Buckeye Partners 4.125% 1/3/2025	1,384,289	0.02
USD 1,500,000	Buckeye Partners 4.35% 15/10/2024	1,445,571	0.02
USD 1,584,492	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3.454% 10/3/2033	1,527,176	0.02
USD 2,604,935	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3.633% 10/3/2033	2,398,268	0.03
USD 13,358,641	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3.717% 10/3/2033	12,088,897	0.13
USD 573,000	BXP Trust 2017-CC 3.67% 13/8/2037	493,193	0.01
USD 2,156,000	BXP Trust 2017-CC 3.67% 13/8/2037	1,742,589	0.02
USD 470,000	BXP Trust 2017-GM 3.539% 13/6/2039	409,748	0.01
USD 945,000	BXP Trust 2017-GM 3.539% 13/6/2039	803,650	0.01
USD 1,864,000	Caesars Entertainment 6.25% 1/7/2025	1,823,847	0.02
USD 3,368,000	Caesars Entertainment 8.125% 1/7/2027	3,319,055	0.04
USD 1,970,000	California Pollution Control Financing Authority 5% 21/11/2045	1,972,899	0.02
USD 847,000	California Resources 7.125% 1/2/2026	834,638	0.01
USD 1,655,000	California State Public Works Board 8.361% 1/10/2034	2,180,612	0.02
USD 3,130,000	California State University 2.975% 1/11/2051	2,417,855	0.03
USD 250,000	Callon Petroleum 7.5% 15/6/2030	231,844	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 9,175,000	Calpine 4.5% 15/2/2028	8,372,064	0.09
USD 1,299,000	Calpine 5.125% 15/3/2028	1,157,460	0.01
USD 1,980,000	CAMB Commercial Mortgage Trust 2019-LIFE 4.541% 15/12/2037	1,926,095	0.02
USD 1,208,000	CAMB Commercial Mortgage Trust 2019-LIFE 5.641% 15/12/2037	1,168,718	0.01
USD 490,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC1 3.074% 25/1/2036	421,003	0.01
USD 1,042,223	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC3 2.594% 25/8/2036	994,596	0.01
USD 378,867	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC4 2.604% 25/10/2036	365,948	0.00
USD 2,720,607	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2007-FRE1 2.704% 25/2/2037	2,603,043	0.03
USD 425,000	Carrols Restaurant 5.875% 1/7/2029	319,481	0.00
EUR 1,768,000	Catalent Pharma Solutions 2.375% 1/3/2028	1,494,577	0.02
USD 572,000	CCO / CCO Capital 5% 1/2/2028	526,915	0.01
USD 425,000	CCO / CCO Capital 6.375% 1/9/2029	414,056	0.00
USD 1,270,000	CDI Escrow Issuer 5.75% 1/4/2030	1,176,782	0.01
USD 65,000	Cedar Fair 5.25% 15/7/2029	59,367	0.00
USD 65,000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5.375% 15/4/2027	61,326	0.00
USD 3,265,000	Celanese US 5.9% 5/7/2024	3,294,307	0.04
USD 3,590,000	Centene 2.45% 15/7/2028	3,032,324	0.03
USD 2,405,000	Centene 2.625% 1/8/2031	1,928,968	0.02
USD 2,444,000	Centene 4.25% 15/12/2027	2,319,782	0.03
USD 10,347,000	Centennial Resource Production 5.375% 15/1/2026	9,534,398	0.11
USD 1,448,000	Centennial Resource Production 6.875% 1/4/2027	1,399,275	0.02
USD 500,000	Central Parent / CDK Global 7.25% 15/6/2029	478,100	0.01
USD 2,210,000	Central Puget Sound Regional Transit Authority 4% 1/11/2046	2,188,807	0.02
USD 1,155,000	Central Puget Sound Regional Transit Authority 5% 1/11/2033	1,346,263	0.02
USD 9,849,000	Century Communities 6.75% 1/6/2027	9,662,632	0.11
USD 5,181,244	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C3 1.86% 10/1/2048	251,207	0.00
USD 5,189,832	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 0.854% 10/5/2058	121,494	0.00
USD 1,710,609	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 5.001% 10/5/2058	1,607,358	0.02
USD 1,462,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2017-C8 4.199% 15/6/2050	1,375,505	0.02
USD 940,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2018-TAN 4.236% 15/2/2033	930,857	0.01
USD 1,140,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2018-TAN 4.69% 15/2/2033	1,119,322	0.01
USD 1,080,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2018-TAN 5.295% 15/2/2033	1,057,379	0.01
USD 350,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2018-TAN 6.661% 15/2/2033	339,066	0.00
USD 1,634,000	Change Healthcare / Change Healthcare Finance 5.75% 1/3/2025	1,603,224	0.02
USD 326,000	Charles River Laboratories International 4.25% 1/5/2028	299,345	0.00
USD 612,000	Charles Schwab 1.65% 11/3/2031	496,730	0.01
USD 583,000	Charles Schwab 3.45% 13/2/2026	576,947	0.01
USD 297,000	Charles Schwab 4.2% 24/3/2025	299,338	0.00
USD 1,000,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 2.25% 15/1/2029	825,945	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,576,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 2.8% 1/4/2031	3,728,640	0.04
USD 838,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3.5% 1/6/2041	587,418	0.01
USD 710,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3.7% 1/4/2051	482,326	0.00
USD 1,789,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3.85% 1/4/2061	1,171,322	0.01
USD 844,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3.9% 1/6/2052	588,082	0.01
USD 1,784,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4.2% 15/3/2028	1,687,445	0.02
USD 1,250,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4.908% 23/7/2025	1,248,714	0.01
USD 9,792,481	Chase Mortgage Finance Trust Series 2007-S6 6% 25/12/2037	4,916,017	0.06
USD 1,142,000	Cheever Escrow Issuer 7.125% 1/10/2027	1,114,798	0.01
EUR 100,000	Chemours 4% 15/5/2026	93,521	0.00
USD 1,450,000	Cheniere Energy 4.625% 15/10/2028	1,397,713	0.02
USD 219,000	Cheniere Energy Partners 3.25% 31/1/2032	176,567	0.00
USD 905,000	Cheniere Energy Partners 4.5% 1/10/2029	831,582	0.01
USD 1,309,000	Chesapeake Energy 5.5% 1/2/2026	1,270,901	0.01
USD 179,000	Chesapeake Energy 5.875% 1/2/2029	171,215	0.00
USD 2,100,306	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-0A4 1.819% 25/4/2046	705,750	0.01
USD 371,326	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-0A5 2.844% 25/4/2046	351,968	0.00
USD 5,438,578	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-15 6.5% 25/9/2037	2,596,072	0.03
USD 68,000	Churchill Downs 4.75% 15/1/2028	61,477	0.00
USD 82,000	Churchill Downs 5.5% 1/4/2027	78,749	0.00
USD 490,000	Cigna 1.25% 15/3/2026	442,771	0.00
USD 435,000	Cigna 3.4% 15/3/2051	334,741	0.00
USD 1,087,496	Citicorp Mortgage Trust Series 2007-9 6.25% 25/12/2037	951,692	0.01
USD 1,094,104	Citicorp Mortgage Trust Series 2008-2 6.5% 25/6/2038	883,332	0.01
USD 1,427,000	Citigroup 0.981% 1/5/2025	1,345,993	0.01
USD 4,297,000	Citigroup 2.014% 25/1/2026	4,043,132	0.04
USD 6,950,000	Citigroup 3.07% 24/2/2028	6,453,678	0.07
USD 1,933,000	Citigroup 3.29% 17/3/2026	1,868,948	0.02
USD 1,867,000	Citigroup 3.352% 24/4/2025	1,831,080	0.02
USD 124,000	Citigroup 3.4% 1/5/2026	120,003	0.00
USD 1,560,000	Citigroup 3.52% 27/10/2028	1,456,360	0.02
USD 1,503,000	Citigroup 4.14% 24/5/2025	1,494,875	0.02
USD 1,734,000	Citigroup 4.412% 31/3/2031	1,663,453	0.02
USD 851,000	Citigroup 5.316% 26/3/2041	859,901	0.01
USD 1,622,121	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 5.258% 10/3/2047	1,599,264	0.02
USD 821,302	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 4.57% 10/2/2048	784,545	0.01
USD 20,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P3 5.051% 15/4/2049	18,521	0.00
USD 3,881,357	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 2.644% 25/5/2037	2,887,187	0.03
USD 2,521,975	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL3 2.614% 25/7/2045	1,854,214	0.02

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,149,550	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AMC1 2.604% 25/12/2036	1,231,178	0.01
USD 2,791,000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-WFHE2 3.149% 25/3/2037	2,607,681	0.03
USD 597,000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2014-C 4.25% 25/2/2054	551,221	0.01
USD 276,908	CitiMortgage Alternative Loan Trust Series 2007-A6 6% 25/6/2037	249,050	0.00
USD 4,405,000	City of Boston MA 5% 1/11/2037	5,154,538	0.06
USD 1,735,000	City of Charleston Waterworks & Sewer System Revenue 5% 1/1/2052	1,950,329	0.02
USD 2,955,000	City of Charlotte NC Airport Revenue 3% 1/7/2046	2,314,329	0.03
USD 1,440,000	City of Charlotte NC Airport Revenue 4% 1/7/2051	1,325,137	0.01
USD 2,150,000	City of Los Angeles Department of Airports 5% 15/5/2048	2,233,495	0.03
USD 475,000	City of Philadelphia PA Airport Revenue 5% 1/7/2042	487,792	0.01
USD 1,055,000	City of Riverside CA Electric Revenue 7.605% 1/10/2040	1,392,793	0.02
USD 1,885,000	City of Salt Lake City UT Airport Revenue 5% 1/7/2037	2,010,849	0.02
USD 3,015,000	City of Salt Lake City UT Airport Revenue 5% 1/7/2046	3,134,282	0.04
USD 9,965,000	City of Salt Lake City UT Airport Revenue 5% 1/7/2047	10,194,127	0.11
USD 1,560,000	City of Salt Lake City UT Public Utilities Revenue 5% 1/2/2052	1,734,788	0.02
USD 1,375,000	City of Tampa FL Water & Wastewater System Revenue 5% 1/10/2052	1,527,079	0.02
USD 177,000	Clean Harbors 4.875% 15/7/2027	168,620	0.00
USD 206,000	Clear Channel Outdoor 5.125% 15/8/2027	184,584	0.00
USD 612,000	Clorox 1.8% 15/5/2030	502,426	0.01
USD 2,000,000	Clorox 3.9% 15/5/2028	1,973,199	0.02
USD 612,000	Coca-Cola 1.375% 15/3/2031	502,189	0.01
USD 946,000	Coca-Cola 2.5% 15/3/2051	682,882	0.01
USD 329,000	Coca-Cola 3% 5/3/2051	262,245	0.00
USD 677,000	Colgate Energy Partners III 5.875% 1/7/2029	628,398	0.01
USD 379,000	Colgate Energy Partners III 7.75% 15/2/2026	378,748	0.00
USD 2,490,000	Colorado Health Facilities Authority 4% 15/11/2046	2,359,379	0.03
USD 612,000	Comcast 1.5% 15/2/2031	493,364	0.00
USD 1,500,000	Comcast 2.35% 15/1/2027	1,401,810	0.02
USD 7,001,000	Comcast 2.45% 15/8/2052	4,627,639	0.05
USD 563,000	Comcast 2.937% 1/11/2056	389,198	0.00
USD 1,126,000	Comcast 2.987% 1/11/2063	763,839	0.01
USD 1,380,000	Comcast 3.15% 1/3/2026	1,344,492	0.01
USD 1,750,000	Comcast 3.3% 1/2/2027	1,695,313	0.02
USD 156,000	Comcast 3.55% 1/5/2028	151,166	0.00
USD 980,000	Comcast 3.95% 15/10/2025	978,438	0.01
USD 100,000	COMM 2013-300P Mortgage Trust 4.54% 10/8/2030	94,441	0.00
USD 520,573	COMM 2013-GAM 3.367% 10/2/2028	513,771	0.01
USD 1,740,000	COMM 2013-WWP Mortgage Trust 3.898% 10/3/2031	1,740,684	0.02
USD 711,283	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust 4.82% 10/2/2047	697,005	0.01
USD 1,265,000	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 4.514% 10/9/2047	1,214,808	0.01
USD 2,691,000	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust 4.487% 10/8/2048	2,586,141	0.03
USD 4,115,626	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 0.966% 10/8/2048	80,668	0.00
USD 1,024,500	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 4.678% 10/8/2048	943,345	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,316,780	COMM 2015-LC23 Mortgage Trust 3.774% 10/10/2048	1,289,258	0.01
USD 111,320,422	COMM 2016-667M Mortgage Trust 0.145% 10/10/2036	312,810	0.00
USD 1,100,000	COMM 2016-667M Mortgage Trust 3.285% 10/10/2036	902,092	0.01
USD 2,910,275	COMM 2018-COR3 Mortgage Trust 1.75% 10/5/2051	224,766	0.00
USD 5,105,000	Commercial Metals 4.125% 15/1/2030	4,469,735	0.05
USD 1,857,000	Commercial Metals 4.375% 15/3/2032	1,576,370	0.02
USD 425,000	Commonwealth Financing Authority 4.144% 1/6/2038	409,698	0.00
USD 295,000	Commonwealth of Massachusetts 2.9% 1/9/2049	223,053	0.00
USD 1,880,000	Commonwealth of Massachusetts 5% 1/9/2049	2,070,839	0.02
USD 235,000	Commonwealth of Massachusetts 5.456% 1/12/2039	259,458	0.00
USD 4,513,000	Connect Finco / Connect US Finco 6.75% 1/10/2026	4,140,626	0.05
USD 4,489,000	Connecticut Avenue Trust 2022-R01 5.333% 25/12/2041	4,143,674	0.05
USD 1,980,000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 5% 1/7/2045	2,018,548	0.02
USD 147,721	Conseco Finance 6.28% 1/9/2030	148,339	0.00
USD 522,516	Conseco Finance 6.63% 1/6/2030	500,107	0.01
USD 238,920	Conseco Finance 6.83% 1/4/2030	232,855	0.00
USD 2,023,276	Conseco Finance 6.98% 1/9/2030	1,926,348	0.02
USD 460,356	Conseco Finance 7.21% 15/1/2029	438,529	0.01
USD 819,777	Conseco Finance 7.5% 1/3/2030	366,135	0.00
USD 802,188	Conseco Finance 7.53% 15/3/2028	801,885	0.01
USD 764,360	Conseco Finance 7.86% 1/3/2030	354,549	0.00
USD 1,781,141	Conseco Finance Securitizations 7.96% 1/5/2031	623,771	0.01
USD 1,191,186	Conseco Finance Securitizations 8.06% 1/9/2029	297,297	0.00
USD 3,241,702	Conseco Finance Securitizations 8.2% 1/5/2031	1,168,513	0.01
USD 1,472,272	Conseco Finance Securitizations 8.31% 1/5/2032	352,925	0.00
USD 415,000	Conservation Fund A Nonprofit 3.474% 15/12/2029	379,613	0.00
USD 850,000	Contra Costa Community College District 6.504% 1/8/2034	980,486	0.01
USD 612,000	Costco Wholesale 1.75% 20/4/2032	506,692	0.01
USD 291,000	Cottage Health Obligated 3.304% 1/11/2049	231,445	0.00
EUR 2,269,000	Coty 3.875% 15/4/2026*	2,116,391	0.02
EUR 300,000	Coty 4.75% 15/4/2026*	272,655	0.00
USD 1,679,115	Countrywide Asset-Backed Certificates 2.759% 25/5/2037	1,299,867	0.02
USD 4,800,000	Countrywide Asset-Backed Certificates 2.879% 25/11/2036	4,427,712	0.05
USD 650,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/4/2029	750,476	0.01
USD 360,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/10/2030	423,470	0.00
USD 295,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/10/2031	350,185	0.00
USD 360,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/10/2032	428,300	0.00
USD 360,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/10/2033	424,460	0.00
USD 360,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/10/2034	421,373	0.00
USD 360,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/10/2035	419,184	0.00
USD 360,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/10/2036	417,807	0.00
USD 850,000	County of Broward FL Airport System Revenue 2.914% 1/10/2032	745,493	0.01
USD 5,000,000	County of Fairfax VA Sewer Revenue 4% 15/7/2051	5,057,188	0.06
USD 360,000	County of Guilford NC 5% 1/3/2030	419,977	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,090,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 2.529% 1/10/2030	1,816,400	0.02
USD 795,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.454% 1/10/2030	739,788	0.01
USD 1,475,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 4.062% 1/10/2031	1,425,692	0.02
USD 1,725,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2038	1,787,959	0.02
USD 2,475,000	County of Miami-Dade FL Water & Sewer System Revenue 4% 1/10/2051	2,342,080	0.03
USD 9,160,000	County of Montgomery MD 4% 1/12/2044	8,538,568	0.10
USD 769,000	Covanta 4.875% 1/12/2029	650,189	0.01
USD 3,000,000	Cox Communications 1.8% 1/10/2030	2,392,671	0.03
USD 504,482	Credit Suisse ABS Repackaging Trust 2013-A 2.5% 25/1/2030	488,533	0.01
USD 3,418	Credit Suisse First Boston Mortgage 4.877% 15/4/2037	3,318	0.00
USD 7,508,474	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 6.5% 27/10/2037	3,341,956	0.04
USD 1,504,008	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 1.964% 25/7/2037	1,057,466	0.01
USD 303,734	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 3.022% 25/12/2036	259,791	0.00
USD 3,420,338	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 6.056% 25/9/2036	226,301	0.00
USD 648,861	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 6.25% 25/10/2036	624,145	0.01
USD 612,000	Crown Castle 2.5% 15/7/2031	506,418	0.01
USD 473,000	Crown Castle 3.25% 15/1/2051	342,558	0.00
USD 1,000,000	Crown Castle 3.3% 1/7/2030	893,887	0.01
USD 1,503,000	Crown Castle 4.3% 15/2/2029	1,454,448	0.02
USD 1,298,000	CrownRock / CrownRock Finance 5.625% 15/10/2025	1,280,412	0.01
USD 19,163,000	CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust 0.26% 15/11/2050	219,192	0.00
USD 887,395	CSAIL 2018-C14 Commercial Mortgage Trust 5.087% 15/11/2051	803,494	0.01
USD 2,494,000	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust 4.898% 15/8/2051	2,313,033	0.03
USD 563,000	CSC 5.25% 1/6/2024	550,616	0.01
USD 497,000	CSC 5.5% 15/4/2027	470,218	0.00
USD 271,000	CSC 6.5% 1/2/2029	252,962	0.00
USD 116,659,107	CSMC 2014-USA 0A 0.186% 15/9/2037	257,817	0.00
USD 770,000	CSMC 2017-TIME 3.646% 13/11/2039	689,796	0.01
USD 527,909	CSMC Series 2014-4R 2.459% 27/2/2036	551,280	0.01
USD 1,312,054	CSMC Series 2015-4R 2.409% 27/10/2036	964,354	0.01
USD 790,000	CSMC Trust 2017-PFHP 3.341% 15/12/2030	786,166	0.01
USD 946,000	CSX 2.5% 15/5/2051	643,802	0.01
USD 2,367,000	CVS Health 1.75% 21/8/2030	1,924,109	0.02
USD 4,609,000	CVS Health 2.7% 21/8/2040	3,375,514	0.04
USD 500,000	CVS Health 2.875% 1/6/2026	478,435	0.01
USD 2,150,000	CVS Health 3.75% 1/4/2030	2,027,230	0.02
USD 713,000	CVS Health 5.05% 25/3/2048	694,329	0.01
USD 4,259,221	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-16 4.504% 25/4/2036	3,777,691	0.04
USD 2,958,237	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-17 6.547% 25/5/2036	2,445,136	0.03
USD 27,377	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 2.604% 25/9/2046	27,266	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 863,451	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 2.704% 25/12/2036	803,505	0.01
USD 6,137,834	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-18 2.894% 25/3/2037	4,931,034	0.06
USD 260,112	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-U 2.661% 15/3/2034	250,051	0.00
USD 196,729	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S3 6.019% 25/1/2029	295,878	0.00
USD 87,778	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S5 6.155% 25/6/2035	108,133	0.00
USD 1,072,499	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 2.581% 15/5/2035	1,053,944	0.01
USD 58,184	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 2.581% 15/5/2035	56,035	0.00
USD 189,379	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005-B 2.571% 15/5/2035	186,025	0.00
USD 967,084	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-C 2.571% 15/5/2036	924,694	0.01
USD 449,055	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-H 2.541% 15/11/2036	431,194	0.01
USD 650,000	Dallas Fort Worth International Airport 3.144% 1/11/2045	526,750	0.01
USD 417,000	Dana 4.25% 1/9/2030	338,501	0.00
USD 946,000	Danaher 2.8% 10/12/2051	686,901	0.01
USD 162,000	Darling Ingredients 5.25% 15/4/2027	158,713	0.00
USD 3,655,051	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 3.669% 15/5/2035	3,573,159	0.04
USD 3,207,307	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 4.369% 15/5/2035	3,076,296	0.03
USD 4,389,268	DBJPM 2017-C6 Mortgage Trust 1% 10/6/2050	166,573	0.00
USD 6,941,235	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3.648% 10/10/2034	6,408,742	0.07
USD 3,439,265	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3.648% 10/10/2034	3,132,821	0.04
USD 1,080,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3.648% 10/10/2034	1,004,338	0.01
USD 2,072,000	Dell International / EMC 3.45% 15/12/2051	1,394,921	0.02
USD 1,412,000	Dell International / EMC 5.3% 1/10/2029	1,407,810	0.02
USD 2,747,000	Dell International / EMC 6.02% 15/6/2026	2,861,757	0.03
USD 3,505	Deutsche ALT-A 5.674% 27/1/2037	3,532	0.00
USD 4,749,724	Deutsche Alt-A Mortgage Loan Trust Series 2007-OA4/DE 2.784% 25/8/2047	4,964,899	0.06
USD 174,252	Deutsche Alt-B Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 6.364% 25/7/2036	151,046	0.00
USD 272,988	Deutsche Alt-B Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 6.51% 25/7/2036	236,602	0.00
USD 562,000	Discovery Communications 4% 15/9/2055	378,430	0.00
USD 900,000	District of Columbia 5% 15/7/2034	937,486	0.01
USD 900,000	District of Columbia 5% 15/7/2035	936,297	0.01
USD 1,545,000	DocuSign 0% 15/1/2024	1,454,739	0.02
EUR 1,600,000	Dow Chemical 1.875% 15/3/2040	1,110,632	0.01
USD 612,000	Duke Realty 2.25% 15/1/2032	510,674	0.01
USD 3,989,000	Earthstone Energy 8% 15/4/2027	3,914,446	0.04
USD 326,000	eBay 1.9% 11/3/2025	308,122	0.00
USD 524,000	Elanco Animal Health 6.4% 28/8/2028	491,250	0.01
USD 3,426,000	Elevance Health 1.5% 15/3/2026	3,133,866	0.03
USD 217,000	Elevance Health 2.375% 15/1/2025	208,397	0.00
USD 1,750,000	Elevance Health 2.875% 15/9/2029	1,581,326	0.02
USD 690,000	Elevance Health 3.125% 15/5/2050	524,015	0.01
USD 715,000	Elevance Health 3.65% 1/12/2027	694,411	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
EUR 3,840,000	Eli Lilly 1.375% 14/9/2061	2,137,574	0.02
USD 946,000	Eli Lilly 2.25% 15/5/2050	664,162	0.01
USD 300,000	Eli Lilly 3.1% 15/5/2027	293,218	0.00
USD 2,745,000	Eli Lilly 3.375% 15/3/2029	2,671,735	0.03
USD 1,260,000	Elmwood CLO 15 1.981% 22/4/2035	1,226,705	0.01
USD 2,750,000	Elmwood CLO 15 4.311% 22/4/2035	2,531,735	0.03
GBP 791,000	Encore Capital 4.25% 1/6/2028	749,851	0.01
EUR 1,725,000	Encore Capital 4.875% 15/10/2025	1,673,859	0.02
GBP 600,000	Encore Capital 5.375% 15/2/2026	654,465	0.01
USD 415,000	Endeavor Energy Resources / EER Finance 5.75% 30/1/2028	411,140	0.00
USD 1,000,000	Enterprise Products Operating 3.9% 15/2/2024	997,811	0.01
USD 2,750,000	Equinix 1% 15/9/2025	2,483,945	0.03
USD 2,102,000	Equinix 2.5% 15/5/2031	1,741,339	0.02
USD 690,000	Equinix 2.625% 18/11/2024	666,737	0.01
USD 2,515,000	Equinix 2.95% 15/9/2051	1,719,161	0.02
USD 473,000	Equinix 3% 15/7/2050	326,134	0.00
USD 1,599,000	Equinix 3.2% 18/11/2029	1,441,334	0.02
USD 1,118,000	Exelon 2.75% 15/3/2027	1,048,406	0.01
USD 612,000	Expedia 2.95% 15/3/2031	514,394	0.01
USD 834,876	Fannie Mae Pool 2% 1/9/2050	724,016	0.01
USD 371,282	Fannie Mae Pool 2% 1/10/2050	322,049	0.00
USD 10,068,891	Fannie Mae Pool 2.5% 1/2/2051	9,083,104	0.10
USD 5,874,814	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2050	5,509,155	0.06
USD 3,758,080	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2051	3,512,442	0.04
USD 1,082,547	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2051	1,014,390	0.01
USD 1,589,587	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2051	1,482,616	0.02
USD 1,583,568	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2051	1,477,166	0.02
USD 3,563,687	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2051	3,335,997	0.04
USD 1,364,225	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2052	1,277,130	0.01
USD 20,246,861	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2052	18,955,053	0.21
USD 2,260,246	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2052	2,108,346	0.02
USD 3,930,888	Fannie Mae Pool 3.5% 1/1/2048	3,834,710	0.04
USD 1,864,044	Fannie Mae Pool 3.5% 1/2/2050	1,799,447	0.02
USD 81,764	Fannie Mae Pool 3.5% 1/2/2050	79,114	0.00
USD 1,406,636	Fannie Mae Pool 3.5% 1/11/2050	1,358,304	0.02
USD 3,538,074	Fannie Mae Pool 3.5% 1/11/2050	3,418,287	0.04
USD 11,335,149	Fannie Mae Pool 3.5% 1/12/2050	10,953,136	0.12
USD 65,179	Fannie Mae Pool 3.5% 1/3/2051	62,768	0.00
USD 51,380	Fannie Mae Pool 3.5% 1/6/2051	49,479	0.00
USD 55,272	Fannie Mae Pool 3.5% 1/7/2051	53,234	0.00
USD 54,990	Fannie Mae Pool 3.5% 1/8/2051	52,956	0.00
USD 13,867,102	Fannie Mae Pool 3.5% 1/3/2052	13,401,766	0.15
USD 7,111,367	Fannie Mae Pool 3.5% 1/3/2052	6,842,461	0.08
USD 3,906,530	Fannie Mae Pool 3.5% 1/3/2052	3,748,839	0.04
USD 11,357,223	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2052	10,966,443	0.12
USD 7,213,403	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2052	6,947,347	0.08

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 6,188,490	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2052	5,980,823	0.07
USD 387,291	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2047	385,575	0.00
USD 697,328	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2048	694,802	0.01
USD 801,250	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2048	798,267	0.01
USD 572,884	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2048	571,828	0.01
USD 575,161	Fannie Mae Pool 4% 1/7/2048	571,740	0.01
USD 1,654,967	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2048	1,649,758	0.02
USD 4,605,476	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2049	4,576,053	0.05
USD 15,520,008	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2049	15,473,052	0.17
USD 4,799,071	Fannie Mae Pool 4% 1/2/2050	4,728,898	0.05
USD 269,544	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2050	267,138	0.00
USD 1,809,612	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2050	1,792,213	0.02
USD 6,389,097	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2050	6,365,145	0.07
USD 1,950,191	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2050	1,928,161	0.02
USD 2,514,810	Fannie Mae Pool 4% 1/8/2050	2,493,807	0.03
USD 379,067	Fannie Mae Pool 4% 1/11/2050	375,201	0.00
USD 39,662,483	Fannie Mae Pool 4% 1/1/2051	39,362,602	0.44
USD 44,974,070	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2051	44,572,703	0.50
USD 5,779,390	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2051	5,709,043	0.06
USD 118,279,830	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2051	116,881,546	1.30
USD 43,299,351	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2051	42,788,358	0.48
USD 555,297	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2052	555,194	0.01
USD 780,239	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2052	779,919	0.01
USD 1,497,100	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2052	1,477,518	0.02
USD 542,269	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2047	549,435	0.01
USD 52,396	Fannie Mae Pool 4.5% 1/6/2048	52,777	0.00
USD 677,493	Fannie Mae Pool 4.5% 1/9/2048	680,160	0.01
USD 8,105,734	Fannie Mae Pool 4.5% 1/1/2049	8,171,958	0.09
USD 902,047	Fannie Mae Pool 4.5% 1/5/2049	910,483	0.01
USD 381,857	Fannie Mae Pool 4.5% 1/6/2049	384,807	0.00
USD 1,500,411	Fannie Mae Pool 4.5% 1/7/2049	1,516,274	0.02
USD 526,213	Fannie Mae Pool 4.5% 1/9/2049	524,395	0.01
USD 334,928	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2049	337,988	0.00
USD 1,706,412	Fannie Mae Pool 4.5% 1/11/2049	1,713,760	0.02
USD 759,130	Fannie Mae Pool 4.5% 1/1/2050	757,979	0.01
USD 927,185	Fannie Mae Pool 4.5% 1/1/2050	933,554	0.01
USD 2,037,600	Fannie Mae Pool 4.5% 1/9/2050	2,049,662	0.02
USD 2,827,728	Fannie Mae Pool 4.5% 1/9/2050	2,857,571	0.03
USD 1,244,431	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2050	1,246,957	0.01
USD 19,195,574	Fannie Mae Pool 4.5% 1/12/2050	19,257,578	0.21
USD 3,778,030	Fannie Mae Pool 4.5% 1/1/2051	3,774,678	0.04
USD 2,276,045	Fannie Mae Pool 4.5% 1/4/2052	2,322,005	0.03
USD 1,243,531	Fannie Mae REMICS 3% 25/2/2052	147,367	0.00
USD 3,460,454	Fannie Mae REMICS 4% 25/5/2050	673,548	0.01
USD 11,853,995	Fannie Mae REMICS 4% 25/11/2050	2,286,070	0.03
USD 2,079,182	Fannie Mae REMICS 4% 25/11/2050	399,709	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,429,169	Fannie Mae REMICS 4% 25/6/2051	666,111	0.01
USD 4,651,821	Fannie Mae REMICS 4% 25/8/2051	873,867	0.01
USD 1,610,000	FedEx 3.25% 1/4/2026	1,575,085	0.02
USD 242,000	Fidelity National Information Services 1.15% 1/3/2026	215,131	0.00
USD 799,734	First Franklin Mortgage Loan Trust 2004-FFH3 3.494% 25/10/2034	750,977	0.01
USD 1,477,450	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 2.684% 25/10/2036	1,062,443	0.01
USD 866,415	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 2.764% 25/10/2036	625,491	0.01
USD 5,485,604	First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-FF2 2.584% 25/3/2037	3,164,228	0.04
USD 2,552,000	Fiserv 3.2% 1/7/2026	2,433,872	0.03
USD 369,000	Fiserv 4.4% 1/7/2049	322,659	0.00
USD 7,341,000	Five Point Operating / Five Point Capital 7.875% 15/11/2025	6,417,852	0.07
USD 3,228,266	Flagstar Mortgage Trust 2018-6RR 4.916% 25/10/2048	2,983,781	0.03
USD 135,000	Ford Foundation/The 2.415% 1/6/2050	96,204	0.00
USD 1,144,000	Ford Motor 3.25% 12/2/2032	898,223	0.01
USD 3,642,000	Ford Motor 6.1% 19/8/2032	3,579,321	0.04
USD 4,381,000	Ford Motor Credit 3.35% 1/11/2022	4,385,359	0.05
USD 1,837,000	Ford Motor Credit 5.584% 18/3/2024	1,830,985	0.02
USD 739,000	Forestar 3.85% 15/5/2026	624,990	0.01
USD 5,361,000	Forestar 5% 1/3/2028	4,449,546	0.05
USD 18,670,061	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0.943% 25/5/2029	784,423	0.01
USD 13,124,339	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.015% 25/6/2029	641,535	0.01
USD 30,127,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.024% 25/6/2029	1,591,618	0.02
USD 6,939,170	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.12% 25/10/2030	446,570	0.01
USD 3,380,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.467% 25/12/2029	239,636	0.00
USD 350,978	Freddie Mac Pool 2% 1/8/2050	304,468	0.00
USD 5,028,375	Freddie Mac Pool 3% 1/6/2051	4,690,376	0.05
USD 7,541,399	Freddie Mac Pool 3% 1/7/2051	7,080,964	0.08
USD 1,100,596	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2051	1,029,622	0.01
USD 10,532,609	Freddie Mac Pool 3% 1/9/2051	9,859,672	0.11
USD 4,736,813	Freddie Mac Pool 3% 1/10/2051	4,423,056	0.05
USD 2,996,547	Freddie Mac Pool 3% 1/11/2051	2,811,701	0.03
USD 4,126,681	Freddie Mac Pool 3% 1/11/2051	3,851,715	0.04
USD 13,674,690	Freddie Mac Pool 3% 1/11/2051	12,823,206	0.14
USD 6,250,523	Freddie Mac Pool 3% 1/12/2051	5,856,980	0.07
USD 13,837,091	Freddie Mac Pool 3% 1/1/2052	12,934,290	0.14
USD 19,287,418	Freddie Mac Pool 3% 1/1/2052	18,056,642	0.20
USD 5,133,291	Freddie Mac Pool 3% 1/1/2052	4,832,396	0.05
USD 27,387,795	Freddie Mac Pool 3% 1/2/2052	25,699,868	0.29
USD 6,786,581	Freddie Mac Pool 3% 1/2/2052	6,330,213	0.07
USD 56,188,093	Freddie Mac Pool 3% 1/3/2052	52,640,493	0.59
USD 68,086	Freddie Mac Pool 3.5% 1/6/2051	65,568	0.00
USD 46,590	Freddie Mac Pool 3.5% 1/8/2051	44,866	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,112,149	Freddie Mac Pool 4% 1/6/2049	1,106,144	0.01
USD 15,225,259	Freddie Mac Pool 4% 1/3/2050	15,169,304	0.17
USD 8,704,668	Freddie Mac Pool 4% 1/5/2050	8,590,672	0.10
USD 1,910,658	Freddie Mac Pool 4% 1/4/2052	1,885,668	0.02
USD 164,512	Freddie Mac Pool 4.5% 1/9/2048	165,324	0.00
USD 3,945,916	Freddie Mac Pool 4.5% 1/1/2051	3,984,795	0.04
USD 1,127,906	Freddie Mac Pool 4.5% 1/2/2051	1,132,243	0.01
USD 1,409,208	Freddie Mac Pool 4.5% 1/4/2052	1,412,000	0.02
USD 880,387	Freddie Mac Pool 4.5% 1/4/2052	883,501	0.01
USD 1,525,971	Freddie Mac Pool 4.5% 1/4/2052	1,537,016	0.02
USD 1,499,006	Freddie Mac Pool 4.5% 1/4/2052	1,515,405	0.02
USD 1,419,781	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2050	203,354	0.00
USD 1,544,723	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2051	229,197	0.00
USD 1,967,444	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2051	341,640	0.00
USD 3,569,518	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2051	540,623	0.01
USD 1,406,273	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2051	192,564	0.00
USD 2,960,216	Freddie Mac REMICS 3% 25/10/2051	490,001	0.01
USD 3,848,813	Freddie Mac REMICS 3% 25/10/2051	547,061	0.01
USD 1,876,604	Freddie Mac REMICS 3% 25/11/2051	292,507	0.00
USD 4,095,799	Freddie Mac REMICS 3% 25/11/2051	623,518	0.01
USD 6,392,021	Freddie Mac REMICS 3% 25/2/2052	972,527	0.01
USD 2,655,888	Freddie Mac REMICS 3.5% 25/9/2048	493,076	0.01
USD 1,443,304	Freddie Mac REMICS 4% 25/7/2049	225,060	0.00
USD 1,164,120	Freddie Mac REMICS 4% 25/9/2050	221,750	0.00
USD 5,457,810	Freddie Mac REMICS 4% 25/12/2050	1,015,168	0.01
USD 1,502,871	Freddie Mac REMICS 4.5% 25/6/2050	280,891	0.00
USD 1,626,412	Freddie Mac REMICS 4.5% 25/10/2050	346,522	0.00
USD 490,000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA5 6.983% 25/10/2050	496,568	0.01
USD 4,655,448	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 5.583% 25/1/2042	4,250,643	0.05
USD 318,575	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 4.894% 25/12/2042	318,727	0.00
USD 1,538,279	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 6.894% 25/3/2030	1,604,904	0.02
USD 402,171	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 10.394% 25/5/2025	407,423	0.00
USD 241,961	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 13.944% 25/1/2025	245,843	0.00
USD 2,286,000	Freedom Mortgage 8.125% 15/11/2024	2,023,339	0.02
USD 2,002,000	Freedom Mortgage 8.25% 15/4/2025	1,740,075	0.02
USD 2,167,000	Freeport-McMoRan 3.875% 15/3/2023	2,167,940	0.02
USD 782,435	FREMF 2017-KGS1 Mortgage Trust 3.713% 25/10/2027	736,674	0.01
USD 1,262,121	FREMF 2018-K732 Mortgage Trust 4.188% 25/5/2025	1,230,812	0.01
USD 4,972,000	FREMF 2018-KW05 Trust 3.786% 25/4/2028	4,338,858	0.05
USD 83,491,759	FREMF 2019-KW08 Mortgage Trust 0.1% 25/1/2029	365,435	0.00
USD 3,038,646	Fremont Home Loan Trust 2006-3 2.724% 25/2/2037	2,356,433	0.03
USD 1,355,000	Fresno Unified School District 4% 1/8/2046	1,307,780	0.01
USD 3,211,000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	2,825,038	0.03
USD 3,575,000	Frontier Communications 5.875% 15/10/2027	3,341,724	0.04

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,712,000	Frontier Communications 6.75% 1/5/2029	4,086,223	0.04
USD 2,915,000	Frontier Communications 8.75% 15/5/2030	3,013,673	0.03
USD 4,530,000	Frontier Florida 6.86% 1/2/2028	4,319,785	0.05
USD 1,125,000	Frontier North 6.73% 15/2/2028	1,032,930	0.01
USD 10,309,000	FS Rialto 2022-FL6 Issuer 4.58% 19/8/2037	10,237,290	0.11
USD 776,000	Full House Resorts 8.25% 15/2/2028	709,252	0.01
USD 2,501,562	GAM Resecuritization Trust 2018-B 3.5% 27/8/2051	2,347,626	0.03
USD 226,000	GATX 3.5% 15/3/2028	209,505	0.00
USD 1,770,000	General Mills 4.2% 17/4/2028	1,766,978	0.02
USD 3,265,000	General Motors 5.2% 1/4/2045	2,780,141	0.03
USD 2,000,000	General Motors 5.4% 2/10/2023	2,021,350	0.02
USD 2,890,000	General Motors 5.4% 15/10/2029	2,826,018	0.03
USD 1,309,000	General Motors 5.95% 1/4/2049	1,228,349	0.01
EUR 822,000	General Motors Financial 0.6% 20/5/2027	696,341	0.01
USD 3,500,000	General Motors Financial 2.35% 26/2/2027	3,115,437	0.03
USD 612,000	General Motors Financial 2.35% 8/1/2031	479,504	0.01
USD 3,995,000	General Motors Financial 2.7% 20/8/2027	3,558,705	0.04
USD 2,500,000	General Motors Financial 3.8% 7/4/2025	2,436,512	0.03
USD 1,400,000	General Motors Financial 4.35% 9/4/2025	1,381,832	0.02
USD 1,810,000	George Washington University/The 4.126% 15/9/2048	1,672,109	0.02
USD 860,000	Georgia State Road & Tollway Authority 4% 15/7/2038	880,394	0.01
USD 269,000	Georgia-Pacific 3.6% 1/3/2025	265,153	0.00
USD 1,650,000	Georgia-Pacific 3.734% 15/7/2023	1,647,910	0.02
USD 1,600,000	Gilead Sciences 1.2% 1/10/2027	1,386,333	0.02
USD 612,000	Gilead Sciences 1.65% 1/10/2030	501,272	0.01
USD 2,885,000	Gilead Sciences 2.8% 1/10/2050	2,006,519	0.02
USD 2,000,000	Gilead Sciences 3.65% 1/3/2026	1,967,602	0.02
USD 1,174,000	Global Payments 2.65% 15/2/2025	1,119,142	0.01
USD 650,000	Global Payments 3.2% 15/8/2029	571,521	0.01
USD 300,000	Global Payments 3.75% 1/6/2023	299,704	0.00
USD 1,145,000	Global Payments 4% 1/6/2023	1,145,297	0.01
USD 389,000	Global Payments 4.15% 15/8/2049	300,454	0.00
USD 950,000	GLP Capital / GLP Financing II 3.35% 1/9/2024	908,815	0.01
USD 1,086,000	GLP Capital / GLP Financing II 4% 15/1/2031	946,675	0.01
USD 904,000	Golden Entertainment 7.625% 15/4/2026	916,557	0.01
USD 840,000	Golden State Tobacco Securitization 3.487% 1/6/2036	697,618	0.01
USD 424,000	Goldman Sachs 0.855% 12/2/2026	386,469	0.00
EUR 10,300,000	Goldman Sachs 0.875% 9/5/2029	8,520,225	0.09
USD 3,340,000	Goldman Sachs 1.093% 9/12/2026	2,978,484	0.03
USD 9,310,000	Goldman Sachs 1.217% 6/12/2023	9,010,945	0.10
EUR 5,600,000	Goldman Sachs 1.25% 7/2/2029	4,792,304	0.05
USD 1,709,000	Goldman Sachs 1.431% 9/3/2027	1,522,171	0.02
USD 6,500,000	Goldman Sachs 1.542% 10/9/2027	5,723,060	0.06
USD 2,818,000	Goldman Sachs 1.948% 21/10/2027	2,511,666	0.03
USD 2,035,000	Goldman Sachs 1.992% 27/1/2032	1,618,774	0.02
USD 612,000	Goldman Sachs 2.383% 21/7/2032	498,132	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,558,000	Goldman Sachs 2.908% 21/7/2042	1,149,569	0.01
USD 4,633,000	Goldman Sachs 3.615% 15/3/2028	4,396,228	0.05
USD 5,170,841	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-3 2.1% 20/5/2048	4,421,378	0.05
USD 3,710,431	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-5 2.31% 20/10/2048	3,196,436	0.04
USD 6,133,000	GoTo 5.5% 1/9/2027	4,476,080	0.05
USD 4,445,262	Government National Mortgage Association 0.312% 16/10/2054	63,935	0.00
USD 6,246,128	Government National Mortgage Association 0.538% 16/3/2055	122,890	0.00
USD 3,762,108	Government National Mortgage Association 0.58% 16/9/2053	53,349	0.00
USD 662,128	Government National Mortgage Association 0.58% 16/10/2056	18,969	0.00
USD 2,925,300	Government National Mortgage Association 0.602% 16/9/2055	72,877	0.00
USD 648,693	Government National Mortgage Association 0.695% 16/8/2057	19,884	0.00
USD 406,887	Government National Mortgage Association 0.763% 16/2/2050	10,667	0.00
USD 3,224,540	Government National Mortgage Association 0.774% 16/12/2057	123,883	0.00
USD 3,673,644	Government National Mortgage Association 2.5% 20/9/2050	453,360	0.01
USD 15,761,616	Government National Mortgage Association 2.5% 20/10/2050	2,214,948	0.03
USD 3,155,809	Government National Mortgage Association 2.5% 20/10/2050	407,374	0.00
USD 1,080,863	Government National Mortgage Association 2.5% 20/11/2050	131,333	0.00
USD 2,434,980	Government National Mortgage Association 2.5% 20/11/2050	310,187	0.00
USD 3,858,127	Government National Mortgage Association 2.5% 20/12/2050	487,188	0.01
USD 830,475	Government National Mortgage Association 2.5% 20/6/2051	104,549	0.00
USD 2,294,418	Government National Mortgage Association 3% 20/12/2051	287,795	0.00
USD 1,374,028	Government National Mortgage Association 3% 20/12/2051	189,815	0.00
USD 2,038,108	Government National Mortgage Association 3.5% 20/1/2051	346,994	0.00
USD 3,097,718	Government National Mortgage Association 3.5% 20/10/2051	416,157	0.01
USD 1,536,570	Government National Mortgage Association 3.5% 20/11/2051	197,818	0.00
USD 1,374,758	Government National Mortgage Association 3.5% 20/11/2051	185,794	0.00
USD 2,801,771	Government National Mortgage Association 3.5% 20/12/2051	372,228	0.00
USD 2,066,852	Government National Mortgage Association 4% 20/5/2051	337,152	0.00
USD 1,269,204	Government National Mortgage Association 4% 20/9/2051	184,099	0.00
USD 3,017,703	Government National Mortgage Association 4% 20/12/2051	455,490	0.01
USD 1,462,000	Grand Canyon University 3.25% 1/10/2023	1,443,725	0.02
USD 2,102,000	Grand Canyon University 5.125% 1/10/2028	1,953,206	0.02
USD 695,000	Grant County Public Utility District No 2 Priest Rapids Hydroelectric Project 4.584% 1/1/2040	670,969	0.01
EUR 316,000	Graphic Packaging International 2.625% 1/2/2029*	268,961	0.00
USD 641,594	Greenpoint Manufactured Housing 8.29% 15/12/2029	644,446	0.01
USD 1,025,123	GreenPoint Mortgage Funding Trust 2006-AR2 2.859% 25/3/2036	988,090	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 750,000	GS Mortgage II 3.573% 10/12/2030	749,147	0.01
USD 440,000	GS Mortgage II 3.591% 10/9/2037	409,234	0.01
USD 25,000,000	GS Mortgage II Series 2005-ROCK 0.395% 3/5/2032	160,042	0.00
USD 2,452,265	GS Mortgage II Series 2005-ROCK 5.366% 3/5/2032	2,449,886	0.03
USD 818,000	GS Mortgage Trust 2012-GCJ9 4.448% 10/11/2045	813,515	0.01
USD 110,000	GS Mortgage Trust 2014-GC20 4.529% 10/4/2047	105,620	0.00
USD 730,000	GS Mortgage Trust 2015-590M 3.932% 10/10/2035	674,159	0.01
USD 2,170,000	GS Mortgage Trust 2017-GPTX 2.856% 10/5/2034	2,151,631	0.02
USD 619,279	GS Mortgage Trust 2017-GS7 3% 10/8/2050	499,956	0.01
USD 10,123,239	GSAA Home Equity Trust 2006-5 2.804% 25/3/2036	3,859,477	0.04
USD 428,005	GSAA Home Equity Trust 2007-2 5.917% 25/3/2037	99,520	0.00
USD 940,857	GSAMP Trust 2007-H1 2.644% 25/1/2047	522,142	0.01
USD 2,000,000	GSAMP Trust 2007-HSBC1 5.819% 25/2/2047	1,911,740	0.02
USD 2,862,000	GSK Consumer Healthcare Capital US 3.024% 24/3/2024	2,800,705	0.03
USD 4,705,000	GSK Consumer Healthcare Capital US 3.375% 24/3/2027	4,439,473	0.05
USD 845,447	GSMPS Mortgage Loan Trust 2005-RP1 2.794% 25/1/2035	757,912	0.01
USD 3,173,700	GSMPS Mortgage Loan Trust 2005-RP2 2.794% 25/3/2035	3,074,105	0.03
USD 803,955	GSMPS Mortgage Loan Trust 2006-RP1 2.794% 25/1/2036	676,245	0.01
USD 1,686,608	GSR Mortgage Loan Trust 2006-7F 6.5% 25/8/2036	639,922	0.01
USD 584,057	GSR Mortgage Loan Trust 2007-1F 5.5% 25/1/2037	704,451	0.01
USD 4,131,753	GSR Mortgage Loan Trust 2007-0A2 2.322% 25/6/2047	2,800,047	0.03
USD 1,734,000	GUSAP III 4.25% 21/1/2030	1,619,300	0.02
USD 450,000	GXO Logistics 1.65% 15/7/2026	381,100	0.00
USD 2,377,000	GXO Logistics 2.65% 15/7/2031	1,816,890	0.02
USD 7,150,871	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-12 2.571% 19/12/2036	6,208,574	0.07
USD 400,371	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-4 2.616% 19/7/2047	363,760	0.00
USD 2,800,000	Hays Consolidated Independent School District 4% 15/2/2047	2,744,115	0.03
USD 612,000	HCA 2.375% 15/7/2031	487,521	0.01
USD 1,328,000	HCA 3.125% 15/3/2027	1,229,019	0.01
USD 4,777,000	HCA 3.5% 1/9/2030	4,181,508	0.05
USD 2,072,000	HCA 3.5% 15/7/2051	1,447,075	0.02
USD 4,700,000	HCA 4.5% 15/2/2027	4,603,820	0.05
USD 4,000,000	HCA 5% 15/3/2024	4,028,961	0.04
USD 351,000	HCA 5.25% 15/6/2049	316,504	0.00
USD 2,452,000	HCA 5.375% 1/2/2025	2,479,769	0.03
USD 390,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 4% 1/7/2030	421,843	0.00
USD 10,820,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 4% 1/1/2045	10,461,657	0.12
USD 7,475,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 4% 15/5/2048	7,022,290	0.08
USD 1,000,000	Healthpeak Properties 1.35% 1/2/2027	879,777	0.01
USD 1,315,000	HF Sinclair 5.875% 1/4/2026	1,329,619	0.02
USD 130,000	Hilton Domestic Operating 4.875% 15/1/2030	119,003	0.00
USD 157,000	Hilton Worldwide Finance / Hilton Worldwide Finance 4.875% 1/4/2027	150,132	0.00
USD 612,000	Home Depot 1.375% 15/3/2031	494,296	0.01
USD 2,500,000	Home Depot 1.5% 15/9/2028	2,179,245	0.02

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 946,000	Home Depot 2.375% 15/3/2051	636,106	0.01
USD 1,750,000	Home Depot 2.875% 15/4/2027	1,684,602	0.02
USD 1,190,000	Home Equity Asset Trust 2006-3 3.044% 25/7/2036	1,082,359	0.01
USD 1,546,633	Home Equity Asset Trust 2007-1 2.744% 25/5/2037	1,206,708	0.01
USD 6,869,011	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2006-E 2.614% 25/4/2037	4,949,616	0.06
USD 1,484,858	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A 2.634% 25/4/2037	1,042,578	0.01
USD 7,261,953	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A 2.684% 25/4/2037	5,111,728	0.06
USD 322,416	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series SPMD 2004-A 3.631% 25/7/2034	315,909	0.00
USD 204,000	Horizon Therapeutics USA 5.5% 1/8/2027	196,178	0.00
USD 280,000	Houston Community College System 5% 15/2/2029	316,570	0.00
USD 2,073,000	Houston Galleria Mall Trust 2015-HGLR 3.982% 5/3/2037	1,875,250	0.02
USD 2,120,000	Howard Hughes 5.375% 1/8/2028	1,881,047	0.02
USD 4,703,000	Howmet Aerospace 5.9% 1/2/2027	4,722,964	0.05
USD 581,000	HP 3% 17/6/2027	539,653	0.01
USD 192,000	Humana 1.35% 3/2/2027	168,327	0.00
USD 886,000	Humana 2.15% 3/2/2032	721,742	0.01
USD 1,193,000	Huntington Bancshares 4.443% 4/8/2028	1,168,291	0.01
USD 925,000	Idaho Health Facilities Authority 5% 1/12/2047	977,567	0.01
USD 65,000	iHeartCommunications 4.75% 15/1/2028	55,974	0.00
USD 1,163,000	iHeartCommunications 5.25% 15/8/2027	1,050,160	0.01
USD 104,490	iHeartCommunications 6.375% 1/5/2026	100,229	0.00
USD 546,993	Impac Secured Assets Trust 2006-3 2.784% 25/11/2036	484,525	0.01
USD 1,210,000	IMT Trust 2017-APTS 3.478% 15/6/2034	1,173,625	0.01
USD 5,620,171	IMT Trust 2017-APTS 3.613% 15/6/2034	5,305,024	0.06
USD 2,669,820	IMT Trust 2017-APTS 3.613% 15/6/2034	2,571,265	0.03
USD 2,000,000	IMT Trust 2017-APTS 3.613% 15/6/2034	1,863,264	0.02
USD 370,000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 3.911% 10/7/2035	353,561	0.00
USD 800,000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 4.158% 10/7/2035	760,798	0.01
USD 4,305,000	Indiana Finance Authority 4% 1/12/2040	4,199,681	0.05
USD 2,576,958	IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust 2007-HOA1 0.285% 25/7/2047	1,350	0.00
USD 478,724	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR15 2.684% 25/7/2036	449,056	0.01
USD 3,726,883	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR35 2.804% 25/1/2037	3,450,949	0.04
USD 4,098,692	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-AR19 3.395% 25/9/2037	2,890,958	0.03
USD 504,042	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-FLX5 2.684% 25/8/2037	451,069	0.01
USD 180,000	Intel 3.1% 15/2/2060	125,507	0.00
USD 2,170,000	Intel 3.75% 5/8/2027	2,141,222	0.02
USD 612,000	Intercontinental Exchange 1.85% 15/9/2032	487,084	0.01
USD 946,000	Intercontinental Exchange 3% 15/9/2060	657,640	0.01
USD 1,950,000	International Business Machines 2.95% 15/5/2050	1,398,568	0.02
USD 7,000,000	International Business Machines 3.5% 15/5/2029	6,638,180	0.07
USD 341,000	International Business Machines 3.625% 12/2/2024	340,577	0.00
USD 696,000	International Business Machines 4.25% 15/5/2049	625,373	0.01
USD 4,445,000	International Flavors & Fragrances 1.832% 15/10/2027	3,823,688	0.04

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 435,000	International Flavors & Fragrances 3.468% 1/12/2050	322,964	0.00
USD 200,000	IQVIA 5% 15/5/2027	193,639	0.00
USD 341,983	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-3 6.53% 25/9/2037	320,816	0.00
USD 112,848	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-P1 2.724% 25/12/2036	108,530	0.00
USD 10,336,087	IXIS Real Estate Capital Trust 2007-HE1 2.674% 25/5/2037	2,806,134	0.03
USD 1,455,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-AON 4.128% 5/7/2031	1,428,124	0.02
USD 5,397,808	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-PHH 3.601% 15/6/2035	5,262,955	0.06
USD 2,485,000	JobsOhio Beverage System 3.985% 1/1/2029	2,476,712	0.03
USD 3,525,000	John Deere Capital 1.25% 10/1/2025	3,333,348	0.04
USD 2,250,000	John Deere Capital 3.35% 18/4/2029	2,156,017	0.02
USD 946,000	Johnson & Johnson 2.25% 1/9/2050	657,786	0.01
USD 200,996	JP Morgan Alternative Loan Trust 2007-A2 3.471% 25/5/2037	176,871	0.00
USD 1,226,841	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2015-JP1 4.383% 15/1/2049	1,078,090	0.01
USD 2,321,741	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2015-JP1 4.883% 15/1/2049	2,198,365	0.02
USD 10,620,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2016-JP3 0.75% 15/8/2049	267,624	0.00
USD 248,080	JP Morgan Madison Avenue Trust Series 2014-1 6.694% 25/11/2024	238,336	0.00
USD 762,908	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2006-CW1 2.849% 25/5/2036	745,355	0.01
USD 4,655,000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2007-CH1 4.628% 25/11/2036	4,930,210	0.06
USD 1,165,690	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C22 0.962% 15/9/2047	13,781	0.00
USD 110,000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C22 4.702% 15/9/2047	105,596	0.00
USD 865,037	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C23 0.748% 15/9/2047	8,033	0.00
USD 7,006,000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C27 0.5% 15/2/2048	70,691	0.00
USD 1,253,950	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C29 0.717% 15/5/2048	15,602	0.00
USD 1,480,000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C33 4.274% 15/12/2048	1,296,552	0.01
USD 1,198,000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2016-C1 4.39% 17/3/2049	1,067,714	0.01
USD 887,395	JPMCC Commercial Mortgage Trust 2017-JP5 3.937% 15/3/2050	798,793	0.01
USD 4,150,000	JPMDB Commercial Mortgage Trust 2016-C4 0.75% 15/12/2049	105,215	0.00
USD 470,000	JPMorgan Chase 0.969% 23/6/2025	440,856	0.00
USD 1,727,000	JPMorgan Chase 1.561% 10/12/2025	1,612,152	0.02
USD 612,000	JPMorgan Chase 1.764% 19/11/2031	484,385	0.01
USD 2,095,000	JPMorgan Chase 1.953% 4/2/2032	1,674,226	0.02
USD 1,709,000	JPMorgan Chase 2.083% 22/4/2026	1,601,071	0.02
USD 1,664,000	JPMorgan Chase 2.182% 1/6/2028	1,482,688	0.02
USD 1,558,000	JPMorgan Chase 2.525% 19/11/2041	1,104,443	0.01
USD 860,000	JPMorgan Chase 2.7% 18/5/2023	855,418	0.01
USD 1,126,000	JPMorgan Chase 3.109% 22/4/2051	825,381	0.01
USD 1,780,000	JPMorgan Chase 4.005% 23/4/2029	1,696,734	0.02
USD 5,465,000	JPMorgan Chase 4.08% 26/4/2026	5,411,260	0.06
USD 12,611,000	JPMorgan Chase 4.323% 26/4/2028	12,391,872	0.14

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,143,000	JPMorgan Chase 4.851% 25/7/2028	4,151,193	0.05
USD 2,400,000	JPMorgan Chase Bank 0% 28/12/2023	2,282,400	0.02
USD 2,486,000	Kaiser Foundation Hospitals 2.81% 1/6/2041	1,938,072	0.02
USD 401,000	Keurig Dr Pepper 3.8% 1/5/2050	318,956	0.00
USD 2,650,000	Keurig Dr Pepper 3.95% 15/4/2029	2,535,568	0.03
USD 788,000	KeyBank NA/Cleveland OH 4.15% 8/8/2025	782,822	0.01
USD 5,000,000	KeyCorp Student Loan Trust 2004-A 4.019% 28/7/2042	4,615,332	0.05
USD 5,776,789	KeyCorp Student Loan Trust 2005-A 3.497% 27/12/2038	5,399,431	0.06
USD 612,000	Kilroy Realty 2.5% 15/11/2032	476,434	0.01
USD 612,000	Kimco Realty 2.25% 1/12/2031	492,925	0.01
USD 1,173,000	Kinetik 5.875% 15/6/2030	1,119,782	0.01
USD 1,250,000	KLA 4.65% 1/11/2024	1,271,205	0.01
USD 1,860,000	Kraft Heinz Foods 4.375% 1/6/2046	1,590,575	0.02
USD 1,840,053	Ladder Capital Commercial Mortgage 2013-GCP Mortgage Trust 1.331% 15/2/2036	90,989	0.00
USD 1,312,000	Lam Research 3.75% 15/3/2026	1,310,932	0.01
USD 78,000	Lamar Media 3.75% 15/2/2028	70,078	0.00
USD 197,732	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust 2002-A 0% 15/6/2033	179,415	0.00
USD 266,575	Lehman ABS Mortgage Loan Trust 2.534% 25/6/2037	190,237	0.00
USD 1,062,170	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2006-2 2.894% 25/9/2036	935,481	0.01
USD 173,918	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-1 2.694% 25/3/2037	171,336	0.00
USD 6,294,000	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-3 4.444% 25/10/2037	5,479,546	0.06
USD 987,582	Lehman XS Trust Series 2007-16N 4.344% 25/9/2047	1,224,021	0.01
USD 490,468	Lehman XS Trust Series 2007-20N 4.744% 25/12/2037	504,853	0.01
USD 525,538	LendingPoint Pass-Through Trust Series 2022-ST1 2.5% 15/3/2028	503,217	0.01
USD 623,939	LendingPoint Pass-Through Trust Series 2022-ST2 3.25% 15/4/2028	601,970	0.01
USD 380,000	Level 3 Financing 4.625% 15/9/2027	336,275	0.00
USD 800,000	Lexington County Health Services District 5% 1/11/2041	833,720	0.01
EUR 1,322,000	Liberty Mutual 3.625% 23/5/2059	1,202,222	0.01
USD 2,409,000	Lions Gate Capital 5.5% 15/4/2029	1,922,816	0.02
USD 9,200,128	Loanpal Solar Loan 2.47% 20/12/2047	7,928,027	0.09
USD 2,805,307	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-5 2.744% 25/6/2036	1,523,404	0.02
USD 752,229	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-6 2.744% 25/7/2036	321,354	0.00
USD 6,155,747	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-7 2.764% 25/8/2036	2,833,552	0.03
USD 1,755,000	Los Angeles Department of Water & Power 5% 1/7/2041	1,960,994	0.02
USD 4,175,000	Los Angeles Department of Water & Power 5% 1/7/2051	4,542,386	0.05
USD 3,375,000	Lowe ' s 1.7% 15/10/2030	2,719,993	0.03
USD 1,638,000	Lowe ' s 2.625% 1/4/2031	1,409,893	0.02
USD 11,334,000	Lowe ' s 3% 15/10/2050	7,926,954	0.09
USD 2,251,000	Lowe ' s 3.35% 1/4/2027	2,175,321	0.02
USD 226,000	Lowe ' s 4% 15/4/2025	225,873	0.00
USD 3,085,000	Lowe ' s 4.25% 1/4/2052	2,662,633	0.03
USD 57,000	Lowe ' s 5.125% 15/4/2050	56,349	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 306,735	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2015-3 3.295% 20/4/2048	299,177	0.00
USD 1,949,753	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5 0.944% 10/3/2050	44,163	0.00
USD 4,400,000	Lumen Technologies 5.125% 15/12/2026	3,830,772	0.04
USD 1,423,000	LYB International Finance III 3.625% 1/4/2051	1,066,412	0.01
USD 1,885,000	Lyford Consolidated Independent School District/TX 4% 15/8/2047	1,810,755	0.02
USD 3,192,000	M/I Homes 4.95% 1/2/2028	2,822,576	0.03
USD 395,000	Macy's Retail 5.875% 1/4/2029	343,597	0.00
USD 1,425,000	Macy's Retail 5.875% 15/3/2030	1,221,289	0.01
USD 4,008,000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 4.108% 15/8/2034	3,752,833	0.04
USD 3,529,000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 4.167% 15/8/2034	3,258,520	0.04
USD 392,088	Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust 2002-A 5.694% 25/3/2032	392,515	0.00
USD 3,540,000	Magallanes 3.428% 15/3/2024	3,463,296	0.04
USD 3,240,000	Magallanes 3.638% 15/3/2025	3,132,066	0.04
USD 972,000	Marriott Ownership Resorts 6.125% 15/9/2025	972,496	0.01
USD 1,200,000	Massachusetts Development Finance Agency 4% 1/7/2045	1,144,496	0.01
USD 7,110,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 15/11/2032	8,584,442	0.10
USD 2,655,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2044	2,758,857	0.03
USD 990,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2047	1,035,734	0.01
USD 1,005,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2048	1,045,863	0.01
USD 800,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.5% 1/12/2039	789,764	0.01
USD 845,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.5% 1/12/2048	849,338	0.01
USD 845,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.6% 1/12/2044	827,923	0.01
USD 3,520,000	Massachusetts School Building Authority 2.866% 15/10/2031	3,201,562	0.04
USD 2,545,000	Massachusetts School Building Authority 2.966% 15/10/2032	2,302,110	0.03
USD 1,965,267	Mastr Asset Backed Trust 2004-HE1 4.919% 25/9/2034	1,872,955	0.02
USD 1,401,845	Mastr Asset Backed Trust 2007-HE1 2.724% 25/5/2037	1,154,707	0.01
USD 326,293	MASTR Resecuritization Trust 2008-3 2.692% 25/8/2037	210,305	0.00
USD 302,003	Mastr Specialized Loan Trust 2.704% 25/6/2046	287,740	0.00
USD 143,000	Matador Resources 5.875% 15/9/2026	139,475	0.00
USD 435,000	Mattel 5.875% 15/12/2027	432,547	0.00
USD 1,745,000	Mauser Packaging Solutions 5.5% 15/4/2024	1,690,984	0.02
USD 830,000	Maxar Technologies 7.75% 15/6/2027	824,759	0.01
USD 1,030,000	McDonald's 3.5% 1/7/2027	1,003,025	0.01
USD 410,000	McDonald's 3.625% 1/9/2049	337,213	0.00
USD 1,085,000	McLaren Health Care 4.386% 15/5/2048	1,022,588	0.01
USD 16,352,000	Medline Borrower 3.875% 1/4/2029	13,821,893	0.15
USD 3,406,000	Merck 2.15% 10/12/2031	2,920,653	0.03
USD 946,000	Merck 2.45% 24/6/2050	662,958	0.01
USD 3,000,000	Merck 2.9% 10/12/2061	2,119,713	0.02
USD 1,055,288	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust Series 2007-OAR2 2.864% 25/4/2037	968,775	0.01
USD 4,611,611	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-2 2.684% 25/5/2037	2,696,872	0.03
USD 4,969,227	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-H1 5.944% 25/10/2037	4,638,543	0.05

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 825,457	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2006-RM3 2.624% 25/6/2037	191,456	0.00
USD 2,600,000	Meta Platforms 3.5% 15/8/2027	2,529,923	0.03
USD 147,000	Metropolitan Life Global Funding I 1.875% 11/1/2027	132,461	0.00
USD 1,693,000	Metropolitan Life Global Funding I 4.05% 25/8/2025	1,685,263	0.02
USD 2,815,000	Metropolitan Washington Airports Authority Aviation Revenue 5% 1/10/2048	2,913,984	0.03
USD 33,000	MGM Resorts International 4.625% 1/9/2026	30,076	0.00
USD 89,000	MGM Resorts International 5.5% 15/4/2027	82,655	0.00
USD 32,000	MGM Resorts International 5.75% 15/6/2025	31,132	0.00
USD 4,105,000	Michigan Finance Authority 4% 15/2/2047	3,887,510	0.04
USD 820,000	Michigan Finance Authority 5% 15/11/2028	882,599	0.01
USD 670,000	Michigan Finance Authority 5% 15/11/2041	694,952	0.01
USD 320,000	Microchip Technology 4.25% 1/9/2025	316,246	0.00
USD 2,905,000	Microsoft 2.525% 1/6/2050	2,155,881	0.02
USD 946,000	Microsoft 2.675% 1/6/2060	680,839	0.01
USD 5,995,000	Microsoft 3.125% 3/11/2025	5,903,557	0.07
USD 1,876,000	Midwest Gaming Borrower / Midwest Gaming Finance 4.875% 1/5/2029	1,649,454	0.02
USD 612,000	Mondelez International 1.5% 4/2/2031	486,759	0.01
USD 490,000	Mondelez International 2.625% 4/9/2050	335,534	0.00
USD 231,000	Moody 's 2.55% 18/8/2060	144,439	0.00
USD 715,000	Moody 's 3.1% 29/11/2061	497,656	0.01
EUR 4,400,000	Morgan Stanley 0.497% 7/2/2031	3,499,529	0.04
USD 2,025,000	Morgan Stanley 0.56% 10/11/2023	2,010,476	0.02
USD 3,670,000	Morgan Stanley 0.79% 30/5/2025	3,434,773	0.04
USD 360,000	Morgan Stanley 1.512% 20/7/2027	319,596	0.00
USD 612,000	Morgan Stanley 1.794% 13/2/2032	483,087	0.01
USD 5,498,000	Morgan Stanley 2.475% 21/1/2028	5,007,854	0.06
USD 1,527,000	Morgan Stanley 2.699% 22/1/2031	1,324,266	0.01
USD 1,932,000	Morgan Stanley 2.802% 25/1/2052	1,335,774	0.01
EUR 3,040,000	Morgan Stanley 2.95% 7/5/2032	2,852,019	0.03
USD 4,277,000	Morgan Stanley 3.62% 17/4/2025	4,223,179	0.05
USD 1,108,000	Morgan Stanley 3.625% 20/1/2027	1,079,432	0.01
USD 7,306,000	Morgan Stanley 4.21% 20/4/2028	7,154,544	0.08
USD 2,494,000	Morgan Stanley 4.679% 17/7/2026	2,499,829	0.03
USD 2,187,373	Morgan Stanley ABS Capital I Trust 2005-HE5 3.314% 25/9/2035	1,834,310	0.02
USD 396,053	Morgan Stanley ABS Capital I Trust 2007-SEA1 4.344% 25/2/2047	382,755	0.00
USD 3,654,543	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 1.325% 15/12/2047	90,779	0.00
USD 10,520,884	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 1.325% 15/12/2047	251,526	0.00
USD 3,349,202	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C21 0.412% 15/3/2048	23,828	0.00
USD 428,938	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C23 4.281% 15/7/2050	380,443	0.00
USD 1,500,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C24 4.479% 15/5/2048	1,442,189	0.02
USD 209,922	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 4.677% 15/10/2048	200,537	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 5,104,909	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 1.46% 15/10/2048	189,443	0.00
USD 175,765	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C33 4.558% 15/5/2050	160,960	0.00
USD 362,592	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 2.73% 15/12/2050	273,509	0.00
USD 943,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-150E 4.438% 9/9/2032	840,145	0.01
USD 393,508	Morgan Stanley Capital I Trust 2015-MS1 4.158% 15/5/2048	361,978	0.00
USD 230,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-CLS 4.341% 15/11/2034	226,563	0.00
USD 5,229,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-CLS 4.991% 15/11/2034	5,134,286	0.06
USD 2,519,058	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 2.31% 15/6/2050	221,400	0.00
USD 2,562,856	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 4.281% 15/6/2050	2,365,731	0.03
USD 479,686	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 3% 15/7/2051	360,751	0.00
USD 365,563	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 5.025% 15/7/2051	340,322	0.00
USD 1,200,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-L1 4.139% 15/10/2051	1,176,803	0.01
USD 2,754,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4.419% 11/7/2040	2,339,977	0.03
USD 225,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4.419% 11/7/2040	210,288	0.00
USD 690,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 3.291% 15/7/2035	684,469	0.01
USD 1,213,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 3.591% 15/7/2035	1,176,332	0.01
USD 357,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 4.941% 15/7/2035	342,195	0.00
USD 746,317	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 2006-3 2.764% 25/4/2036	559,247	0.01
USD 1,498,845	Morgan Stanley Resecuritization Trust 2013-R7 2.579% 26/12/2046	1,418,486	0.02
USD 630,775	Morgan Stanley Residential Mortgage Loan Trust 2014-1 3.079% 25/6/2044	608,363	0.01
USD 2,243,853	Mortgage Loan Resecuritization Trust 2.713% 16/4/2036	2,114,592	0.02
USD 1,677,463	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1 4.01% 22/6/2043	1,615,803	0.02
USD 4,084,767	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS 4.2% 22/2/2044	3,902,041	0.04
USD 709,741	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS 5.97% 22/2/2044	674,915	0.01
USD 5,346,519	Mosaic Solar Loan Trust 2019-1 4.37% 21/12/2043	5,095,100	0.06
USD 989,269	Mosaic Solar Loan Trust 2022-2 4.38% 21/1/2053	971,363	0.01
USD 414,786	Mosaic Solar Loans 2017-2 3.82% 22/6/2043	391,937	0.00
USD 2,494,000	Motorola Solutions 2.75% 24/5/2031	2,046,905	0.02
USD 1,475,000	Motorola Solutions 4.6% 23/2/2028	1,458,125	0.02
USD 664,000	Motorola Solutions 5.5% 1/9/2044	632,375	0.01
USD 117,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 4.625% 1/8/2029	99,995	0.00
USD 182,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 5% 15/10/2027	163,925	0.00
USD 65,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 5.25% 1/8/2026	62,801	0.00
USD 2,953,000	MSCG Trust 2018-SELF 4.541% 15/10/2037	2,834,528	0.03
USD 440,000	MSCG Trust 2018-SELF 5.441% 15/10/2037	416,100	0.01
USD 455,689	Multi Security Asset Trust Commercial Mortgage-Backed Pass-Through 4.78% 28/11/2035	308,096	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,605,393	NACC Reperforming Loan REMIC Trust 2004-R1 6.5% 25/3/2034	1,422,144	0.02
USD 368,598	NACC Reperforming Loan REMIC Trust 2004-R1 7.5% 25/3/2034	333,851	0.00
USD 1,620,000	Nationstar Home Equity Loan Trust 2007-B 2.854% 25/4/2037	1,516,893	0.02
USD 1,680,000	Nationstar Mortgage 5.125% 15/12/2030	1,329,845	0.01
USD 1,832,000	Nationstar Mortgage 5.5% 15/8/2028	1,545,332	0.02
USD 794,000	Nationstar Mortgage 5.75% 15/11/2031	639,324	0.01
USD 648,000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	579,284	0.01
USD 1,072,000	Natixis Commercial Mortgage Trust 2018-285M 5.094% 15/2/2033	1,065,734	0.01
USD 388,572	Natixis Commercial Mortgage Trust 2018-FL1 3.341% 15/6/2035	382,139	0.00
USD 2,882,000	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 3.5% 15/8/2044	2,675,755	0.03
USD 2,174,000	Navient Private Education Loan Trust 2015-A 3.5% 15/12/2044	2,046,120	0.02
USD 1,200,000	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 3.16% 15/11/2068	1,029,929	0.01
USD 2,110,000	Navient Private Education Loan Trust 2020-I 2.95% 15/4/2069	1,926,441	0.02
USD 612,000	Nestle 2.5% 14/9/2041	472,167	0.01
EUR 3,000,000	Netflix 3.625% 15/5/2027	2,896,683	0.03
USD 4,489,061	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B 3.164% 25/10/2035	4,403,631	0.05
USD 2,660,039	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-C 3.119% 25/12/2035	2,059,750	0.02
USD 639,000	New Home 7.25% 15/10/2025	528,374	0.01
USD 1,155,000	New Jersey Health Care Facilities Financing Authority 3% 1/7/2051	849,132	0.01
USD 1,900,000	New Jersey Health Care Facilities Financing Authority 4% 1/7/2051	1,777,587	0.02
USD 1,150,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5.754% 15/12/2028	1,189,483	0.01
USD 1,000,000	New York City Municipal Water Finance Authority 3.5% 15/6/2048	885,904	0.01
USD 1,885,000	New York City Municipal Water Finance Authority 4% 15/6/2049	1,796,828	0.02
USD 1,515,000	New York City Municipal Water Finance Authority 5.44% 15/6/2043	1,717,725	0.02
USD 435,000	New York City Municipal Water Finance Authority 5.75% 15/6/2041	507,318	0.01
USD 4,115,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.35% 1/11/2030	3,833,569	0.04
USD 3,300,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.9% 1/8/2031	3,176,666	0.04
USD 1,115,000	New York State Dormitory Authority 3.19% 15/2/2043	927,213	0.01
USD 2,295,000	New York State Thruway Authority 3% 15/3/2050	1,772,678	0.02
USD 3,490,000	New York State Urban Development 3.32% 15/3/2029	3,347,774	0.04
USD 1,480,000	New York State Urban Development 4% 15/3/2038	1,444,193	0.02
USD 590,000	New York Transportation Development 5% 1/7/2046	604,399	0.01
USD 4,715,000	New York Transportation Development 5.25% 1/1/2050	4,852,148	0.05
USD 1,676,000	Newmont 2.6% 15/7/2032	1,375,045	0.01
USD 1,224,000	Nexstar Media 4.75% 1/11/2028	1,106,172	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,487,000	Nexstar Media 5.625% 15/7/2027	1,424,157	0.02
USD 1,500,000	NextEra Energy Capital 1.9% 15/6/2028	1,307,954	0.02
USD 1,490,000	NextEra Energy Capital 2.44% 15/1/2032	1,249,068	0.01
USD 2,000,000	NextEra Energy Capital 2.94% 21/3/2024	1,967,144	0.02
USD 1,351,000	NextEra Energy Capital 3% 15/1/2052	976,431	0.01
USD 2,170,000	NextEra Energy Capital 4.255% 1/9/2024	2,173,897	0.02
USD 5,800,000	NGPL PipeCo 7.768% 15/12/2037	6,297,573	0.07
USD 206,860	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2001-R1A 7% 19/2/2030	199,578	0.00
USD 676,744	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2005-AP1 6.046% 25/2/2035	647,284	0.01
USD 454,652	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2006-AF1 7.134% 25/5/2036	118,037	0.00
USD 80,748	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2006-S5 2.844% 25/10/2036	93,934	0.00
USD 1,434,052	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2007-2 2.864% 25/6/2037	1,278,189	0.01
USD 1,600,000	Norfolk Southern 2.9% 25/8/2051	1,160,369	0.01
USD 250,000	Northern Oil and Gas 8.125% 1/3/2028	241,591	0.00
USD 2,895,000	Northern States Power 2.9% 1/3/2050	2,199,602	0.03
USD 1,533,000	Northern States Power 3.2% 1/4/2052	1,221,801	0.01
USD 1,574,000	Northern States Power 4.5% 1/6/2052	1,552,134	0.02
USD 2,959,000	Northern Trust 4% 10/5/2027	2,957,330	0.03
USD 100,000	NRG Energy 5.25% 15/6/2029	91,460	0.00
USD 227,000	NRG Energy 5.75% 15/1/2028	213,623	0.00
USD 1,600,000	NVIDIA 2.85% 1/4/2030	1,464,126	0.02
USD 1,390,000	NVIDIA 3.5% 1/4/2050	1,169,474	0.01
USD 503,625	Oakwood Mortgage Investors 5.26% 15/1/2019***	331,990	0.00
USD 418,804	Oakwood Mortgage Investors 6.93% 15/9/2031	256,782	0.00
USD 1,126,027	Oakwood Mortgage Investors 7.475% 15/8/2027	980,777	0.01
USD 2,212,000	Occidental Petroleum 8.5% 15/7/2027	2,478,204	0.03
USD 3,230,000	Ohio Water Development Authority Water Pollution Control Loan Fund 5% 1/12/2050	3,515,801	0.04
USD 381,000	OhioHealth 3.042% 15/11/2050	291,393	0.00
USD 28,148,566	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 0.511% 10/5/2039	461,918	0.01
USD 2,232,801	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 4.077% 10/5/2039	1,758,094	0.02
EUR 696,000	Olympus Water US 3.875% 1/10/2028	583,082	0.01
EUR 509,000	Olympus Water US 5.375% 1/10/2029	401,840	0.00
USD 321,000	Omnicom 2.6% 1/8/2031	270,320	0.00
USD 2,500,000	Oncor Electric Delivery 2.95% 1/4/2025	2,438,923	0.03
USD 719,000	Oncor Electric Delivery 4.15% 1/6/2032	721,049	0.01
USD 340,000	Oncor Electric Delivery 5.75% 15/3/2029	369,083	0.00
USD 41,869,799	One Market Plaza Trust 2017-1MKT 0% 10/2/2032	1,256	0.00
USD 8,776,000	One Market Plaza Trust 2017-1MKT 0.218% 10/2/2032	23,614	0.00
USD 2,109,848	Onemain Financial Issuance Trust 2018-1 3.61% 14/3/2029	2,109,795	0.02
USD 4,500,000	Onemain Financial Issuance Trust 2018-1 5.52% 14/3/2029	4,422,503	0.05
USD 3,870,000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 4.05% 14/10/2036	3,340,642	0.04

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,270,000	OneMain Financial Issuance Trust 2020-2 2.76% 14/9/2035	1,096,323	0.01
USD 3,210,000	OneMain Financial Issuance Trust 2020-2 3.45% 14/9/2035	2,733,579	0.03
USD 450,000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 2.22% 16/6/2036	380,667	0.00
USD 3,831,000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 2.643% 16/6/2036	3,689,684	0.04
USD 2,000,000	Option One Mortgage Loan Trust 2005-4 Asset-Backed Certificates Series 2005-4 3.179% 25/11/2035	1,719,840	0.02
USD 1,950,000	Option One Mortgage Loan Trust 2007-CP1 2.654% 25/3/2037	1,549,818	0.02
USD 5,019,902	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 5.866% 25/1/2037	4,359,709	0.05
USD 5,413,829	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 5.866% 25/1/2037	4,771,959	0.05
USD 2,096,098	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD2 5.82% 25/3/2037	1,834,861	0.02
USD 1,000,000	Oracle 2.3% 25/3/2028	873,229	0.01
USD 379,000	Oracle 2.5% 1/4/2025	360,410	0.00
USD 1,800,000	Oracle 2.95% 15/11/2024	1,750,705	0.02
USD 625,000	Oracle 2.95% 15/5/2025	599,577	0.01
USD 8,000,000	Oracle 2.95% 1/4/2030	6,866,470	0.08
USD 1,921,000	Oracle 3.4% 8/7/2024	1,893,718	0.02
USD 10,342,000	Oracle 3.6% 1/4/2050	7,133,380	0.08
USD 562,000	Oracle 3.85% 1/4/2060	378,580	0.00
USD 3,171,000	Oracle 3.95% 25/3/2051	2,316,985	0.03
USD 2,174,800	Oregon School Boards Association 4.759% 30/6/2028	2,194,386	0.02
USD 1,910,000	Oregon School Boards Association 5.55% 30/6/2028	1,999,485	0.02
USD 1,860,000	Oregon School Boards Association 5.68% 30/6/2028	1,965,904	0.02
USD 750,000	Organon / Organon Foreign Debt Co-Issuer 5.125% 30/4/2031	658,170	0.01
USD 493,123	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2001-A 7.82% 15/3/2032	456,252	0.01
USD 859,535	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2007-B 3.591% 15/10/2037	876,940	0.01
USD 65,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4.625% 15/3/2030	54,316	0.00
USD 85,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	78,109	0.00
USD 1,435,000	Owens & Minor 6.625% 1/4/2030	1,322,446	0.01
USD 1,417,488	Ownit Mortgage Loan Trust Series 2006-2 6.5% 25/1/2037	1,249,600	0.01
USD 2,605,000	PACCAR Financial 3.55% 11/8/2025	2,585,709	0.03
USD 190,000	Pacific Gas and Electric 4.2% 1/6/2041	143,447	0.00
USD 3,137,500	Pacific Gas and Electric 4.5% 1/7/2040	2,477,709	0.03
USD 1,100,000	Pacific Gas and Electric 4.6% 15/6/2043	853,005	0.01
USD 1,500,000	Pacific Gas and Electric 4.95% 8/6/2025	1,494,311	0.02
USD 1,250,000	Pacific Gas and Electric 5.45% 15/6/2027	1,232,642	0.01
USD 660,000	Pacific Gas and Electric 5.9% 15/6/2032	640,614	0.01
USD 600,000	Paramount Global 3.375% 15/2/2028	563,668	0.01
USD 1,043,000	Paramount Global 4.95% 19/5/2050	863,722	0.01
USD 3,011,000	Paramount Global 6.375% 30/3/2062	2,774,596	0.03

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,627,000	Park Intermediate / PK Domestic Property / PK Finance Co-Issuer 4.875% 15/5/2029	2,316,042	0.03
USD 881,000	Parker-Hannifin 4.25% 15/9/2027	873,803	0.01
USD 78,000	PDC Energy 5.75% 15/5/2026	74,954	0.00
USD 4,618,000	Peninsula Pacific Entertainment / Peninsula Pacific Entertainment Finance 8.5% 15/11/2027	4,953,745	0.06
USD 1,105,000	Pennsylvania State University/The 4% 1/9/2050	1,069,475	0.01
USD 2,355,000	Pennsylvania Turnpike Commission Oil Franchise Tax Revenue 5% 1/12/2048	2,473,903	0.03
USD 853,000	Periama 5.95% 19/4/2026	784,990	0.01
USD 2,950,000	Pfizer 2.7% 28/5/2050	2,235,448	0.02
USD 4,575,000	Pitney Bowes 6.875% 15/3/2027	3,466,409	0.04
USD 3,525,000	Pitney Bowes 7.25% 15/3/2029	2,421,620	0.03
USD 2,700,000	PNC Bank 3.25% 1/6/2025	2,652,209	0.03
USD 593,000	PNC Bank 4.2% 1/11/2025	591,112	0.01
USD 2,255,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.458% 1/10/2062	2,203,736	0.02
USD 3,005,000	PPL Electric Utilities 3% 1/10/2049	2,284,541	0.03
USD 182,198	Prime Mortgage Trust 2006-DR1 5.5% 25/5/2035	159,470	0.00
USD 228,000	Principal Life Global Funding II 0.75% 12/4/2024	214,874	0.00
USD 211,000	Principal Life Global Funding II 1.25% 16/8/2026	186,465	0.00
USD 1,685,000	Procter & Gamble 3% 25/3/2030	1,597,069	0.02
USD 1,287,000	Progressive 2.5% 15/3/2027	1,214,059	0.01
USD 445,000	Progressive 3% 15/3/2032	402,595	0.00
USD 1,000,000	Progressive 3.2% 26/3/2030	935,423	0.01
USD 1,095,000	Providence St Joseph Health Obligated 2.7% 1/10/2051	735,030	0.01
USD 3,305,632	PRPM 2020-4 2.951% 25/10/2025	3,201,357	0.04
USD 630,000	QUALCOMM 3.25% 20/5/2027	615,651	0.01
USD 618,285	RALI Series 2007-QH9 Trust 2.107% 25/11/2037	558,432	0.01
USD 920,632	RAMP Series 2004-RS7 Trust 2.879% 25/7/2034	746,921	0.01
USD 500,000	Range Resources 5% 15/3/2023	500,017	0.01
USD 2,728,074	RASC Series 2006-EMX9 Trust 2.924% 25/11/2036	2,251,563	0.03
USD 4,614,929	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL9 4.846% 25/6/2037	4,597,983	0.05
USD 432,000	Regions Financial 2.25% 18/5/2025	412,605	0.00
USD 74,818	Reperforming Loan REMIC Trust 2005-R3 2.844% 25/9/2035	66,762	0.00
USD 2,112,000	Republic Services 1.45% 15/2/2031	1,676,927	0.02
USD 2,000,000	Republic Services 2.9% 1/7/2026	1,907,354	0.02
USD 966,025	Residential Asset Securitization Trust 2005-A5 2.844% 25/5/2035	667,234	0.01
USD 2,601,104	RFMSI Series 2006-SA2 Trust 4.786% 25/8/2036	1,885,369	0.02
USD 227,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.75% 15/10/2027	206,188	0.00
USD 2,395,000	Roche 1.93% 13/12/2028	2,101,408	0.02
USD 946,000	Roche 2.607% 13/12/2051	682,083	0.01
USD 3,722,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3.625% 1/3/2029	3,001,700	0.03
USD 1,682,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3.875% 1/3/2031	1,314,232	0.01
USD 1,735,000	Rockwall Independent School District 5% 15/2/2052	1,899,169	0.02
USD 612,000	Roper Technologies 1.75% 15/2/2031	484,733	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,550,000	Rutgers The State University of New Jersey 3.27% 1/5/2043	2,127,950	0.02
USD 835,000	RWJ Barnabas Health 3.477% 1/7/2049	686,746	0.01
USD 553,000	Ryder System 2.5% 1/9/2024	535,394	0.01
USD 612,000	S&P Global 1.25% 15/8/2030	491,081	0.01
USD 772,000	Sabre GLBL 7.375% 1/9/2025	734,173	0.01
USD 2,382,000	Sabre GLBL 9.25% 15/4/2025	2,356,167	0.03
USD 23,048	SACO I Trust 2006-9 2.744% 25/8/2036	23,027	0.00
USD 946,000	Salesforce 2.9% 15/7/2051	712,762	0.01
USD 9,100,000	Salt River Project Agricultural Improvement & Power District 5% 1/1/2031	10,702,407	0.12
USD 2,345,000	San Diego County Water Authority 5% 1/5/2052	2,640,078	0.03
USD 2,570,000	San Diego Gas & Electric 2.95% 15/8/2051	1,928,106	0.02
USD 1,800,000	Sanger Independent School District 4% 15/8/2047	1,750,039	0.02
USD 4,023,000	Sasol Financing USA 4.375% 18/9/2026	3,752,282	0.04
USD 1,770,000	Sasol Financing USA 5.5% 18/3/2031	1,486,273	0.02
USD 1,820,000	Sasol Financing USA 5.875% 27/3/2024	1,820,455	0.02
USD 750,000	SBA Communications 3.125% 1/2/2029	619,847	0.01
EUR 384,000	SCIL IV / SCIL USA 4.375% 1/11/2026*	319,754	0.00
EUR 629,000	SCIL IV / SCIL USA 4.642% 1/11/2026*	598,056	0.01
USD 3,661,877	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 0% 25/7/2056	816,510	0.01
USD 4,827,340	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 1.15% 25/7/2056	369,967	0.00
USD 490,256	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1 3.258% 25/5/2057	229,420	0.00
USD 170,000	Securitized Asset Backed Receivables Trust 2006-0P1 3.449% 25/10/2035	144,804	0.00
USD 7,674,000	Select Medical 6.25% 15/8/2026	7,395,357	0.08
USD 1,401,000	Sempra Energy 3.7% 1/4/2029	1,320,228	0.02
USD 1,462,000	Service Properties Trust 4.35% 1/10/2024	1,314,290	0.01
USD 4,904,000	Service Properties Trust 4.5% 15/6/2023	4,786,301	0.05
USD 1,427,000	Service Properties Trust 4.5% 15/3/2025	1,250,465	0.01
USD 395,000	Service Properties Trust 5.5% 15/12/2027	342,955	0.00
USD 2,337,000	Service Properties Trust 7.5% 15/9/2025	2,253,813	0.02
USD 6,028,550	Sesac Finance 5.216% 25/7/2049	5,724,074	0.06
USD 1,268,047	SG Mortgage Trust 2006-FRE2 2.764% 25/7/2036	306,221	0.00
USD 612,000	Sherwin-Williams 2.2% 15/3/2032	498,712	0.01
USD 2,000,000	Sherwin-Williams 2.95% 15/8/2029	1,803,526	0.02
EUR 630,000	Silgan 2.25% 1/6/2028*	539,216	0.01
USD 395,000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	373,785	0.00
USD 1,079,000	Sirius XM Radio 5.5% 1/7/2029	1,011,384	0.01
USD 1,245,000	Skyworks Solutions 0.9% 1/6/2023	1,215,082	0.01
USD 7,089,892	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 7.141% 15/10/2041	7,736,920	0.09
USD 1,485,000	SMB Private Education Loan Trust 2014-A 4.5% 15/9/2045	1,315,700	0.02
USD 6,689,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-B 3.5% 17/12/2040	6,411,184	0.07
USD 1,910,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-C 3.5% 15/9/2043	1,814,036	0.02
USD 1,800,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-A 3% 15/8/2045	1,518,868	0.02

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,410,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A 2.5% 15/9/2054	3,114,205	0.04
USD 1,290,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A 3.2% 15/9/2054	1,214,596	0.01
USD 3,600,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTB 2.5% 15/9/2054	2,965,951	0.03
USD 8,810,000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2.99% 15/1/2053	8,052,008	0.09
USD 3,100,000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 3.86% 15/1/2053	2,874,156	0.03
USD 1,690,000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 3.86% 15/1/2053	1,589,208	0.02
USD 2,886,000	Sonoco Products 2.25% 1/2/2027	2,630,232	0.03
USD 30,634	Soundview Home Loan Trust 2004-WMC1 3.239% 25/1/2035	27,650	0.00
USD 2,934,000	South Carolina Public Service Authority 6.454% 1/1/2050	3,472,047	0.04
USD 1,590,000	South Dakota Health & Educational Facilities Authority 4% 1/11/2034	1,569,176	0.02
USD 205,000	South Wayne County Water and Sewer Authority 4% 15/2/2030	219,444	0.00
EUR 3,787,000	Southern 1.875% 15/9/2081	2,791,085	0.03
USD 1,681,000	Southern California Edison 3.65% 1/6/2051	1,332,493	0.02
USD 83,000	Southern California Edison 3.7% 1/8/2025	81,749	0.00
USD 545,000	Spartanburg County School District No 7 5% 1/3/2048	590,322	0.01
USD 1,168,000	Sprint 7.125% 15/6/2024	1,210,947	0.01
USD 5,010,000	Sprint 7.875% 15/9/2023	5,163,115	0.06
USD 860,000	SRS Distribution 4.625% 1/7/2028	762,943	0.01
EUR 100,000	Standard Industries 2.25% 21/11/2026	84,381	0.00
USD 410,000	Standard Industries 4.75% 15/1/2028	360,065	0.00
USD 131,000	Standard Industries 5% 15/2/2027	120,367	0.00
USD 2,285,000	State of California 7.3% 1/10/2039	2,935,556	0.03
USD 630,000	State of California 7.35% 1/11/2039	813,482	0.01
USD 580,000	State of California 7.5% 1/4/2034	744,074	0.01
USD 1,300,000	State of California 7.55% 1/4/2039	1,739,970	0.02
USD 760,000	State of Connecticut 3.31% 15/1/2026	745,094	0.01
USD 2,040,000	State of Florida Department of Transportation Turnpike System Revenue 5% 1/7/2029	2,346,222	0.03
USD 2,140,000	State of Florida Department of Transportation Turnpike System Revenue 5% 1/7/2030	2,480,363	0.03
USD 2,250,000	State of Florida Department of Transportation Turnpike System Revenue 5% 1/7/2031	2,635,552	0.03
USD 2,360,000	State of Florida Department of Transportation Turnpike System Revenue 5% 1/7/2032	2,788,377	0.03
USD 2,480,000	State of Florida Department of Transportation Turnpike System Revenue 5% 1/7/2033	2,947,668	0.03
USD 1,695,000	State of Georgia 4% 1/7/2040	1,729,117	0.02
USD 1,695,000	State of Georgia 4% 1/7/2041	1,714,695	0.02
USD 1,575,000	State of Georgia 5% 1/7/2029	1,827,461	0.02
USD 1,705,000	State of Georgia 5% 1/7/2030	2,005,084	0.02
USD 1,705,000	State of Georgia 5% 1/7/2031	2,026,525	0.02
USD 2,330,000	State of Louisiana 5% 1/3/2038	2,600,632	0.03
USD 1,400,000	State of Maryland 5% 1/8/2033	1,641,584	0.02
USD 1,885,000	State of Minnesota 4% 1/9/2038	1,940,509	0.02

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,225,000	State of Minnesota 5% 1/8/2036	4,677,796	0.05
USD 3,080,000	State of New York 2.8% 15/2/2032	2,764,521	0.03
USD 955,000	State of Ohio 5% 1/3/2039	1,069,354	0.01
USD 2,420,000	State of Oregon 5.892% 1/6/2027	2,571,023	0.03
USD 2,800,000	State of Washington 4% 1/2/2036	2,892,755	0.03
USD 2,605,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2028	2,949,529	0.03
USD 2,000,000	State Street 1.684% 18/11/2027	1,811,588	0.02
USD 3,853,000	Steel Dynamics 3.25% 15/10/2050	2,669,118	0.03
USD 750,000	Steel Dynamics 3.45% 15/4/2030	670,253	0.01
USD 297,000	Stem 0.5% 1/12/2028	240,015	0.00
USD 916,000	Stillwater Mining 4% 16/11/2026	810,420	0.01
USD 854,250	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 3.118% 25/4/2036	548,091	0.01
USD 1,074,711	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006- AR2 2.904% 25/2/2036	926,845	0.01
USD 288,284	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006- AR5 2.864% 25/5/2046	190,569	0.00
USD 4,481,192	Structured Asset Mortgage Loan Trust Series 2006-RF3 6% 25/10/2036	2,821,301	0.03
USD 2,436,583	Structured Asset Mortgage Loan Trust Series 2006-RF4 6% 25/10/2036	1,526,189	0.02
USD 500,000	Summer BC Bidco B 5.5% 31/10/2026	435,395	0.00
USD 760,000	Sumter Landing Community Development District 4.172% 1/10/2047	676,883	0.01
USD 3,023,000	Sunoco / Sunoco Finance 4.5% 30/4/2030	2,606,937	0.03
USD 1,210,000	Sunoco / Sunoco Finance 5.875% 15/3/2028	1,127,057	0.01
USD 157,000	Sunoco / Sunoco Finance 6% 15/4/2027	152,566	0.00
USD 5,467,000	Sutter Health 3.695% 15/8/2028	5,246,290	0.06
USD 2,050,000	Talen Energy Supply 6.625% 15/1/2028	2,083,763	0.02
USD 4,476,000	Talen Energy Supply 7.25% 15/5/2027	4,604,685	0.05
USD 4,233,000	Tap Rock Resources 7% 1/10/2026	4,015,276	0.04
USD 102,000	Targa Resources Partners / Targa Resources Partners Finance 5% 15/1/2028	99,713	0.00
USD 102,000	Targa Resources Partners / Targa Resources Partners Finance 6.5% 15/7/2027	105,262	0.00
USD 1,000,000	Target 2.65% 15/9/2030	899,888	0.01
USD 3,445,000	Tarrant County Cultural Education Facilities Finance 4% 15/2/2047	3,302,545	0.04
USD 1,968,000	Taylor Morrison Communities 5.875% 15/6/2027	1,895,046	0.02
USD 637,000	TEGNA 4.625% 15/3/2028	609,927	0.01
USD 143,000	TEGNA 5% 15/9/2029	137,550	0.00
USD 9,212,000	Tenet Healthcare 4.25% 1/6/2029	7,995,003	0.09
USD 4,338,000	Tenet Healthcare 4.375% 15/1/2030	3,792,744	0.04
USD 102,000	Tenet Healthcare 4.625% 15/7/2024	99,199	0.00
USD 255,000	Tenet Healthcare 4.625% 15/6/2028	232,147	0.00
USD 274,000	Tenet Healthcare 4.875% 1/1/2026	261,365	0.00
USD 196,000	Tenet Healthcare 5.125% 1/11/2027	182,747	0.00
USD 2,070,000	Tenet Healthcare 6.125% 15/6/2030	1,979,334	0.02
USD 196,000	Tenet Healthcare 6.25% 1/2/2027	188,560	0.00
USD 250,000	Tennessee Housing Development Agency 3.85% 1/7/2043	243,789	0.00
USD 205,000	Tennessee Housing Development Agency 3.95% 1/1/2049	200,587	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,700,000	Texas A&M University 2.836% 15/5/2027	1,631,896	0.02
USD 685,000	Texas Instruments 1.75% 4/5/2030	586,931	0.01
USD 969,913	Thornburg Mortgage Trust 2006-3 2.525% 25/6/2046	696,659	0.01
USD 63,603	Thornburg Mortgage Trust 2007-3 5.341% 25/6/2047	60,773	0.00
USD 2,612,000	TK Elevator US Newco 5.25% 15/7/2027	2,400,228	0.03
USD 1,000,000	T-Mobile USA 2.05% 15/2/2028	873,514	0.01
USD 612,000	T-Mobile USA 2.25% 15/11/2031	494,824	0.00
USD 1,750,000	T-Mobile USA 2.4% 15/3/2029	1,515,553	0.02
USD 2,453,000	T-Mobile USA 2.7% 15/3/2032	2,054,206	0.02
USD 2,171,000	T-Mobile USA 3.3% 15/2/2051	1,578,087	0.02
USD 844,000	T-Mobile USA 3.4% 15/10/2052	618,329	0.01
USD 1,700,000	T-Mobile USA 3.75% 15/4/2027	1,635,117	0.02
USD 1,535,000	T-Mobile USA 3.875% 15/4/2030	1,433,829	0.02
USD 598,000	T-Mobile USA 4.5% 15/4/2050	529,760	0.01
USD 3,315,000	Tobacco Settlement Financing 6.706% 1/6/2046	3,131,667	0.04
USD 937,000	Toyota Motor Credit 1.8% 13/2/2025	892,037	0.01
USD 612,000	Toyota Motor Credit 1.9% 12/9/2031	508,208	0.01
USD 555,000	Toyota Motor Credit 3.05% 22/3/2027	533,463	0.01
USD 3,195,000	Tri Pointe Homes 5.25% 1/6/2027	2,906,981	0.03
USD 167,000	Tri Pointe Homes 5.7% 15/6/2028	151,524	0.00
USD 1,770,000	Triborough Bridge & Tunnel Authority 5% 15/5/2051	1,899,432	0.02
USD 850,000	Tricon American Homes 2018-SFR1 Trust 4.564% 17/5/2037	831,120	0.01
USD 580,000	Tricon American Homes 2018-SFR1 Trust 4.96% 17/5/2037	557,787	0.01
USD 1,910,000	Tri-County Metropolitan Transportation District of Oregon 5% 1/9/2043	2,142,398	0.02
USD 1,294,000	Truist Bank 3.3% 15/5/2026	1,247,246	0.01
USD 1,492,000	Truist Bank 3.8% 30/10/2026	1,459,603	0.02
USD 367,000	TWDC Enterprises 18 3.15% 17/9/2025	359,118	0.00
USD 840,000	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C11 5.069% 15/6/2051	764,066	0.01
USD 691,000	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C12 4.788% 15/8/2051	660,581	0.01
EUR 721,000	UGI International 2.5% 1/12/2029	565,122	0.01
USD 650,000	Union Pacific 2.75% 1/3/2026	625,736	0.01
USD 894,000	Union Pacific 2.8% 14/2/2032	799,920	0.01
USD 433,000	Union Pacific 3.25% 5/2/2050	345,279	0.00
USD 98,000	United Rentals North America 3.875% 15/11/2027	91,295	0.00
USD 439,000	United Rentals North America 4.875% 15/1/2028	412,545	0.00
USD 98,000	United Rentals North America 5.25% 15/1/2030	92,051	0.00
USD 132,000	United Rentals North America 5.5% 15/5/2027	131,175	0.00
USD 56,191,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2026	62,293,534	0.69
USD 6,848,500	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/10/2026	7,303,265	0.08
USD 7,312,700	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2027	7,501,871	0.08
USD 18,124,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/1/2030	20,110,122	0.22
USD 149,777,400	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.5% 15/4/2024	174,620,600	1.94

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 41,073,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/4/2023	48,427,438	0.54
USD 52,705,000	United States Treasury Note/Bond 0.625% 15/5/2030	43,675,151	0.49
USD 46,479,100	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15/2/2031	39,734,184	0.44
USD 15,484,500	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15/5/2040	10,642,872	0.12
USD 1,065,572,000	United States Treasury Note/Bond 1.25% 30/11/2026	977,246,076	10.86
USD 46,464,500	United States Treasury Note/Bond 1.25% 31/12/2026*	42,553,133	0.47
USD 14,306,600	United States Treasury Note/Bond 1.375% 15/11/2031	12,322,118	0.14
USD 39,031,800	United States Treasury Note/Bond 1.625% 15/8/2029	35,286,424	0.39
USD 8,589,500	United States Treasury Note/Bond 1.625% 15/11/2050	5,959,804	0.07
USD 43,511,000	United States Treasury Note/Bond 1.75% 15/11/2029	39,688,491	0.44
USD 20,159,800	United States Treasury Note/Bond 1.75% 15/8/2041	15,143,869	0.17
USD 19,225,400	United States Treasury Note/Bond 1.875% 15/2/2041	14,880,535	0.17
USD 7,385,700	United States Treasury Note/Bond 1.875% 15/2/2051	5,461,956	0.06
USD 10,376,200	United States Treasury Note/Bond 1.875% 15/11/2051	7,656,501	0.09
USD 10,043,200	United States Treasury Note/Bond 2.25% 15/8/2049	8,155,392	0.09
USD 31,898,500	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/5/2029	30,208,877	0.34
USD 13,926,000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/2/2042	11,664,113	0.13
USD 14,761,300	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/11/2049†	12,322,226	0.14
USD 110,558,600	United States Treasury Note/Bond 2.625% 31/5/2027	107,345,491	1.19
USD 6,530,000	United States Treasury Note/Bond 2.75% 30/4/2027	6,371,596	0.07
USD 19,130,800	United States Treasury Note/Bond 2.75% 31/7/2027	18,666,729	0.21
USD 10,379,800	United States Treasury Note/Bond 2.75% 15/8/2032	10,066,784	0.11
USD 535,565,900	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/5/2032	524,729,056	5.83
USD 264,901,700	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/5/2052	247,062,226	2.75
USD 567,700	United States Treasury Note/Bond 3% 15/8/2048	529,669	0.01
USD 9,669,300	United States Treasury Note/Bond 3% 15/8/2052	9,277,240	0.10
USD 58,982,700	United States Treasury Note/Bond 3.25% 30/6/2027	58,855,979	0.65
USD 34,771,300	United States Treasury Note/Bond 3.25% 15/5/2042	33,570,604	0.37
USD 4,836,000	United Wholesale Mortgage 5.5% 15/11/2025	4,262,541	0.05
USD 1,639,000	UnitedHealth 2.9% 15/5/2050	1,222,462	0.01
USD 780,000	UnitedHealth 3.1% 15/3/2026	763,902	0.01
USD 825,000	UnitedHealth 3.125% 15/5/2060	616,131	0.01
USD 1,600,000	UnitedHealth 3.375% 15/4/2027	1,568,789	0.02
USD 3,185,000	UnitedHealth 3.875% 15/12/2028	3,155,252	0.04
USD 500,000	Uniti / Uniti Fiber / CSL Capital 7.875% 15/2/2025	494,108	0.01
USD 1,095,000	University of California 5.77% 15/5/2043	1,228,813	0.01
USD 6,925,000	University of Massachusetts Building Authority 5% 1/11/2052	7,531,895	0.08
USD 2,385,000	University of Michigan 5% 1/4/2047	2,652,827	0.03
USD 54,000	University of Southern California 3.028% 1/10/2039	46,301	0.00
USD 1,865,000	University of Utah/The 4% 1/8/2051	1,791,939	0.02
USD 1,980,000	University of Vermont and State Agricultural College 5% 1/10/2043	2,116,214	0.02
USD 1,380,000	Univision Communications 6.625% 1/6/2027	1,336,537	0.01
USD 1,570,000	Univision Communications 7.375% 30/6/2030	1,556,215	0.02
USD 130,476	Upstart Pass-Through Trust Series 2020-ST5 2% 20/7/2027	123,046	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,267,283	Upstart Pass-Through Trust Series 2021-ST2 2.5% 20/4/2027	3,115,545	0.04
USD 2,081,799	Upstart Pass-Through Trust Series 2021-ST3 2% 20/5/2027	1,983,602	0.02
USD 1,483,058	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.95% 15/5/2027	1,335,659	0.02
USD 5,250,000	US Bancorp 2.215% 27/1/2028	4,808,414	0.05
USD 474,000	US Bancorp 3.1% 27/4/2026	457,287	0.00
USD 3,985,000	US Bancorp 4.548% 22/7/2028	4,015,325	0.04
USD 889,773	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 4.24% 25/11/2047	802,600	0.01
USD 148,962	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 5% 25/11/2047	133,278	0.00
USD 149,781	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2018-1 4.26% 25/4/2048	139,340	0.00
USD 2,750,000	Ventas Realty 3.75% 1/5/2024	2,722,816	0.03
USD 1,325,000	Venture Global Calcasieu Pass 3.875% 1/11/2033	1,101,406	0.01
EUR 1,100,000	Verizon Communications 1.5% 19/9/2039	807,200	0.01
USD 3,437,000	Verizon Communications 1.68% 30/10/2030	2,762,402	0.03
USD 2,600,000	Verizon Communications 2.1% 22/3/2028	2,304,705	0.03
USD 6,040,000	Verizon Communications 2.355% 15/3/2032	4,991,560	0.05
USD 202,000	Verizon Communications 2.625% 15/8/2026	190,889	0.00
EUR 200,000	Verizon Communications 2.875% 15/1/2038	181,695	0.00
USD 1,020,000	Verizon Communications 2.875% 20/11/2050	711,033	0.01
USD 2,558,000	Verizon Communications 2.987% 30/10/2056	1,749,288	0.02
USD 895,000	Verizon Communications 3.55% 22/3/2051	709,753	0.01
USD 3,470,000	Verizon Communications 3.875% 8/2/2029	3,346,091	0.04
USD 7,340,000	Verizon Communications 4.016% 3/12/2029	7,113,209	0.08
USD 687,000	Verizon Communications 4.125% 16/3/2027	684,728	0.01
USD 1,170,000	Vertiv 4.125% 15/11/2028	1,019,351	0.01
USD 540,000	Viasat 5.625% 15/4/2027	497,578	0.01
USD 304,000	VICI Properties 4.375% 15/5/2025	296,983	0.00
USD 3,066,000	VICI Properties 5.125% 15/5/2032	2,944,770	0.03
USD 1,121,000	VICI Properties 5.625% 15/5/2052	1,036,559	0.01
USD 3,625,000	VICI Properties / VICI Note 3.5% 15/2/2025	3,421,492	0.04
USD 2,429,000	VICI Properties / VICI Note 3.75% 15/2/2027	2,205,350	0.02
USD 1,510,000	VICI Properties / VICI Note 4.125% 15/8/2030	1,338,771	0.01
USD 1,858,000	VICI Properties / VICI Note 4.25% 1/12/2026	1,741,931	0.02
USD 138,000	VICI Properties / VICI Note 4.5% 1/9/2026	130,747	0.00
USD 1,633,000	VICI Properties / VICI Note 4.625% 1/12/2029	1,510,794	0.02
USD 2,180,000	VICI Properties / VICI Note 5.625% 1/5/2024	2,183,423	0.02
USD 207,000	VICI Properties / VICI Note 5.75% 1/2/2027	204,048	0.00
USD 1,775,000	Victor Valley Community College District 4% 1/8/2044	1,732,248	0.02
USD 1,930,000	Virginia College Building Authority 1.965% 1/2/2032	1,582,704	0.02
USD 3,070,000	Virginia Commonwealth Transportation Board 4% 15/5/2035	3,182,970	0.04
USD 612,000	Visa 1.1% 15/2/2031	492,408	0.01
USD 946,000	Visa 2% 15/8/2050	626,782	0.01
USD 1,230,000	Vistra 7% 15/6/2171	1,151,477	0.01
USD 5,790,000	Vistra Operations 3.55% 15/7/2024	5,589,323	0.06

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,085,000	Vistra Operations 5% 31/7/2027	1,946,806	0.02
USD 1,500,000	Vistra Operations 5.125% 13/5/2025	1,495,012	0.02
USD 359,000	Vistra Operations 5.625% 15/2/2027	346,864	0.00
USD 290,000	VMware 0.6% 15/8/2023	280,463	0.00
USD 1,069,000	VMware 1.8% 15/8/2028	894,131	0.01
USD 6,216,000	VMware 2.2% 15/8/2031	4,884,552	0.05
USD 1,800,000	VMware 4.65% 15/5/2027	1,788,357	0.02
USD 6,080,000	VMware 4.7% 15/5/2030	5,823,792	0.06
USD 2,000,000	Volkswagen of America Finance 4.25% 13/11/2023	1,999,485	0.02
USD 14,009,800	Voyager OPTONE Delaware Trust 2.16% 25/2/2038	4,109,709	0.05
USD 946,000	Walmart 2.65% 22/9/2051	720,701	0.01
USD 3,000,000	Walt Disney 2% 1/9/2029	2,603,448	0.03
USD 946,000	Walt Disney 2.75% 1/9/2049	689,798	0.01
USD 1,800,000	Walt Disney 3.8% 22/3/2030	1,750,845	0.02
USD 1,304,000	Walt Disney 6.65% 15/11/2037	1,562,541	0.02
USD 4,658,062	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR3 Trust 1.859% 25/2/2046	4,212,503	0.05
USD 542,617	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR5 Trust 1.849% 25/6/2046	501,683	0.01
USD 1,704,140	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust 1.609% 25/6/2047	1,496,511	0.02
USD 8,095,000	Washington Health Care Facilities Authority 4% 1/10/2045	7,856,572	0.09
USD 780,370	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2005-9 Trust 2.994% 25/11/2035	540,681	0.01
USD 319,016	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2005-9 Trust 5.5% 25/11/2035	256,653	0.00
USD 667,670	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-1 Trust 6.5% 25/2/2036	567,084	0.01
USD 2,421,648	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 6% 25/4/2036	2,285,023	0.03
USD 214,053	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 6.85% 25/5/2036	195,861	0.00
USD 936,394	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 7% 25/5/2036	914,915	0.01
USD 4,096,625	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-9 Trust 4.303% 25/10/2036	1,412,987	0.02
USD 3,736,130	Washington Mutural Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE4 Trust 2.804% 25/9/2036	1,242,673	0.01
USD 4,595,110	Washington Mutural Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust 2.599% 25/10/2036	3,734,923	0.04
USD 925,000	Waste Management 1.15% 15/3/2028	788,817	0.01
USD 612,000	Waste Management 1.5% 15/3/2031	487,323	0.00
USD 833,000	Waste Management 2.95% 1/6/2041	653,850	0.01
USD 921,000	Weekley Homes / Weekley Finance 4.875% 15/9/2028	768,029	0.01
USD 5,520,000	Wells Fargo 2.164% 11/2/2026	5,196,963	0.06
USD 2,602,000	Wells Fargo 4.808% 25/7/2028	2,599,357	0.03
USD 572,513	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 4.224% 15/12/2048	548,167	0.01
USD 2,633,561	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1 1.393% 15/8/2049	106,132	0.00
USD 448,469	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 5.115% 15/1/2059	435,402	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,759,418	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 5.148% 15/1/2059	2,619,249	0.03
USD 1,851,126	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 4.118% 15/9/2050	1,653,997	0.02
USD 830,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41 4.188% 15/11/2050	769,143	0.01
USD 960,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C42 4.002% 15/12/2050	886,698	0.01
USD 2,424,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-HSDB 3.241% 13/12/2031	2,393,066	0.03
USD 896,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 3.874% 15/6/2036	834,384	0.01
USD 316,791	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C44 3% 15/5/2051	233,976	0.00
USD 859,552	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C45 4.727% 15/6/2051	790,877	0.01
USD 941,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C46 4.633% 15/8/2051	881,344	0.01
USD 1,675,000	Welltower 2.05% 15/1/2029	1,419,861	0.02
USD 3,615,000	Welltower 2.75% 15/1/2032	3,015,892	0.03
USD 750,000	Welltower 4% 1/6/2025	741,306	0.01
USD 2,795,000	Welltower 4.5% 15/1/2024	2,805,863	0.03
USD 1,190,000	West County Facilities Financing Authority 4% 1/6/2046	1,139,061	0.01
USD 2,038,000	Western Digital 4.75% 15/2/2026	1,963,897	0.02
USD 496,178	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C24 4.204% 15/11/2047	451,237	0.01
USD 446,000	William Lyon Homes 6.625% 15/7/2027	439,629	0.01
USD 1,711,000	WinWater Mortgage Loan Trust 2014-3 3.973% 20/11/2044	1,706,198	0.02
USD 3,949,291	WinWater Mortgage Loan Trust 2015-5 3.75% 20/8/2045	3,231,321	0.04
USD 5,000,000	Wisconsin Health & Educational Facilities Authority 4% 1/4/2039	4,836,109	0.05
USD 1,515,000	Wisconsin Health & Educational Facilities Authority 5% 15/11/2035	1,601,002	0.02
USD 1,520,000	Wisconsin Health & Educational Facilities Authority 5% 15/11/2039	1,592,117	0.02
EUR 603,000	WMG Acquisition 2.25% 15/8/2031	476,415	0.01
USD 1,209,000	Workday 3.7% 1/4/2029	1,143,154	0.01
USD 2,685,000	WRKCo 3.9% 1/6/2028	2,589,396	0.03
USD 2,303,000	WRKCo 4.9% 15/3/2029	2,312,361	0.03
USD 123,000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.25% 15/5/2027	111,115	0.00
USD 2,042,000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.5% 1/3/2025	1,952,464	0.02
USD 2,416,000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 5.125% 1/10/2029	2,034,490	0.02
USD 2,856,000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 7.75% 15/4/2025	2,851,345	0.03
USD 7,415,000	Xerox 5% 15/8/2025	6,888,795	0.08
USD 2,375,000	Xerox 5.5% 15/8/2028	2,073,172	0.02
USD 808,000	XHR 4.875% 1/6/2029	708,203	0.01
USD 699,000	XHR 6.375% 15/8/2025	684,382	0.01
USD 1,735,000	Ysleta Independent School District 5% 15/8/2056	1,889,425	0.02
		5,675,881,760	63.08
債券合計		7,405,305,869	82.31

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 5,200,000	General Motors Financial 0% 7/11/2022	5,167,549	0.06
USD 4,980,000	General Motors Financial 0% 13/2/2023	4,889,557	0.05
USD 4,980,000	General Motors Financial 0% 14/2/2023	4,888,876	0.05
USD 4,986,000	General Motors Financial 0% 15/2/2023	4,894,059	0.06
		<hr/>	
		19,840,041	0.22
コマーシャル・ペーパー合計			
		<hr/>	
		19,840,041	0.22
預託証書			
	米国		
USD 5,390,000	Citibank (New York Branch) 4.06% 1/8/2023	5,385,586	0.06
預託証書合計			
		<hr/>	
		5,385,586	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合計			
		<hr/>	
		7,606,614,967	84.55
		<hr/>	

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
その他の譲渡可能な有価証券			
普通株式			
	米国		
97,804	Fanatics**	6,546,999	0.07
普通株式合計		6,546,999	0.07
債券			
	バミューダ		
USD 8,777	DGL2 9.125% 1/4/2024**	-	0.00
	ケイマン諸島		
USD 9,164,792	Prima Capital CRE Securitization 2016-VI 4% 24/8/2040**	8,617,654	0.10
	香港		
CNH 917,253	China City Construction International 5.35% 3/7/2017**,***	-	0.00
	インド		
USD 116,049	Videocon Industries 2.8% 31/12/2020**,***	-	0.00
	米国		
USD 1,228,685	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 0% 15/8/2030**	937,243	0.01
USD 11,144,350	American Airlines Pass Through Trust 3.5% 15/12/2027**	10,239,429	0.11
USD 2,035,000	American Airlines Pass Through Trust 4% 15/12/2025**	1,953,600	0.02
USD 250,000	Chesapeake Energy 0% 15/6/2021**,***	-	0.00
USD 5,581,000	Chesapeake Energy 0% 15/2/2022**,***	-	0.00
USD 546,000	Chesapeake Energy 0% 15/8/2022**,***	-	0.00
USD 2,391	Lehman Brothers 0% 31/12/2049**	-	0.00
USD 2,391	Lehman Brothers Special Finance 0% 31/12/2049**	-	0.00
USD 1,480,000	Sun Country 7% 15/12/2023**	1,435,600	0.02
USD 1,480,000	Sun Country 4.7% 15/12/2025**	1,383,800	0.02
USD 1,974,879	Sun Country 4.84% 15/3/2031**	1,883,640	0.02
USD 10,740,000	Washington Mutual Bank Escrow 0% 6/11/2018**,***	-	0.00
USD 7,220,000	Washington Mutual Bank Escrow 0% 1/5/2018**,***	-	0.00
USD 630,000	Washington Mutual Bank Escrow 0% 16/6/2018**,***	-	0.00
USD 3,780,000	Washington Mutual Bank Escrow 0% 4/2/2018**,***	-	0.00
USD 3,399,000	Washington Mutual Bank Escrow 0% 16/6/2018**,***	-	0.00
		17,833,312	0.20
債券合計		26,450,966	0.30
その他の譲渡可能な有価証券合計		32,997,965	0.37
投資有価証券合計		7,639,612,932	84.91
その他の純資産		1,357,477,574	15.09
純資産合計(米ドル)		8,997,090,506	100.00

クロス・アンブレラ型の投資保有高および関連当事者ファンドに対する投資。詳細については注記10を参照のこと。

- ～ 関連当事者ファンドに対する投資。詳細については注記10を参照のこと。
- * 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。
- *** 当証券はデフォルトが生じている。詳細については注記2(b)を参照のこと。
- † 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13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 2022年8月31日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益 / (損) (米ドル)
AUD	4,710,774	USD	3,274,193	Deutsche Bank	21/9/2022	(44,642)
AUD	22,005,671	USD	15,159,374	HSBC Bank	21/9/2022	(73,016)
AUD	8,994,330	USD	6,223,857	JP Morgan	21/9/2022	(57,642)
AUD	26,700,105	USD	18,479,994	Barclays	21/9/2022	(175,286)
AUD	4,104,000	USD	2,847,344	Toronto-Dominion	21/9/2022	(33,778)
AUD	25,535,887	USD	17,700,484	Citigroup	21/9/2022	(193,926)
AUD	1,735,000	JPY	158,816,157	Deutsche Bank	21/9/2022	43,512
AUD	3,514,228	USD	2,421,597	BNP Paribas	21/9/2022	(12,358)
AUD	147,493	USD	100,000	State Street	21/9/2022	1,116
AUD	4,837,214	USD	3,334,010	Goldman Sachs	21/9/2022	(17,776)
AUD	589,976	USD	400,000	Bank of America	21/9/2022	4,468
AUD	49,599,406	USD	34,513,845	Morgan Stanley	21/9/2022	(510,136)
AUD	1,447,394	USD	1,000,000	UBS	21/9/2022	(7,715)
AUD	9,553,000	JPY	888,903,083	BNP Paribas	21/9/2022	135,290
AUD	1,215,000	JPY	109,874,880	Bank of America	21/9/2022	40,155
AUD	1,735,000	JPY	160,294,255	HSBC Bank	21/9/2022	32,846
AUD	856,194	USD	600,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(13,022)
AUD	3,490,000	JPY	326,549,458	Citigroup	21/9/2022	36,393
AUD	20,997,000	USD	14,757,363	RBS	19/9/2022	(362,990)
AUD	4,316,000	CAD	3,921,897	RBS	19/9/2022	(27,156)
BRL	40,302,239	USD	7,858,500	HSBC Bank	21/9/2022	(110,666)
BRL	36,611,591	USD	6,892,000	Citigroup	21/9/2022	146,331
BRL	11,374,713	USD	2,169,000	Goldman Sachs	14/9/2022	21,660
BRL	6,192,933	USD	1,115,000	Citigroup	14/9/2022	77,699
BRL	9,398,245	USD	1,710,000	BNP Paribas	21/9/2022	96,749
BRL	28,944,814	USD	5,480,000	Citigroup	2/9/2022	111,712
BRL	28,499,099	USD	5,500,000	BNP Paribas	2/9/2022	5,605
BRL	37,490,487	USD	7,341,000	HSBC Bank	2/9/2022	(98,393)
CAD	2,729,878	USD	2,150,000	Standard Chartered Bank	21/9/2022	(71,622)
CAD	5,717,957	USD	4,425,000	Citigroup	21/9/2022	(71,663)
CAD	2,231,040	USD	1,750,000	Barclays	21/9/2022	(51,409)
CAD	1,767,000	JPY	183,236,150	State Street	21/9/2022	23,146
CAD	4,120,474	USD	3,200,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(62,899)
CAD	7,096,129	USD	5,474,000	Goldman Sachs	21/9/2022	(71,399)
CAD	4,896,469	USD	3,800,000	HSBC Bank	21/9/2022	(72,099)
CAD	11,067,942	USD	8,579,330	Deutsche Bank	21/9/2022	(152,810)
CAD	4,789,538	USD	3,672,000	BNP Paribas	21/9/2022	(25,511)
CAD	2,935,000	JPY	305,800,585	Deutsche Bank	21/9/2022	28,026
CAD	2,445,790	USD	1,872,000	Bank of America	21/9/2022	(9,911)
CAD	2,708,543	USD	2,091,000	Morgan Stanley	21/9/2022	(28,864)
CAD	17,838,918	USD	13,849,000	JP Morgan	21/9/2022	(267,433)
CAD	4,000,029	USD	3,103,000	Bank of America	19/9/2022	(57,549)
CHF	10,739,714	USD	11,216,000	BNP Paribas	21/9/2022	(232,738)
CHF	794,863	USD	800,000	Deutsche Bank	21/9/2022	12,889

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
CHF	2,313,955	USD	2,400,000	HSBC Bank	21/9/2022	(33,571)
CHF	18,844,058	USD	19,634,000	JP Morgan	21/9/2022	(362,610)
CHF	4,155,655	USD	4,330,000	Citigroup	21/9/2022	(80,106)
CHF	11,060,000	EUR	11,001,341	JP Morgan	21/9/2022	290,378
CHF	10,343,396	USD	10,845,000	Morgan Stanley	21/9/2022	(267,043)
CHF	20,692,655	EUR	20,730,495	Société Générale	21/9/2022	395,437
CHF	1,187,345	EUR	1,191,551	Deutsche Bank	21/9/2022	20,652
CHF	2,537,234	EUR	2,527,000	BNY Mellon	21/9/2022	63,386
CHF	96,349	USD	100,000	Standard Chartered Bank	21/9/2022	(1,466)
CHF	2,506,429	USD	2,600,000	Bank of America	21/9/2022	(36,732)
CHF	10,980,000	EUR	11,162,348	UBS	21/9/2022	47,277
CHF	1,802,967	USD	1,900,000	Goldman Sachs	21/9/2022	(56,146)
CHF	3,554,128	GBP	3,102,000	Bank of America	19/9/2022	31,972
CHF	3,524,496	USD	3,708,000	BNP Paribas	19/9/2022	(104,176)
CNH	42,760,000	USD	6,392,413	Barclays	14/9/2022	(193,687)
CNH	89,662,292	USD	13,356,138	Deutsche Bank	21/9/2022	(357,360)
CNH	76,799,000	USD	11,411,441	HSBC Bank	14/9/2022	(278,234)
CNH	50,087,156	USD	7,439,550	Morgan Stanley	21/9/2022	(178,171)
CNH	43,328,215	USD	6,436,000	BNP Paribas	21/9/2022	(154,498)
CNH	21,999,907	USD	3,262,000	Citigroup	21/9/2022	(72,567)
CNH	21,727,598	USD	3,218,000	JP Morgan	21/9/2022	(68,045)
CNH	17,734,449	USD	2,615,000	Citigroup	22/9/2022	(43,927)
COP	328,666,313	USD	84,670	UBS	21/9/2022	(10,710)
COP	6,565,660,000	USD	1,481,171	BNY Mellon	23/11/2022	(21,201)
CZK	95,734,408	USD	3,956,000	UBS	19/9/2022	(58,908)
EUR	89,166,000	GBP	76,341,569	Deutsche Bank	21/9/2022	666,786
EUR	68,510,000	USD	70,540,959	Barclays	21/9/2022	(1,912,058)
EUR	14,263,357	USD	14,320,360	Bank of America	21/9/2022	(32,250)
EUR	22,310,000	GBP	19,225,684	BNP Paribas	21/9/2022	22,311
EUR	20,140,000	GBP	17,224,642	Barclays	21/9/2022	172,315
EUR	24,062,705	USD	24,827,571	Deutsche Bank	21/9/2022	(723,105)
EUR	41,475,847	USD	42,899,387	BNP Paribas	21/9/2022	(1,351,558)
EUR	74,577,853	USD	78,230,163	Citigroup	21/9/2022	(3,522,879)
EUR	26,248,786	USD	27,355,725	HSBC Bank	21/9/2022	(1,061,386)
EUR	70,965,388	USD	73,034,998	JP Morgan	21/9/2022	(1,946,446)
EUR	4,423,759	NOK	45,700,000	Goldman Sachs	21/9/2022	(159,340)
EUR	16,443,844	CHF	16,340,000	Société Générale	21/9/2022	(238,165)
EUR	11,106,980	CHF	11,020,000	HSBC Bank	21/9/2022	(143,649)
EUR	194,004	USD	200,000	Standard Chartered Bank	21/9/2022	(5,659)
EUR	11,140,744	CHF	11,070,000	Bank of America	21/9/2022	(160,959)
EUR	2,936,358	USD	3,000,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(58,547)
EUR	33,752,571	USD	34,403,195	Morgan Stanley	21/9/2022	(592,046)
EUR	20,056,383	NOK	205,700,000	HSBC Bank	21/9/2022	(572,330)
EUR	5,528,534	CHF	5,490,000	JP Morgan	21/9/2022	(76,370)

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益 / (損) (米ドル)
EUR	10,950,000	USD	11,252,921	Goldman Sachs	21/9/2022	(283,917)
EUR	142,986,479	USD	145,355,273	Toronto-Dominion	21/9/2022	(2,120,637)
EUR	5,466,000	NOK	53,796,571	HSBC Bank	19/9/2022	70,821
EUR	3,552,000	CZK	87,512,186	UBS	19/9/2022	(4,710)
EUR	5,484,000	USD	5,561,506	BNP Paribas	19/9/2022	(68,742)
EUR	5,532,000	USD	5,507,930	Citigroup	19/9/2022	32,912
EUR	5,500,000	USD	5,489,913	JP Morgan	14/9/2022	16,988
EUR	6,880,000	USD	6,851,648	Société Générale	21/9/2022	40,293
EUR	2,669,000	USD	2,670,127	JP Morgan	19/9/2022	3,138
GBP	12,890,131	USD	15,379,246	Morgan Stanley	21/9/2022	(410,191)
GBP	24,566,007	USD	29,498,345	HSBC Bank	21/9/2022	(970,322)
GBP	69,635,469	EUR	81,110,000	Deutsche Bank	21/9/2022	(384,467)
GBP	24,960,489	EUR	28,650,000	Goldman Sachs	21/9/2022	286,403
GBP	9,126,381	USD	11,057,903	JP Morgan	21/9/2022	(459,615)
GBP	6,932,680	USD	8,420,024	Citigroup	21/9/2022	(369,238)
GBP	11,519,991	USD	13,977,283	Deutsche Bank	21/9/2022	(599,343)
GBP	7,588,418	EUR	8,770,000	Barclays	21/9/2022	27,060
GBP	2,035,000	USD	2,492,743	BNY Mellon	21/9/2022	(129,537)
GBP	7,534,080	EUR	8,710,000	BNP Paribas	21/9/2022	24,063
GBP	9,570,000	USD	11,389,238	Barclays	21/9/2022	(275,785)
GBP	3,762,397	EUR	4,376,000	Citigroup	21/9/2022	(14,397)
GBP	13,861,775	USD	16,685,678	Goldman Sachs	21/9/2022	(588,271)
GBP	5,042,265	USD	6,004,880	BNP Paribas	21/9/2022	(149,397)
GBP	3,600,898	USD	4,300,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(118,348)
GBP	3,102,000	CHF	3,511,486	Bank of America	19/9/2022	11,630
GBP	5,810,000	USD	6,783,285	UBS	21/9/2022	(36,247)
IDR	-	USD	46,595,782	HSBC Bank	21/9/2022	(293,648)
IDR	89,987,625,000	USD	6,109,969	HSBC Bank	14/12/2022	(74,009)
IDR	89,751,943,050	USD	6,099,351	Bank of America	14/12/2022	(79,199)
IDR	163,070,431,950	USD	11,086,724	BNP Paribas	14/12/2022	(148,701)
JPY	3,812,819,097	USD	28,438,331	JP Morgan	21/9/2022	(926,721)
JPY	16,900,000	USD	126,353	Bank of America	14/9/2022	(4,480)
JPY	121,575,183	USD	900,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(22,767)
JPY	1,436,716,935	USD	10,739,757	Bank of America	21/9/2022	(373,046)
JPY	184,453,065	CAD	1,767,000	Bank of America	21/9/2022	(14,365)
JPY	1,136,950,698	USD	8,445,000	Morgan Stanley	21/9/2022	(241,269)
JPY	202,733,250	USD	1,500,000	Goldman Sachs	21/9/2022	(37,167)
JPY	848,484,056	USD	6,288,807	HSBC Bank	21/9/2022	(166,522)
JPY	712,573,679	USD	5,343,000	Citigroup	21/9/2022	(201,385)
JPY	177,496,462	CAD	1,725,000	HSBC Bank	21/9/2022	(32,584)
JPY	1,036,862,805	USD	7,704,000	BNP Paribas	21/9/2022	(222,458)
JPY	124,856,633	CAD	1,210,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(20,317)
JPY	1,214,247,093	USD	9,035,847	Deutsche Bank	21/9/2022	(274,380)
JPY	553,732,889	AUD	6,080,000	Deutsche Bank	21/9/2022	(172,756)

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
JPY	110,853,052	AUD	1,215,000	JP Morgan	21/9/2022	(33,097)
JPY	162,689,215	AUD	1,735,000	Citigroup	21/9/2022	(15,565)
JPY	823,559,692	AUD	8,698,000	Standard Chartered Bank	21/9/2022	(20,620)
JPY	153,781,368	USD	1,154,577	Standard Chartered Bank	14/9/2022	(45,594)
JPY	739,607,288	USD	5,516,000	Deutsche Bank	22/9/2022	(178,886)
KRW	7,152,252,836	USD	5,450,000	Goldman Sachs	19/9/2022	(111,300)
MXN	347,774,168	USD	16,780,665	Morgan Stanley	21/9/2022	406,310
MXN	253,329,912	USD	12,194,566	Bank of America	21/9/2022	324,980
MXN	108,995,064	USD	5,448,000	Goldman Sachs	19/9/2022	(59,368)
NOK	56,242,507	EUR	5,486,938	Deutsche Bank	21/9/2022	153,361
NOK	19,722,671	USD	2,000,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(18,767)
NOK	59,148,412	USD	5,995,000	Bank of America	21/9/2022	(53,267)
NOK	101,826,330	USD	10,461,000	Deutsche Bank	21/9/2022	(232,074)
NOK	8,983,266	USD	900,000	Goldman Sachs	21/9/2022	2,410
NOK	79,828,483	USD	7,986,800	Morgan Stanley	21/9/2022	32,341
NOK	41,042,032	USD	4,173,200	HSBC Bank	21/9/2022	(50,337)
NOK	52,117,168	USD	5,235,000	JP Morgan	21/9/2022	411
NOK	82,684,261	USD	8,377,000	BNP Paribas	21/9/2022	(70,982)
NOK	244,534,936	EUR	23,353,630	JP Morgan	21/9/2022	1,170,508
NOK	36,792,420	USD	3,736,000	Citigroup	21/9/2022	(40,031)
NZD	68,454,892	USD	43,222,877	HSBC Bank	21/9/2022	(1,286,580)
NZD	9,762,249	USD	6,076,858	Morgan Stanley	21/9/2022	(96,387)
NZD	7,838,843	USD	4,927,294	Bank of America	21/9/2022	(125,123)
NZD	7,688,058	USD	4,822,417	Deutsche Bank	21/9/2022	(112,620)
NZD	3,219,173	USD	2,000,000	Standard Chartered Bank	21/9/2022	(27,896)
NZD	9,897,426	USD	6,196,364	JP Morgan	21/9/2022	(133,082)
NZD	6,205,583	USD	3,819,834	Citigroup	21/9/2022	(18,219)
NZD	3,148,619	USD	1,958,618	BNP Paribas	21/9/2022	(29,736)
NZD	1,593,993	USD	1,000,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(23,501)
NZD	36,640,000	USD	22,661,917	Barclays	21/9/2022	(215,810)
SEK	67,444,906	USD	6,669,000	Morgan Stanley	21/9/2022	(342,235)
SEK	28,372,234	USD	2,800,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(138,501)
SEK	9,971,860	USD	1,000,000	Bank of America	21/9/2022	(64,575)
SEK	92,763,154	USD	8,998,800	Deutsche Bank	21/9/2022	(297,020)
SEK	20,896,639	USD	2,030,000	BNP Paribas	21/9/2022	(69,761)
SEK	6,217,504	USD	600,000	HSBC Bank	21/9/2022	(16,758)
SEK	4,197,954	USD	400,000	State Street	21/9/2022	(6,205)
SEK	46,332,622	USD	4,433,200	Citigroup	21/9/2022	(86,902)
SEK	42,022,514	USD	4,000,000	JP Morgan	21/9/2022	(58,018)
SEK	14,865,085	USD	1,400,000	Goldman Sachs	21/9/2022	(5,559)
SEK	5,288,538	USD	500,000	Barclays	21/9/2022	(3,901)
TRY	16,779,120	USD	926,000	Deutsche Bank	29/9/2022	(21,576)
USD	1,115,000	MXN	22,402,267	Goldman Sachs	14/9/2022	6,369

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	1,115,000	BRL	5,500,340	Goldman Sachs	14/9/2022	55,688
USD	1,312,242	JPY	170,681,368	Bank of America	14/9/2022	81,386
USD	6,497,944	MXN	132,651,000	Deutsche Bank	21/9/2022	(57,659)
USD	18,134,966	MXN	375,752,120	Citigroup	21/9/2022	(434,676)
USD	44,540,150	AUD	63,182,810	HSBC Bank	21/9/2022	1,224,109
USD	11,481,078	CNH	76,799,000	Barclays	14/9/2022	347,872
USD	6,368,424	KRW	8,000,000,000	UBS	21/9/2022	398,068
USD	43,036,114	IDR	629,596,824,347	JP Morgan	21/9/2022	660,796
USD	1,191,456	MXN	23,793,000	State Street	21/9/2022	15,608
USD	4,736,000	NOK	46,108,382	BNP Paribas	21/9/2022	104,199
USD	2,700,000	CHF	2,596,555	BNP Paribas	21/9/2022	44,562
USD	7,324,000	CAD	9,417,546	BNP Paribas	21/9/2022	154,001
USD	5,214,013	JPY	695,562,682	BNP Paribas	21/9/2022	195,141
USD	9,827,516	CNH	65,967,638	Royal Bank of Canada	21/9/2022	263,868
USD	6,436,000	CNH	43,206,091	Deutsche Bank	21/9/2022	172,203
USD	32,139,134	EUR	30,095,740	Royal Bank of Canada	21/9/2022	1,991,163
USD	5,914,994	AUD	8,648,793	Morgan Stanley	21/9/2022	(14,333)
USD	583,161	EUR	546,000	Commonwealth Bank of Australia	21/9/2022	36,214
USD	1,250,433,755	EUR	1,180,945,113	BNP Paribas	21/9/2022	67,439,078
USD	4,600,000	AUD	6,564,392	Goldman Sachs	21/9/2022	99,672
USD	231,505,140	GBP	186,921,496	HSBC Bank	21/9/2022	14,436,878
USD	1,000,000	CAD	1,279,107	State Street	21/9/2022	26,159
USD	1,400,000	CHF	1,373,372	State Street	21/9/2022	(4,517)
USD	8,885,000	CAD	11,428,747	Royal Bank of Canada	21/9/2022	183,782
USD	832,545	DKK	5,841,000	JP Morgan	21/9/2022	45,845
USD	5,375,000	NOK	52,877,219	Bank of America	21/9/2022	63,238
USD	500,000	SEK	4,985,930	Bank of America	21/9/2022	32,288
USD	5,844,125	CHF	5,649,527	Bank of America	21/9/2022	66,482
USD	5,347,000	CAD	6,927,292	Citigroup	21/9/2022	72,942
USD	8,737,952	AUD	12,566,576	JP Morgan	21/9/2022	122,723
USD	14,887,000	NOK	143,827,423	Deutsche Bank	21/9/2022	438,868
USD	6,965,000	JPY	934,795,932	Bank of America	21/9/2022	219,927
USD	1,872,000	BRL	9,629,381	Goldman Sachs	21/9/2022	20,817
USD	7,304,375	CHF	7,025,622	Citigroup	21/9/2022	119,432
USD	500,000	EUR	480,157	State Street	21/9/2022	19,010
USD	300,000	NZD	472,736	State Street	21/9/2022	10,396
USD	9,282,502	AUD	13,021,000	ANZ	21/9/2022	355,735
USD	9,154,681	JPY	1,227,725,371	Royal Bank of Canada	21/9/2022	295,961
USD	1,700,000	NZD	2,731,865	Royal Bank of Canada	21/9/2022	26,427
USD	3,000,000	CHF	2,938,832	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(5,477)
USD	31,133,679	EUR	30,712,475	Morgan Stanley	21/9/2022	367,899
USD	3,096,783	CAD	3,997,956	UBS	21/9/2022	52,960
USD	4,710,408	ZAR	76,614,000	JP Morgan	21/9/2022	227,656

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	13,081,014	GBP	11,011,000	State Street	21/9/2022	294,156
USD	8,337,124	MXN	175,230,000	RBS	21/9/2022	(322,730)
USD	3,900,000	SEK	40,074,445	BNP Paribas	21/9/2022	140,759
USD	1,000,000	NZD	1,606,106	Goldman Sachs	21/9/2022	16,080
USD	200,000	EUR	190,861	Goldman Sachs	21/9/2022	8,808
USD	28,194,818	GBP	23,575,381	Goldman Sachs	21/9/2022	817,191
USD	3,268,560	MXN	68,722,000	Morgan Stanley	21/9/2022	(127,677)
USD	6,892,295	ZAR	111,920,538	UBS	21/9/2022	343,727
USD	113,516,895	EUR	109,433,652	JP Morgan	21/9/2022	3,893,315
USD	5,465,000	SEK	55,363,601	Deutsche Bank	21/9/2022	271,539
USD	5,200,000	NOK	51,353,479	Morgan Stanley	21/9/2022	41,304
USD	8,991,137	AUD	12,968,699	Deutsche Bank	21/9/2022	100,226
USD	23,697,567	GBP	19,629,268	Deutsche Bank	21/9/2022	902,483
USD	33,964,510	EUR	33,376,289	Citigroup	21/9/2022	530,294
USD	1,800,000	AUD	2,604,775	Citigroup	21/9/2022	14,253
USD	8,107,000	JPY	1,087,025,568	Citigroup	21/9/2022	263,507
USD	11,233,000	JPY	1,489,775,634	HSBC Bank	21/9/2022	483,440
USD	2,995,000	JPY	398,572,491	Goldman Sachs	21/9/2022	119,078
USD	1,734,000	BRL	8,987,322	Barclays	21/9/2022	6,248
USD	9,951,000	SEK	102,232,945	Citigroup	21/9/2022	360,893
USD	9,996,000	NOK	98,987,567	JP Morgan	21/9/2022	52,239
USD	16,508,041	NZD	26,574,677	Barclays	21/9/2022	228,073
USD	814,985	MXN	17,174,000	JP Morgan	21/9/2022	(33,753)
USD	3,300,000	NZD	5,244,347	HSBC Bank	21/9/2022	87,248
USD	6,836,402	EUR	6,607,354	HSBC Bank	21/9/2022	217,582
USD	224,627	HKD	1,759,000	HSBC Bank	21/9/2022	414
USD	6,386,000	CAD	8,243,806	HSBC Bank	21/9/2022	109,621
USD	8,690,000	CHF	8,325,632	JP Morgan	21/9/2022	175,565
USD	111,544,368	EUR	108,282,353	Bank of America	21/9/2022	3,074,091
USD	7,368,000	CHF	6,990,641	Morgan Stanley	21/9/2022	218,830
USD	16,067,310	NZD	25,642,057	Citigroup	21/9/2022	358,677
USD	400,000	NOK	3,916,071	Citigroup	21/9/2022	6,612
USD	11,410,695	CNH	76,799,000	HSBC Bank	21/9/2022	276,772
USD	6,364,000	TRY	124,543,480	Goldman Sachs	29/9/2022	(349,106)
USD	11,744,500	CHF	11,293,306	Deutsche Bank	21/9/2022	195,094
USD	3,404,496	NZD	5,413,288	Deutsche Bank	21/9/2022	88,251
USD	26,289,835	EUR	25,805,345	Deutsche Bank	21/9/2022	439,703
USD	2,070,000	NOK	20,429,037	UBS	21/9/2022	17,808
USD	13,816,807	JPY	1,857,459,890	JP Morgan	21/9/2022	414,202
USD	9,350,969	JPY	1,258,632,189	Deutsche Bank	21/9/2022	269,238
USD	17,710,737	GBP	14,663,754	JP Morgan	21/9/2022	682,008
USD	7,000,000	CHF	6,688,649	HSBC Bank	21/9/2022	159,670
USD	46,332,072	EUR	45,494,610	Barclays	21/9/2022	758,505
USD	22,785,311	EUR	21,579,000	RBS	21/9/2022	1,168,860
USD	14,442,881	GBP	11,906,257	Morgan Stanley	21/9/2022	616,380
USD	1,800,000	SEK	18,286,740	HSBC Bank	21/9/2022	84,586

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	8,586,330	CAD	11,083,402	JP Morgan	21/9/2022	148,038
USD	10,881,323	NZD	17,506,647	JP Morgan	21/9/2022	156,539
USD	5,400,000	NOK	53,665,885	HSBC Bank	21/9/2022	9,014
USD	5,480,275	EUR	5,254,602	Standard Chartered Bank	21/9/2022	216,554
USD	900,000	CAD	1,173,004	Standard Chartered Bank	21/9/2022	6,939
USD	400,000	GBP	333,035	Standard Chartered Bank	21/9/2022	13,252
USD	100,000	GBP	83,674	Commonwealth Bank of Australia	21/9/2022	2,831
USD	5,734,000	CAD	7,429,178	Morgan Stanley	21/9/2022	77,834
USD	1,200,000	NOK	11,937,939	Goldman Sachs	21/9/2022	779
USD	1,601,815	GBP	1,313,700	Bank of America	21/9/2022	76,240
USD	900,000	CAD	1,176,621	Bank of America	21/9/2022	4,185
USD	2,687,255	NZD	4,257,063	Bank of America	21/9/2022	79,326
USD	2,086,000	BRL	11,391,229	Morgan Stanley	21/9/2022	(103,887)
USD	800,000	JPY	108,325,840	State Street	21/9/2022	18,369
USD	6,215,000	SEK	65,187,376	JP Morgan	21/9/2022	100,006
USD	2,800,000	CAD	3,626,509	Deutsche Bank	21/9/2022	38,976
USD	1,100,000	JPY	150,189,183	Morgan Stanley	21/9/2022	16,301
USD	1,900,000	SEK	19,621,322	Morgan Stanley	21/9/2022	59,393
USD	5,446,782	AUD	7,959,044	BNP Paribas	21/9/2022	(9,676)
USD	9,444,338	IDR	142,909,734,697	Bank of America	14/12/2022	(141,396)
USD	11,218,940	IDR	170,610,637,569	Goldman Sachs	14/12/2022	(224,846)
USD	13,747,697	EUR	13,660,000	UBS	21/9/2022	63,990
USD	37,512,530	NZD	60,362,137	Morgan Stanley	21/9/2022	533,956
USD	12,435,554	GBP	10,270,847	Citigroup	21/9/2022	508,221
USD	7,535,109	IDR	114,209,627,734	Citigroup	14/12/2022	(125,553)
USD	5,566,787	IDR	84,810,000,000	BNP Paribas	14/12/2022	(121,882)
USD	2,169,000	BRL	12,078,077	Citigroup	14/9/2022	(157,121)
USD	3,325,000	BRL	18,550,175	Citigroup	21/9/2022	(241,146)
USD	4,923,397	GBP	4,138,167	BNP Paribas	21/9/2022	117,824
USD	28,126,842	CNH	190,662,816	JP Morgan	21/9/2022	485,529
USD	6,317,967	CNH	42,760,000	Goldman Sachs	14/9/2022	119,241
USD	1,710,000	BRL	9,386,216	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(94,437)
USD	3,659,984	NZD	5,866,551	BNP Paribas	21/9/2022	66,065
USD	300,000	SEK	3,063,738	RBS	21/9/2022	12,602
USD	1,600,000	CHF	1,545,856	UBS	21/9/2022	19,088
USD	5,179,000	ZAR	86,003,868	HSBC Bank	21/9/2022	146,838
USD	1,200,000	BRL	6,585,342	BNP Paribas	21/9/2022	(65,987)
USD	5,462,000	BRL	29,121,176	Citigroup	2/9/2022	(163,780)
USD	18,000	BRL	96,298	Morgan Stanley	2/9/2022	(604)
USD	200,000	SEK	2,037,728	Barclays	21/9/2022	8,848
USD	2,586,000	JPY	351,670,140	Nomura	21/9/2022	48,505
USD	5,587,756	EUR	5,500,000	JP Morgan	14/9/2022	80,855
USD	700,000	SEK	7,120,828	Goldman Sachs	21/9/2022	32,021
USD	900,000	CAD	1,153,505	Goldman Sachs	21/9/2022	21,785

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	600,000	AUD	851,715	Standard Chartered Bank	21/9/2022	16,092
USD	5,500,000	BRL	28,979,667	JP Morgan	2/9/2022	(98,443)
USD	300,000	JPY	39,152,037	Barclays	21/9/2022	17,496
USD	3,218,000	CNH	21,779,366	Bank of America	21/9/2022	60,540
USD	2,562,500	CNH	17,305,367	Goldman Sachs	21/9/2022	53,657
USD	6,927,390	EUR	6,750,000	Société Générale	21/9/2022	165,675
USD	1,800,000	NOK	17,476,105	Royal Bank of Canada	21/9/2022	44,445
USD	7,341,000	BRL	37,660,919	BNP Paribas	2/9/2022	65,466
USD	2,582,384	MXN	52,643,000	Goldman Sachs	13/9/2022	(23,291)
USD	2,764,802	EUR	2,669,000	BNP Paribas	19/9/2022	91,537
USD	6,346,000	COP	26,852,583,100	Citigroup	19/9/2022	301,524
USD	23,042,680	EUR	22,566,000	Standard Chartered Bank	19/9/2022	440,616
USD	1,255,500	GBP	1,050,601	Barclays	21/9/2022	35,458
USD	5,448,000	MXN	110,145,148	Deutsche Bank	19/9/2022	2,510
USD	3,696,000	CLP	3,322,704,000	Citigroup	22/9/2022	16,072
USD	1,884,554	EUR	1,841,000	Morgan Stanley	23/11/2022	32,383
USD	2,930,742	MXN	59,806,290	HSBC Bank	23/11/2022	11,432
USD	20,604,705	MXN	415,034,000	BNY Mellon	13/9/2022	61,730
USD	7,588,610	COP	33,253,290,000	JP Morgan	23/11/2022	194,259
USD	5,548,390	AUD	7,978,000	JP Morgan	19/9/2022	79,118
USD	5,450,000	KRW	7,206,535,000	Citigroup	19/9/2022	70,782
USD	800,000	AUD	1,159,834	Royal Bank of Canada	21/9/2022	4,856
USD	1,756,000	ZAR	30,043,994	Citigroup	21/9/2022	(1,901)
USD	1,756,000	ZAR	29,855,863	BNP Paribas	21/9/2022	9,107
USD	7,341,000	BRL	37,792,570	HSBC Bank	4/10/2022	99,829
USD	22,705,397	AUD	32,850,000	Barclays	21/9/2022	184,525
USD	1,830,000	BRL	9,317,116	JP Morgan	4/10/2022	44,812
USD	8,094,000	EUR	8,102,646	HSBC Bank	9/9/2022	(16,031)
USD	8,094,000	CAD	10,543,406	HSBC Bank	9/9/2022	66,047
USD	8,094,000	AUD	11,752,185	HSBC Bank	9/9/2022	38,683
USD	8,094,000	GBP	6,921,451	HSBC Bank	9/9/2022	58,136
ZAR	115,374,000	USD	7,140,633	UBS	21/9/2022	(389,999)
ZAR	35,162,960	USD	2,061,065	JP Morgan	21/9/2022	(3,649)
ZAR	103,217,166	USD	6,026,965	Bank of America	21/9/2022	12,363
ZAR	42,892,589	USD	2,576,500	Citigroup	21/9/2022	(66,817)
ZAR	43,115,521	USD	2,623,000	HSBC Bank	19/9/2022	(99,793)
ZAR	61,782,336	USD	3,696,000	Bank of America	19/9/2022	(80,374)
ZAR	36,644,395	USD	2,168,750	Goldman Sachs	21/9/2022	(24,654)
未実現純評価益						83,649,286
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	93,270,052	USD	65,089,200	BNY Mellon	15/9/2022	(1,152,411)
USD	94,806	AUD	135,501	BNY Mellon	15/9/2022	1,919
未実現純評価損						(1,150,492)

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
ヘッジを使用したカナダ・ドル建投資証券クラス						
CAD	1,614,132,156	USD	1,251,201,870	BNY Mellon	15/9/2022	(22,232,886)
USD	10,300,848	CAD	13,300,000	BNY Mellon	15/9/2022	174,485
未実現純評価損						(22,058,401)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	209,867,835	USD	219,805,435	BNY Mellon	15/9/2022	(5,279,467)
USD	2,073,900	CHF	1,989,101	BNY Mellon	15/9/2022	40,658
未実現純評価損						(5,238,809)
ヘッジを使用したオフショア中国人民元建投資証券クラス						
CNY	27,954	USD	4,137	BNY Mellon	15/9/2022	(84)
USD	20	CNY	141	BNY Mellon	15/9/2022	-
未実現純評価損						(84)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	1,235,405,270	USD	1,262,260,526	BNY Mellon	15/9/2022	(25,197,795)
USD	17,154,398	EUR	17,156,807	BNY Mellon	15/9/2022	(25,093)
未実現純評価損						(25,222,888)
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	1,029,375,761	USD	1,247,148,446	BNY Mellon	15/9/2022	(51,881,442)
USD	26,965,640	GBP	22,574,587	BNY Mellon	15/9/2022	753,098
未実現純評価損						(51,128,344)
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	3,071,647	USD	391,701	BNY Mellon	15/9/2022	(224)
USD	2,545	HKD	19,966	BNY Mellon	15/9/2022	1
未実現純評価損						(223)
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	50,163,408,575	USD	373,014,168	BNY Mellon	15/9/2022	(11,222,922)
USD	2,379,517	JPY	326,838,339	BNY Mellon	15/9/2022	22,330
未実現純評価損						(11,200,592)
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	92,697,010	USD	20,002,609	BNY Mellon	15/9/2022	(425,742)
USD	204,654	PLN	963,798	BNY Mellon	15/9/2022	1,099
未実現純評価損						(424,643)
ヘッジを使用したスウェーデン・クローナ建投資証券クラス						
SEK	11,017,623	USD	1,085,031	BNY Mellon	15/9/2022	(51,786)
USD	5,926	SEK	63,249	BNY Mellon	15/9/2022	(5)
未実現純評価損						(51,791)

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	107,892,158	USD	78,287,629	BNY Mellon	15/9/2022	(1,069,647)
USD	1,467,018	SGD	2,037,097	BNY Mellon	15/9/2022	9,076
未実現純評価損						(1,060,571)
未実現純評価損合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 9,564,769,949米ドル)						(33,887,552)

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 2022年8月31日現在

契約数	通貨	契約 / 摘要	満期日	基礎となるエクスポージャー (米ドル)	未実現評価益 / (損) (米ドル)
(720)	EUR	Euro BOBL	2022年9月	88,756,629	2,238,728
364	EUR	Euro Bund	2022年9月	53,975,328	(118,589)
(324)	EUR	Euro BUXL	2022年9月	53,859,038	1,599,472
(5,384)	EUR	Euro Schatz	2022年9月	585,277,530	2,240,625
(809)	EUR	Euro-BTP	2022年9月	97,138,019	4,943,035
(259)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2022年9月	279,012,040	(110,226)
765	AUD	Australian 10 Year Bond	2022年9月	62,942,782	497,142
(1,325)	AUD	Australian 3 Year Bond	2022年9月	97,798,368	(253,918)
(27)	EUR	Dax Index	2022年9月	8,736,913	41,877
(420)	EUR	EURO STOXX 50 Index	2022年9月	14,920,627	(312,805)
(1,161)	EUR	EURO STOXX Banks Index	2022年9月	4,616,964	(67,154)
10	GBP	FTSE 100 Index	2022年9月	847,943	15,851
28	EUR	FTSE MIB Market Index	2022年9月	3,045,612	(7,703)
151	USD	MSCI Emerging Markets Index	2022年9月	7,469,215	(107,175)
20	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	2022年9月	4,982,300	(190,525)
(452)	USD	Russell 2000 E-Mini Index	2022年9月	41,925,260	(3,072,521)
25	USD	S&P 500 E-Mini Index	2022年9月	5,000,937	(24,635)
280	KRW	Korean 10 Year Bond	2022年9月	23,127,658	(680,273)
(181)	EUR	3 Month EURIBOR	2022年12月	44,441,067	9,054
(774)	USD	US Long Bond (CBT)	2022年12月	105,481,687	713,771
2,667	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2022年12月	312,330,703	(2,001,396)
(7,154)	USD	US Ultra 10 Year Note	2022年12月	897,491,656	1,038,553
(539)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2022年12月	81,203,719	(320,675)
(299)	GBP	Long Gilt	2022年12月	37,586,825	664,785
6,432	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2022年12月	1,340,217,740	(1,660,437)
(11,968)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2022年12月	1,327,232,494	4,294,722
28	USD	30 Day Federal Funds	2023年1月	11,232,399	(21,939)
(2,224)	EUR	3 Month EURIBOR	2023年3月	543,640,756	2,290,100
582	USD	3 Month SOFR	2023年3月	140,058,300	(302,663)
465	GBP	3 Month SONIA	2023年3月	130,009,686	(630,384)
44	USD	3 Month SOFR	2023年6月	10,576,500	(10,563)
(125)	USD	3 Month SOFR	2023年9月	30,060,937	55,776
4	GBP	3 Month SONIA	2023年9月	1,110,585	232
(1,954)	USD	3 Month SOFR	2024年6月	472,501,625	952,575
2,043	EUR	3 Month EURIBOR	2025年3月	499,958,679	(508,933)
合計				7,418,568,521	11,193,784

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 2022年8月31日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (6,274,819)	ファンドはITRAXX.X0.34.V2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	Bank of America	20/12/2025	(843,172)	10,505
CDS	USD 5,940,000	ファンドはCDX.NA.HY.35.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2025	288,232	(51,120)
CDS	EUR (10,000)	ファンドはADLER Real Estate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	Bank of America	20/12/2026	(3,149)	(2,906)
CDS	USD 3,045,000	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	Bank of America	20/6/2027	16,649	203,628
CDS	USD 3,045,000	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	Bank of America	20/6/2027	14,836	203,628
CDS	USD 1,827,000	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	Bank of America	20/6/2027	7,089	122,177
CDS	USD 3,395,000	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	Bank of America	20/6/2027	14,520	227,034
CDS	USD 158,927,000	ファンドはCDX.NA.IG.38.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	20/6/2027	645,007	(622,815)
CDS	EUR 26,382,000	ファンドはITRAXX.FINSR.37.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	20/6/2027	(80,038)	325,014
CDS	USD 856,000	ファンドはBeazer Homes USA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	20/6/2024	28,762	8,190
CDS	USD 515,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	11,038	71,572
CDS	USD 215,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	3,890	29,880
CDS	USD 500,000	ファンドはTenet Healthcare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	20/6/2024	(21,527)	(23,599)
CDS	USD 3,044,000	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	20/12/2024	81	35,741
CDS	USD 3,045,000	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	20/12/2024	82	35,753
CDS	USD 3,040,000	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	20/12/2024	82	35,694

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 3,044,000	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	20/12/2024	755	35,741
CDS	USD 4,260,000	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	20/12/2024	1,057	50,019
CDS	USD 1,844,000	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	20/12/2024	457	21,651
CDS	USD 2,740,000	ファンドはOccidental Petroleumに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	(673,952)	(11,003)
CDS	USD (525,000)	ファンドはSprint Communications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	20/6/2025	(32,847)	56,710
CDS	USD (510,000)	ファンドはSprint Communications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	20/6/2025	(41,253)	55,090
CDS	USD (725,000)	ファンドはSprint Communications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	20/6/2025	(52,322)	78,314
CDS	USD (256,667)	ファンドはSprint Communications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	20/6/2025	(19,318)	27,725
CDS	EUR (70,977)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2027	(4,190)	(1,908)
CDS	EUR (26,683)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2027	(1,575)	(717)
CDS	EUR (900,000)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2027	(44,333)	(24,195)
CDS	USD 48,084,998	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	20/6/2027	517,065	3,215,585
CDS	USD 750,000	ファンドはBeazer Homes USA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	20/6/2024	23,074	7,175
CDS	USD 500,000	ファンドはBeazer Homes USA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	20/6/2024	16,225	4,784
CDS	USD 500,000	ファンドはXeroxに係るデフォルト・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	(7,283)	9,907

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 1,250,000	ファンドはBoeingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	23,322	11,850
CDS	USD (818,182)	ファンドはCCO Holdings / CCO Holdings Capital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	BNP Paribas	20/12/2025	(88,989)	59,770
CDS	USD (490,909)	ファンドはCCO Holdings / CCO Holdings Capital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	BNP Paribas	20/12/2025	(53,136)	35,862
CDS	EUR (650,000)	ファンドはVirgin Media Finance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	BNP Paribas	20/12/2025	(69,710)	18,015
CDS	USD (1,750,000)	ファンドはAT&T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	20/6/2027	(8,230)	(19,106)
CDS	EUR (1,400,000)	ファンドはSaipem Finance International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	BNP Paribas	20/6/2027	(156,126)	(211,100)
CDS	USD 750,000	ファンドはBorgwarnerに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2027	(4,842)	5,859
CDS	USD 441,176	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2027	(2,728)	3,593
CDS	USD 308,824	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2027	(1,898)	2,515
CDS	EUR 3,600,000	ファンドはUniCreditに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2027	18,762	417,092
CDS	USD 390,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	23,229	54,200
CDS	USD 750,000	ファンドはStaples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	20/6/2024	87,570	91,935
CDS	USD 215,000	ファンドはAlly Financial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	20/6/2025	(4,470)	(17,388)
CDS	USD 325,000	ファンドはAlly Financial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	20/6/2025	(6,760)	(26,284)
CDS	EUR (130,000)	ファンドはADLER Real Estate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	(40,939)	(37,776)
CDS	USD 1,000,000	ファンドはSouthwest Airlinesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2026	4,835	8,131
CDS	EUR 1,006,313	ファンドはBayerische Motoren Werkeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2027	15,428	6,517

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 503,105	ファンドはBayerische Motoren Werkeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2027	7,713	3,258
CDS	EUR 1,050,582	ファンドはBayerische Motoren Werkeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2027	9,776	6,804
CDS	EUR 3,340,000	ファンドはBayerische Motoren Werkeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2027	37,431	21,632
CDS	USD 2,990,000	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	Citibank	20/6/2027	(19,429)	199,950
CDS	USD 2,980,000	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	Citibank	20/6/2027	(18,191)	199,281
CDS	USD 3,806,000	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	Citibank	20/6/2027	(22,484)	254,518
CDS	USD 250,000	ファンドはFord Motor Credit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	20/6/2027	(6,794)	(18,367)
CDS	USD 650,000	ファンドはFord Motor Credit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	20/6/2027	(31,638)	(47,754)
CDS	EUR 3,340,000	ファンドはMercedes-Benzに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2027	33,446	35,425
CDS	USD (2,261,000)	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	Citigroup	17/9/2058	(354,707)	(365,894)
CDS	USD 1,440,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Citigroup	17/9/2058	186,328	233,033
CDS	USD 24,464,000	ファンドはCDX.NA.HY.33.V12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	20/12/2024	834,146	(468,913)
CDS	EUR (110,000)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2026	(5,843)	(52)
CDS	EUR (2,260,000)	ファンドはAltice France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	20/12/2026	(320,364)	(144,026)
CDS	EUR (290,000)	ファンドはAltice France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	20/12/2026	(41,109)	(18,481)
CDS	EUR (244,777)	ファンドはIntrum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	20/12/2026	(30,982)	(11,124)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (155,223)	ファンドはIntrum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	20/12/2026	(19,743)	(7,054)
CDS	EUR (2,680,000)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2027	(197,495)	(72,046)
CDS	EUR (147,145)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2027	(8,968)	(3,956)
CDS	EUR (391,407)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2027	(23,855)	(10,522)
CDS	EUR (425,714)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2027	5,820	(11,444)
CDS	EUR (638,572)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2027	8,171	(17,167)
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	45,140	(9,355)
CDS	USD 3,537,032	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	(42,067)	(3,935)
CDS	USD (491,207)	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	(63,444)	(105,181)
CDS	EUR 1,006,000	ファンドはAnheuser Busch Inbevに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2027	972	(8,061)
CDS	USD (98,000)	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	(5,085)	(15,859)
CDS	USD 2,841,548	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	(34,233)	(3,161)
CDS	USD 241,520	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	(97)	(54)
CDS	USD 565,361	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	53	(127)
CDS	EUR (402,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon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	(31,112)	(73,123)
CDS	EUR (95,541)	ファンドはNovafives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	(3,026)	(10,118)
CDS	EUR (54,459)	ファンドはNovafives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	(1,438)	(5,767)
CDS	USD 210,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	3,777	29,185

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 250,000	ファンドはStaples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	20/6/2024	8,206	30,645
CDS	USD 825,000	ファンドはTenet Healthcare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	20/6/2024	(29,300)	(39,979)
CDS	USD 800,000	ファンドはTenet Healthcare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	20/6/2024	(28,412)	(38,767)
CDS	USD 875,000	ファンドはTenet Healthcare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	20/6/2024	(31,151)	(42,402)
CDS	USD 894,000	ファンドはTenet Healthcare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	20/6/2024	(37,691)	(42,195)
CDS	USD 165,000	ファンドはMacysに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(11,411)	11,085
CDS	USD 250,000	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(16,740)	(1,592)
CDS	USD 290,000	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(15,203)	(1,847)
CDS	USD 665,000	ファンドはSouthwest Airlinesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(13,792)	(1,637)
CDS	USD 665,000	ファンドはSouthwest Airlinesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(12,949)	(1,637)
CDS	USD 1,040,000	ファンドはSouthwest Airlinesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(37,330)	(2,560)
CDS	EUR (90,000)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2026	(8,309)	(42)
CDS	EUR (401,312)	ファンドはTK Elevator Holdco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	20/12/2026	(7,922)	(1,372)
CDS	USD 3,525,000	ファンドはCaterpillarに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2026	18,549	(70,706)
CDS	USD (291,773,229)	ファンドはCDX.NA.HY.38.V2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	20/6/2027	(4,799,431)	(2,990,736)
CDS	EUR (425,714)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2027	4,165	(11,444)
CDS	EUR 8,620,000	ファンドはITRAXX.EUR.37.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	20/6/2027	58,909	69,299
CDS	EUR 5,010,000	ファンドはBayerische Motoren Werkeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	49,074	32,448

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 2,950,000	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	20/6/2027	(37,767)	197,275
CDS	USD 2,940,000	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	20/6/2027	(39,929)	196,606
CDS	USD 3,886,000	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	20/6/2027	(52,777)	259,868
CDS	USD 2,000,000	ファンドはCaterpillarに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	7,751	(40,116)
CDS	USD 6,078,440	ファンドはChile Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	164,889	132,640
CDS	USD 5,144,000	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	Goldman Sachs	20/6/2027	105,294	368,861
CDS	USD 15,591,000	ファンドはIndonesia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	(61,705)	114,995
CDS	EUR 30,046,188	ファンドはITRAXX.X0.37.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	430,876	913,265
CDS	EUR 5,790,000	ファンドはLloyds Bankingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	112,878	15,480
CDS	USD 150,000	ファンドはMacysに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	(2,909)	23,189
CDS	USD 550,000	ファンドはParamount Globalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	(3,472)	14,212
CDS	USD 22,900,795	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	Goldman Sachs	20/6/2027	(58,262)	56,369
CDS	USD 2,605,200	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	50,982	198,134
CDS	USD 1,736,800	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	39,603	132,090
CDS	USD 1,420,000	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	13,286	11,564

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 1,350,000	ファンドはSouthwest Airlinesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	(3,536)	17,559
CDS	USD 3,462,000	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	20/6/2027	60,850	831,259
CDS	USD 1,731,000	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	20/6/2027	59,876	415,630
CDS	USD 865,500	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	20/6/2027	28,764	207,815
CDS	USD 865,500	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	20/6/2027	28,764	207,815
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	(27,276)	9,355
CDS	USD (1,003,333)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(15,625)	(34,720)
CDS	USD (948,150)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(14,726)	(32,811)
CDS	USD (1,003,333)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(17,739)	(34,720)
CDS	USD (1,841,000)	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	(74,839)	(297,926)
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	(11,009)	(35,602)
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	(65,179)	(182,704)
CDS	USD (2,250,000)	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	(351,852)	(364,114)
CDS	USD (660,000)	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	(33,513)	(106,807)
CDS	EUR (660,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon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	(54,661)	(120,052)
CDS	EUR (268,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon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	(25,497)	(48,748)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (480,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon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	(9,035)	(87,311)
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	(22,649)	(58,469)
CDS	USD 822,410	ファンドはRealogy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	10,429	8,441
CDS	USD 820,000	ファンドはRR Donnelley & Sons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	(39,808)	(28,791)
CDS	USD 250,000	ファンドはTenet Healthcare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	20/6/2024	(10,894)	(12,115)
CDS	USD 290,000	ファンドはAvis Budget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	20/12/2024	(23,460)	(12,148)
CDS	USD 1,110,000	ファンドはAvis Budget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	20/12/2024	(85,980)	(42,686)
CDS	EUR (1,130,000)	ファンドはVirgin Media Finance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	20/6/2025	(129,773)	39,159
CDS	USD 1,380,000	ファンドはAvis Budget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	20/6/2025	(145,597)	(49,005)
CDS	USD (850,000)	ファンドはCCO Holdings / CCO Holdings Capital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	20/12/2025	(94,936)	62,095
CDS	USD (490,909)	ファンドはCCO Holdings / CCO Holdings Capital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	20/12/2025	(54,296)	35,862
CDS	EUR (1,300,000)	ファンドはVirgin Media Finance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	20/12/2025	(126,517)	36,031
CDS	EUR (300,000)	ファンドはVirgin Media Finance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	20/12/2025	(31,058)	8,315
CDS	EUR (20,000)	ファンドはVirgin Media Finance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	20/12/2025	(2,071)	554
CDS	EUR (1,340,000)	ファンドはVirgin Media Finance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	20/12/2025	(138,725)	37,139
CDS	EUR (260,000)	ファンドはADLER Real Estate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	20/6/2026	(100,487)	(74,415)
CDS	EUR (260,000)	ファンドはADLER Real Estate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	20/6/2026	(103,559)	(74,415)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (393,314)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2027	(25,107)	(10,573)
CDS	EUR (147,863)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2027	(9,439)	(3,975)
CDS	EUR (369,715)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2027	(23,601)	(9,939)
CDS	EUR (138,990)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2027	(8,873)	(3,736)
CDS	EUR (104,587)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2027	(6,663)	(2,812)
CDS	EUR (39,319)	ファンドはCMA CGM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	20/6/2027	(2,505)	(1,057)
CDS	EUR (1,070,000)	ファンドはLadbrokes Coral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	20/6/2027	(24,542)	(156,729)
CDS	EUR (1,300,000)	ファンドはNovafives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	20/6/2027	(82,253)	(375,883)
CDS	USD 840,000	ファンドはCaterpillarに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2027	2,524	(16,849)
CDS	USD 500,000	ファンドはFord Motor Credit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	20/6/2027	11,034	(36,734)
CDS	USD 425,000	ファンドはFord Motor Credit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	20/6/2027	5,584	(31,224)
CDS	USD 250,000	ファンドはFord Motor Credit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	20/6/2027	(4,241)	(18,367)
CDS	USD 500,000	ファンドはGeneral Motors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	20/6/2027	(9,371)	(62,653)
CDS	EUR 5,010,000	ファンドはMercedes-Benzに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2027	44,447	53,138
CDS	USD 75,000	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2027	570	611
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	(26,465)	(82,047)
CDS	USD (400,000)	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	25,870	(64,731)
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	(2,193)	(5,357)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 491,207	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	61,393	105,181
CDS	EUR (17,800,000)	ファンドはEDP - Energias de Portugal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	20/3/2023	47,086	34,347
CDS	EUR (7,875,000)	ファンドはEDP - Energias de Portugal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	11,858	274,259
CDS	EUR (4,800,000)	ファンドはEDP - Energias de Portugal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	7,228	167,167
CDS	EUR (7,875,000)	ファンドはNaturgy Energy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	41,503	13,241
CDS	EUR (4,800,000)	ファンドはNaturgy Energy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	25,297	8,071
CDS	USD 250,000	ファンドはStaples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	14,640	19,283
CDS	USD 3,445,000	ファンドはBoeingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	51,246	32,658
CDS	USD 811,501	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	Morgan Stanley	20/6/2025	(42,932)	14,848
CDS	USD 1,250,000	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2025	(66,858)	(7,962)
CDS	EUR (290,000)	ファンドはADLER Real Estate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	20/12/2025	(130,367)	(82,059)
CDS	USD (282,209)	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	Morgan Stanley	20/6/2026	(1,938)	(3,826)
CDS	EUR (2,700,000)	ファンドはADLER Real Estate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	20/12/2026	(844,866)	(784,586)
CDS	USD (1,750,000)	ファンドはVerizon Communications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	20/6/2027	(12,916)	(16,847)
CDS	EUR 4,440,000	ファンドはBritish American Tobaccoに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2027	73,031	55,219

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 19,921,000	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	20/6/2027	422,626	538,806
CDS	EUR 680,851	ファンドはNaturgy Energyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2027	7,765	6,537
CDS	EUR 1,117,021	ファンドはNaturgy Energyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2027	12,740	10,725
CDS	USD (2,006,667)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(35,923)	(69,440)
CDS	USD (700,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(113,907)	(113,280)
CDS	USD (9,149,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(1,439,784)	(1,480,569)
CDS	USD (6,630,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(1,051,146)	(1,072,923)
CDS	USD (2,250,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(352,231)	(364,114)
CDS	USD (500,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	51,709	(80,914)
CDS	USD (4,520,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(241,228)	(731,465)
CDS	USD (3,616,400)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(196,340)	(585,237)
CDS	USD (4,520,500)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(229,943)	(731,546)
CDS	USD (4,520,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(225,947)	(731,465)
CDS	USD (4,520,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(226,222)	(731,465)
CDS	USD 1,987,097	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	(23,631)	(2,210)
CDS	USD 3,606,580	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	(42,895)	(4,012)
CDS	USD 3,994,064	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	(52,160)	(4,443)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 646,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	70,201	104,541
CDS	USD 507,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	55,097	82,047
IFS	EUR 12,883,000	ファンドはCPTFEMU + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、7.67%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/8/2023	(18,237)	(19,034)
IFS	USD 12,883,000	ファンドはUSCPIU + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3.24%の固定金利を支払う	Bank of America	20/8/2023	2,010	2,010
IFS	USD 1,850,000	ファンドはUSCPIU + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、2.951%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2027	14,824	14,824
IFS	USD 9,240,000	ファンドはUSCPIU + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、2.8675%の固定金利を支払う	Bank of America	13/8/2027	104,324	104,324
IFS	GBP 1,645,000	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、3.85%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/7/2031	(343,168)	(343,168)
IFS	EUR 6,680,000	ファンドはCPTFEMU + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2.693%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/8/2032	29,758	29,758
IFS	EUR 2,195,000	ファンドはCPTFEMU + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、2.731%の固定金利を支払う	Bank of America	16/8/2032	17,750	18,395
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	Bank of America	15/3/2048	(387,028)	(387,028)
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、3.525%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	15/11/2046	(584,856)	(584,856)
IRS	USD 469,854,799	ファンドは1.079%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2021	(17,880,174)	(17,880,174)
IRS	USD 4,020,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.0955%の固定金利を支払う	Bank of America	19/9/2022	111,856	111,856
IRS	MXN 393,224,917	ファンドは4.415%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月MXIBTIIIEの変動金利を支払う	Bank of America	28/2/2023	(504,999)	(504,999)
IRS	MXN 393,224,917	ファンドは4.495%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月MXIBTIIIEの変動金利を支払う	Bank of America	3/3/2023	(506,323)	(506,323)
IRS CLP	19,211,685,000	ファンドはCLP 6ヶ月Sinacofi Chile Interbank Rateの変動金利を受け取り、1.42%の固定金利を支払う	Bank of America	1/4/2023	1,828,213	1,828,213
IRS CLP	19,211,685,000	ファンドは1.65%の固定金利を受け取り、CLP 6ヶ月Sinacofi Chile Interbank Rateの変動金利を支払う	Bank of America	28/5/2023	(1,859,889)	(1,859,889)
IRS	USD 194,737,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.5005%の固定金利を支払う	Bank of America	12/7/2023	1,814,555	3,439,416

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	MXN 279,585,258	ファンドは4.68%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	27/2/2024	(983,774)	(983,774)
IRS	MXN 278,683,371	ファンドは4.855%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	1/3/2024	(950,914)	(950,914)
IRS	USD 232,932,853	ファンドは1.1285%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	7/3/2024	(8,553,527)	(8,553,527)
IRS	USD 349,576,239	ファンドは1.12925%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	8/3/2024	(12,851,796)	(12,851,796)
IRS	USD 354,810,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.398%の固定金利を支払う	Bank of America	8/3/2024	18,397,534	18,397,534
IRS	USD 104,313,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.447%の固定金利を支払う	Bank of America	19/3/2024	5,405,303	5,405,303
IRS	PLN 66,743,500	ファンドはPLN 3ヶ月WIBORの変動金利を受け取り、6.15%の固定金利を支払う	Bank of America	11/4/2024	184,356	184,356
IRS	EUR 43,791,200	ファンドはEUR 1日EURIBORの変動金利を受け取り、1.447%の固定金利を支払う	Bank of America	11/5/2024	345,339	346,609
IRS	USD 87,929,483	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.525%の固定金利を支払う	Bank of America	6/6/2024	4,922,410	4,922,410
IRS	USD 79,318,511	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.5705%の固定金利を支払う	Bank of America	28/6/2024	4,466,672	4,466,672
IRS	EUR 142,220,900	ファンドはEUR 1日EURIBORの変動金利を受け取り、1.545%の固定金利を支払う	Bank of America	6/7/2024	945,955	966,881
IRS	USD 73,770,363	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.51%の固定金利を支払う	Bank of America	13/7/2024	4,313,855	4,313,855
IRS	USD 109,280,260	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.5425%の固定金利を支払う	Bank of America	16/7/2024	6,367,337	6,367,337
IRS	MXN 478,108,000	ファンドはMXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を受け取り、9.51%の固定金利を支払う	Bank of America	18/7/2024	(51,818)	(51,818)
IRS	USD 72,845,435	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.5465%の固定金利を支払う	Bank of America	20/7/2024	4,263,974	4,263,974
IRS	USD 36,422,718	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.548%の固定金利を支払う	Bank of America	20/7/2024	2,130,997	2,130,997
IRS	USD 145,204,848	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.487%の固定金利を支払う	Bank of America	23/7/2024	8,676,648	8,676,648
IRS	GBP 98,060,000	ファンドは2.5975%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	4/8/2024	(1,698,703)	(1,698,703)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	PLN 86,542,000	ファンドはPLN 3ヶ月WIBORの変動金利を受け取り、6.3%の固定金利を支払う	Bank of America	4/8/2024	182,409	182,409
IRS	GBP 98,290,000	ファンドは2.83697%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	10/8/2024	(1,441,276)	(1,441,276)
IRS	USD 11,574,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.9395%の固定金利を支払う	Bank of America	12/8/2024	346,504	346,504
IRS	USD 110,244,063	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.5555%の固定金利を支払う	Bank of America	12/8/2024	6,615,022	6,615,022
IRS	USD 71,761,051	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.566%の固定金利を支払う	Bank of America	13/8/2024	4,294,086	4,294,086
IRS	GBP 19,870,000	ファンドは3.76%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	24/8/2024	(72,814)	(72,664)
IRS	USD 73,323,670	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.565%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2024	4,476,416	4,476,416
IRS	USD 36,295,220	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.5665%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2024	2,214,788	2,214,788
IRS	USD 36,845,135	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.56886%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2024	2,246,687	2,246,687
IRS	USD 36,845,140	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.5704%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2024	2,245,606	2,245,606
IRS	USD 32,570,000	ファンドは3.25%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	30/9/2024	(57,978)	(169,540)
IRS	USD 19,990,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.216%の固定金利を支払う	Bank of America	8/11/2024	122,775	122,775
IRS	USD 11,945,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.059%の固定金利を支払う	Bank of America	18/1/2025	93,008	93,008
IRS	USD 11,940,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.0945%の固定金利を支払う	Bank of America	7/2/2025	79,586	79,586
IRS	USD 65,616,484	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2%の固定金利を支払う	Bank of America	17/2/2025	1,785,384	1,785,384
IRS	USD 2,868,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.125%の固定金利を支払う	Bank of America	21/2/2025	16,504	16,504
IRS	USD 6,100,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.243%の固定金利を支払う	Bank of America	22/2/2025	21,216	21,216
IRS	USD 3,000,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.4685%の固定金利を支払う	Bank of America	2/3/2025	(2,935)	(2,935)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 13,480,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、2.862%の固定金利を支払う	Bank of America	18/4/2025	124,883	124,883
IRS	USD 6,810,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、2.9765%の固定金利を支払う	Bank of America	21/4/2025	47,770	47,770
IRS	USD 10,000,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、3.065%の固定金利を支払う	Bank of America	2/5/2025	50,520	50,520
IRS	USD 100,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、3.1245%の固定金利を支払う	Bank of America	2/5/2025	393	393
IRS	USD 3,037,500	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、3.224%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2025	4,275	4,275
IRS	USD 3,037,500	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、3.2385%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2025	3,445	3,445
IRS	USD 14,170,000	ファンドは0.098%の固定金利を受け取り、USD 1 日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	2/6/2025	(482,715)	(1,211,004)
IRS	USD 3,016,000	ファンドは2.4385%の固定金利を受け取り、USD 1 日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	10/7/2025	(45,105)	(45,105)
IRS	USD 12,065,000	ファンドは2.491%の固定金利を受け取り、USD 1 日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	10/7/2025	(168,565)	(168,565)
IRS	AUD 71,605,000	ファンドはAUD 3 ヶ月BBSWの変動金利を受け取り、3.69%の固定金利を支払う	Bank of America	22/7/2025	10,584	10,584
IRS	AUD 71,605,000	ファンドはAUD 3 ヶ月BBSWの変動金利を受け取り、3.71%の固定金利を支払う	Bank of America	22/7/2025	1,656	1,656
IRS	USD 3,740,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、3.085%の固定金利を支払う	Bank of America	28/8/2025	5,895	5,895
IRS	USD 35,300,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、3.1045%の固定金利を支払う	Bank of America	28/8/2025	42,808	42,808
IRS	CNY 109,515,000	ファンドは2.245%の固定金利を受け取り、CNY 3 ヶ月CNRRの変動金利を支払う	Bank of America	21/12/2025	405	405
IRS	CNY 109,515,000	ファンドは2.24%の固定金利を受け取り、CNY 3 ヶ月CNRRの変動金利を支払う	Bank of America	21/12/2025	(1,889)	(1,889)
IRS	EUR 46,840,000	ファンドはEUR 6 ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.85%の固定金利を支払う	Bank of America	12/2/2026	1,278,926	1,278,926
IRS	USD 13,050,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、1.245%の固定金利を支払う	Bank of America	25/2/2026	11,510	183,334
IRS	EUR 47,320,000	ファンドはEUR 6 ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.635%の固定金利を支払う	Bank of America	4/3/2026	1,492,878	1,492,878

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 10,620,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.42%の固定金利を支払う	Bank of America	6/3/2026	7,737	131,763
IRS	EUR 6,210,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.777%の固定金利を支払う	Bank of America	7/5/2026	57,065	57,065
IRS	USD 181,181,900	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.15%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2026	85,273	318,099
IRS	EUR 473,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.14993%の固定金利を支払う	Bank of America	11/6/2026	877	877
IRS	USD 6,240,000	ファンドは2.039%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	6/8/2026	(87,689)	(87,689)
IRS	USD 6,325,000	ファンドは2.2665%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	13/8/2026	(62,147)	(62,147)
IRS	USD 3,246,500	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、2.8885%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2026	64,587	64,587
IRS	EUR 3,010,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.11301%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2026	9,586	9,586
IRS	EUR 3,000,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.1677%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2026	6,487	6,487
IRS	USD 6,330,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.668%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2026	14,905	14,905
IRS	USD 1,362,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.807%の固定金利を支払う	Bank of America	3/9/2026	(352)	(352)
IRS	USD 1,362,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.8095%の固定金利を支払う	Bank of America	3/9/2026	(413)	(413)
IRS	USD 16,935,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.04%の固定金利を支払う	Bank of America	28/2/2027	56,656	43,109
IRS	USD 116,466,427	ファンドは1.549%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	7/3/2027	(7,631,636)	(7,631,636)
IRS	USD 3,833,000	ファンドは1.735%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	14/3/2027	(221,869)	(221,869)
IRS	EUR 31,140,000	ファンドは0.92799%の固定金利を受け取り、EUR 1日EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	7/4/2027	(260,612)	(304,358)
IRS	EUR 121,800,000	ファンドは0.94%の固定金利を受け取り、EUR 1日EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	7/4/2027	(1,162,986)	(1,176,893)
IRS	EUR 53,250,000	ファンドは1.37%の固定金利を受け取り、EUR 1日EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	23/4/2027	(304,930)	(302,674)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	EUR 81,690,000	ファンドは1.673%の固定金利を受け取り、EUR 1日EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	12/5/2027	(225,278)	(236,073)
IRS	USD 6,714,000	ファンドは1.36%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2027	(50,046)	(508,874)
IRS	USD 7,540,000	ファンドは1.35%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2027	(55,987)	(574,778)
IRS	USD 8,320,000	ファンドは1.2145%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	1/8/2027	(57,153)	(702,180)
IRS	GBP 105,180,000	ファンドはGBP 1日SONIAの変動金利を受け取り、1.9%の固定金利を支払う	Bank of America	4/8/2027	835,532	835,532
IRS	GBP 105,390,000	ファンドはGBP 1日SONIAの変動金利を受け取り、1.98697%の固定金利を支払う	Bank of America	10/8/2027	743,131	743,131
IRS	USD 2,790,000	ファンドは1.974%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	19/9/2027	(140,828)	(140,828)
IRS	USD 2,790,000	ファンドは1.9985%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	19/9/2027	(137,681)	(137,681)
IRS	USD 2,790,000	ファンドは1.9875%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	19/9/2027	(139,094)	(139,094)
IRS	USD 5,954,500	ファンドは2.943%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	8/11/2027	(32,355)	(32,355)
IRS	USD 289,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、2.9025%の固定金利を支払う	Bank of America	14/3/2028	5,388	5,388
IRS	USD 3,930,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、3.035%の固定金利を支払う	Bank of America	13/9/2028	45,416	45,416
IRS	USD 64,027,800	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.92%の固定金利を支払う	Bank of America	16/2/2029	24,070	216,443
IRS	USD 3,450,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.6815%の固定金利を支払う	Bank of America	4/6/2029	8,115	8,115
IRS	USD 3,015,000	ファンドは3.116%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	17/6/2029	27,447	27,447
IRS	USD 18,395,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.96%の固定金利を支払う	Bank of America	30/6/2029	103,370	(8,654)
IRS	USD 1,050,000	ファンドは2.929%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	26/8/2029	(1,941)	(1,941)
IRS	EUR 2,330,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.185%の固定金利を支払う	Bank of America	16/1/2030	330,082	330,406

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 15,435,000	ファンドは0.6475%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	25/9/2030	(2,770,999)	(2,770,999)
IRS	USD 15,435,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.6965%の固定金利を支払う	Bank of America	25/9/2030	2,717,384	2,717,384
IRS	USD 12,348,000	ファンドは0.6795%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	29/9/2030	(2,191,344)	(2,191,344)
IRS	USD 12,348,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.75%の固定金利を支払う	Bank of America	29/9/2030	2,129,538	2,129,538
IRS	EUR 6,510,000	ファンドは0.6142%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(856,670)	(856,670)
IRS	EUR 28,050,000	ファンドは0.7895%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(3,311,725)	(3,311,725)
IRS	EUR 8,470,000	ファンドは1.2395%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(705,749)	(705,749)
IRS	EUR 9,690,000	ファンドは1.465%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(637,002)	(638,754)
IRS	EUR 41,810,000	ファンドは1.6988%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(2,001,599)	(2,001,599)
IRS	EUR 6,340,000	ファンドは1.9045%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(202,863)	(202,863)
IRS	EUR 18,325,000	ファンドは0.767%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(2,195,360)	(2,195,360)
IRS	USD 14,140,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.502%の固定金利を支払う	Bank of America	10/3/2031	152,205	444,927
IRS	USD 10,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.262%の固定金利を支払う	Bank of America	30/3/2031	(19)	173
IRS	EUR 2,150,000	ファンドは1.6119%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(131,528)	(131,528)
IRS	EUR 1,075,000	ファンドは1.711%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(57,138)	(57,138)
IRS	EUR 1,079,000	ファンドは1.72254%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(56,343)	(56,343)
IRS	EUR 1,075,000	ファンドは1.7317%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(55,336)	(55,336)
IRS	EUR 1,075,000	ファンドは1.745%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(54,358)	(54,179)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	EUR 7,520,000	ファンドは1.9275%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(267,876)	(267,876)
IRS	EUR 2,145,000	ファンドは2.0077%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(62,480)	(62,480)
IRS	EUR 2,145,000	ファンドは2.0742%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(50,930)	(50,930)
IRS	EUR 2,150,000	ファンドは2.092%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(47,950)	(47,950)
IRS	EUR 1,079,000	ファンドは2.124%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(21,268)	(21,268)
IRS	EUR 1,075,000	ファンドは2.2162%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(13,164)	(13,164)
IRS	EUR 1,075,000	ファンドは2.23%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(11,799)	(11,963)
IRS	EUR 7,520,000	ファンドは2.358%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(5,747)	(5,747)
IRS	EUR 1,075,000	ファンドは2.41437%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	4,085	4,085
IRS	EUR 1,075,000	ファンドは2.4995%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	11,495	11,495
IRS	EUR 1,075,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.64005%の固定金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(23,729)	(23,729)
IRS	EUR 7,240,000	ファンドは1.86%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(299,649)	(297,472)
IRS	EUR 1,079,000	ファンドは2.37%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	1,989	224
IRS	EUR 41,523,251	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.02%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2031	7,873,523	7,873,523
IRS	USD 9,990,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.425%の固定金利を支払う	Bank of America	23/9/2031	100,712	1,177,875
IRS	USD 2,972,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.11567%の固定金利を支払う	Bank of America	27/9/2031	423,903	423,903
IRS	USD 139,346,104	ファンドは1.5638%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	14/10/2031	(17,640,693)	(17,640,693)
IRS	USD 72,617,577	ファンドは1.59%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	19/11/2031	(9,164,346)	(9,164,346)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	MXN 58,122,000	ファンドはMXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.6%の固定金利を支払う	Bank of America	1/1/2032	(217,232)	(217,232)
IRS	MXN 89,548,000	ファンドはMXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.565%の固定金利を支払う	Bank of America	12/1/2032	(344,804)	(344,804)
IRS	USD 156,867,514	ファンドは1.7343%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	28/1/2032	(18,272,030)	(18,272,030)
IRS	USD 5,370,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.7575%の固定金利を支払う	Bank of America	10/2/2032	510,008	510,008
IRS	EUR 1,160,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.8395%の固定金利を支払う	Bank of America	16/2/2032	150,245	150,245
IRS	USD 4,980,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.308%の固定金利を支払う	Bank of America	22/2/2032	51,172	658,625
IRS	EUR 580,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.8575%の固定金利を支払う	Bank of America	1/3/2032	75,667	75,667
IRS	USD 5,050,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.687%の固定金利を支払う	Bank of America	7/3/2032	512,281	512,281
IRS	USD 3,815,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.59%の固定金利を支払う	Bank of America	9/3/2032	417,679	417,679
IRS	USD 6,587,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.652%の固定金利を支払う	Bank of America	10/3/2032	687,583	687,583
IRS	EUR 850,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.905%の固定金利を支払う	Bank of America	14/3/2032	107,661	107,661
IRS	EUR 590,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.024%の固定金利を支払う	Bank of America	16/3/2032	68,662	68,662
IRS	USD 4,490,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.9485%の固定金利を支払う	Bank of America	16/3/2032	359,161	359,161
IRS	EUR 590,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.046%の固定金利を支払う	Bank of America	17/3/2032	67,487	67,487
IRS	USD 3,750,548	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.9855%の固定金利を支払う	Bank of America	18/3/2032	288,647	288,647
IRS	USD 7,483,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.106%の固定金利を支払う	Bank of America	23/3/2032	501,849	501,849
IRS	USD 4,449,352	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.1245%の固定金利を支払う	Bank of America	23/3/2032	291,570	291,570
IRS	EUR 1,610,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.1255%の固定金利を支払う	Bank of America	29/3/2032	173,091	173,091

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 5,301,448	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.263%の固定金利を支払う	Bank of America	29/3/2032	286,995	286,995
IRS	USD 4,493,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.3125%の固定金利を支払う	Bank of America	7/4/2032	225,179	225,179
IRS	EUR 600,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.338%の固定金利を支払う	Bank of America	8/4/2032	53,440	53,440
IRS	USD 10,222,322	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.3525%の固定金利を支払う	Bank of America	8/4/2032	478,389	478,389
IRS	USD 4,500,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.41%の固定金利を支払う	Bank of America	8/4/2032	189,047	189,047
IRS	USD 8,180,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.4225%の固定金利を支払う	Bank of America	8/4/2032	335,130	335,130
IRS	USD 4,502,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.4135%の固定金利を支払う	Bank of America	11/4/2032	187,996	187,996
IRS	USD 4,567,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.554%の固定金利を支払う	Bank of America	13/4/2032	137,253	137,253
IRS	USD 5,373,819	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.588%の固定金利を支払う	Bank of America	19/4/2032	146,463	146,463
IRS	USD 3,863,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.6187%の固定金利を支払う	Bank of America	20/4/2032	95,405	95,405
IRS	USD 3,866,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.65335%の固定金利を支払う	Bank of America	21/4/2032	84,308	84,308
IRS	USD 4,605,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.7234%の固定金利を支払う	Bank of America	21/4/2032	73,475	73,475
IRS	EUR 600,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.641%の固定金利を支払う	Bank of America	21/4/2032	37,626	37,626
IRS	MXN 109,165,000	ファンドはMXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を受け取り、8.955%の固定金利を支払う	Bank of America	21/4/2032	62,649	62,649
IRS	USD 5,760,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.6375%の固定金利を支払う	Bank of America	25/4/2032	133,388	133,388
IRS	USD 7,618,000	ファンドは2.513%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	28/4/2032	(255,856)	(255,856)
IRS	USD 3,050,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.7245%の固定金利を支払う	Bank of America	3/5/2032	48,514	48,514
IRS	USD 13,950,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、0.505%の固定金利を支払う	Bank of America	4/5/2032	136,964	2,816,881

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 7,638,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.85%の固定金利を支払う	Bank of America	9/5/2032	41,174	41,174
IRS	USD 13,630,000	ファンドは2.87%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	15/5/2032	(80,786)	(35,203)
IRS	USD 5,973,136	ファンドは2.6565%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	16/5/2032	(129,402)	(129,402)
IRS	USD 63,216,532	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.58%の固定金利を支払う	Bank of America	24/5/2032	1,764,860	1,778,785
IRS	USD 11,858,932	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.585%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2032	328,833	328,833
IRS	USD 6,666,000	ファンドは2.5278%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	27/5/2032	(217,023)	(217,023)
IRS	USD 5,170,704	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.715%の固定金利を支払う	Bank of America	3/6/2032	86,863	86,863
IRS	GBP 4,540,000	ファンドは2.7075%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	7/6/2032	(117,981)	(117,981)
IRS	USD 6,660,568	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.84671%の固定金利を支払う	Bank of America	8/6/2032	37,831	37,831
IRS	USD 24,565,000	ファンドは2.767%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	9/6/2032	(305,105)	(305,105)
IRS	USD 5,970,050	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.77467%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2032	70,278	70,278
IRS	USD 5,952,826	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.83485%の固定金利を支払う	Bank of America	13/6/2032	39,808	39,808
IRS	USD 5,210,700	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.9425%の固定金利を支払う	Bank of America	14/6/2032	(12,654)	(12,654)
IRS	USD 5,210,700	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.948%の固定金利を支払う	Bank of America	14/6/2032	(15,080)	(15,080)
IRS	USD 3,675,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.155%の固定金利を支払う	Bank of America	15/6/2032	(75,065)	(75,065)
IRS	USD 14,784,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.07269%の固定金利を支払う	Bank of America	17/6/2032	(199,049)	(199,049)
IRS	USD 7,457,888	ファンドは2.981%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	21/6/2032	42,550	42,550
IRS	USD 7,373,000	ファンドは2.769%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	5/7/2032	(90,719)	(90,719)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 6,144,167	ファンドは2.818%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	5/7/2032	(49,972)	(49,972)
IRS	USD 5,925,920	ファンドは2.696%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	6/7/2032	(109,730)	(109,730)
IRS	USD 4,057,349	ファンドは2.6095%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	7/7/2032	(105,025)	(105,025)
IRS	USD 2,941,500	ファンドは2.6715%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	8/7/2032	(60,625)	(60,625)
IRS	USD 3,489,271	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.892%の固定金利を支払う	Bank of America	12/7/2032	6,377	6,377
IRS	EUR 12,710,000	ファンドは2.048%の固定金利を受け取り、EUR 1日EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	13/7/2032	(93,119)	(93,119)
IRS	EUR 12,710,000	ファンドは2.111%の固定金利を受け取り、EUR 1日EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	13/7/2032	(58,463)	(58,463)
IRS	EUR 25,420,000	ファンドは2.266%の固定金利を受け取り、EUR 1日EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	13/7/2032	53,604	53,604
IRS	USD 14,080,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.816%の固定金利を支払う	Bank of America	13/7/2032	(49,440)	(49,440)
IRS	USD 28,150,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.873%の固定金利を支払う	Bank of America	13/7/2032	(163,608)	(163,608)
IRS	EUR 8,974,000	ファンドは2.4425%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	14/7/2032	(44,889)	(44,889)
IRS	AUD 17,115,000	ファンドは4.16%の固定金利を受け取り、AUD 3ヶ月BBSWの変動金利を支払う	Bank of America	21/7/2032	(10,193)	(10,193)
IRS	AUD 17,115,000	ファンドは4.14%の固定金利を受け取り、AUD 3ヶ月BBSWの変動金利を支払う	Bank of America	21/7/2032	(18,930)	(18,930)
IRS	EUR 2,000,000	ファンドは2.099%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/7/2032	(39,480)	(39,480)
IRS	USD 7,211,000	ファンドは2.58638%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	26/7/2032	(201,614)	(201,614)
IRS	USD 2,260,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.5125%の固定金利を支払う	Bank of America	26/7/2032	19,904	19,904
IRS	EUR 8,460,000	ファンドは1.8035%の固定金利を受け取り、EUR 1日EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	28/7/2032	(152,701)	(152,701)
IRS	EUR 8,580,000	ファンドは1.568%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	28/7/2032	(549,377)	(555,388)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 679,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.276%の固定金利を支払う	Bank of America	4/8/2032	12,483	12,483
IRS	USD 19,242,000	ファンドは2.534%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	10/8/2032	(626,099)	(626,099)
IRS	EUR 9,310,000	ファンドは1.747%の固定金利を受け取り、EUR 1日EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2032	(191,994)	(191,994)
IRS	USD 11,520,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.4025%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2032	153,470	153,470
IRS	CAD 1,363,000	ファンドは3.26%の固定金利を受け取り、CAD 6ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	18/8/2032	(22,852)	(26,502)
IRS	USD 450,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.93%の固定金利を支払う	Bank of America	18/8/2032	38,046	38,046
IRS	USD 680,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.6425%の固定金利を支払う	Bank of America	19/8/2032	15,817	15,817
IRS	USD 2,210,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.645%の固定金利を支払う	Bank of America	19/8/2032	50,931	50,931
IRS	USD 1,355,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.65%の固定金利を支払う	Bank of America	19/8/2032	6,031	30,644
IRS	USD 2,715,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.651%の固定金利を支払う	Bank of America	19/8/2032	61,167	61,167
IRS	CAD 2,700,000	ファンドは3.42%の固定金利を受け取り、CAD 6ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	22/8/2032	(24,709)	(24,709)
IRS	CAD 1,362,000	ファンドは3.461%の固定金利を受け取り、CAD 6ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	23/8/2032	(8,871)	(8,871)
IRS	USD 890,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.7265%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2032	14,278	14,278
IRS	USD 680,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.72735%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2032	10,859	10,859
IRS	USD 1,355,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.7355%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2032	20,687	20,687
IRS	USD 7,211,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.7435%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2032	105,124	105,124
IRS	USD 680,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.767%の固定金利を支払う	Bank of America	24/8/2032	8,538	8,538
IRS	USD 680,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.7915%の固定金利を支払う	Bank of America	24/8/2032	7,103	7,103

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 1,360,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、2.8045%の固定金利を支払う	Bank of America	24/8/2032	12,683	12,683
IRS	USD 2,040,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、2.808%の固定金利を支払う	Bank of America	24/8/2032	18,410	18,410
IRS	USD 1,360,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、2.80918%の固定金利を支払う	Bank of America	24/8/2032	12,135	12,135
IRS	USD 680,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、2.8145%の固定金利を支払う	Bank of America	24/8/2032	5,756	5,756
IRS	USD 5,420,000	ファンドは2.665%の固定金利を受け取り、USD 1 日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	25/8/2032	(15,341)	(15,341)
IRS	USD 1,360,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、2.854%の固定金利を支払う	Bank of America	25/8/2032	6,883	6,883
IRS	GBP 881,000	ファンドは2.8415%の固定金利を受け取り、GBP 1 日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	26/8/2032	(10,769)	(10,769)
IRS	USD 675,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、2.874%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2032	2,253	2,253
IRS	USD 675,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、2.88%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2032	1,904	1,904
IRS	USD 675,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、2.902%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2032	624	624
IRS	USD 675,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、2.905%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2032	449	449
IRS	USD 675,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、2.9165%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2032	(220)	(220)
IRS	USD 1,310,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、2.919%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2032	(709)	(709)
IRS	EUR 26,300,000	ファンドは2.1175%の固定金利を受け取り、EUR 1 日EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	27/8/2032	(125,680)	(125,680)
IRS	CAD 2,715,000	ファンドは3.5595%の固定金利を受け取り、CAD 6 ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	29/8/2032	(844)	(844)
IRS	USD 1,362,333	ファンドは2.828%の固定金利を受け取り、USD 1 日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	29/8/2032	(9,949)	(9,949)
IRS	USD 1,300,000	ファンドは2.873%の固定金利を受け取り、USD 1 日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	30/8/2032	(4,447)	(4,447)
IRS	USD 1,445,000	ファンドはUSD 1 日SOFRの変動金利を受け取り、2.9075%の固定金利を支払う	Bank of America	31/8/2032	637	637

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 7,277,057	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.92%の固定金利を支払う	Bank of America	1/9/2032	(4,516)	(4,516)
IRS	EUR 16,610,000	ファンドは2.2185%の固定金利を受け取り、EUR 1日EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	1/9/2032	(7,833)	(7,833)
IRS	USD 45,530,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.6925%の固定金利を支払う	Bank of America	1/9/2032	80,347	80,347
IRS	USD 1,362,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.93947%の固定金利を支払う	Bank of America	1/9/2032	(3,135)	(3,135)
IRS	USD 1,365,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.944%の固定金利を支払う	Bank of America	1/9/2032	(3,674)	(3,674)
IRS	USD 1,864,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.6885%の固定金利を支払う	Bank of America	6/2/2033	191,742	191,742
IRS	EUR 12,306,000	ファンドは1.91%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	17/5/2033	(613,434)	(613,434)
IRS	USD 1,498,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.835%の固定金利を支払う	Bank of America	7/5/2034	(6,003)	(6,003)
IRS	USD 4,200,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.59%の固定金利を支払う	Bank of America	29/5/2034	67,044	67,044
IRS	USD 6,450,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.6%の固定金利を支払う	Bank of America	29/5/2034	97,661	97,661
IRS	USD 10,600,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.605%の固定金利を支払う	Bank of America	30/5/2034	155,968	155,968
IRS	USD 294,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.364%の固定金利を支払う	Bank of America	13/8/2034	9,924	9,924
IRS	USD 1,405,000	ファンドは2.748%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	27/8/2034	(3,206)	(3,206)
IRS	USD 8,890,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.497%の固定金利を支払う	Bank of America	12/2/2035	25,597	916,204
IRS	USD 1,000,000	ファンドは1.81%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	1/2/2037	(77,111)	(77,111)
IRS	USD 2,114,015	ファンドは2.9895%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	17/5/2037	2,168	2,168
IRS	USD 1,789,031	ファンドは2.993%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	17/5/2037	2,055	2,055
IRS	USD 3,766,381	ファンドは3.00397%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	17/5/2037	5,776	5,776

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 1,883,191	ファンドは3.0055%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	17/5/2037	2,989	2,989
IRS	USD 1,013,516	ファンドは2.8025%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	21/5/2037	(5,613)	(5,613)
IRS	USD 1,066,859	ファンドは2.8175%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	21/5/2037	(5,347)	(5,347)
IRS	EUR 1,846,800	ファンドは2.14946%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2037	(34,433)	(34,433)
IRS	EUR 1,846,800	ファンドは2.19748%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2037	(31,073)	(31,073)
IRS	EUR 1,846,800	ファンドは2.2215%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2037	(29,392)	(29,392)
IRS	EUR 1,846,800	ファンドは2.32113%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2037	(22,420)	(22,420)
IRS	EUR 3,596,400	ファンドは2.50712%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2037	(18,315)	(18,315)
IRS	USD 1,855,217	ファンドは2.9285%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	2/6/2037	(2,111)	(2,111)
IRS	USD 1,855,217	ファンドは2.9555%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	2/6/2037	(356)	(356)
IRS	USD 1,952,860	ファンドは3.07028%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	2/6/2037	7,477	7,477
IRS	USD 3,902,202	ファンドは2.9985%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	9/6/2037	5,082	5,082
IRS	USD 3,905,720	ファンドは3.029%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	9/6/2037	9,257	9,257
IRS	USD 3,902,202	ファンドは3.0593%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	9/6/2037	13,389	13,389
IRS	EUR 1,798,200	ファンドは2.52853%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/6/2037	(7,392)	(7,392)
IRS	USD 1,952,860	ファンドは3.1175%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	15/6/2037	10,656	10,656
IRS	USD 1,949,341	ファンドは3.154%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	15/6/2037	13,126	13,126
IRS	EUR 1,798,200	ファンドは2.80506%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	28/6/2037	11,754	11,754

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	EUR 1,798,200	ファンドは2.909%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	28/6/2037	18,824	18,824
IRS	EUR 374,000	ファンドは2.6325%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	13/7/2037	59	59
IRS	EUR 1,798,200	ファンドは2.545%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/7/2037	(5,528)	(5,528)
IRS	EUR 4,345,000	ファンドは2.2315%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	13/8/2037	(63,597)	(63,597)
IRS	USD 5,490,000	ファンドは2.9505%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	24/8/2037	(2,733)	(2,733)
IRS	USD 5,605,000	ファンドは3.027%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	25/8/2037	12,120	12,120
IRS	USD 4,160,000	ファンドは3.119%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	26/8/2037	22,304	22,304
IRS	USD 2,775,000	ファンドは3.0525%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	27/8/2037	8,452	8,452
IRS	USD 5,731,000	ファンドは1.835%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	17/1/2039	(418,752)	(418,752)
IRS	USD 5,030,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、0.7065%の固定金利を支払う	Bank of America	17/8/2040	81,600	1,532,569
IRS	USD 8,083,900	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.93%の固定金利を支払う	Bank of America	26/11/2041	(46,745)	(62,200)
IRS	USD 1,484,174	ファンドは2.5735%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	27/5/2042	(4,197)	(4,197)
IRS	USD 2,593,961	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.1955%の固定金利を支払う	Bank of America	19/5/2047	(1,058)	(1,058)
IRS	USD 1,299,654	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.132%の固定金利を支払う	Bank of America	21/5/2047	1,683	1,683
IRS	USD 1,898,672	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.14%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2047	1,945	1,945
IRS	EUR 1,260,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.27%の固定金利を支払う	Bank of America	18/1/2048	(28,571)	(28,571)
IRS	USD 4,870,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.0775%の固定金利を支払う	Bank of America	5/7/2049	29,225	52,924
IRS	USD 3,370,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.445%の固定金利を支払う	Bank of America	16/8/2049	19,303	151,393

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 3,440,000	ファンドは1.449%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	12/2/2050	(62,658)	(824,178)
IRS	USD 18,194,800	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.81%の固定金利を支払う	Bank of America	25/1/2051	(161,146)	(436,587)
IRS	USD 33,463,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.81%の固定金利を支払う	Bank of America	28/1/2051	(296,393)	(805,094)
IRS	USD 18,855,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	1/2/2051	(166,840)	(417,263)
IRS	USD 10,566,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	4/2/2051	(93,499)	(234,493)
IRS	USD 10,880,700	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	5/2/2051	(96,278)	(241,458)
IRS	USD 4,010,000	ファンドは1.585%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	19/2/2051	(77,320)	(862,862)
IRS	USD 4,450,600	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	22/2/2051	139,727	(99,540)
IRS	USD 16,715,200	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2051	526,207	(392,407)
IRS	USD 2,732,300	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2051	86,015	(64,142)
IRS	USD 1,343,000	ファンドは1.614%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	11/6/2051	(26,348)	(281,961)
IRS	USD 36,909,800	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.79%の固定金利を支払う	Bank of America	21/1/2052	1,171,966	(897,347)
IRS	EUR 660,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.765%の固定金利を支払う	Bank of America	14/4/2052	17,702	17,702
IRS	EUR 330,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.648%の固定金利を支払う	Bank of America	14/4/2052	11,202	11,202
IRS	EUR 660,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.708%の固定金利を支払う	Bank of America	14/4/2052	19,993	19,993
IRS	EUR 660,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.729%の固定金利を支払う	Bank of America	14/4/2052	19,149	19,149
IRS	EUR 660,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.73728%の固定金利を支払う	Bank of America	14/4/2052	18,816	18,816
IRS	USD 880,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.9%の固定金利を支払う	Bank of America	22/4/2052	6,921	7,065

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	JPY 10,082,160	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、0.8599%の固定金利を支払う	Bank of America	25/4/2052	2,666	2,666
IRS	USD 880,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.85%の固定金利を支払う	Bank of America	28/4/2052	9,703	9,273
IRS	USD 880,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.9%の固定金利を支払う	Bank of America	2/5/2052	6,965	6,961
IRS	USD 880,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.9095%の固定金利を支払う	Bank of America	2/5/2052	6,530	6,530
IRS	EUR 1,895,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.72806%の固定金利を支払う	Bank of America	9/5/2052	54,672	54,672
IRS	EUR 815,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.74936%の固定金利を支払う	Bank of America	9/5/2052	22,457	22,457
IRS	EUR 815,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.799%の固定金利を支払う	Bank of America	9/5/2052	19,996	19,996
IRS	JPY 10,082,160	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、0.8535%の固定金利を支払う	Bank of America	9/5/2052	2,800	2,800
IRS	JPY 10,082,160	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、0.857%の固定金利を支払う	Bank of America	9/5/2052	2,733	2,733
IRS	USD 880,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.91%の固定金利を支払う	Bank of America	12/5/2052	6,777	6,403
IRS	USD 880,000	ファンドは2.0085%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	16/5/2052	(1,895)	(1,895)
IRS	USD 3,513,036	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.902%の固定金利を支払う	Bank of America	17/5/2052	280	280
IRS	USD 7,026,075	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.91718%の固定金利を支払う	Bank of America	17/5/2052	(2,050)	(2,050)
IRS	USD 3,513,036	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.9225%の固定金利を支払う	Bank of America	17/5/2052	(1,482)	(1,482)
IRS	USD 950,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.983%の固定金利を支払う	Bank of America	19/5/2052	3,260	3,260
IRS	USD 880,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.0525%の固定金利を支払う	Bank of America	19/5/2052	(133)	(133)
IRS	USD 950,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.038%の固定金利を支払う	Bank of America	20/5/2052	558	558
IRS	USD 1,531,324	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.894%の固定金利を支払う	Bank of America	21/5/2052	400	400

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	EUR 680,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.95%の固定金利を支払う	Bank of America	23/5/2052	10,361	10,361
IRS	JPY 19,611,570	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、0.88%の固定金利を支払う	Bank of America	23/5/2052	4,478	4,478
IRS	EUR 680,000	ファンドは1.02637%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2052	(7,189)	(7,189)
IRS	EUR 680,000	ファンドは1.0713%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2052	(5,331)	(5,331)
IRS	EUR 680,000	ファンドは1.11%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2052	(3,731)	(3,731)
IRS	EUR 680,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.031%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2052	6,997	6,997
IRS	EUR 680,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.057%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2052	5,922	5,922
IRS	JPY 16,172,460	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、0.85%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2052	4,624	4,624
IRS	JPY 16,172,460	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、0.7915%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2052	6,430	6,430
IRS	USD 946,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.98%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2052	3,260	3,305
IRS	USD 946,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.99%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2052	2,263	2,818
IRS	USD 475,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.02794%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2052	486	486
IRS	USD 1,785,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.03%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2052	2,163	1,639
IRS	USD 950,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.0455%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2052	113	113
IRS	USD 5,352,444	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.0585%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2052	(2,946)	(2,946)
IRS	EUR 2,284,200	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.85752%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2052	13,359	13,359
IRS	EUR 2,284,200	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.89209%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2052	11,038	11,038
IRS	EUR 2,284,200	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.9075%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2052	10,003	10,003

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	EUR 2,284,200	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.97108%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2052	5,734	5,734
IRS	EUR 4,985,550	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.22706%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2052	(25,000)	(25,000)
IRS	EUR 805,000	ファンドは1.302%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	30/5/2052	5,020	5,020
IRS	EUR 13,896,000	ファンドは1.6487%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	30/5/2052	(357,205)	(808,695)
IRS	EUR 680,000	ファンドは1.2135%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	2/6/2052	585	585
IRS	EUR 680,000	ファンドは1.2403%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	2/6/2052	1,692	1,692
IRS	USD 950,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.0785%の固定金利を支払う	Bank of America	3/6/2052	(1,575)	(1,575)
IRS	USD 2,694,243	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.946%の固定金利を支払う	Bank of America	4/6/2052	(2,860)	(2,860)
IRS	USD 2,650,787	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.9725%の固定金利を支払う	Bank of America	4/6/2052	(4,531)	(4,531)
IRS	USD 2,836,045	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.99146%の固定金利を支払う	Bank of America	4/6/2052	(6,163)	(6,163)
IRS	USD 950,000	ファンドは2.15%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	6/6/2052	5,080	5,103
IRS	EUR 805,000	ファンドは1.3%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	5,037	4,966
IRS	EUR 850,000	ファンドは1.63%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	22,300	22,292
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.24828%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(2,203)	(2,203)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.2785%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(3,540)	(3,540)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.29422%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(4,235)	(4,235)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.31167%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(5,007)	(5,007)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.3165%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(5,221)	(5,221)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.32558%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(5,623)	(5,623)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.341%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(6,305)	(6,305)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.3608%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(7,181)	(7,181)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.37%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(7,272)	(7,588)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.3705%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(7,610)	(7,610)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.37987%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(8,025)	(8,025)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.38%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(8,163)	(8,031)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.5%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(13,248)	(13,340)
IRS	USD 945,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.014%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	1,506	1,506
IRS	USD 945,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.0925%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(2,313)	(2,313)
IRS	EUR 2,397,600	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.25485%の固定金利を支払う	Bank of America	11/6/2052	(13,979)	(13,979)
IRS	USD 5,668,572	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.9455%の固定金利を支払う	Bank of America	11/6/2052	(6,090)	(6,090)
IRS	USD 5,672,091	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.959%の固定金利を支払う	Bank of America	11/6/2052	(7,965)	(7,965)
IRS	USD 5,668,572	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.0055%の固定金利を支払う	Bank of America	11/6/2052	(14,403)	(14,403)
IRS	USD 950,000	ファンドは2.105%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	13/6/2052	2,977	2,977
IRS	USD 950,000	ファンドは2.138%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	13/6/2052	4,590	4,590
IRS	USD 965,000	ファンドは2.0885%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	16/6/2052	2,239	2,239
IRS	USD 965,000	ファンドは2.10274%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	16/6/2052	2,946	2,946

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 965,000	ファンドは2.10523%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	16/6/2052	3,070	3,070
IRS	USD 965,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.9115%の固定金利を支払う	Bank of America	16/6/2052	6,551	6,551
IRS	USD 965,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.9785%の固定金利を支払う	Bank of America	16/6/2052	3,224	3,224
IRS	USD 480,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.03438%の固定金利を支払う	Bank of America	16/6/2052	223	223
IRS	USD 940,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.055%の固定金利を支払う	Bank of America	16/6/2052	(560)	(560)
IRS	JPY 25,029,525	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、0.985%の固定金利を支払う	Bank of America	17/6/2052	740	740
IRS	USD 2,779,747	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.9565%の固定金利を支払う	Bank of America	17/6/2052	(3,793)	(3,793)
IRS	USD 2,776,229	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.964%の固定金利を支払う	Bank of America	17/6/2052	(4,297)	(4,297)
IRS	USD 965,000	ファンドは2.003%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	20/6/2052	(1,964)	(1,964)
IRS	EUR 725,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.445%の固定金利を支払う	Bank of America	23/6/2052	(10,932)	(10,932)
IRS	EUR 2,393,302	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.19426%の固定金利を支払う	Bank of America	26/6/2052	(9,694)	(9,694)
IRS	EUR 2,393,797	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.2055%の固定金利を支払う	Bank of America	26/6/2052	(10,486)	(10,486)
IRS	USD 965,000	ファンドは2.086%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	8/7/2052	2,350	2,350
IRS	USD 965,000	ファンドは2.01254%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	14/7/2052	(1,226)	(1,226)
IRS	USD 965,000	ファンドは2.049%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	14/7/2052	582	582
IRS	EUR 1,700,000	ファンドは1.15%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/7/2052	(5,633)	(4,548)
IRS	EUR 850,000	ファンドは1.1715%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/7/2052	(1,165)	(1,165)
IRS	EUR 850,000	ファンドは1.299%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/7/2052	5,411	5,411

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 965,000	ファンドは2.0225%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	21/7/2052	(655)	(655)
IRS	USD 965,000	ファンドは2.023%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	21/7/2052	(630)	(630)
IRS	EUR 2,272,050	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.957%の固定金利を支払う	Bank of America	22/7/2052	6,614	6,614
IRS	JPY 49,810,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、0.99%の固定金利を支払う	Bank of America	26/7/2052	1,114	1,114
IRS	USD 965,000	ファンドは2.062%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	28/7/2052	1,378	1,378
IRS	USD 1,880,000	ファンドは2.11484%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	28/7/2052	7,786	7,786
IRS	USD 965,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.95715%の固定金利を支払う	Bank of America	1/8/2052	3,773	3,773
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.9625%の固定金利を支払う	Bank of America	4/8/2052	10,116	10,116
IRS	EUR 1,285,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.965%の固定金利を支払う	Bank of America	4/8/2052	17,662	17,662
IRS	EUR 1,285,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.9705%の固定金利を支払う	Bank of America	4/8/2052	17,233	17,233
IRS	USD 965,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.9518%の固定金利を支払う	Bank of America	4/8/2052	4,004	4,004
IRS	EUR 850,000	ファンドは1.048%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	5/8/2052	(7,396)	(7,396)
IRS	EUR 850,000	ファンドは1.07%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2052	(6,223)	(6,223)
IRS	EUR 820,000	ファンドは1.1275%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2052	(3,145)	(3,145)
IRS	EUR 820,000	ファンドは1.15035%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2052	(2,009)	(2,009)
IRS	USD 940,000	ファンドは2.1%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2052	3,323	3,323
IRS	USD 940,000	ファンドは2.101%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2052	3,371	3,371
IRS	USD 965,000	ファンドは2.135%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2052	5,669	5,144

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 940,000	ファンドは2.15%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2052	5,829	5,734
IRS	GBP 1,247,000	ファンドは1.90281%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	12/8/2052	(24,000)	(24,000)
IRS	GBP 2,495,000	ファンドは1.907%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	12/8/2052	(47,388)	(47,388)
IRS	GBP 1,247,000	ファンドは1.92999%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	12/8/2052	(21,956)	(21,956)
IRS	EUR 5,405,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.955%の固定金利を支払う	Bank of America	13/8/2052	16,023	16,023
IRS	USD 1,775,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.10894%の固定金利を支払う	Bank of America	14/8/2052	(7,143)	(7,143)
IRS	USD 1,770,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.11568%の固定金利を支払う	Bank of America	14/8/2052	(7,734)	(7,734)
IRS	USD 845,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.1165%の固定金利を支払う	Bank of America	14/8/2052	(3,728)	(3,728)
IRS	USD 3,545,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.13505%の固定金利を支払う	Bank of America	14/8/2052	(19,012)	(19,012)
IRS	CAD 580,000	ファンドはCAD 6ヶ月CDORの変動金利を受け取り、3.26%の固定金利を支払う	Bank of America	18/8/2052	8,632	11,766
IRS	EUR 690,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.26152%の固定金利を支払う	Bank of America	18/8/2052	(2,996)	(2,996)
IRS	EUR 820,000	ファンドは1.2013%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	19/8/2052	572	572
IRS	CAD 1,155,000	ファンドはCAD 6ヶ月CDORの変動金利を受け取り、3.382%の固定金利を支払う	Bank of America	22/8/2052	2,840	2,840
IRS	CAD 575,000	ファンドはCAD 6ヶ月CDORの変動金利を受け取り、3.396%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2052	239	239
IRS	EUR 850,000	ファンドは1.2775%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	25/8/2052	4,558	4,558
IRS	USD 855,000	ファンドは2.1155%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	25/8/2052	3,844	3,844
IRS	USD 850,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.04%の固定金利を支払う	Bank of America	25/8/2052	(531)	(531)
IRS	GBP 365,000	ファンドはGBP 1日SONIAの変動金利を受け取り、2.525%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2052	8,836	8,836

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 850,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.0495%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2052	(945)	(945)
IRS	USD 8,050,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.9395%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2052	(9,676)	(9,676)
IRS	USD 8,055,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.937%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2052	(9,192)	(9,192)
IRS	USD 4,028,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.975%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2052	(8,323)	(8,323)
IRS	USD 5,860,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.01%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2052	(17,101)	(17,101)
IRS	CAD 1,170,000	ファンドはCAD 6ヶ月CDORの変動金利を受け取り、3.4495%の固定金利を支払う	Bank of America	29/8/2052	(8,586)	(8,586)
IRS	USD 845,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.05%の固定金利を支払う	Bank of America	29/8/2052	(435)	(988)
IRS	USD 930,000	ファンドは2.7735%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	21/2/2053	(15,813)	26,966
IRS	USD 2,710,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、0.621%の固定金利を支払う	Bank of America	12/7/2053	39,075	1,059,094
IRS	USD 480,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.645%の固定金利を支払う	Bank of America	15/1/2055	77,882	77,882
IRS	USD 150,500	ファンドは1.6525%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	1/12/2056	(1,377)	(21,140)
IRS	BRL 64,965,000	ファンドは5.42%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	BNP Paribas	2/1/2023	(415,430)	(415,430)
IRS	MXN 279,950,277	ファンドはMXN 1ヶ月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	625,478	625,478
IRS	BRL 30,597,000	ファンドは11.694%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2025	(41,489)	(41,489)
IRS	MXN 274,683,000	ファンドは6.02%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	24/3/2026	(1,276,806)	(1,276,806)
IRS	MXN 414,800,000	ファンドは7.481%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	14/4/2027	(1,157,058)	(1,157,058)
IRS	BRL 8,497,537	ファンドは12.4%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	847,472	847,472
IRS	BRL 14,017,904	ファンドは8.195%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	223,724	223,724

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	BRL 10,765,416	ファンドは8.375%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	197,792	197,792
IRS	BRL 29,228,390	ファンドは9.45%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	1,108,337	1,108,337
IRS	BRL 6,194,622	ファンドは9.45%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	234,899	234,899
IRS	BRL 21,841,287	ファンドは11.65%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2025	(33,589)	(33,589)
IRS	THB 710,287,976	ファンドはTHB 3ヶ月BKIBORの変動金利を受け取り、2.17%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	21/9/2024	(58,498)	(58,498)
IRS	MXN 144,525,723	ファンドはMXN 1ヶ月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	340,576	340,576
TRS	USD 6,000,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1日SOFR + 0bpsを支払う	Barclays	20/9/2022	(178,127)	(179,276)
TRS	USD 4,771,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1日SOFR + 0bpsを支払う	Barclays	20/9/2022	(109,157)	(110,170)
TRS	USD 10,190,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1日SOFR + 0bpsを支払う	Barclays	20/9/2022	295,241	292,603
TRS	USD 2,500,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1日SOFR + 0bpsを支払う	Barclays	20/9/2022	43,225	42,499
TRS	USD 2,044,049	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1日SOFR + 0bpsを支払う	Barclays	20/9/2022	(20,237)	(21,392)
TRS	USD 11,075,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1日SOFR + 0bpsを支払う	Barclays	20/9/2022	(516,506)	(533,727)
TRS	USD (591)	ファンドはUSD 1日SOFR - 10bpsを受け取り、Sherwin Williams + 0bpsを支払う	BNP Paribas	2/9/2022	19,929	19,929
TRS	USD (628)	ファンドはUSD 1日SOFR - 12bpsを受け取り、PPG Industries + 0bpsを支払う	BNP Paribas	2/9/2022	559	559
TRS	USD (9,200)	ファンドはUSD 1日SOFR - 13bpsを受け取り、PPG Industries + 0bpsを支払う	BNP Paribas	2/9/2022	8,188	8,188
TRS	USD (8,412)	ファンドはUSD 1日SOFR - 8bpsを受け取り、PPG Industries + 0bpsを支払う	BNP Paribas	2/9/2022	7,487	7,487
TRS	USD (4,206)	ファンドはUSD 1日SOFR - 8bpsを受け取り、Sherwin Williams + 0bpsを支払う	BNP Paribas	2/9/2022	141,826	141,826
TRS	USD 9,592,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1日SOFR + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(338,749)	(340,440)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	USD 4,985,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(118,812)	(119,871)
TRS	USD 5,107,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(69,147)	(70,331)
TRS	USD 6,356,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	62,864	61,100
TRS	USD 5,494,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(185,614)	(189,313)
TRS	USD 11,034,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(365,803)	(379,267)
TRS	USD 10,762,000	ファンドはUSD 1日SOFR + Obpsを受け取り、Markit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(58,260)	(55,717)
TRS	USD 32,159,000	ファンドはUSD 1日SOFR + Obpsを受け取り、Markit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(100,516)	(104,341)
TRS	USD 6,075,300	ファンドはUSD 1日SOFR + Obpsを受け取り、Markit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	14,026	12,711
TRS	USD 1,922,796	ファンドはUSD 1日SOFR + Obpsを受け取り、Markit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(12,292)	(13,080)
TRS	USD 5,530,000	ファンドはUSD 1日SOFR + Obpsを受け取り、Markit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(237,456)	(245,327)
TRS	EUR 3,200,000	ファンドはEUR 3ヶ月EURIBOR + Obpsを受け取り、Markit iBoxx Euro Liquid High Yield + Obpsを支払う	BNP Paribas	20/12/2022	(74,116)	(75,219)
TRS	EUR 8,179,000	ファンドはiBoxx Euro Corporate + Obpsを受け取り、EUR 3ヶ月EURIBOR + Obpsを支払う	BNP Paribas	20/12/2022	(289,727)	(287,703)
TRS	USD 2,517	ファンドはUSD 1日SOFR + 20bpsを受け取り、S5INDU PERFORMANCE SHELL +0 bpsを支払う	Citibank	9/9/2022	54,137	54,137
TRS	USD (5,000)	ファンドはUSD 1日SOFR - 25bpsを受け取り、Pitney Bowes + 0 bpsを支払う	Citibank	27/12/2022	4,650	4,650
TRS	EUR 300,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、EUR 3ヶ月EURIBOR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(6,187)	(6,304)
TRS	USD 11,032,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	158,811	156,650
TRS	USD 24,515,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(211,457)	(218,164)
TRS	USD 6,356,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(30,294)	(32,033)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	USD 8,170,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(79,829)	(82,202)
TRS	USD 11,034,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(455,317)	(470,651)
TRS	USD 11,034,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(373,515)	(387,316)
TRS	USD 11,052,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(281,909)	(296,097)
TRS	USD 5,524,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(123,521)	(134,920)
TRS	USD 11,047,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(132,461)	(155,256)
TRS	USD 3,668,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(51,492)	(59,750)
TRS	EUR 6,500,000	ファンドはEUR 3ヶ月 EURIBOR + Obpsを受け取り、iboxx Euro Liquid High Yield + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/12/2022	(501,358)	(501,596)
TRS	EUR 2,600,000	ファンドはEUR 3ヶ月 EURIBOR + Obpsを受け取り、iboxx Euro Liquid High Yield + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/12/2022	(168,880)	(169,097)
TRS	EUR 2,370,000	ファンドはEUR 3ヶ月 EURIBOR + Obpsを受け取り、Markit iBoxx Euro Liquid High Yield + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/12/2022	(129,449)	(129,643)
TRS	USD 17,000	ファンドはJPM EMBIG DIV CORE + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	JP Morgan	16/9/2022	(90,837)	(90,837)
TRS	USD 8,274,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	JP Morgan	20/9/2022	(465)	(2,153)
TRS	USD 8,170,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	JP Morgan	20/9/2022	(66,694)	(69,102)
TRS	USD 8,314,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	JP Morgan	20/9/2022	(257,737)	(271,498)
TRS	USD 48,322	ファンドはJPMEMBIG DIV CORE + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + 65bpsを支払う	JP Morgan	15/11/2022	(1,230,313)	(1,230,313)
TRS	USD 47,678	ファンドはJPMEMBIG DIV CORE + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + 65bpsを支払う	JP Morgan	16/11/2022	(1,055,280)	(1,055,280)
TRS	USD 90,094,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2022	2,812,083	2,789,652

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	USD 10,749,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2022	(110,002)	(114,638)
TRS	USD 4,502,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2022	(93,118)	(95,337)
TRS	USD 4,502,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2022	(83,581)	(85,800)
TRS	USD 19,228,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2022	(583,052)	(595,995)
TRS	USD 5,530,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2022	(244,305)	(252,176)
TRS	USD 3,668,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + Obpsを受け取り、USD 1日 SOFR + Obpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2022	(46,062)	(54,321)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 7,946,073,031米ドル)					(23,536,498)	(14,922,666)

CDS: クレジット・デフォルト・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 2022年8月31日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
56,262,071	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.09	29/9/2022	(60,332)	2,016
56,262,071	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.005	29/9/2022	181,261	781,685
6,444,034	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 136	29/9/2022	(36,648)	9,749
790,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1	3/10/2022	211,935	335,363
18,780,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 125	21/12/2022	(21,350)	55,742
2,090,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 105	28/3/2023	(111,386)	14,015
2,090,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 105	28/3/2023	(111,386)	14,015
1,490,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 110	19/4/2023	(88,531)	20,537
2,200,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 110	19/5/2023	(171,437)	37,783
14,380,000	プット	OTC USD/JPY	Barclays	USD 130.04	8/9/2022	(168,493)	41
14,380,000	プット	OTC USD/JPY	Barclays	USD 130.04	8/9/2022	(168,493)	41
32,540,000	プット	OTC USD/JPY	Barclays	USD 115	21/9/2022	(261,296)	-
130,240,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 0.985	13/10/2022	(70,739)	1,071,609
19,570,000	コール	OTC USD/CNH	BNP Paribas	USD 6.8	17/10/2022	125,863	180,658
111,480,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1	2/11/2022	499,472	1,720,442
4,410,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 0.9	12/2/2022	86,455	145,438
18,486,000	コール	OTC USD/CNH	Citibank	USD 6.85	20/9/2022	100,726	174,116
16,596,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 0.98	22/9/2022	(64,075)	62,348
172,500	プット	OTC USD/CNH	Citibank	USD 7	11/10/2022	44,765	71,589
132,000	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 17	10/11/2022	57,279	128,159
15,805,000	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 16.5	10/11/2022	(14,221)	174,576
1,030,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 125	21/12/2022	19,097	61,069
862,500	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 0.85	18/1/2023	(13,901)	29,814
15,986,000	コール	OTC AUD/USD	Deutsche Bank	AUD 0.702	15/9/2022	(68,183)	26,350
16,780,000	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 115	13/9/2022	(36,748)	-
53,255,170	コール	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 6.79	26/9/2022	463,237	895,456
16,282,000	コール	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 6.83	28/9/2022	103,010	199,497
17,195,000	コール	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 6.8	11/10/2022	174,556	282,025
12,117,000	プット	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 0.99	26/10/2022	(14,472)	134,002
43,987,729	コール	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 6.8	27/10/2022	341,815	756,840
1,350,000	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 122	8/12/2022	(120,766)	32,999
895,000	コール	OTC USD/CNH	HSBC Bank	USD 7	12/2/2022	104,632	219,639
21,910,000	コール	OTC USD/CNH	HSBC Bank	USD 6.9	22/9/2022	23,839	120,331
26,043,000	プット	OTC EUR/NOK	HSBC Bank	EUR 9.39	30/9/2022	(270,737)	3,634
10,900,000	コール	OTC EUR/CNH	HSBC Bank	EUR 7	18/11/2022	(8,895)	125,993
37,113,297	プット	OTC EUR/CHF	JP Morgan	EUR 0.965	14/9/2022	(197,113)	78,097
88,628,770	コール	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6.8	15/9/2022	461,112	1,319,128
13,070,000	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 130.04	15/9/2022	(202,090)	1,018
345,000	プット	OTC USD/SEK	JP Morgan	USD 9.5	19/9/2022	(34,074)	81
11,052,000	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 16.9	20/10/2022	(47,813)	177,814
8,993,000	プット	OTC EUR/NOK	JP Morgan	EUR 9.35	26/10/2022	(58,912)	5,400
9,270,000	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 130	15/11/2022	(15,330)	41,124
7,366,000	コール	OTC USD/CLP	Morgan Stanley	USD 70	8/9/2022	(75,997)	205
7,366,000	プット	OTC USD/CLP	Morgan Stanley	USD 970	8/9/2022	372,631	571,366
860,000	コール	OTC USD/CNH	Morgan Stanley	USD 7.2	11/10/2022	7,753	28,823

買建オプション 2022年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
748,680	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 109	12/10/2022	(20,963)	-
16,845,300	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 116	12/10/2022	(82,295)	11
16,300,000	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 134	26/10/2022	(128,740)	121,155
30,341,000	プット	OTC EUR/NOK	Morgan Stanley	EUR 9.65	16/11/2022	(126,753)	145,828
17,387,000	プット	OTC USD/CAD	RBC	USD 1.25	10/4/2022	(50,992)	2,125
64,834,996	プット	OTC USD/JPY	RBC	USD 130	8/9/2022	(817,073)	172
9,290,000	プット	OTC USD/JPY	RBC	USD 127	21/9/2022	(65,727)	282
5,615,000	コール	OTC USD/JPY	RBC	USD 135	10/12/2022	135,928	174,465
2,020,000	コール	OTC EUR/CHF	UBS	EUR 1.1	9/6/2022	(129,952)	-
13,540,000	コール	OTC EUR/CHF	UBS	EUR 1.06	5/9/2022	(70,482)	-
561,600	コール	OTC AUD/USD	UBS	AUD 0.76	22/9/2022	(31,102)	229
1,487	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 400	2/9/2022	(323,553)	556,881
1,249	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 115	16/9/2022	(171,235)	190,472
1,367	プット	Apple	Exchange Traded	USD 125	16/9/2022	(132,846)	7,519
347	プット	Apple	Exchange Traded	USD 140	16/9/2022	(144,934)	10,237
513	コール	BASF	Exchange Traded	EUR 52	16/9/2022	(107,176)	513
1,057	コール	BASF	Exchange Traded	EUR 56	16/9/2022	(176,133)	1,057
366	コール	Cellnex Telecom	Exchange Traded	EUR 54	16/9/2022	(50,472)	-
163	プット	Dollar Tree	Exchange Traded	USD 145	16/9/2022	32,391	147,515
35	コール	Domino's Pizza	Exchange Traded	USD 400	16/9/2022	(47,272)	7,700
111	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 330	16/9/2022	(39,319)	19,203
80	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 350	16/9/2022	(5,620)	80
80	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 850	16/9/2022	(71,465)	1,841
120	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 700	16/9/2022	(101,972)	960
214	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,000	16/9/2022	(108,266)	5,673
120	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 300	16/9/2022	(229,225)	18,668
477	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 400	16/9/2022	(626,899)	144,116
477	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 700	16/9/2022	(519,986)	790,968
836	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 140	16/9/2022	(53,044)	2,091
1,033	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 130	16/9/2022	(33,474)	2,584
175	プット	First Quantum Minerals	Exchange Traded	CAD 18	16/9/2022	(9,538)	1,266
925	プット	Ford Motor	Exchange Traded	USD 10	16/9/2022	(30,973)	925
55	プット	FTSE 100 Index	Exchange Traded	GBP 200	16/9/2022	(79,167)	1,437
55	プット	FTSE 100 Index	Exchange Traded	GBP 7,000	16/9/2022	(180,362)	19,792
363	コール	General Motors	Exchange Traded	USD 38	16/9/2022	(63,858)	73,689
1,058	プット	Intel	Exchange Traded	USD 32.5	16/9/2022	62,180	125,902
44	コール	Intuit	Exchange Traded	USD 490	16/9/2022	(77,120)	6,050
125	コール	Lions Gate Entertainment	Exchange Traded	USD 14	16/9/2022	(2,836)	1,875
530	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 290	16/9/2022	(379,866)	21,465

買建オプション 2022年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
399	コール	Mosaic	Exchange Traded	USD 70	16/9/2022	(234,082)	5,187
120	プット	Sherwin-Williams	Exchange Traded	USD 240	16/9/2022	(49,948)	97,200
1,081	コール	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 97.125	16/9/2022	(126,063)	13,513
2,531	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 430	16/9/2022	(1,231,911)	56,947
75	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 405	16/9/2022	64,004	84,225
675	プット	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 15	16/9/2022	(28,330)	675
37	コール	United Rentals	Exchange Traded	USD 350	16/9/2022	(26,778)	925
75	コール	Valero Energy	Exchange Traded	USD 110	16/9/2022	8,270	63,187
144	プット	Vertiv Holdings	Exchange Traded	USD 7.5	16/9/2022	(9,033)	144
185	コール	Walt Disney	Exchange Traded	USD 125	16/9/2022	(58,872)	4,440
750	コール	Western Digital	Exchange Traded	USD 60	16/9/2022	(30,568)	3,375
141	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 118.5	23/9/2022	565	58,383
166	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 116.5	23/9/2022	(1,188)	118,016
442	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 116	23/9/2022	(2,106)	238,265
1,326	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 117	23/9/2022	96,078	1,232,766
10	プット	Nasdaq-100 Index	Exchange Traded	USD 900	30/9/2022	340,295	654,750
57	プット	Nasdaq-100 Index	Exchange Traded	USD 100	30/9/2022	2,754,471	4,485,615
482	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 410	30/9/2022	459,930	798,192
2,660	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 415	30/9/2022	3,356,440	5,274,780
489	プット	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 96.125	14/10/2022	(13,267)	110,025
425	プット	Carnival	Exchange Traded	USD 5	21/10/2022	(10,044)	3,613
55	プット	Change Healthcare	Exchange Traded	USD 17	21/10/2022	(68)	1,375
38	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 330	21/10/2022	(39,700)	22,705
266	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,000	21/10/2022	(91,321)	50,163
210	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 400	21/10/2022	50,846	167,337
135	プット	iHeartCommunications	Exchange Traded	USD 7.5	21/10/2022	(5,932)	6,750
425	プット	KB Home	Exchange Traded	USD 25	21/10/2022	3,015	30,812
109	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 290	21/10/2022	(35,168)	33,245
8	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 300	21/10/2022	(13,538)	18,800
23	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 500	21/10/2022	(219,472)	54,395
125	プット	Sabre	Exchange Traded	USD 5	21/10/2022	(6,799)	938
160	プット	Sabre	Exchange Traded	USD 6	21/10/2022	(3,242)	3,440
1,088	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 430	21/10/2022	(527,385)	236,640
15	コール	Tesla	Exchange Traded	USD 316.67	21/10/2022	(10,160)	14,663
99	コール	Tesla	Exchange Traded	USD 320	21/10/2022	(75,149)	88,605
185	コール	Walt Disney	Exchange Traded	USD 130	21/10/2022	(50,270)	15,818
350	プット	Xerox Holdings	Exchange Traded	USD 15	21/10/2022	4,948	17,500
86	コール	Dynatrace	Exchange Traded	USD 45	18/11/2022	(33,278)	14,620
109	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 330	18/11/2022	(1,878)	117,175

買建オプション 2022年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
54	コール	Generac Holdings	Exchange Traded	USD 300	18/11/2022	(81,470)	21,600
5	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 300	18/11/2022	(5,586)	23,475
138	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 380	18/11/2022	66,312	140,898
39	コール	Tesla	Exchange Traded	USD 320	18/11/2022	(29,239)	57,037
250	コール	Western Digital	Exchange Traded	USD 65	18/11/2022	(18,156)	3,500
375	プット	Ally Financial	Exchange Traded	USD 20	16/12/2022	(15,148)	6,563
352	コール	Commerzbank	Exchange Traded	EUR 9	16/12/2022	(27,995)	4,050
45	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 4,000	16/12/2022	(26,406)	10,647
130	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 100	16/12/2022	(85,283)	86,942
137	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 300	16/12/2022	(12,335)	148,092
400	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 100	16/12/2022	(41,676)	8,504
425	プット	Ford Motor	Exchange Traded	USD 8	16/12/2022	(17,519)	3,188
48	コール	Lions Gate Entertainment	Exchange Traded	USD 15	16/12/2022	(803)	1,320
14	コール	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton	Exchange Traded	EUR 640	16/12/2022	13,967	75,457
4	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 300	16/12/2022	(2,089)	28,080
1,082	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 350	16/12/2022	(1,223,449)	696,267
249	プット	STOXX Europe 600 Automobiles & Parts Index	Exchange Traded	EUR 350	16/12/2022	(82,741)	66,013
146	プット	STOXX Europe 600 Automobiles & Parts Index	Exchange Traded	EUR 470	16/12/2022	(10,616)	153,366
47	プット	STOXX Europe 600 Chemicals Index	Exchange Traded	EUR 840	16/12/2022	(20,299)	14,811
103	プット	STOXX Europe 600 Chemicals Index	Exchange Traded	EUR 40	16/12/2022	28,699	180,328
28	プット	STOXX Europe 600 Personal & Household Goods Index	Exchange Traded	EUR 800	16/12/2022	(16,212)	15,056
79	コール	Abbott Laboratories	Exchange Traded	USD 125	20/1/2023	(42,441)	5,530
14	コール	Adobe	Exchange Traded	USD 480	20/1/2023	(38,822)	11,235
20	コール	Align Technology	Exchange Traded	USD 290	20/1/2023	(46,833)	37,900
140	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 125	20/1/2023	(61,484)	60,900
5	コール	Booking Holdings	Exchange Traded	USD 600	20/1/2023	(79,939)	11,550
88	コール	Dynatrace	Exchange Traded	USD 45	20/1/2023	(25,035)	23,980
27	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 340	20/1/2023	(22,237)	34,897
88	コール	Glencore	Exchange Traded	GBP 5.8	20/1/2023	(36,841)	12,627
13	コール	Humana	Exchange Traded	USD 500	20/1/2023	8,586	36,660
15	コール	Intuit	Exchange Traded	USD 450	20/1/2023	(818)	59,625
91	コール	Otis Worldwide	Exchange Traded	USD 85	20/1/2023	(21,363)	10,920
500	プット	PG&E	Exchange Traded	USD 7	20/1/2023	(4,959)	7,500
65	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 6,000	20/1/2023	(44,506)	488
48	コール	salesforce.com	Exchange Traded	USD 210	20/1/2023	(57,917)	11,712
48	コール	salesforce.com	Exchange Traded	USD 200	20/1/2023	(48,289)	18,240

買建オプション 2022年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
16	コール	ServiceNow	Exchange Traded	USD 550	20/1/2023	(65,236)	24,320
62	コール	XPO Logistics	Exchange Traded	USD 57.5	20/1/2023	(13,716)	28,830
651	コール	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 97.125	10/3/2023	(298,080)	117,994
649	コール	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 96.75	10/3/2023	(394,443)	214,981
652	コール	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 96.375	10/3/2023	(290,316)	387,125
1,089	コール	Nasdaq-100 Index	Goldman Sachs	USD 707.725	16/9/2022	(236,074)	1,421
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 896,415,716米ドル)						(3,419,666)	29,778,206

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 2022年8月31日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(112,608,663)	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 0.975	29/9/2022	55,177	(451,475)
(18,780,000)	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 120	21/12/2022	12,860	(16,531)
(14,380,000)	プット	OTC USD/JPY	Barclays	USD 124.71	8/9/2022	56,082	-
(14,380,000)	プット	OTC USD/JPY	Barclays	USD 124.71	8/9/2022	56,082	-
(32,540,000)	プット	OTC USD/JPY	Barclays	USD 112	21/9/2022	150,986	-
(130,240,000)	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 0.965	13/10/2022	30,954	(533,475)
(111,480,000)	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 0.98	2/11/2022	(206,478)	(968,873)
(18,486,000)	コール	OTC USD/CNH	Citibank	USD 6.95	20/9/2022	(22,944)	(51,043)
(22,128,000)	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 0.95	22/9/2022	34,842	(14,639)
(23,707,000)	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 15.75	10/11/2022	867	(76,183)
(4,390,000)	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 17	10/11/2022	12,649	(140,308)
(23,980,000)	コール	OTC AUD/USD	Deutsche Bank	AUD 0.716	15/9/2022	40,367	(8,363)
(16,780,000)	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 109	13/9/2022	41,950	-
(53,255,170)	コール	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 6.99	26/9/2022	753	(116,994)
(16,282,000)	コール	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 6.93	28/9/2022	(22,938)	(72,859)
(12,117,000)	プット	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 0.96	26/10/2022	29,644	(38,324)
(43,987,729)	コール	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 7.05	27/10/2022	(18,960)	(129,809)
(43,987,729)	コール	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 7.05	27/10/2022	(55,469)	(129,809)
(21,910,000)	コール	OTC USD/CNH	HSBC Bank	USD 7	22/9/2022	1,871	(36,449)
(37,113,297)	プット	OTC EUR/CHF	JP Morgan	EUR 0.94	14/9/2022	50,549	(7,085)
(88,628,770)	コール	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 7	15/9/2022	154,691	(95,951)
(13,070,000)	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 124.71	15/9/2022	90,049	(3)
(17,195,000)	コール	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6.8	11/10/2022	(120,392)	(282,025)
(19,570,000)	コール	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6.8	17/10/2022	(20,674)	(180,659)
(16,578,000)	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 16.35	20/10/2022	35,841	(102,337)
(7,368,000)	コール	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 18	20/10/2022	9,113	(61,583)
(9,270,000)	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 125	15/11/2022	5,801	(11,719)
(7,366,000)	コール	OTC USD/CLP	Morgan Stanley	USD 40	8/9/2022	115,068	(659)
(11,048,000)	プット	OTC USD/CLP	Morgan Stanley	USD 920	8/9/2022	(236,018)	(332,302)
(5,615,000)	コール	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 135	12/10/2022	(126,704)	(174,465)
(16,300,000)	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 130	26/10/2022	75,580	(44,975)
(30,341,000)	プット	OTC EUR/NOK	Morgan Stanley	EUR 9.35	16/11/2022	37,045	(36,464)
(18,717,000)	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 109	10/12/2022	31,295	-
(64,834,996)	プット	OTC USD/JPY	RBC	USD 125	8/9/2022	299,927	-
(4,847)	プット	S&P 500 Index	Citibank	USD 700	16/9/2022	710,775	(55,051)
(1,137)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 380	2/9/2022	234,331	(9,665)
(1,037)	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 125	16/9/2022	100,376	(12,963)
(1,714)	プット	Apple	Exchange Traded	USD 115	16/9/2022	73,409	(2,571)
(163)	プット	Dollar Tree	Exchange Traded	USD 125	16/9/2022	28,426	(12,714)
(954)	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 550	16/9/2022	1,258,565	(712,468)
(110)	プット	FTSE 100 Index	Exchange Traded	GBP 600	16/9/2022	245,617	(7,981)
(530)	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 310	16/9/2022	53,938	(4,770)
(75)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 385	16/9/2022	(19,151)	(26,325)
(37)	プット	United Rentals	Exchange Traded	USD 270	16/9/2022	9,821	(11,748)

売建オプション 2022年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(75)	プット	Valero Energy	Exchange Traded	USD 110	16/9/2022	17,982	(20,850)
(185)	プット	Walt Disney	Exchange Traded	USD 110	16/9/2022	(13,455)	(32,468)
(1,722)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 115	23/9/2022	33,258	(484,313)
(575)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 114	23/9/2022	(5,366)	(76,367)
(87)	プット	US Treasury 5 Year Note	Exchange Traded	USD 111.25	23/9/2022	(10,385)	(73,406)
(57)	プット	Nasdaq-100 Index	Exchange Traded	USD 100	30/9/2022	(1,006,362)	(1,633,620)
(10)	プット	Nasdaq-100 Index	Exchange Traded	USD 900	30/9/2022	(117,437)	(227,400)
(2,660)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 390	30/9/2022	(1,247,280)	(1,956,430)
(482)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 385	30/9/2022	(166,780)	(284,621)
(434)	プット	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 96.5	14/10/2022	(139,323)	(322,788)
(38)	プット	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 260	21/10/2022	21,404	(8,151)
(210)	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 200	21/10/2022	(24,315)	(81,935)
(109)	プット	Microsoft	Exchange Traded	USD 250	21/10/2022	(25,239)	(63,765)
(21)	プット	Nasdaq-100 Index	Exchange Traded	USD 600	21/10/2022	(242,778)	(518,595)
(23)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 250	21/10/2022	148,874	(24,265)
(2,175)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 440	21/10/2022	662,857	(204,450)
(15)	プット	Tesla	Exchange Traded	USD 233.33	21/10/2022	1,813	(12,075)
(219)	プット	Tesla	Exchange Traded	USD 240	21/10/2022	(1,685)	(208,598)
(5)	プット	Tesla	Exchange Traded	USD 700	21/10/2022	(196,675)	(210,563)
(185)	プット	Walt Disney	Exchange Traded	USD 110	21/10/2022	(32,326)	(74,463)
(86)	プット	Dynatrace	Exchange Traded	USD 35	18/11/2022	4,181	(18,490)
(109)	プット	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 260	18/11/2022	6,950	(40,766)
(54)	プット	Generac Holdings	Exchange Traded	USD 220	18/11/2022	(67,783)	(116,640)
(138)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 340	18/11/2022	(20,146)	(46,575)
(39)	プット	Tesla	Exchange Traded	USD 240	18/11/2022	(9,740)	(55,478)
(352)	プット	Commerzbank	Exchange Traded	EUR 7.2	16/12/2022	(18,534)	(36,448)
(14)	プット	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton	Exchange Traded	EUR 520	16/12/2022	18,970	(14,216)
(438)	プット	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 96.25	16/12/2022	(22,833)	(213,525)
(1,298)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 310	16/12/2022	794,702	(332,937)
(146)	プット	STOXX Europe 600 Automobiles & Parts Index	Exchange Traded	EUR 400	16/12/2022	4,192	(67,554)
(103)	プット	STOXX Europe 600 Chemicals Index	Exchange Traded	EUR 940	16/12/2022	(11,462)	(79,087)
(977)	プット	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 96.25	13/1/2023	(93,948)	(848,769)
(977)	プット	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 96	13/1/2023	(63,144)	(549,563)
(79)	プット	Abbott Laboratories	Exchange Traded	USD 105	20/1/2023	(13,410)	(55,103)
(14)	プット	Adobe	Exchange Traded	USD 400	20/1/2023	(15,462)	(64,085)
(20)	プット	Align Technology	Exchange Traded	USD 230	20/1/2023	3,947	(47,500)
(140)	プット	Alphabet	Exchange Traded	USD 100	20/1/2023	15,505	(65,100)

売建オプション 2022年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(5)	プット	Booking Holdings	Exchange Traded	USD 2,000	20/1/2023	(47,141)	(114,000)
(88)	プット	Dynatrace	Exchange Traded	USD 35	20/1/2023	11,069	(26,180)
(27)	プット	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 280	20/1/2023	7,392	(35,303)
(88)	プット	Glencore	Exchange Traded	GBP 4.5	20/1/2023	(7,168)	(40,457)
(13)	プット	Humana	Exchange Traded	USD 390	20/1/2023	19,223	(7,865)
(15)	プット	Intuit	Exchange Traded	USD 370	20/1/2023	20,028	(27,000)
(91)	プット	Otis Worldwide	Exchange Traded	USD 65	20/1/2023	4,976	(17,973)
(96)	プット	salesforce.com	Exchange Traded	USD 160	20/1/2023	(29,748)	(140,400)
(16)	プット	ServiceNow	Exchange Traded	USD 450	20/1/2023	(11,077)	(79,280)
(62)	プット	XPO Logistics	Exchange Traded	USD 45	20/1/2023	7,588	(17,205)
(651)	コール	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 97.625	10/3/2023	158,017	(207,506)
(652)	コール	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 96.75	10/3/2023	31,609	(684,600)
(649)	コール	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 97.125	3/10/2023	189,657	(425,906)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 791,614,104米ドル)						1,818,765	(15,966,251)

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 2022年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益 / (損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR 6,550,000	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 ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2027より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Bank of America	21/9/2022	(96,317)	42,374
EUR 6,550,000	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 ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2027より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Bank of America	21/9/2022	(32,871)	42,374
EUR 19,800,000	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 ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Bank of America	21/9/2022	(172,863)	233,568
USD 5,000,000	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 CDX.NA.HY.38.V2の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Bank of America	19/10/2022	7,694	46,205
USD 2,500,000	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 CDX.NA.HY.38.V2の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Bank of America	19/10/2022	4,590	23,102
USD 16,100,000	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USD SOFRの変動金利を15/6/2024より毎年受け取り、3.9%の固定金利を15/12/2023より半年毎に支払う。	Bank of America	13/6/2023	(117,700)	164,050
USD 19,255,000	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30/11/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を30/5/2025より毎年支払う。	Bank of America	28/5/2024	(113,222)	741,700
USD 19,255,000	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USD SOFRの変動金利を30/5/2025より毎年受け取り、2.62%の固定金利を30/11/2024より半年毎に支払う。	Bank of America	28/5/2024	175,100	1,030,022
USD 9,295,000	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USD SOFRの変動金利を25/8/2028より毎年受け取り、3.15%の固定金利を25/2/2028より半年毎に支払う。	Bank of America	23/8/2027	21,114	270,220
EUR 19,400,000	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 ITRAXX.FINSR.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、1%の固定金利を支払う。	Barclays	21/9/2022	(37,371)	27,973
EUR 19,300,000	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 ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	21/9/2022	(165,237)	22,841

買建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR 12,800,000	ファンドは、コール・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5%の固定金利を受け取り、ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に支払う。	Barclays	19/10/2022	(22,852)	7,847
EUR 7,400,000	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ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	19/10/2022	(15,938)	76,736
EUR 7,400,000	ファンドは、コール・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5%の固定金利を受け取り、ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に支払う。	Barclays	19/10/2022	(85)	1,416
EUR 6,700,000	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ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	19/10/2022	14,490	97,891
USD 20,250,000	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USD SOFRの変動金利を26/6/2024より毎年受け取り、2.96%の固定金利を26/12/2023より半年毎に支払う。	Barclays	22/6/2023	(135,814)	638,748
USD 20,250,000	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2.96%の固定金利を26/12/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を26/6/2024より毎年支払う。	Barclays	22/6/2023	10,078	784,641
EUR 36,480,000	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0.05%の固定金利を4/3/2025より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を4/9/2024より半年毎に支払う。	Barclays	29/2/2024	(124,752)	31,378
USD 4,070,000	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2.94%の固定金利を12/12/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を12/6/2025より毎年支払う。	Barclays	10/6/2024	27,662	214,678
USD 4,070,000	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USD SOFRの変動金利を12/6/2025より毎年受け取り、2.94%の固定金利を12/12/2024より半年毎に支払う。	Barclays	10/6/2024	(17,751)	169,265
USD 16,800,000	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USD SOFRの変動金利を25/4/2024より毎年受け取り、3.25%の固定金利を25/10/2023より半年毎に支払う。	BNP Paribas	21/4/2023	(28,804)	334,076
EUR 14,030,000	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EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を15/3/2023より半年毎に受け取り、2.63%の固定金利を15/9/2023より毎年支払う。	Citibank	13/9/2022	(136,424)	49,569

買建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 8,085,000	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USD SOFRの変動金利を11/6/2025より毎年受け取り、2.805%の固定金利を11/12/2024より半年毎に支払う。	Citibank	7/6/2024	14,781	374,564
USD 8,085,000	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2.805%の固定金利を11/12/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を11/6/2025より毎年支払う。	Citibank	7/6/2024	15,993	375,776
USD 10,460,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.232%の固定金利を27/8/2025より半年毎に受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を27/2/2026より毎年支払う。	Citibank	25/2/2025	(155,781)	100,728
USD 10,460,000	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USD 1日SOFRの変動金利を27/2/2026より毎年受け取り、1.232%の固定金利を27/8/2025より半年毎に支払う。	Citibank	25/2/2025	531,548	1,408,319
USD 10,193,500	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2.79%の固定金利を29/12/2028より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を29/6/2029より毎年支払う。	Citibank	27/6/2028	(22,671)	586,397
USD 33,500,000	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3.24%の固定金利を16/12/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を16/6/2024より毎年支払う。	Deutsche Bank	14/6/2023	445,320	1,771,920
USD 33,500,000	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USD SOFRの変動金利を16/6/2024より毎年受け取り、3.24%の固定金利を16/12/2023より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	14/6/2023	(573,341)	753,259
USD 17,655,000	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2.43%の固定金利を14/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/8/2024より毎年支払う。	Deutsche Bank	10/8/2023	(246,627)	368,649
USD 17,655,000	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USD SOFRの変動金利を14/8/2024より毎年受け取り、2.43%の固定金利を14/2/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	10/8/2023	386,030	1,001,306
EUR 71,730,000	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0.35%の固定金利を12/2/2025より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を12/8/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	8/2/2024	(212,489)	92,356
USD 10,890,000	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USD SOFRの変動金利を9/4/2027より毎年受け取り、2.342%の固定金利を9/10/2026より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	7/4/2026	(139,695)	822,717

買建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 10,890,000	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2.342%の固定金利を9/10/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を9/4/2027より毎年支払う。	Deutsche Bank	7/4/2026	17,564	422,987
USD 6,000,000	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CDX.NA.HY.38.V2の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	21/9/2022	(15,843)	37,617
USD 427,133,762	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USD SOFRの変動金利を13/2/2024より毎年受け取り、3.75%の固定金利を13/8/2023より毎年支払う。	Goldman Sachs	9/2/2023	213,469	1,494,870
GBP 229,114,058	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GBP SONIAの変動金利を3/4/2024より毎年受け取り、2.47%の固定金利を3/4/2023より毎年支払う。	Goldman Sachs	3/4/2023	3,311,506	4,812,317
EUR 315,429,398	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EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を4/11/2023より半年毎に受け取り、1%の固定金利を4/5/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	2/5/2023	3,107,925	4,782,149
USD 9,295,000	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USD SOFRの変動金利を23/6/2028より毎年受け取り、3.29%の固定金利を23/12/2027より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	21/6/2027	(51,752)	249,871
USD 33,073,000	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2.8725%の固定金利を1/3/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を1/9/2024より毎年支払う。	JP Morgan	30/8/2023	43,029	1,270,038
USD 33,073,000	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USD SOFRの変動金利を1/9/2024より毎年受け取り、2.8725%の固定金利を1/3/2024より半年毎に支払う。	JP Morgan	30/8/2023	(6,894)	1,220,114
USD 2,255,000	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USD 1日SOFRの変動金利を29/4/2039より毎年受け取り、2.725%の固定金利を29/10/2038より半年毎に支払う。	JP Morgan	27/4/2038	10,333	102,588
USD 2,255,000	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2.725%の固定金利を29/10/2038より半年毎に受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を29/4/2039より毎年支払う。	JP Morgan	27/4/2038	(95,404)	145,394
USD 2,777,500	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USD 1日SOFRの変動金利を24/2/2040より毎年受け取り、2.62%の固定金利を24/8/2029より半年毎に支払う。	JP Morgan	22/2/2039	10,258	128,206

買建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 2,777,500	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2.62%の固定金利を24/8/2039より半年毎に受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を24/2/2040より毎年支払う。	JP Morgan	22/2/2039	(110,549)	173,189
EUR 6,666,667	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ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Morgan Stanley	19/10/2022	65,081	165,326
USD 29,055,610	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2.26%の固定金利を30/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を31/10/2023より毎年支払う。	Morgan Stanley	27/10/2022	(211,621)	58,925
USD 551,236,172	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0.8%の固定金利を20/9/2023より半年毎に受け取り、USD 3ヶ月BBA SOFRの変動金利を20/6/2023より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	16/3/2023	(1,748,367)	4,564
USD 4,280,000	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2.195%の固定金利を1/10/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を1/4/2025より毎年支払う。	Morgan Stanley	28/3/2024	(107,022)	96,813
USD 4,280,000	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USD SOFRの変動金利を1/4/2025より毎年受け取り、2.195%の固定金利を1/10/2024より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	28/3/2024	108,272	312,107
USD 4,215,000	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1.169%の固定金利を9/12/2025より半年毎に受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を9/6/2026より毎年支払う。	UBS	5/6/2025	(57,167)	41,833
USD 4,215,000	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USD 1日SOFRの変動金利を9/6/2026より毎年受け取り、1.169%の固定金利を9/12/2025より半年毎に支払う。	UBS	5/6/2025	211,654	586,290
EUR 7,557,000	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EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を20/7/2028より半年毎に受け取り、3%の固定金利を20/1/2029より毎年支払う。	UBS	18/1/2028	(48,277)	452,943
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 925,357,362米ドル)				3,731,990	29,264,806

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 2022年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (6,600,000)	ファンドは、コール・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ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Bank of America	19/10/2022	61,945	(31,033)
USD (5,325,000)	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USD SOFRの変動金利を7/11/2023より毎年受け取り、2.56%の固定金利を7/5/2023より半年毎に支払う。	Bank of America	3/11/2022	68,778	(35,192)
USD (5,325,000)	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3.06%の固定金利を7/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を7/11/2023より毎年支払う。	Bank of America	3/11/2022	31,408	(72,563)
USD (9,180,000)	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USD SOFRの変動金利を16/11/2023より毎年受け取り、2.44%の固定金利を16/5/2023より半年毎に支払う。	Bank of America	14/11/2022	100,401	(50,084)
USD (24,690,000)	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2.475%の固定金利を14/8/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/2/2024より毎年支払う。	Bank of America	10/2/2023	(565,733)	(1,224,956)
USD (24,690,000)	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USD SOFRの変動金利を14/2/2024より毎年受け取り、2.475%の固定金利を14/8/2023より半年毎に支払う。	Bank of America	10/2/2023	349,303	(309,920)
USD (9,388,000)	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USD SOFRの変動金利を15/3/2024より毎年受け取り、1.93%の固定金利を15/9/2023より半年毎に支払う。	Bank of America	13/3/2023	262,681	(46,418)
USD (9,388,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.93%の固定金利を15/9/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を15/3/2024より毎年支払う。	Bank of America	13/3/2023	(509,739)	(818,839)
USD (9,700,000)	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USD SOFRの変動金利を14/4/2024より毎年受け取り、2.605%の固定金利を14/10/2023より半年毎に支払う。	Bank of America	12/4/2023	175,785	(194,270)
USD (9,700,000)	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2.605%の固定金利を14/10/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/4/2024より毎年支払う。	Bank of America	12/4/2023	(61,905)	(431,960)
USD (28,693,986)	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USD SOFRの変動金利を20/4/2024より毎年受け取り、3.45%の固定金利を20/10/2023より半年毎に支払う。	Bank of America	18/4/2023	2,106	(431,890)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (128,790,000)	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%の固定金利を15/12/2023より毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を15/6/2024より毎年支払う。	Bank of America	13/6/2023	137,282	(144,446)
USD (17,980,000)	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2.765%の固定金利を26/12/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を26/6/2025より毎年支払う。	Bank of America	24/6/2024	8,024	(248,640)
USD (17,980,000)	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USD SOFRの変動金利を26/6/2025より毎年受け取り、2.765%の固定金利を26/12/2024より半年毎に支払う。	Bank of America	24/6/2024	39,236	(217,429)
USD (31,877,988)	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2.855%の固定金利を28/2/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を28/8/2026より毎年支払う。	Bank of America	26/8/2025	35,069	(1,670,403)
USD (31,877,988)	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USD SOFRの変動金利を28/8/2026より毎年受け取り、2.855%の固定金利を28/2/2026より半年毎に支払う。	Bank of America	26/8/2025	(106,186)	(1,811,658)
USD (4,647,500)	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USD SOFRの変動金利を25/8/2028より毎年受け取り、2.15%の固定金利を25/2/2028より半年毎に支払う。	Bank of America	23/8/2027	597	(110,023)
EUR (6,400,000)	ファンドは、コール・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ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	21/9/2022	79,816	(22,942)
EUR (10,000,000)	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ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	21/9/2022	65,877	(35,490)
EUR (6,700,000)	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、ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に支払う。	Barclays	21/9/2022	(100,643)	(231,857)
EUR (7,400,000)	ファンドは、コール・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ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	19/10/2022	42,196	(34,795)
EUR (21,485,000)	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ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	19/10/2022	(345,240)	(532,805)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (6,600,000)	ファンドは、コール・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ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	19/10/2022	45,825	(72,402)
EUR (6,700,000)	ファンドは、コール・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ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	16/11/2022	26,528	(46,686)
EUR (6,600,000)	ファンドは、コール・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ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	16/11/2022	28,591	(45,989)
USD (14,900,000)	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1.178%の固定金利を11/7/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を11/1/2024より毎年支払う。	Barclays	9/1/2023	(29,820)	(2,209,461)
USD (44,130,000)	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USD 1日SOFRの変動金利を16/1/2024より毎年受け取り、1.25%の固定金利を16/7/2023より半年毎に支払う。	Barclays	12/1/2023	175,775	(2,069)
USD (44,130,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.75%の固定金利を16/7/2023より半年毎に受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を16/1/2024より毎年支払う。	Barclays	12/1/2023	(1,278,867)	(1,456,711)
EUR (4,375,000)	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2.7%の固定金利を25/1/2024より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を25/7/2023より半年毎に支払う。	Barclays	23/1/2023	(39,949)	(99,376)
USD (9,700,000)	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USD SOFRの変動金利を17/4/2024より毎年受け取り、2.63%の固定金利を17/10/2023より半年毎に支払う。	Barclays	13/4/2023	155,449	(202,966)
USD (9,700,000)	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2.63%の固定金利を17/10/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を17/4/2024より毎年支払う。	Barclays	13/4/2023	(61,098)	(419,513)
USD (19,790,000)	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USD SOFRの変動金利を16/8/2024より毎年受け取り、1.48%の固定金利を16/2/2024より半年毎に支払う。	Barclays	14/8/2023	15,870	(91,269)
USD (19,790,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.48%の固定金利を16/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を16/8/2024より毎年支払う。	Barclays	14/8/2023	329,799	(2,366,151)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (72,960,000)	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1.05%の固定金利を4/3/2025より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を4/9/2024より半年毎に支払う。	Barclays	29/2/2024	(1,445,917)	(1,997,296)
USD (17,980,000)	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3.18%の固定金利を20/12/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を20/6/2025より毎年支払う。	Barclays	17/6/2024	70,600	(191,458)
USD (17,980,000)	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USD SOFRの変動金利を20/6/2025より毎年受け取り、3.18%の固定金利を20/12/2024より半年毎に支払う。	Barclays	17/6/2024	(31,593)	(293,651)
USD (17,385,000)	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2.735%の固定金利を26/12/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を26/6/2025より毎年支払う。	Barclays	24/6/2024	(1,287)	(244,894)
USD (17,385,000)	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USD SOFRの変動金利を20/6/2025より毎年受け取り、2.735%の固定金利を26/12/2024より半年毎に支払う。	Barclays	24/6/2024	38,325	(205,282)
USD (1,255,000)	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USD SOFRの変動金利を14/3/2030より毎年受け取り、1.4075%の固定金利を14/3/2030より半年毎に支払う。	Barclays	12/3/2029	2,803	(72,657)
USD (1,255,000)	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2.79%の固定金利を14/9/2029より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/3/2030より毎年支払う。	Barclays	12/3/2029	4,811	(79,814)
EUR (12,900,000)	ファンドは、コール・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ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	BNP Paribas	21/9/2022	119,217	(22,363)
USD (134,000,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4%の固定金利を25/10/2023より毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を25/4/2024より毎年支払う。	BNP Paribas	21/4/2023	38,616	(383,484)
EUR (14,030,000)	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3.13%の固定金利を15/9/2023より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を15/3/2023より半年毎に支払う。	Citibank	13/9/2022	48,366	(2,160)
USD (9,610,000)	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USD SOFRの変動金利を3/10/2023より毎年受け取り、2.07%の固定金利を3/4/2023より半年毎に支払う。	Citibank	29/9/2022	167,844	(1,292)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (9,610,000)	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2.57%の固定金利を3/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を3/10/2023より毎年支払う。	Citibank	29/9/2022	(162,499)	(327,791)
USD (54,305,155)	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2.88%の固定金利を2/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を2/11/2023より毎年支払う。	Citibank	31/10/2022	(712,717)	(1,109,144)
USD (57,080,119)	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3.75%の固定金利を9/11/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を9/5/2024より毎年支払う。	Citibank	5/5/2023	348,327	(610,619)
USD (53,491,389)	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3.67%の固定金利を27/12/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を27/6/2024より毎年支払う。	Citibank	23/6/2023	180,433	(733,185)
USD (45,020,000)	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USD SOFRの変動金利を21/9/2023より毎年受け取り、1.95%の固定金利を21/3/2023より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	19/9/2022	144,064	-
USD (5,665,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.54%の固定金利を12/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を12/10/2023より毎年支払う。	Deutsche Bank	7/10/2022	25,389	(676,020)
USD (9,830,000)	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USD SOFRの変動金利を14/10/2023より毎年受け取り、2.34%の固定金利を14/4/2023より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	12/10/2022	151,119	(15,991)
USD (9,830,000)	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2.84%の固定金利を14/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/10/2023より毎年支払う。	Deutsche Bank	12/10/2022	(4,036)	(192,281)
USD (7,650,000)	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2.78%の固定金利を17/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を17/10/2023より毎年支払う。	Deutsche Bank	13/10/2022	(37,122)	(174,822)
USD (7,650,000)	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USD SOFRの変動金利を17/10/2023より毎年受け取り、2.28%の固定金利を17/4/2023より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	13/10/2022	104,857	(9,893)
USD (5,665,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.535%の固定金利を17/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を17/10/2023より毎年支払う。	Deutsche Bank	13/10/2022	26,502	(678,343)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (18,760,000)	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USD 1日SOFRの変動金利を20/1/2024より毎年受け取り、1.36%の固定金利を20/7/2023より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	18/1/2023	74,838	(1,327)
USD (28,120,000)	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USD SOFRの変動金利を13/4/2024より毎年受け取り、2.8825%の固定金利を13/10/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	11/4/2023	172,010	(117,275)
USD (28,120,000)	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2.8825%の固定金利を13/10/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を13/4/2024より毎年支払う。	Deutsche Bank	11/4/2023	(89,476)	(378,760)
USD (9,266,000)	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2.765%の固定金利を18/11/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を18/5/2024より毎年支払う。	Deutsche Bank	16/5/2023	(5,192)	(352,667)
USD (9,266,000)	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USD SOFRの変動金利を18/5/2024より毎年受け取り、2.765%の固定金利を18/11/2023より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	16/5/2023	88,796	(258,679)
USD (4,669,000)	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USD SOFRの変動金利を21/7/2024より毎年受け取り、2.75%の固定金利を21/1/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	19/7/2023	24,670	(144,746)
USD (4,669,000)	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2.75%の固定金利を21/1/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を21/7/2024より毎年支払う。	Deutsche Bank	19/7/2023	(22,774)	(190,227)
USD (12,708,000)	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2.435%の固定金利を14/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/8/2024より毎年支払う。	Deutsche Bank	10/8/2023	(271,619)	(717,352)
USD (12,708,000)	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USD SOFRの変動金利を14/8/2024より毎年受け取り、2.435%の固定金利を14/2/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	10/8/2023	178,467	(267,266)
EUR (71,730,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.35%の固定金利を12/2/2025より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を12/8/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	8/2/2024	(1,203,557)	(1,653,665)
USD (3,990,268)	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USD SOFRの変動金利を8/5/2025より毎年受け取り、2.75%の固定金利を8/11/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	6/5/2024	8,788	(111,319)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (3,990,268)	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USD SOFRの変動金利を8/5/2025より毎年受け取り、2.75%の固定金利を8/11/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	6/5/2024	11,147	(108,960)
USD (17,385,000)	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USD SOFRの変動金利を20/6/2025より毎年受け取り、2.78%の固定金利を26/12/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	24/6/2024	33,699	(212,733)
USD (17,385,000)	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2.78%の固定金利を26/12/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を20/6/2025より毎年支払う。	Deutsche Bank	24/6/2024	8,237	(238,195)
USD (30,000,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.15%の固定金利を18/12/2025より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を18/6/2026より毎年支払う。	Deutsche Bank	16/6/2025	427,647	(1,259,853)
USD (30,000,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を18/6/2026より毎年受け取り、3.15%の固定金利を18/12/2025より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	16/6/2025	(408,314)	(2,095,814)
USD (18,214,776)	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USD SOFRの変動金利を30/7/2026より毎年受け取り、2.555%の固定金利を30/1/2026より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	28/7/2025	130,763	(803,655)
USD (5,506,299)	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2.555%の固定金利を30/1/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を30/7/2026より毎年支払う。	Deutsche Bank	28/7/2025	(66,343)	(348,816)
USD (5,506,299)	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USD SOFRの変動金利を30/7/2026より毎年受け取り、2.555%の固定金利を30/1/2026より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	28/7/2025	39,530	(242,944)
USD (18,214,776)	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2.555%の固定金利を30/1/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を30/7/2026より毎年支払う。	Deutsche Bank	28/7/2025	(219,461)	(1,153,879)
USD (615,318)	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USD SOFRの変動金利を31/7/2026より毎年受け取り、2.545%の固定金利を31/1/2026より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	29/7/2025	3,755	(26,950)
USD (615,318)	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2.545%の固定金利を31/1/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を31/7/2026より毎年支払う。	Deutsche Bank	29/7/2025	(8,526)	(39,230)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (27,068,934)	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2.545%の固定金利を30/1/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を31/7/2026より毎年支払う。	Deutsche Bank	29/7/2025	215,422	(1,124,490)
USD (27,068,934)	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2.484%の固定金利を30/1/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を31/7/2026より毎年支払う。	Deutsche Bank	29/7/2025	(455,170)	(1,795,083)
EUR (105,926,397)	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%の固定金利を9/9/2023より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を9/3/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	7/9/2022	(198,659)	(469,882)
EUR (6,500,000)	ファンドは、コール・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ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	21/9/2022	64,730	(7,530)
USD (6,000,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.38.V2の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	21/9/2022	10,209	(10,284)
USD (5,000,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.38.V2の変動金利を20/6/2027より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	21/9/2022	(650)	(8,570)
EUR (6,700,000)	ファンドは、コール・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ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	19/10/2022	31,746	(73,499)
USD (53,540,807)	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3.05%の固定金利を28/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を28/10/2023より毎年支払う。	Goldman Sachs	26/10/2022	(354,779)	(692,086)
USD (54,182,125)	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2.92%の固定金利を4/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を4/11/2023より毎年支払う。	Goldman Sachs	2/11/2022	(592,081)	(1,023,100)
USD (87,128,964)	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2.9%の固定金利を15/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を15/11/2023より毎年支払う。	Goldman Sachs	10/11/2022	(1,183,804)	(1,802,548)
EUR (4,487,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.821%の固定金利を15/11/2023より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を15/5/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	11/11/2022	78,585	(24,257)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (4,487,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.821%の固定金利を15/11/2023より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を15/5/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	11/11/2022	(175,583)	(269,343)
USD (63,645,000)	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USD 1日SOFRの変動金利を17/11/2023より毎年受け取り、1.74%の固定金利を17/5/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	15/11/2022	349,260	(1,583)
USD (63,645,000)	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USD 1日SOFRの変動金利を17/11/2023より毎年受け取り、1.78%の固定金利を17/5/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	15/11/2022	332,323	(1,813)
USD (53,201,779)	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3.2%の固定金利を28/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を28/11/2023より毎年支払う。	Goldman Sachs	23/11/2022	(10,526)	(616,445)
EUR (5,080,000)	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2.75%の固定金利を14/12/2023より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を14/6/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	12/12/2022	(32,032)	(84,434)
USD (854,267,523)	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4.4%の固定金利を13/8/2023より毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を13/2/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	9/2/2023	(41,342)	(1,178,710)
USD (174,553,141)	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3.27%の固定金利を27/9/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を27/3/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	23/3/2023	(1,663,804)	(3,126,559)
USD (56,890,021)	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3.28%の固定金利を28/9/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を28/3/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	24/3/2023	(523,541)	(1,007,106)
GBP (458,228,116)	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3.22%の固定金利を3/4/2023より毎年受け取り、GBP SONIAの変動金利を3/4/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	3/4/2023	(5,060,409)	(6,561,221)
EUR (630,858,796)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.75%の固定金利を4/5/2024より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を4/11/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	2/5/2023	(4,185,937)	(5,815,086)
USD (54,834,240)	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3.57%の固定金利を15/11/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を15/5/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	11/5/2023	297,659	(755,707)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (10,125,000)	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3.104%の固定金利を20/12/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を20/6/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	15/6/2023	117,615	(267,641)
USD (10,125,000)	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USD SOFRの変動金利を20/6/2024より毎年受け取り、3.104%の固定金利を20/12/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	15/6/2023	(75,691)	(460,947)
EUR (26,501,000)	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3.5%の固定金利を27/8/2028より毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を27/2/2028より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	25/8/2027	(100,094)	(659,924)
USD (17,304,865)	ファンドは、コール・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CDX.NA.HY.38.V2の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	JP Morgan	21/9/2022	70,995	(8,840)
USD (16,150,000)	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1.22%の固定金利を4/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を4/11/2023より毎年支払う。	JP Morgan	2/11/2022	(168,274)	(718,850)
USD (5,580,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.45%の固定金利を7/6/2023より半年毎に受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を7/12/2023より毎年支払う。	JP Morgan	5/12/2022	(534,288)	(704,478)
USD (8,952,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.421%の固定金利を19/6/2023より半年毎に受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を19/12/2023より毎年支払う。	JP Morgan	15/12/2022	(898,538)	(1,150,089)
EUR (2,352,500)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.81%の固定金利を10/2/2024より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を10/8/2023より半年毎に支払う。	JP Morgan	8/2/2023	(89,281)	(162,743)
EUR (2,352,500)	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EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を10/8/2023より半年毎に受け取り、1.81%の固定金利を10/2/2024より毎年支払う。	JP Morgan	8/2/2023	48,482	(24,980)
USD (14,550,000)	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USD SOFRの変動金利を27/3/2024より毎年受け取り、2.278%の固定金利を27/9/2023より半年毎に支払う。	JP Morgan	23/3/2023	323,612	(152,355)
USD (14,550,000)	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2.278%の固定金利を27/9/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を27/3/2024より毎年支払う。	JP Morgan	23/3/2023	(441,435)	(917,402)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (9,266,000)	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2.674%の固定金利を24/11/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を24/5/2024より毎年支払う。	JP Morgan	22/5/2023	(61,013)	(392,967)
USD (9,266,000)	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USD SOFRの変動金利を24/5/2024より毎年受け取り、2.674%の固定金利を24/11/2023より半年毎に支払う。	JP Morgan	22/5/2023	102,233	(229,722)
USD (13,955,000)	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USD SOFRの変動金利を23/8/2024より毎年受け取り、2.678%の固定金利を23/2/2024より半年毎に支払う。	JP Morgan	21/8/2023	87,460	(416,315)
USD (13,955,000)	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2.678%の固定金利を23/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を23/8/2024より毎年支払う。	JP Morgan	21/8/2023	(120,864)	(624,639)
USD (11,300,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.265%の固定金利を6/3/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を6/9/2023より毎年支払う。	Morgan Stanley	1/9/2022	11,069	(1,615,799)
USD (116,003,796)	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2.91%の固定金利を6/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を6/10/2023より毎年支払う。	Morgan Stanley	4/10/2022	(592,797)	(1,486,026)
EUR (6,666,667)	ファンドは、コール・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ITRAXX.X0.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Morgan Stanley	19/10/2022	54,755	(18,175)
USD (107,641,689)	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USD SOFRの変動金利を31/10/2023より毎年受け取り、2.47%の固定金利を30/4/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	27/10/2022	202,959	(14,913)
USD (5,037,000)	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3.2%の固定金利を9/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を9/11/2023より毎年支払う。	Morgan Stanley	7/11/2022	55,826	(49,979)
USD (5,037,000)	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USD SOFRの変動金利を9/11/2023より毎年受け取り、2.7%の固定金利を9/5/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	7/11/2022	32,105	(52,539)
USD (109,447,660)	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3.35%の固定金利を12/6/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を12/12/2023より毎年支払う。	Morgan Stanley	8/12/2022	143,489	(1,030,337)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (8,953,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.4325%の固定金利を15/6/2023より半年毎に受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を15/12/2023より毎年支払う。	Morgan Stanley	13/12/2022	(888,804)	(1,142,174)
EUR (2,352,500)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.798%の固定金利を14/2/2024より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を14/8/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	10/2/2023	(93,007)	(165,237)
EUR (2,352,500)	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EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を14/8/2023より半年毎に受け取り、1.798%の固定金利を14/2/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	10/2/2023	47,581	(24,648)
USD (233,257,979)	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USD 1日SOFRの変動金利を17/2/2024より毎年受け取り、1.4%の固定金利を17/2/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	15/2/2023	737,821	(30,783)
USD (233,257,979)	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2.7%の固定金利を17/8/2023より半年毎に受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を17/2/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	15/2/2023	(2,908,990)	(3,786,836)
USD (233,257,979)	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2.6%の固定金利を17/8/2023より半年毎に受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を17/2/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	15/2/2023	(3,158,275)	(4,143,583)
USD (9,192,000)	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USD SOFRの変動金利を6/3/2024より毎年受け取り、1.724%の固定金利を6/9/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	2/3/2023	271,117	(26,933)
USD (9,192,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.724%の固定金利を6/9/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を6/3/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	2/3/2023	(647,885)	(945,935)
USD (9,388,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.84%の固定金利を13/9/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を13/3/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	9/3/2023	(566,955)	(881,923)
USD (9,388,000)	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USD SOFRの変動金利を13/3/2024より毎年受け取り、1.84%の固定金利を13/9/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	9/3/2023	277,558	(37,410)
USD (551,236,172)	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USD 3ヶ月BBA SOFRの変動金利を20/6/2023より四半期毎に受け取り、0.4%の固定金利を20/9/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	16/3/2023	604,987	(1,373)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (551,236,172)	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USD 3ヶ月BBA SOFRの変動金利を20/6/2023より四半期毎に受け取り、0.6%の固定金利を20/9/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	16/3/2023	1,044,813	(2,536)
USD (58,188,598)	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3.4%の固定金利を10/10/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を10/4/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	6/4/2023	(233,479)	(901,193)
USD (26,900,000)	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USD SOFRの変動金利を14/4/2024より毎年受け取り、2.849%の固定金利を14/10/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	12/4/2023	159,797	(107,186)
USD (26,900,000)	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2.849%の固定金利を14/10/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/4/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	12/4/2023	(106,501)	(373,483)
USD (26,900,000)	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USD SOFRの変動金利を14/4/2024より毎年受け取り、2.831%の固定金利を14/10/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	12/4/2023	160,585	(104,380)
USD (26,900,000)	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2.831%の固定金利を14/10/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/4/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	12/4/2023	(114,787)	(379,752)
USD (9,700,000)	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USD SOFRの変動金利を18/4/2024より毎年受け取り、2.575%の固定金利を18/10/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	14/4/2023	153,681	(186,425)
USD (9,700,000)	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2.575%の固定金利を18/10/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を18/4/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	14/4/2023	(107,418)	(447,524)
USD (31,327,000)	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USD SOFRの変動金利を9/6/2024より毎年受け取り、2.84%の固定金利を9/12/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	7/6/2023	44,341	(1,013,594)
USD (31,327,000)	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2.84%の固定金利を9/12/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を9/6/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	7/6/2023	(46,444)	(1,116,003)
USD (20,971,000)	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2.46%の固定金利を10/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を10/8/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	8/8/2023	(409,228)	(1,155,795)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (20,971,000)	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USD SOFRの変動金利を10/8/2024より毎年受け取り、2.46%の固定金利を10/2/2024より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	8/8/2023	291,771	(454,796)
USD (21,980,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.4075%の固定金利を16/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を16/8/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	14/8/2023	206,704	(2,748,814)
USD (21,980,000)	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USD SOFRの変動金利を16/8/2024より毎年受け取り、1.4075%の固定金利を16/2/2024より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	14/8/2023	26,681	(89,370)
USD (3,887,390)	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2.828%の固定金利を15/11/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を15/5/2025より毎年支払う。	Morgan Stanley	13/5/2024	6,808	(114,090)
USD (3,887,390)	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USD SOFRの変動金利を15/5/2025より毎年受け取り、2.828%の固定金利を15/11/2024より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	13/5/2024	18,098	(102,800)
USD (6,690,000)	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2.87%の固定金利を15/11/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を15/5/2025より毎年支払う。	Morgan Stanley	13/5/2024	963	(171,639)
USD (16,785,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.99%の固定金利を22/2/2025より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を22/8/2025より毎年支払う。	Morgan Stanley	20/8/2024	(121,410)	(1,439,868)
USD (11,012,597)	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USD SOFRの変動金利を30/7/2026より毎年受け取り、2.555%の固定金利を30/1/2026より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	28/7/2025	83,464	(485,887)
USD (11,012,597)	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2.555%の固定金利を30/1/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を30/7/2026より毎年支払う。	Morgan Stanley	28/7/2025	(128,281)	(697,632)
USD (11,012,598)	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USD SOFRの変動金利を30/7/2026より毎年受け取り、2.53%の固定金利を30/1/2026より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	28/7/2025	92,172	(475,528)
USD (11,012,598)	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2.53%の固定金利を30/1/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を30/7/2026より毎年支払う。	Morgan Stanley	28/7/2025	(141,305)	(709,005)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (4,590,000)	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3%の固定金利を22/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を22/11/2023より毎年支払う。	Nomura	18/11/2022	3,539	(80,343)
USD (4,590,000)	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USD SOFRの変動金利を22/11/2023より毎年受け取り、2.5%の固定金利を22/5/2023より半年毎に支払う。	Nomura	18/11/2022	52,276	(31,607)
USD (5,510,000)	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USD SOFRの変動金利を2/6/2024より毎年受け取り、2.715%の固定金利を2/12/2023より半年毎に支払う。	Nomura	31/5/2023	37,687	(148,000)
USD (5,510,000)	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2.715%の固定金利を2/12/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を2/6/2024より毎年支払う。	Nomura	31/5/2023	(39,049)	(224,736)
USD (8,155,000)	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%の固定金利を22/11/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を22/5/2025より毎年支払う。	Nomura	20/5/2024	(20,988)	(177,564)
USD (8,155,000)	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USD SOFRの変動金利を22/5/2025より毎年受け取り、2.1%の固定金利を22/11/2024より半年毎に支払う。	Nomura	20/5/2024	20,663	(122,049)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 2,835,781,783米ドル)				(23,197,409)	(97,324,388)

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 2022年8月31日現在

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価損 (米ドル)
	ベルギー		
15,499	Telenet Group Holding	Bank of America	(18,142)
			(18,142)
	中国		
(63,250)	ZTO Express Cayman	Bank of America	(79,508)
			(79,508)
	イタリア		
417,353	Telecom Italia	Bank of America	(13,486)
			(13,486)
	英国		
60,814	Liberty Global	Bank of America	(80,883)
			(80,883)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 3,224,513米ドル)			(192,019)

事後通告証券契約 2022年8月31日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
	米国		
USD (1,688,600)	Fannie Mae or Freddie Mac 2% TBA	(1,460,177)	(0.02)
USD (146,106,300)	Fannie Mae or Freddie Mac 2.5% TBA	(130,992,993)	(1.46)
USD (2,190,200)	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	(2,036,458)	(0.02)
USD 43,482,300	Fannie Mae or Freddie Mac 3.5% TBA	41,634,302	0.46
USD 127,951,000	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	125,441,961	1.39
USD (59,493,250)	Fannie Mae or Freddie Mac 4.5% TBA	(59,354,975)	(0.66)
USD 234,614,000	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	237,523,763	2.64
USD (151,563,050)	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	(140,843,468)	(1.56)
USD (639,300,000)	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	(626,007,361)	(6.96)
USD (303,000,000)	Fannie Mae or Freddie Mac 4.5% TBA	(301,917,011)	(3.35)
USD 210,000,000	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	212,284,569	2.36
T B A 合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 1,879,497,039米ドル)		(645,727,848)	(7.18)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表 2022年8月31日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
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債券			
オーストラリア			
USD 91,000	GAIF Bond Issuer Pty 3.4% 30/9/2026	86,759	0.01
USD 26,000	Mineral Resources 8% 1/11/2027	26,138	0.00
USD 400,000	Mirvac Finance 3.625% 18/3/2027	382,246	0.02
USD 260,000	Santos Finance 4.125% 14/9/2027	243,750	0.02
USD 8,450,000	Westpac Banking 3.15% 16/1/2024	8,371,615	0.53
		9,110,508	0.58
オーストリア			
USD 235,000	Klabn Austria 3.2% 12/1/2031	186,496	0.01
バーレーン			
USD 200,000	Bahrain Government International Bond 7.375% 14/5/2030	201,940	0.01
ベルギー			
EUR 1,400,000	KBC 0.5% 3/12/2029	1,273,264	0.08
EUR 900,000	KBC 1.125% 25/1/2024	886,599	0.05
EUR 600,000	KBC 1.5% 29/3/2026	574,816	0.04
		2,734,679	0.17
バミューダ諸島			
USD 200,000	Geopark 5.5% 17/1/2027	175,274	0.01
USD 240,000	Li & Fung 4.5% 18/8/2025	217,726	0.01
USD 18,000	Weatherford International 6.5% 15/9/2028	16,991	0.00
USD 3,000	Weatherford International 11% 1/12/2024	3,060	0.00
		413,051	0.02
ブラジル			
USD 5,000,000	Banco Bradesco 2.85% 27/1/2023	4,972,462	0.31
USD 358,000	Brazilian Government International Bond 3.875% 12/6/2030	313,061	0.02
		5,285,523	0.33
英領バージン諸島			
USD 500,000	Huarong Finance 2017 4.25% 7/11/2027	404,716	0.03
USD 400,000	Hysan MTN 2.875% 2/6/2027	373,621	0.02
USD 460,000	Ocean Laurel 2.375% 20/10/2025	413,685	0.03
USD 240,000	SF Investment 2021 2.375% 17/11/2026	220,068	0.01
USD 500,000	Sinochem Offshore Capital 2.25% 24/11/2026*	451,365	0.03
USD 550,000	Sinopec Overseas Development 2017 3.625% 12/4/2027*	541,263	0.03
USD 300,000	Yunda Investment 2.25% 19/8/2025	269,563	0.02
		2,674,281	0.17
カナダ			
USD 8,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 3.875% 15/1/2028	7,174	0.00
USD 167,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4.375% 15/1/2028	150,096	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
カナダ(続き)			
USD 129,000	Air Canada 3.875% 15/8/2026	114,360	0.01
USD 75,000	Bombardier 6% 15/2/2028	66,501	0.00
USD 244,000	Bombardier 7.125% 15/6/2026	230,883	0.01
USD 116,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 5% 15/6/2029	92,355	0.00
USD 1,005,000	Canadian Pacific Railway 1.75% 2/12/2026	913,372	0.06
USD 652,000	Clarios Global / Clarios US Finance 6.25% 15/5/2026	645,526	0.04
USD 5,030,000	CPPIB Capital 0.5% 16/9/2024	4,729,851	0.30
USD 1,885,000	Enbridge 2.5% 14/2/2025	1,809,056	0.12
USD 47,000	Garda World Security 4.625% 15/2/2027	41,844	0.00
USD 58,000	GFL Environmental 3.5% 1/9/2028	50,282	0.00
USD 144,000	GFL Environmental 4% 1/8/2028	122,295	0.01
USD 129,000	GFL Environmental 5.125% 15/12/2026	124,821	0.01
USD 73,000	New Gold 7.5% 15/7/2027	56,444	0.01
USD 46,000	NOVA Chemicals 4.875% 1/6/2024	44,232	0.00
USD 3,975,000	OMERS Finance Trust 1.1% 26/3/2026	3,614,572	0.23
USD 136,000	Open Text 3.875% 15/2/2028	116,204	0.01
USD 56,000	Parkland 5.875% 15/7/2027	53,674	0.00
EUR 730,000	Toronto-Dominion Bank/The 0.375% 25/4/2024	708,066	0.04
USD 110,000	Videotron 5.125% 15/4/2027	103,313	0.01
		13,794,921	0.87
ケイマン諸島			
USD 650,000	Allegro CLO II-S 4.882% 21/10/2028	628,799	0.04
USD 2,000,000	Allegro CLO IV 4.062% 15/1/2030	1,951,587	0.12
USD 550,000	Allegro CLO XI 4.588% 19/1/2033	538,280	0.03
USD 3,250,000	Apidos CLO XXIX 4.333% 25/7/2030	3,175,579	0.20
USD 385,000	Arabian Centres Sukuk II 5.625% 7/10/2026	349,925	0.02
USD 1,450,000	ASSURANT CLO 3.75% 20/4/2031	1,427,977	0.09
USD 300,000	Baidu 3.625% 6/7/2027*	285,964	0.02
USD 3,500,000	Bean Creek CLO 3.73% 20/4/2031	3,445,605	0.22
USD 520,000	Benefit Street Partners CLO V-B 3.8% 20/4/2031	512,652	0.03
USD 500,000	Canyon CLO 2018-1 3.582% 15/7/2031	491,496	0.03
USD 1,750,000	Carbone Clo 3.85% 20/1/2031	1,725,938	0.11
USD 2,333,392	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-5 3.652% 15/7/2031	2,302,206	0.15
USD 1,250,000	CARLYLE US CLO 2018-4 4.78% 20/1/2031	1,194,857	0.08
USD 340,000	CDBL Funding 1 3.5% 24/10/2027	321,040	0.02
USD 350,000	China Mengniu Dairy 1.875% 17/6/2025	324,032	0.02
USD 200,000	China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman 2.45% 9/2/2026	169,623	0.01
USD 1,000,000	CIFC Funding 2017-V 3.92% 16/11/2030	991,613	0.06
USD 250,000	CIFC Funding 2018-V 3.702% 15/1/2032	246,523	0.02
USD 7,000,000	CIFC Funding 2019-I 3.81% 20/4/2032	6,886,139	0.44
USD 1,000,000	Clear Creek CLO 3.91% 20/10/2030	988,431	0.06

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ケイマン諸島(続き)		
USD 6,255,000	Deer Creek Clo 2017-1 3.89% 20/10/2030	6,194,951	0.39
USD 225,000	Doha Finance 2.375% 31/3/2026	208,064	0.01
USD 222,000	Fantasia 10.875% 9/1/2023	21,645	0.00
USD 200,000	Fantasia 11.875% 1/6/2023	19,500	0.00
USD 2,150,000	Galaxy XXII CLO 3.94% 16/4/2034	2,099,507	0.13
USD 2,500,000	Goldentree Loan Management US Clo 3 4.01% 20/4/2030	2,430,555	0.15
USD 500,000	Goldentree Loan Management US CLO 5 3.78% 20/10/2032	489,407	0.03
USD 1,000,000	Goldentree Loan Opportunities XI 3.81% 18/1/2031	991,662	0.06
USD 200,000	Grupo Aval 4.375% 4/2/2030	161,941	0.01
USD 92,000	Hawaiian Brand Intellectual Property / HawaiianMiles Loyalty 5.75% 20/1/2026	85,201	0.01
USD 1,187,902	ICG US CLO 2015-1 3.878% 19/10/2028	1,178,425	0.07
USD 400,000	LCM Loan Income Fund I Income Note Issuer 3.82% 16/7/2031	394,419	0.03
USD 350,000	Longfor 3.9% 16/4/2023*	341,250	0.02
USD 250,000	MAF Sukuk 4.638% 14/5/2029*	253,121	0.02
USD 250,000	Marble Point CLO XXII 4.633% 25/7/2034	235,371	0.02
USD 250,000	Milos CLO 3.78% 20/10/2030	246,744	0.02
USD 500,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 25 4.09% 18/10/2029	483,316	0.03
USD 4,870,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 3.66% 18/10/2030	4,801,528	0.30
USD 500,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 3.868% 19/10/2031	494,864	0.03
USD 300,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 4.438% 19/10/2031	290,590	0.02
USD 850,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 3.82% 16/10/2033	833,908	0.05
USD 750,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 4.227% 20/1/2035	727,452	0.05
USD 520,000	OCP CLO 2017-14 4.134% 20/11/2030	516,067	0.03
USD 8,600,000	Peace Park CLO 3.84% 20/10/2034	8,253,039	0.52
USD 3,920,000	Pikes Peak CLO 1 3.963% 24/7/2031	3,862,468	0.24
USD 200,000	Redsun Properties 10.5% 3/10/2022	17,000	0.00
USD 4,690,000	Regatta VIII Funding 3.99% 17/10/2030	4,654,472	0.29
USD 1,000,000	Regatta VIII Funding 4.44% 17/10/2030	977,270	0.06
USD 250,000	Regatta X Funding 4.19% 17/1/2031	240,524	0.02
USD 1,750,000	Regatta XVI Funding 4.562% 15/1/2033	1,721,466	0.11
USD 275,000	Rockford Tower CLO 2017-3 3.9% 20/10/2030	272,783	0.02
USD 525,000	RR 19 3.652% 15/10/2035	509,845	0.03
USD 2,500,000	RR 3 3.602% 15/1/2030	2,469,819	0.16
USD 480,000	Sharjah Sukuk Program 2.942% 10/6/2027	439,897	0.03
USD 510,000	SNB Funding 2.9% 29/1/2027*	485,909	0.03
USD 1,000,000	Symphony CLO XXIII 4.112% 15/1/2034	973,859	0.06
USD 550,000	Tencent 3.595% 19/1/2028	515,944	0.03
USD 1,000,000	TICP CLO V 2016-1 4.49% 17/7/2031	971,058	0.06
USD 900,000	Trinitas CLO XVIII 3.88% 20/1/2035	874,255	0.06
		78,697,362	4.97
	チリ		
USD 200,000	Chile Government International Bond 3.24% 6/2/2028	186,636	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	チリ(続き)		
USD 235,000	Colbun 3.15% 19/1/2032	200,319	0.01
USD 280,000	Empresa Nacional del Petroleo 4.375% 30/10/2024	278,168	0.02
		665,123	0.04
	中国		
USD 210,000	Guoren Property & Casualty Insurance 3.35% 1/6/2026	192,446	0.01
USD 330,000	ZhongAn Online P&C Insurance 3.5% 8/3/2026	270,435	0.02
		462,881	0.03
	コロンビア		
USD 311,000	Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	279,447	0.02
USD 200,000	Colombia Government International Bond 4.5% 28/1/2026	189,509	0.01
USD 260,000	Colombia Government International Bond 8.125% 21/5/2024	270,797	0.02
USD 350,000	Ecopetrol 4.625% 2/11/2031	273,437	0.02
USD 340,000	Ecopetrol 5.375% 26/6/2026	320,587	0.02
USD 340,000	SURA Asset Management 4.875% 17/4/2024	337,639	0.02
		1,671,416	0.11
	デンマーク		
USD 3,160,000	Danske Bank 0.976% 10/9/2025	2,904,448	0.19
USD 3,065,000	Danske Bank 1.621% 11/9/2026	2,719,139	0.17
		5,623,587	0.36
	ドミニカ共和国		
USD 298,000	Banco de Reservas de la Republica Dominicana 7% 1/2/2023	299,117	0.02
USD 250,000	Dominican Republic International Bond 5.5% 22/2/2029	228,738	0.01
USD 254,000	Dominican Republic International Bond 5.5% 22/2/2029	232,398	0.02
		760,253	0.05
	フィンランド		
EUR 905,000	CRH Finland Services 0.875% 5/11/2023*	892,592	0.06
	フランス		
USD 202,000	Altice France 5.5% 15/1/2028	166,066	0.01
USD 326,000	Altice France 8.125% 1/2/2027	310,932	0.02
EUR 200,000	Arkema 0.125% 14/10/2026	179,123	0.01
EUR 300,000	Banque Federative du Credit Mutuel 0.75% 8/6/2026	278,429	0.02
EUR 500,000	BPCE 0.625% 28/4/2025	475,150	0.03
USD 925,000	BPCE 2.045% 19/10/2027	808,334	0.05
EUR 500,000	Capgemini 0.625% 23/6/2025	475,963	0.03
USD 250,000	Constellium 3.75% 15/4/2029	206,588	0.01
EUR 900,000	Engie 0.375% 28/2/2023*	897,322	0.06
EUR 160,306	FCT Autonoria 2019 0.909% 25/9/2035	159,081	0.01
EUR 160,066	FCT Autonoria 2019 2.759% 25/9/2035	156,284	0.01
EUR 741,795	FCT Noria 2021 0.759% 25/10/2049	722,547	0.04
EUR 463,622	FCT Noria 2021 1.159% 25/10/2049	446,975	0.03
EUR 649,070	FCT Noria 2021 1.559% 25/10/2049	619,669	0.04
EUR 300,000	FCT Pixel 2021 2.218% 25/2/2038	287,212	0.02

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
フランス(続き)			
EUR 1,410,404	Harmony French Home Loans FCT 2020-2 1.218% 27/8/2061	1,407,366	0.09
EUR 1,000,000	Harmony French Home Loans FCT 2020-2 1.868% 27/8/2061	972,159	0.06
EUR 400,000	Harmony French Home Loans FCT 2021-1 1.468% 27/5/2061	382,534	0.03
USD 362,000	Iliad 6.5% 15/10/2026	331,270	0.02
EUR 800,000	Pernod Ricard 0% 24/10/2023	785,714	0.05
EUR 400,000	PSA Banque France 0% 22/1/2025	374,245	0.02
EUR 600,000	Schneider Electric 0.25% 9/9/2024	581,907	0.04
EUR 2,200,000	Societe Generale 1.375% 23/2/2028*	2,161,320	0.14
		13,186,190	0.84
ドイツ			
EUR 535,000	Amphenol Technologies 0.75% 4/5/2026*	495,781	0.03
EUR 600,000	BASF 0.101% 5/6/2023	595,147	0.04
EUR 1,105,000	BASF 2% 5/12/2022*	1,108,494	0.07
EUR 600,000	Bayer 0.05% 12/1/2025	564,988	0.03
EUR 200,000	Commerzbank 0.75% 24/3/2026	185,840	0.01
EUR 290,000	Covestro 0.875% 3/2/2026	264,680	0.01
EUR 600,000	Deutsche Bank 1% 19/11/2025	560,521	0.04
USD 1,310,000	Deutsche Bank 1.447% 1/4/2025	1,223,876	0.08
EUR 800,000	Deutsche Bank 1.875% 23/2/2028	705,024	0.04
USD 3,385,000	Deutsche Bank 2.552% 7/1/2028	2,894,650	0.18
USD 2,085,000	Deutsche Bank 6.119% 14/7/2026	2,090,413	0.13
EUR 1,315,000	E.ON 0% 24/10/2022	1,314,284	0.09
EUR 210,000	E.ON 0.875% 8/1/2025	202,842	0.01
EUR 300,000	KION 1.625% 24/9/2025	279,642	0.02
EUR 300,000	Red & Black Auto Germany 8 UG 0.723% 15/9/2030	292,609	0.02
EUR 400,000	Red & Black Auto Germany 8 UG 0.923% 15/9/2030	384,911	0.02
EUR 1,100,000	Volkswagen Bank 1.875% 31/1/2024	1,090,944	0.07
EUR 600,000	Volkswagen Bank 2.5% 31/7/2026	577,573	0.04
EUR 520,000	Volkswagen Financial Services 0.875% 31/1/2028	450,048	0.03
EUR 330,000	Volkswagen Leasing 0.375% 20/7/2026	294,328	0.02
EUR 2,455,000	Volkswagen Leasing 1% 16/2/2023	2,453,995	0.15
EUR 700,000	ZF Finance 3% 21/9/2025	637,558	0.04
		18,668,148	1.17
グアテマラ			
USD 200,000	Guatemala Government Bond 3.7% 7/10/2033	162,181	0.01
USD 210,000	Guatemala Government Bond 5.375% 24/4/2032	202,003	0.01
		364,184	0.02
香港			
USD 400,000	CITIC 3.875% 28/2/2027*	390,127	0.03
USD 300,000	CMB International Leasing Management 1.25% 16/9/2024	279,563	0.02
USD 200,000	CMB International Leasing Management 1.875% 12/8/2025	183,409	0.01
USD 315,000	GLP China 2.95% 29/3/2026	253,260	0.02
		1,106,359	0.08

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ハンガリー			
USD 200,000	Hungary Government International Bond 5.25% 16/6/2029	193,112	0.01
インド			
USD 200,000	Export-Import Bank of India 3.375% 5/8/2026	191,112	0.01
USD 468,000	Hindustan Petroleum 4% 12/7/2027	444,145	0.03
USD 300,000	ICICI Bank 3.8% 14/12/2027	285,811	0.02
USD 200,000	ICICI Bank 4% 18/3/2026	195,042	0.01
USD 465,000	Power Finance 3.75% 18/6/2024	456,627	0.03
USD 718,000	REC 3.875% 7/7/2027	672,199	0.04
		2,244,936	0.14
インドネシア			
USD 700,000	Pertamina Persero 1.4% 9/2/2026	630,875	0.04
USD 251,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.4% 6/6/2027	253,824	0.02
USD 225,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.4% 6/6/2027	227,531	0.01
USD 500,000	Perusahaan Perseroan Persero Perusahaan Listrik Negara 4.125% 15/5/2027	484,759	0.03
		1,596,989	0.10
アイルランド			
USD 2,200,000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 2.45% 29/10/2026	1,945,917	0.12
USD 1,700,000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 2.875% 14/8/2024	1,625,529	0.10
USD 2,160,000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 3.3% 23/1/2023	2,151,311	0.14
GBP 899,664	Agora UK 2021 2.787% 22/7/2031	998,396	0.06
GBP 969,633	Atom Mortgage 3.487% 22/7/2031	1,074,383	0.07
GBP 1,199,155	Atom Mortgage 4.387% 22/7/2031	1,274,342	0.08
EUR 525,000	ESB Finance 3.494% 12/1/2024	535,715	0.03
EUR 561,000	Fresenius Finance Ireland 0% 1/10/2025	512,860	0.03
GBP 736,753	Frost CMBS 2021-1 3.043% 20/11/2033	836,474	0.05
EUR 1,050,696	Haus European Loan Conduit No 39 0.917% 28/7/2051	1,013,674	0.06
EUR 796,770	Haus European Loan Conduit No 39 1.367% 28/7/2051	751,920	0.05
EUR 636,816	Haus European Loan Conduit No 39 1.667% 28/7/2051	584,078	0.04
EUR 691,800	Haus European Loan Conduit No 39 2.267% 28/7/2051	633,740	0.04
EUR 1,001,508	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 1.089% 17/8/2033	956,013	0.06
EUR 918,882	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 1.739% 17/8/2033	864,489	0.06
EUR 324,546	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 2.239% 17/8/2033	316,812	0.02
EUR 1,000,794	Last Mile PE 2021 1.239% 17/8/2031	969,152	0.06
EUR 1,316,723	Last Mile PE 2021 1.389% 17/8/2031	1,294,897	0.08
EUR 678,857	Last Mile PE 2021 1.539% 17/8/2031	647,502	0.04
EUR 918,807	Last Mile PE 2021 1.939% 17/8/2031	850,263	0.05
USD 264,000	LCPR Senior Secured Financing 6.75% 15/10/2027	249,612	0.01
EUR 2,001,394	Pearl Finance 2020 1.739% 17/11/2032	1,978,458	0.13
EUR 1,128,144	Pearl Finance 2020 2.239% 17/11/2032	1,133,449	0.07
EUR 1,354,717	Pearl Finance 2020 2.839% 17/11/2032	1,338,359	0.09

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
アイルランド(続き)			
USD 1,476,529	Prodigy Finance CM2021-1 3.694% 25/7/2051	1,443,488	0.09
EUR 458,250	River Green Finance 2020 1.122% 22/1/2032	449,254	0.03
EUR 238,875	River Green Finance 2020 1.472% 22/1/2032	229,590	0.01
EUR 636,873	SCF Rahoituspalvelut IX 1.039% 25/10/2030	623,131	0.04
USD 2,850,000	SMBC Aviation Capital Finance 1.9% 15/10/2026	2,448,173	0.16
USD 605,000	SMBC Aviation Capital Finance 2.3% 15/6/2028	497,263	0.03
GBP 798,138	Taurus 2021-1 UK 2.543% 17/5/2031	893,998	0.06
GBP 321,638	Taurus 2021-1 UK 3.343% 17/5/2031	349,052	0.02
GBP 262,075	Taurus 2021-1 UK 4.293% 17/5/2031	281,699	0.02
GBP 487,039	Taurus 2021-4 UK 2.643% 17/8/2031	545,573	0.03
GBP 290,859	Taurus 2021-4 UK 3.793% 17/8/2031	308,997	0.02
EUR 1,477,000	Vita Scientia 2022-1 1.3% 27/2/2033	1,477,821	0.09
		34,085,384	2.14
マン島			
USD 209,000	AngloGold Ashanti 3.75% 1/10/2030	179,106	0.01
イスラエル			
USD 215,170	Leviathan Bond 5.75% 30/6/2023	214,900	0.01
イタリア			
EUR 440,000	ACEA 0% 28/9/2025	404,202	0.02
EUR 910,000	ASTM 1% 25/11/2026	807,240	0.05
EUR 1,120,000	Autoflorence 2 0.746% 24/12/2044	1,113,477	0.07
EUR 608,000	Autoflorence 2 0.796% 24/12/2044	582,624	0.04
EUR 414,000	Autoflorence 2 1.196% 24/12/2044	388,437	0.02
EUR 222,000	Autoflorence 2 2.396% 24/12/2044	210,045	0.01
EUR 143,000	Brignole 2021 0.846% 24/7/2036	137,983	0.01
EUR 100,000	Brignole 2021 1.646% 24/7/2036	95,376	0.01
EUR 979,765	Cassia 2022-1 2.891% 22/5/2034	952,007	0.06
EUR 468,531	Cassia 2022-1 3.891% 22/5/2034	468,937	0.03
EUR 270,000	FCA Bank 0% 16/4/2024	259,138	0.02
EUR 180,000	FCA Bank 0.125% 16/11/2023	175,414	0.01
EUR 620,000	FCA Bank 0.5% 18/9/2023	609,443	0.04
EUR 407,862	Progetto Quinto 0.469% 27/10/2036	403,607	0.02
EUR 599,000	Red & Black Auto Italy 2.935% 28/12/2031	575,490	0.04
EUR 320,000	Snam 0% 15/8/2025	295,054	0.02
USD 310,000	Telecom Italia 5.303% 30/5/2024	297,969	0.02
USD 1,165,000	UniCredit 2.569% 22/9/2026	1,020,609	0.06
EUR 1,180,000	UniCredit 6.95% 31/10/2022	1,189,268	0.08
		9,986,320	0.63
日本			
EUR 621,000	Asahi 0.01% 19/4/2024	599,632	0.04
EUR 290,000	Asahi 0.155% 23/10/2024	277,001	0.01
USD 1,000,000	Mitsubishi UFJ Financial 4.08% 19/4/2028	971,135	0.06

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	日本(続き)		
USD 5,735,000	Mitsubishi UFJ Financial 4.788% 18/7/2025	5,760,433	0.37
EUR 1,045,000	Mizuho Financial 0.523% 10/6/2024	1,011,337	0.06
EUR 185,000	Nissan Motor 2.652% 17/3/2026	174,712	0.01
USD 2,671,000	Nissan Motor 3.043% 15/9/2023	2,626,419	0.17
USD 2,697,000	Nissan Motor 3.522% 17/9/2025	2,558,429	0.16
USD 1,320,000	Nissan Motor 4.345% 17/9/2027	1,224,991	0.08
USD 270,000	Nissan Motor 4.345% 17/9/2027*	250,566	0.01
USD 910,000	NTT Finance 4.372% 27/7/2027	915,182	0.06
		16,369,837	1.03
	ジャージー		
USD 1,772,000	Aptiv / Aptiv 2.396% 18/2/2025	1,690,547	0.11
EUR 1,230,000	Heathrow Funding 1.5% 12/10/2027	1,172,363	0.07
		2,862,910	0.18
	リベリア		
USD 112,000	Royal Caribbean Cruises 5.5% 31/8/2026	90,693	0.01
USD 2,000	Royal Caribbean Cruises 5.5% 1/4/2028	1,543	0.00
USD 131,000	Royal Caribbean Cruises 9.125% 15/6/2023	131,984	0.01
USD 31,000	Royal Caribbean Cruises 11.625% 15/8/2027	30,733	0.00
		254,953	0.02
	ルクセンブルグ		
USD 200,000	Allied Universal Holdco /Allied Universal Finance /Atlas Luxco 4 4.625% 1/6/2028	169,533	0.01
USD 365,000	Altice Financing 5% 15/1/2028	295,742	0.02
EUR 460,000	Becton Dickinson Euro Finance 1.208% 4/6/2026	431,072	0.03
EUR 1,897,000	BL Consumer Credit 2021 0.809% 25/9/2038	1,892,880	0.12
EUR 528,000	BL Consumer Credit 2021 1.159% 25/9/2038	512,905	0.03
EUR 681,000	BL Consumer Credit 2021 1.709% 25/9/2038	645,474	0.04
EUR 355,000	BL Consumer Credit 2021 2.909% 25/9/2038	333,923	0.02
USD 106,000	Camelot Finance 4.5% 1/11/2026	98,737	0.01
USD 200,000	EIG Pearl 4.387% 30/11/2046	162,500	0.01
EUR 700,000	FACT Master 0.953% 20/7/2028	675,233	0.04
EUR 979,533	Germany Compartment Consumer 2020-1 1.123% 14/11/2034	972,170	0.06
EUR 522,418	Germany Compartment Consumer 2020-1 1.723% 14/11/2034	518,477	0.04
EUR 391,813	Germany Compartment Consumer 2020-1 2.473% 14/11/2034	383,008	0.03
USD 200,000	Herens Holdco 4.75% 15/5/2028	169,747	0.01
EUR 370,000	Highland 0.318% 15/12/2026	328,739	0.02
EUR 405,000	Holcim Finance Luxembourg 0.125% 19/7/2027*	350,591	0.02
EUR 665,000	Medtronic Global 0% 2/12/2022	664,392	0.04
EUR 483,000	Medtronic Global 0% 15/10/2025	449,067	0.03
EUR 635,000	Medtronic Global 0.375% 7/3/2023	632,939	0.04
EUR 1,515,000	SIG Combibloc PurchaseCo 1.875% 18/6/2023*	1,497,556	0.09
EUR 270,000	SIG Combibloc PurchaseCo 2.125% 18/6/2025	258,400	0.02
EUR 605,000	Simon International Finance 1.375% 18/11/2022	605,379	0.04
USD 200,000	Telenet Finance Luxembourg Notes 5.5% 1/3/2028	184,000	0.01

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 500,000	Traton Finance Luxembourg 0% 14/6/2024	475,550	0.03
EUR 500,000	Traton Finance Luxembourg 0.125% 10/11/2024	470,765	0.03
EUR 900,000	Traton Finance Luxembourg 0.125% 24/3/2025*	834,187	0.05
		14,012,966	0.89
モーリシャス			
USD 250,000	India Green Energy 5.375% 29/4/2024	240,313	0.02
メキシコ			
USD 200,000	BBVA Bancomer 5.125% 18/1/2033	178,999	0.01
USD 221,000	Comision Federal de Electricidad 4.688% 15/5/2029	200,021	0.02
USD 200,000	Comision Federal de Electricidad 4.875% 15/1/2024	197,250	0.01
USD 200,000	Grupo KUO 5.75% 7/7/2027	188,566	0.01
USD 350,000	Mexico City Airport Trust 4.25% 31/10/2026	331,625	0.02
USD 380,000	Mexico Government International Bond 4.125% 21/1/2026	379,810	0.03
USD 200,000	Mexico Government International Bond 4.75% 27/4/2032	194,200	0.01
USD 280,000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/1/2031	210,840	0.01
USD 262,000	Petroleos Mexicanos 6.7% 16/2/2032	203,941	0.01
USD 419,000	Petroleos Mexicanos 6.875% 4/8/2026	390,717	0.03
USD 129,000	Petroleos Mexicanos 8.75% 2/6/2029	118,842	0.01
USD 200,000	Trust Fibra Uno 5.25% 30/1/2026	190,883	0.01
		2,785,694	0.18
モロッコ			
USD 316,000	Morocco Government International Bond 3% 15/12/2032	237,220	0.02
オランダ			
EUR 701,000	American Medical Systems Europe 1.375% 8/3/2028	642,105	0.04
EUR 600,000	Bayer Capital 1.5% 26/6/2026	567,370	0.04
EUR 890,000	BMW Finance 0% 14/4/2023	884,516	0.06
EUR 490,000	Conti-Gummi Finance 1.125% 25/9/2024	477,860	0.03
EUR 1,115,000	Digital Dutch Finco 0.625% 15/7/2025*	1,031,083	0.07
EUR 560,436	Domi 2021-1 0.349% 15/6/2053	551,742	0.03
EUR 1,726,379	Domi 2022-1 0.798% 15/4/2054	1,711,393	0.11
EUR 832,243	Dutch Property Finance 2020-2 1.002% 28/1/2058	825,158	0.05
EUR 290,000	Dutch Property Finance 2020-2 1.562% 28/1/2058	281,263	0.02
EUR 2,253,382	Dutch Property Finance 2021-1 0.862% 28/7/2058	2,225,989	0.14
EUR 740,000	Dutch Property Finance 2021-1 1.312% 28/7/2058	706,797	0.04
EUR 1,098,103	Dutch Property Finance 2021-2 0.912% 28/4/2059	1,082,161	0.07
EUR 820,000	Dutch Property Finance 2021-2 1.012% 28/4/2059	768,661	0.05
EUR 504,000	Dutch Property Finance 2021-2 1.262% 28/4/2059	458,058	0.03
EUR 275,000	E.ON International Finance 0.75% 30/11/2022	274,894	0.02
EUR 1,155,000	Enel Finance International 0% 17/6/2024	1,110,959	0.07
USD 520,000	Equate Petrochemical 4.25% 3/11/2026	511,550	0.03
EUR 230,000	GSK Consumer Healthcare Capital NL 1.25% 29/3/2026	217,767	0.01
EUR 700,000	Heimstaden Bostad Treasury 0.25% 13/10/2024	642,587	0.04

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ(続き)			
EUR 330,000	IMCD 2.125% 31/3/2027	298,785	0.02
EUR 500,000	ING Groep 0.1% 3/9/2025	471,217	0.03
EUR 800,000	ING Groep 1% 20/9/2023	793,414	0.05
USD 900,000	ING Groep 1.726% 1/4/2027	799,488	0.05
EUR 1,000,312	Jubilee Place 0.852% 17/1/2059	989,321	0.06
EUR 407,000	Jubilee Place 1.102% 17/1/2059	369,939	0.03
EUR 201,000	Jubilee Place 1.602% 17/1/2059	179,369	0.01
EUR 431,920	Jubilee Place 2020-1 1.002% 17/10/2057	427,570	0.03
EUR 620,783	Jubilee Place 2021-1 0.832% 17/7/2058	614,012	0.04
EUR 700,000	Louis Dreyfus Finance 2.375% 27/11/2025*	672,731	0.04
EUR 112,218	Magoi 2019 1.385% 27/7/2039	109,005	0.01
EUR 450,000	Mercedes-Benz International Finance 0.25% 6/11/2023	442,212	0.03
USD 120,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 2.7% 1/5/2025	113,929	0.01
EUR 200,000	Redexis Gas Finance 1.875% 28/5/2025	191,297	0.01
USD 80,000	Sensata Technologies 4% 15/4/2029	70,003	0.00
USD 111,000	Sensata Technologies 5% 1/10/2025	108,959	0.01
EUR 935,000	Siemens Financieringsmaatschappij 0.375% 6/9/2023	926,315	0.06
EUR 665,000	Stellantis 3.375% 7/7/2023	670,513	0.04
USD 27,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 3.15% 1/10/2026	22,883	0.00
EUR 410,000	Toyota Motor Finance Netherlands 0% 27/10/2025	378,800	0.02
USD 311,000	Trivium Packaging Finance 5.5% 15/8/2026	299,086	0.02
EUR 720,000	Viterra Finance 0.375% 24/9/2025	634,521	0.04
EUR 1,000,000	Vonovia Finance 0.125% 6/4/2023*	991,827	0.06
USD 194,000	Ziggo Bond 6% 15/1/2027	173,420	0.01
		25,720,529	1.63
オマーン			
USD 200,000	Oman Government International Bond 7.375% 28/10/2032	217,500	0.01
USD 267,000	OQ SAOC 5.125% 6/5/2028	259,352	0.02
		476,852	0.03
パナマ			
USD 225,000	Aeropuerto Internacional de Tocumen 5.125% 11/8/2061	181,669	0.01
USD 250,000	Banco Latinoamericano de Comercio Exterior 2.375% 14/9/2025	232,500	0.01
USD 295,000	Banco Nacional de Panama 2.5% 11/8/2030	237,514	0.02
USD 162,000	Carnival 4% 1/8/2028	134,580	0.01
USD 208,000	Carnival 5.75% 1/3/2027	164,382	0.01
USD 16,000	Carnival 6% 1/5/2029	12,343	0.00
USD 5,000	Carnival 7.625% 1/3/2026	4,266	0.00
USD 108,000	Carnival 10.5% 1/2/2026	111,445	0.01
USD 248,000	Panama Government International Bond 2.252% 29/9/2032	193,194	0.01
USD 238,000	Panama Government International Bond 3.875% 17/3/2028	229,263	0.02
		1,501,156	0.10

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	パラグアイ		
USD 319,000	Paraguay Government International Bond 4.95% 28/4/2031	307,982	0.02
USD 332,000	Paraguay Government International Bond 5% 15/4/2026	332,763	0.02
		640,745	0.04
	ペルー		
USD 341,000	Peruvian Government International Bond 2.392% 23/1/2026	319,593	0.02
USD 116,000	Peruvian Government International Bond 2.783% 23/1/2031	99,231	0.01
USD 201,000	Peruvian Government International Bond 4.125% 25/8/2027	197,578	0.01
USD 200,000	SAN Miguel Industrias Pet / NG PET R&P Latin America 3.5% 2/8/2028	169,094	0.01
		785,496	0.05
	フィリピン		
USD 200,000	Philippine Government International Bond 3.75% 14/1/2029	198,250	0.01
	ポルトガル		
EUR 236,350	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 2.309% 25/1/2035	226,474	0.02
EUR 1,024,185	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 4.309% 25/1/2035	959,712	0.06
EUR 800,000	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No. 2 2.876% 23/9/2038	771,161	0.05
EUR 1,500,000	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ViriatoFinanceNo10.785% 28/10/2040	1,488,071	0.09
EUR 200,000	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ViriatoFinanceNo11.035% 28/10/2040	191,812	0.01
EUR 700,000	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ViriatoFinanceNo11.635% 28/10/2040	659,234	0.04
		4,296,464	0.27
	ルーマニア		
EUR 69,000	Romanian Government International Bond 2.5% 8/2/2030	54,363	0.00
EUR 66,000	Romanian Government International Bond 2.875% 11/3/2029	54,849	0.00
USD 254,000	Romanian Government International Bond 5.25% 25/11/2027	248,126	0.02
		357,338	0.02
	サウジアラビア		
USD 865,000	Saudi Arabian Oil 2.875% 16/4/2024	849,322	0.05
	シンガポール		
USD 360,000	BOC Aviation 3.5% 18/9/2027	341,494	0.02
USD 470,000	BPRL International Singapore 4.375% 18/1/2027	452,317	0.03
USD 465,000	Oil India International 4% 21/4/2027	445,490	0.03
USD 473,000	ONGC Videsh Vankorneft 3.75% 27/7/2026	453,897	0.03
		1,693,198	0.11
	南アフリカ		
USD 200,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.3% 12/10/2028	177,596	0.01
USD 213,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.85% 30/9/2029	189,321	0.01
		366,917	0.02

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
韓国			
USD 200,000	GS Caltex 4.5% 5/1/2026	197,764	0.01
USD 320,000	Hyundai Capital Services 3.625% 29/8/2027	301,971	0.02
USD 200,000	KB Kookmin Card 4% 9/6/2025	197,188	0.01
USD 450,000	Kia 1.75% 16/10/2026	400,982	0.03
USD 200,000	Korea Electric Power 3.625% 14/6/2025	196,521	0.01
USD 300,000	Korea Gas 3.875% 13/7/2027	293,934	0.02
USD 200,000	Korea Western Power 4.125% 28/6/2025	197,788	0.01
USD 200,000	LOTTE Property & Development 4.5% 1/8/2025	200,264	0.02
USD 350,000	Mirae Asset 1.375% 7/7/2024	327,948	0.02
USD 200,000	Mirae Asset 2.625% 30/7/2025	186,653	0.01
USD 200,000	NongHyup Bank 4% 6/1/2026	198,325	0.01
		2,699,338	0.17
スペイン			
EUR 909,668	Autonoria Spain 2021 FT 0.709% 31/1/2039	905,459	0.06
EUR 727,734	Autonoria Spain 2021 FT 0.859% 31/1/2039	711,067	0.04
EUR 181,933	Autonoria Spain 2021 FT 1.609% 31/1/2039	172,659	0.01
EUR 470,088	Autonoria Spain 2021 FT 2.709% 31/1/2039	443,528	0.03
EUR 188,035	Autonoria Spain 2021 FT 3.959% 31/1/2039	177,558	0.01
EUR 500,000	Banco de Sabadell 0.625% 7/11/2025*	467,694	0.03
EUR 200,000	Banco de Sabadell 1.125% 11/3/2027	181,454	0.01
USD 600,000	Banco Santander 1.722% 14/9/2027	518,054	0.03
USD 1,600,000	Banco Santander 2.746% 28/5/2025	1,506,307	0.10
EUR 500,000	Cellnex Finance 2.25% 12/4/2026	467,539	0.03
EUR 403,962	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 0.528% 20/3/2033	402,715	0.03
EUR 346,253	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 0.778% 20/3/2033	339,841	0.02
EUR 173,127	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 1.778% 20/3/2033	167,375	0.01
EUR 288,545	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 3.5% 20/3/2033	273,009	0.02
		6,734,259	0.43
スウェーデン			
USD 1,600,000	Svenska Handelsbanken 1.418% 11/6/2027	1,422,213	0.09
EUR 241,000	Volvo Treasury 0% 11/2/2023	240,081	0.01
		1,662,294	0.10
スイス			
EUR 1,300,000	Credit Suisse 3.25% 2/4/2026	1,259,593	0.08
EUR 715,000	UBS 0.25% 29/1/2026	666,667	0.04
EUR 875,000	UBS 0.75% 21/4/2023	872,379	0.06
USD 3,220,000	UBS 1.494% 10/8/2027	2,802,042	0.18
USD 2,680,000	UBS 4.703% 5/8/2027	2,636,601	0.17
		8,237,282	0.53
英国			
USD 200,000	Antofagasta 2.375% 14/10/2030	163,000	0.01
GBP 521,872	Atlas Funding 2021-1 2.501% 25/7/2058	600,602	0.04
GBP 100,000	Atlas Funding 2021-1 3.101% 25/7/2058	114,517	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 100,000	Atlas Funding 2021-1 3.301% 25/7/2058	113,087	0.01
GBP 100,000	Atlas Funding 2021-1 3.851% 25/7/2058	112,526	0.01
GBP 1,699,000	Azure Finance NO 2 4.691% 20/7/2030	1,964,651	0.12
USD 235,000	Barclays 3.932% 7/5/2025	230,192	0.02
USD 4,535,000	Barclays 5.501% 9/8/2028	4,496,119	0.28
GBP 202,000	Barley Hill NO 2 3.091% 27/8/2058	226,568	0.01
GBP 115,000	Barley Hill NO 2 3.391% 27/8/2058	127,135	0.01
EUR 545,000	BAT International Finance 0.875% 13/10/2023	538,696	0.03
USD 1,000,000	BAT International Finance 1.668% 25/3/2026	894,358	0.06
GBP 837,000	Brants Bridge 2022-1 0% 12/12/2064	972,445	0.06
GBP 1,680,059	Brass No 10 1.891% 16/4/2069	1,936,582	0.12
GBP 348,000	Canada Square Funding 2021-2 2.584% 17/6/2058	390,988	0.02
GBP 102,000	Canada Square Funding 2021-2 2.984% 17/6/2058	112,960	0.01
GBP 1,302,401	Canada Square Funding 6 2.411% 17/1/2059	1,494,417	0.09
GBP 431,000	Canada Square Funding 6 2.861% 17/1/2059	475,285	0.03
GBP 318,000	Canada Square Funding 6 3.011% 17/1/2059	342,147	0.02
GBP 178,000	Canada Square Funding 6 3.411% 17/1/2059	186,092	0.01
GBP 474,931	CMF 2020-1 2.291% 16/1/2057	548,923	0.03
GBP 220,000	CMF 2020-1 2.691% 16/1/2057	251,932	0.02
GBP 105,000	CMF 2020-1 2.941% 16/1/2057	118,914	0.01
GBP 689,866	Dowson 2021-2 2.371% 20/10/2028	798,073	0.05
GBP 700,000	Dowson 2021-2 2.891% 20/10/2028	796,384	0.05
GBP 800,000	Dowson 2021-2 3.291% 20/10/2028	893,715	0.06
GBP 331,000	Dowson 2022-1 3.441% 20/1/2029	373,813	0.02
GBP 172,000	Dowson 2022-1 3.941% 20/1/2029	194,840	0.01
GBP 100,000	Dowson 2022-1 4.391% 20/1/2029	111,065	0.01
GBP 577,000	Economic Master Issuer 1.991% 25/6/2073	660,430	0.04
GBP 187,000	Economic Master Issuer 2020-1 2.161% 25/6/2072	216,879	0.01
USD 200,000	eG Global Finance 6.75% 7/2/2025	189,263	0.01
GBP 1,075,455	Elvet Mortgages 2020-1 2.268% 22/3/2065	1,246,546	0.08
GBP 967,403	Elvet Mortgages 2021-1 1.957% 22/10/2063	1,110,173	0.07
GBP 914,628	Finsbury Square 2.019% 16/12/2067	1,036,569	0.06
GBP 828,000	Finsbury Square 2.369% 16/12/2067	931,848	0.06
GBP 1,045,000	Finsbury Square 2.619% 16/12/2067	1,172,189	0.07
GBP 298,964	Finsbury Square 2020-1 2.169% 16/3/2070	346,207	0.02
GBP 224,959	Finsbury Square 2020-1 2.719% 16/3/2070	258,113	0.02
GBP 179,648	Finsbury Square 2020-2 2.669% 16/6/2070	208,597	0.01
GBP 1,577,639	Finsbury Square 2021-2 2.169% 16/12/2071	1,791,170	0.11
GBP 730,000	Finsbury Square 2021-2 2.619% 16/12/2071	792,084	0.05
GBP 371,000	Finsbury Square 2021-2 2.769% 16/12/2071	389,287	0.02
GBP 201,000	Finsbury Square 2021-2 3.069% 16/12/2071	219,063	0.01
USD 280,000	Fresnillo 4.25% 2/10/2050	216,205	0.01
GBP 1,095,000	Funding IV 2.741% 15/9/2024	1,272,232	0.08
GBP 605,000	Funding IV 3.391% 15/9/2024	702,251	0.04

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 230,000	Funding IV 3.891% 15/9/2024	266,942	0.02
GBP 580,000	Funding V 2.441% 15/10/2025	669,914	0.04
GBP 424,000	Funding V 2.891% 15/10/2025	478,144	0.03
GBP 115,000	Funding V 3.391% 15/10/2025	129,082	0.01
GBP 210,000	Funding VI 4.791% 15/7/2026	240,634	0.02
GBP 1,230,979	Gemgarto 2021-1 1.959% 16/12/2067	1,414,297	0.09
GBP 668,000	Gemgarto 2021-1 2.469% 16/12/2067	755,593	0.05
GBP 218,000	Gemgarto 2021-1 2.669% 16/12/2067	240,569	0.01
GBP 858,049	Gemgarto 2021-1 6.369% 16/12/2067	996,303	0.06
USD 600,000	GSK Consumer Healthcare Capital UK 3.125% 24/3/2025	578,719	0.04
GBP 1,309,000	Harben Finance 2.354% 28/9/2055	1,445,930	0.09
GBP 730,000	Harben Finance 2.604% 28/9/2055	774,712	0.05
GBP 441,000	Harben Finance 2.954% 28/9/2055	456,441	0.03
GBP 608,471	Hops Hill No 1 2.641% 27/5/2054	699,259	0.04
GBP 124,993	Hops Hill No 1 3.291% 27/5/2054	142,573	0.01
GBP 199,992	Hops Hill No 1 3.541% 27/5/2054	225,068	0.01
GBP 99,997	Hops Hill No 1 4.041% 27/5/2054	112,629	0.01
USD 1,605,000	HSBC 2.999% 10/3/2026	1,522,300	0.10
EUR 1,200,000	Informa 1.5% 5/7/2023	1,194,731	0.07
EUR 2,255,000	Informa 2.125% 6/10/2025	2,170,143	0.14
GBP 2,414,676	Jupiter Mortgage NO 1 2.374% 20/7/2060	2,772,803	0.17
GBP 217,750	Lanark Master Issuer 2.263% 22/12/2069	252,637	0.02
GBP 1,434,190	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 2.441% 12/6/2057	1,652,268	0.10
GBP 630,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 3.191% 12/6/2057	723,600	0.05
GBP 370,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 3.591% 12/6/2057	418,816	0.03
GBP 530,758	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 2.224% 20/7/2058	602,668	0.04
GBP 266,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 2.524% 20/7/2058	295,663	0.02
GBP 159,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 2.824% 20/7/2058	169,625	0.01
GBP 103,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 3.224% 20/7/2058	110,068	0.01
GBP 412,833	London Wall Mortgage Capital 2.443% 15/5/2051	468,631	0.03
GBP 462,094	London Wall Mortgage Capital 2.493% 15/5/2052	525,444	0.03
USD 4,800,000	LSEGA Financing 1.375% 6/4/2026	4,331,894	0.27
GBP 305,000	Mortimer BTL 2021-1 2.51% 23/6/2053	336,732	0.02
GBP 108,000	Mortimer BTL 2021-1 2.86% 23/6/2053	117,676	0.01
EUR 600,000	National Grid Electricity Transmission 0.19% 20/1/2025	567,983	0.04
USD 3,025,000	NatWest 1.642% 14/6/2027	2,653,747	0.17
USD 1,780,000	NatWest 2.359% 22/5/2024	1,749,390	0.11
EUR 900,000	NatWest Markets 0.125% 18/6/2026	804,033	0.05
USD 1,810,000	NatWest Markets 1.6% 29/9/2026	1,600,107	0.10
GBP 954,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 2.661% 15/3/2029	1,094,695	0.07
GBP 775,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 3.241% 15/3/2029	881,321	0.06
GBP 735,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 2.591% 15/11/2029	834,654	0.05

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 404,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 3.041% 15/11/2029	451,319	0.03
GBP 1,156,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2022-1 2.991% 15/4/2030	1,315,122	0.08
GBP 1,702,224	Oat Hill NO 2 2.541% 27/5/2046	1,963,440	0.12
GBP 80,524	Orbita Funding 2020-1 2.271% 17/3/2027	93,527	0.01
GBP 958,609	Pierpont BTL 2021-1 2.21% 22/12/2053	1,087,040	0.07
GBP 1,355,000	Pierpont BTL 2021-1 2.66% 22/12/2053	1,519,865	0.10
GBP 1,260,000	Polaris 2022-1 3.041% 23/10/2059	1,403,300	0.09
GBP 421,000	Polaris 2022-1 3.191% 23/10/2059	463,109	0.03
GBP 307,000	Polaris 2022-1 3.691% 23/10/2059	336,866	0.02
GBP 538,000	Polaris 2022-1 5.091% 23/10/2059	582,347	0.04
GBP 2,218,616	Precise Mortgage Funding 2019-1B 2.541% 12/12/2055	2,568,958	0.16
GBP 115,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 3.141% 16/10/2056	130,929	0.01
GBP 100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 3.391% 16/10/2056	111,930	0.01
GBP 100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 3.641% 16/10/2056	111,592	0.01
GBP 780,734	Residential Mortgage 32 2.652% 20/6/2070	903,868	0.06
GBP 525,000	Residential Mortgage 32 3.602% 20/6/2070	600,408	0.04
GBP 334,794	RMAC No 1 1.61% 12/6/2044	367,305	0.02
USD 322,000	Rolls-Royce 5.75% 15/10/2027	293,387	0.02
GBP 905,000	Sage AR Funding No 1 2.943% 17/11/2030	1,032,184	0.06
GBP 385,000	Sage AR Funding No 1 3.643% 17/11/2030	434,637	0.03
GBP 535,000	Sage AR Funding No 1 3.843% 17/11/2030	601,740	0.04
USD 2,235,000	Santander UK 3.373% 5/1/2024	2,223,788	0.14
GBP 570,484	Satus 2021-1 2.391% 17/8/2028	660,222	0.04
GBP 605,000	Satus 2021-1 2.891% 17/8/2028	687,192	0.04
GBP 743,000	Satus 2021-1 3.291% 17/8/2028	826,515	0.05
GBP 122,000	Satus 2021-1 3.591% 17/8/2028	131,689	0.01
GBP 247,000	Satus 2021-1 4.891% 17/8/2028	263,129	0.02
GBP 6,130,560	Silk Road Finance Number Six 2.26% 21/9/2067	7,140,498	0.45
GBP 916,000	Silverstone Master Issuer 1.869% 21/1/2070	1,054,039	0.07
GBP 1,396,000	Silverstone Master Issuer 2.049% 21/1/2070	1,620,235	0.10
USD 625,000	Standard Chartered 0.991% 12/1/2025	591,375	0.04
GBP 120,000	Stanlington No 2 3.091% 12/6/2056	132,578	0.01
GBP 110,000	Stanlington No 2 3.541% 12/6/2056	120,040	0.01
GBP 303,000	Stanlington No 2 4.641% 12/6/2056	338,092	0.02
GBP 491,748	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 2.23% 12/7/2063	562,083	0.04
GBP 156,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 2.48% 12/7/2063	171,015	0.01
GBP 107,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 2.78% 12/7/2063	114,727	0.01
GBP 585,563	Tower Bridge Funding 2020-1 2.772% 20/9/2063	679,712	0.04
GBP 1,060,000	Tower Bridge Funding 2020-1 3.502% 20/9/2063	1,226,696	0.08
GBP 145,000	Tower Bridge Funding 2020-1 3.852% 20/9/2063	167,670	0.01
GBP 115,000	Tower Bridge Funding 2020-1 4.852% 20/9/2063	133,122	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国(続き)			
GBP 1,904,942	Tower Bridge Funding 2021-1 2.479% 21/7/2064	2,194,214	0.14
GBP 381,999	Tower Bridge Funding 2021-1 3.079% 21/7/2064	435,351	0.03
GBP 364,999	Tower Bridge Funding 2021-1 3.429% 21/7/2064	415,888	0.03
GBP 253,000	Tower Bridge Funding 2021-1 3.729% 21/7/2064	283,771	0.02
GBP 252,999	Tower Bridge Funding 2021-2 2.793% 20/11/2063	282,358	0.02
GBP 139,999	Tower Bridge Funding 2021-2 3.193% 20/11/2063	154,726	0.01
GBP 169,999	Tower Bridge Funding 2021-2 3.493% 20/11/2063	181,142	0.01
GBP 747,497	Tower Bridge Funding 2022-1 2.122% 20/12/2063	852,033	0.05
GBP 293,000	Tower Bridge Funding 2022-1 2.402% 20/12/2063	320,657	0.02
GBP 264,000	Tower Bridge Funding 2022-1 2.652% 20/12/2063	280,170	0.02
GBP 719,869	Turbo Finance 9 2.521% 20/8/2028	835,012	0.05
GBP 1,590,000	Turbo Finance 9 3.341% 20/8/2028	1,825,812	0.12
GBP 637,522	Twin Bridges 2020-1 2.591% 12/12/2054	740,057	0.05
GBP 1,145,000	Twin Bridges 2020-1 3.341% 12/12/2054	1,319,271	0.08
GBP 390,000	Twin Bridges 2020-1 3.591% 12/12/2054	445,627	0.03
GBP 225,000	Twin Bridges 2020-1 4.341% 12/12/2054	256,971	0.02
GBP 2,800,067	Twin Bridges 2021-1 2.191% 12/3/2055	3,182,728	0.20
GBP 436,000	Twin Bridges 2021-1 2.941% 12/3/2055	475,173	0.03
GBP 220,000	Twin Bridges 2021-1 3.441% 12/3/2055	234,382	0.01
GBP 1,101,638	Twin Bridges 2021-2 2.001% 12/9/2055	1,238,643	0.08
GBP 443,000	Twin Bridges 2021-2 2.241% 12/9/2055	476,369	0.03
GBP 338,000	Twin Bridges 2021-2 2.491% 12/9/2055	360,943	0.02
GBP 188,000	Twin Bridges 2021-2 2.841% 12/9/2055	195,113	0.01
GBP 192,841	Twin Bridges 2021-2 4.241% 12/9/2055	223,347	0.01
GBP 1,495,294	Twin Bridges 2022-1 2.111% 1/12/2055	1,677,047	0.11
GBP 891,000	Twin Bridges 2022-1 2.341% 1/12/2055	937,557	0.06
GBP 723,000	Twin Bridges 2022-1 2.641% 1/12/2055	738,999	0.05
GBP 365,000	Twin Bridges 2022-1 3.041% 1/12/2055	359,899	0.02
GBP 658,368	Unique Pub Finance 7.395% 28/3/2024	775,783	0.05
USD 300,000	Virgin Media Secured Finance 5.5% 15/5/2029	267,789	0.02
EUR 530,000	Virgin Money UK 0.375% 27/5/2024	521,069	0.03
EUR 314,000	WPP Finance 2013 3% 20/11/2023	317,921	0.02
		127,840,682	8.08
米国			
USD 5,673,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 3.901% 10/8/2035	5,434,154	0.34
USD 2,145,000	225 Liberty Street Trust 2016-225L 3.597% 10/2/2036	2,023,618	0.13
USD 5,662,000	7-Eleven 0.8% 10/2/2024	5,392,956	0.34
USD 1,165,000	7-Eleven 0.95% 10/2/2026	1,036,330	0.07
EUR 320,000	AbbVie 1.25% 1/6/2024	315,446	0.02
EUR 1,305,000	AbbVie 1.5% 15/11/2023	1,303,695	0.08
USD 1,750,000	AbbVie 2.95% 21/11/2026	1,654,277	0.11
USD 200,000	Acuris Finance US / Acuris Finance 5% 1/5/2028	168,204	0.01
USD 117,000	AdaptHealth 6.125% 1/8/2028	108,898	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 49,000	ADT Security 4.125% 15/6/2023	48,681	0.00
USD 191,000	Advanced Drainage Systems 5% 30/9/2027	182,348	0.01
USD 223,000	Aethon United BR / Aethon United Finance 8.25% 15/2/2026	225,132	0.01
USD 1,185,000	Air Lease 1.875% 15/8/2026	1,040,591	0.07
USD 53,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.5% 15/3/2029	43,791	0.00
USD 123,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.625% 15/1/2027	112,670	0.01
USD 68,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 5.875% 15/2/2028	64,782	0.00
USD 1,905,000	Alexander Funding Trust 1.841% 15/11/2023	1,811,814	0.11
USD 22,000	Allegiant Travel 7.25% 15/8/2027	21,876	0.00
USD 483,000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 4.25% 15/10/2027	437,492	0.03
USD 410,000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6.625% 15/7/2026	385,622	0.02
USD 79,000	AMC Networks 4.75% 1/8/2025	73,460	0.00
USD 252,000	American Airlines 11.75% 15/7/2025	277,478	0.02
USD 161,000	American Airlines Aadvantage Loyalty IP 5.5% 20/4/2026	153,861	0.01
USD 42,000	American Builders & Contractors Supply 4% 15/1/2028	38,078	0.00
USD 3,025,000	American Express 2.55% 4/3/2027	2,820,868	0.18
USD 3,600,000	American Express 3.95% 1/8/2025	3,567,140	0.23
EUR 700,000	American International 1.875% 21/6/2027	658,672	0.04
EUR 1,400,000	American Tower 0.4% 15/2/2027	1,216,424	0.08
EUR 1,050,000	American Tower 0.45% 15/1/2027	920,596	0.06
USD 925,000	American Tower 1.3% 15/9/2025	840,511	0.05
USD 500,000	American Tower 1.45% 15/9/2026	440,257	0.03
USD 1,245,000	American Tower 1.6% 15/4/2026	1,119,772	0.07
USD 450,000	American Tower 2.4% 15/3/2025	427,079	0.03
USD 85,000	AmWINS 4.875% 30/6/2029	74,335	0.01
USD 88,000	ANGI 3.875% 15/8/2028	67,130	0.00
USD 13,000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 5.75% 1/3/2027	12,338	0.00
USD 173,000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 7.875% 15/5/2026	176,333	0.01
USD 79,000	Antero Resources 7.625% 1/2/2029	81,466	0.01
USD 1,430,000	Aon / Aon Global 2.85% 28/5/2027	1,338,846	0.08
USD 75,000	APX 6.75% 15/2/2027	73,577	0.01
USD 79,000	Aramark Services 5% 1/4/2025	77,254	0.01
USD 78,000	Aramark Services 5% 1/2/2028	71,980	0.00
USD 96,000	Aramark Services 6.375% 1/5/2025	94,681	0.01
USD 117,000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6.25% 1/4/2028	107,533	0.01
USD 146,000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6.875% 1/4/2027	138,074	0.01
USD 118,000	Arconic 6.125% 15/2/2028	110,956	0.01
USD 100,000	Arcosa 4.375% 15/4/2029	90,754	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 538,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	530,777	0.03
USD 228,000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 5.875% 30/6/2029	205,678	0.01
EUR 845,000	AT&T 1.05% 5/9/2023*	838,711	0.05
USD 5,035,000	AT&T 1.7% 25/3/2026	4,611,434	0.29
USD 241,000	Avantor Funding 4.625% 15/7/2028	222,000	0.01
USD 114,000	Avaya 6.125% 15/9/2028	62,621	0.00
USD 1,380,000	Aviation Capital 1.95% 30/1/2026	1,192,763	0.08
USD 1,665,000	Aviation Capital 1.95% 20/9/2026	1,398,248	0.09
USD 299,000	Axalta Coating Systems 3.375% 15/2/2029	248,894	0.02
USD 3,054,000	Ball 5.25% 1/7/2025	3,028,973	0.19
USD 11,318	Banc of America Mortgage 2003-J Trust 2.465% 25/11/2033	10,459	0.00
USD 4,950,000	Bank of America 1.197% 24/10/2026	4,431,846	0.28
USD 2,694,000	Bank of America 1.319% 19/6/2026	2,454,609	0.16
USD 2,825,000	Bank of America 1.53% 6/12/2025	2,638,872	0.17
USD 2,325,000	Bank of America 1.734% 22/7/2027	2,080,700	0.13
USD 4,365,000	Bank of America 1.843% 4/2/2025	4,196,452	0.27
USD 1,575,000	Bank of America 2.015% 13/2/2026	1,478,228	0.09
USD 5,295,000	Bank of America 3.004% 20/12/2023	5,275,938	0.33
USD 4,135,000	Bank of America 4.827% 22/7/2026	4,148,609	0.26
USD 2,710,000	Bank of New York Mellon 3.43% 13/6/2025	2,679,503	0.17
USD 2,095,000	Bank of New York Mellon 4.414% 24/7/2026	2,108,167	0.13
USD 2,935,000	BAT Capital 2.789% 6/9/2024	2,846,923	0.18
USD 8,120,000	BAT Capital 3.222% 15/8/2024	7,936,785	0.50
EUR 510,000	Becton Dickinson 0.034% 13/8/2025	472,742	0.03
EUR 310,000	Becton Dickinson 1.401% 24/5/2023	309,809	0.02
USD 176,000	Big River Steel / BRS Finance 6.625% 31/1/2029	175,033	0.01
USD 122,000	Black Knight InfoServ 3.625% 1/9/2028	111,986	0.01
USD 3,500,000	Blackstone Private Credit Fund 3.25% 15/3/2027	3,012,150	0.19
USD 1,965,000	Blackstone Private Credit Fund 4% 15/1/2029	1,701,369	0.11
USD 258,000	Block 2.75% 1/6/2026	230,114	0.02
USD 93,000	Blue Racer Midstream / Blue Racer Finance 7.625% 15/12/2025	92,701	0.01
USD 1,500,000	Boeing 2.196% 4/2/2026	1,374,694	0.09
EUR 840,000	Booking 0.1% 8/3/2025	789,919	0.05
USD 128,000	Booz Allen Hamilton 3.875% 1/9/2028	114,067	0.01
USD 343,000	Boxer Parent 7.125% 2/10/2025	339,913	0.02
USD 75,000	Boyne USA 4.75% 15/5/2029	66,975	0.00
USD 1,535,000	Broadcom 3.15% 15/11/2025	1,486,405	0.09
USD 2,700,000	Broadcom / Broadcom Cayman Finance 3.875% 15/1/2027	2,602,199	0.16
USD 84,000	Brookfield Property REIT / BPR Cumulus / BPR Nimbus / GGS Sellco 4.5% 1/4/2027	71,569	0.00
USD 77,000	Buckeye Partners 4.125% 1/3/2025	72,167	0.01
USD 70,000	Buckeye Partners 4.5% 1/3/2028	61,915	0.00
USD 134,000	BWX Technologies 4.125% 30/6/2028	123,631	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,130,000	BX Trust 2018-BILT 4.161% 15/5/2030	1,081,454	0.07
USD 397,000	Caesars Entertainment 6.25% 1/7/2025	388,448	0.02
USD 84,000	Caesars Resort Collection / CRC Finco 5.75% 1/7/2025	82,701	0.01
USD 28,000	Callon Petroleum 6.375% 1/7/2026	26,079	0.00
USD 157,000	Callon Petroleum 8% 1/8/2028	151,476	0.01
USD 85,000	Calpine 4.625% 1/2/2029	72,535	0.01
USD 125,000	Calpine 5.25% 1/6/2026	121,737	0.01
USD 57,000	Camelot Return Merger Sub 8.75% 1/8/2028	52,224	0.00
USD 1,545,000	Capital One Financial 1.878% 2/11/2027	1,365,296	0.09
USD 1,715,000	Capital One Financial 2.636% 3/3/2026	1,628,752	0.10
USD 3,000,000	Capital One Financial 2.986% 6/12/2024	2,923,867	0.19
USD 2,820,000	Capital One Financial 4.927% 10/5/2028	2,798,252	0.18
USD 7,000	Carpenter Technology 6.375% 15/7/2028	6,702	0.00
USD 126,000	Catalent Pharma Solutions 3.125% 15/2/2029	104,853	0.01
USD 457,000	CCO / CCO Capital 5.125% 1/5/2027	436,460	0.03
USD 313,000	CCO / CCO Capital 5.375% 1/6/2029	288,303	0.02
USD 176,000	CCO / CCO Capital 6.375% 1/9/2029	171,468	0.01
USD 2,430,160	CD 2016-CD1 Mortgage Trust 2.622% 10/8/2049	2,345,226	0.15
USD 76,000	CD&R Smokey Buyer 6.75% 15/7/2025	72,664	0.00
USD 4,000,000	CDW / CDW Finance 4.125% 1/5/2025	3,936,639	0.25
USD 93,000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5.5% 1/5/2025	91,232	0.01
USD 7,625,000	Celanese US 5.9% 5/7/2024	7,693,443	0.49
USD 422,000	Centene 2.45% 15/7/2028	356,446	0.02
USD 162,000	Centennial Resource Production 6.875% 1/4/2027	156,549	0.01
USD 142,000	Central Parent / CDK Global 7.25% 15/6/2029	135,780	0.01
USD 3,180,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 3.217% 10/11/2049	3,020,328	0.19
USD 64,000	Charles River Laboratories International 4.25% 1/5/2028	58,767	0.00
USD 1,555,000	Charles Schwab 2.45% 3/3/2027	1,456,527	0.09
USD 3,999,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4.908% 23/7/2025	3,994,886	0.25
USD 208,000	Cheniere Energy 4.625% 15/10/2028	200,499	0.01
USD 178,000	Chesapeake Energy 6.75% 15/4/2029	174,696	0.01
USD 128,301	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-HYB8 3.074% 20/12/2035	120,825	0.01
USD 141,000	Chobani / Chobani Finance 4.625% 15/11/2028	123,587	0.01
USD 44,000	CHS/Community Health Systems 5.625% 15/3/2027	37,661	0.00
USD 65,000	CHS/Community Health Systems 8% 15/3/2026	60,409	0.00
EUR 340,000	Chubb INA 0.3% 15/12/2024	323,898	0.02
USD 42,000	Churchill Downs 4.75% 15/1/2028	37,971	0.00
USD 231,000	Churchill Downs 5.5% 1/4/2027	221,841	0.01
USD 141,000	CITGO Petroleum 7% 15/6/2025	137,868	0.01
USD 1,340,000	Citigroup 0.981% 1/5/2025	1,263,932	0.08
USD 6,880,000	Citigroup 1.462% 9/6/2027	6,083,928	0.38
USD 135,000	Citigroup 3.106% 8/4/2026	129,814	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,120,000	Citigroup 3.29% 17/3/2026	1,082,888	0.07
USD 2,735,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P 3.251% 10/5/2035	2,679,257	0.17
USD 4,105,233	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC11 2.815% 10/4/2046	4,084,211	0.26
USD 838,645	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 3.552% 10/3/2047	832,265	0.05
USD 3,380,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC21 3.855% 10/5/2047	3,337,237	0.21
USD 4,800,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 3.137% 10/2/2048	4,654,397	0.29
USD 5,523,941	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29 2.935% 10/4/2048	5,313,032	0.34
USD 4,101,125	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC33 3.778% 10/9/2058	4,008,254	0.25
USD 2,827,573	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P4 2.779% 10/7/2049	2,742,460	0.17
USD 2,899,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P4 2.902% 10/7/2049	2,742,443	0.17
USD 6,345,171	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P5 2.684% 10/10/2049	5,917,378	0.37
USD 308,000	Clarivate Science 3.875% 1/7/2028	264,568	0.02
USD 132,000	Clean Harbors 4.875% 15/7/2027	125,751	0.01
USD 592,000	Clear Channel Outdoor 5.125% 15/8/2027	530,456	0.03
USD 129,000	Clearway Energy Operating 4.75% 15/3/2028	120,213	0.01
USD 138,000	Clydesdale Acquisition 6.625% 15/4/2029	132,511	0.01
USD 19,000	CNX Resources 6% 15/1/2029	17,840	0.00
USD 267,000	Colgate Energy Partners III 7.75% 15/2/2026	266,822	0.02
USD 6,440,000	COMM 2013-CCRE10 Mortgage Trust 4.21% 10/8/2046	6,421,374	0.41
USD 254,943	COMM 2013-CCRE7 Mortgage Trust 2.739% 10/3/2046	254,253	0.02
USD 800,000	COMM 2013-CCRE8 Mortgage Trust 4.048% 10/6/2046	789,379	0.05
USD 4,868,987	COMM 2013-CCRE9 Mortgage Trust 4.411% 10/7/2045	4,835,961	0.31
USD 127,934	COMM 2013-SFS Mortgage Trust 1.873% 12/4/2035	126,461	0.01
USD 3,000,000	COMM 2014-277P Mortgage Trust 3.732% 10/8/2049	2,894,229	0.18
USD 4,250,000	COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust 3.828% 15/7/2047	4,188,028	0.27
USD 5,134,667	COMM 2014-CCRE21 Mortgage Trust 3.528% 10/12/2047	5,020,747	0.32
USD 5,000,000	COMM 2014-LC15 Mortgage Trust 4.006% 10/4/2047	4,948,453	0.31
USD 1,084,495	COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust 3.367% 10/6/2047	1,076,208	0.07
USD 1,017,167	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 3.548% 10/9/2047	1,008,378	0.06
USD 560,000	COMM 2015-3BP Mortgage Trust 3.178% 10/2/2035	532,185	0.03
USD 8,677,982	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 1.017% 10/5/2048	156,599	0.01
USD 1,462,725	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust 3.445% 10/8/2048	1,444,970	0.09
USD 4,785,241	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust 3.445% 10/7/2048	4,668,680	0.30
USD 765,000	COMM 2018-COR3 Mortgage Trust 4.228% 10/5/2051	753,054	0.05
USD 142,000	CommScope 6% 1/3/2026	134,005	0.01
USD 51,000	CommScope Technologies 6% 15/6/2025	46,148	0.00
USD 180,000	Comstock Resources 6.75% 1/3/2029	171,741	0.01
USD 242,000	Connect Finco / Connect US Finco 6.75% 1/10/2026	222,032	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 74,000	Consensus Cloud Solutions 6.5% 15/10/2028	66,301	0.00
USD 93,000	Consolidated Communications 6.5% 1/10/2028	76,027	0.01
USD 89,000	CoreLogic 4.5% 1/5/2028	70,217	0.00
USD 4,000	Coty /HFC Prestige Products /HFC Prestige International US 4.75% 15/1/2029	3,526	0.00
USD 263,000	Crescent Energy Finance 7.25% 1/5/2026	251,600	0.02
USD 86,000	Crowdstrike 3% 15/2/2029	74,944	0.01
USD 143,000	Crown Americas / Crown Americas Capital VI 4.75% 1/2/2026	138,240	0.01
USD 1,820,000	Crown Castle 1.35% 15/7/2025	1,670,583	0.11
USD 8,000	CrownRock / CrownRock Finance 5% 1/5/2029	7,375	0.00
USD 347,000	CrownRock / CrownRock Finance 5.625% 15/10/2025	342,298	0.02
USD 1,645,000	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust 3.505% 15/4/2050	1,602,956	0.10
USD 2,700,000	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust 4.224% 15/8/2051	2,660,421	0.17
USD 373,000	CSC 5.25% 1/6/2024	364,795	0.02
USD 200,000	CSC 5.375% 1/2/2028	182,053	0.01
USD 23,000	CTR Partnership / CareTrust Capital 3.875% 30/6/2028	19,415	0.00
USD 149,000	Cushman & Wakefield US Borrower 6.75% 15/5/2028	147,927	0.01
USD 1,130,000	CVS Health 3.625% 1/4/2027	1,102,344	0.07
EUR 375,000	Danaher 1.7% 30/3/2024	374,255	0.02
USD 71,000	Darling Ingredients 5.25% 15/4/2027	69,560	0.00
USD 2,238,719	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 3.172% 15/5/2035	2,212,696	0.14
USD 1,500,000	DBJPM 2016-C3 Mortgage Trust 2.632% 10/8/2049	1,411,309	0.09
USD 2,076,000	DBWF 2018-GLKS Mortgage Trust 3.396% 19/12/2030	2,030,125	0.13
USD 114,000	DCP Midstream Operating 5.125% 15/5/2029	111,862	0.01
USD 7,000	DCP Midstream Operating 5.625% 15/7/2027	7,096	0.00
USD 1,810,000	Dell International / EMC 4% 15/7/2024	1,804,334	0.11
EUR 1,000,000	Digital Euro Finco 2.5% 16/1/2026	964,193	0.06
USD 113,000	Directv Financing / Directv Financing Co-Obligor 5.875% 15/8/2027	104,681	0.01
USD 103,000	DISH DBS 5% 15/3/2023	101,069	0.01
USD 303,000	DISH DBS 5.25% 1/12/2026	250,452	0.02
USD 840,000	DR Horton 1.3% 15/10/2026	729,312	0.05
USD 204,000	DT Midstream 4.125% 15/6/2029	178,892	0.01
USD 82,000	Earthstone Energy 8% 15/4/2027	80,467	0.01
USD 2,250,000	Edison International 4.7% 15/8/2025	2,235,783	0.14
USD 462,000	Element Solutions 3.875% 1/9/2028	402,335	0.02
USD 125,000	Enact 6.5% 15/8/2025	121,911	0.01
USD 34,000	Energizer 6.5% 31/12/2027	31,709	0.00
USD 1,215,000	Energy Transfer 2.9% 15/5/2025	1,152,921	0.07
USD 1,930,000	Energy Transfer 3.45% 15/1/2023	1,930,307	0.12
USD 1,250,000	Energy Transfer 3.6% 1/2/2023	1,248,617	0.08
USD 1,435,000	Energy Transfer 4.5% 15/4/2024	1,433,598	0.09
USD 4,400,000	Energy Transfer 5.875% 15/1/2024	4,463,426	0.28
USD 136,000	EnLink Midstream 5.375% 1/6/2029	127,297	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 35,000	EnLink Midstream 5.625% 15/1/2028	33,550	0.00
USD 190,000	EnLink Midstream Partners 4.85% 15/7/2026	187,179	0.01
USD 75,000	EnPro Industries 5.75% 15/10/2026	73,718	0.01
USD 13,000	Entegris 3.625% 1/5/2029	11,076	0.00
USD 236,000	Entegris Escrow 4.75% 15/4/2029	216,221	0.01
USD 69,000	EQM Midstream Partners 6% 1/7/2025	67,203	0.00
USD 204,000	EQM Midstream Partners 6.5% 1/7/2027	197,226	0.01
USD 1,005,000	Equinix 1.25% 15/7/2025	921,243	0.06
USD 3,656,000	Equinix 1.45% 15/5/2026	3,275,069	0.21
USD 2,200,000	Eversource Energy 2.9% 1/3/2027	2,069,827	0.13
USD 740,000	Exelon 2.75% 15/3/2027	693,936	0.04
USD 80,000	Fair Isaac 4% 15/6/2028	70,770	0.00
USD 4,486,675	Fannie Mae Pool 2.5% 1/6/2035	4,273,269	0.27
USD 378,279	Fannie Mae Pool 2.763% 1/9/2042	387,377	0.02
USD 21,136	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2027	20,765	0.00
USD 30,788	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2028	30,123	0.00
USD 345,958	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2030	339,469	0.02
USD 139,055	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2030	136,442	0.01
USD 36,810	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2030	36,118	0.00
USD 21,851	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	21,441	0.00
USD 12,772	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	12,532	0.00
USD 46,669	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	45,799	0.00
USD 372,544	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	365,559	0.02
USD 51,050	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	50,045	0.00
USD 12,180	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	11,851	0.00
USD 9,905	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2030	9,695	0.00
USD 242,561	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2030	237,428	0.02
USD 398,697	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2030	388,502	0.03
USD 44,008	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2031	42,975	0.00
USD 15,026	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2031	14,732	0.00
USD 30,229	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2031	29,662	0.00
USD 268,209	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2031	263,176	0.02
USD 297,108	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2031	291,731	0.02
USD 24,888	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2031	24,352	0.00
USD 40,710	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2031	39,946	0.00
USD 35,406	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2031	34,454	0.00
USD 56,618	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2031	55,555	0.00
USD 285,495	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2031	280,048	0.02
USD 13,356	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2031	13,106	0.00
USD 31,895	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2031	31,299	0.00
USD 445,809	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2031	435,252	0.03
USD 301,417	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2031	293,317	0.02
USD 85,756	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2031	83,884	0.01
USD 39,316	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2032	38,581	0.00

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 252,747	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2032	245,955	0.02
USD 105,534	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2032	102,699	0.01
USD 180,429	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2032	177,054	0.01
USD 395,483	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2032	388,093	0.03
USD 551,036	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2032	536,824	0.03
USD 21,446	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2032	20,913	0.00
USD 8,512	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2032	8,300	0.00
USD 12,379	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2032	12,073	0.00
USD 210,475	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2032	204,816	0.01
USD 237,284	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2032	231,369	0.02
USD 378,706	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2032	369,285	0.02
USD 45,005	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2032	43,953	0.00
USD 19,494	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2032	19,009	0.00
USD 12,932	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	12,593	0.00
USD 73,022	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	71,138	0.00
USD 144,153	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	140,618	0.01
USD 36,331	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2033	35,378	0.00
USD 226,566	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2033	220,929	0.01
USD 24,954	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2033	24,315	0.00
USD 869,864	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2035	840,117	0.05
USD 572,545	Fannie Mae Pool 3.155% 1/9/2044	570,867	0.04
USD 89,940	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2034	88,787	0.01
USD 581,574	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2034	574,589	0.04
USD 889,297	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2033	898,049	0.06
USD 750,400	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2033	754,169	0.05
USD 315,309	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2033	317,710	0.02
USD 5,073,742	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2033	5,099,705	0.32
USD 382,762	Fannie Mae Pool 4% 1/2/2034	384,961	0.02
USD 24,457	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	24,542	0.00
USD 197,519	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	198,146	0.01
USD 209,988	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	210,814	0.01
USD 251,538	Fannie Mae Pool 4% 1/7/2037	252,903	0.02
USD 311,635	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2037	310,246	0.02
USD 217,974	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2038	217,010	0.01
USD 3,181,969	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2043	3,197,437	0.20
USD 4,184,879	Fannie Mae Pool 4% 1/12/2044	4,194,108	0.27
USD 10,221,681	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2048	10,271,251	0.65
USD 686,833	Fannie Mae Pool 4.5% 1/3/2047	696,927	0.04
USD 2,060,822	Fannie Mae Pool 4.5% 1/5/2047	2,090,546	0.13
USD 278,935	Fannie Mae Pool 4.5% 1/7/2047	283,264	0.02
USD 2,282,326	Fannie Mae Pool 4.5% 1/11/2047	2,330,327	0.15
USD 372,055	Fannie Mae Pool 4.5% 1/6/2048	380,929	0.02
USD 1,152,537	Fannie Mae Pool 4.5% 1/11/2048	1,183,301	0.08
USD 3,548,593	Fannie Mae Pool 4.5% 1/2/2049	3,658,825	0.23

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 977,265	Fannie Mae Pool 4.5% 1/4/2049	1,004,410	0.06
USD 377	Fannie Mae Pool 5% 1/7/2025	379	0.00
USD 2,682,025	Fannie Mae Pool 5% 1/6/2039	2,808,234	0.18
USD 14,000,000	Federal Farm Credit Banks Funding 0.71% 1/4/2025	12,975,122	0.82
USD 16,000,000	Federal National Mortgage Association 0.55% 19/8/2025	14,583,447	0.92
USD 103,000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 4.625% 15/1/2029	90,224	0.01
EUR 1,530,000	Fidelity National Information Services 0.125% 3/12/2022	1,528,203	0.10
USD 1,370,000	Fidelity National Information Services 4.5% 15/7/2025	1,374,463	0.09
USD 1,146,000	First-Citizens Bank & Trust 3.929% 19/6/2024	1,135,497	0.07
USD 307,000	FirstEnergy 4.4% 15/7/2027	294,775	0.02
USD 1,076,764	Ford Credit Auto Owner Trust 2018-B 3.38% 15/3/2024	1,076,950	0.07
USD 615,000	Ford Motor Credit 2.7% 10/8/2026	537,356	0.03
USD 387,000	Ford Motor Credit 2.9% 16/2/2028	324,383	0.02
USD 1,826,000	Ford Motor Credit 3.37% 17/11/2023	1,778,252	0.11
USD 200,000	Ford Motor Credit 3.81% 9/1/2024	194,892	0.01
USD 200,000	Ford Motor Credit 5.113% 3/5/2029	187,007	0.01
USD 58,000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 6.5% 1/10/2025	54,213	0.00
USD 491,800	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/2/2036	475,364	0.03
USD 1,000,952	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/2/2034	1,006,973	0.06
USD 1,221,796	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/2/2034	1,230,003	0.08
USD 1,103,310	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/3/2034	1,112,608	0.07
USD 54,403	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/11/2036	54,748	0.00
USD 685,115	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/6/2037	689,471	0.04
USD 229,584	Freddie Mac Gold Pool 4.5% 1/7/2047	234,391	0.02
USD 6,891,532	Freddie Mac Gold Pool 4.5% 1/3/2049	7,082,379	0.45
USD 100,456,364	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0.835% 25/9/2024	1,098,827	0.07
USD 1,503,450	Freddie Mac Non Gold Pool 3.219% 1/5/2045	1,490,649	0.09
USD 5,843,643	Freddie Mac REMICS 1.5% 15/4/2044	5,727,763	0.36
USD 830,654	Freddie Mac REMICS 2% 25/6/2044	784,355	0.05
USD 2,333,597	Freddie Mac REMICS 2% 25/6/2045	2,196,144	0.14
USD 1,435,674	Freddie Mac REMICS 3% 15/8/2043	1,372,705	0.09
USD 817,881	Freddie Mac REMICS 3% 15/1/2044	804,600	0.05
USD 1,673,431	Freddie Mac REMICS 3% 15/9/2046	1,611,898	0.10
USD 1,050,713	Freddie Mac REMICS 3% 25/7/2049	1,001,938	0.06
USD 1,296,649	Freddie Mac REMICS 4% 15/12/2043	1,295,760	0.08
USD 36,732	Freddie Mac REMICS 4.5% 15/9/2041	36,982	0.00
USD 80,061	Freddie Mac REMICS 4.5% 15/11/2041	81,209	0.01
USD 590,000	FREMF 2013-K27 Mortgage Trust 3.619% 25/1/2046	586,471	0.04
USD 465,000	FREMF 2013-K31 Mortgage Trust 3.746% 25/7/2046	462,273	0.03
USD 62,000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	54,548	0.00
USD 196,000	Frontier Communications 5.875% 15/10/2027	183,211	0.01
USD 142,000	Gartner 4.5% 1/7/2028	131,258	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 55,000	Gates Global / Gates 6.25% 15/1/2026	52,191	0.00
USD 30,000	GCI 4.75% 15/10/2028	27,078	0.00
EUR 360,000	General Mills 0.45% 15/1/2026	334,354	0.02
USD 965,000	General Motors 5.4% 2/10/2023	975,302	0.06
EUR 1,500,000	General Motors Financial 0.85% 26/2/2026	1,361,773	0.09
USD 2,700,000	General Motors Financial 2.35% 26/2/2027	2,403,337	0.15
USD 900,000	General Motors Financial 4% 15/1/2025	889,819	0.06
USD 78,000	Global Net Lease / Global Net Lease Operating Partnership 3.75% 15/12/2027	67,363	0.00
USD 4,200,000	Global Payments 1.2% 1/3/2026	3,715,851	0.24
USD 535,000	Global Payments 2.15% 15/1/2027	476,480	0.03
USD 15,000	Go Daddy Operating / GD Finance 3.5% 1/3/2029	12,665	0.00
USD 96,000	Go Daddy Operating / GD Finance 5.25% 1/12/2027	90,369	0.01
USD 1,029,000	Goldman Sachs 0.627% 17/11/2023	1,020,770	0.06
USD 1,030,000	Goldman Sachs 0.657% 10/9/2024	989,160	0.06
USD 1,500,000	Goldman Sachs 1.431% 9/3/2027	1,336,019	0.08
USD 705,000	Goldman Sachs 1.948% 21/10/2027	628,362	0.04
USD 2,925,000	Goldman Sachs 2.64% 24/2/2028	2,663,377	0.17
USD 1,250,000	Goldman Sachs 3.615% 15/3/2028	1,186,118	0.08
USD 970,214	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4 1.93% 20/7/2048	810,101	0.05
USD 607,743	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-5 2.31% 20/10/2048	523,554	0.03
USD 83,000	Goodyear Tire & Rubber 9.5% 31/5/2025	86,838	0.01
USD 3,672,513	Government National Mortgage Association 0.646% 16/2/2053	63,781	0.00
USD 1,844,836	Government National Mortgage Association 3% 20/7/2045	1,810,732	0.11
USD 821,118	Government National Mortgage Association 3% 20/3/2047	797,180	0.05
USD 56,000	Graham 5.75% 1/6/2026	55,699	0.00
USD 114,000	Graphic Packaging International 3.5% 15/3/2028	100,714	0.01
USD 1,697,682	GS Mortgage Trust 2011-GC5 5.209% 10/8/2044	1,692,667	0.11
USD 990,778	GS Mortgage Trust 2013-GC16 3.813% 10/11/2046	986,313	0.06
USD 3,495,242	GS Mortgage Trust 2014-GC18 4.074% 10/1/2047	3,466,325	0.22
USD 2,960,000	GS Mortgage Trust 2014-GC24 3.931% 10/9/2047	2,916,981	0.18
USD 2,330,000	GS Mortgage Trust 2015-GC32 3.764% 10/7/2048	2,276,235	0.14
USD 1,500,000	GS Mortgage Trust 2015-GC34 3.506% 10/10/2048	1,450,772	0.09
USD 2,916,913	GS Mortgage Trust 2016-GS2 3.05% 10/5/2049	2,770,245	0.18
USD 2,275,346	GS Mortgage Trust 2016-GS3 2.777% 10/10/2049	2,206,972	0.14
USD 8,000	Gulfport Energy 8% 17/5/2026	8,065	0.00
USD 38,000	Halliburton 3.8% 15/11/2025	37,760	0.00
USD 200,000	Hanwha Energy USA 4.125% 5/7/2025	197,554	0.01
USD 56,000	HAT I / HAT II 3.375% 15/6/2026	49,078	0.00
USD 1,700,000	HCA 5.25% 15/4/2025	1,721,082	0.11
USD 3,500,000	HCA 5.375% 1/2/2025	3,539,638	0.22
USD 893,000	HCA 5.375% 1/9/2026	900,997	0.06
USD 2,722,000	HCA 5.875% 15/2/2026	2,778,917	0.18

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 820,000	Healthpeak Properties 1.35% 1/2/2027	721,417	0.05
USD 65,000	Herc 5.5% 15/7/2027	61,577	0.00
USD 8,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 5.75% 1/2/2029	7,340	0.00
USD 15,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6.25% 1/11/2028	14,308	0.00
USD 20,000	Hilton Domestic Operating 3.75% 1/5/2029	17,258	0.00
USD 111,000	Hilton Domestic Operating 5.375% 1/5/2025	109,900	0.01
USD 82,000	Hilton Worldwide Finance / Hilton Worldwide Finance 4.875% 1/4/2027	78,413	0.01
USD 74,000	Home Point Capital 5% 1/2/2026	52,650	0.00
USD 133,000	Howard Hughes 5.375% 1/8/2028	118,009	0.01
USD 1,470,000	Huntington Bancshares 4.443% 4/8/2028	1,439,553	0.09
USD 1,805,000	Hyundai Capital America 1.65% 17/9/2026	1,582,162	0.10
USD 61,000	IAA 5.5% 15/6/2027	57,730	0.00
USD 10,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4.375% 1/2/2029	8,558	0.00
USD 70,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4.75% 15/9/2024	66,827	0.00
USD 101,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 5.25% 15/5/2027	91,976	0.01
USD 76,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 6.25% 15/5/2026	72,963	0.00
EUR 1,045,000	Illinois Tool Works 0.25% 5/12/2024	999,623	0.06
USD 152,000	Imola Merger 4.75% 15/5/2029	129,773	0.01
USD 925,000	Intel 3.75% 5/8/2027	912,733	0.06
USD 2,373,000	Intercontinental Exchange 4% 15/9/2027	2,352,461	0.15
USD 6,430,000	International Flavors & Fragrances 1.23% 1/10/2025	5,792,044	0.37
USD 308,000	IQVIA 5% 15/5/2027	298,204	0.02
USD 3,780,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-BCON 3.735% 5/1/2031	3,764,105	0.24
USD 4,720,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2013-C16 4.166% 15/12/2046	4,676,537	0.30
USD 694,167	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2013-LC11 2.554% 15/4/2046	691,212	0.04
USD 4,818,941	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2016-JP2 2.559% 15/8/2049	4,488,462	0.28
USD 1,431,518	JP Morgan Mortgage Trust 2014-2 3% 25/6/2029	1,366,704	0.09
USD 881,563	JP Morgan Mortgage Trust 2016-2 3.161% 25/6/2046	843,667	0.05
USD 1,272,247	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2013-C17 3.705% 15/1/2047	1,264,818	0.08
USD 1,643,999	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C23 3.657% 15/9/2047	1,624,741	0.10
USD 457,532	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C26 3.288% 15/1/2048	450,846	0.03
USD 1,277,472	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C33 3.504% 15/12/2048	1,228,563	0.08
USD 3,000,000	JPMorgan Chase 0.824% 1/6/2025	2,810,719	0.18
USD 3,900,000	JPMorgan Chase 1.045% 19/11/2026	3,472,873	0.22
EUR 420,000	JPMorgan Chase 1.5% 27/1/2025	410,806	0.03
USD 1,850,000	JPMorgan Chase 1.578% 22/4/2027	1,656,618	0.11
USD 1,234,000	JPMorgan Chase 2.083% 22/4/2026	1,156,069	0.07
USD 2,405,000	JPMorgan Chase 2.301% 15/10/2025	2,297,999	0.15

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,880,000	JPMorgan Chase 4.851% 25/7/2028	3,887,673	0.25
USD 185,000	Kaiser Aluminum 4.625% 1/3/2028	159,405	0.01
USD 3,500,000	KB Home 7.625% 15/5/2023	3,518,457	0.22
USD 855,000	KeyBank NA/Cleveland OH 4.15% 8/8/2025	849,382	0.05
USD 75,000	Korn Ferry 4.625% 15/12/2027	70,427	0.00
USD 487,000	Kraft Heinz Foods 3.875% 15/5/2027	470,897	0.03
USD 62,000	LABL 5.875% 1/11/2028	55,369	0.00
USD 48,000	Ladder Capital Finance / Ladder Capital Finance 4.25% 1/2/2027	41,755	0.00
USD 7,000	Lamar Media 3.75% 15/2/2028	6,289	0.00
USD 141,000	Lamb Weston 4.875% 15/5/2028	134,731	0.01
USD 50,000	Legends Hospitality / Legends Hospitality Co-Issuer 5% 1/2/2026	45,821	0.00
USD 31,000	Level 3 Financing 3.4% 1/3/2027	27,384	0.00
USD 3,000	Level 3 Financing 3.625% 15/1/2029	2,412	0.00
USD 96,000	Level 3 Financing 4.25% 1/7/2028	81,002	0.01
USD 57,000	Level 3 Financing 5.25% 15/3/2026	57,950	0.00
USD 50,000	Life Time 5.75% 15/1/2026	45,072	0.00
USD 57,000	Lindblad Expeditions 6.75% 15/2/2027	52,501	0.00
USD 99,000	Lions Gate Capital 5.5% 15/4/2029	79,020	0.01
USD 21,000	Live Nation Entertainment 3.75% 15/1/2028	18,488	0.00
USD 70,000	Live Nation Entertainment 4.75% 15/10/2027	64,320	0.00
USD 246,000	Live Nation Entertainment 6.5% 15/5/2027	247,553	0.02
USD 1,805,000	Lowe 's 3.35% 1/4/2027	1,744,316	0.11
USD 175,000	Lumen Technologies 4% 15/2/2027	154,360	0.01
USD 200,000	Lumen Technologies 5.125% 15/12/2026	174,126	0.01
USD 180,000	Lumen Technologies 6.75% 1/12/2023	182,060	0.01
USD 932,000	LYB International Finance III 1.25% 1/10/2025	841,995	0.05
USD 16,000	Magnolia Oil & Gas Operating / Magnolia Oil & Gas Finance 6% 1/8/2026	15,474	0.00
USD 835,000	MassMutual Global Funding II 2.8% 21/3/2025	807,454	0.05
USD 225,000	Matador Resources 5.875% 15/9/2026	219,454	0.01
USD 175,000	Match II 4.625% 1/6/2028	156,033	0.01
USD 101,000	Mauser Packaging Solutions 5.5% 15/4/2024	97,874	0.01
USD 22,000	Maxar Technologies 7.75% 15/6/2027	21,861	0.00
USD 182,000	Medline Borrower 3.875% 1/4/2029	153,840	0.01
USD 150,000	Meritage Homes 5.125% 6/6/2027	141,121	0.01
USD 2,700,000	Met Tower Global Funding 3.7% 13/6/2025	2,660,300	0.17
USD 4,855,000	Meta Platforms 3.5% 15/8/2027	4,724,146	0.30
USD 55,000	MGM Resorts International 5.75% 15/6/2025	53,509	0.00
USD 126,000	MGM Resorts International 6% 15/3/2023	125,682	0.01
USD 80,000	MicroStrategy 6.125% 15/6/2028	67,212	0.00
USD 121,000	Mileage Plus / Mileage Plus Intellectual Property Assets 6.5% 20/6/2027	121,455	0.01
EUR 700,000	MMS USA 0.625% 13/6/2025*	660,640	0.04

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 40,000	ModivCare 5.875% 15/11/2025	37,749	0.00
USD 146,000	Molina Healthcare 4.375% 15/6/2028	134,924	0.01
USD 4,545,000	Morgan Stanley 0.529% 25/1/2024	4,476,141	0.28
USD 2,300,000	Morgan Stanley 0.56% 10/11/2023	2,283,504	0.14
USD 2,275,000	Morgan Stanley 0.731% 5/4/2024	2,225,975	0.14
USD 1,800,000	Morgan Stanley 0.791% 22/1/2025	1,709,265	0.11
USD 2,755,000	Morgan Stanley 2.475% 21/1/2028	2,509,392	0.16
USD 4,088,642	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C10 3.38% 15/7/2046	4,090,162	0.26
USD 191,482	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C10 3.912% 15/7/2046	191,122	0.01
USD 1,480,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C13 4.039% 15/11/2046	1,464,805	0.09
USD 1,455,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C15 4.051% 15/4/2047	1,442,263	0.09
USD 1,263,862	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18 3.621% 15/10/2047	1,251,523	0.08
USD 6,616,709	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C20 3.249% 15/2/2048	6,422,872	0.41
USD 2,625,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 3.372% 15/10/2048	2,543,008	0.16
USD 4,189,500	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 3.635% 15/10/2048	4,084,709	0.26
USD 7,000,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 3.252% 15/10/2048	6,775,033	0.43
USD 2,692,562	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C30 2.729% 15/9/2049	2,612,964	0.17
USD 3,000,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C31 3.102% 15/11/2049	2,841,553	0.18
USD 3,465,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2016-UB11 2.782% 15/8/2049	3,243,526	0.21
USD 47,000	MPH Acquisition 5.5% 1/9/2028	40,415	0.00
USD 215,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 5% 15/10/2027	193,647	0.01
USD 29,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 5.25% 1/8/2026	28,019	0.00
USD 114,000	Nabors Industries 7.375% 15/5/2027	110,580	0.01
EUR 380,000	National Grid North America 0.41% 20/1/2026	348,922	0.02
USD 79,000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	70,623	0.00
USD 72,000	Navient 6.75% 15/6/2026	68,171	0.00
USD 97,697	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 3.641% 15/2/2029	97,684	0.01
USD 2,000,000	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 3.16% 15/11/2068	1,716,548	0.11
USD 516,210	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 3.291% 15/11/2068	507,021	0.03
USD 291,653	Navient Student Loan Trust 2018-EA 4% 15/12/2059	289,493	0.02
USD 125,000	NCR 5% 1/10/2028	117,311	0.01
USD 2,500,000	Netflix 4.375% 15/11/2026	2,441,128	0.15
USD 301,000	New Fortress Energy 6.5% 30/9/2026	283,901	0.02
USD 74,000	New Fortress Energy 6.75% 15/9/2025	71,673	0.00
USD 358,723	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3 3.25% 25/9/2056	339,382	0.02

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,800,350	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-1 4% 25/12/2057	1,743,217	0.11
USD 2,000,000	Newell Brands 4.45% 1/4/2026	1,895,120	0.12
USD 56,000	NextEra Energy Operating Partners 4.25% 15/7/2024	54,140	0.00
USD 300,000	NFP 4.875% 15/8/2028	262,913	0.02
USD 79,000	NGL Energy Operating / NGL Energy Finance 7.5% 1/2/2026	72,788	0.01
USD 113,000	Nielsen Finance / Nielsen Finance 5.625% 1/10/2028	113,355	0.01
USD 4,200,000	Nissan Motor Acceptance 2% 9/3/2026	3,679,900	0.23
USD 164,000	Northern Oil and Gas 8.125% 1/3/2028	158,484	0.01
USD 117,000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 4.75% 30/4/2027	102,745	0.01
USD 375,000	Novelis 3.25% 15/11/2026	332,668	0.02
USD 47,000	NRG Energy 5.25% 15/6/2029	42,986	0.00
USD 8,000	NRG Energy 5.75% 15/1/2028	7,529	0.00
USD 265,000	Nucor 2% 1/6/2025	250,277	0.02
USD 116,000	NuStar Logistics 5.75% 1/10/2025	110,329	0.01
USD 82,000	Occidental Petroleum 5.5% 1/12/2025	84,077	0.01
USD 25,000	Occidental Petroleum 5.875% 1/9/2025	25,672	0.00
USD 7,000	Occidental Petroleum 8% 15/7/2025	7,566	0.00
USD 427,000	Occidental Petroleum 8.5% 15/7/2027	478,387	0.03
USD 1,415,000	ONE Gas 1.1% 11/3/2024	1,361,682	0.09
USD 113,000	OneMain Finance 6.625% 15/1/2028	104,692	0.01
USD 76,000	OneMain Finance 7.125% 15/3/2026	71,760	0.00
USD 4,255,000	Oracle 1.65% 25/3/2026	3,829,507	0.24
USD 285,000	Organon / Organon Foreign Debt Co-Issuer 4.125% 30/4/2028	254,010	0.02
USD 168,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	154,381	0.01
USD 64,000	P&L Development / PLD Finance 7.75% 15/11/2025	51,614	0.00
USD 953,000	Pacific Gas and Electric 3.45% 1/7/2025	911,650	0.06
USD 575,000	Parker-Hannifin 2.7% 14/6/2024	562,600	0.04
USD 118,000	Pattern Energy Operations / Pattern Energy Operations 4.5% 15/8/2028	106,566	0.01
USD 77,000	PDC Energy 5.75% 15/5/2026	73,993	0.01
USD 535,000	PeaceHealth Obligated 1.375% 15/11/2025	487,712	0.03
USD 68,000	Penske Automotive 3.5% 1/9/2025	64,111	0.00
USD 1,285,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 1.7% 15/6/2026	1,143,891	0.07
USD 62,000	Performance Food 5.5% 15/10/2027	58,413	0.00
USD 163,000	Picasso Finance Sub 6.125% 15/6/2025	163,611	0.01
USD 145,000	Pioneer Natural Resources 0.55% 15/5/2023	141,714	0.01
USD 1,395,000	Pioneer Natural Resources 1.125% 15/1/2026	1,249,371	0.08
USD 111,000	Playtika 4.25% 15/3/2029	94,829	0.01
USD 77,000	Post 5.625% 15/1/2028	73,042	0.01
USD 200,000	PRA Health Sciences 2.875% 15/7/2026	178,909	0.01
USD 108,000	Prime Healthcare Services 7.25% 1/11/2025	95,752	0.01
USD 76,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5.25% 15/4/2024	75,136	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 136,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5.75% 15/4/2026	132,328	0.01
USD 32,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 6.25% 15/1/2028	28,358	0.00
USD 60,000	PTC 3.625% 15/2/2025	56,481	0.00
USD 195,000	PulteGroup 5% 15/1/2027	195,153	0.01
USD 325,000	Radiate Holdco / Radiate Finance 4.5% 15/9/2026	279,692	0.02
USD 40,000	Raptor Acquisition / Raptor Co-Issuer 4.875% 1/11/2026	36,551	0.00
USD 120,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.5% 15/2/2029	104,079	0.01
USD 39,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.75% 15/10/2027	35,424	0.00
USD 82,000	RLJ Lodging Trust 3.75% 1/7/2026	73,938	0.01
USD 104,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2.875% 15/10/2026	87,553	0.00
USD 16,000	Rockies Express Pipeline 4.95% 15/7/2029	14,479	0.00
USD 1,665,000	Ryder System 2.85% 1/3/2027	1,541,485	0.10
USD 1,702,000	Sabine Pass Liquefaction 5.75% 15/5/2024	1,728,134	0.11
USD 87,000	Sabre GBLB 7.375% 1/9/2025	82,737	0.01
USD 38,000	Sabre GBLB 9.25% 15/4/2025	37,588	0.00
USD 700,000	Santander USA 3.5% 7/6/2024	688,764	0.04
USD 29,000	SBA Communications 3.125% 1/2/2029	23,967	0.00
USD 212,000	SBA Communications 3.875% 15/2/2027	194,409	0.01
USD 1,315,000	Sealed Air 5.125% 1/12/2024	1,303,783	0.08
USD 147,000	Sealed Air 5.5% 15/9/2025	147,217	0.01
USD 1,890,611	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3 3.5% 25/8/2057	1,851,750	0.12
USD 3,083,324	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2019-4 3% 25/2/2059	2,966,151	0.19
USD 1,445,000	Sempra Energy 3.3% 1/4/2025	1,408,106	0.09
USD 165,297	Sequoia Mortgage Trust 2017-CH1 3.5% 25/8/2047	157,799	0.01
USD 746,900	Sesac Finance 5.216% 25/7/2049	709,177	0.05
USD 675,000	Sherwin-Williams 4.25% 8/8/2025	675,585	0.04
USD 97,000	Shift4 Payments / Shift4 Payments Finance Sub 4.625% 1/11/2026	90,873	0.01
USD 8,000	Silgan 4.125% 1/2/2028	7,389	0.00
USD 56,000	Sinclair Television 5.125% 15/2/2027	48,505	0.00
USD 99,000	Sirius XM Radio 3.125% 1/9/2026	88,296	0.01
USD 142,000	Sirius XM Radio 4% 15/7/2028	124,786	0.01
USD 50,000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	47,315	0.00
USD 69,000	Six Flags Theme Parks 7% 1/7/2025	70,035	0.00
USD 550,000	SK Battery America 2.125% 26/1/2026	490,465	0.03
USD 42,000	SLM 3.125% 2/11/2026	35,338	0.00
USD 5,581,223	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-A 2.139% 15/12/2038	5,409,012	0.34
USD 3,867,560	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B 2.159% 15/6/2039	3,700,843	0.23
USD 3,835,067	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-A 2.119% 15/6/2039	3,628,994	0.23

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,054,929	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B 2.099% 15/12/2039	1,950,680	0.12
USD 1,091,933	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A 2.069% 16/12/2041	1,057,356	0.07
USD 4,217,053	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 7.141% 15/10/2041	4,601,904	0.29
USD 938,767	SLM Student Loan Trust 2013-4 2.994% 25/6/2043	911,755	0.06
USD 27,000	SM Energy 6.5% 15/7/2028	26,233	0.00
USD 3,000	SM Energy 6.625% 15/1/2027	2,929	0.00
USD 85,000	SM Energy 6.75% 15/9/2026	83,631	0.01
USD 1,884,130	SMB Private Education Loan Trust 2017-A 3.291% 15/9/2034	1,868,666	0.12
USD 509,065	SMB Private Education Loan Trust 2020-A 3.221% 15/9/2037	498,771	0.03
USD 4,751,959	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTB 1.6% 15/9/2054	4,334,939	0.27
USD 1,710,201	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 0% 15/1/2053	1,658,457	0.10
USD 950,000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2.31% 15/1/2053	883,484	0.06
USD 3,094,345	SMB Private Education Loan Trust 2021-C 1.39% 15/1/2053	2,767,417	0.18
USD 5,417,892	SMB Private Education Loan Trust 2022-B 3.333% 16/2/2055	5,337,451	0.34
USD 2,310,000	SMB Private Education Loan Trust 2022-C 0.881% 16/5/2050	2,313,268	0.15
USD 2,403,000	SMB Private Education Loan Trust 2022-C 4.48% 16/5/2050	2,386,115	0.15
USD 11,273	SoFi Professional Loan Program 2016-C 2.36% 27/12/2032	11,259	0.00
USD 100,497	SoFi Professional Loan Program 2016-D 2.34% 25/4/2033	99,054	0.01
USD 1,114,006	SoFi Professional Loan Program 2017-D 2.65% 25/9/2040	1,084,657	0.07
USD 1,037,456	SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F 2.84% 25/1/2041	1,016,124	0.06
USD 1,845,665	Sofi Professional Loan Program 2018-B Trust 3.34% 25/8/2047	1,815,074	0.11
USD 1,659,261	Sofi Professional Loan Program 2018-C Trust 3.59% 25/1/2048	1,630,555	0.10
USD 1,563,426	Sofi Professional Loan Program 2018-D Trust 3.6% 25/2/2048	1,536,096	0.10
USD 1,515,000	Sonoco Products 2.25% 1/2/2027	1,380,735	0.09
USD 219,000	Sotheby's 7.375% 15/10/2027	206,796	0.01
USD 30,437	Soundview Home Loan Trust 2003-2 3.744% 25/11/2033	30,036	0.00
USD 5,195,000	Southern 4.475% 1/8/2024	5,214,549	0.33
USD 54,000	Specialty Building Products / SBP Finance 6.375% 30/9/2026	48,747	0.00
USD 54,000	Spirit AeroSystems 5.5% 15/1/2025	52,950	0.00
USD 6,000	Spirit AeroSystems 7.5% 15/4/2025	5,831	0.00
USD 73,000	Sprint 7.625% 1/3/2026	77,566	0.01
USD 303,000	Sprint Capital 6.875% 15/11/2028	322,706	0.02
USD 2,045,313	Sprint Spectrum / Sprint Spectrum II / Sprint Spectrum III 4.738% 20/9/2029	2,050,064	0.13
USD 249,000	SRM Escrow Issuer 6% 1/11/2028	225,493	0.01
USD 248,000	SRS Distribution 4.625% 1/7/2028	220,011	0.01
USD 233,000	SS&C Technologies 5.5% 30/9/2027	221,647	0.01
USD 31,000	Standard Industries 4.75% 15/1/2028	27,224	0.00
USD 230,000	Standard Industries 5% 15/2/2027	211,331	0.01
USD 90,000	Staples 7.5% 15/4/2026	76,721	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 23,000	Starwood Property Trust 4.375% 15/1/2027	20,654	0.00
USD 74,000	Starwood Property Trust 5.5% 1/11/2023	73,760	0.01
USD 67,000	Station Casinos 4.5% 15/2/2028	57,759	0.00
USD 165,000	Steel Dynamics 2.4% 15/6/2025	156,606	0.01
USD 74,000	Stevens 6.125% 1/10/2026	74,213	0.01
USD 270,000	Switch 3.75% 15/9/2028	268,150	0.02
USD 52,000	Synaptics 4% 15/6/2029	44,901	0.00
USD 3,076,000	Synchrony Financial 4.5% 23/7/2025	3,014,930	0.19
USD 1,544,000	Synchrony Financial 4.875% 13/6/2025	1,524,287	0.10
USD 267,000	Syneos Health 3.625% 15/1/2029	227,906	0.01
USD 9,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/3/2027	8,227	0.00
USD 222,000	Tap Rock Resources 7% 1/10/2026	210,581	0.01
USD 41,000	Taylor Morrison Communities 5.875% 15/6/2027	39,480	0.00
USD 120,000	Teleflex 4.25% 1/6/2028	109,085	0.01
USD 122,000	Tempur Sealy International 4% 15/4/2029	100,955	0.01
USD 56,000	Tenet Healthcare 4.625% 1/9/2024	54,557	0.00
USD 80,000	Tenet Healthcare 4.625% 15/6/2028	72,830	0.01
USD 165,000	Tenet Healthcare 4.875% 1/1/2026	157,391	0.01
USD 31,000	Tenet Healthcare 6.25% 1/2/2027	29,823	0.00
USD 1,290,000	Texas Electric Market Stabilization Funding N 4.265% 1/8/2036	1,287,954	0.08
EUR 565,000	Thermo Fisher Scientific 2% 15/4/2025	560,265	0.04
USD 272,000	TK Elevator US Newco 5.25% 15/7/2027	249,947	0.02
USD 1,921,000	T-Mobile USA 1.5% 15/2/2026	1,739,684	0.11
USD 489,000	T-Mobile USA 2.25% 15/2/2026	450,149	0.03
USD 113,000	Tri Pointe Homes 5.25% 1/6/2027	102,813	0.01
USD 61,000	Triumph 8.875% 1/6/2024	61,853	0.00
USD 40,000	TTMT Escrow Issuer 8.625% 30/9/2027	40,248	0.00
USD 127,000	Twilio 3.625% 15/3/2029	106,093	0.01
USD 106,000	Twitter 3.875% 15/12/2027	98,845	0.01
USD 26,000	Uber Technologies 4.5% 15/8/2029	22,647	0.00
USD 380,000	Uber Technologies 6.25% 15/1/2028	363,419	0.02
USD 66,000	Uber Technologies 7.5% 15/9/2027	65,900	0.00
USD 34,000	Uber Technologies 8% 1/11/2026	34,452	0.00
USD 2,900,000	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C1 3.46% 15/6/2050	2,720,135	0.17
USD 3,324,926	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2 3.225% 15/8/2050	3,158,221	0.20
USD 4,151,000	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C5 3.212% 15/11/2050	3,909,721	0.25
USD 141,000	United Airlines 4.375% 15/4/2026	129,731	0.01
USD 91,000	United Airlines 4.625% 15/4/2029	80,194	0.01
USD 1,144,420	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust 5.875% 15/4/2029	1,147,379	0.07
USD 175,120	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust 4.875% 15/7/2027	165,051	0.01
USD 15,000,000	United States Treasury Note/Bond 0.125% 30/4/2023	14,692,276	0.93

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 30,000,000	United States Treasury Note/Bond 0.125% 15/8/2023	29,069,722	1.84
USD 8,230,900	United States Treasury Note/Bond 0.5% 15/3/2023	8,114,082	0.51
USD 26,500,000	United States Treasury Note/Bond 0.75% 15/11/2024	24,991,777	1.58
USD 6,220,000	United States Treasury Note/Bond 1.5% 15/2/2025	5,934,998	0.38
USD 47,385,000	United States Treasury Note/Bond 1.75% 15/3/2025	45,450,730	2.87
USD 22,000,000	United States Treasury Note/Bond 1.75% 15/8/2041	16,526,211	1.05
USD 27,405,000	United States Treasury Note/Bond 2.75% 15/5/2025	26,904,537	1.70
USD 57,895,000	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/6/2025	56,992,652	3.60
USD 57,490,000	United States Treasury Note/Bond 3.125% 15/8/2025	56,964,506	3.60
USD 59,000	Uniti / Uniti Finance / CSL Capital 4.75% 15/4/2028	49,389	0.00
USD 106,000	Univision Communications 6.625% 1/6/2027	102,662	0.01
USD 2,700,000	US Bancorp 2.215% 27/1/2028	2,472,899	0.16
USD 1,325,000	US Bancorp 4.548% 22/7/2028	1,335,083	0.08
USD 88,000	US Foods 6.25% 15/4/2025	87,893	0.01
USD 280,000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6.875% 1/4/2026	261,520	0.02
USD 75,000	Vail Resorts 6.25% 15/5/2025	75,395	0.01
USD 400,000	Venture Global Calcasieu Pass 3.875% 15/8/2029	352,028	0.02
USD 355,000	VeriSign 5.25% 1/4/2025	360,924	0.02
USD 141,000	Veritas US / Veritas Bermuda 7.5% 1/9/2025	116,008	0.01
USD 7,630,000	Verizon Communications 2.1% 22/3/2028	6,763,424	0.43
USD 150,000	Vertiv 4.125% 15/11/2028	130,686	0.01
USD 88,000	Viasat 5.625% 15/4/2027	81,087	0.01
USD 3,095,000	VICI Properties 4.375% 15/5/2025	3,023,561	0.19
USD 1,290,000	Virginia Electric and Power 3.75% 15/5/2027	1,271,963	0.08
USD 139,000	Vistra Operations 5.625% 15/2/2027	134,301	0.01
USD 1,842,000	VMware 1% 15/8/2024	1,725,437	0.11
USD 4,490,000	VMware 1.4% 15/8/2026	3,977,902	0.25
USD 1,925,000	VMware 3.9% 21/8/2027	1,848,689	0.12
USD 52,000	Wabash National 4.5% 15/10/2028	44,785	0.00
USD 1,560,000	Wells Fargo 3.526% 24/3/2028	1,476,134	0.09
USD 3,120,000	Wells Fargo 3.908% 25/4/2026	3,059,609	0.19
USD 2,715,000	Wells Fargo 4.54% 15/8/2026	2,704,568	0.17
USD 1,374,830	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014-LC16 3.477% 15/8/2050	1,363,026	0.09
USD 4,004,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C27 3.451% 15/2/2048	3,892,576	0.25
USD 1,579,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1 3.148% 15/5/2048	1,528,850	0.10
USD 4,765,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 3.372% 15/1/2059	4,603,191	0.29
USD 3,075,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 3.635% 15/1/2059	2,985,790	0.19
USD 4,996,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 3.418% 15/9/2050	4,769,539	0.30
USD 198,000	WESCO Distribution 7.125% 15/6/2025	199,185	0.01

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 4,000	WESCO Distribution 7.25% 15/6/2028	4,027	0.00
USD 66,000	Western Midstream Operating 4.65% 1/7/2026	62,793	0.00
USD 202,000	Western Midstream Operating 4.75% 15/8/2028	194,327	0.01
USD 1,770,672	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 3.393% 15/8/2047	1,756,389	0.11
USD 70,000	William Carter 5.625% 15/3/2027	67,967	0.00
USD 780,000	Workday 3.5% 1/4/2027	747,369	0.05
USD 243,000	WR Grace 4.875% 15/6/2027	225,050	0.01
USD 85,000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.25% 15/5/2027	76,786	0.01
USD 677,000	Zayo 4% 1/3/2027	577,567	0.04
USD 154,000	ZoomInfo Technologies / ZoomInfo Finance 3.875% 1/2/2029	133,683	0.01
		1,025,444,083	64.81
ウルグアイ			
USD 122,188	Uruguay Government International Bond 4.375% 23/1/2031	125,040	0.01
債券合計		1,451,393,379	91.73
コマーシャル・ペーパー			
オーストラリア			
USD 3,000,000	National Australia Bank 0% 15/3/2023	2,941,113	0.19
米国			
USD 5,000,000	Enel Finance America 0% 20/9/2022	4,992,318	0.31
USD 1,700,000	Enel Finance America 0% 21/11/2022	1,687,168	0.11
USD 2,000,000	Enel Finance America 0% 8/9/2023	1,920,268	0.12
USD 1,400,000	General Motors Financial 0% 14/11/2022	1,390,191	0.09
USD 5,590,000	HSBC USA 0% 14/6/2023	5,407,229	0.34
USD 3,000,000	HSBC USA 0% 23/8/2023	2,873,238	0.18
		18,270,412	1.15
コマーシャル・ペーパー合計		21,211,525	1.34
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		1,472,604,904	93.07
投資有価証券合計		1,472,604,904	93.07
その他の純資産		109,651,915	6.93
純資産合計(米ドル)		1,582,256,819	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。

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
CAD	412,060	USD	321,005	State Street	21/9/2022	(7,285)
EUR	2,395,367	USD	2,536,951	Morgan Stanley	21/9/2022	(137,427)
EUR	1,790,000	USD	1,847,681	State Street	21/9/2022	(54,574)
EUR	1,790,000	USD	1,847,702	JP Morgan	21/9/2022	(54,595)
EUR	1,011,000	USD	1,036,309	HSBC Bank	21/9/2022	(23,555)
GBP	4,345,000	USD	5,322,343	BNY Mellon	21/9/2022	(276,580)
GBP	1,815,032	USD	2,221,311	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(113,550)
GBP	1,811,000	USD	2,136,125	Toronto-Dominion	21/9/2022	(33,047)
USD	388,977	GBP	310,000	Toronto-Dominion	21/9/2022	28,980
USD	119,113,530	GBP	95,973,000	HSBC Bank	21/9/2022	7,661,971
USD	322,943	CAD	413,000	JP Morgan	21/9/2022	8,508
USD	142,072,603	EUR	134,152,000	BNP Paribas	21/9/2022	7,687,778
USD	3,144,069	GBP	2,588,000	State Street	21/9/2022	138,675
USD	2,209,059	EUR	2,157,000	RBS	21/9/2022	48,316
USD	112,665	EUR	111,590	RBS	14/12/2022	230
未実現純評価益						14,873,845
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	175,750,350	USD	179,589,418	BNY Mellon	15/9/2022	(3,603,258)
USD	2,835,245	EUR	2,815,748	BNY Mellon	15/9/2022	15,756
未実現純評価損						(3,587,502)
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	1,217,689	USD	877,198	BNY Mellon	15/9/2022	(5,703)
未実現純評価損						(5,703)
未実現純評価益合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 447,634,595米ドル)						11,280,640

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 2022年8月31日現在

契約数	通貨	契約 / 摘要	満期日	基礎となるエクスポージャー (米ドル)	未実現評価益 / (損) (米ドル)
(262)	EUR	Euro B0BL	2022年9月	32,297,551	387,927
(2)	EUR	Euro Bund	2022年9月	296,568	5,562
(107)	EUR	Euro Schatz	2022年9月	11,631,630	63,157
(24)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2022年9月	25,854,398	(71,971)
(8)	USD	US Long Bond (CBT)	2022年12月	1,090,250	6,673
(275)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2022年12月	32,205,078	145,790
(3)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2022年12月	351,328	1,484
(237)	USD	US Ultra 10 Year Note	2022年12月	29,732,391	151,588
(86)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2022年12月	12,956,438	(36,969)
3,165	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2022年12月	659,482,144	(849,877)
(8)	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2022年12月	1,666,937	2,898
(1,397)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2022年12月	154,925,116	430,780
(126)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2022年12月	13,973,203	45,477
合計				976,463,032	282,519

スワップ 2022年8月31日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益 / (損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 34,540,000	ファンドはCDX.NA.IG.38.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	20/6/2027	150,133	(135,358)
CDS	USD (3,969,900)	ファンドはCDX.NA.HY.38.V2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	20/6/2027	(40,895)	(40,692)
IRS	USD 35,755,000	ファンドは2.95053%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	30/6/2024	(389,162)	(389,162)
IRS	USD 35,755,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2.77909%の固定金利を支払う	Bank of America	30/11/2026	515,491	515,491
合計		(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 109,235,786米ドル)			235,567	(49,721)

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IRS: 金利スワップ

事後通告証券契約 2022年8月31日現在

保有高	摘要	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
TBA			
	米国		
USD 15,230,000	Fannie Mae or Freddie Mac 4.5% TBA	15,194,602	0.96
TBA合計		15,194,602	0.96
	(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 15,194,602米ドル)		

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】(2023年6月末現在)

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」

資産総額	1,498,049,188円
負債総額	708,435円
純資産総額(-)	1,497,340,753円
発行済数量	1,297,516,354口
1 単位当たり純資産額(/)	1.1540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われます。

10 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

資本金 3,120百万円

発行する株式の総数 36,000株

発行済株式の総数 15,000株

直近5カ年における主な資本金の額の増減 該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構

経営の意思決定機構

<株主総会>

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

<取締役会>

取締役により構成され、当社の業務執行を決定し、その執行について監督します。

<エグゼクティブ委員会他各委員会>

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

運用の意思決定機構

投資委員会

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

運用担当部署

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

ポートフォリオ・マネジャー

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

リスク管理

・委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行っております。具体的には、運用担当部門から独立したリスク管理担当部門においてファンドの投資リスクおよび流動性リスクの計測・分析、投資・流動性制限のモニタリングなどを行うことにより、ファンドの投資リスク（流動性リスクを含む）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。

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っています。

委託会社の運用する証券投資信託は2023年6月末現在、以下の通りです(親投資信託を除きます。)

種類	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	195	10,893,602
単位型株式投資信託	72	447,435
合計	267	11,341,037

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36期事業年度（自2022年1月1日 至2022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35期 (2021年12月31日現在)	第36期 (2022年12月31日現在)
資産の部			
流動資産			
現金・預金		17,813	18,002
立替金		16	50
前払費用		223	260
未収入金	2	527	2
未収委託者報酬		2,017	1,751
未収運用受託報酬		2,244	2,880
未収収益	2	981	570
その他流動資産		2	-
流動資産計		23,827	23,520
固定資産			
有形固定資産			
建物附属設備	1	789	744
器具備品	1	575	553
有形固定資産計		1,364	1,297
無形固定資産			
ソフトウェア		10	12
無形固定資産計		10	12
投資その他の資産			
投資有価証券		50	39
長期差入保証金		1,118	1,125
前払年金費用		1,001	1,084
長期前払費用		12	9
繰延税金資産		889	898
投資その他の資産計		3,072	3,156
固定資産計		4,448	4,465
資産合計		28,275	27,986

	第35期 (2021年12月31日現在)	第36期 (2022年12月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	143	143
未払金	2	
未払収益分配金	4	4
未払償還金	70	70
未払手数料	459	421
その他未払金	2,991	1,995
未払費用	2	
未払消費税等	272	172
未払法人税等	402	384
為替予約	-	4
前受金	166	276
賞与引当金	2,156	1,778
役員賞与引当金	203	149
早期退職慰労引当金	-	326
流動負債計	7,630	6,355
固定負債		
退職給付引当金	82	92
資産除去債務	784	961
固定負債計	866	1,053
負債合計	8,497	7,409
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	9,470	10,276
利益剰余金合計	9,807	10,612
株主資本合計	19,775	20,580
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	3	3
評価・換算差額等合計	3	3
純資産合計	19,778	20,576
負債・純資産合計	28,275	27,986

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

		第35期 (自 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)	第36期 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
営業収益			
委託者報酬		6,653	6,484
運用受託報酬	1	8,355	8,687
その他営業収益	1	14,536	16,110
営業収益計		29,546	31,281
営業費用			
支払手数料		1,534	1,551
広告宣伝費		170	188
調査費			
調査費		298	360
委託調査費	1	4,326	4,677
調査費計		4,625	5,037
委託計算費		94	106
営業雑経費			
通信費		51	86
印刷費		95	87
諸会費		39	47
営業雑経費計		187	222
営業費用計		6,611	7,106
一般管理費			
給料			
役員報酬		579	915
給料・手当		5,106	5,934
賞与		2,616	2,360
給料計		8,302	9,209
退職給付費用		352	463
福利厚生費		1,073	1,109
事務委託費	1	3,360	3,699
交際費		11	34
寄付金		-	1
旅費交通費		24	123
租税公課		260	285
不動産賃借料		902	901
水道光熱費		53	76
固定資産減価償却費		426	441
資産除去債務利息費用		0	0
事務過誤取引損		519	3
諸経費		348	431
一般管理費計		15,638	16,782
営業利益		7,296	7,392

	第35期 (自 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)	第36期 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
営業外収益		
為替差益	102	53
その他	1	3
営業外収益計	103	57
営業外費用		
有価証券売却損	-	2
固定資産除却損	0	-
その他	-	0
営業外費用計	0	2
経常利益	7,398	7,448
特別利益		
特別利益計	-	-
特別損失		
特別退職金	0	362
特別損失計	0	362
税引前当期純利益	7,398	7,085
法人税、住民税及び事業税	2,415	2,485
法人税等調整額	0	5
当期純利益	4,984	4,605

(3)【株主資本等変動計算書】

第35期（自 2021年1月1日 至 2021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				
2021年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	10,386	10,723	20,691	3	3	20,694
当期変動額											
剰余金の配当						5,900	5,900	5,900			5,900
当期純利益						4,984	4,984	4,984			4,984
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									0	0	0
当期変動額合計	-	-	-	-	-	915	915	915	0	0	915
2021年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	9,470	9,807	19,775	3	3	19,778

第36期（自 2022年1月1日 至 2022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				
2022年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	9,470	9,807	19,775	3	3	19,778
当期変動額											
剰余金の配当						3,800	3,800	3,800			3,800
当期純利益						4,605	4,605	4,605			4,605
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									7	7	7
当期変動額合計	-	-	-	-	-	805	805	805	7	7	798
2022年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	10,276	10,612	20,580	3	3	20,576

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3～15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。

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

早期退職慰労金の支払に備えて、早期退職慰労金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. 収益及び費用の計上基準

当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬、その他営業収益および成功報酬を稼得しております。当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

委託者報酬：当社は投資信託の信託約款に基づき、投資信託の運用について履行義務を負っております。委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産価額に対する一定割合として計算され、投資信託の運用期間にわたり収益認識しております。

運用受託報酬：当社は顧客との投資一任契約及び投資助言契約に基づき運用及び助言について履行義務を負っております。運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約等に基づき純資産価額に対する一定割合として計算され、対象口座の運用期間にわたり収益認識しております。

その他営業収益：当社はグループ会社との契約に基づき委託された業務について履行義務を負っております。グループ会社から受領する収益は、当社のグループ会社との契約で定められた算式に基づき、当社がグループ会社にオフショアファンド関連のサービス等を提供する期間にわたり月次で収益認識しております。

成功報酬：成功報酬は対象となるファンドまたは口座の運用益に対する一定割合、もしくは特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として計算されます。当該報酬は契約上支払われることが確定した時点で収益認識しております。

7. その他計算書類作成のための基本となる重要な事項

(1) 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。

(2) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

(会計方針の変更)**(収益認識に関する会計基準等の適用)**

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。)等を当会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。

収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当会計期間の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当会計期間の期首の繰越利益剰余金に反映させ、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。

これによる財務諸表に与える影響はありません。

なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前会計期間に係る「注記事項(収益認識関係)」については記載しておりません。

(時価の算定に関する会計基準等の適用)

「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号2019年7月4日)第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。これによる財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日)第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前会計期間に係るものについては記載しておりません。

(未適用の会計基準等)

「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月12日 企業会計基準委員会)

(1) 概要

2020年3月27日に成立した「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において、連結納税制度を見直しグループ通算制度へ移行することとされたことを受け、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱を明らかにすることを目的として企業会計基準委員会から公表されたものです。

(2) 適用予定日

2023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。

（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 (2021年12月31日)	当事業年度 (2022年12月31日)
建物附属設備	2,246 百万円	2,488 百万円
器具備品	1,470 百万円	1,662 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 (2021年12月31日)	当事業年度 (2022年12月31日)
未収入金	524 百万円	- 百万円
未収収益	377 百万円	186 百万円
その他未払金	1,940 百万円	1,982 百万円
未払費用	112 百万円	55 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 (2021年12月31日)	当事業年度 (2022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 関係会社との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 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)	当事業年度 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
運用受託報酬	249 百万円	224 百万円
その他営業収益	6,036 百万円	6,692 百万円
委託調査費	1,178 百万円	1,869 百万円
事務委託費	1,204 百万円	1,351 百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2021年1月1日 至 2021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)	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

(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
2021年3月30日 株主総会決議	普通株式	5,900	393,333	2020年12月31日	2021年3月30日

当事業年度(自 2022年1月1日 至 2022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

(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
2022年3月31日 株主総会決議	普通株式	3,800	253,333	2021年12月31日	2022年3月31日

（リース取引関係）

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに掛かる未経過リース料は以下のとおりであります。

	前事業年度	当事業年度
	(自 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)	(自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
1年以内	835 百万円	726 百万円
1年超	-	1,938 百万円
合計	835 百万円	2,665 百万円

(注) 前事業年度における未経過リース料には、解約損害金が含まれております。

（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。

(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、未収運用受託報酬及び未収収益は、顧客及び関係会社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及び未払費用はその全てが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（2021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	17,813	17,813	-
(2) 未収委託者報酬	2,017	2,017	-
(3) 未収運用受託報酬	2,244	2,244	-
(4) 未収収益	981	981	-
(5) 未収入金	527	527	-
(6) 長期差入保証金	1,118	1,119	0
資産計	24,703	24,704	0
(1) 未払手数料	459	459	-
(2) 未払費用	760	760	-
(3) その他未払金	2,991	2,991	-
負債計	4,210	4,210	-

(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、(4) 未収収益及び(5) 未収入金

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おります。

(6) 長期差入保証金

事務所敷金の時価については、事務所の敷金を合理的に見積もった返済期日までの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) 未払費用及び(3) その他未払金

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（2021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	17,813	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	2,017	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,244	-	-	-
(4) 未収収益	981	-	-	-
(5) 未収入金	527	-	-	-
合計	23,584	-	-	-

当事業年度（2022年12月31日）

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
長期差入保証金	1,125	1,077	47

(注1) 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収収益、未収入金、未払手数料、未払費用、その他未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記述を省略しています。

(注2) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

当事業年度（2022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	18,002	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,751	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,880	-	-	-
(4) 未収収益	570	-	-	-
(5) 未収入金	2	-	-	-
合計	23,209	-	-	-

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価等の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：同一の資産又は負債の活発な市場における（無調整の）相場価格により算定した時価

レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接又は間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

当事業年度（2022年12月31日）

(単位：百万円)

	レベル1	レベル2	レベル3	合計
長期差入保証金	-	1,077	-	1,077

(注) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

長期差入保証金の時価について、そのうち事務所敷金については、事務所の敷金を合理的に見積もった返済期日までの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しているため、レベル2の時価に分類しております。また従業員社宅敷金については、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しているため、レベル2の時価に分類しております。

(退職給付関係)

前事業年度(自 2021年1月1日 至 2021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、2009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、2011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、2011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 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)
退職給付債務の期首残高	2,149
勤務費用	322
利息費用	20
数理計算上の差異の発生額	188
退職給付の支払額	94
過去勤務費用の発生額	0
退職給付債務の期末残高	2,588

(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 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)
年金資産の期首残高	3,313
期待運用収益	9
数理計算上の差異の発生額	17
事業主からの拠出額	359
退職給付の支払額	94
年金資産の期末残高	3,606

(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 (2021年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	2,505
年金資産	3,606
非積立型制度の退職給付債務	1,100
未積立退職給付債務	82
未認識数理計算上の差異	1,018
未認識過去勤務費用	65
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	33
退職給付引当金	919
前払年金費用	82
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,001
	919

(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 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)
勤務費用	322
利息費用	20
期待運用収益	9
数理計算上の差異の費用処理額	59
過去勤務費用の処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用合計	270
特別退職金	0
合計	270

(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 (2021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87%、株式13%及びその他1%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 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)
割引率	0.7%
長期期待運用収益率	0.3%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、80百万円 でありました。

当事業年度（自 2022年1月1日 至 2022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、2009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、2011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、2011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 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
退職給付債務の期首残高	2,588
勤務費用	392
利息費用	17
数理計算上の差異の発生額	78
退職給付の支払額	116
過去勤務費用の発生額	0
退職給付債務の期末残高	2,803

(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 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
年金資産の期首残高	3,606
期待運用収益	3
数理計算上の差異の発生額	573
事業主からの拠出額	448
退職給付の支払額	116
年金資産の期末残高	3,368

(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 (2022年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	2,710
年金資産	3,368
	657
非積立型制度の退職給付債務	92
未積立退職給付債務	565
未認識数理計算上の差異	455
未認識過去勤務費用	29
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	991
退職給付引当金	92
前払年金費用	1,084
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	991

(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 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
勤務費用	392
利息費用	17
期待運用収益	3
数理計算上の差異の費用処理額	27
過去勤務費用の処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用合計	375
特別退職金	362
合計	738

(注) 特別退職金は、特別損失の「特別退職金」に含めて計上しております。

(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 (2022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88%、株式11%及びその他1%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 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
割引率	1.3%
長期期待運用収益率	0.1%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、87百万円 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 (2021年12月31日)	当事業年度 (2022年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	161	140
賞与引当金	660	544
資産除去債務	240	294
未払事業税	89	83
早期退職慰労引当金	-	99
退職給付引当金	25	28
有形固定資産	1	0
その他	78	121
繰延税金資産合計	1,257	1,312
繰延税金負債		
退職給付引当金	306	331
資産除去債務に対応する除去費用	59	82
その他	1	-
繰延税金負債合計	367	414
繰延税金資産の純額	889	898

（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 (2021年12月31日)	当事業年度 (2022年12月31日)
固定資産 - 繰延税金資産	889	898

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 (2021年12月31日)	当事業年度 (2022年12月31日)
	法定実効税率	30.6 %
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目	2.0	3.9
その他	0.0	0.4
税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.6 %	35.0 %

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

当事業所の定期建物賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を合理的に見積り、割引率は0.16%～0.72%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

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前回見積算出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、見積りの変更による増加額を0.72%で割り引き、変更前の資産除去債務に176百万円加算しております。

（単位：百万円）

	前事業年度 (自 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)	当事業年度 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
期首残高	783	784
見積りの変更による増加額	-	176
時の経過による調整額	0	0
期末残高	784	961

（収益認識関係）

当事業年度（自 2022年1月1日 至 2022年12月31日）

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

	当事業年度 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
委託者報酬	6,484 百万円
運用受託報酬	7,644 百万円
成功報酬（注）	1,042 百万円
その他営業収益	16,110 百万円
合計	31,281 百万円

（注）成功報酬は、損益計算書において運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）6. 収益及び費用の計上基準に記載のとおりです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに会計期間末において存在する顧客との契約から当会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため、記載を省略しています。

（セグメント情報等）

前事業年度（自 2021年1月1日 至 2021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	6,653	8,355	14,536	29,546

(2) 地域ごとの情報

売上高

（単位：百万円）

日本	北米	その他	合計
14,396	13,081	2,067	29,546

（注）売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

（単位：百万円）

相手先	営業収益	関連するセグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・ マネジメント・インク	6,285	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	4,259	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 2022年1月1日 至 2022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	6,484	8,687	16,110	31,281

(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
14,721	13,745	2,813	31,281

（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	6,917	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	4,287	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 2021年1月1日 至 2021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	249	未収収益	377
							受入手数料	6,036		
							委託調査費	1,178	未払費用	112
							事務委託費	1,204		
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	連結法人税の 個別帰属額	1,940	その他未払金	1,940

当事業年度（自 2022年1月1日 至 2022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	224	未収収益	186
							受入手数料	6,692		
							委託調査費	1,869	未払費用	55
							事務委託費	1,351		
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	連結法人税の 個別帰属額	1,982	その他未払金	1,982

- (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 2021年1月1日 至 2021年12月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2022年1月1日 至 2022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 2021年1月1日 至 2021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	4,259	未収収益	321
							委託調査費	282		
							事務委託費	20		

当事業年度（自 2022年1月1日 至 2022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	4,287	未収収益	180
							委託調査費	35		
							事務委託費	12		

(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 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)	当事業年度 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
1株当たり純資産額	1,318,566 円 41 銭	1,371,780 円 88 銭
1株当たり当期純利益金額	332,267 円 26 銭	307,029 円 07 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 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)	当事業年度 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
当期純利益 (百万円)	4,984	4,605
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)	4,984	4,605
普通株式の期中平均株式数 (株)	15,000	15,000

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うことを内容とした運用を行うこと(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うことを内容とした運用を行うこと(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うことを内容とした運用を行うこと。
- (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（2023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 : 株式会社日本カストディ銀行
- ・資本金 : 51,000百万円（2023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（株式会社日本カストディ銀行）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） （2023年3月末現在）	事業の内容
アイザワ証券株式会社	3,000	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。
株式会社SBI証券	48,323	
SMB C日興証券株式会社	10,000	
四国アライアンス証券株式会社*	3,000	
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・スタンレー証券株式会社	40,500	
楽天証券株式会社	19,495	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い、新規の募集および販売の取扱いは行いません。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(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い、換金に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、換金代金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行います。

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

2023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

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山田 信之指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 水野 龍也

監査意見

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2022年1月1日から2022年12月31日までの第36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。

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2022年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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

2023年9月1日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会御中

P w C あらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 榊原 康太

監査意見

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2022年12月21日から2023年6月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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2023年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、ブラックロック・ジャパン株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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. 上記の監査報告書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。