

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成28年9月16日

【計算期間】 第22特定期間（自平成27年12月22日 至平成28年6月20日）

【ファンド名】 ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー
（愛称：BR Win）

【発行者名】 ブラックロック・ジャパン株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役会長 井澤 吉幸

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【事務連絡者氏名】 加藤 淳一郎

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【電話番号】 03-6703-4935

【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【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>

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

<属性区分表>

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

<各分類および区分の定義>

．商品分類

単位型投信・追加型投信の区分	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行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（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

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

ファンドの特色

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

主要投資対象ファンドの投資対象

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

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

主要投資対象ファンドの投資アプローチ

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

■柔軟性の高い運用

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

■リスクコントロール

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

※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。

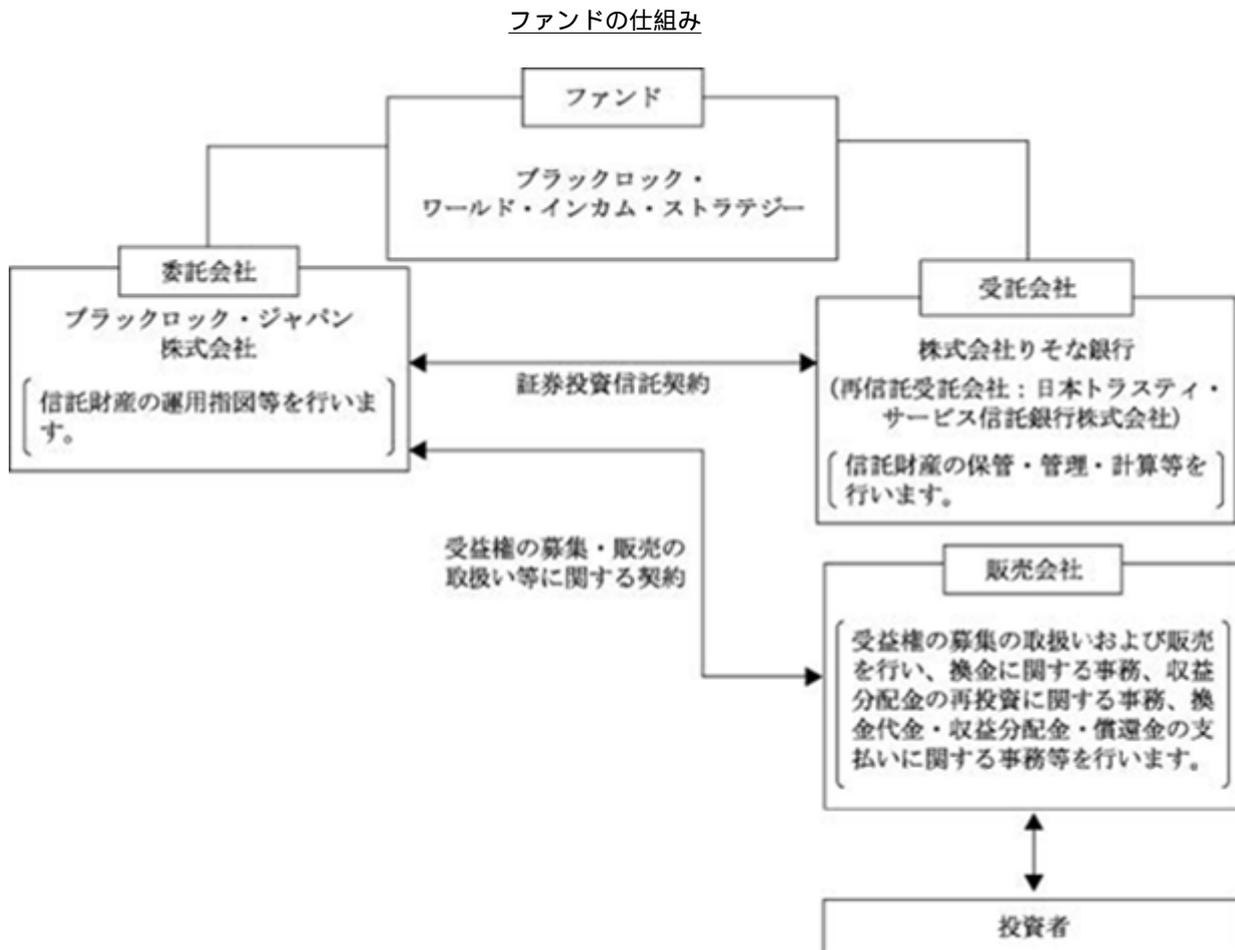


e．外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

(2)【ファンドの沿革】

平成17年7月7日	信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始
平成18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
平成19年1月4日	投資信託振替制度への移行
平成21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、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 >

平成28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 2,435百万円

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	10,158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もあります。

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、自己又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又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(社債等の振替に関する法律第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、商工組合中央金庫法第33条の2に規定する短期商工債、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社債をいいます。)
- 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、解約、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
- e. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- f. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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	ファンドはトータル・リターンを最大化を目指します。ファンドは、少なくとも純資産の70%を世界各国の政府、政府関連機関、企業が様々な通貨建てで発行する譲渡性のある債券に投資をします。非投資適格債を含むあらゆる種別の有価証券を投資対象とし、これらを有効利用します。通貨エクスポージャーについては柔軟に運用します。 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）に投資割合の制限を設けず投資を行うことができます。
設定日	2007年1月31日
存続期間	無期限
主な投資制限	・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（インターナショナル）リミテッド

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

(b) B G F USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

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

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

(3)【運用体制】

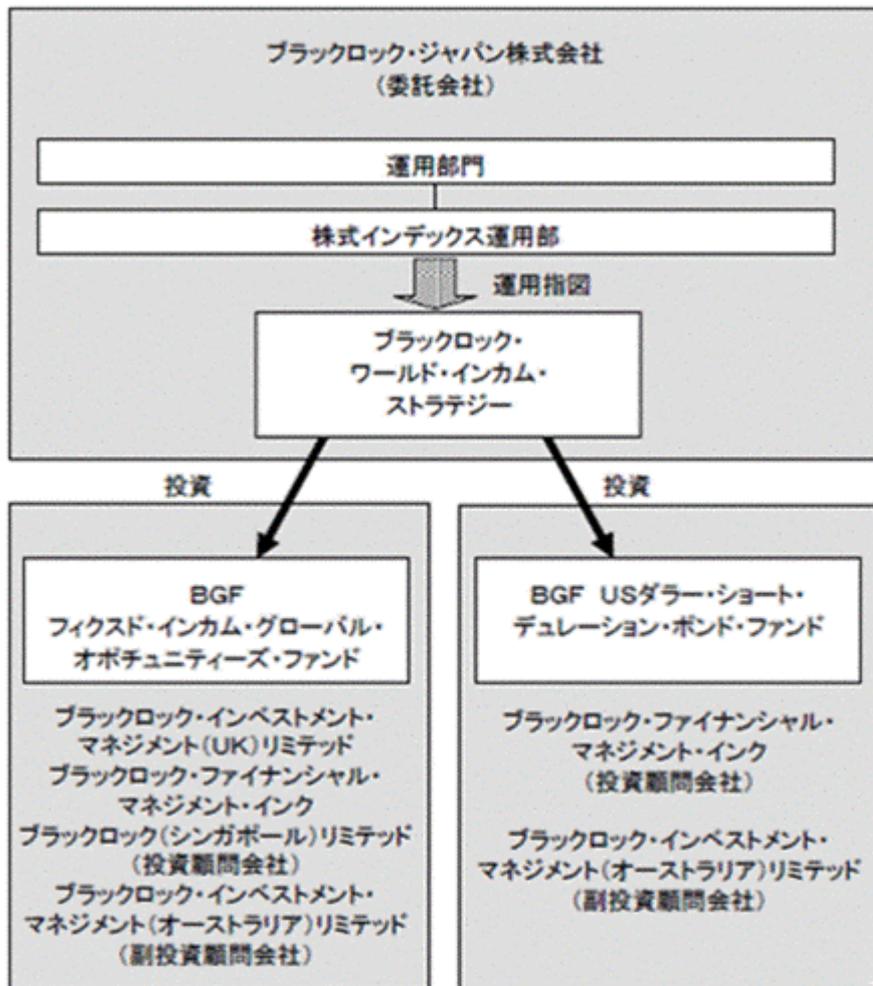
ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

ファンドの運用については委託会社の運用部門が統括しています。

社内には内部監査を担当する部門、ファンドの運用状況やリスク状況等をモニターし関連部署にフィードバックする部門、或いは投資委員会等開催により、各ファンドの投資方針等に従って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：7名程度）が担当いたします。

運用体制図



運用体制は、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>

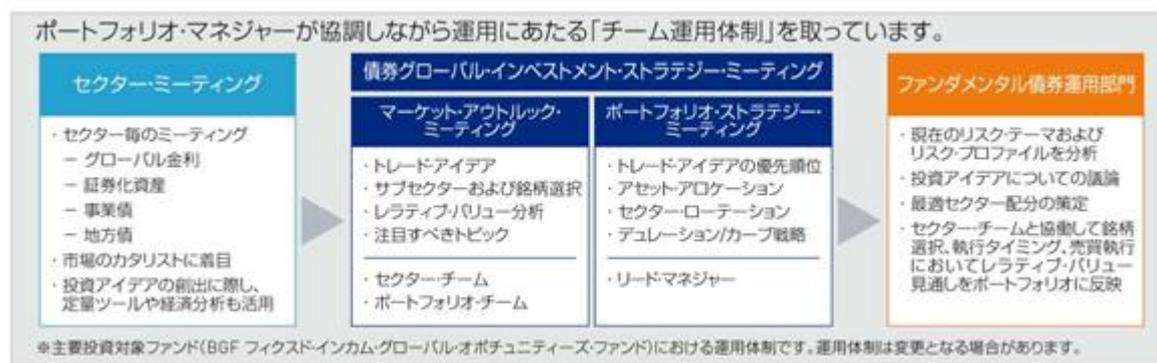
ブラックロック・グループのファンダメンタル債券運用部門によって運用されます。

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。



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4.89兆ドル^{*}（約502兆円）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。

* 2016年6月末現在。(円換算レートは1ドル=102.59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。基準価額水準、市況動向等によっては分配を行わないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

c. 留保益の運用方針

留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

収益の分配

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

(a) 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(「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、次期以降の分配金に充てるため、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算した利益金額(「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。

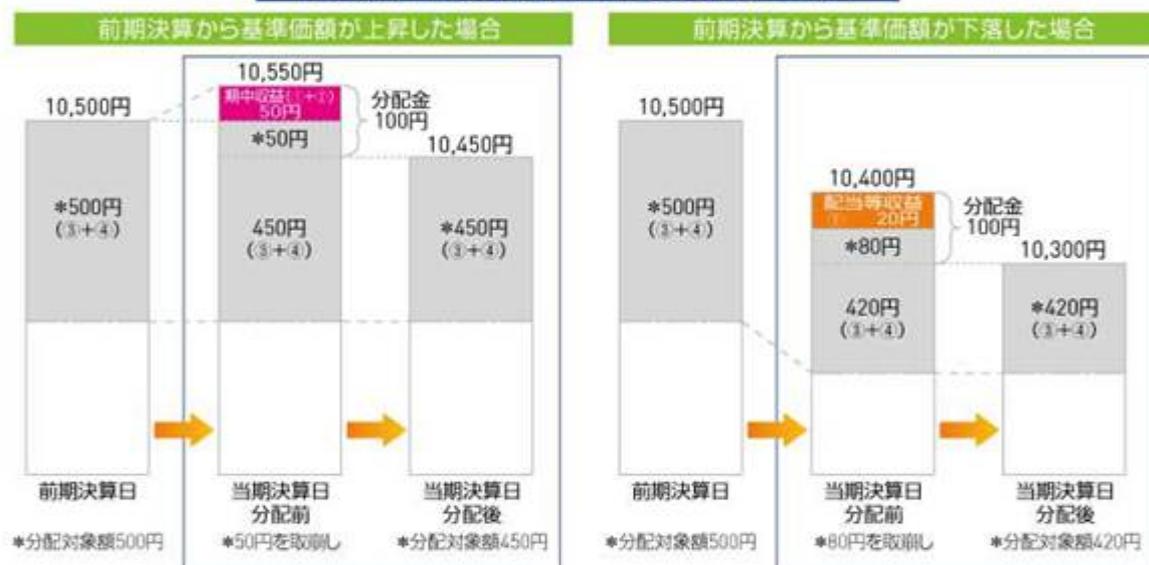
収益分配金に関する留意事項

- 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



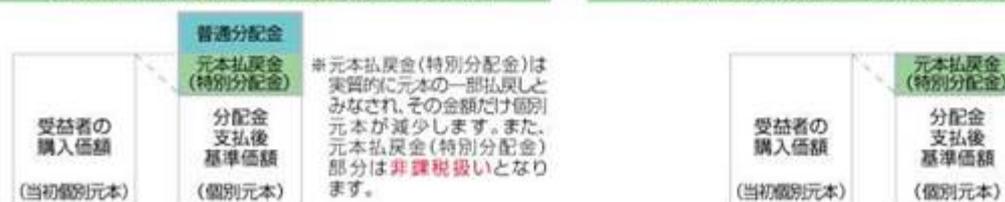
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※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。

- 受益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、分配金額より基準価額の値上がりか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(受益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。分配後の受益者の個別元本は、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】

以下は、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。

受託会社の自己または利害関係人等との取引

- a．受託会社は、投資者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託および投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、受託会社および受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下同じ。）、信託業務の委託先およびその利害関係人または受託会社における他の信託財産との間で、投資信託約款に定める資産への投資を、信託業法、投資信託および投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行うことができます。
- b．a．の取扱いは、「外国為替予約の指図および範囲」「有価証券売却等の指図」「再投資の指図」および「資金の借入れ」における委託会社の指図による取引についても同様とします。

特別な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。

有価証券売却等の指図

委託会社は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

再投資の指図

委託会社は、有価証券の売却代金、有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等、その他の収入金を再投資することの指図ができます。

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、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約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．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、投資者への解約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解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは投資者への解約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解約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。

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運用の効率を高めるため、または証券価格、市場金利、為替等の変動による影響から投資対象ファンドを守るために用いられます。デリバティブ取引を用いた結果、取引コストと投資元本を脅かすリスクが伴い、当ファンドの運用成果に影響を与えます。また、デリバティブ取引は必ず用いられるわけではなく、用いられたとしても本来の目的を達成できる保証はありません。

ファンド運営上のリスク

a. 購入および換金の受付の中止・取消

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の購入および換金の受付を中止する場合があります。また、この場合、既に受付けた受益権の購入および換金の受付についても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30億口を下回る事となった場合、または投資者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情が発生したとき等は、ファンドを償還させる場合があります。

c. 法令・税制・会計等の変更

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

(2) リスクの管理体制

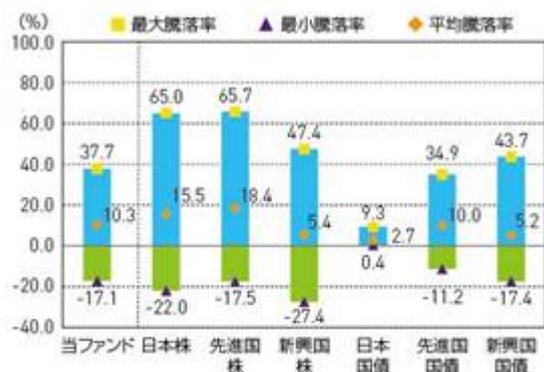
委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行っております。具体的には、運用担当部門とは異なる部門においてファンドの投資リスクの計測・分析、投資制限のモニタリングなどを行うことにより、ファンドの投資リスクが運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行っております。

リスクの管理体制は、変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2011年7月～2016年6月)



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

(2011年7月～2016年6月)



※上記グラフは、2011年7月～2016年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドについては、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※上記グラフは、2011年7月～2016年6月の5年間の各月末における分配金再投資基準価額の1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※各資産クラスの指数

日本株……東証株価指数(配当込み)

先進国株……MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)

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

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国国債……シティ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・レディバース・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。

<各指数について>

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

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

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表している指数で、日本国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。同指数に関する知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行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。シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、シティグループ・インデックスLLCが公表する、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを指数化したものです。同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他の一切の権利は、シティグループ・インデックスLLCに帰属します。

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・レディバース・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の3.24%（税抜3.00%）を上限として、販売会社が独自に定めることができます。詳細は販売会社にお問い合わせください。

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています（以下同じ。）。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額

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

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

投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

信託報酬の支払時期と支払方法等

信託報酬は、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)は、投資者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。

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

委託会社は、年0.108%(税抜0.10%)を上限とする、上記の諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で算出する率を毎日純資産総額に対して乗じて得た額、または上記の諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で算出する額を、上記の諸費用の支払の合計額とみなして、ファンドから受領することができます。諸費用および諸費用に係る消費税等相当額は毎計算期末、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取得した場合、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。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、NISAの口座では、特定口座や一般口座で生じた配当所得および譲渡所得との損益通算はできません。非課税の対象となる金額、期間等を含めて詳しくは販売会社にお問い合わせください。

b. 法人の投資者に対する課税

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

上記は2016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】

「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】(平成28年6月末現在)

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	2,168,688,740	97.12
内 ルクセンブルグ	2,168,688,740	97.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	64,318,591	2.88
純資産総額	2,233,007,331	100.00

(2)【投資資産】(平成28年6月末現在)

【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	2,109,608	1,014.69	2,140,604,469	1,016.75	2,144,946,465	96.06
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	16,327	1,451.03	23,691,868	1,454.11	23,742,275	1.06

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

(注2) 簿価単価及び評価単価は投資証券の1口当たりの価額です。

種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.12

(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】

平成28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3特定期間	第10期(平成18年7月20日)	16,214,713,970	16,297,843,937	0.9753	0.9803
	第11期(平成18年8月21日)	16,683,340,133	16,766,737,571	1.0002	1.0052
	第12期(平成18年9月20日)	17,676,460,212	17,764,275,846	1.0065	1.0115
	第13期(平成18年10月20日)	19,300,359,000	19,395,875,564	1.0103	1.0153
	第14期(平成18年11月20日)	20,571,203,671	20,671,830,883	1.0221	1.0271
	第15期(平成18年12月20日)	21,914,507,884	22,019,866,516	1.0400	1.0450
第4特定期間	第16期(平成19年1月22日)	22,605,036,948	22,713,608,304	1.0410	1.0460
	第17期(平成19年2月20日)	23,877,088,471	23,992,883,503	1.0310	1.0360
	第18期(平成19年3月20日)	25,311,983,469	25,435,675,958	1.0232	1.0282
	第19期(平成19年4月20日)	26,265,580,990	26,392,576,501	1.0341	1.0391
	第20期(平成19年5月21日)	27,465,693,306	27,597,115,579	1.0449	1.0499
	第21期(平成19年6月20日)	28,004,195,707	28,139,314,425	1.0363	1.0413
第5特定期間	第22期(平成19年7月20日)	28,781,664,199	28,920,142,198	1.0392	1.0442
	第23期(平成19年8月20日)	27,836,634,426	27,978,933,896	0.9781	0.9831
	第24期(平成19年9月20日)	29,072,607,634	29,216,953,900	1.0070	1.0120
	第25期(平成19年10月22日)	29,407,120,412	29,553,959,604	1.0013	1.0063
	第26期(平成19年11月20日)	29,263,142,519	29,411,442,822	0.9866	0.9916
	第27期(平成19年12月20日)	30,551,802,054	30,706,260,658	0.9890	0.9940
第6特定期間	第28期(平成20年1月21日)	29,771,026,893	29,895,293,953	0.9583	0.9623
	第29期(平成20年2月20日)	29,643,599,106	29,767,533,484	0.9568	0.9608
	第30期(平成20年3月21日)	27,581,949,260	27,702,484,389	0.9153	0.9193
	第31期(平成20年4月21日)	27,468,475,302	27,585,531,131	0.9386	0.9426
	第32期(平成20年5月20日)	26,873,162,410	26,987,977,877	0.9362	0.9402
	第33期(平成20年6月20日)	26,645,792,583	26,759,836,259	0.9346	0.9386
第7特定期間	第34期(平成20年7月22日)	26,213,540,971	26,326,387,997	0.9292	0.9332
	第35期(平成20年8月20日)	26,330,514,378	26,443,133,902	0.9352	0.9392
	第36期(平成20年9月22日)	24,961,848,378	25,074,472,877	0.8866	0.8906
	第37期(平成20年10月20日)	21,940,834,129	22,051,622,772	0.7922	0.7962
	第38期(平成20年11月20日)	19,882,589,375	19,991,253,269	0.7319	0.7359
	第39期(平成20年12月22日)	19,446,434,956	19,552,888,120	0.7307	0.7347
第8特定期間	第40期(平成21年1月20日)	19,034,354,837	19,139,727,309	0.7226	0.7266
	第41期(平成21年2月20日)	19,513,893,830	19,593,054,633	0.7395	0.7425
	第42期(平成21年3月23日)	18,538,961,270	18,611,926,067	0.7622	0.7652
	第43期(平成21年4月20日)	18,364,027,254	18,433,643,934	0.7914	0.7944
	第44期(平成21年5月20日)	17,662,594,042	17,730,704,246	0.7780	0.7810
	第45期(平成21年6月22日)	16,706,815,281	16,770,956,599	0.7814	0.7844
第9特定期間	第46期(平成21年7月21日)	16,459,175,020	16,522,406,387	0.7809	0.7839
	第47期(平成21年8月20日)	16,539,085,565	16,601,108,801	0.8000	0.8030
	第48期(平成21年9月24日)	16,495,357,752	16,557,085,526	0.8017	0.8047
	第49期(平成21年10月20日)	16,368,225,399	16,429,411,038	0.8026	0.8056
	第50期(平成21年11月20日)	15,855,289,033	15,915,097,990	0.7953	0.7983
	第51期(平成21年12月21日)	15,727,275,360	15,786,916,559	0.7911	0.7941

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第10特定期間	第52期(平成22年1月20日)	15,879,099,243	15,938,976,920	0.7956	0.7986
	第53期(平成22年2月22日)	15,622,514,310	15,682,374,624	0.7829	0.7859
	第54期(平成22年3月23日)	15,153,523,145	15,211,297,623	0.7869	0.7899
	第55期(平成22年4月20日)	14,712,789,821	14,767,653,188	0.8045	0.8075
	第56期(平成22年5月20日)	14,149,503,857	14,203,706,884	0.7831	0.7861
	第57期(平成22年6月21日)	13,688,423,551	13,724,013,776	0.7692	0.7712
第11特定期間	第58期(平成22年7月20日)	11,953,075,578	11,984,914,441	0.7508	0.7528
	第59期(平成22年8月20日)	11,308,909,494	11,339,059,482	0.7502	0.7522
	第60期(平成22年9月21日)	10,792,419,166	10,821,365,833	0.7457	0.7477
	第61期(平成22年10月20日)	9,719,515,608	9,733,187,683	0.7109	0.7119
	第62期(平成22年11月22日)	8,197,751,787	8,209,183,400	0.7171	0.7181
	第63期(平成22年12月20日)	7,552,878,249	7,563,501,906	0.7109	0.7119
第12特定期間	第64期(平成23年1月20日)	7,099,765,359	7,109,923,367	0.6989	0.6999
	第65期(平成23年2月21日)	6,740,300,864	6,749,866,393	0.7046	0.7056
	第66期(平成23年3月22日)	6,459,285,013	6,468,682,205	0.6874	0.6884
	第67期(平成23年4月20日)	6,064,782,117	6,073,395,050	0.7041	0.7051
	第68期(平成23年5月20日)	5,829,780,579	5,838,139,774	0.6974	0.6984
	第69期(平成23年6月20日)	5,472,705,804	5,480,744,958	0.6808	0.6818
第13特定期間	第70期(平成23年7月20日)	5,194,094,232	5,201,873,380	0.6677	0.6687
	第71期(平成23年8月22日)	4,982,537,926	4,990,074,175	0.6611	0.6621
	第72期(平成23年9月20日)	4,825,687,355	4,833,044,388	0.6559	0.6569
	第73期(平成23年10月20日)	4,726,461,704	4,733,673,067	0.6554	0.6564
	第74期(平成23年11月21日)	4,597,750,464	4,604,774,306	0.6546	0.6556
	第75期(平成23年12月20日)	4,628,803,830	4,635,786,108	0.6629	0.6639
第14特定期間	第76期(平成24年1月20日)	4,628,516,959	4,635,490,459	0.6637	0.6647
	第77期(平成24年2月20日)	4,764,021,111	4,770,915,024	0.6910	0.6920
	第78期(平成24年3月21日)	4,945,408,372	4,952,229,483	0.7250	0.7260
	第79期(平成24年4月20日)	4,740,779,337	4,747,487,380	0.7067	0.7077
	第80期(平成24年5月21日)	4,565,667,725	4,572,339,900	0.6843	0.6853
	第81期(平成24年6月20日)	4,508,864,540	4,515,457,272	0.6839	0.6849
第15特定期間	第82期(平成24年7月20日)	4,530,795,123	4,537,310,005	0.6955	0.6965
	第83期(平成24年8月20日)	4,554,045,114	4,560,532,884	0.7019	0.7029
	第84期(平成24年9月20日)	4,533,139,157	4,539,595,130	0.7022	0.7032
	第85期(平成24年10月22日)	4,545,170,896	4,551,531,577	0.7146	0.7156
	第86期(平成24年11月20日)	4,600,052,086	4,606,374,386	0.7276	0.7286
	第87期(平成24年12月20日)	4,846,349,125	4,852,659,951	0.7679	0.7689
第16特定期間	第88期(平成25年1月21日)	5,163,561,913	5,169,840,531	0.8224	0.8234
	第89期(平成25年2月20日)	4,608,502,510	4,613,908,223	0.8525	0.8535
	第90期(平成25年3月21日)	4,184,944,067	4,189,773,939	0.8665	0.8675
	第91期(平成25年4月22日)	4,228,972,916	4,233,613,081	0.9114	0.9124
	第92期(平成25年5月20日)	4,344,332,667	4,348,918,128	0.9474	0.9484
	第93期(平成25年6月20日)	3,945,101,538	3,949,642,330	0.8688	0.8698
第17特定期間	第94期(平成25年7月22日)	3,776,413,408	3,780,629,135	0.8958	0.8968
	第95期(平成25年8月20日)	3,675,699,022	3,679,854,311	0.8846	0.8856
	第96期(平成25年9月20日)	3,572,183,774	3,576,180,836	0.8937	0.8947
	第97期(平成25年10月21日)	3,495,530,548	3,499,496,967	0.8813	0.8823
	第98期(平成25年11月20日)	3,535,169,009	3,539,090,680	0.9014	0.9024
	第99期(平成25年12月20日)	3,534,080,557	3,537,815,885	0.9461	0.9471

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18特定期間	第100期(平成26年1月20日)	3,514,700,010	3,518,420,799	0.9446	0.9456
	第101期(平成26年2月20日)	3,333,120,710	3,336,709,422	0.9288	0.9298
	第102期(平成26年3月20日)	3,309,975,047	3,313,526,405	0.9320	0.9330
	第103期(平成26年4月21日)	3,319,759,900	3,323,292,914	0.9396	0.9406
	第104期(平成26年5月20日)	3,287,975,525	3,291,503,617	0.9319	0.9329
	第105期(平成26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(平成26年7月22日)	3,091,663,347	3,094,963,055	0.9370	0.9380
	第107期(平成26年8月20日)	2,922,432,284	2,925,515,852	0.9477	0.9487
	第108期(平成26年9月22日)	2,906,995,848	2,912,806,105	1.0006	1.0026
	第109期(平成26年10月20日)	2,835,004,527	2,840,817,697	0.9754	0.9774
	第110期(平成26年11月20日)	3,047,787,148	3,053,430,342	1.0802	1.0822
	第111期(平成26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(平成27年1月20日)	3,002,013,111	3,007,608,381	1.0731	1.0751
	第113期(平成27年2月20日)	2,929,559,332	2,934,928,132	1.0913	1.0933
	第114期(平成27年3月20日)	2,867,615,806	2,872,793,102	1.1078	1.1098
	第115期(平成27年4月20日)	2,819,136,164	2,824,310,941	1.0896	1.0916
	第116期(平成27年5月20日)	2,888,833,190	2,894,070,137	1.1033	1.1053
	第117期(平成27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(平成27年7月21日)	2,918,007,772	2,923,197,074	1.1246	1.1266
	第119期(平成27年8月20日)	3,026,468,578	3,031,911,931	1.1120	1.1140
	第120期(平成27年9月24日)	2,913,790,409	2,919,231,076	1.0711	1.0731
	第121期(平成27年10月20日)	2,781,230,978	2,786,452,181	1.0654	1.0674
	第122期(平成27年11月20日)	2,863,610,850	2,868,850,506	1.0931	1.0951
	第123期(平成27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(平成28年1月20日)	2,723,110,213	2,728,407,951	1.0280	1.0300
	第125期(平成28年2月22日)	2,562,948,245	2,568,192,861	0.9774	0.9794
	第126期(平成28年3月22日)	2,531,544,368	2,536,750,608	0.9725	0.9745
	第127期(平成28年4月20日)	2,363,085,461	2,368,056,126	0.9508	0.9528
	第128期(平成28年5月20日)	2,380,314,677	2,385,285,544	0.9577	0.9597
	第129期(平成28年6月20日)	2,235,938,659	2,240,853,941	0.9098	0.9118
	平成27年6月末現在	2,999,141,519		1.1072	
	平成27年7月末現在	3,049,812,077		1.1190	
	平成27年8月末現在	2,951,775,585		1.0837	
	平成27年9月末現在	2,893,515,824		1.0655	
	平成27年10月末現在	2,822,239,119		1.0779	
	平成27年11月末現在	2,841,383,656		1.0913	
	平成27年12月末現在	2,821,306,387		1.0651	
	平成28年1月末現在	2,778,144,735		1.0544	
	平成28年2月末現在	2,561,714,163		0.9817	
	平成28年3月末現在	2,447,742,699		0.9785	
	平成28年4月末現在	2,378,869,944		0.9571	
	平成28年5月末現在	2,403,577,530		0.9663	
	平成28年6月末現在	2,233,007,331		0.8965	

【分配の推移】

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第3特定期間	第10期	0.0050
	第11期	0.0050
	第12期	0.0050
	第13期	0.0050
	第14期	0.0050
	第15期	0.0050
第4特定期間	第16期	0.0050
	第17期	0.0050
	第18期	0.0050
	第19期	0.0050
	第20期	0.0050
	第21期	0.0050
第5特定期間	第22期	0.0050
	第23期	0.0050
	第24期	0.0050
	第25期	0.0050
	第26期	0.0050
	第27期	0.0050
第6特定期間	第28期	0.0040
	第29期	0.0040
	第30期	0.0040
	第31期	0.0040
	第32期	0.0040
	第33期	0.0040
第7特定期間	第34期	0.0040
	第35期	0.0040
	第36期	0.0040
	第37期	0.0040
	第38期	0.0040
	第39期	0.0040
第8特定期間	第40期	0.0040
	第41期	0.0030
	第42期	0.0030
	第43期	0.0030
	第44期	0.0030
	第45期	0.0030
第9特定期間	第46期	0.0030
	第47期	0.0030
	第48期	0.0030
	第49期	0.0030
	第50期	0.0030
	第51期	0.0030
第10特定期間	第52期	0.0030
	第53期	0.0030
	第54期	0.0030
	第55期	0.0030
	第56期	0.0030
	第57期	0.0020
第11特定期間	第58期	0.0020
	第59期	0.0020
	第60期	0.0020
	第61期	0.0010
	第62期	0.0010
	第63期	0.0010
第12特定期間	第64期	0.0010
	第65期	0.0010
	第66期	0.0010
	第67期	0.0010
	第68期	0.0010
	第69期	0.0010

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第13特定期間	第70期	0.0010
	第71期	0.0010
	第72期	0.0010
	第73期	0.0010
	第74期	0.0010
	第75期	0.0010
第14特定期間	第76期	0.0010
	第77期	0.0010
	第78期	0.0010
	第79期	0.0010
	第80期	0.0010
	第81期	0.0010
第15特定期間	第82期	0.0010
	第83期	0.0010
	第84期	0.0010
	第85期	0.0010
	第86期	0.0010
	第87期	0.0010
第16特定期間	第88期	0.0010
	第89期	0.0010
	第90期	0.0010
	第91期	0.0010
	第92期	0.0010
	第93期	0.0010
第17特定期間	第94期	0.0010
	第95期	0.0010
	第96期	0.0010
	第97期	0.0010
	第98期	0.0010
	第99期	0.0010
第18特定期間	第100期	0.0010
	第101期	0.0010
	第102期	0.0010
	第103期	0.0010
	第104期	0.0010
	第105期	0.0010
第19特定期間	第106期	0.0010
	第107期	0.0010
	第108期	0.0020
	第109期	0.0020
	第110期	0.0020
	第111期	0.0020
第20特定期間	第112期	0.0020
	第113期	0.0020
	第114期	0.0020
	第115期	0.0020
	第116期	0.0020
	第117期	0.0020
第21特定期間	第118期	0.0020
	第119期	0.0020
	第120期	0.0020
	第121期	0.0020
	第122期	0.0020
	第123期	0.0020
第22特定期間	第124期	0.0020
	第125期	0.0020
	第126期	0.0020
	第127期	0.0020
	第128期	0.0020
	第129期	0.0020

【収益率の推移】

特定期間	計算期間	収益率(%)
第3特定期間	第10期	0.9
	第11期	3.1
	第12期	1.1
	第13期	0.9
	第14期	1.7
	第15期	2.2
第4特定期間	第16期	0.6
	第17期	0.5
	第18期	0.3
	第19期	1.6
	第20期	1.5
	第21期	0.3
第5特定期間	第22期	0.8
	第23期	5.4
	第24期	3.5
	第25期	0.1
	第26期	1.0
	第27期	0.8
第6特定期間	第28期	2.7
	第29期	0.3
	第30期	3.9
	第31期	3.0
	第32期	0.2
	第33期	0.3
第7特定期間	第34期	0.1
	第35期	1.1
	第36期	4.8
	第37期	10.2
	第38期	7.1
	第39期	0.4
第8特定期間	第40期	0.6
	第41期	2.8
	第42期	3.5
	第43期	4.2
	第44期	1.3
	第45期	0.8
第9特定期間	第46期	0.3
	第47期	2.8
	第48期	0.6
	第49期	0.5
	第50期	0.5
	第51期	0.2
第10特定期間	第52期	0.9
	第53期	1.2
	第54期	0.9
	第55期	2.6
	第56期	2.3
	第57期	1.5
第11特定期間	第58期	2.1
	第59期	0.2
	第60期	0.3
	第61期	4.5
	第62期	1.0
	第63期	0.7
第12特定期間	第64期	1.5
	第65期	1.0
	第66期	2.3
	第67期	2.6
	第68期	0.8
	第69期	2.2

特定期間	計算期間	収益率(%)
第13特定期間	第70期	1.8
	第71期	0.8
	第72期	0.6
	第73期	0.1
	第74期	0.0
	第75期	1.4
第14特定期間	第76期	0.3
	第77期	4.3
	第78期	5.1
	第79期	2.4
	第80期	3.0
	第81期	0.1
第15特定期間	第82期	1.8
	第83期	1.1
	第84期	0.2
	第85期	1.9
	第86期	2.0
	第87期	5.7
第16特定期間	第88期	7.2
	第89期	3.8
	第90期	1.8
	第91期	5.3
	第92期	4.1
	第93期	8.2
第17特定期間	第94期	3.2
	第95期	1.1
	第96期	1.1
	第97期	1.3
	第98期	2.4
	第99期	5.1
第18特定期間	第100期	0.1
	第101期	1.6
	第102期	0.5
	第103期	0.9
	第104期	0.7
	第105期	1.0
第19特定期間	第106期	0.2
	第107期	1.2
	第108期	5.8
	第109期	2.3
	第110期	10.9
	第111期	1.4
第20特定期間	第112期	1.7
	第113期	1.9
	第114期	1.7
	第115期	1.5
	第116期	1.4
	第117期	0.8
第21特定期間	第118期	1.5
	第119期	0.9
	第120期	3.5
	第121期	0.3
	第122期	2.8
	第123期	1.9
第22特定期間	第124期	3.8
	第125期	4.7
	第126期	0.3
	第127期	2.0
	第128期	0.9
	第129期	4.8

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

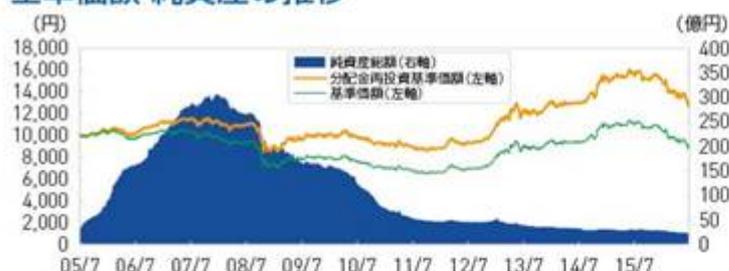
特定期間	計算期間	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第3特定期間	第10期	475,586,991	240,113,381	16,625,993,545
	第11期	427,692,805	374,198,678	16,679,487,672
	第12期	1,146,317,114	262,677,931	17,563,126,855
	第13期	1,827,266,342	287,080,367	19,103,312,830
	第14期	1,429,766,606	407,636,926	20,125,442,510
第4特定期間	第15期	1,516,389,170	570,105,195	21,071,726,485
	第16期	1,066,897,915	424,353,041	21,714,271,359
	第17期	1,553,415,447	108,680,245	23,159,006,561
	第18期	1,833,466,112	253,974,831	24,738,497,842
	第19期	1,030,857,459	370,252,933	25,399,102,368
第5特定期間	第20期	1,132,181,607	246,829,190	26,284,454,785
	第21期	1,591,659,542	852,370,726	27,023,743,601
	第22期	1,056,825,240	384,968,998	27,695,599,843
	第23期	1,102,746,953	338,452,605	28,459,894,191
	第24期	668,302,688	258,943,501	28,869,253,378
第6特定期間	第25期	1,147,828,719	649,243,586	29,367,838,511
	第26期	1,126,706,598	834,484,470	29,660,060,639
	第27期	1,491,806,995	260,146,748	30,891,720,886
	第28期	683,092,319	508,048,079	31,066,765,126
	第29期	770,324,327	853,494,907	30,983,594,546
第7特定期間	第30期	251,114,619	1,100,926,738	30,133,782,427
	第31期	400,227,469	1,270,052,503	29,263,957,393
	第32期	578,827,802	1,138,918,358	28,703,866,837
	第33期	778,965,276	971,913,054	28,510,919,059
	第34期	751,182,769	1,050,345,242	28,211,756,586
第8特定期間	第35期	598,163,767	655,039,120	28,154,881,233
	第36期	849,712,602	848,468,873	28,156,124,962
	第37期	494,787,705	953,751,906	27,697,160,761
	第38期	284,867,375	816,054,440	27,165,973,696
	第39期	327,222,267	879,904,776	26,613,291,187
第9特定期間	第40期	97,125,738	367,298,677	26,343,118,248
	第41期	562,124,790	518,308,525	26,386,934,513
	第42期	328,398,423	2,393,733,608	24,321,599,328
	第43期	622,807,703	1,738,846,730	23,205,560,301
	第44期	225,777,008	727,935,755	22,703,401,554
第10特定期間	第45期	263,084,548	1,586,046,444	21,380,439,658
	第46期	507,272,981	810,590,053	21,077,122,586
	第47期	402,163,674	804,874,200	20,674,412,060
	第48期	261,021,385	359,508,696	20,575,924,749
	第49期	281,412,125	462,123,684	20,395,213,190
第11特定期間	第50期	65,330,184	524,224,140	19,936,319,234
	第51期	720,753,964	776,673,457	19,880,399,741
	第52期	389,853,324	311,027,231	19,959,225,834
	第53期	494,786,499	500,574,086	19,953,438,247
	第54期	105,146,141	800,424,828	19,258,159,560
第12特定期間	第55期	88,919,025	1,059,289,288	18,287,789,297
	第56期	196,668,494	416,781,804	18,067,675,987
	第57期	91,237,133	363,800,184	17,795,112,936
	第58期	144,954,930	2,020,636,276	15,919,431,590
	第59期	79,936,100	924,373,465	15,074,994,225
第12特定期間	第60期	14,236,783	615,897,181	14,473,333,827
	第61期	31,216,474	832,474,826	13,672,075,475
	第62期	6,877,197	2,247,339,525	11,431,613,147
	第63期	14,242,171	822,197,553	10,623,657,765
	第64期	5,601,819	471,251,409	10,158,008,175
第12特定期間	第65期	5,496,284	597,974,968	9,565,529,491
	第66期	503,609,038	671,945,971	9,397,192,558
	第67期	5,663,077	789,922,129	8,612,933,506
	第68期	4,611,140	258,349,047	8,359,195,599
	第69期	4,949,469	324,990,364	8,039,154,704

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13特定期間	第70期	4,473,201	264,479,896	7,779,148,009
	第71期	4,418,716	247,316,861	7,536,249,864
	第72期	4,349,087	183,565,518	7,357,033,433
	第73期	4,368,375	150,037,906	7,211,363,902
	第74期	4,214,820	191,736,692	7,023,842,030
	第75期	78,238,723	119,801,796	6,982,278,957
第14特定期間	第76期	4,026,217	12,804,218	6,973,500,956
	第77期	4,013,535	83,600,619	6,893,913,872
	第78期	3,898,297	76,700,593	6,821,111,576
	第79期	3,582,088	116,649,681	6,708,043,983
	第80期	3,566,513	39,435,029	6,672,175,467
	第81期	3,864,403	83,307,511	6,592,732,359
第15特定期間	第82期	3,545,128	81,394,732	6,514,882,755
	第83期	3,473,000	30,585,116	6,487,770,639
	第84期	3,446,269	35,243,421	6,455,973,487
	第85期	3,452,479	98,744,853	6,360,681,113
	第86期	7,416,555	45,796,857	6,322,300,811
	第87期	3,564,657	15,038,546	6,310,826,922
第16特定期間	第88期	3,015,074	35,223,575	6,278,618,421
	第89期	2,744,790	875,649,572	5,405,713,639
	第90期	1,622,495	577,464,051	4,829,872,083
	第91期	56,914,015	246,620,601	4,640,165,497
	第92期	43,088,121	97,792,574	4,585,461,044
	第93期	35,159,285	79,827,431	4,540,792,898
第17特定期間	第94期	1,512,360	326,577,670	4,215,727,588
	第95期	1,444,530	61,882,577	4,155,289,541
	第96期	34,217,565	192,444,545	3,997,062,561
	第97期	12,535,405	43,176,041	3,966,419,925
	第98期	1,497,780	46,246,055	3,921,671,650
	第99期	94,541,717	280,884,882	3,735,328,485
第18特定期間	第100期	19,488,243	34,027,554	3,720,789,174
	第101期	16,078,535	148,155,518	3,588,712,191
	第102期	12,423,450	49,777,022	3,551,358,619
	第103期	1,221,589	19,565,482	3,533,014,726
	第104期	53,519,669	58,441,461	3,528,092,934
	第105期	1,265,383	93,152,251	3,436,206,066
第19特定期間	第106期	1,231,953	137,729,565	3,299,708,454
	第107期	1,144,037	217,283,597	3,083,568,894
	第108期	1,136,709	179,576,779	2,905,128,824
	第109期	1,940,114	483,849	2,906,585,089
	第110期	2,081,007	87,068,940	2,821,597,156
	第111期	54,873,218	79,489,321	2,796,981,053
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

(参考情報)

運用実績(2016年6月30日現在)

基準価額・純資産の推移



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

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

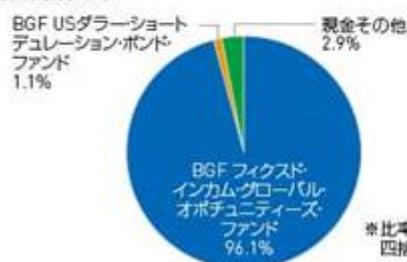
分配の推移

設定来累計		3,340円
直近1年間累計		240円
第125期	2016年2月	20円
第126期	2016年3月	20円
第127期	2016年4月	20円
第128期	2016年5月	20円
第129期	2016年6月	20円

※ 分配金は税引前、1万口当たり

主要な資産の状況

資産構成比率



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

組入上位10銘柄*(%)

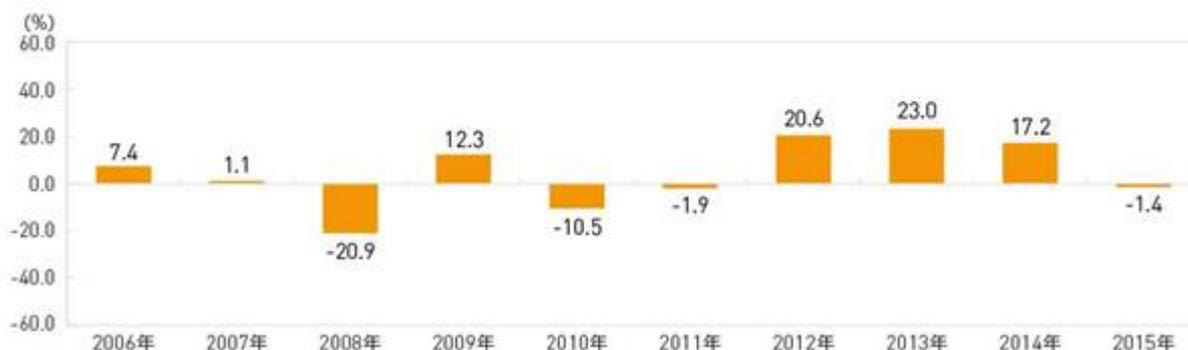
順位	銘柄名	種別	比率
1	FNMA 30YR TBA (REG A) 4 08/11/2016	政府系不動産担保証券	11.6
2	TREASURY NOTE (OTR) 1.625 05/15/2026	国債	9.7
3	GNMA2 30YR TBA (REG C) 4 08/18/2016	政府系不動産担保証券	3.9
4	TREASURY (CPI) NOTE 0.125 04/15/2021	国債	2.3
5	FNMA 15YR 2011 PRODUCTION	政府系不動産担保証券	2.1
6	JAPAN (GOVERNMENT OF) 2YR #356 0.1 09/15/2017	国債	1.9
7	FNMA 15YR 2015 PRODUCTION	政府系不動産担保証券	1.9
8	TREASURY (CPI) NOTE 0.625 01/15/2026	国債	1.7
9	FNMA 30YR 3.5% LLB 85K 2015	政府系不動産担保証券	1.4
10	SPDR GOLD SHARES ETF TRUST	その他	1.4

*当ファンドの主要投資対象ファンドである「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」の組入れ銘柄です。(2016年6月末現在) 残存期間1年未満の短期証券を除きます。比率はBGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンドの純資産総額に対する割合。

年間収益率の推移

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

※ 当ファンドにはベンチマークはありません。

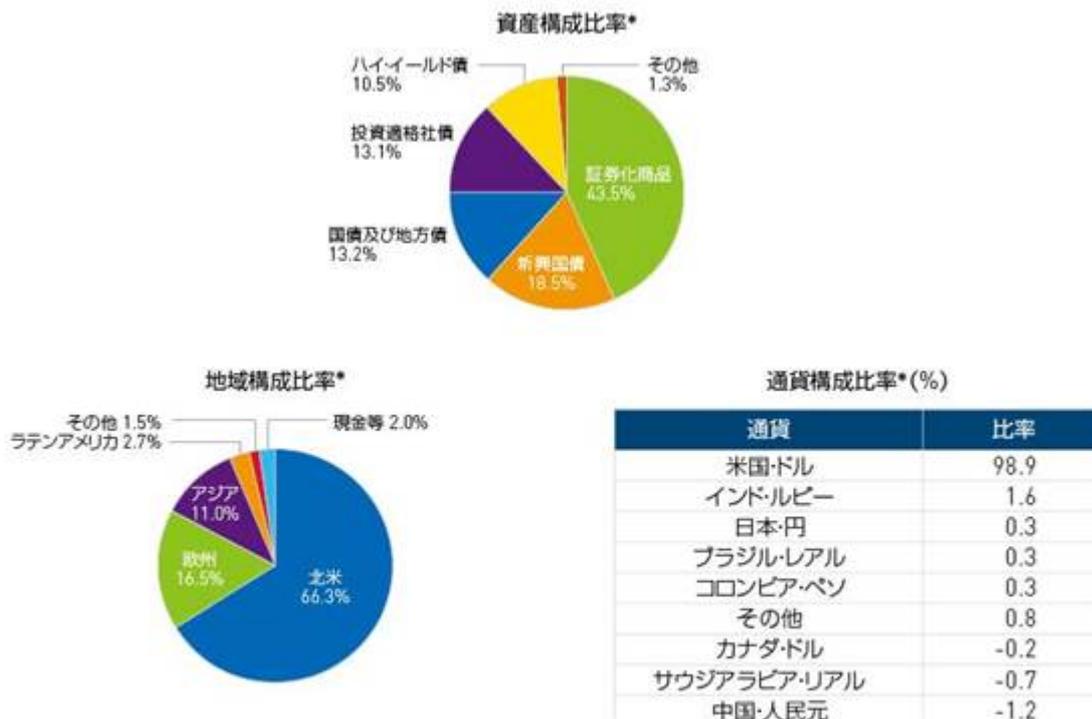


※ 運用実績・データ等は作成日現在および過去のものであり、今後の運用成果を保証するものではありません。

※ ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページにて開示しております。

主要投資対象ファンドの主な資産の状況

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



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

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

※ ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページにて開示しております。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

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

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

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

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

取り扱いを行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合せください。

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予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せん。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

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

(5) 購入単位

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

ただし、「累積投資コース」を選択した投資者が収益分配金を再投資する場合は1円単位とします。なお、販売会社によって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の3.24% (税抜3.00%) を上限として、販売会社が独自に定めることができます。

詳細は販売会社にお問い合わせください。

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています。

- b . 累積投資契約に基づく収益分配金の再投資は無手数料となります。

(8) 購入代金のお支払い

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

(9) 購入の受付の中止、既に受付けた購入の受付の取消

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

2【換金（解約）手続等】

(1) 換金の申込と受付

投資者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に以下の単位をもって換金の申込をすることができます。なお、販売会社によって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って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、換金受付日の翌営業日の基準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。

(5) 換金代金の支払い

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

(6) 換金の受付中止および取消

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付を中止することおよび既に受付けた換金の受付を取り消すことができます。換金の受付が中止された場合には、投資者は当該受付中止以前に行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従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。ただし、第1計算期間は、平成17年7月7日から平成17年10月20日までとします。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、この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、この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、この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、この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、監督官庁よりこのファンドの償還の命令を受けたときはその命令に従い、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、委託会社はこの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、委託会社はこの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. の規定にしていますが、

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、ご購入いただいた販売会社からあらかじめ申し出いただいた方法にて知れている受益者にお届けいたします。

信託事務の委託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き

「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>

収益分配金は、当ファンドの毎計算期間終了日後1ヶ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年間その支払を請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属するものとします。

<累積投資コース>

「累積投資契約」に基づいて収益分配金を再投資する投資者に対しては、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。この場合、販売会社は、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ます。

(3) 受益権の換金請求権

投資者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に換金を請求する権利を有します。換金代金は、投資者の請求を受け付けた日から起算して、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この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(平成27年12月22日から平成28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。
なお、従来、当ファンドが監査証明を受けているPwCあらた監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成28年7月1日をもってPwCあらた有限責任監査法人となりました。

1【財務諸表】

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前特定期間末 (平成27年12月21日現在)	当特定期間末 (平成28年6月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	53	176
金銭信託	68,707	21,992,225
コール・ローン	33,807,802	-
投資証券	2,746,977,933	2,167,916,581
派生商品評価勘定	561,440	2,487
未収入金	56,273,920	54,229,420
流動資産合計	2,837,689,855	2,244,140,889
資産合計		
	2,837,689,855	2,244,140,889
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	5,285,533	4,915,282
未払受託者報酬	104,421	85,372
未払委託者報酬	3,654,974	2,988,146
その他未払費用	261,059	213,430
流動負債合計	9,305,987	8,202,230
負債合計		
	9,305,987	8,202,230
純資産の部		
元本等		
元本	2,642,766,651	2,457,641,093
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	185,617,217	221,702,434
(分配準備積立金)	475,385,831	427,110,685
元本等合計	2,828,383,868	2,235,938,659
純資産合計		
	2,828,383,868	2,235,938,659
負債純資産合計		
	2,837,689,855	2,244,140,889

(2)【損益及び剰余金計算書】

	(単位：円)	
	前特定期間 (自 平成27年6月23日 至 平成27年12月21日)	当特定期間 (自 平成27年12月22日 至 平成28年6月20日)
営業収益		
受取配当金	37,884,696	38,506,878
受取利息	2,537	1,988
有価証券売買等損益	54,400,831	32,029,226
為替差損益	38,312,483	366,631,820
営業収益合計	54,826,081	360,152,180
営業費用		
受託者報酬	625,150	543,002
委託者報酬	21,881,770	19,006,719
その他費用	1,906,989	1,680,519
営業費用合計	24,413,909	21,230,240
営業利益又は営業損失()	79,239,990	381,382,420
経常利益又は経常損失()	79,239,990	381,382,420
当期純利益又は当期純損失()	79,239,990	381,382,420
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()	415,738	308,526
期首剰余金又は期首欠損金()	297,463,544	185,617,217
剰余金増加額又は欠損金減少額	27,170,881	4,359,651
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	4,181,846
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	27,170,881	177,805
剰余金減少額又は欠損金増加額	28,373,242	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	28,373,242	-
分配金	31,819,714	30,605,408
期末剰余金又は期末欠損金()	185,617,217	221,702,434

(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計算日において知りうる直近の最終相場で評価しております。

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

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

(3) 時価が入手できなかった有価証券

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

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

個別法に基づき、原則としてわが国における計算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、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。

4 収益及び費用の計上基準

(1) 受取配当金の計上基準

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

(2) 有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 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。

(2) 計算期間の取扱い

当特定期間は前特定期間末が休業日であったため、平成27年12月22日から平成28年6月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前特定期間末 (平成27年12月21日現在)	当特定期間末 (平成28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	2,642,766,651口	2,457,641,093口
2 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 - 円	元本の欠損 221,702,434円
3 1口当たり純資産額	1.0702円	0.9098円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前特定期間 (自 平成27年6月23日 至 平成27年12月21日)
分配金の計算過程	<p>第118期計算期間(平成27年6月23日～平成27年7月21日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(5,502,875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(37,431,723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)(71,202,165円)、分配準備積立金(483,534,681円)により、分配対象収益は597,671,444円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、5,189,302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119期計算期間(平成27年7月22日～平成27年8月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,153,802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)(101,694,524円)、分配準備積立金(519,794,750円)により、分配対象収益は623,543,076円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、5,443,353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120期計算期間(平成27年8月21日～平成27年9月24日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(1,534,510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)(102,669,472円)、分配準備積立金(515,229,452円)により、分配対象収益は619,433,434円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、5,440,667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121期計算期間(平成27年9月25日～平成27年10月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,370,276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)(98,888,752円)、分配準備積立金(490,336,940円)により、分配対象収益は591,595,968円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、5,221,203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122期計算期間(平成27年10月21日～平成27年11月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(5,632,556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)(107,663,099円)、分配準備積立金(480,833,034円)により、分配対象収益は594,128,689円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、5,239,656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123期計算期間(平成27年11月21日～平成27年12月21日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,025,083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)(116,482,435円)、分配準備積立金(477,646,281円)により、分配対象収益は597,153,799円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、5,285,533円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p>

項目	当特定期間 (自 平成27年12月22日 至 平成28年 6月20日)
分配金の計算過程	<p>第124期計算期間(平成27年12月22日～平成28年 1月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,278,240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)(118,403,916円)、分配準備積立金(474,831,236円)により、分配対象収益は596,513,392円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、5,297,738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125期計算期間(平成28年 1月21日～平成28年 2月22日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,100,504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)(117,955,501円)、分配準備積立金(467,334,614円)により、分配対象収益は587,390,619円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、5,244,616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126期計算期間(平成28年 2月23日～平成28年 3月22日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,920,780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)(118,380,738円)、分配準備積立金(459,505,664円)により、分配対象収益は580,807,182円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、5,206,240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127期計算期間(平成28年 3月23日～平成28年 4月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,418,728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)(113,417,940円)、分配準備積立金(436,138,923円)により、分配対象収益は551,975,591円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、4,970,665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128期計算期間(平成28年 4月21日～平成28年 5月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(5,613,785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)(113,776,860円)、分配準備積立金(433,250,356円)により、分配対象収益は552,641,001円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、4,970,867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129期計算期間(平成28年 5月21日～平成28年 6月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,333,755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)(112,853,786円)、分配準備積立金(428,692,212円)により、分配対象収益は544,879,753円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、4,915,282円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

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

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

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

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

3 金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

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

(2) 信用リスクの管理

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

(3) 取引先リスクの管理

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

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

金融商品の時価等に関する事項

前特定期間末 (平成27年12月21日現在)	当特定期間末 (平成28年6月20日現在)
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>4 金銭債権の特定期間末日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2 時価の算定方法 (1)有価証券 同左</p> <p>(2) 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 同左</p> <p>4 金銭債権の特定期間末日後の償還予定額 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 期中元本変動額

項目	前特定期間末 (平成27年12月21日現在)	当特定期間末 (平成28年6月20日現在)
期首元本額	2,702,993,852円	2,642,766,651円
期中追加設定元本額	253,545,505円	27,042,721円
期中一部解約元本額	313,772,706円	212,168,279円

2 有価証券関係

前特定期間末(平成27年12月21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	19,003,191
合計	19,003,191

当特定期間末(平成28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	2,080,352
合計	2,080,352

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	前特定期間末（平成27年12月21日現在）			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超(円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	56,830,773	-	56,269,333	561,440
合計		56,830,773	-	56,269,333	561,440

区分	種類	当特定期間末（平成28年6月20日現在）			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超(円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	54,226,903	-	54,224,416	2,487
合計		54,226,903	-	54,224,416	2,487

(注1) 時価の算定方法

為替予約取引

- 1 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」という)の対顧客先物相場が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
計算日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラスJ 投資証券	2,076,850.210	20,477,743.070	
		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	16,327.610	230,219.300	
	アメリカドル	小計	2,093,177.820	20,707,962.370 (2,167,916,581)	
投資証券 合計			2,093,177.820	2,167,916,581 (2,167,916,581)	
合計				2,167,916,581 (2,167,916,581)	

(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

当該事項はデリバティブ取引関係の注記事項として記載しております。

(参考情報)

当ファンドは、「ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラス」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、2015年8月31日に終了する計算期間(2014年9月1日から2015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2015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 2015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		9,436,124,570	1,431,979,590
未実現評価損		(103,981,098)	(14,003,911)
投資有価証券 - 時価	2 (a)	9,332,143,472	1,417,975,679
銀行預金	2 (a)	109,562,344	78,063,318
ブローカーに対する債権	16	4,140,000	-
未収利息および未収配当金	2 (a)	65,151,392	5,935,326
売却投資有価証券未収金	2 (a)	6,078,849,571*	15,636,230*
販売投資証券未収金	2 (a)	7,884,561	5,326,182
以下に係る未実現評価益：			
未決済上場先物取引	2 (c)	412,546	-
未決済先渡為替予約	2 (c)	30,136,719	143,586
事後通告証券契約の時価	2 (c)	-	78,596,564
買建オプション/スワップオプションの時価	2 (c)	18,690,728	14,735
その他の資産	2 (a, c)	7,308	-
資産合計		15,646,978,641	1,601,691,620
負債			
銀行からの借入金	2 (a)	2,340,968	-
未払収益分配金	2 (a)	1,417,029	83,194
購入投資有価証券未払金	2 (a)	6,378,999,372*	93,938,321*
買戻し投資証券未払金	2 (a)	45,208,221	7,859,787
以下に係る未実現評価損：			
未決済上場先物取引	2 (c)	-	480,055
事後通告証券契約の時価	2 (c)	89,335,583	-
スワップの時価	2 (c)	5,411,280	447,886
売建オプション/スワップオプションの時価	2 (c)	26,019,751	5,501
その他の負債	5, 6, 7, 8	26,118,495	1,211,633
負債合計		6,574,850,699	104,026,377
純資産合計		9,072,127,942	1,497,665,243

* T B A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 2015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	2015年	2014年	2013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	9,072,127,942	3,779,625,069	915,430,724
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	9.90	-	-
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	10.15	10.35	-
クラスA 毎日分配型投資証券	米ドル	10.07	10.22	-
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	10.07	10.22	-
クラスA 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.08	10.24	9.83
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	7.47	7.62	7.32
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	シンガポール・ドル	14.68	14.86	14.28
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差分配型投資証券	豪ドル	9.77	-	-
クラスA 中国人民元・ヘッジ金利差分配型投資証券	人民元	97.84	-	-
クラスA 安定分配型投資証券	米ドル	12.54	12.92	-
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定分配型投資証券	香港ドル	97.58	100.55	-
クラスA 無分配投資証券	米ドル	13.20	13.18	12.40
クラスA スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	10.01	-	-
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.82	9.85	9.28
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,023	1,026	-
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	14.43	14.21	13.10
クラスA スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローネ	100.32	-	-
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ドル	19.26	19.16	18.06
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	9.92	-	-
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	10.07	10.22	-
クラスC 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.03	10.18	9.77
クラスC 無分配投資証券	米ドル	11.87	12.01	11.44
クラスD 毎年分配型投資証券	米ドル	13.40	13.61	-
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	9.96	-	-
クラスD 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.60	10.76	10.33
クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	7.49	7.64	7.34
クラスD 無分配投資証券	米ドル	13.37	13.29	12.44
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	10.53	10.56	-
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.21	10.18	9.55

3 会計年度末における純資産価額の概要 2015年8月31日現在(続き)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・
ファンド

	通貨	2015年	2014年	2013年
		8月31日現在	8月31日現在	8月31日現在
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	10.51	10.42	-
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	14.64	14.34	13.15
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	19.53	19.33	18.13
クラスE無分配投資証券	米ドル	12.61	12.66	11.97
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.42	9.49	8.99
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	9.86	-	-
クラスI毎四半期分配型投資証券	米ドル	9.87	10.01	-
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	9.93	-	-
クラスI無分配投資証券	米ドル	10.57	10.49	-
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	カナダ・ドル	10.09	-	-
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	11.15	-	-
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.45	10.41	-
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	10.53	10.42	-
クラスI日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,035	1,031	-
クラスJ毎月分配型投資証券	米ドル	10.07	10.22	-
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	9.93	-	-
クラスX毎月分配型投資証券	米ドル	10.07	10.22	-
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	豪ドル	10.39	10.31	-
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	ユーロ	10.02	10.21	-
クラスX無分配投資証券	米ドル	10.07	-	-
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	10.39	10.02	-
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	カナダ・ドル	9.93	-	-
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	11.28	-	-
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.78	10.68	9.94
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	10.14	-	-
クラスXスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローネ	10.07	-	-

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

3 会計年度末における純資産価額の概要 2015年8月31日現在(続き)

	USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド			
	通貨	2015年 8月31日現在	2014年 8月31日現在	2013年 8月31日現在
純資産合計	米ドル	1,497,665,243	952,088,045	684,608,085
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	8.63	8.72	8.68
クラスA毎月分配型投資証券	米ドル	8.62	8.71	8.67
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	9.87	9.94	-
クラスA無分配投資証券	米ドル	12.84	12.80	12.50
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.20	10.22	9.99
クラスC毎日分配型投資証券	米ドル	8.63	8.73	8.68
クラスC無分配投資証券	米ドル	10.94	11.05	10.92
クラスD毎月分配型投資証券	米ドル	9.89	10.00	9.95
クラスD無分配投資証券	米ドル	12.97	12.88	12.54
クラスE無分配投資証券	米ドル	11.96	11.98	11.76
クラスX無分配投資証券	米ドル	13.90	13.74	13.30

価格は各投資証券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では、各投資証券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。

損益および純資産変動計算書 2015年8月31日に終了した会計年度

	注記	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	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		3,779,625,069	952,088,045
収益			
預金利息		-	2,656
債券利息		177,734,440	31,314,860
スワップ利息		8,751,013	43,954
集団投資スキームによる収益		61,244	-
配当金、源泉徴収税控除後		1,743,128	-
有価証券貸付		756,445	194,891
収益合計	2 (b)	189,046,270	31,556,361
費用			
銀行利息		88,902	-
スワップ利息		3,140,703	443,515
管理事務代行報酬	7	7,771,520	871,222
保管および預託報酬	8	1,372,875	203,777
販売報酬	6	7,535,715	1,620,767
税金	9	2,927,605	568,309
投資運用報酬	5	47,137,116	6,591,829
費用合計		69,974,436	10,299,419
純利益		119,071,834	21,256,942
以下に係る実現純評価益 / (損) :			
投資有価証券	2 (a)	(99,463,104)	(10,981,956)
事後通告証券契約	2 (c)	(8,928,570)	1,629,098
上場先物取引	2 (c)	(76,524,710)	(5,066,850)
オプション契約	2 (c)	(11,037,739)	(33,518)
スワップ取引	2 (c)	(24,448,040)	(828,052)
先渡為替予約	2 (c)	(129,687,410)	14,529,052
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	6,744,862	(212,748)
当期実現純評価損		(343,344,711)	(964,974)
以下に係る未実現純評価益 / (損) の純変動額 :			
投資有価証券	2 (a)	(125,490,966)	(11,657,781)
事後通告証券契約	2 (c)	(1,696,419)	(120,900)
上場先物取引	2 (c)	8,450,622	(171,626)
オプション契約	2 (c)	(15,287,290)	(354)
スワップ取引	2 (c)	1,868,388	(505,662)
先渡為替予約	2 (c)	35,609,764	(1,431,497)
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(651,109)	(25,787)
当期末実現純評価益 / (損) の純変動		(97,197,010)	(13,913,607)
運用成績による純資産の増加 / (減少)		(321,469,887)	6,378,361
資本の変動			
投資証券発行による正味受取額		8,484,015,804	1,351,406,713
投資証券買戻しによる正味支払額		(2,853,805,407)	(811,298,070)
資本の変動による純資産の増加		5,630,210,397	540,108,643
配当金宣言額	17	(16,237,637)	(909,806)
期末純資産		9,072,127,942	1,497,665,243

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 2015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

	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	-	224,524	12,678	211,846
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	450,006	2,608,435	154,258	2,904,183
クラスA 毎日分配型投資証券	1,087,602	5,381,876	863,726	5,605,752
クラスA 毎月分配型投資証券	6,939,515	5,156,156	10,082,609	2,013,062
クラスA 毎四半期分配型投資証券	8,820,602	13,067,164	3,876,056	18,011,710
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	3,942,225	1,058,984	3,946,648	1,054,561
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	64,750	238,506	16,710	286,546
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差分配型投資証券	-	220,060	601	219,459
クラスA 中国人民元・ヘッジ金利差分配型投資証券	-	308	-	308
クラスA 安定分配型投資証券	122,042	648,202	71,352	698,892
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定分配型投資証券	385	196,795	72,280	124,900
クラスA 無分配投資証券	56,033,019	97,184,534	33,997,306	119,220,247
クラスA スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	-	8,556,229	329,119	8,227,110
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	10,912,305	25,632,341	6,439,033	30,105,613
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	396,638	724,203	290	1,120,551
クラスA ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	32,762,126	79,423,814	69,946,851	42,239,089
クラスA スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	-	978,982	96,117	882,865
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	53,884	519,500	75,927	497,457
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	-	4,224,944	320	4,224,624
クラスC 毎日分配型投資証券	503,094	668,812	74,127	1,097,779
クラスC 毎四半期分配型投資証券	2,681,310	2,425,245	662,914	4,443,641
クラスC 無分配投資証券	6,209,483	14,726,018	3,661,111	17,274,390
クラスD 毎年分配型投資証券	1,500,007	449,805	153,515	1,796,297
クラスD カナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	-	663	-	663
クラスD 毎四半期分配型投資証券	15,767,286	16,771,985	6,989,794	25,549,477
クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	269,529	192,090	96,939	364,680
クラスD 無分配投資証券	35,021,727	79,302,968	32,949,055	81,375,640
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	2,097,113	7,285,165	2,965,039	6,417,239
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	33,145,603	60,725,596	29,772,235	64,098,964
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	1,344,401	2,734,951	1,535,104	2,544,248
クラスD ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	1,240	-	-	1,240
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	342	14,871	331	14,882

発行済投資証券口数変動表 2015年8月31日現在(続き)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

	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E無分配投資証券	24,054,045	41,028,492	19,335,680	45,746,857
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	33,369,693	43,213,234	18,651,220	57,931,707
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	-	610	-	610
クラスI毎四半期分配型投資証券	7,492,517	35,673,739	-	43,166,256
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	-	3,430,469	383	3,430,086
クラスI無分配投資証券	10,266,740	54,893,386	16,215,062	48,945,064
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	-	570	-	570
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	-	347,937	-	347,937
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	3,456,989	32,593,696	5,865,749	30,184,936
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	4,144,053	20,266,269	5,033,145	19,377,177
クラスI日本円ヘッジ無分配投資証券	9,786,670	35,514,158	2,902,049	42,398,779
クラスJ毎月分配型投資証券	2,541,419	478,709	648,120	2,372,008
クラスX英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	-	16,112,361	320	16,112,041
クラスX毎月分配型投資証券	4,232,995	735,820	1,368,032	3,600,783
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	3,806,241	120,573	1,344,475	2,582,339
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	267,648	73,711	60,156	281,203
クラスX無分配投資証券	-	4,855,561	261,261	4,594,300
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	545	7,152,306	15,396	7,137,455
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	-	10,700,625	606	10,700,019
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	-	882,261	414	881,847
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	2,940,398	109,927	2,622,886	427,439
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	-	12,649,334	310	12,649,024
クラスXスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	-	78,658,479	2,241,138	76,417,341

発行済投資証券口数変動表 2015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

	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	2,257,179	2,241,864	2,133,346	2,365,697
クラスA 毎月分配型投資証券	1,188,068	2,391,844	955,089	2,624,823
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配 型投資証券	40,012	85,864	-	125,876
クラスA 無分配投資証券	21,157,352	29,782,607	17,432,467	33,507,492
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	101,302	1,020,533	168,905	952,930
クラスC 毎日分配型投資証券	893,955	1,254,839	1,496,559	652,235
クラスC 無分配投資証券	1,424,399	1,264,565	544,487	2,144,477
クラスD 毎月分配型投資証券	2,289,922	2,323,256	2,601,453	2,011,725
クラスD 無分配投資証券	13,119,582	35,637,425	24,694,955	24,062,052
クラスE 無分配投資証券	15,855,213	23,623,270	14,666,518	24,811,965
クラスX 無分配投資証券	17,773,490	9,120,941	1,363,893	25,530,538

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 2015年8月31日現在

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通/優先株式			
	バミューダ		
813,000	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd	504,550	0.01
	カナダ		
5,883	Norbord Inc	96,010	0.00
99,749	Northern Graphite Corp	26,964	0.00
		122,974	0.00
	ケイマン諸島		
147,094	Vantage Drilling Co	23,315	0.00
	中国		
353,252	Huatai Securities Co Ltd 'H'	642,646	0.01
	香港		
750,000	China Unicom Hong Kong Ltd	985,093	0.01
	オランダ		
14,780	LyondellBasell Industries NV 'A'	1,223,932	0.01
	米国		
15,232	American Capital Agency Corp (Reit)	293,597	0.00
7,513	Anadarko Petroleum Corp	511,485	0.01
30,098	Annaly Capital Management Inc (Reit)	304,592	0.00
36,717	Apple Inc	4,126,256	0.05
51,831	CBS Corp 'B'	2,336,023	0.03
3,745	Concho Resources Inc	382,926	0.00
36,019	Delta Air Lines Inc	1,590,239	0.02
6,559	EOG Resources Inc	492,974	0.01
16,518	GEO Group Inc/The (Reit)	498,348	0.01
280,000	GMAC Capital Trust I (Pref)	7,151,200	0.08
52,586	Matador Resources Co	1,147,427	0.01
7,708	National Retail Properties Inc (Reit)	274,251	0.00
3,373	Pioneer Natural Resources Co	394,574	0.01
40,000	RBS Capital Funding Trust V (Pref)	986,800	0.01
6,240	Realty Income Corp (Reit)	284,606	0.00
15,026	RSP Permian Inc	328,769	0.00
27,896	Two Harbors Investment Corp (Reit)	264,175	0.00
30,912	United Continental Holdings Inc	1,777,749	0.02
18,700	United Rentals Inc	1,245,420	0.01
226,231	VEREIT Inc (Reit)	1,857,356	0.02
9,505	Whiting Petroleum Corp	162,916	0.00
		26,411,683	0.29

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通/優先株式合計		29,914,193	0.33
債券			
	アルゼンチン		
USD 6,769,000	YPF SA '144A' 8.5% 28/7/2025	6,362,860	0.07
	オーストラリア		
USD 1,300,000	APT Pipelines Ltd 4.2% 23/3/2025	1,253,851	0.01
USD 4,500,000	CNOOC Finance 2015 Australia Pty Ltd 2.625% 5/5/2020	4,433,477	0.05
USD 187,500	Linc Energy Ltd 9% 10/4/2018	153,750	0.00
EUR 7,250,000	Origin Energy Finance Ltd 3.5% 4/10/2021*	8,278,015	0.09
USD 500,000	Transfield Services Ltd '144A' 8.375% 15/5/2020	518,750	0.01
		14,637,843	0.16
	オーストリア		
USD 3,800,000	Erste Group Bank AG FRN 26/5/2025	3,735,058	0.04
EUR 4,500,000	UNIQA Insurance Group AG FRN 27/7/2046	5,231,089	0.06
		8,966,147	0.10
	バミューダ		
CNY 1,000,000	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd 5% 8/8/2019	141,383	0.00
USD 1,435,000	Digicel Ltd '144A' 6% 15/4/2021	1,320,028	0.02
CNH 6,000,000	IT Ltd 6.25% 15/5/2018	865,788	0.01
USD 900,000	Kunlun Energy Co Ltd 3.75% 13/5/2025	875,637	0.01
USD 1,900,000	Noble Group Ltd FRN 24/6/2019 (Perpetual)	1,149,500	0.01
USD 1,350,000	Noble Group Ltd 6.75% 29/1/2020*	1,127,250	0.01
HKD 2,000,000	REXLot Holdings Ltd 4.5% 17/4/2019	193,535	0.00
CNH 5,000,000	Southwest Securities International Securities Ltd 6.45% 28/5/2018	733,127	0.01
		6,406,248	0.07
	英領バージン諸島		
USD 1,000,000	Asia View Ltd 1.5% 8/8/2019	1,010,500	0.01
USD 2,900,000	Billion Express Investments Ltd 0.75% 18/10/2015	2,892,750	0.03
USD 1,550,000	Bluestar Finance Holdings Ltd 4.375% 11/6/2020*	1,533,849	0.02
USD 1,700,000	Caifu Holdings Ltd 8.75% 24/1/2020	1,636,250	0.02
USD 3,000,000	CCCI Treasure Ltd FRN 21/4/2020 (Perpetual)	2,910,771	0.03
USD 250,000	Central Plaza Development Ltd FRN 8/4/2018 (Perpetual)	260,000	0.00
USD 730,000	China Energy Reserve and Chemicals Group Overseas Co Ltd 5.25% 11/5/2018	719,963	0.01
CNH 4,250,000	China New Town Finance I Ltd 5.5% 6/5/2018	668,493	0.01
USD 1,100,000	CNOOC Finance 2012 Ltd 5% 2/5/2042	1,160,586	0.01
USD 900,000	COSCO Finance 2011 Ltd 4% 3/12/2022	885,150	0.01
USD 1,600,000	Cosmos Boom Investment Ltd 0.5% 23/6/2020	1,504,000	0.02
USD 1,200,000	CP Foods Holdings Ltd 0.5% 15/1/2019	1,257,000	0.01
USD 3,700,000	Double Rosy Ltd 3.625% 18/11/2019	3,685,200	0.04
USD 2,000,000	Franshion Capital Ltd 6.8% 12/10/2015 (Perpetual)	2,090,000	0.02
CNH 6,500,000	Fuqing Investment Management Ltd 4.85% 21/7/2018	997,319	0.01
USD 2,500,000	Greenland Global Investment Ltd 5.875% 3/7/2024	2,405,413	0.03

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英領バージン諸島(続き)		
USD 1,920,000	King Power Capital Ltd 5.625% 3/11/2024	1,988,842	0.02
USD 2,375,000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd 4.75% 30/7/2025	2,374,169	0.03
USD 1,200,000	PB Issuer No 4 Ltd 3.25% 3/7/2021	1,149,000	0.01
HKD 6,000,000	Shine Power International Ltd 28/7/2019 (Zero Coupon)	743,174	0.01
USD 1,575,000	Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd 4.1% 28/4/2045	1,449,995	0.02
HKD 5,000,000	Tong Jie Ltd 18/2/2018 (Zero Coupon)	657,858	0.01
USD 2,200,000	Trillion Chance Ltd 8.5% 10/1/2019	2,067,927	0.02
USD 1,900,000	Wanda Properties International Co Ltd 7.25% 29/1/2024	2,042,310	0.02
USD 500,000	Wanda Properties Overseas Ltd 4.875% 21/11/2018	511,253	0.01
USD 400,000	Yingde Gases Investment Ltd 8.125% 22/4/2018	322,000	0.00
USD 1,650,000	Zhaohai Investment BVI Ltd 4% 23/7/2020	1,604,303	0.02
		40,528,075	0.45
	カナダ		
USD 1,404,000	MEG Energy Corp '144A' 6.5% 15/3/2021	1,161,529	0.01
USD 1,774,000	MEG Energy Corp '144A' 7% 31/3/2024	1,459,115	0.02
USD 1,422,000	Novelis Inc 8.75% 15/12/2020	1,422,889	0.02
EUR 900,000	Valeant Pharmaceuticals International Inc 4.5% 15/5/2023	981,645	0.01
USD 5,196,000	Valeant Pharmaceuticals International Inc '144A' 6.125% 15/4/2025	5,372,664	0.06
USD 392,000	Valeant Pharmaceuticals International Inc '144A' 6.75% 15/8/2018	412,580	0.00
		10,810,422	0.12
	ケイマン諸島		
CNH 2,500,000	Agile Property Holdings Ltd 6.5% 28/2/2017*	362,684	0.00
USD 1,330,000	Agile Property Holdings Ltd 9.875% 20/3/2017	1,348,593	0.02
USD 1,500,000	Alibaba Group Holding Ltd 4.5% 28/11/2034	1,408,243	0.02
HKD 4,000,000	Biostime International Holdings Ltd 20/2/2019 (Zero Coupon)	487,278	0.01
GBP 300,000	Brakes Capital 7.125% 15/12/2018	478,818	0.01
USD 1,400,000	CAR Inc 6% 11/2/2021	1,359,365	0.02
USD 1,300,000	CCBL Cayman Corp Ltd 3.25% 28/7/2020	1,284,946	0.01
USD 3,600,000	CDBL Funding 1 4.25% 2/12/2024	3,541,140	0.04
USD 750,000	China Aoyuan Property Group Ltd 10.875% 26/5/2018	750,375	0.01
USD 1,600,000	CIFI Holdings Group Co Ltd 7.75% 5/6/2020	1,448,773	0.02
USD 200,000	CIFI Holdings Group Co Ltd 12.25% 15/4/2018	215,000	0.00
USD 1,800,000	E-House China Holdings Ltd '144A' 2.75% 15/12/2018	1,695,960	0.02
USD 450,000	E-House China Holdings Ltd 2.75% 15/12/2018	422,156	0.00
USD 250,000	Evergrande Real Estate Group Ltd 12% 17/2/2020	241,938	0.00
USD 2,500,000	Fantasia Holdings Group Co Ltd 10.625% 23/1/2019*	2,250,000	0.03
USD 1,000,000	Fantasia Holdings Group Co Ltd 13.75% 27/9/2017	990,000	0.01
CNH 1,500,000	Far East Consortium International Ltd/HK 5.875% 4/3/2016	229,248	0.00
USD 1,800,000	Formosa Group Cayman Ltd 3.375% 22/4/2025	1,711,260	0.02
USD 2,500,000	Global A&T Electronics Ltd 10% 1/2/2019	2,112,500	0.02
USD 1,500,000	Global A&T Electronics Ltd 10% 1/2/2019	1,276,875	0.01

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ケイマン諸島(続き)		
USD 1,400,000	Goodman HK Finance 4.375% 19/6/2024	1,410,773	0.02
CNH 5,000,000	Greenland Hong Kong Holdings Ltd 5.5% 23/1/2018	735,066	0.01
USD 250,000	Greentown China Holdings Ltd 8.5% 4/2/2018	262,262	0.00
HKD 6,000,000	HC International Inc 5% 27/11/2019	628,602	0.01
HKD 14,000,000	Hengan International Group Co Ltd 27/6/2018 (Zero Coupon)	1,881,958	0.02
USD 300,000	Kaisa Group Holdings Ltd (Defaulted) 8.875% 19/3/2018	153,000	0.00
USD 1,450,000	Kaisa Group Holdings Ltd 9% 6/6/2019	728,625	0.01
USD 750,000	Kaisa Group Holdings Ltd 10.25% 8/1/2020*	382,500	0.00
USD 450,000	Kaisa Group Holdings Ltd (Defaulted) 12.875% 18/9/2017	227,250	0.00
USD 1,670,000	KWG Property Holding Ltd 8.25% 5/8/2019*	1,670,501	0.02
USD 250,000	KWG Property Holding Ltd 13.25% 22/3/2017	270,000	0.00
USD 250,000	Longfor Properties Co Ltd 6.75% 29/1/2023	247,500	0.00
USD 900,000	MIE Holdings Corp 7.5% 25/4/2019	531,000	0.01
CNH 4,000,000	Panda Funding Investment 2013 3.95% 17/12/2016	616,757	0.01
USD 250,000	Powerlong Real Estate Holdings Ltd 11.25% 25/1/2018	252,980	0.00
GBP 3,159,722	Punch Taverns Finance B Ltd 5.267% 30/3/2024	4,655,606	0.05
GBP 2,250,000	Punch Taverns Finance B Ltd 5.943% 30/9/2022	3,352,170	0.04
GBP 1,532,469	Punch Taverns Finance B Ltd 7.369% 30/9/2021	2,401,146	0.03
USD 3,000,000	Qihoo 360 Technology Co Ltd 0.5% 15/8/2020	2,643,750	0.03
USD 600,000	Qihoo 360 Technology Co Ltd 1.75% 15/8/2021	505,875	0.01
USD 250,000	Shimao Property Holdings Ltd 8.375% 10/2/2022	250,079	0.00
CNH 7,300,000	Shui On Development Holding Ltd 6.875% 26/2/2017	1,076,029	0.01
USD 250,000	SOHO China Ltd 7.125% 7/11/2022	246,170	0.00
USD 400,000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd 4.5% 14/2/2022	427,050	0.00
USD 250,000	Sunac China Holdings Ltd 12.5% 16/10/2017	269,137	0.00
USD 402,000	TICP CLO III Ltd '2014-3A B1' '144A' FRN 20/1/2027	401,295	0.00
USD 1,200,000	Times Property Holdings Ltd 12.625% 21/3/2019*	1,263,942	0.01
USD 3,000,000	TPK Holding Co Ltd 8/4/2020 (Zero Coupon)	2,577,750	0.03
GBP 800,000	Trafford Centre Finance Ltd/The FRN 28/7/2035	1,108,556	0.01
USD 800,000	Transocean Inc 6.5% 15/11/2020*	656,000	0.01
EUR 426,000	UPCB Finance IV Ltd 4% 15/1/2027	445,208	0.01
USD 200,000	Yuzhou Properties Co Ltd 8.75% 4/10/2018	197,810	0.00
		56,091,499	0.62
	中国		
USD 2,000,000	China Construction Bank Corp FRN 13/5/2025	1,978,400	0.02
CNH 67,000,000	China Government Bond 3.38% 21/11/2024	10,279,126	0.12
USD 3,500,000	China Life Insurance Co Ltd FRN 3/7/2075	3,390,660	0.04
EUR 1,000,500	Industrial & Commercial Bank of China Ltd FRN 10/12/2021 (Perpetual)*	1,184,059	0.01
		16,832,245	0.19
	デンマーク		
DKK 34,130,000	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 2% 1/10/2047	4,666,498	0.05
DKK 42,114,944	Nykredit Realkredit A/S 2% 1/10/2047	5,736,073	0.07

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
デンマーク(続き)			
DKK 53,338,832	Realkredit Danmark A/S 2% 1/10/2047	7,294,874	0.08
		17,697,445	0.20
フランス			
EUR 300,000	3AB Optique Developpement SAS 5.625% 15/4/2019*	326,765	0.00
EUR 200,000	Autodis SA 6.5% 1/2/2019*	234,739	0.00
EUR 400,000	AXA SA FRN 8/10/2025 (Perpetual)	441,964	0.01
EUR 600,000	BNP Paribas Cardif SA FRN 25/11/2025 (Perpetual)	661,678	0.01
USD 425,000	BNP Paribas SA '144A' FRN 19/8/2025 (Perpetual)	435,731	0.00
USD 8,150,000	BNP Paribas SA FRN 19/8/2025 (Perpetual)*	8,355,788	0.09
EUR 550,000	BNP Paribas SA FRN 14/10/2027	612,393	0.01
EUR 2,500,000	Cap Gemini SA 1.75% 1/7/2020	2,856,573	0.03
EUR 4,200,000	Cap Gemini SA 2.5% 1/7/2023	4,856,240	0.05
EUR 1,100,000	Credit Agricole Assurances SA FRN 13/1/2025 (Perpetual)	1,206,305	0.01
EUR 5,000,000	Credit Agricole SA 2.625% 17/3/2027	5,284,456	0.06
USD 800,000	Credit Agricole SA/London '144A' 3.875% 15/4/2024	814,114	0.01
EUR 450,000	Crown European Holdings SA 3.375% 15/5/2025	469,696	0.01
EUR 310,320	Driver France 1 FCT FRN 21/7/2020	348,935	0.00
EUR 600,000	Electricite de France SA FRN 22/1/2026 (Perpetual)	723,682	0.01
GBP 400,000	Electricite de France SA FRN 22/1/2029 (Perpetual)	622,633	0.01
EUR 1,428	FCT Copernic '2012-1 A1' FRN 25/9/2029	1,606	0.00
EUR 565,775	FCT Marsollier Mortgages '2009-1 A' FRN 27/9/2050	635,993	0.01
EUR 175,000	Horizon Holdings I SASU 7.25% 1/8/2023	202,006	0.00
EUR 900,000	Numericable-SFR SAS 5.375% 15/5/2022*	1,047,481	0.01
EUR 1,400,000	Numericable-SFR SAS 5.625% 15/5/2024*	1,614,595	0.02
USD 1,545,000	Numericable-SFR SAS '144A' 6% 15/5/2022	1,556,587	0.02
EUR 100,000	Orange SA FRN 7/2/2020 (Perpetual)	117,864	0.00
EUR 150,000	Orange SA FRN 1/10/2021 (Perpetual)	174,171	0.00
EUR 4,125,000	Orange SA FRN 1/10/2026 (Perpetual)	4,849,294	0.05
EUR 7,010,000	Renault SA 3.125% 5/3/2021	8,476,494	0.09
EUR 2,500,000	Renault SA 3.625% 19/9/2018	3,027,582	0.03
EUR 200,000	SGD Group SAS 5.625% 15/5/2019	229,292	0.00
EUR 700,000	Societe Generale SA 2.625% 27/2/2025	755,162	0.01
EUR 6,300,000	Societe Generale SFH SA 0.125% 27/2/2020*	7,050,101	0.08
EUR 400,000	Total SA FRN 26/2/2021 (Perpetual)	438,636	0.01
EUR 200,000	Total SA FRN 26/2/2025 (Perpetual)	211,776	0.00
EUR 500,000	WFS Global Holding SAS 9.5% 15/7/2022	581,524	0.01
		59,221,856	0.65
ドイツ			
EUR 1,000,000	Bayer AG FRN 2/4/2075	1,089,448	0.01
EUR 4,500,000	Bertelsmann SE & Co KGaA FRN 23/4/2075	4,586,705	0.05
EUR 9,200,000	Commerzbank AG 7.75% 16/3/2021	12,538,507	0.14
USD 2,735,000	Commerzbank AG 8.125% 19/9/2023	3,213,625	0.04
EUR 500,000	Deutsche Bank AG 2.75% 17/2/2025	534,607	0.01
USD 1,600,000	Deutsche Bank AG 4.5% 1/4/2025*	1,552,990	0.02

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ドイツ(続き)		
EUR 12,472,000	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.1% 15/4/2026	14,872,687	0.16
EUR 48,230,000	KFW 0.375% 23/4/2030	48,174,193	0.53
EUR 200,000	Merck KGaA FRN 12/12/2074	223,564	0.00
EUR 500,000	ProGroup AG 5.125% 1/5/2022	581,681	0.01
EUR 600,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 3.5% 15/1/2027	646,937	0.01
EUR 1,800,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 4% 15/1/2025	2,026,104	0.02
EUR 90,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 5.125% 21/1/2023	107,654	0.00
EUR 90,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 5.625% 15/4/2023	108,791	0.00
EUR 360,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 5.75% 15/1/2023	435,065	0.00
		90,692,558	1.00
	ギリシャ		
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) FRN 24/2/2030	67,376	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) FRN 24/2/2037	61,382	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) FRN 24/2/2039	61,146	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2023	78,126	0.01
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2024	76,666	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2025	75,537	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2026	73,402	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2027	71,717	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2028	70,204	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2029	68,787	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2031	66,190	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2032	65,010	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2033	63,962	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2034	63,125	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2035	62,485	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2036	61,867	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2038	61,192	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2040	61,068	0.00

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ギリシャ(続き)		
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2041	61,102	0.00
EUR 102,777	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2042	61,085	0.00
EUR 11,169,000	Hellenic Republic Government Bond '144A' 4.75% 17/4/2019	10,396,258	0.12
		11,727,687	0.13
	ガーンジー		
USD 5,471,000	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd '144A' 4.875% 15/5/2045	5,386,243	0.06
USD 1,970,613	Doric Nimrod Air Alpha 2013-1 Class A Pass Through Trust '144A' 5.25% 30/5/2023	2,069,144	0.02
		7,455,387	0.08
	香港		
CNH 3,000,000	Beijing Capital Hong Kong Ltd 4.7% 20/6/2017	451,513	0.01
USD 200,000	China South City Holdings Ltd 8.25% 29/1/2019	188,060	0.00
USD 240,000	China South City Holdings Ltd 13.5% 17/10/2017	255,672	0.00
USD 1,000,000	CITIC Ltd FRN 22/11/2018 (Perpetual)	1,127,500	0.01
USD 2,500,000	CITIC Ltd 6.8% 17/1/2023	2,871,700	0.03
USD 2,550,000	CRCC Yupeng Ltd FRN 1/8/2019 (Perpetual)	2,527,394	0.03
USD 1,200,000	Far East Horizon Ltd FRN 23/6/2017 (Perpetual)*	1,203,600	0.01
USD 250,000	Gemdale International Investment Ltd 7.125% 16/11/2017	255,325	0.00
USD 1,000,000	Poly Property Group Co Ltd 4.75% 16/5/2018	974,355	0.01
CNH 3,000,000	Yufu Eternity Ltd 5.625% 26/11/2017	449,506	0.01
		10,304,625	0.11
	インド		
USD 490,000	Bank of India/London 6.25% 16/2/2021	549,944	0.01
USD 200,000	Bharat Petroleum Corp Ltd 4.625% 25/10/2022	205,240	0.00
INR 2,200,000,000	Food Corp of India 9.95% 7/3/2022	35,806,999	0.40
INR 500,000,000	Housing Development Finance Corp Ltd 9.3% 1/8/2016	7,585,216	0.08
INR 838,000,000	Housing Development Finance Corp Ltd 9.45% 21/8/2019	12,975,272	0.14
INR 830,000,000	Housing Development Finance Corp Ltd 9.65% 17/1/2019	12,884,041	0.14
USD 1,750,000	ICICI Bank Ltd FRN 30/4/2022	1,790,268	0.02
INR 2,288,000,000	India Government Bond 7.16% 20/5/2023	32,812,382	0.36
INR 975,000,000	India Government Bond 8.33% 9/7/2026	15,007,153	0.17
USD 1,200,000	Lodha Developers International Ltd 12% 13/3/2020*	1,170,000	0.01
INR 2,150,000,000	Mahanagar Telephone Nigam Ltd 8.29% 28/11/2024	32,514,405	0.36
USD 1,580,000	NTPC Ltd 5.625% 14/7/2021	1,753,816	0.02
INR 400,000,000	NTPC Ltd 9.17% 22/9/2024	6,366,941	0.07
INR 1,600,000,000	Power Finance Corp Ltd 8.65% 28/12/2024	24,523,927	0.27
INR 1,600,000,000	Rural Electrification Corp Ltd 8.57% 21/12/2024	24,393,219	0.27
INR 2,100,000,000	Rural Electrification Corp Ltd 9.06% 23/9/2017	32,125,594	0.35
INR 800,000,000	Steel Authority of India Ltd 9% 14/10/2024	12,537,123	0.14
USD 300,000	Videocon Industries Ltd 6.75% 16/12/2015	256,875	0.00
		255,258,415	2.81

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	インドネシア		
USD 1,130,000	Berau Coal Energy Tbk PT 7.25% 13/3/2017	610,200	0.01
EUR 1,700,000	Indonesia Government International Bond 3.375% 30/7/2025	1,818,399	0.02
USD 2,180,000	Indonesia Government International Bond 4.125% 15/1/2025*	2,100,975	0.02
USD 4,956,000	Indonesia Government International Bond '144A' 5.375% 17/10/2023	5,216,190	0.06
USD 849,000	Indonesia Government International Bond '144A' 5.875% 15/1/2024	921,165	0.01
USD 4,319,000	Indonesia Government International Bond '144A' 6.625% 17/2/2037*	4,723,906	0.05
IDR 50,869,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/3/2024	3,547,072	0.04
IDR 160,634,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/3/2034	10,785,344	0.12
USD 1,500,000	Pelabuhan Indonesia II PT 4.25% 5/5/2025	1,341,450	0.02
USD 400,000	Pelabuhan Indonesia II PT 5.375% 5/5/2045	328,500	0.00
USD 1,000,000	Pertamina Persero PT 6.45% 30/5/2044	930,000	0.01
USD 7,961,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III '144A' 4.325% 28/5/2025*	7,572,901	0.08
USD 630,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.325% 28/5/2025	599,288	0.01
		40,495,390	0.45
	アイルランド		
EUR 1,500,000	Allied Irish Banks Plc 2.75% 16/4/2019	1,750,216	0.02
EUR 1,320,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 4.25% 15/1/2022	1,496,551	0.02
EUR 1,530,382	Atlantes Mortgage Plc FRN 20/8/2061	1,484,085	0.02
EUR 150,000	Avoca Clo XIV Ltd '14X E' FRN 12/7/2028	158,821	0.00
EUR 150,000	Avoca Clo XIV Ltd '14X F' FRN 12/7/2028	148,358	0.00
EUR 550,000	Avoca Clo XIV Ltd '14X SUB' 12/7/2028 (Zero Coupon)	549,233	0.01
EUR 5,987,000	Bank of Ireland FRN 18/6/2020 (Perpetual)*	6,892,430	0.07
EUR 10,800,000	Bank of Ireland FRN 11/6/2024	12,442,713	0.14
EUR 4,875,000	Bank of Ireland 1.25% 9/4/2020	5,433,161	0.06
EUR 2,000,000	Bank of Ireland 3.25% 15/1/2019	2,394,969	0.03
EUR 195,368	Deco 7-Pan Europe 2 Plc '7-E2X B' FRN 27/1/2018	218,605	0.00
EUR 987,158	Deco 7-Pan Europe 2 Plc '7-E2X C' FRN 27/1/2018	1,084,516	0.01
EUR 1,493,301	German Residential Funding Ltd '2013-1 D' FRN 27/8/2024	1,739,700	0.02
EUR 1,094,992	German Residential Funding Ltd '2013-2 E' FRN 27/11/2024	1,274,574	0.01
EUR 730,000	Harvest Clo XI Ltd FRN 26/3/2029	790,397	0.01
EUR 2,701,613	Magellan Mortgages No4 Plc FRN 20/7/2059	2,610,635	0.03
EUR 89,446	Talisman-6 Finance Plc FRN 22/10/2016	99,267	0.00
		40,568,231	0.45

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	イタリア		
EUR 1,384,848	Asset Backed European Securitisation Transaction Nine Srl FRN 10/12/2028	1,556,341	0.02
EUR 3,974,237	Asset Backed European Securitisation Transaction Ten Srl 0.552% 10/12/2028	4,473,628	0.05
EUR 8,950,000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2.875% 16/4/2021*	11,224,159	0.12
EUR 4,740,000	Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC 3.375% 22/10/2018	5,862,519	0.06
EUR 10,650,000	Banco Popolare SC 2.75% 27/7/2020	11,947,473	0.13
EUR 2,000,000	Banco Popolare SC 3.5% 14/3/2019	2,316,123	0.03
EUR 154,136	Berica PMI SRL 1 FRN 31/5/2057	175,130	0.00
EUR 400,000	Enel SpA FRN 10/1/2074	492,396	0.01
EUR 3,270,000	Enel SpA FRN 15/1/2075	3,909,511	0.04
EUR 2,486,165	Fondi Immobili Pubblici Funding SRL FRN 10/1/2023	2,742,642	0.03
EUR 1,300,000	Intesa Sanpaolo SpA 2.855% 23/4/2025*	1,384,102	0.02
EUR 500,000	Intesa Sanpaolo SpA 3.5% 17/1/2022	617,000	0.01
EUR 600,000	Intesa Sanpaolo SpA 3.928% 15/9/2026	684,176	0.01
EUR 6,100,000	Intesa Sanpaolo SpA 6.625% 13/9/2023	8,371,733	0.09
EUR 8,380,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.7% 15/9/2018	10,012,222	0.11
EUR 16,455,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.1% 15/9/2021*	21,917,680	0.24
EUR 15,100,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.15% 12/11/2017*	17,603,306	0.19
EUR 7,295,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.25% 22/4/2017*	8,449,458	0.09
EUR 37,729,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.35% 15/9/2019	50,952,864	0.56
EUR 33,245,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.45% 26/3/2016	37,822,853	0.42
EUR 71,368,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.55% 22/10/2016*	82,290,141	0.91
EUR 6,296,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.1% 15/9/2026	9,058,792	0.10
EUR 26,371,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.75% 1/6/2017	31,974,346	0.35
EUR 700,000	Mediobanca SpA 2.25% 18/3/2019	809,533	0.01
EUR 922,982	Taurus 2015-1 IT Srl '2015-IT1 A' FRN 18/2/2027	1,041,243	0.01
EUR 1,100,000	Telecom Italia SpA 3.25% 16/1/2023	1,240,294	0.01
EUR 1,100,000	UniCredit SpA 3.25% 14/1/2021	1,332,159	0.02
EUR 7,115,000	UniCredit SpA 6.95% 31/10/2022	9,391,344	0.10
EUR 700,000	Unione di Banche Italiane SCpA 2.875% 18/2/2019	825,757	0.01
		340,478,925	3.75
	日本		
JPY 40,000,000	Chugoku Electric Power Co Inc/The 23/3/2018 (Zero Coupon)	354,520	0.00
JPY 20,000,000	Chugoku Electric Power Co Inc/The 25/3/2020 (Zero Coupon)	182,771	0.00
JPY 80,000,000	CYBERDYNE Inc 12/12/2017 (Zero Coupon)	708,301	0.01
USD 1,450,000	Fukoku Mutual Life Insurance Co FRN 28/7/2025 (Perpetual)	1,450,000	0.02
JPY 10,033,000,000	Japan Government Twenty Year Bond 1.5% 20/6/2034	88,872,819	0.98
JPY 20,000,000	LIXIL Group Corp 4/3/2020 (Zero Coupon)	164,589	0.00

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	日本(続き)		
JPY 20,000,000	LIXIL Group Corp 4/3/2022 (Zero Coupon)	162,525	0.00
JPY 14,000,000	Maruzen Showa Unyu Co Ltd 29/3/2019 (Zero Coupon)	126,264	0.00
USD 900,000	Mitsui OSK Lines Ltd 24/4/2020 (Zero Coupon)	802,350	0.01
JPY 20,000,000	Mitsumi Electric Co Ltd 3/8/2022 (Zero Coupon)	168,014	0.00
JPY 180,000,000	Nagoya Railroad Co Ltd 11/12/2024 (Zero Coupon)	1,595,534	0.02
USD 940,000	Nippon Life Insurance Co FRN 16/10/2044	975,250	0.01
USD 2,230,000	ORIX Corp 2.95% 23/7/2020	2,247,082	0.02
JPY 60,000,000	Park24 Co Ltd 26/4/2018 (Zero Coupon)	530,606	0.01
USD 100,000	Shizuoka Bank Ltd/The 25/4/2018 (Zero Coupon)	101,731	0.00
EUR 399,000	SoftBank Group Corp 4.75% 30/7/2025	451,105	0.01
USD 500,000	Yamaguchi Financial Group Inc 20/12/2018 (Zero Coupon)	606,341	0.01
		99,499,802	1.10
	ジャージー		
GBP 1,400,000	AA Bond Co Ltd 5.5% 31/7/2022	2,145,081	0.02
GBP 350,000	CPUK Finance Ltd 7% 28/8/2020	543,072	0.01
		2,688,153	0.03
	ルクセンブルグ		
USD 10,410,000	Actavis Funding SCS 3% 12/3/2020	10,345,791	0.11
USD 585,000	Aguila 3 SA '144A' 7.875% 31/1/2018	597,431	0.01
EUR 800,000	Altice Financing SA 5.25% 15/2/2023	912,001	0.01
EUR 1,230,000	Altice Luxembourg SA 6.25% 15/2/2025	1,303,771	0.01
EUR 2,000,000	Altice Luxembourg SA 7.25% 15/5/2022	2,261,493	0.02
USD 945,000	Altice Luxembourg SA '144A' 7.625% 15/2/2025	902,569	0.01
GBP 5,600,000	AYR Issuer SA FRN 10/8/2019	8,618,956	0.10
EUR 180,000	Bilbao Luxembourg SA 10.688% 1/12/2018	213,792	0.00
EUR 800,000	Cirsa Funding Luxembourg SA 5.875% 15/5/2023*	802,543	0.01
EUR 995,000	CNH Industrial Finance Europe SA 2.75% 18/3/2019	1,112,582	0.01
EUR 2,972,000	DH Europe Finance SA 1.7% 4/1/2022	3,381,240	0.04
EUR 1,520,000	DH Europe Finance SA 2.5% 8/7/2025	1,763,864	0.02
EUR 1,961,000	European Financial Stability Facility 1.2% 17/2/2045	1,978,036	0.03
EUR 3,500,000	Harman Finance International SCA 2% 27/5/2022	3,863,248	0.04
EUR 800,000	INEOS Group Holdings SA 5.75% 15/2/2019*	905,824	0.01
USD 945,000	Intelsat Jackson Holdings SA 5.5% 1/8/2023	838,687	0.01
USD 1,693,000	Intelsat Jackson Holdings SA 7.25% 15/10/2020	1,635,861	0.02
EUR 800,000	JH-Holding Finance SA 8.25% 1/12/2022	935,246	0.01
EUR 250,000	LSF9 Balta Issuer SA 7.75% 15/9/2022	281,763	0.00
EUR 850,000	Matterhorn Telecom SA 3.875% 1/5/2022	880,597	0.01
EUR 408,000	Monitchem HoldCo 3 SA 5.25% 15/6/2021	453,664	0.01
EUR 600,000	Play Finance 2 SA 5.25% 1/2/2019	691,582	0.01
USD 100,000	Telecom Italia Capital SA 6% 30/9/2034	98,250	0.00
USD 100,000	Telecom Italia Capital SA 6.375% 15/11/2033	102,233	0.00
EUR 500,000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/1/2033	749,705	0.01
EUR 729,000	Telenet Finance V Luxembourg SCA 6.75% 15/8/2024	898,602	0.01
EUR 2,409,000	Telenet Finance VI Luxembourg SCA 4.875% 15/7/2027	2,590,686	0.03

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
ルクセンブルグ(続き)			
EUR 274,000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc 6.375% 1/5/2022	310,000	0.00
EUR 2,700,000	Wind Acquisition Finance SA 4% 15/7/2020	3,081,794	0.03
		52,511,811	0.58
マレーシア			
USD 2,200,000	1MDB Energy Ltd 5.99% 11/5/2022	2,541,176	0.03
USD 6,500,000	1MDB Global Investments Ltd 4.4% 9/3/2023	5,188,722	0.06
USD 1,000,000	Cahaya Capital Ltd 18/9/2021 (Zero Coupon)	916,250	0.01
		8,646,148	0.10
メキシコ			
EUR 2,000,000	Cemex SAB de CV 4.375% 5/3/2023	2,145,224	0.02
EUR 450,000	Cemex SAB de CV 4.75% 11/1/2022	503,413	0.00
MXN 443,440,000	Mexican Bonos 4.75% 14/6/2018	26,241,631	0.29
MXN 103,700,000	Mexican Bonos 5% 11/12/2019	6,077,778	0.07
MXN 260,000,000	Mexican Bonos 8% 7/12/2023	17,439,719	0.19
USD 1,546,000	Mexico Government International Bond 4% 2/10/2023	1,567,267	0.02
USD 5,858,000	Mexico Government International Bond 4.75% 8/3/2044*	5,500,741	0.06
USD 2,358,000	Mexico Government International Bond 5.55% 21/1/2045*	2,473,858	0.03
USD 696,000	Mexico Government International Bond 6.05% 11/1/2040*	784,740	0.01
USD 2,500,000	Minera y Metalurgica del Boleo SA de CV 2.875% 7/5/2019	2,525,907	0.03
		65,260,278	0.72
モンゴル			
USD 1,500,000	Development Bank of Mongolia LLC 5.75% 21/3/2017	1,419,375	0.02
CNH 5,000,000	Mongolia Government International Bond 7.5% 30/6/2018	719,551	0.01
USD 2,980,000	Trade & Development Bank of Mongolia LLC 9.375% 19/5/2020	2,932,582	0.03
		5,071,508	0.06
オランダ			
EUR 4,925,000	ABN AMRO Bank NV FRN 30/6/2025	5,642,276	0.06
EUR 200,000	Achmea BV FRN 4/4/2043	252,185	0.00
USD 650,000	AE-Rotor Holding BV 4.969% 28/3/2018	670,475	0.01
EUR 450,000	Constellium NV 4.625% 15/5/2021*	433,731	0.00
USD 1,006,000	Constellium NV '144A' 8% 15/1/2023	895,340	0.01
USD 2,994,000	Cooperatieve Centrale Raiffeisen- Boerenleenbank BA/Netherlands 4.375% 4/8/2025	3,001,927	0.03
EUR 3,189,000	E.ON International Finance BV 5.25% 8/9/2015	3,584,710	0.04
EUR 360,000	Euro-Galaxy IV CLO '2015-4X D' FRN 30/7/2028	399,882	0.00
EUR 515,000	Euro-Galaxy IV CLO '2015-4X E' FRN 30/7/2028	553,161	0.01
EUR 300,000	Euro-Galaxy IV CLO '2015-4X F' FRN 30/7/2028	322,294	0.00
EUR 400,000	Gas Natural Fenosa Finance BV FRN 18/11/2022 (Perpetual)	448,974	0.01
EUR 5,500,000	Gas Natural Fenosa Finance BV (Restricted) FRN 24/4/2024 (Perpetual)	5,641,832	0.06
EUR 2,000,000	Generali Finance BV FRN 21/11/2025 (Perpetual)	2,211,411	0.02
USD 2,500,000	Greenko Dutch BV 8% 1/8/2019	2,515,000	0.03

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ(続き)			
USD 250,000	Jababeka International BV 7.5% 24/9/2019	240,004	0.00
EUR 1,200,000	LGE HoldCo VI BV 7.125% 15/5/2024	1,472,792	0.02
EUR 1,900,000	North Westerly CLO IV 2013 BV 'IV-X A-1' FRN 15/1/2026	2,138,703	0.02
EUR 1,471,000	North Westerly CLO IV 2013 BV 'IV-X D' FRN 15/1/2026	1,664,908	0.02
USD 1,178,000	NXP Semiconductors NV '144A' 1% 1/12/2019	1,305,371	0.01
EUR 800,000	PortAventura Entertainment Barcelona BV 7.25% 1/12/2020	929,971	0.01
USD 1,500,000	Royal Capital B.V. FRN 5/5/2019 (Perpetual)	1,529,348	0.02
EUR 400,000	Samvardhana Motherson Automotive Systems Group BV 4.125% 15/7/2021	447,015	0.00
EUR 700,000	Schaeffler Finance BV 3.25% 15/5/2025	746,319	0.01
EUR 400,000	Schaeffler Holding Finance BV 5.75% 15/11/2021	484,600	0.01
EUR 926,856	Storm BV '2013-4 A1' FRN 22/10/2053	1,041,772	0.01
EUR 1,300,000	Telefonica Europe BV FRN 4/12/2019 (Perpetual)	1,489,106	0.02
EUR 400,000	Telefonica Europe BV FRN 31/3/2020 (Perpetual)	470,197	0.01
EUR 5,000,000	Unilever NV 3.375% 29/9/2015*	5,629,331	0.06
EUR 400,000	United Group BV 7.875% 15/11/2020	474,533	0.01
EUR 3,530,000	Volkswagen International Finance NV FRN 20/3/2030 (Perpetual)	3,632,548	0.04
EUR 1,500,000	Ziggo Bond Finance BV 4.625% 15/1/2025	1,608,648	0.02
		51,878,364	0.57
ニュージーランド			
NZD 4,931,000	New Zealand Government Bond 2.51% 20/9/2035	3,301,271	0.04
NZD 5,570,000	New Zealand Government Bond 3% 20/9/2030	4,047,537	0.04
		7,348,808	0.08
ノルウェー			
USD 2,500,000	Eksporthfinans ASA 2.375% 25/5/2016	2,503,125	0.03
EUR 400,000	Silk Bidco AS 7.5% 1/2/2022	463,862	0.00
		2,966,987	0.03
ポルトガル			
EUR 725,328	Atlantes Ltd / Atlantes Finance Plc FRN 20/3/2033	819,156	0.01
EUR 3,600,000	Novo Banco SA 2.625% 8/5/2017	3,930,868	0.04
EUR 3,000,000	Novo Banco SA 4% 21/1/2019	3,375,408	0.04
EUR 800,000	Novo Banco SA 4.75% 15/1/2018	914,288	0.01
EUR 21,166,667	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 3.85% 15/4/2021*	26,592,493	0.29
EUR 11,515,000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 3.875% 15/2/2030	14,191,637	0.16
EUR 50,777,000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 4.1% 15/2/2045*	62,653,575	0.69
EUR 1,796,025	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta Electricity Receivables 4.172% 16/2/2017	2,052,514	0.02
EUR 3,857,211	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta II Electricity Receivables 2.98% 16/2/2018	4,353,712	0.05
		118,883,651	1.31

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
ロシア連邦			
RUB 608,240,000	Russian Federal Bond - OFZ 7% 16/8/2023	6,976,875	0.08
RUB 114,035,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.6% 20/7/2022	1,391,921	0.01
USD 3,600,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.875% 16/9/2023	3,444,750	0.04
USD 3,200,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 5.625% 4/4/2042	2,928,000	0.03
		14,741,546	0.16
シンガポール			
USD 2,350,000	Berau Capital Resources Pte Ltd (Defaulted) 12.5% 8/7/2015	1,269,000	0.01
USD 300,000	Olam International Ltd 6% 15/10/2016	308,625	0.00
SGD 1,900,000	OSIM International Ltd 18/9/2019 (Zero Coupon)	1,282,619	0.02
USD 2,220,000	Pratama Agung Pte Ltd 6.25% 24/2/2020*	2,109,000	0.02
USD 1,500,000	United Overseas Bank Ltd FRN 19/9/2024*	1,536,247	0.02
USD 250,000	Yanlord Land Group Ltd 10.625% 29/3/2018*	260,625	0.00
		6,766,116	0.07
スロベニア			
EUR 30,969,000	Slovenia Government Bond 2.125% 28/7/2025*	35,148,171	0.39
EUR 4,620,000	Slovenia Government Bond 2.25% 25/3/2022	5,473,326	0.06
EUR 4,545,000	Slovenia Government Bond 4.625% 9/9/2024*	6,279,622	0.07
EUR 4,885,000	Slovenia Government Bond 5.125% 30/3/2026*	7,079,642	0.08
USD 8,008,000	Slovenia Government International Bond 4.125% 18/2/2019	8,468,460	0.09
USD 3,747,000	Slovenia Government International Bond '144A' 4.125% 18/2/2019	3,962,453	0.04
USD 6,608,000	Slovenia Government International Bond '144A' 5.25% 18/2/2024*	7,318,360	0.08
USD 21,795,000	Slovenia Government International Bond 5.25% 18/2/2024	24,107,994	0.27
USD 9,538,000	Slovenia Government International Bond 5.5% 26/10/2022	10,754,095	0.12
USD 6,581,000	Slovenia Government International Bond '144A' 5.5% 26/10/2022	7,403,625	0.08
USD 16,945,000	Slovenia Government International Bond 5.85% 10/5/2023	19,380,844	0.21
		135,376,592	1.49
韓国			
USD 600,000	Hyundai Heavy Industries Co Ltd 29/6/2020 (Zero Coupon)	599,250	0.01
USD 240,000	Woori Bank FRN 10/6/2045	238,783	0.00
USD 2,700,000	Woori Bank 4.75% 30/4/2024	2,792,854	0.03
		3,630,887	0.04
スペイン			
EUR 1,500,000	Abengoa Finance SAU 6% 31/3/2021	1,061,380	0.01
EUR 400,000	Abengoa Finance SAU 7% 15/4/2020*	289,493	0.00
EUR 800,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 19/2/2019 (Perpetual)	914,247	0.01
EUR 1,800,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 18/2/2020 (Perpetual)	2,033,261	0.02
EUR 700,000	Banco Popular Espanol SA FRN 10/10/2018 (Perpetual)	879,758	0.01
EUR 800,000	Banco Popular Espanol SA FRN 10/4/2020 (Perpetual)	895,630	0.01
EUR 4,700,000	Banco Popular Espanol SA 2.125% 8/10/2019	5,643,537	0.06

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
スペイン(続き)			
EUR 1,200,000	Banco Santander SA FRN 12/3/2019 (Perpetual)	1,341,046	0.01
EUR 12,700,000	Bankia SA FRN 22/5/2024	14,104,296	0.16
EUR 15,700,000	Bankia SA 1% 25/9/2025	16,820,001	0.19
EUR 16,900,000	Bankia SA 1.125% 5/8/2022	19,248,113	0.21
EUR 6,800,000	Bankia SA 3.5% 17/1/2019	7,986,057	0.09
EUR 7,900,000	BPE Financiaciones SA 2% 3/2/2020	8,853,882	0.10
EUR 300,000	CaixaBank SA FRN 14/11/2023	356,213	0.00
EUR 3,300,000	Cajas Rurales Unidas SCC 1.25% 26/1/2022	3,767,792	0.04
EUR 6,900,000	Ibercaja Banco SA FRN 28/7/2025	7,592,441	0.08
EUR 1,500,000	Obrascon Huarte Lain SA 5.5% 15/3/2023*	1,420,262	0.02
EUR 3,900,000	Programa Cédulas TDA Fondo de Titulización de Activos 4.25% 10/4/2031*	5,442,408	0.06
EUR 600,000	Santander Issuances SAU 2.5% 18/3/2025	635,433	0.01
EUR 7,088,000	Spain Government Bond 2.1% 30/4/2017	8,220,607	0.09
EUR 4,908,000	Spain Government Bond '144A' 4.1% 30/7/2018	6,093,663	0.07
		113,599,520	1.25
スリランカ			
USD 1,700,000	Sri Lanka Government International Bond 6.25% 4/10/2020	1,727,489	0.02
USD 630,000	Sri Lanka Government International Bond 6.25% 27/7/2021*	637,144	0.01
USD 1,000,000	SriLankan Airlines Ltd 5.3% 27/6/2019	973,800	0.01
		3,338,433	0.04
スウェーデン			
SEK 10,585,765	Bluestep Mortgage Securities No2 Ltd FRN 10/11/2055	1,248,973	0.01
USD 400,000	Swedbank AB FRN 17/3/2020 (Perpetual)	401,000	0.01
EUR 200,000	Volvo Treasury AB FRN 10/6/2075	226,029	0.00
		1,876,002	0.02
スイス			
EUR 6,650,000	Credit Suisse AG FRN 18/9/2025	8,415,889	0.09
USD 3,620,000	Credit Suisse AG 6.5% 8/8/2023	3,965,419	0.04
EUR 5,000,000	Credit Suisse AG/Guernsey 2.875% 24/9/2015	5,625,456	0.06
USD 1,000,000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 18/12/2024 (Perpetual)	963,775	0.01
USD 400,000	UBS AG FRN 22/5/2023	409,158	0.01
EUR 6,000,000	UBS AG FRN 12/2/2026	7,252,159	0.08
EUR 7,825,000	UBS Group AG FRN 19/2/2022 (Perpetual)*	9,101,292	0.10
USD 400,000	UBS Group AG FRN 19/2/2025 (Perpetual)	414,351	0.01
USD 2,995,000	UBS Group AG FRN 7/8/2025 (Perpetual)	2,981,747	0.03
		39,129,246	0.43
台湾			
USD 1,200,000	Advanced Semiconductor Engineering Inc 27/3/2018 (Zero Coupon)	1,122,000	0.01
USD 1,000,000	Neo Solar Power Corp 18/7/2017 (Zero Coupon)	891,120	0.01
		2,013,120	0.02

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
タイ			
THB 79,000,000	Bangkok Dusit Medical Services PCL 18/9/2019 (Zero Coupon)	2,285,204	0.03
トルコ			
USD 2,060,000	Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust '144A' 4.2% 15/3/2027	2,054,592	0.02
アラブ首長国連邦			
USD 3,050,000	National Bank of Abu Dhabi PJSC FRN 17/6/2020 (Perpetual)	3,104,900	0.03
英国			
GBP 630,000	Annington Finance No 5 Plc 13% 15/1/2023	1,137,447	0.01
GBP 1,094,814	Auburn Securities 5 Plc FRN 1/12/2041	1,654,564	0.02
GBP 173,464	Bakkavor Finance 2 Plc 8.25% 15/2/2018	278,389	0.00
USD 1,998,000	Barclays Bank Plc 7.625% 21/11/2022	2,281,466	0.03
GBP 1,050,000	Barclays Plc FRN 15/9/2022 (Perpetual)*	1,620,937	0.02
GBP 600,000	Boparan Finance Plc 5.5% 15/7/2021	848,260	0.01
GBP 584,229	Brass No 3 Plc FRN 16/4/2051	906,471	0.01
GBP 1,000,000	Canary Wharf Finance II Plc 'C2' FRN 22/10/2037	1,475,224	0.02
GBP 4,392,000	Canary Wharf Finance II Plc 'D2' FRN 22/10/2037	6,596,595	0.07
GBP 400,000	Centrica Plc FRN 10/4/2075	606,084	0.01
EUR 800,000	Centrica Plc FRN 10/4/2076	872,403	0.01
GBP 3,110,000	Centrica Plc 4.375% 13/3/2029	5,047,667	0.06
GBP 950,000	Cognita Financing Plc 7.75% 15/8/2021	1,489,384	0.02
GBP 200,000	Coventry Building Society FRN 1/11/2019 (Perpetual)	297,105	0.00
GBP 400,000	Debenhams Plc 5.25% 15/7/2021	609,844	0.01
GBP 1,430,000	E-CARAT 5 Plc 'B' FRN 18/4/2023	2,204,958	0.02
GBP 10,240,000	Enterprise Inns Plc 6% 6/10/2023*	15,571,153	0.17
GBP 390,000	Enterprise Inns Plc 6.875% 15/2/2021	632,006	0.01
EUR 500,000	Ephios Bondco Plc 6.25% 1/7/2022*	571,904	0.01
EUR 800,000	Ephios Bondco Plc 6.25% 1/7/2022	915,047	0.01
EUR 275,000	Ephios Holdco II Plc 8.25% 1/7/2023	312,748	0.00
GBP 2,485,000	Eurosail-UK 2007-4bl Plc '2007-4X A3' FRN 13/6/2045	3,674,909	0.04
GBP 282,116	Gemgarto Plc '2015-1 X1' FRN 16/2/2047	432,801	0.00
GBP 2,602,136	Gosforth Funding 2014-1 Plc '2014-1 A1' FRN 19/10/2056	4,006,421	0.04
EUR 680,000	Granite Master Issuer Plc '2007-1 3C1' FRN 20/12/2054	759,038	0.01
GBP 782,890	Granite Mortgages 03-2 Plc FRN 20/7/2043	1,205,013	0.01
GBP 11,050,527	Greene King Finance Plc FRN 15/12/2033	17,093,282	0.19
GBP 855,000	House of Fraser Funding Plc FRN 15/9/2020	1,304,693	0.01
EUR 4,700,000	HSBC Holdings Plc 3% 30/6/2025	5,326,068	0.06
GBP 562,000	IDH Finance Plc 6% 1/12/2018	880,569	0.01
EUR 295,000	International Game Technology Plc 4.75% 15/2/2023	316,470	0.00
GBP 200,000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 5% 15/2/2022	308,949	0.00

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
EUR 3,151,625	Kensington Mortgage Securities Plc '2007-1X A3B' FRN 14/6/2040	3,423,156	0.04
EUR 1,000,000	Lloyds Banking Group Plc FRN 27/6/2020 (Perpetual)	1,177,363	0.01
GBP 6,300,000	Logistics UK 2015 Plc '2015-1X A' FRN 20/8/2025	9,720,773	0.11
GBP 5,025,000	Logistics UK 2015 Plc '2015-1X E' FRN 20/8/2025	7,776,610	0.09
EUR 1,050,000	Ludgate Funding Plc '2007-1 BB' FRN 1/1/2061	944,562	0.01
EUR 900,000	Ludgate Funding Plc '2007-1 MB' FRN 1/1/2061	841,298	0.01
GBP 2,000,000	Mitchells & Butlers Finance Plc FRN 15/6/2036	2,802,858	0.03
GBP 362,658	Morpheus European Loan Conduit No 19 Plc FRN 1/11/2029	548,538	0.01
GBP 3,400,000	Nationwide Building Society FRN 20/6/2019 (Perpetual)	5,229,863	0.06
GBP 143,428	Nemus II Arden Plc '2006-2 C' FRN 15/2/2020	204,124	0.00
GBP 1,000,000	New Look Secured Issuer Plc 6.5% 1/7/2022	1,491,362	0.02
GBP 5,540,000	Paragon Mortgages NO 23 Plc 'A2' FRN 15/1/2043	8,451,287	0.09
GBP 1,175,000	Paragon Mortgages NO 23 Plc 'C' FRN 15/1/2043	1,787,550	0.02
EUR 5,130,000	Paragon Mortgages Plc 0.676% 15/1/2043	5,643,195	0.06
GBP 200,000	Pension Insurance Corp Plc 6.5% 3/7/2024	311,106	0.00
GBP 1,742,877	Precise Mortgage Funding Plc '2014-1 A' FRN 12/9/2047	2,634,433	0.03
GBP 473,580	Punch Taverns Finance Plc FRN 15/7/2021	680,040	0.01
GBP 2,355,000	Punch Taverns Finance Plc '144A' FRN 15/10/2027	3,365,033	0.04
GBP 1,234,200	Punch Taverns Finance Plc 7.274% 15/10/2026	2,088,566	0.02
GBP 425,000	Punch Taverns Finance Plc '144A' 7.274% 15/10/2026	724,373	0.01
GBP 544,000	Punch Taverns Finance Plc '144A' 7.32% 15/10/2025	924,618	0.01
GBP 1,569,785	Punch Taverns Finance Plc 7.32% 15/10/2025	2,634,604	0.03
GBP 800,000	Rochester Financing No.1 Plc 2.018% 16/7/2046	1,223,333	0.01
USD 4,900,000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN 10/8/2020 (Perpetual)	4,980,850	0.05
EUR 2,900,000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN 25/3/2024*	3,349,714	0.04
USD 1,272,000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN 10/8/2025 (Perpetual)	1,302,210	0.01
GBP 500,000	Santander UK Group Holdings Plc FRN 24/6/2022 (Perpetual)	786,904	0.01
GBP 139,152	Silk Road Finance Number Three Plc '2012-1 A' FRN 21/6/2055	216,115	0.00
GBP 10,250,000	Silverstone Master Issuer Plc '2015-1X 1A' FRN 21/1/2070	15,766,313	0.17
EUR 8,740,000	Sky Plc 1.5% 15/9/2021	9,846,773	0.11
GBP 475,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2028	741,100	0.01
GBP 4,567,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2031	6,804,160	0.08
GBP 2,215,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2036	3,299,964	0.04
GBP 818,000	Spirit Issuer Plc 6.582% 28/12/2018	1,346,238	0.01
GBP 400,000	SSE Plc FRN 10/9/2020 (Perpetual)	592,834	0.01
GBP 895,000	Stonegate Pub Co Financing Plc FRN 15/4/2019*	1,390,339	0.02
GBP 735,000	Stonegate Pub Co Financing Plc 5.75% 15/4/2019*	1,137,610	0.01
EUR 609,000	Taurus 2015-2 DEU Ltd '2015-DE2 E' FRN 1/2/2026	673,399	0.01
EUR 2,661,440	Taurus 2015-2 DEU Ltd '2015-DE2 A' 0.877% 1/2/2026	2,994,527	0.03

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国(続き)			
EUR 926,000	Taurus 2015-2 DEU Ltd '2015-DE2 D' 2.177% 1/2/2026	1,041,226	0.01
EUR 674,215	Taurus Plc '2013-GMF1 D' FRN 21/5/2024	778,192	0.01
GBP 385,000	Temese Funding 1 Plc FRN 21/11/2021	594,533	0.01
GBP 297,863	Temese Funding 1 Plc 'A' FRN 21/11/2021	459,713	0.01
GBP 413,418	Tesco Property Finance 3 Plc 5.744% 13/4/2040	607,668	0.01
GBP 472,019	Triton European Loan Conduit No 26 Plc FRN 25/10/2019	674,289	0.01
GBP 1,642,601	Turbo Finance 4 Plc FRN 20/1/2021	2,533,979	0.03
GBP 5,101,860	Unique Pub Finance Co Plc/The 5.659% 30/6/2027	7,974,199	0.09
GBP 12,750,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.464% 30/3/2032	17,572,184	0.19
GBP 5,249,400	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.542% 30/3/2021	8,454,020	0.09
GBP 1,284,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28/3/2024	2,024,191	0.02
GBP 42,307,000	United Kingdom Gilt 3.5% 22/7/2068	85,543,303	0.94
USD 1,280,000	Vedanta Resources Plc 8.25% 7/6/2021	1,125,600	0.01
GBP 1,700,000	Virgin Media Secured Finance Plc 6.25% 28/3/2029	2,709,140	0.03
GBP 800,000	Vougeot Bidco Plc 7.875% 15/7/2020	1,318,093	0.01
GBP 200,000	Voyage Care Bondco Plc 6.5% 1/8/2018	318,565	0.00
GBP 9,167,000	WARWICK FINANCE RESIDENTIAL MORTGAGES NUMBER ONE Plc 'A' FRN 21/9/2049	14,140,891	0.16
GBP 4,795,000	Westfield Stratford City Finance Plc FRN 4/11/2019	7,418,894	0.08
		356,384,244	3.93
米国			
USD 2,180,000	1211 Avenue of the Americas Trust '2015-1211 A1A2' '144A' 3.901% 10/8/2035	2,242,969	0.02
USD 11,128,000	AbbVie Inc 2.5% 14/5/2020	11,020,648	0.12
USD 2,870,000	AbbVie Inc 4.5% 14/5/2035	2,773,455	0.03
USD 705,000	ACAS CLO 2014-1 Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 18/7/2026	691,868	0.01
USD 340,000	ACAS CLO 2014-2 Ltd '2014-2A C' '144A' FRN 15/1/2027	337,512	0.00
USD 400,000	ACAS CLO 2015-1 Ltd '2015-1A A1' '144A' FRN 18/4/2027	399,131	0.00
USD 1,000,000	ACAS CLO 2015-1 Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 18/4/2027	956,318	0.01
USD 9,620,000	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series '2006- CW1 A2D' FRN 25/7/2036	5,403,920	0.06
USD 1,000,000	Adirondack Park CLO Ltd 2013-1A '2013-1A D' '144A' FRN 15/4/2024	979,970	0.01
USD 2,980,028	Adjustable Rate Mortgage Trust '2005-12 4A1' FRN 25/3/2036	2,236,085	0.02
USD 910,000	ADT Corp/The 4.875% 15/7/2042	705,250	0.01
USD 2,625,000	Alachua County Health Facilities Authority 5% 1/12/2044	2,794,732	0.03
USD 2,300,000	Ally Financial Inc 3.5% 27/1/2019	2,302,875	0.03
USD 2,180,000	Ally Financial Inc 8% 1/11/2031	2,591,475	0.03
USD 250,000	ALM V Ltd '2012-5A DR' '144A' FRN 18/10/2027	250,263	0.00
USD 310,000	ALM VI Ltd '2012-6A A2R' '144A' FRN 15/7/2026	309,900	0.00
USD 2,685,000	ALM VI Ltd '2012-6A CR' '144A' FRN 15/7/2026	2,656,376	0.03
USD 3,225,000	ALM VI Ltd '2012-6A DR' '144A' FRN 15/7/2026	3,202,892	0.04
USD 3,750,000	ALM VII Ltd '2012-7A A1' '144A' FRN 19/10/2024	3,745,243	0.04
USD 1,495,000	ALM VII Ltd '2012-7A C' '144A' FRN 19/10/2024	1,498,805	0.02

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 780,000	ALM VII Ltd '2012-7A D' '144A' FRN 19/10/2024	758,174	0.01
USD 1,343,000	ALM VII R Ltd '2013-7RA A2' '144A' FRN 24/4/2024	1,329,640	0.01
USD 970,000	ALM VII R Ltd '2013-7RA D' '144A' FRN 24/4/2024	950,937	0.01
USD 2,900,000	ALM VII R-2 Ltd '2013-7R2A A2' '144A' FRN 24/4/2024	2,884,002	0.03
USD 625,000	ALM VII R-2 Ltd '2013-7R2A C' '144A' FRN 24/4/2024	618,220	0.01
USD 385,000	ALM VIII Ltd '2013-8A B' '144A' FRN 20/1/2026	379,912	0.00
USD 700,000	ALM VIII Ltd '2013-8A C' '144A' FRN 20/1/2026	667,088	0.01
USD 900,000	ALM VIII Ltd '2013-8A D' '144A' FRN 20/1/2026	801,281	0.01
USD 400,000	ALM X Ltd '2013-10A B' '144A' FRN 15/1/2025	388,181	0.00
USD 1,000,000	ALM XI Ltd '2014-11A A2A' '144A' FRN 17/10/2026	993,099	0.01
USD 655,000	ALM XI Ltd '2014-11A C' '144A' FRN 17/10/2026	637,619	0.01
USD 433,000	ALM XII Ltd '2015-12A B' '144A' FRN 16/4/2027	429,337	0.00
USD 260,000	ALM XII Ltd '2015-12A C1' '144A' FRN 16/4/2027	255,191	0.00
USD 425,000	ALM XIV Ltd '2014-14A A1' '144A' FRN 28/7/2026	422,555	0.00
USD 1,387,000	ALM XIV Ltd '2014-14A A2' '144A' FRN 28/7/2026	1,373,605	0.02
USD 380,000	ALM XIV Ltd '2014-14A B' '144A' FRN 28/7/2026	380,072	0.00
USD 1,485,000	ALM XIV Ltd '2014-14A C' '144A' FRN 28/7/2026	1,433,658	0.02
USD 620,000	ALM XIV Ltd '2014-14A D' '144A' FRN 28/7/2026	558,639	0.01
USD 2,493,584	Alternative Loan Trust '2005-38 A3' FRN 25/9/2035	2,179,564	0.02
USD 1,978,593	Alternative Loan Trust '2005-61 2A2' FRN 25/12/2035	1,550,123	0.02
USD 1,296,072	Alternative Loan Trust '2005-72 A3' FRN 25/1/2036	1,066,532	0.01
USD 6,879,334	Alternative Loan Trust '2006-0A3 1A1' FRN 25/5/2036	5,704,722	0.06
USD 1,194,730	Alternative Loan Trust '2006-0A3 2A1' FRN 25/5/2036	969,759	0.01
USD 3,178,269	Alternative Loan Trust '2006-23CB 2A5' FRN 25/8/2036	1,608,576	0.02
USD 1,961,968	Alternative Loan Trust '2006-J7 2A1' FRN 20/11/2036	1,450,756	0.02
USD 4,595,560	Alternative Loan Trust '2006-0A6 1A2' FRN 25/7/2046	4,028,634	0.04
USD 1,411,770	Alternative Loan Trust '2006-0A11 A4' FRN 25/9/2046	1,180,213	0.01
USD 1,650,000	Alternative Loan Trust '2006-0A16 A1D' FRN 25/10/2046	1,310,341	0.01
USD 6,466,216	Alternative Loan Trust '2006-0A14 1A1' FRN 25/11/2046	5,510,865	0.06
USD 2,292,316	Alternative Loan Trust '2007-0A3 1A1' FRN 25/4/2047	1,935,684	0.02
USD 14,884,894	Alternative Loan Trust '2007-0H3 A1A' FRN 25/9/2047	12,809,598	0.14
USD 2,929,339	Alternative Loan Trust '2005-80CB 4A1' 6% 25/2/2036	2,499,992	0.03
USD 6,381,344	Alternative Loan Trust '2007-9T1 1A1' 6% 25/5/2037	5,448,264	0.06
USD 6,734,583	Alternative Loan Trust '2007-25 1A3' 6.5% 25/11/2037	5,727,486	0.06
USD 1,139,000	AMAC CDO Funding I '2006-1A C '144A' FRN 23/11/2050	1,090,282	0.01
USD 2,363,000	American Airlines Group Inc '144A' 4.625% 1/3/2020	2,333,462	0.03
USD 1,876,000	American Homes 4 Rent 2014-SFR2 Trust '2014-SFR2 E' '144A' 6.231% 17/10/2036	1,957,191	0.02
USD 710,000	American Money Management Corp '2015-16A C' '144A' FRN 14/4/2027	700,127	0.01
USD 280,000	American Money Management Corp '2015-16A D' '144A' FRN 14/4/2027	271,452	0.00
USD 4,790,000	Amgen Inc 2.125% 1/5/2020	4,687,025	0.05
USD 2,251,000	Amgen Inc 3.125% 1/5/2025	2,140,235	0.02
USD 2,263,000	Amgen Inc 4.4% 1/5/2045	2,127,338	0.02

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 380,000	AMMC CLO 15 Ltd '2014-15A C1' '144A' FRN 9/12/2026	381,229	0.00
USD 530,000	AMMC CLO 15 Ltd '2014-15A D' '144A' FRN 9/12/2026	528,035	0.01
USD 880,000	AMMC CLO IX Ltd '2011-9A D' '144A' FRN 15/1/2022	881,303	0.01
USD 2,375,000	Anchorage Capital CLO 3 Ltd '2014-3A B' '144A' FRN 28/4/2026	2,336,684	0.03
USD 548,969	Anchorage Capital CLO 3 Ltd '2014-3A C' '144A' FRN 28/4/2026	524,702	0.01
USD 680,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd '2015-6A B' '144A' FRN 15/4/2027	670,142	0.01
USD 590,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd '2015-6A D' '144A' FRN 15/4/2027	551,830	0.01
USD 500,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd '2015-6A E1' '144A' FRN 15/4/2027	439,791	0.00
USD 1,812,500	Anchorage Capital CLO 7 Ltd '2015-7 A C' '144A' FRN 8/8/2027	1,800,719	0.02
USD 1,625,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd '2015-7 A D' '144A' FRN 8/8/2027	1,551,713	0.02
USD 2,255,000	Apidos CLO IX '2012-9AR CR' '144A' FRN 15/7/2023	2,257,820	0.02
USD 1,235,000	Apidos CLO IX '2012-9AR DR' '144A' FRN 15/7/2023	1,230,085	0.01
USD 500,000	Apidos CLO IX '2012-9AR ER' '144A' FRN 15/7/2023	501,046	0.01
USD 500,000	Apidos CLO XIX '2014-19A D' '144A' FRN 17/10/2026	490,939	0.01
USD 800,000	Apidos CLO XIX '2014-19A E' '144A' FRN 17/10/2026	744,655	0.01
USD 475,000	Apidos CLO XVI '2013-16A C' '144A' FRN 19/1/2025	449,254	0.01
USD 675,000	Apidos CLO XVII '2014-17A A1A' '144A' FRN 17/4/2026	673,935	0.01
USD 1,650,000	Apidos CLO XVII '2014-17A B' '144A' FRN 17/4/2026	1,627,216	0.02
USD 670,000	Apidos CLO XVIII '2014-18A C' '144A' FRN 22/7/2026	655,590	0.01
USD 375,000	Apidos CLO XVIII '2014-18A D' '144A' FRN 22/7/2026	344,846	0.00
USD 250,000	Apidos CLO XX '2015-20A B' '144A' FRN 16/1/2027	250,270	0.00
USD 500,000	Apidos CLO XXI '2015-21A C' '144A' FRN 18/7/2027	481,228	0.01
USD 22,460,000	Apple Inc 2% 6/5/2020	22,360,940	0.25
GBP 4,605,000	Apple Inc 3.05% 31/7/2029	6,871,517	0.08
USD 1,000,000	ARC Properties Operating Partnership LP 2% 6/2/2017	978,750	0.01
USD 380,000	ARES CLO Ltd '2012-2A CR' '144A' FRN 12/10/2023	380,261	0.00
USD 750,000	ARES CLO Ltd '2012-2A DR' '144A' FRN 12/10/2023	744,640	0.01
USD 1,750,000	Ares XXIII CLO Ltd '2012-1A E' '144A' FRN 19/4/2023	1,758,112	0.02
USD 500,000	Ares XXIII CLO Ltd '2012-1AR CR' '144A' FRN 19/4/2023	501,346	0.01
USD 2,000,000	Ares XXIII CLO Ltd '2012-1AR DR' '144A' FRN 19/4/2023	2,004,840	0.02
USD 335,000	Ares XXV CLO Ltd '2012-3A D' '144A' FRN 17/1/2024	336,854	0.00
USD 275,000	Ares XXV CLO Ltd '2012-3X C' FRN 17/1/2024	273,192	0.00
USD 750,000	Ares XXV CLO Ltd '2012-3X D' FRN 17/1/2024	754,151	0.01
USD 2,000,000	Ares XXXII CLO Ltd '2014-32A A2' '144A' FRN 15/11/2025	2,004,971	0.02
USD 255,000	Ares XXXII CLO Ltd '2014-32A B' '144A' FRN 15/11/2025	255,178	0.00
USD 515,000	Ares XXXII CLO Ltd '2014-32A C' '144A' FRN 15/11/2025	513,701	0.01
USD 775,000	Ares XXXIII CLO Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 5/12/2025	773,932	0.01
USD 250,000	Ares XXXIII CLO Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 5/12/2025	240,723	0.00

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 1,378,468	Argent Mortgage Loan Trust '2005-W1 A2' FRN 25/5/2035	1,073,058	0.01
USD 1,879,500	Argentina Bonos 7% 3/10/2015*	1,880,492	0.02
USD 900,000	Arizona Health Facilities Authority 5% 1/1/2044	983,853	0.01
USD 900,000	Ashland Inc 3.875% 15/4/2018	922,500	0.01
USD 4,250,000	AT&T Inc 2.45% 30/6/2020	4,168,109	0.05
USD 10,845,000	AT&T Inc 3% 30/6/2022	10,447,270	0.12
USD 2,159,000	AT&T Inc 4.75% 15/5/2046	1,983,619	0.02
USD 300,000	Atlas Senior Loan Fund IV Ltd '2013-2A A3L' '144A' FRN 17/2/2026	292,583	0.00
USD 1,625,000	Atlas Senior Loan Fund Ltd '2012-1A B2L' '144A' FRN 15/8/2024	1,631,787	0.02
USD 375,000	Atlas Senior Loan Fund V Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 16/7/2026	368,989	0.00
USD 375,000	Atlas Senior Loan Fund V Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 16/7/2026	358,345	0.00
USD 1,290,000	Atrium CDO Corp '144A' FRN 23/10/2022	1,291,692	0.01
USD 2,500,000	Atrium IX '144A' FRN 28/2/2024	2,438,854	0.03
USD 1,540,000	Atrium VII '144A' FRN 16/11/2022	1,543,790	0.02
USD 644,000	Atrium X '10A A' '144A' FRN 16/7/2025	637,748	0.01
USD 500,000	Atrium X '10A D' '144A' FRN 16/7/2025	485,703	0.01
USD 945,000	Audatex North America Inc '144A' 6.125% 1/11/2023	941,456	0.01
USD 720,000	Avalon IV Capital Ltd 3.083% 17/4/2023	723,531	0.01
USD 10,610,000	AVANT Loans Funding Trust '2015-A A' '144A' 4% 16/8/2021	10,610,000	0.12
USD 2,178,670	Aventura Mall Trust '2013-AVM E' '144A' FRN 5/12/2032	2,146,197	0.02
USD 780,000	Aviation Capital Group Corp '144A' 7.125% 15/10/2020	904,800	0.01
USD 1,061,208	B2R Mortgage Trust '2015-1 A1' '144A' 2.524% 15/5/2048	1,053,078	0.01
USD 1,000,000	Babson CLO Ltd '2014-1A B' '144A' FRN 20/7/2025	980,141	0.01
USD 1,115,000	Babson CLO Ltd '2014-3A C1' '144A' FRN 15/1/2026	1,116,091	0.01
USD 515,000	Babson CLO Ltd '2014-3A D1' '144A' FRN 15/1/2026	489,384	0.01
USD 2,030,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2013-DSMZ M' '144A' FRN 15/9/2018	2,033,786	0.02
USD 2,993,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2015-ASHF F' '144A' FRN 15/1/2028	2,998,612	0.03
USD 2,925,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL1 D' '144A' FRN 15/12/2031	2,876,177	0.03
USD 3,150,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2015-200P F' '144A' FRN 14/4/2033	2,766,431	0.03
USD 661,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2007-1 AMFX' FRN 15/1/2049	686,711	0.01
USD 3,640,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2007-3 AJ' FRN 10/6/2049	3,758,922	0.04
USD 5,361,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2007-5 AM' FRN 10/2/2051	5,664,457	0.06

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,490,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2006-6 AJ' 5.421% 10/10/2045	2,542,073	0.03
USD 1,163,732	Banc of America Funding 2006-A Trust '2006-A 3A2' FRN 20/2/2036	950,679	0.01
USD 1,250,000	Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Inc '2004-4 F' '144A' FRN 10/7/2042	1,273,679	0.01
USD 501,927	Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Inc '2005-3 AM' 4.727% 10/7/2043	503,143	0.01
USD 64,445	Banc of America Re-REMIC Trust '2010-UB4 A4B' '144A' FRN 20/12/2041	62,885	0.00
USD 1,519,000	Bank of America Corp FRN 5/9/2024 (Perpetual)	1,507,607	0.02
USD 4,986,000	Bank of America Corp FRN 17/3/2025 (Perpetual)	4,904,977	0.05
USD 8,038,000	Bank of America Corp 2.25% 21/4/2020	7,909,754	0.09
USD 6,046,000	Bank of America Corp 3.875% 1/8/2025	6,112,503	0.07
USD 7,700,000	Bank of America Corp 3.95% 21/4/2025	7,465,966	0.08
USD 4,544,000	Bank of America Corp 4% 1/4/2024	4,663,373	0.05
USD 1,697,000	Bank of America Corp 4% 22/1/2025	1,665,787	0.02
USD 960,000	Battalion CLO VII Ltd '2014-7A A2' '144A' FRN 17/10/2026	961,679	0.01
USD 680,000	Battalion CLO VII Ltd '2014-7A B' '144A' FRN 17/10/2026	681,273	0.01
USD 1,220,000	Battalion CLO VII Ltd '2014-7A C' '144A' FRN 17/10/2026	1,188,879	0.01
USD 250,000	Battalion CLO VII Ltd '2014-7A D' '144A' FRN 17/10/2026	226,734	0.00
USD 250,000	Battalion CLO VIII Ltd '2015-8A C' '144A' FRN 18/4/2027	243,330	0.00
USD 690,000	Battalion CLO VIII Ltd '2015-8A D' '144A' FRN 18/4/2027	630,059	0.01
USD 2,315,000	Bay Area Toll Authority 5% 1/10/2054	2,513,615	0.03
USD 2,285,852	Bayview Commercial Asset Trust '2008-4 A3' '144A' FRN 25/7/2038	2,277,229	0.03
USD 9,657,234	Bayview Financial Revolving Asset Trust '2004-B A1' '144A' FRN 28/5/2039	7,524,714	0.08
USD 4,233,487	Bayview Opportunity Master Fund (Step-up coupon) '2014- 16RP A' '144A' FRN 28/11/2029	4,250,785	0.05
USD 1,147,323	Bayview Opportunity Master Fund '2012-4NR3 A' '144A' FRN 28/2/2035	1,152,046	0.01
USD 2,135,444	Bayview Opportunity Master Fund (Step-up coupon) '2015-3 A1' '144A' 3.623% 28/4/2030	2,144,326	0.02
USD 1,251,258	BBCMS Trust '2014-BX0 B' '144A' FRN 15/8/2027	1,250,418	0.01
USD 2,090,000	BBCMS Trust '2015-SLP D' '144A' FRN 15/2/2028	2,074,841	0.02
USD 710,000	BBCMS Trust '2015-VFM A2' '144A' 3.375% 12/3/2036	713,674	0.01
USD 1,041,021	BCAP LLC 2010-RR11-I Trust '2010-RR11 4A1' '144A' FRN 27/3/2047	944,337	0.01
USD 1,652,321	BCMSC Trust '2000-A A2' FRN 15/6/2030	894,965	0.01
USD 1,533,989	BCMSC Trust '2000-A A3' FRN 15/6/2030	857,649	0.01
USD 2,626,397	BCMSC Trust '2000-A A4' FRN 15/6/2030	1,551,116	0.02
USD 1,427,977	Bear Stearns ALT-A Trust '2006-6 1A1' FRN 25/11/2036	1,097,984	0.01
USD 370,640	Bear Stearns ARM Trust '2004-5 2A' FRN 25/7/2034	372,517	0.00

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,348,228	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-FS1 1A3' FRN 25/5/2035	1,096,597	0.01
USD 2,429,751	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2006-EC2 M2' FRN 25/2/2036	2,103,433	0.02
USD 7,745,020	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2006-HE7 1A2' FRN 25/9/2036	6,304,106	0.07
USD 3,776,815	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2006-HE10 22A' FRN 25/12/2036	2,952,317	0.03
USD 1,728,710	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-AQ2 A2' FRN 25/1/2037	1,478,951	0.02
USD 1,231,462	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-HE1 21A2' FRN 25/1/2037	1,118,085	0.01
USD 1,539,101	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-HE2 22A' FRN 25/3/2037	1,231,471	0.01
USD 5,366,452	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust (Step-up coupon) '2005-AC9 A5' 5.75% 25/12/2035	4,794,436	0.05
USD 6,114,826	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust (Step-up coupon) '2006-AC1 1A2' 5.75% 25/2/2036	5,071,618	0.06
USD 464,000	Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust '2005- PW10 AM' FRN 11/12/2040	466,171	0.01
USD 2,868,826	Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust '2007- PW15 A1A' 5.317% 11/2/2044	3,005,118	0.03
USD 150,000	Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust '2007- PW18 AM' 6.084% 11/6/2050	162,066	0.00
USD 1,330,000	Bear Stearns Second Lien Trust '2007-SV1A M1' '144A' FRN 25/12/2036	1,246,125	0.01
EUR 800,000	Belden Inc 5.5% 15/4/2023	898,523	0.01
USD 2,295,000	Benefit Street Partners CLO IV Ltd '2014-IVA A1A' '144A' FRN 20/7/2026	2,281,308	0.03
USD 760,000	Benefit Street Partners CLO IV Ltd '2014-IVA B' '144A' FRN 20/7/2026	742,821	0.01
USD 765,000	Benefit Street Partners CLO IV Ltd 3.357% 20/10/2026	756,237	0.01
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO IV Ltd 3.725% 20/7/2026	478,349	0.01
USD 680,000	Benefit Street Partners CLO IV Ltd 3.807% 20/10/2026	651,678	0.01
USD 510,000	Benefit Street Partners CLO IV Ltd 5.407% 20/10/2026	464,875	0.01
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO Ltd '2012-IA C' '144A' FRN 15/10/2023	502,748	0.01
USD 1,020,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd '2015-VIA A2' '144A' FRN 18/4/2027	1,015,677	0.01
USD 980,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd '2015-VIA B' '144A' FRN 18/4/2027	971,010	0.01
USD 610,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd '2015-VIA C' '144A' FRN 18/4/2027	589,080	0.01
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd '2015-VIA D' '144A' FRN 18/4/2027	466,099	0.01

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 460,000	Betony CLO Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 15/4/2027 (Zero Coupon)	441,975	0.00
USD 2,400,000	BHMS 2014-ATLS Mortgage Trust '2014-ATLS AFL' '144A' FRN 5/7/2033	2,392,285	0.03
USD 955,000	BHMS 2014-MZ '2014-MZ M' '144A' FRN 5/7/2033	959,980	0.01
USD 2,475,000	BlueMountain CLO 2013-1 Ltd '2013-1A A1' '144A' FRN 15/5/2025	2,449,984	0.03
USD 260,000	BlueMountain CLO 2013-1 Ltd '2013-1A B' '144A' FRN 15/5/2025	255,668	0.00
USD 432,000	BlueMountain CLO 2014-1 Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 30/4/2026	422,456	0.00
USD 530,000	BlueMountain CLO 2014-4 Ltd '2014-4A E' '144A' FRN 30/11/2026	490,220	0.01
USD 250,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd '2015-1A B' '144A' FRN 13/4/2027	250,259	0.00
USD 559,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 13/4/2027	521,433	0.01
USD 750,000	BlueMountain CLO 2015-2 Ltd '2015-2A E' '144A' FRN 18/7/2027	682,848	0.01
USD 1,575,000	BlueMountain CLO Ltd '2011-1A E' '144A' FRN 16/8/2022	1,584,208	0.02
USD 96,211	BNC Mortgage Loan Trust '2007-3 A2' FRN 25/7/2037	95,312	0.00
USD 670,000	Board of Governors of Colorado State University System 5% 1/3/2045	746,598	0.01
USD 6,309,000	Boston Scientific Corp 2.85% 15/5/2020	6,279,606	0.07
USD 4,658,000	Boston Scientific Corp 3.85% 15/5/2025	4,511,201	0.05
USD 1,055,000	Bowman Park CLO Ltd '2014-1A D2' '144A' FRN 23/11/2025	1,053,781	0.01
USD 1,415,000	Brightstar Corp '144A' 7.25% 1/8/2018	1,492,825	0.02
USD 3,500,000	Buckeye Tobacco Settlement Financing Authority 5.875% 1/6/2047	2,817,990	0.03
USD 697,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust '2013-1515 F' '144A' FRN 10/3/2033	652,410	0.01
USD 2,002,000	BWAY 2015-1740 Mortgage Trust '2015-1740 E' '144A' FRN 13/1/2035	1,937,550	0.02
USD 2,500,000	BXHTL Mortgage Trust '2015-JWRZ DR3' '144A' FRN 15/5/2029	2,425,000	0.03
USD 3,200,000	BXHTL Mortgage Trust '2015-JWRZ GL3' '144A' FRN 15/5/2029	3,044,748	0.03
USD 2,079,000	Caesars Entertainment Resort Properties LLC / Caesars Entertainment Resort Prope 8% 1/10/2020	2,073,802	0.02
USD 1,000,000	California Educational Facilities Authority 5% 1/10/2032	1,271,940	0.01
USD 944,000	California Resources Corp 6% 15/11/2024	712,720	0.01
USD 1,520,000	Calpine Corp 5.375% 15/1/2023	1,478,200	0.02
USD 330,000	Canyon Capital CLO 2015-1 Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 15/4/2027	323,867	0.00

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,100,000	Capital One Bank USA NA 2.3% 5/6/2019	1,084,360	0.01
USD 3,591,000	Capital One Financial Corp FRN 1/6/2020 (Perpetual)	3,576,421	0.04
USD 825,000	Capital One NA/Mclean VA 2.4% 5/9/2019	812,703	0.01
USD 1,535,000	Capital One NA/Mclean VA 2.95% 23/7/2021	1,499,198	0.02
USD 2,640,000	Carefree Portfolio Trust '2014-CARE D' '144A' FRN 15/11/2019	2,661,796	0.03
USD 2,060,000	Carefree Portfolio Trust '2014-CARE E' '144A' FRN 15/11/2019	2,079,663	0.02
USD 1,000,000	Carefree Portfolio Trust '2014-CMZA MZA' '144A' FRN 15/11/2019	1,003,390	0.01
USD 520,000	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd '2012-1A DR' '144A' FRN 20/4/2022	519,436	0.01
USD 2,650,000	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd '2012-2AR ER' '144 A' FRN 20/7/2023	2,656,495	0.03
USD 1,455,000	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd '2012-3A C' '144A' FRN 4/10/2024	1,458,858	0.02
USD 771,000	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd '2012-4A D' '144A' FRN 20/1/2025	772,682	0.01
USD 500,000	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd '2013-1A D' '144A' FRN 14/2/2025	475,654	0.01
USD 1,200,000	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 17/4/2025	1,190,681	0.01
USD 1,440,000	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd '2014-2A B2' '144A' FRN 15/5/2025	1,431,696	0.02
USD 715,000	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd '2014-5A C' '144A' FRN 16/10/2025	716,733	0.01
USD 2,710,000	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd '2014-3A A2' '144A' FRN 27/7/2026	2,712,021	0.03
USD 485,000	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 20/4/2027	485,404	0.01
USD 525,000	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 20/4/2027	515,248	0.01
USD 485,000	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd '2015-1A E1' '144A' FRN 20/4/2027	447,570	0.01
USD 250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd '2015-2A C' '144A' FRN 27/4/2027	245,293	0.00
USD 280,000	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd '2015-2A D' '144A' FRN 27/4/2027	258,271	0.00
USD 2,005,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series '2005-FRE1 M1' FRN 25/12/2035	1,692,194	0.02
USD 1,885,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series '2006-FRE1 A4' FRN 25/7/2036	1,139,974	0.01
USD 2,629,110	Carrington Mortgage Loan Trust Series '2006-NC5 A3' FRN 25/1/2037	1,571,267	0.02

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 846,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series '2006-NC5 A4' FRN 25/1/2037	511,195	0.01
USD 5,370,031	Carrington Mortgage Loan Trust Series '2007-FRE1 A2' FRN 25/2/2037	5,060,282	0.06
USD 1,525,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.25% 30/9/2022	1,540,601	0.02
USD 1,565,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 7.375% 1/6/2020	1,643,250	0.02
USD 2,371,000	CCO Safari II LLC '144A' 3.579% 23/7/2020	2,370,215	0.03
USD 11,690,000	CCO Safari II LLC '144A' 4.464% 23/7/2022	11,634,975	0.13
USD 4,885,000	CCO Safari II LLC '144A' 4.908% 23/7/2025	4,869,329	0.05
USD 2,446,000	CCO Safari II LLC '144A' 6.384% 23/10/2035	2,495,803	0.03
USD 2,680,000	CDGJ Commercial Mortgage Trust '2014-BXCH EPA' '144A' FRN 15/12/2027	2,699,032	0.03
USD 540,000	Cedar Funding III CLO Ltd '2014-3A C' '144A' FRN 20/5/2026	519,600	0.01
USD 450,000	Cedar Funding III CLO Ltd '2014-3A D' '144A' FRN 20/5/2026	423,631	0.00
EUR 4,659,000	Cellco Partnership / Verizon Wireless Capital LLC 8.75% 18/12/2015	5,363,200	0.06
EUR 1,400,000	Cemex Finance LLC 5.25% 1/4/2021	1,616,907	0.02
USD 1,335,000	Cent CLO 22 Ltd '2014-22A C' '144A' FRN 7/11/2026	1,297,035	0.01
USD 765,000	Central Texas Turnpike System 'B' 5% 15/8/2037	843,868	0.01
USD 1,000,000	Central Texas Turnpike System 'C' 5% 15/8/2037	1,081,655	0.01
USD 1,160,000	CGBAM Commercial Mortgage Trust '2015-SMRT E' '144A' FRN 10/4/2028	1,131,258	0.01
USD 1,194,000	CG-CCRE Commercial Mortgage Trust '2014-FL1 D' '144A' FRN 15/6/2031	1,187,854	0.01
USD 752,000	CG-CCRE Commercial Mortgage Trust '2014-FL1 E' '144A' FRN 15/6/2031	748,534	0.01
USD 71,515,000	CG-CCRE Commercial Mortgage Trust '2014-FL2 XCP' '144A' FRN 15/11/2031	57,135	0.00
USD 1,310,000	Chesapeake Energy Corp 6.5% 15/8/2017	1,241,225	0.01
USD 270,000	Chesapeake Funding LLC '2013-1A B' '144A' FRN 7/1/2025	269,391	0.00
USD 385,000	Chesapeake Funding LLC '2014-1A B' '144A' FRN 7/3/2026	384,767	0.00
USD 205,000	Chesapeake Funding LLC '2014-1A C' '144A' FRN 7/3/2026	204,526	0.00
USD 755,000	Chesapeake Funding LLC '2014-1A D' '144A' FRN 7/3/2026	753,286	0.01
USD 1,750,000	Chicago Board of Education 5% 1/12/2042	1,374,065	0.02
USD 3,829,601	CHL Mortgage Pass-Through Trust '2006-OA4 A1' FRN 25/4/2046	2,125,490	0.02
USD 2,799,003	CHL Mortgage Pass-Through Trust '2006-OA5 2A1' FRN 25/4/2046	2,282,069	0.03
USD 760,741	CHLUPA Trust '2013-VM A' '144A' 3.326% 15/8/2020	761,691	0.01
USD 375,000	Chrysler Capital Auto Receivables Trust '2013-BA B' '144A' 1.78% 17/6/2019	376,115	0.00
USD 220,000	Chrysler Capital Auto Receivables Trust '2013-AA B' '144A' 1.83% 15/3/2019	221,498	0.00
USD 570,000	Chrysler Capital Auto Receivables Trust '2013-BA C' '144A' 2.24% 16/9/2019	571,963	0.01

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 470,000	Chrysler Capital Auto Receivables Trust '2013-AA C' '144A' 2.28% 15/7/2019	473,398	0.01
USD 1,096,000	CHS/Community Health Systems Inc 8% 15/11/2019	1,149,430	0.01
USD 500,000	CIFC Funding 2012-I Ltd '2012-1AR B1R' '144A' FRN 14/8/2024	501,224	0.01
USD 1,250,000	CIFC Funding 2012-II Ltd '2012-2A B2R' '144A' FRN 5/12/2024	1,243,422	0.01
USD 250,000	CIFC Funding 2014 Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 18/4/2025	235,753	0.00
USD 750,000	CIFC Funding 2014-II Ltd '2014-2A A3L' '144A' FRN 24/5/2026	742,479	0.01
USD 1,390,000	CIFC Funding 2014-II Ltd '2014-2A B1L' '144A' FRN 24/5/2026	1,331,297	0.01
USD 443,000	CIFC Funding 2014-III Ltd '2014-3A C1' '144A' FRN 22/7/2026	433,041	0.00
USD 1,646,000	CIFC Funding 2014-III Ltd '2014-3A D' '144A' FRN 22/7/2026	1,564,523	0.02
USD 745,000	CIFC Funding 2014-IV Ltd '2014-4A D' '144A' FRN 17/10/2026	707,128	0.01
USD 4,805,000	CIFC Funding 2014-V Ltd '2014-5A A1' '144A' FRN 17/1/2027	4,806,289	0.05
USD 810,000	CIFC Funding 2014-V Ltd '2014-5A C' '144A' FRN 17/1/2027	810,912	0.01
USD 1,050,000	CIFC Funding 2014-V Ltd '2014-5A D2' '144A' FRN 17/1/2027	1,053,444	0.01
USD 370,000	CIFC Funding 2015-I Ltd '2015-1A B' '144A' FRN 22/1/2027	370,161	0.00
USD 650,000	CIFC Funding 2015-I Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 22/1/2027	641,894	0.01
USD 680,000	CIFC Funding 2015-I Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 22/1/2027	669,963	0.01
USD 970,000	CIFC Funding 2015-II Ltd '2015-2A A' '144A' FRN 15/4/2027	967,806	0.01
USD 530,000	CIFC Funding 2015-II Ltd '2015-2A D' '144A' FRN 15/4/2027	509,506	0.01
USD 1,125,000	CIFC Funding 2015-IV Ltd '2015-4A C1' '144A' FRN 20/10/2027	1,092,578	0.01
USD 940,000	CIT Group Inc 4.25% 15/8/2017	956,450	0.01
USD 315,000	CIT Group Inc '144A' 5.5% 15/2/2019	330,750	0.00
USD 563,500	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-SSHP D' '144A' FRN 15/9/2017	564,218	0.01
USD 8,700,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2013-SMP XB' '144A' FRN 12/1/2030	68,060	0.00
USD 2,200,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2014-388G E' '144A' FRN 15/6/2033	2,179,768	0.02

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,624,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2013-375P E' '144A' FRN 10/5/2035	3,292,208	0.04
USD 335,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2014-GC21 D' '144A' FRN 10/5/2047	305,733	0.00
USD 60,100,382	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2014-GC23 XA' FRN 10/7/2047	4,347,151	0.05
USD 65,000,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-P1 XA' FRN 15/9/2048	3,807,830	0.04
USD 1,500,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-P1 D' '144A' 3.225% 15/9/2048	1,140,224	0.01
USD 2,094,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2014-GC25 AS' 4.017% 10/10/2047	2,171,203	0.02
USD 7,711,000	Citigroup Inc FRN 15/8/2020 (Perpetual)	7,651,263	0.08
USD 6,071,000	Citigroup Inc FRN 15/2/2023 (Perpetual)*	6,002,701	0.07
USD 9,115,000	Citigroup Inc FRN 15/5/2025 (Perpetual)	8,750,400	0.10
USD 2,310,000	Citigroup Inc 3.3% 27/4/2025	2,245,325	0.02
USD 1,285,000	City of Atlanta GA Water & Wastewater Revenue 5% 1/11/2040	1,448,568	0.02
USD 670,000	City of Atlanta GA Water & Wastewater Revenue 5% 1/11/2043	752,939	0.01
USD 1,430,000	City of Charleston SC Waterworks & Sewer System Revenue 5% 1/1/2045	1,636,156	0.02
USD 1,000,000	City of Detroit MI Sewage Disposal System Revenue FRN 1/7/2032	884,015	0.01
USD 715,000	City of Houston TX Airport System Revenue 5% 1/7/2024	812,151	0.01
USD 1,715,000	City of San Jose CA Airport Revenue 5% 1/3/2037	1,772,247	0.02
USD 820,000	City of Tulare CA Sewer Revenue 5% 15/11/2045	912,812	0.01
USD 3,008,000	CNOOC Finance 2015 USA LLC 3.5% 5/5/2025	2,889,712	0.03
USD 775,000	COBALT CMBS Commercial Mortgage Trust '2007-C3 AJ' FRN 15/5/2046	792,271	0.01
USD 815,000	Colorado Health Facilities Authority 5.25% 1/1/2045	881,284	0.01
USD 4,354,000	Comcast Corp 3.375% 15/8/2025	4,317,065	0.05
USD 3,073,000	Comcast Corp 4.4% 15/8/2035	3,101,215	0.03
USD 3,559,000	Comcast Corp 4.6% 15/8/2045	3,637,926	0.04
USD 5,420,000	COMM 2007-C9 Mortgage Trust '2007-C9 AJFL' '144A' FRN 10/12/2049	5,255,427	0.06
USD 400,000	COMM 2007-C9 Mortgage Trust 5.989% 10/12/2049	404,482	0.00
USD 100,000	COMM 2013-300P Mortgage Trust '2013-300P D' '144A' FRN 10/8/2030	103,283	0.00
USD 1,295,000	COMM 2013-CCRE11 Mortgage Trust '2013-CR11 D' '144A' FRN 10/10/2046	1,285,165	0.01
USD 305,000	COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust '2013-CR12 D' '144A' FRN 10/10/2046	303,235	0.00
USD 14,254,087	COMM 2013-CCRE13 Mortgage Trust '2013-CR13 XA' FRN 10/12/2023	751,497	0.01

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 175,000	COMM 2013-FL3 Mortgage Trust '2013-FL3 MMHP' '144A' FRN 13/10/2028	176,286	0.00
USD 1,230,000	COMM 2013-GAM '2013-GAM A2' '144A' 3.367% 10/2/2028	1,259,387	0.01
USD 3,000,000	COMM 2013-LC13 Mortgage Trust '2013-LC13 D' '144A' FRN 10/8/2046	3,005,422	0.03
USD 2,154,000	COMM 2014-277P Mortgage Trust '2014-277P A' '144A' FRN 10/8/2049	2,224,484	0.02
USD 9,099,122	COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust '2014-CR18 XA' FRN 15/7/2047	660,223	0.01
USD 3,115,000	COMM 2014-FL4 Mortgage Trust '2014-FL4 D' '144A' FRN 13/7/2031	3,111,670	0.03
USD 3,260,000	COMM 2014-FL5 Mortgage Trust '2014-FL5 D' '144A' FRN 15/10/2031	3,039,758	0.03
USD 1,447,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust '2014-PAT D' '144A' FRN 13/8/2027	1,447,692	0.02
USD 500,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust '2014-PAT E' '144A' FRN 13/8/2027	496,474	0.01
USD 8,000,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust '2014-PAT F' '144A' FRN 13/8/2027	7,663,160	0.08
USD 6,905,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust '2014-PAT G' '144A' FRN 13/8/2027	5,995,577	0.07
USD 29,477,415	COMM 2015-CCRE22 Mortgage Trust 1.169% 10/3/2048	1,973,321	0.02
USD 1,950,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust '2015-CR23 CME' '144A' FRN 10/5/2048	1,801,269	0.02
USD 1,980,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust '2015-CR23 D' FRN 10/5/2048	1,689,198	0.02
USD 34,481,716	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 1.162% 10/5/2048	2,315,878	0.03
USD 4,146,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust '2015-LC19 D' '144A' FRN 10/2/2048	3,306,398	0.04
USD 1,512,690	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust '2015-LC19 XA' FRN 10/2/2048	131,353	0.00
USD 2,930,000	COMM Mortgage Trust '2015-CR25 D' FRN 10/8/2048	2,325,937	0.03
USD 23,830,000	COMM Mortgage Trust '2015-CR25 XA' FRN 10/8/2048	1,673,688	0.02
USD 5,040,000	Commercial Mortgage Trust '2014-KYO F' '144A' FRN 11/6/2027	5,011,370	0.06
USD 1,296,000	Commercial Mortgage Trust '2014-FL5 B' '144A' FRN 15/10/2031	1,298,942	0.01
USD 32,500,000	Commercial Mortgage Trust 13/2/2032 (Zero Coupon)	5,624,814	0.07
USD 300,000	Commercial Mortgage Trust '2006-GG7 AM' FRN 10/7/2038	307,997	0.00
USD 1,215,000	Commercial Mortgage Trust '2007-CD5 AJ' FRN 15/11/2044	1,299,014	0.01
USD 2,200,000	Commercial Mortgage Trust '2007-CD5 AJA' FRN 15/11/2044	2,343,014	0.03
USD 5,503,417	Commercial Mortgage Trust '2013-CR11 XA' FRN 10/10/2046	372,174	0.00
USD 1,275,000	Commercial Mortgage Trust '2007-GG11 AM' FRN 10/12/2049	1,355,780	0.02
USD 945,000	Communications Sales & Leasing Inc / CSL Capital LLC (Restricted) '144A' 8.25% 15/10/2023	862,313	0.01

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 766,931	Conseco Financial Corp '1998-6 M1' 6.63% 1/6/2030	687,359	0.01
USD 2,009,000	CONSOL Energy Inc 5.875% 15/4/2022	1,456,525	0.02
USD 70,010	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	74,364	0.00
USD 599,316	Continental Airlines 2010-1 Class B Pass Through Trust 6% 12/1/2019	618,420	0.01
USD 850,000	Continental Airlines 2012-3 Class C Pass Thru Certificates 6.125% 29/4/2018	887,188	0.01
USD 1,000,000	Continental Resources Inc/OK 4.9% 1/6/2044	751,035	0.01
USD 7,075,000	Core Industrial Trust '2015-CALW G' '144A' FRN 10/2/2034	6,515,403	0.07
USD 13,340,000	Core Industrial Trust '2015-TEXW XA' '144A' FRN 10/2/2034	592,140	0.01
USD 9,240,000	Core Industrial Trust '2015-WEST XA' '144A' FRN 10/2/2037	700,531	0.01
USD 581,351	Countrywide Asset-Backed Certificates '2006-19 2A2' FRN 25/3/2037	542,393	0.01
USD 2,078,426	Countrywide Asset-Backed Certificates '2006-16 1A' FRN 25/12/2046	1,634,603	0.02
USD 1,250,946	Countrywide Asset-Backed Certificates '2007-4 A2' FRN 25/4/2047	1,349,852	0.01
USD 2,901,607	Countrywide Asset-Backed Certificates '2007-13 1A' FRN 25/10/2047	2,452,119	0.03
USD 4,707	Countrywide Asset-Backed Certificates '2007-7 2A2' FRN 25/10/2047	4,714	0.00
USD 3,552,884	Countrywide Asset-Backed Certificates (Step-up coupon) '2006-S3 A3' 6.273% 25/6/2021	3,630,902	0.04
USD 2,550,789	Countrywide Asset-Backed Certificates (Step-up coupon) '2006-S3 A4' 6.273% 25/1/2029	2,492,486	0.03
USD 1,390,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2036	1,510,367	0.02
USD 3,700,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2038	4,030,003	0.04
USD 770,000	County of Miami-Dade FL Transit System 5% 1/7/2042	838,133	0.01
USD 3,000,000	County of Miami-Dade FL Water & Sewer System Revenue 5% 1/10/2042	3,329,595	0.04
USD 1,425,000	County of Sacramento CA Airport System Revenue 5.25% 1/7/2039	1,533,015	0.02
USD 250,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust '2015-1A C' '144A' 3.3% 17/7/2023	252,188	0.00
USD 4,389,503	Credit Suisse ABS Repackaging Trust '2013-A B' '144A' 2.5% 25/1/2030	4,259,863	0.05
USD 965,000	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2006-C2 AM' FRN 15/3/2039	975,065	0.01
USD 8,361,968	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2007-C4 A1AM' FRN 15/9/2039	8,893,116	0.10

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 308,000	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2007-C4 AJ' FRN 15/9/2039	316,514	0.00
USD 1,750,000	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2007-C4 AM' FRN 15/9/2039	1,859,306	0.02
USD 127,624	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2007-C5 AAB' FRN 15/9/2040	130,853	0.00
USD 225,000	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2006-C5 AM' 5.343% 15/12/2039	234,425	0.00
USD 3,245,000	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2006-C4 AM' 5.509% 15/9/2039	3,361,658	0.04
USD 1,260,000	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp '2005-C6 AJ' FRN 15/12/2040	1,263,884	0.01
USD 63,607	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp '2005-C3 AJ' 4.771% 15/7/2037	63,597	0.00
USD 204,394	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp '2005-C2 AMFX' 4.877% 15/4/2037	204,289	0.00
USD 320,000	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp '2005-C3 B' 4.882% 15/7/2037	319,431	0.00
USD 1,650,000	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates '2015-4R 1A4' '144A' FRN 27/10/2036	777,100	0.01
USD 570,000	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates '2015-4R 1A2' '144A' FRN 27/11/2036	458,599	0.01
USD 2,605,332	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates '2015-5R 3A1' '144A' 4.75% 27/1/2037	2,605,332	0.03
USD 385,000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp III 6.25% 1/2/2021	401,844	0.00
USD 650,000	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust '2015-C1 D' '144A' FRN 15/4/2050	563,151	0.01
USD 3,131,441	CSMC 2015-PR1 Trust (Step-up coupon) '2015-PR1 A1' '144A' 3.5% 25/2/2055	3,006,183	0.03
USD 406,100	CSMC Series '2010-20R 9A1' '144A' FRN 27/1/2036	401,374	0.00
USD 870,000	CSMC Series '2014-4R 16A3' '144A' FRN 27/2/2036	734,125	0.01
USD 1,062,528	CSMC Series '2014-9R 6A1' '144A' FRN 27/3/2036	1,009,315	0.01
USD 1,822,683	CSMC Series '2015-6R 5A1' '144A' FRN 27/3/2036	1,695,095	0.02
USD 2,633,739	CSMC Series '2015-6R 5A2' '144A' FRN 27/3/2036	1,399,980	0.02
USD 2,922,318	CSMC Series '2014-9R 3A1' '144A' FRN 27/11/2037	2,729,708	0.03
USD 6,700,837	CSMC Series '2014-11R 16A1' '144A' FRN 27/9/2047	6,437,842	0.07
USD 5,140,000	CSMC Series '2010-UD1 B' '144A' FRN 16/12/2049	5,367,702	0.06
USD 615,000	CSMC Series '2009-RR1 A3C' '144A' 5.383% 15/2/2040	633,569	0.01
USD 3,060,000	CSMC Trust '2015-DEAL A' '144A' FRN 15/4/2029	3,060,295	0.03
USD 1,390,000	CSMC Trust '2015-DEAL D' '144A' FRN 15/4/2029	1,384,858	0.02
USD 122,260,000	CSMC Trust '2014-USA X2' '144A' FRN 15/9/2037	1,202,733	0.01
USD 1,320,000	CSMC Trust '2014-TIKI D' '144A' FRN 15/9/2038	1,308,828	0.01
USD 790,000	CSMC Trust '2014-TIKI E' '144A' FRN 15/9/2038	788,828	0.01
USD 1,750,000	CSMC Trust '2014-TIKI F' '144A' FRN 15/9/2038	1,734,766	0.02

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,355,000	CVS Health Corp 3.875% 20/7/2025	3,442,451	0.04
USD 11,399,000	CVS Health Corp 4.875% 20/7/2035	11,837,058	0.13
USD 3,672,000	CVS Health Corp 5.125% 20/7/2045	3,939,979	0.04
USD 1,236,603	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series '2006-S5 A4' 5.842% 25/6/2035	1,204,426	0.01
USD 775,963	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series '2006-S5 A5' 6.155% 25/6/2035	709,133	0.01
USD 6,666,000	Daimler Finance North America LLC 144A' 2.45% 18/5/2020	6,630,637	0.07
USD 4,000,000	Dallas/Fort Worth International Airport 5% 1/11/2043	4,192,340	0.05
USD 1,070,000	DaVita HealthCare Partners Inc 5.125% 15/7/2024	1,068,400	0.01
USD 8,628,640	DCP Rights LLC '2014-1A A' '144A' 5.463% 25/10/2044	8,748,295	0.10
USD 2,430,000	Delta Air Lines 2010-1 Class B Pass Through Trust '144A' 6.375% 2/1/2016	2,476,170	0.03
USD 1,178,754	Deutsche ALT-A Securities Inc ALT '2007-RS1 A2' '144A' FRN 27/1/2037	1,943,323	0.02
USD 1,175,257	Deutsche Alt-A Securities Mortgage Loan Trust Series '2006-0A1 A1' FRN 25/2/2047	955,036	0.01
USD 1,168,471	Deutsche Alt-A Securities Mortgage Loan Trust Series '2007-0A4 1A1B' FRN 25/8/2047	974,946	0.01
USD 2,050,000	DISH DBS Corp 4.25% 1/4/2018	2,050,000	0.02
USD 1,525,000	DISH DBS Corp 5.875% 15/7/2022	1,452,563	0.02
USD 980,000	District of Columbia 5% 1/6/2030	1,147,036	0.01
USD 945,000	District of Columbia 5% 15/7/2034	1,053,042	0.01
USD 945,000	District of Columbia 5% 15/7/2035	1,050,467	0.01
USD 2,175,000	District of Columbia 5% 1/6/2038	2,462,676	0.03
USD 84,000	DPL Inc 6.5% 15/10/2016	86,310	0.00
USD 450,000	Dryden 34 Senior Loan Fund '2014-34A C' '144A' FRN 15/10/2026	443,435	0.00
USD 250,000	Dryden 36 Senior Loan Fund '2014-36A C' '144A' FRN 9/11/2025	250,007	0.00
USD 630,000	Dryden 36 Senior Loan Fund '2014-36A D' '144A' FRN 9/11/2025	617,049	0.01
USD 255,000	Dryden 36 Senior Loan Fund '2014-36A E' '144A' FRN 9/11/2025	234,321	0.00
USD 475,000	Dryden Senior Loan Fund 18/4/2026 (Zero Coupon)	470,387	0.01
USD 3,065,000	Dryden XXVIII Senior Loan Fund '2013-28A A1L' '144A' FRN 15/8/2025	3,031,578	0.03
USD 943,000	Endo Finance LLC / Endo Finco Inc '144A' 5.375% 15/1/2023	953,609	0.01
USD 3,360,000	Energy Transfer Partners LP 4.9% 15/3/2035	2,871,397	0.03
USD 3,366,000	Exelon Corp 2.85% 15/6/2020	3,367,350	0.04
USD 2,000,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2013-C01 M2' FRN 25/10/2023	2,118,308	0.02
USD 555,506	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2014-C01 M2' FRN 25/1/2024	560,216	0.01

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 6,119,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2014-C02 1M2' FRN 25/5/2024	5,407,495	0.06
USD 715,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2014-C03 1M2' FRN 25/7/2024	651,094	0.01
USD 18,372,744	Fannie Mae Interest Strip '413 C13' 4% 25/5/2040	3,837,236	0.04
USD 1,466,835	Fannie Mae Pool '254880' 4.5% 1/8/2023	1,590,032	0.02
USD 468,792	Fannie Mae Pool '255042' 4.5% 1/11/2023	508,185	0.01
USD 116,743	Fannie Mae Pool '257294' 4.5% 1/7/2028	126,548	0.00
USD 2,363,286	Fannie Mae Pool '257571' 4.5% 1/2/2039	2,564,714	0.03
USD 79,283	Fannie Mae Pool '257584' 4.5% 1/2/2029	85,942	0.00
USD 2,865,376	Fannie Mae Pool '889200' 4.5% 1/3/2038	3,115,835	0.03
USD 5,985,926	Fannie Mae Pool '932389' 4.5% 1/1/2040	6,507,817	0.07
USD 118,450	Fannie Mae Pool '964747' 4.5% 1/7/2038	128,398	0.00
USD 41,254	Fannie Mae Pool '995676' 4.5% 1/5/2039	45,353	0.00
USD 2,152	Fannie Mae Pool 'AA0245' 4.5% 1/1/2039	2,333	0.00
USD 447,243	Fannie Mae Pool 'AA2969' 4.5% 1/2/2039	484,806	0.01
USD 9,484	Fannie Mae Pool 'AA3408' 4.5% 1/3/2039	10,304	0.00
USD 877,228	Fannie Mae Pool 'AA4319' 4.5% 1/4/2039	953,268	0.01
USD 9,827	Fannie Mae Pool 'AA7666' 4.5% 1/6/2039	10,776	0.00
USD 417,878	Fannie Mae Pool 'AA7689' 4.5% 1/6/2039	453,464	0.01
USD 907,007	Fannie Mae Pool 'AB0984' 4.5% 1/2/2039	983,185	0.01
USD 186,330	Fannie Mae Pool 'AB1515' 4.5% 1/8/2040	202,692	0.00
USD 15,182	Fannie Mae Pool 'AB2643' 4.5% 1/5/2041	16,510	0.00
USD 4,298,353	Fannie Mae Pool 'AB2813' 4.5% 1/4/2041	4,674,436	0.05
USD 7,660,795	Fannie Mae Pool 'AB3493' 4.5% 1/9/2041	8,354,976	0.09
USD 5,542,007	Fannie Mae Pool 'AB7880' 3.5% 1/2/2043	5,779,870	0.06
USD 8,911,498	Fannie Mae Pool 'AB9163' 3.5% 1/5/2043	9,293,726	0.10
USD 16,543	Fannie Mae Pool 'AD1035' 4.5% 1/2/2040	17,989	0.00
USD 105,318	Fannie Mae Pool 'AD1593' 4.5% 1/2/2040	114,518	0.00
USD 41,936	Fannie Mae Pool 'AD3072' 4.5% 1/4/2040	45,625	0.00
USD 13,730	Fannie Mae Pool 'AD3724' 4.5% 1/3/2040	14,940	0.00
USD 192,275	Fannie Mae Pool 'AD7127' 4.5% 1/7/2040	209,034	0.00
USD 89,363	Fannie Mae Pool 'AD7593' 4.5% 1/7/2040	97,178	0.00
USD 13,305,348	Fannie Mae Pool 'AD7612' 4.5% 1/7/2040	14,432,963	0.16
USD 22,214	Fannie Mae Pool 'AD7741' 4.5% 1/7/2040	24,117	0.00
USD 39,188	Fannie Mae Pool 'AD7879' 4.5% 1/6/2040	42,504	0.00
USD 8,129,335	Fannie Mae Pool 'AD8036' 4.5% 1/8/2040	8,830,624	0.10
USD 119,230	Fannie Mae Pool 'AD8529' 4.5% 1/8/2040	129,623	0.00
USD 30,183	Fannie Mae Pool 'AE0138' 4.5% 1/3/2040	33,096	0.00
USD 50,381	Fannie Mae Pool 'AE0725' 4.5% 1/1/2041	54,822	0.00
USD 135,361	Fannie Mae Pool 'AE0984' 4.5% 1/2/2041	147,274	0.00
USD 143,209	Fannie Mae Pool 'AE5471' 4.5% 1/10/2040	155,641	0.00
USD 168,599	Fannie Mae Pool 'AH4221' 4.5% 1/3/2041	182,993	0.00
USD 594,640	Fannie Mae Pool 'AH4842' 4.5% 1/2/2041	647,139	0.01
USD 1,576,683	Fannie Mae Pool 'AH7196' 4.5% 1/3/2041	1,715,066	0.02

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 13,370	Fannie Mae Pool 'AH8013' 4.5% 1/3/2041	14,492	0.00
USD 303,434	Fannie Mae Pool 'AH9918' 4.5% 1/4/2041	330,198	0.00
USD 11,131	Fannie Mae Pool 'AI1163' 4.5% 1/4/2041	12,103	0.00
USD 70,335	Fannie Mae Pool 'AI1888' 4.5% 1/5/2041	76,491	0.00
USD 631,923	Fannie Mae Pool 'AI2532' 4.5% 1/5/2041	687,912	0.01
USD 2,477,942	Fannie Mae Pool 'AI2555' 4.5% 1/6/2041	2,698,162	0.03
USD 26,387	Fannie Mae Pool 'AI4815' 4.5% 1/6/2041	28,687	0.00
USD 619,046	Fannie Mae Pool 'AI6013' 4.5% 1/7/2041	671,609	0.01
USD 442,641	Fannie Mae Pool 'AI6061' 4.5% 1/7/2041	480,553	0.01
USD 461,273	Fannie Mae Pool 'AI6349' 4.5% 1/7/2041	502,003	0.01
USD 973,469	Fannie Mae Pool 'AJ3139' 4.5% 1/9/2036	1,059,368	0.01
USD 229,039	Fannie Mae Pool 'AK4726' 4.5% 1/3/2042	249,432	0.00
USD 40,010	Fannie Mae Pool 'AL3967' 4.5% 1/8/2042	43,519	0.00
USD 302,016	Fannie Mae Pool 'AL4323' 4.5% 1/11/2043	327,382	0.00
USD 7,791,541	Fannie Mae Pool 'AL4699' 3.5% 1/10/2043	8,126,871	0.09
USD 188,033	Fannie Mae Pool 'AL5231' 4.5% 1/9/2042	204,324	0.00
USD 5,887,380	Fannie Mae Pool 'AL5439' 3.5% 1/11/2043	6,139,977	0.07
USD 20,919,490	Fannie Mae Pool 'AL5570' 4.5% 1/7/2044	22,746,018	0.25
USD 44,823,167	Fannie Mae Pool 'AL5878' 3.5% 1/9/2029	47,647,475	0.53
USD 129,302,208	Fannie Mae Pool 'AL6167' 3.5% 1/1/2044	134,854,393	1.49
USD 2,091,341	Fannie Mae Pool 'AL6548' 4.5% 1/2/2038	2,282,254	0.03
USD 14,276,608	Fannie Mae Pool 'AL6616' 3.5% 1/3/2044	14,887,504	0.16
USD 5,888,455	Fannie Mae Pool 'AL6624' 4.5% 1/9/2042	6,410,843	0.07
USD 4,829,869	Fannie Mae Pool 'AQ6238' 3.5% 1/12/2042	5,036,920	0.06
USD 39,339	Fannie Mae Pool 'AR0604' 4.5% 1/10/2043	42,670	0.00
USD 6,830,781	Fannie Mae Pool 'AR2624' 3.5% 1/2/2043	7,123,724	0.08
USD 4,862,880	Fannie Mae Pool 'AS0164' 3.5% 1/8/2043	5,070,709	0.06
USD 842,036	Fannie Mae Pool 'AS0872' 4.5% 1/10/2043	913,210	0.01
USD 1,002,397	Fannie Mae Pool 'AS1128' 4.5% 1/11/2043	1,087,009	0.01
USD 1,714,464	Fannie Mae Pool 'AS1131' 4.5% 1/11/2043	1,858,459	0.02
USD 3,134,454	Fannie Mae Pool 'AS1331' 4.5% 1/12/2043	3,401,721	0.04
USD 10,550,647	Fannie Mae Pool 'AS1380' 4.5% 1/12/2043	11,440,887	0.13
USD 54,582	Fannie Mae Pool 'AS1585' 4.5% 1/1/2044	59,328	0.00
USD 8,078,118	Fannie Mae Pool 'AS2276' 4.5% 1/4/2044	8,761,391	0.10
USD 775,715	Fannie Mae Pool 'AS2322' 4.5% 1/4/2044	843,244	0.01
USD 509,587	Fannie Mae Pool 'AS2328' 4.5% 1/5/2044	552,453	0.01
USD 144,473	Fannie Mae Pool 'AS2351' 4.5% 1/5/2044	157,283	0.00
USD 10,662,046	Fannie Mae Pool 'AS2906' 4.5% 1/7/2044	11,561,166	0.13
USD 306,555	Fannie Mae Pool 'AS3306' 4.5% 1/9/2044	332,747	0.00
USD 217,323	Fannie Mae Pool 'AS3312' 4.5% 1/9/2044	235,829	0.00
USD 5,761,997	Fannie Mae Pool 'AS3412' 4.5% 1/9/2044	6,251,168	0.07
USD 379,446	Fannie Mae Pool 'AS4175' 4.5% 1/12/2044	412,850	0.00
USD 13,997,617	Fannie Mae Pool 'AS4288' 3.5% 1/1/2035	14,680,010	0.16
USD 3,090,334	Fannie Mae Pool 'AS4846' 3.5% 1/4/2035	3,241,459	0.04
USD 8,310,513	Fannie Mae Pool 'AS5060' 3% 1/6/2035	8,506,986	0.09

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 8,223,209	Fannie Mae Pool 'AS5062' 3% 1/5/2035	8,417,618	0.09
USD 7,331,533	Fannie Mae Pool 'AS5085' 3% 1/6/2035	7,504,865	0.08
USD 7,338,864	Fannie Mae Pool 'AS5086' 3% 1/6/2035	7,512,371	0.08
USD 11,064,359	Fannie Mae Pool 'AS5223' 3% 1/6/2035	11,325,940	0.12
USD 3,848,824	Fannie Mae Pool 'AS5224' 3% 1/6/2035	3,939,816	0.04
USD 7,416,329	Fannie Mae Pool 'AS5250' 3% 1/6/2035	7,591,665	0.08
USD 7,654,950	Fannie Mae Pool 'AS5251' 3% 1/6/2035	7,835,928	0.09
USD 7,761,755	Fannie Mae Pool 'AS5291' 3% 1/7/2035	7,945,259	0.09
USD 7,788,443	Fannie Mae Pool 'AS5292' 3% 1/7/2035	7,972,578	0.09
USD 7,818,971	Fannie Mae Pool 'AS5333' 3% 1/7/2035	8,003,831	0.09
USD 8,126,841	Fannie Mae Pool 'AS5538' 3% 1/8/2035	8,318,983	0.09
USD 8,168,073	Fannie Mae Pool 'AS5539' 3% 1/7/2035	8,361,193	0.09
USD 41,134,494	Fannie Mae Pool 'AS5561' 3% 1/8/2035	42,107,053	0.46
USD 1,489,713	Fannie Mae Pool 'AS5562' 3% 1/8/2035	1,524,935	0.02
USD 8,322,400	Fannie Mae Pool 'AS5735' 3% 1/9/2035	8,519,171	0.09
USD 8,361,469	Fannie Mae Pool 'AS5736' 3% 1/9/2035	8,559,166	0.09
USD 8,316,648	Fannie Mae Pool 'AS5741' 3% 1/9/2035	8,513,284	0.09
USD 10,714,111	Fannie Mae Pool 'AT0998' 3.5% 1/4/2043	11,172,009	0.12
USD 8,146,964	Fannie Mae Pool 'AT9218' 3.5% 1/7/2043	8,496,831	0.09
USD 393	Fannie Mae Pool 'AU1177' 4.5% 1/9/2043	426	0.00
USD 238,486	Fannie Mae Pool 'AU4658' 4.5% 1/9/2043	258,604	0.00
USD 2,561,995	Fannie Mae Pool 'AU5988' 4.5% 1/8/2043	2,779,446	0.03
USD 4,374,858	Fannie Mae Pool 'AU6939' 4.5% 1/10/2043	4,751,073	0.05
USD 694,333	Fannie Mae Pool 'AU7404' 4.5% 1/11/2043	754,983	0.01
USD 5,312,199	Fannie Mae Pool 'AV0957' 4.5% 1/3/2044	5,765,321	0.06
USD 2,496,628	Fannie Mae Pool 'AV0967' 4.5% 1/6/2044	2,708,200	0.03
USD 517,816	Fannie Mae Pool 'AV0978' 4.5% 1/10/2043	563,286	0.01
USD 1,000,000	Fannie Mae Pool 'AV0991' 4.5% 1/10/2043	1,088,094	0.01
USD 565	Fannie Mae Pool 'AV1201' 4.5% 1/10/2043	614	0.00
USD 3,502,375	Fannie Mae Pool 'AV2267' 4.5% 1/3/2044	3,801,086	0.04
USD 8,999,998	Fannie Mae Pool 'AV2302' 4.5% 1/12/2043	9,763,103	0.11
USD 12,753,447	Fannie Mae Pool 'AV2367' 4.5% 1/1/2044	13,836,701	0.15
USD 138,807	Fannie Mae Pool 'AV2818' 4.5% 1/7/2044	150,553	0.00
USD 35,002	Fannie Mae Pool 'AV3348' 4.5% 1/4/2044	38,098	0.00
USD 3,855,758	Fannie Mae Pool 'AV3788' 4.5% 1/11/2043	4,195,611	0.05
USD 5,196,748	Fannie Mae Pool 'AV4104' 4.5% 1/1/2044	5,634,068	0.06
USD 3,026,548	Fannie Mae Pool 'AV4139' 4.5% 1/2/2044	3,293,299	0.04
USD 548	Fannie Mae Pool 'AV6700' 4.5% 1/1/2044	596	0.00
USD 664	Fannie Mae Pool 'AV7228' 4.5% 1/1/2044	720	0.00
USD 6,743,998	Fannie Mae Pool 'AV7923' 4.5% 1/1/2044	7,323,956	0.08
USD 2,252,021	Fannie Mae Pool 'AV7930' 4.5% 1/2/2044	2,443,958	0.03
USD 1,901,520	Fannie Mae Pool 'AV8175' 4.5% 1/1/2044	2,062,039	0.02
USD 23,113	Fannie Mae Pool 'AV9607' 4.5% 1/5/2044	25,081	0.00
USD 5,985,634	Fannie Mae Pool 'AW0769' 4.5% 1/4/2044	6,492,403	0.07
USD 538,761	Fannie Mae Pool 'AW1582' 4.5% 1/3/2044	586,371	0.01

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 72,135	Fannie Mae Pool 'AW1938' 4.5% 1/3/2044	78,254	0.00
USD 37,413	Fannie Mae Pool 'AW2445' 4.5% 1/5/2044	40,634	0.00
USD 5,968,281	Fannie Mae Pool 'AW3649' 4.5% 1/4/2044	6,475,463	0.07
USD 1,000,000	Fannie Mae Pool 'AW3727' 4.5% 1/5/2044	1,086,885	0.01
USD 6,113,374	Fannie Mae Pool 'AW4167' 4.5% 1/5/2044	6,635,067	0.07
USD 890,460	Fannie Mae Pool 'AW5110' 4.5% 1/8/2044	968,781	0.01
USD 3,044,969	Fannie Mae Pool 'AW5713' 4.5% 1/8/2044	3,310,849	0.04
USD 77,819	Fannie Mae Pool 'AW5723' 4.5% 1/9/2044	84,702	0.00
USD 4,550,678	Fannie Mae Pool 'AW6505' 4.5% 1/6/2044	4,936,588	0.05
USD 3,300,392	Fannie Mae Pool 'AW7237' 4.5% 1/6/2044	3,579,325	0.04
USD 7,502,831	Fannie Mae Pool 'AW8310' 4.5% 1/8/2044	8,158,215	0.09
USD 2,097,301	Fannie Mae Pool 'AW8487' 4.5% 1/11/2044	2,279,406	0.03
USD 4,864,835	Fannie Mae Pool 'AW8574' 4.5% 1/8/2044	5,285,632	0.06
USD 2,162,279	Fannie Mae Pool 'AW8860' 4.5% 1/10/2044	2,346,021	0.03
USD 3,357,139	Fannie Mae Pool 'AW8902' 4.5% 1/7/2044	3,641,983	0.04
USD 59,128	Fannie Mae Pool 'AW9024' 4.5% 1/8/2044	64,237	0.00
USD 571,664	Fannie Mae Pool 'AX0632' 4.5% 1/9/2044	621,968	0.01
USD 6,019,598	Fannie Mae Pool 'AX0847' 4.5% 1/9/2044	6,530,519	0.07
USD 1,000,001	Fannie Mae Pool 'AX2179' 4.5% 1/11/2044	1,087,750	0.01
USD 1,214,929	Fannie Mae Pool 'AX3140' 4.5% 1/10/2044	1,322,883	0.01
USD 2,899,359	Fannie Mae Pool 'AX3167' 4.5% 1/10/2044	3,142,871	0.03
USD 167,070	Fannie Mae Pool 'AX4387' 4.5% 1/11/2044	181,298	0.00
USD 2,391,678	Fannie Mae Pool 'AX5256' 4.5% 1/11/2044	2,600,046	0.03
USD 4,277,303	Fannie Mae Pool 'AX7253' 4.5% 1/11/2044	4,636,546	0.05
USD 6,941,129	Fannie Mae Pool 'AX7294' 4.5% 1/12/2044	7,524,103	0.08
USD 7,801,222	Fannie Mae Pool 'AX7309' 4.5% 1/12/2044	8,456,433	0.09
USD 1,000,001	Fannie Mae Pool 'AX7350' 4.5% 1/11/2044	1,084,384	0.01
USD 6,428,702	Fannie Mae Pool 'AY1321' 3.5% 1/3/2035	6,743,316	0.07
USD 6,753,115	Fannie Mae Pool 'AY3394' 3.5% 1/4/2035	7,083,618	0.08
USD 2,321,738	Fannie Mae Pool 'AY5647' 3.5% 1/6/2030	2,469,341	0.03
USD 8,918,122	Fannie Mae Pool 'AY7089' 3% 1/4/2035	9,128,987	0.10
USD 170,897	Fannie Mae Pool 'AY7964' 3.5% 1/5/2030	181,780	0.00
USD 2,239,190	Fannie Mae Pool 'AY8108' 3% 1/6/2035	2,292,132	0.03
USD 3,002,451	Fannie Mae Pool 'AY8148' 3% 1/7/2035	3,073,440	0.03
USD 1,878,350	Fannie Mae Pool 'AY8149' 3.5% 1/7/2035	1,970,284	0.02
USD 2,862,923	Fannie Mae Pool 'AY9042' 3% 1/5/2035	2,930,615	0.03
USD 499,043	Fannie Mae Pool 'AY9458' 3.5% 1/5/2030	530,765	0.01
USD 664,520	Fannie Mae Pool 'AZ1104' 3.5% 1/5/2030	706,752	0.01
USD 267,561	Fannie Mae Pool 'AZ1172' 3.5% 1/5/2030	284,565	0.00
USD 479,838	Fannie Mae Pool 'AZ1356' 3.5% 1/6/2030	510,261	0.01
USD 570,721	Fannie Mae Pool 'AZ1750' 3.5% 1/6/2030	603,600	0.01
USD 3,271,462	Fannie Mae Pool 'AZ3164' 3.5% 1/7/2030	3,479,156	0.04
USD 1,840,696	Fannie Mae Pool 'AZ3166' 3.5% 1/7/2030	1,946,884	0.02
USD 1,032,936	Fannie Mae Pool 'AZ3314' 3.5% 1/6/2030	1,098,535	0.01
USD 508,935	Fannie Mae Pool 'AZ5533' 3.5% 1/7/2030	541,475	0.01

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 292,800	Fannie Mae Pool 'AZ8383' 3.5% 1/8/2030	311,521	0.00
USD 34,535	Fannie Mae Pool 'MA0073' 4.5% 1/5/2029	37,436	0.00
USD 127,873	Fannie Mae Pool 'MA0096' 4.5% 1/6/2029	138,638	0.00
USD 2,542,354	Fannie Mae Pool 'MA1213' 3.5% 1/10/2042	2,651,481	0.03
USD 22,924,805	Fannie Mae Pool 'MA1437' 3.5% 1/5/2043	23,910,996	0.26
USD 185,147	Fannie Mae Pool 'MA2164' 3.5% 1/2/2035	194,198	0.00
USD 627,816	Fannie Mae Pool 'MA2176' 3% 1/2/2035	643,039	0.01
USD 4,224,290	Fannie Mae Pool 'MA2197' 3% 1/3/2035	4,324,082	0.05
USD 26,004,449	Fannie Mae Pool 'MA2230' 3% 1/4/2035	26,619,226	0.29
USD 12,264,275	Fannie Mae Pool 'MA2232' 3.5% 1/4/2035	12,864,478	0.14
USD 18,618,322	Fannie Mae Pool 'MA2259' 3% 1/5/2035	19,058,494	0.21
USD 7,433,973	Fannie Mae Pool 'MA2260' 3.5% 1/5/2035	7,797,810	0.09
USD 55,532,298	Fannie Mae Pool 'MA2287' 3% 1/6/2035	56,845,204	0.63
USD 67,784,202	Fannie Mae Pool 'MA2320' 3% 1/7/2035	69,386,783	0.76
USD 12,504,107	Fannie Mae Pool 'MA2321' 3.5% 1/7/2035	13,116,084	0.14
USD 36,503,369	Fannie Mae Pool 'MA2353' 3% 1/8/2035	37,366,404	0.41
USD 8,650,408	Fannie Mae Pool 'MA2354' 3.5% 1/8/2035	9,073,780	0.10
USD 17,942,071	Fannie Mae Pool 'MA2388' 3% 1/9/2035	18,360,677	0.20
USD 88,049	Fannie Mae Pool 'MC0444' 4.5% 1/3/2041	95,827	0.00
USD 985,000	Fannie Mae-Aces '2014-M13 A2' FRN 25/8/2024	1,005,888	0.01
USD 18,505,738	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K040 X1' FRN 25/9/2024	1,030,122	0.01
USD 38,188,850	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K041 X1' FRN 25/10/2024	1,632,688	0.02
USD 9,083,238	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K042 X1' FRN 25/12/2024	724,920	0.01
USD 9,841,070	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K044 X1' FRN 25/1/2025	570,871	0.01
USD 20,037,957	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K045 X1' FRN 25/1/2025	732,808	0.01
USD 36,647,305	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K718 X1' FRN 25/1/2022	1,325,277	0.01
USD 3,938,584	Fieldstone Mortgage Investment Trust Series '2006-3 2A3' FRN 25/11/2036	2,363,225	0.03
USD 750,000	Finn Square CLO Ltd '2012-1A B1' '144A' FRN 24/12/2023	747,351	0.01
USD 1,976,000	First Data Corp '144A' 7.375% 15/6/2019*	2,054,250	0.02
USD 724,186	FirstKey Lending 2015-SFR1 Trust '2015-SFR1 A' '144A' 2.553% 9/3/2047	721,399	0.01
USD 2,500,000	Flagship CLO VIII Ltd '2014-8A C' '144A' FRN 16/1/2026	2,497,211	0.03
USD 875,000	Flatiron CLO 2013-1 Ltd '2013-1A A1' '144A' FRN 17/1/2026	871,858	0.01
USD 1,800,000	Flatiron CLO Ltd '2012-1A C' '144A' FRN 25/10/2024	1,803,051	0.02
USD 7,250,000	Fraser Sullivan CLO VII Ltd '2012-7A A2R' '144A' FRN 20/4/2023	7,252,285	0.08

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 5,270,000	Fraser Sullivan CLO VII Ltd '2012-7A BR' '144A' FRN 20/4/2023	5,269,166	0.06
USD 4,300,000	Fraser Sullivan CLO VII Ltd '2012-7A CR' '144A' FRN 20/4/2023	4,298,188	0.05
USD 1,000,000	Fraser Sullivan CLO VII Ltd '2012-7A DR' '144A' FRN 20/4/2023	1,000,228	0.01
USD 325,095	Freddie Mac Gold Pool 'A90197' 4.5% 1/12/2039	352,479	0.00
USD 1,441,128	Freddie Mac Gold Pool 'A93316' 4.5% 1/8/2040	1,562,011	0.02
USD 308,001	Freddie Mac Gold Pool 'C03532' 4.5% 1/10/2040	334,849	0.00
USD 88,261,374	Freddie Mac Gold Pool 'C91826' 3% 1/5/2035	90,550,857	1.00
USD 64,894,012	Freddie Mac Gold Pool 'C91831' 3% 1/6/2035	66,577,382	0.73
USD 11,960,758	Freddie Mac Gold Pool 'C91832' 3.5% 1/6/2035	12,537,934	0.14
USD 79,111,611	Freddie Mac Gold Pool 'C91837' 3% 1/6/2035	81,163,846	0.89
USD 3,413,707	Freddie Mac Gold Pool 'C91838' 3.5% 1/6/2035	3,578,440	0.04
USD 57,881,587	Freddie Mac Gold Pool 'C91840' 3% 1/7/2035	59,252,738	0.65
USD 4,447,983	Freddie Mac Gold Pool 'C91841' 3.5% 1/7/2035	4,663,645	0.05
USD 17,230,481	Freddie Mac Gold Pool 'C91843' 3% 1/9/2035	17,638,652	0.19
USD 22,253,316	Freddie Mac Gold Pool 'G15194' 3.5% 1/9/2029	23,632,599	0.26
USD 52,389,277	Freddie Mac Gold Pool 'G15227' 3.5% 1/12/2029	55,619,987	0.61
USD 19,807,772	Freddie Mac Gold Pool 'G15229' 3.5% 1/11/2029	21,037,199	0.23
USD 4,006,454	Freddie Mac Gold Pool 'J27462' 3.5% 1/2/2029	4,252,696	0.05
USD 500,042	Freddie Mac Gold Pool 'J29016' 3.5% 1/8/2029	530,058	0.01
USD 1,834,342	Freddie Mac Gold Pool 'J31688' 3.5% 1/5/2030	1,948,523	0.02
USD 3,804,712	Freddie Mac Gold Pool 'J31736' 3.5% 1/5/2030	4,041,812	0.04
USD 198,335	Freddie Mac Gold Pool 'J31969' 3.5% 1/5/2030	210,318	0.00
USD 676,569	Freddie Mac Gold Pool 'J32490' 3.5% 1/8/2030	717,594	0.01
USD 1,050,166	Freddie Mac Gold Pool 'J32493' 3.5% 1/8/2030	1,115,807	0.01
USD 454,474	Freddie Mac Gold Pool 'J32494' 3.5% 1/8/2030	482,035	0.01
USD 558,844	Freddie Mac Gold Pool 'J32495' 3.5% 1/8/2030	593,776	0.01
USD 1,192,751	Freddie Mac Gold Pool 'K92609' 3.5% 1/4/2035	1,250,308	0.01
USD 2,549,351	Freddie Mac Gold Pool 'K92805' 3% 1/5/2035	2,615,480	0.03
USD 1,212,252	Freddie Mac Gold Pool 'K92814' 3.5% 1/6/2035	1,270,750	0.01
USD 1,854,773	Freddie Mac Gold Pool 'K92843' 3% 1/6/2035	1,902,886	0.02
USD 2,890,880	Freddie Mac Gold Pool 'K92851' 3% 1/6/2035	2,965,873	0.03
USD 3,783,345	Freddie Mac Gold Pool 'K92890' 3% 1/6/2035	3,881,495	0.04
USD 392,201	Freddie Mac Gold Pool 'K93070' 3% 1/8/2035	402,376	0.00
USD 2,698,844	Freddie Mac Gold Pool 'K93110' 3% 1/8/2035	2,768,859	0.03
USD 525,058	Freddie Mac Gold Pool 'K93182' 3% 1/9/2035	538,679	0.01
USD 1,095,467	Freddie Mac Gold Pool 'Q01211' 4.5% 1/6/2041	1,186,669	0.01
USD 29,702,066	Freddie Mac Gold Pool 'U90991' 3.5% 1/7/2042	30,979,285	0.34
USD 1,855,367	Freddie Mac Gold Pool 'U91014' 3.5% 1/3/2043	1,935,222	0.02
USD 33,418,277	Freddie Mac Gold Pool 'U99045' 3.5% 1/3/2043	34,854,250	0.38
USD 56,834,681	Freddie Mac Gold Pool 'U99114' 3.5% 1/2/2044	59,281,670	0.65
USD 938,821	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2014-HQ2 M3' FRN 25/9/2024	887,036	0.01

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 110,390,272	FREMF 2015-K718 Mortgage Trust '2015-K718 X2A' '144A' FRN 25/2/2022	582,309	0.01
USD 1,135,000	Fremont Union High School District 5% 1/8/2040	1,293,270	0.01
USD 1,560,000	GAHR Commercial Mortgage Trust '2015-NRF AFL1' '144A' FRN 15/12/2016	1,559,833	0.02
USD 360,000	GAHR Commercial Mortgage Trust '2015-NRF FFX' '144A' FRN 15/12/2019	332,237	0.00
USD 12,152,000	GAHR Commercial Mortgage Trust '2015-NRF GFX' '144A' FRN 15/12/2019	11,004,699	0.12
USD 550,000	Galaxy XVIII CLO Ltd '2014-18A C1' '144A' FRN 15/10/2026	543,073	0.01
EUR 1,200,000	Gates Global LLC / Gates Global Co 5.75% 15/7/2022	1,128,770	0.01
USD 2,000,000	General Electric Capital Corp FRN 15/6/2023 (Perpetual)	2,036,500	0.02
USD 975,000	General Motors Co 4.875% 2/10/2023	996,005	0.01
USD 2,070,000	General Motors Financial Co Inc 3.15% 15/1/2020	2,038,186	0.02
USD 2,404,560	GFT Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2015-GFT1 A' '144A' 3.721% 25/1/2055	2,380,514	0.03
USD 12,067,962	Ginnie Mae II Pool 'MA1376' 4% 20/10/2043	12,823,694	0.14
USD 16,598,791	Ginnie Mae II Pool 'MA1996' 4% 20/6/2044	17,638,306	0.19
USD 162,003,956	Ginnie Mae II Pool 'MA3034' 3.5% 20/8/2045	169,240,964	1.87
USD 4,000,000	Golden State Tobacco Securitization Corp 5.75% 1/6/2047	3,432,920	0.04
USD 703,000	GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd 3.819% 29/10/2026	680,155	0.01
USD 750,000	Goldentree Loan Opportunities XI Ltd '2015-11A D' '144A' FRN 18/4/2027	734,000	0.01
USD 750,000	Goldentree Loan Opportunities XI Ltd '2015-11A E' '144A' FRN 18/4/2027	702,223	0.01
USD 2,941,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 10/5/2020 (Perpetual)	2,889,533	0.03
USD 9,831,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.75% 22/5/2025	9,805,552	0.11
USD 1,894,000	Goldman Sachs Group Inc/The 5.15% 22/5/2045	1,880,422	0.02
USD 4,745,740	Government National Mortgage Association '2013-191 IA' 1.23% 16/7/2042	169,257	0.00
USD 4,171,008	Government National Mortgage Association 6.095% 16/4/2040	519,520	0.01
USD 2,530,000	GP Portfolio Trust '2014-GPP E' '144A' FRN 15/2/2027	2,534,250	0.03
USD 6,800,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust '2014-GRCE F' '144A' FRN 10/6/2028	6,533,025	0.07
USD 1,540,000	Gramercy Park CLO Ltd '2012-1AR DR' '144A' FRN 17/7/2023	1,534,029	0.02
EUR 6,416,473	Granite Master Issuer Plc '2005-4 A5' FRN 20/12/2054	7,175,125	0.08
USD 160,000	GS Mortgage Securities Corp II '2005-ROCK H' '144A' 5.713% 3/5/2032	181,052	0.00
USD 1,015,000	GS Mortgage Securities Corp Trust '2013-NYC5 F' '144A' FRN 10/1/2030	1,020,000	0.01
USD 515,000	GS Mortgage Securities Corp Trust '2013-NYC5 G' '144A' FRN 10/1/2030	509,100	0.01
USD 3,365,000	GS Mortgage Securities Trust '2014-GSFL D' '144A' FRN 15/7/2031	3,351,816	0.04
USD 420,000	GS Mortgage Securities Trust '2014-GSFL E' '144A' FRN 15/7/2031	417,676	0.00
USD 1,610,000	GS Mortgage Securities Trust '2006-GG6 AJ' FRN 10/4/2038	1,624,878	0.02

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,490,000	GT Loan Financing I Ltd '2013-1A A' '144A' FRN 28/10/2024	1,484,140	0.02
USD 878,000	Halcon Resources Corp '144A' 8.625% 1/2/2020*	771,543	0.01
USD 2,348,000	HCA Inc 8% 1/10/2018	2,706,070	0.03
USD 944,000	HD Supply Inc '144A' 5.25% 15/12/2021	973,500	0.01
USD 2,023,000	HD Supply Inc 7.5% 15/7/2020	2,167,645	0.02
USD 1,776,000	HD Supply Inc 11% 15/4/2020	1,975,800	0.02
USD 2,250,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 5% 1/1/2044	2,490,233	0.03
USD 1,272,000	Hertz Corp/The 7.5% 15/10/2018	1,300,620	0.01
USD 1,110,000	Highbridge Loan Management 4-2014 Ltd '4A-2014 B' '144A' FRN 28/7/2025	1,081,596	0.01
USD 430,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd '6A-2015 D' '144A' FRN 5/5/2027	403,742	0.00
USD 380,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd '6A-2015 E1' '144A' FRN 5/5/2027	340,162	0.00
USD 1,570,000	Hillsborough County Aviation Authority 5% 1/10/2044	1,707,171	0.02
USD 7,616,000	Hilton USA Trust '2013-HLT EFX' '144A' FRN 5/11/2030	7,669,468	0.08
USD 17,825,000	Hilton USA Trust '2013-HLT X1FX' '144A' FRN 5/11/2030	4,242	0.00
USD 482,878	Hilton USA Trust 3.908% 5/11/2030	482,446	0.01
USD 13,415,572	Home Equity Mortgage Loan Asset- Backed Trust Series '2006-E 2A3' FRN 25/4/2037	9,148,763	0.10
USD 2,210,228	Home Loan Mortgage Loan Trust '2005-1 A3' FRN 15/4/2036	1,966,942	0.02
USD 390,926	HomeBanc Mortgage Trust '2006-2 A1' FRN 25/12/2036	354,765	0.00
USD 6,079,000	HSBC USA Inc 2.35% 5/3/2020	5,997,608	0.07
USD 7,530,000	HSBC USA Inc 2.75% 7/8/2020	7,533,799	0.08
USD 943,000	Huntsman International LLC '144A' 5.125% 15/11/2022	894,671	0.01
USD 1,177,000	Hyundai Auto Receivables Trust '2013-B CERT' 16/9/2019 (Zero Coupon)	725,360	0.01
USD 528,000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 3.5% 15/3/2017	529,320	0.01
USD 720,000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.875% 15/3/2019	730,440	0.01
USD 850,000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6% 1/8/2020	882,938	0.01
USD 1,275,000	Illinois Finance Authority 5% 1/8/2038	1,406,975	0.02
USD 7,110,310	Impac CMB Trust Series '2005-7 A1' FRN 25/11/2035	5,990,436	0.07
USD 9,883,431	IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust '2007-HOA1 AXPP' 25/7/2047 (Zero Coupon)	881,434	0.01
USD 4,221,636	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust '2006-FLX1 A1' FRN 25/11/2036	3,617,047	0.04
USD 2,546,961	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust '2007-FLX2 A1A' FRN 25/4/2037	2,237,566	0.02
USD 1,000,000	ING IM CLO 2012-1 Ltd '2012-1RA BR' '144A' FRN 14/3/2022	1,006,865	0.01
USD 900,000	ING IM CLO 2012-1 Ltd '2012-1RA CR' '144A' FRN 14/3/2022	898,993	0.01
USD 351,000	Invitation Homes 2013-SFR1 Trust '2013-SFR1 F' '144A' FRN 17/12/2030	341,546	0.00
USD 1,493,000	Invitation Homes 2014-SFR1 Trust '2014-SFR1 A' '144A' FRN 17/6/2031	1,475,308	0.02

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,165,000	Invitation Homes 2014-SFR2 Trust '2014-SFR2 A' '144A' FRN 17/9/2031	1,154,461	0.01
USD 684,000	Invitation Homes 2015-SFR1 Trust '2015-SFR1 E' '144A' FRN 17/3/2032	687,207	0.01
USD 1,419,473	Irwin Home Equity Loan Trust '2006-P1 1A' '144A' FRN 25/12/2036	1,242,984	0.01
USD 389,000	iStar Inc 4% 1/11/2017	383,165	0.00
USD 945,000	Italics Merger Sub Inc '144A' 7.125% 15/7/2023	916,650	0.01
USD 751,837	JP Morgan Alternative Loan Trust '2007-A2 2A1' FRN 25/5/2037	622,571	0.01
USD 146,760,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-CSMO XCP' '144A' FRN 15/1/2016	62,957	0.00
USD 2,660,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-DSTY D' '144A' FRN 10/6/2027	2,604,641	0.03
USD 1,540,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-DSTY E' '144A' FRN 10/6/2027	1,450,965	0.02
USD 1,170,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-PHH B' '144A' FRN 15/8/2027	1,171,165	0.01
USD 1,595,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL4 C' '144A' FRN 15/12/2030	1,592,799	0.02
USD 3,910,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 A' '144A' FRN 15/11/2031	3,909,670	0.04
USD 1,080,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 BAT1' '144A' FRN 15/11/2031	1,080,000	0.01
USD 165,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 BAT2' '144A' FRN 15/11/2031	165,000	0.00
USD 2,170,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 DFW1' '144A' FRN 15/11/2031	2,034,375	0.02
USD 1,160,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 DFW2' '144A' FRN 15/11/2031	1,087,500	0.01
USD 355,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 TLAN' '144A' FRN 15/11/2031	355,000	0.00
USD 520,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 VINE' '144A' FRN 15/11/2031	520,000	0.01
USD 1,270,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-CSMO A' '144A' FRN 15/1/2032	1,268,732	0.01
USD 1,340,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-CSMO D' '144A' FRN 15/1/2032	1,339,369	0.01
USD 1,290,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-CSMO E' '144A' FRN 15/1/2032	1,282,664	0.01
USD 905,329	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2002-CIB4 C' '144A' FRN 12/5/2034	933,473	0.01
USD 1,250,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2006-CB15 AM' FRN 12/6/2043	1,268,475	0.01
USD 160,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2013-LC11 C' FRN 15/4/2046	156,402	0.00
USD 10,555,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2007-LDPX AM' FRN 15/1/2049	10,855,981	0.12
USD 1,160,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2007-CB20 AJ' FRN 12/2/2051	1,204,441	0.01
USD 2,357,802	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2008-C2 A4FL' FRN 12/2/2051	2,325,275	0.03
USD 920,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-DSTY A' '144A' 3.429% 10/6/2027	952,995	0.01

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,612,495	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2012-WLDN A' '144A' 3.905% 5/5/2030	1,689,096	0.02
USD 1,279,827	JP Morgan Madison Avenue Securities Trust Series '2014-1 M2' '144A' FRN 25/11/2024	1,318,606	0.01
USD 2,191,676	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust (Step-up coupon) '2006-WF1 A5' 6.41% 25/7/2036	1,332,526	0.01
USD 938,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C21 D' '144A' FRN 15/8/2047	834,553	0.01
USD 974,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C22 C' FRN 15/9/2047	944,444	0.01
USD 2,349,199	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C23 D' '144A' FRN 15/9/2047	2,000,074	0.02
USD 2,445,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C24 D' '144A' FRN 15/11/2047	2,111,691	0.02
USD 11,551,616	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C24 XA' FRN 15/11/2047	732,534	0.01
USD 7,006,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2015-C27 XD' '144A' FRN 15/2/2048	266,683	0.00
USD 7,836,372	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2015-C28 XA' FRN 15/10/2048	583,202	0.01
USD 3,800,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/5/2020 (Perpetual)	3,738,250	0.04
USD 2,181,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/10/2024 (Perpetual)	2,180,302	0.02
USD 13,844,000	JPMorgan Chase & Co 2.75% 23/6/2020	13,907,530	0.15
USD 11,031,000	JPMorgan Chase & Co 3.9% 15/7/2025	11,252,988	0.12
USD 1,010,000	Kansas Development Finance Authority 5% 1/6/2046	1,099,168	0.01
USD 505,000	Keuka Park CLO Ltd '2013-1A D' '144A' FRN 21/10/2024	481,609	0.01
USD 1,399,000	Kinder Morgan Energy Partners LP 4.7% 1/11/2042	1,049,998	0.01
USD 3,426,000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.625% 1/9/2041	3,008,932	0.03
USD 112,000	Kinder Morgan Inc/DE 3.05% 1/12/2019	109,909	0.00
USD 4,810,000	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2006-C4 AJ' FRN 15/6/2038	4,934,531	0.05
USD 800,000	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2006-C6 B' FRN 15/9/2039	805,312	0.01
USD 2,186,000	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2007-C2 AM' FRN 15/2/2040	2,288,864	0.03
USD 273,000	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2007-C6 AJ' FRN 15/7/2040	282,138	0.00
USD 605,000	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2005-C7 D' FRN 15/11/2040	613,656	0.01
USD 4,326,066	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2007-C7 AJ' FRN 15/9/2045	4,545,501	0.05
USD 1,154,000	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2007-C1 AJ' 5.484% 15/2/2040	1,190,030	0.01
USD 1,409,000	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2007-C6 AMFL' '144A' 6.114% 15/7/2040	1,497,980	0.02
USD 1,440,000	LCCM 2014-909 Mortgage Trust '2014-909 E' '144A' FRN 15/5/2031	1,401,566	0.02

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 2,140,000	LCM X LP '144A' FRN 15/4/2022	2,134,509	0.02
USD 455,000	LCM XV LP 21/9/2021 (Zero Coupon)	451,829	0.01
USD 670,000	LCM XVI LP '144A' FRN 15/7/2026	668,081	0.01
USD 830,000	LCM XVIII LP '18A C1' '144A' FRN 20/4/2027	819,552	0.01
USD 580,000	LCM XVIII LP '18A D' '144A' FRN 20/4/2027	570,793	0.01
USD 570,000	LCM XVIII LP '18A E' '144A' FRN 20/4/2027	525,954	0.01
USD 980,000	LCM XVIII LP '18A INC' '144A' FRN 20/4/2027	905,322	0.01
USD 572,000	Lennar Corp '144A' 2.75% 15/12/2020	1,299,513	0.01
USD 1,400,000	Lennar Corp 4.125% 1/12/2018	1,424,500	0.02
USD 7,394,000	LRFR '2015-1' '144A' 3.5% 31/12/2049	7,394,000	0.08
USD 2,165,000	Limerock CLO III LLC '2014-3A C' '144A' FRN 20/10/2026	2,111,124	0.02
USD 5,813,372	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-1 1A' FRN 25/2/2036	4,785,673	0.05
USD 2,552,544	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-1 2A3' FRN 25/2/2036	1,614,382	0.02
USD 6,456,247	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-6 1A' FRN 25/7/2036	4,616,010	0.05
USD 463,200	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-10 2A2' FRN 25/11/2036	226,768	0.00
USD 4,764,061	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-10 2A3' FRN 25/11/2036	2,347,210	0.03
USD 937,192	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-10 2A4' FRN 25/11/2036	466,181	0.01
USD 4,543,329	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-11 1A' FRN 25/12/2036	2,851,643	0.03
USD 3,660,000	Long Island Power Authority 5% 1/9/2044	4,012,495	0.04
USD 5,000,000	Los Angeles Department of Water 5% 1/7/2043	5,567,550	0.06
USD 70,000	Los Angeles Department of Water & Power 5% 1/7/2044	78,820	0.00
USD 2,915,000	Los Angeles Unified School District/CA 5% 1/7/2022	3,491,237	0.04
USD 3,289,152	LSTAR Securities Investment Trust '2015-1 A' '144A' FRN 1/1/2020	3,263,661	0.04
USD 2,265,922	LSTAR Securities Investment Trust '2015-2 A' '144A' FRN 1/1/2020	2,247,511	0.02
USD 3,886,528	LSTAR Securities Investment Trust '2015-3 A' '144A' FRN 1/3/2020	3,823,978	0.04
USD 7,909,624	LSTAR Securities Investment Trust '2014-1 NOTE' '144A' FRN 1/9/2021	7,919,511	0.09
USD 606,422	LSTAR Securities Investment Trust '2014-2 A' '144A' FRN 1/12/2021	599,600	0.01
USD 1,240,000	Madison Avenue Trust '2013-650M E' '144A' FRN 12/10/2032	1,226,922	0.01
USD 3,250,000	Madison Park Funding IX Ltd '2012-9AR DR' '144A' FRN 15/8/2022	3,249,836	0.04
USD 1,100,000	Madison Park Funding IX Ltd '2012-9AR B2R' '144A' 2.31% 15/8/2022	1,113,280	0.01

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,710,000	Madison Park Funding IX Ltd '2012-9AR C2R' '144A' 3.18% 15/8/2022	1,725,624	0.02
USD 626,000	Madison Park Funding VIII Ltd '2012-8AR CR' '144A' FRN 22/4/2022	626,991	0.01
USD 432,000	Madison Park Funding VIII Ltd '2012-8AR DR' '144A' FRN 22/4/2022	431,672	0.00
USD 1,005,000	Madison Park Funding X Ltd '2012-10A D' '144A' FRN 20/1/2025	1,007,563	0.01
USD 1,000,000	Madison Park Funding XI Ltd '2013-11A D' '144A' FRN 23/10/2025	970,646	0.01
USD 434,000	Madison Park Funding XIII Ltd '2014-13A C' '144A' FRN 19/1/2025	426,992	0.00
USD 750,000	Madison Park Funding XIII Ltd '2014-13A D' '144A' FRN 19/1/2025	721,175	0.01
USD 854,000	Madison Park Funding XIV Ltd '2014-14A D' '144A' FRN 20/7/2026	832,358	0.01
USD 280,000	Madison Park Funding XV Ltd '2014-15A B1' '144A' FRN 27/1/2026	280,913	0.00
USD 250,000	Madison Park Funding XV Ltd '2014-15A D' '144A' FRN 27/1/2026	233,479	0.00
USD 400,000	Madison Park Funding XVI Ltd '2015-16A A2A' '144A' FRN 20/4/2026	400,428	0.00
USD 250,000	Madison Park Funding XVI Ltd '2015-16A B' '144A' FRN 20/4/2026	250,012	0.00
USD 300,000	Madison Park Funding XVI Ltd '2015-16A C' '144A' FRN 20/4/2026	294,075	0.00
USD 1,135,000	Maryland Health & Higher Educational Facilities Authority 5% 1/7/2039	1,232,758	0.01
USD 835,000	Maryland Health & Higher Educational Facilities Authority 5.25% 1/7/2027	959,507	0.01
USD 4,215,000	Massachusetts Educational Financing Authority 5% 1/1/2022	4,680,905	0.05
USD 4,178,238	Mastr Asset Backed Securities Trust '2006-HE2 A3' FRN 25/6/2036	2,380,046	0.03
USD 2,879,095	MASTR Resecuritization Trust '2008-3 A1' '144A' FRN 25/8/2037	2,055,673	0.02
USD 1,200,000	McClatchy Co/The 9% 15/12/2022	1,087,500	0.01
USD 5,876,000	Medtronic Inc (Restricted) '144A' 4.625% 15/3/2045	6,048,837	0.07
USD 145,285	Merrill Lynch Mortgage Trust '2005-CIP1 AJ' FRN 12/7/2038	145,269	0.00
USD 783,472	Merrill Lynch Mortgage Trust '2007-C1 A1A' FRN 12/6/2050	815,898	0.01
USD 1,885,000	MetLife Inc FRN 15/6/2020 (Perpetual)	1,876,753	0.02
USD 3,430,000	Metropolitan Transportation Authority 5.25% 15/11/2055	3,806,734	0.04

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,010,000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 5% 1/10/2053	2,087,496	0.02
USD 200,000	Miami-Dade County Expressway Authority 5% 1/7/2039	220,693	0.00
USD 880,000	Michigan Finance Authority 5% 1/6/2039	951,113	0.01
USD 2,450,000	Micron Technology Inc 3% 15/11/2043	2,133,031	0.02
USD 1,500,000	Micron Technology Inc '144A' 5.625% 15/1/2026	1,376,250	0.02
USD 1,969,113	ML-CFC Commercial Mortgage Trust '2006-4 A1A' FRN 12/12/2049	2,042,782	0.02
USD 230,000	ML-CFC Commercial Mortgage Trust '2006-4 AM' FRN 12/12/2049	239,208	0.00
USD 19,245,000	Morgan Stanley 2.8% 16/6/2020	19,342,745	0.21
USD 10,057,000	Morgan Stanley 4% 23/7/2025	10,269,861	0.11
USD 90,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2013-C13 D' '144A' FRN 15/11/2046	88,400	0.00
USD 9,274,911	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2013-C13 XA' FRN 15/11/2046	629,354	0.01
USD 325,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2014-C14 C' FRN 15/2/2047	339,306	0.00
USD 15,240,730	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2014-C19 XA' FRN 15/12/2047	1,051,306	0.01
USD 11,026,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2014-C19 XD' '144A' FRN 15/12/2047	1,002,864	0.01
USD 3,510,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2015-C21 XB' '144A' FRN 15/3/2048	98,389	0.00
USD 52,057,317	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2015-C22 XA' FRN 15/4/2048	4,003,598	0.04
USD 2,138,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2014-CPT F' '144A' FRN 13/7/2029	2,010,337	0.02
USD 600,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2014-CPT G' '144A' FRN 13/7/2029	569,959	0.01
USD 1,400,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2014-150E F' '144A' FRN 9/9/2032	1,314,272	0.01
USD 780,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-HQ11 AMFL' FRN 12/2/2044	764,588	0.01
USD 345,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2006-HQ9 B' FRN 12/7/2044	352,080	0.00
USD 590,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-HQ12 AM' FRN 12/4/2049	619,758	0.01
USD 920,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-HQ12 AMFL' FRN 12/4/2049	897,992	0.01
USD 2,785,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-IQ15 AM' FRN 11/6/2049	2,958,120	0.03
USD 1,000,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2011-C3 D' '144A' FRN 15/7/2049	1,067,980	0.01

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,704,585	Morgan Stanley Capital I Trust '2005-IQ9 AJ' 4.77% 15/7/2056	1,728,430	0.02
USD 2,160,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-IQ13 AM' 5.406% 15/3/2044	2,263,193	0.03
USD 12,584,079	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust '2007-7AX 1A' FRN 25/4/2037	5,976,557	0.07
USD 2,353,280	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2006-15XS A2B' 5.507% 25/11/2036	1,550,798	0.02
USD 473,045	Morgan Stanley Re-REMIC Trust '2012-I0 AXB2' '144A' 1% 27/3/2051	471,271	0.01
USD 5,250,000	Morgan Stanley Re-REMIC Trust '2009-GG10 A4B' '144A' FRN 12/8/2045	5,571,234	0.06
USD 582,000	Morgan Stanley Re-REMIC Trust '2010-GG10 A4B' '144A' FRN 15/8/2045	614,985	0.01
USD 3,001,980	Morgan Stanley Re-REMIC Trust '2011-I0 C' '144A' 23/3/2051 (Zero Coupon)	2,911,920	0.03
USD 3,081,122	Morgan Stanley Resecuritization Trust '2014-R5 B1' '144A' FRN 26/11/2033	2,756,929	0.03
USD 1,375,000	Mountain Hawk II CLO Ltd '2013-2A A1' '144A' FRN 22/7/2024	1,358,824	0.02
USD 172,000	MSBAM Commercial Mortgage Securities Trust '2012-CKSV D' '144A' FRN 15/10/2030	166,655	0.00
USD 328,580	MSCC Heloc Trust '2007-1 A' FRN 25/12/2031	317,227	0.00
USD 1,447,106	Navient Private Education Loan Trust '2014-CTA A' '144A' FRN 16/9/2024	1,437,030	0.02
USD 16,121,000	Navient Private Education Loan Trust '2015-AA A2B' '144A' FRN 15/12/2028	16,232,533	0.18
USD 6,300,000	Navient Private Education Loan Trust '2014-AA A2B' '144A' FRN 15/2/2029	6,323,965	0.07
USD 2,149,000	Navient Private Education Loan Trust '2015-AA A3' '144A' FRN 15/11/2030	2,134,851	0.02
USD 4,370,000	Navient Private Education Loan Trust '2014-AA A3' '144A' FRN 15/10/2031	4,310,443	0.05
USD 3,365,000	Navient Private Education Loan Trust '2014-CTA B' '144A' FRN 17/10/2044	3,299,113	0.04
USD 12,215,000	Navient Private Education Loan Trust '2014-AA A2A' '144A' 2.74% 15/2/2029	12,273,705	0.14
USD 3,020,000	Navient Private Education Loan Trust '2014-AA B' '144A' 3.5% 15/8/2044	2,793,553	0.03
USD 2,278,000	Navient Private Education Loan Trust '2015-AA B' '144A' 3.5% 15/12/2044	2,103,027	0.02
USD 1,870,000	Nelnet Student Loan Trust '2014-2A A3' '144A' FRN 27/7/2037	1,726,671	0.02
USD 250,000	Neuberger Berman CLO XII Ltd '2012-12AR ER' '144A' FRN 25/7/2023	251,213	0.00

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 250,000	Neuberger Berman CLO XVI Ltd '2014-16A D' '144A' FRN 15/4/2026	236,375	0.00
USD 542,000	Neuberger Berman CLO XVII Ltd '2014-17A D' '144A' FRN 4/8/2025	516,239	0.01
USD 510,000	Neuberger Berman CLO XVIII Ltd '2014-18A B' '144A' FRN 14/11/2025	506,595	0.01
USD 250,000	Neuberger Berman CLO XVIII Ltd '2014-18A C' '144A' FRN 14/11/2025	243,160	0.00
USD 790,000	New Jersey Economic Development Authority 5% 15/6/2029	804,568	0.01
USD 740,000	New Jersey Economic Development Authority 5% 15/6/2030	748,869	0.01
USD 820,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5% 15/6/2042	806,855	0.01
USD 1,210,000	New York City Transitional Finance Authority Building Aid Revenue 5% 15/7/2036	1,383,121	0.02
USD 1,390,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2032	1,609,314	0.02
USD 1,390,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2036	1,588,972	0.02
USD 1,250,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2038	1,421,894	0.02
USD 295,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2039	334,857	0.00
USD 835,000	New York State Dormitory Authority 'A' 5% 15/3/2037	951,837	0.01
USD 1,290,000	New York State Dormitory Authority 'C' 5% 15/3/2037	1,452,992	0.02
USD 1,460,000	New York State Thruway Authority 5% 1/1/2031	1,664,159	0.02
USD 1,215,000	New York State Urban Development Corp 5% 15/3/2044	1,354,160	0.02
USD 1,370,000	NextGear Floorplan Master Owner Trust '2015-1A B' '144A' FRN 15/7/2019	1,370,932	0.02
USD 660,000	NextGear Floorplan Master Owner Trust '2014-1A B' '144A' 2.61% 15/10/2019	656,624	0.01
USD 125,000	North Carolina Medical Care Commission 5% 1/6/2040	136,159	0.00
USD 1,330,000	North Carolina Medical Care Commission 5% 1/6/2045	1,441,993	0.02
USD 1,560,000	North Dakota Public Finance Authority 5% 1/6/2045	1,736,764	0.02
USD 129,356	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	134,692	0.00
USD 1,096,000	NRG Energy Inc 7.625% 15/1/2018	1,167,240	0.01
USD 1,715,000	Oaktree EIF II Series A2 Ltd '2014-A2 B' '144A' FRN 15/11/2025	1,705,069	0.02
USD 1,515,000	Oaktree EIF II Series A2 Ltd '2014-A2 C' '144A' FRN 15/11/2025	1,494,634	0.02
USD 450,000	Oaktree EIF II Series B1 Ltd '2015-B1A B' '144A' FRN 15/2/2026	447,863	0.01
USD 650,000	Oaktree EIF II Series B1 Ltd '2015-B1A C' '144A' FRN 15/2/2026	636,996	0.01
USD 440,000	OCP CLO Ltd '2015-8A A1' '144A' FRN 17/4/2027	437,789	0.00
USD 570,000	OCP CLO Ltd '2015-8A A2A' '144A' FRN 17/4/2027	565,044	0.01
USD 1,230,000	Octagon Investment Partners XII Ltd '2012-1AR ER' '144A' FRN 5/5/2023	1,225,640	0.01

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 935,000	Octagon Investment Partners XII Ltd 4.038% 5/5/2023	935,364	0.01
USD 1,075,000	Octagon Investment Partners XVII Ltd '2013-1A A1' '144A' FRN 25/10/2025	1,063,806	0.01
USD 335,000	Octagon Investment Partners XX Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 12/8/2026	324,451	0.00
USD 1,325,000	Octagon Investment Partners XXI Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 14/11/2026	1,281,674	0.01
USD 3,000,000	Octagon Investment Partners XXI Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 14/11/2026	2,975,236	0.03
USD 1,300,000	Octagon Investment Partners XXII Ltd '2014-1A B2' '144A' FRN 22/11/2025	1,301,019	0.01
USD 555,000	Octagon Investment Partners XXII Ltd '2014-1A C1' '144A' FRN 22/11/2025	550,882	0.01
USD 460,000	Octagon Investment Partners XXII Ltd '2014-1A D1' '144A' FRN 22/11/2025	450,538	0.01
USD 255,000	Octagon Investment Partners XXII Ltd '2014-1A E1' '144A' FRN 22/11/2025	233,413	0.00
USD 250,000	OHA Credit Partners VII Ltd '2012-7A A' '144A' FRN 20/11/2023	249,969	0.00
USD 430,000	OHA Intrepid Leveraged Loan Fund Ltd '2011-1AR DR' '144A' FRN 20/4/2021	431,132	0.00
USD 1,360,000	OHA Loan Funding Ltd '2013-2A A' '144A' FRN 23/8/2024	1,353,395	0.02
USD 14,715,000	OneMain Financial Issuance Trust '2014-1A A' '144A' 2.43% 18/6/2024	14,899,526	0.16
USD 5,743,000	OneMain Financial Issuance Trust '2014-2A A' '144A' 2.47% 18/9/2024	5,768,614	0.06
USD 9,000,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-2A A' '144A' 2.57% 18/7/2025	9,009,450	0.10
USD 1,745,000	OneMain Financial Issuance Trust '2014-2A B' '144A' 3.02% 18/9/2024	1,751,125	0.02
USD 16,601,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-2A B' '144A' 3.1% 18/7/2025	16,568,794	0.18
USD 4,435,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-1A A' '144A' 3.19% 18/3/2026	4,487,320	0.05
USD 8,583,000	OneMain Financial Issuance Trust '2014-1A B' '144A' 3.24% 18/6/2024	8,662,285	0.10
USD 5,300,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-2A C' '144A' 4.32% 18/7/2025	5,299,841	0.06
USD 2,565,000	OneMain Financial Issuance Trust '2014-2A C' '144A' 4.33% 18/9/2024	2,584,699	0.03
USD 1,503,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-1A C' '144A' 5.12% 18/3/2026	1,536,532	0.02
USD 4,550,000	OneMain Financial Issuance Trust '2014-2A D' '144A' 5.31% 18/9/2024	4,525,976	0.05

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,620,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-2A D' '144A' 5.64% 18/7/2025	2,619,450	0.03
USD 2,088,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-1A D' '144A' 6.63% 18/3/2026	2,150,577	0.02
USD 5,305,000	Option One Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2007- FXD1 3A4' 5.86% 25/1/2037	5,009,687	0.06
USD 2,103,000	Oracle Corp 3.9% 15/5/2035	1,996,399	0.02
USD 2,030,000	Oracle Corp 4.125% 15/5/2045	1,925,087	0.02
USD 1,215,000	Orange County Sanitation District 5% 1/2/2029	1,447,782	0.02
USD 1,000,000	Orange County Sanitation District 5% 1/2/2034	1,165,595	0.01
USD 875,000	OZLM Funding III Ltd '2013-3A C' '144A' FRN 22/1/2025	869,966	0.01
USD 400,000	OZLM Funding III Ltd '2013-3A D' '144A' FRN 22/1/2025	368,006	0.00
USD 395,000	OZLM Funding Ltd '2012-2A B' '144A' FRN 30/10/2023	394,949	0.00
USD 1,250,000	OZLM Funding Ltd '2012-1A DR' '144A' FRN 22/7/2027	1,250,534	0.01
USD 532,000	OZLM VII Ltd '2014-7A C' '144A' FRN 17/7/2026	511,559	0.01
USD 666,000	OZLM VII Ltd '2014-7A D' '144A' FRN 17/7/2026	601,572	0.01
USD 2,725,000	OZLM VIII Ltd '2014-8A A2A' '144A' FRN 17/10/2026	2,730,130	0.03
USD 305,000	OZLM VIII Ltd '2014-8A B' '144A' FRN 17/10/2026	303,786	0.00
USD 1,315,000	OZLM VIII Ltd '2014-8A C' '144A' FRN 17/10/2026	1,258,280	0.01
USD 531,000	OZLM XI Ltd '2015-11A B' '144A' FRN 30/1/2027	530,451	0.01
USD 874,000	OZLM XI Ltd '2015-11A C1' '144A' FRN 30/1/2027	864,480	0.01
USD 449,000	OZLM XI Ltd '2015-11A D' '144A' FRN 30/1/2027	415,125	0.00
USD 620,000	OZLM XII Ltd '2015-12A A1' '144A' FRN 30/4/2027	618,613	0.01
USD 1,160,000	OZLM XII Ltd '2015-12A A2' '144A' FRN 30/4/2027	1,143,044	0.01
USD 290,000	OZLM XII Ltd '2015-12A B' '144A' FRN 30/4/2027	283,890	0.00
USD 2,375,000	OZLM XII Ltd '2015-12A C' '144A' FRN 30/4/2027	2,288,409	0.03
USD 500,000	OZLM XII Ltd '2015-12A D' '144A' FRN 30/4/2027	458,208	0.01
USD 335,000	OZLM XIII Ltd '2015-13A C' '144A' FRN 30/7/2027	335,050	0.00
USD 875,000	Palmer Square CLO 2014-1 Ltd '2014-1A B' '144A' FRN 17/10/2022	872,860	0.01
USD 530,000	Palmer Square CLO 2014-1 Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 17/10/2022	523,228	0.01
USD 129,120	Paragon Mortgages No 13 Plc FRN 15/1/2039	119,860	0.00
USD 1,045,000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2022	1,180,845	0.01
USD 1,450,000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2038	1,537,051	0.02
USD 1,000,000	Permanent Master Issuer Plc '2011-2X 1A3' FRN 15/7/2042	1,001,361	0.01
USD 1,000,000	PFS Financing Corp '2013-AA B' '144A' FRN 15/2/2018	1,000,884	0.01
USD 540,000	PFS Financing Corp 1.107% 15/2/2019	537,842	0.01
USD 905,000	Philadelphia Authority for Industrial Development 5% 1/7/2042	1,010,957	0.01
USD 620,000	Pinnacle Park CLO Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 15/4/2026	601,429	0.01
USD 250,000	Pinnacle Park CLO Ltd '2014-1A E' '144A' FRN 15/4/2026	227,053	0.00
USD 260,000	Port Auth N Y & N J 4.926% 1/10/2051	283,007	0.00

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,135,000	Port Authority of New York & New Jersey 5% 15/10/2044	1,238,177	0.01
USD 436,896	Prime Mortgage Trust '2006-DR1 2A1' '144A' 5.5% 25/5/2035	419,274	0.00
USD 770,000	Private Colleges & Universities Authority 5% 1/4/2044	813,405	0.01
USD 418,000	Progress Residential 2014-SFR1 Trust '2014-SFR1 F' '144A' FRN 17/10/2031	414,548	0.00
USD 978,000	Progress Residential 2015-SFR1 Trust '2015-SFR1 E' '144A' FRN 17/2/2032	986,292	0.01
USD 2,979,000	Progress Residential Trust '2015-SFR1 A' '144A' FRN 17/2/2032	2,967,923	0.03
USD 2,030,000	Progress Residential Trust '2015-SFR2 A' '144A' 2.74% 12/6/2032	2,014,203	0.02
USD 945,000	Project Homestake Merger Corp '144A' 8.875% 1/3/2023	845,775	0.01
USD 745,000	Race Point V CLO Ltd '2011-5AR DR' '144A' FRN 15/12/2022	745,345	0.01
USD 705,000	Race Point VI CLO Ltd '2012-6A E' '144A' FRN 24/5/2023	698,008	0.01
USD 2,375,000	Race Point VIII CLO Ltd '2013-8A A' '144A' FRN 20/2/2025	2,357,095	0.03
USD 510,037	RAIT 2014-FL3 Trust '2014-FL3 C' '144A' FRN 15/12/2031	506,201	0.01
USD 4,793,000	RAMP Series 2006-RZ4 Trust '2006-RZ4 A3' FRN 25/10/2036	4,073,240	0.05
USD 1,711,667	RBSSP Resecuritization Trust '2013-4 1A1' '144A' FRN 26/12/2037	1,653,389	0.02
USD 296,872	RCMC LLC '2012-CRE1 A' '144A' 5.623% 15/11/2044	302,738	0.00
USD 260,000	Regatta IV Funding Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 25/7/2026	256,042	0.00
USD 310,000	Regatta IV Funding Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 25/7/2026	295,483	0.00
USD 585,000	Regatta V Funding Ltd '2014-1A B' '144A' FRN 25/10/2026	570,155	0.01
USD 1,025,000	Regatta V Funding Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 25/10/2026	960,401	0.01
USD 505,000	Regatta V Funding Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 25/10/2026	441,797	0.00
USD 1,078,000	Regency Energy Partners LP / Regency Energy Finance Corp 5% 1/10/2022	1,066,499	0.01
USD 1,250,000	Reliance Holding USA Inc 5.4% 14/2/2022	1,359,329	0.02
USD 1,000,000	Resource Capital Corp 2014-CRE2 Ltd '2014-CRE2 A' '144A' FRN 15/4/2032	994,082	0.01
USD 715,000	Resource Capital Corp 2014-CRE2 Ltd '2014-CRE2 B' '144A' FRN 15/4/2032	713,008	0.01
USD 2,131,000	Reynolds American Inc 3.25% 12/6/2020	2,164,330	0.02
USD 1,330,000	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu 5.75% 15/10/2020	1,379,210	0.02
USD 3,383,630	RMAT 2015-RPL1 LLC (Step-up coupon) '2015-RPL1 A1' '144A' 3.967% 26/5/2020	3,395,425	0.04
USD 1,300,000	Rockwood Specialties Group Inc 4.625% 15/10/2020	1,351,188	0.01
USD 548,000	Rolta Americas LLC 8.875% 24/7/2019	320,580	0.00
USD 1,060,000	Ryland Group Inc/The 1.625% 15/5/2018	1,523,088	0.02
USD 1,545,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15/5/2024	1,500,581	0.02
USD 2,215,000	Sabine Pass LNG LP 7.5% 30/11/2016	2,278,681	0.03

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 1,304,545	SACO I Trust '2006-9 A1' FRN 25/8/2036	1,702,438	0.02
USD 1,635,000	Sales Tax Asset Receivable Corp 5% 15/10/2024	2,020,500	0.02
USD 1,020,000	Sales Tax Asset Receivable Corp 5% 15/10/2028	1,222,164	0.01
USD 2,330,000	Sales Tax Asset Receivable Corp 5% 15/10/2029	2,777,185	0.03
USD 208,372	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-S1 R' '144A' 1.42% 16/8/2018	208,622	0.00
USD 431,132	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-S2 R' '144A' 1.43% 16/11/2018	432,008	0.00
USD 342,104	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-S3 R' '144A' 1.43% 19/2/2019	343,004	0.00
USD 595,513	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-S4 R' '144A' 1.43% 16/4/2019	597,288	0.01
USD 652,445	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-S5 R' '144A' 1.43% 18/6/2019	649,183	0.01
USD 595,583	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-S6 R' '144A' 1.43% 17/12/2019	596,667	0.01
USD 3	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-S1 R' '144A' 1.42% 16/8/2018	1,049,750	0.01
USD 3	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-S2 R' '144A' 1.43% 16/11/2018	700,000	0.01
USD 3	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-S3 R' '144A' 1.43% 19/2/2019	1,251,250	0.01
USD 3	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-S4 R' '144A' 1.43% 16/4/2019	1,657,500	0.02
USD 1,220,000	SCG Trust '2013-SRP1 AJ' '144A' FRN 15/11/2026	1,224,452	0.01
EUR 400,000	Sealed Air Corp 4.5% 15/9/2023	463,863	0.01
USD 1,750,000	Seneca Park CLO Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 17/7/2026	1,738,485	0.02
USD 1,060,000	Seneca Park CLO Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 17/7/2026	1,026,144	0.01
USD 250,000	Seneca Park CLO Ltd '2014-1A SUB' '144A' 17/7/2026 (Zero Coupon)	211,969	0.00
USD 1,096,000	Service Corp International/US 7% 15/6/2017	1,183,680	0.01
USD 1,415,000	SESI LLC 7.125% 15/12/2021	1,457,450	0.02
USD 820,000	Silver Bay Realty 2014-1 Trust '2014-1 F' '144A' FRN 17/9/2031	794,788	0.01
USD 525,000	Silver Bay Realty 2014-1 Trust 3.423% 17/9/2031	508,669	0.01
USD 903,005	Silver Bay Realty Trust '2014-1 A' '144A' FRN 17/9/2031	890,270	0.01
USD 750,163	SLC Private Student Loan Trust '2006-A A5' FRN 15/7/2036	743,451	0.01
USD 3,900,000	SLC Private Student Loan Trust '2006-A C' FRN 15/7/2036	3,534,299	0.04
USD 115,660	SLM Private Credit Student Loan Trust '2004-B A2' FRN 15/6/2021	115,117	0.00
USD 156,673	SLM Private Credit Student Loan Trust '2003-B A2' FRN 15/3/2022	154,514	0.00
USD 914,556	SLM Private Credit Student Loan Trust '2005-B A2' FRN 15/3/2023	906,266	0.01

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 578,518	SLM Private Credit Student Loan Trust '2006-C A4' FRN 15/3/2023	571,318	0.01
USD 4,486,701	SLM Private Credit Student Loan Trust '2006-A A4' FRN 15/12/2023	4,438,365	0.05
USD 7,810,000	SLM Private Credit Student Loan Trust '2004-B A3' FRN 15/3/2024	7,495,292	0.08
USD 704,231	SLM Private Credit Student Loan Trust '2006-B A4' FRN 15/3/2024	699,329	0.01
USD 2,354,414	SLM Private Credit Student Loan Trust '2007-A A2' FRN 15/9/2025	2,332,869	0.03
USD 1,340,000	SLM Private Credit Student Loan Trust '2007-A A3' FRN 15/12/2026	1,281,136	0.01
USD 5,534,000	SLM Private Credit Student Loan Trust '2004-A A3' FRN 15/6/2033	5,271,235	0.06
USD 6,218,000	SLM Private Credit Student Loan Trust '2006-B A5' FRN 15/12/2039	5,438,822	0.06
USD 367,471	SLM Private Education Loan Trust '2014-A A1' '144A' FRN 15/7/2022	366,509	0.00
USD 4,325,000	SLM Private Education Loan Trust '2014-A A2B' '144A' FRN 15/1/2026	4,325,316	0.05
USD 6,050,000	SLM Private Education Loan Trust '2013-A A2B' '144A' FRN 17/5/2027	6,033,320	0.07
USD 1,305,000	SLM Private Education Loan Trust '2013-B A2B' '144A' FRN 17/6/2030	1,302,952	0.01
USD 2,840,000	SLM Private Education Loan Trust '2011-B A3' '144A' FRN 16/6/2042	2,994,098	0.03
USD 2,460,000	SLM Private Education Loan Trust '2011-A A3' '144A' FRN 15/1/2043	2,604,650	0.03
USD 1,239,000	SLM Private Education Loan Trust '2012-E A2B' '144A' FRN 15/6/2045	1,265,838	0.01
USD 225,000	SLM Private Education Loan Trust '2013-A A2A' '144A' 1.77% 17/5/2027	222,704	0.00
USD 795,000	SLM Private Education Loan Trust '2013-B A2A' '144A' 1.85% 17/6/2030	788,826	0.01
USD 4,235,000	SLM Private Education Loan Trust '2013-A B' '144A' 2.5% 15/3/2047	4,118,425	0.05
USD 1,500,000	SLM Private Education Loan Trust '2014-A A2A' '144A' 2.59% 15/1/2026	1,524,432	0.02
USD 6,027,000	SLM Private Education Loan Trust '2013-C A2A' '144A' 2.94% 15/10/2031	6,200,508	0.07
USD 2,690,000	SLM Private Education Loan Trust '2013-B B' '144A' 3% 16/5/2044	2,653,678	0.03
USD 1,600,000	SLM Private Education Loan Trust '2012-C A2' '144A' 3.31% 15/10/2046	1,640,190	0.02

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,875,000	SLM Private Education Loan Trust '2012-B A2' '144A' 3.48% 15/10/2030	1,929,306	0.02
USD 2,475,000	SLM Private Education Loan Trust '2013-C B' '144A' 3.5% 15/6/2044	2,493,811	0.03
USD 4,740,000	SLM Private Education Loan Trust '2014-A B' '144A' 3.5% 15/11/2044	4,673,455	0.05
USD 860,000	SLM Student Loan '2011-CX' 4.54% 17/10/2044	925,145	0.01
USD 2,080,000	SMB Private Education Loan Trust '2014-A A2B' '144A' FRN 15/5/2026	2,073,629	0.02
USD 2,000,000	SMB Private Education Loan Trust '2015-B A2B' '144A' FRN 15/7/2027	1,990,000	0.02
USD 5,300,000	SMB Private Education Loan Trust '2015-B A3' '144A' FRN 17/5/2032	5,287,578	0.06
USD 4,560,000	SMB Private Education Loan Trust '2015-B B' '144A' 3.5% 17/12/2040	4,199,441	0.05
USD 3,100,000	SoFi Professional Loan Program '2015-B A1' '144A' FRN 25/4/2035	3,097,546	0.03
USD 2,658,020	SoFi Professional Loan Program '2015-A A2' '144A' 2.42% 25/3/2030	2,664,170	0.03
USD 5,920,000	SoFi Professional Loan Program '2015-B A2' '144A' 2.51% 27/9/2032	5,939,826	0.07
USD 520,322	SoFi Professional Loan Program 2014-A LLC '2014-A A1' '144A' FRN 25/6/2025	526,953	0.01
USD 2,647,684	SoFi Professional Loan Program 2014-A LLC '2014-A A2' '144A' 3.02% 25/10/2027	2,707,361	0.03
USD 3,320,842	SoFi Professional Loan Program LLC '2014-B A2' '144A' 2.55% 27/8/2029	3,340,516	0.04
USD 3,275,000	Solarcity Lmc Series IV LLC '2015-1 B' '144A' 5.58% 21/8/2045	3,227,165	0.04
USD 1,175,000	Sound Point CLO I Ltd '2012-1A C' '144A' FRN 20/10/2023	1,178,011	0.01
USD 2,035,000	Sound Point CLO II Ltd '2013-1A A3L' '144A' FRN 26/4/2025	1,979,578	0.02
USD 750,000	Sound Point CLO III Ltd '2013-2A D' '144A' FRN 15/7/2025	739,100	0.01
USD 1,340,000	Sound Point CLO III Ltd '2013-2A E' '144A' FRN 15/7/2025	1,196,548	0.01
USD 615,000	Sound Point CLO IV Ltd '2013-3A A' '144A' FRN 21/1/2026	611,283	0.01
USD 525,000	Sound Point CLO IV Ltd '2013-3A D' '144A' FRN 21/1/2026	504,719	0.01
USD 700,000	Sound Point CLO IX Ltd '2015-2A D' '144A' FRN 20/7/2027	668,243	0.01
USD 700,000	Sound Point CLO IX Ltd '2015-2A E' '144A' FRN 20/7/2027	640,742	0.01
USD 1,750,000	Sound Point CLO V Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 18/4/2026	1,718,965	0.02
USD 2,025,000	Sound Point CLO VII Ltd '2014-3A A' '144A' FRN 23/1/2027	2,017,691	0.02
USD 590,000	Sound Point CLO VII Ltd '2014-3A D' '144A' FRN 23/1/2027	566,677	0.01

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 400,000	Sound Point CLO VIII Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 15/4/2027	392,549	0.00
USD 500,000	Sound Point CLO VIII Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 15/4/2027	482,581	0.01
USD 3,335,000	South Carolina State Public Service Authority 5% 1/12/2046	3,585,125	0.04
USD 1,535,000	South Carolina Transportation Infrastructure Bank 5% 1/10/2023	1,838,999	0.02
USD 1,460,000	South Carolina Transportation Infrastructure Bank 5% 1/10/2024	1,758,789	0.02
USD 9,790,761	SpringCastle America Funding LLC '2014-AA A' '144A' 2.7% 25/5/2023	9,832,866	0.11
USD 10,180,000	SpringCastle America Funding LLC '2014-AA B' '144A' 4.61% 25/10/2027	10,399,786	0.11
USD 11,187,000	Springleaf Funding Trust '2015-AA B' '144A' 3.62% 15/11/2024	11,349,077	0.13
USD 2,326,000	Sprint Communications Inc '144A' 9% 15/11/2018	2,596,979	0.03
USD 3,165,000	Sprint Corp 7.875% 15/9/2023	3,055,839	0.03
USD 1,204,000	Standard Pacific Corp 10.75% 15/9/2016	1,318,380	0.01
USD 1,455,000	State of California 5% 1/10/2037	1,651,345	0.02
USD 705,000	State of California 5.5% 1/3/2016	722,181	0.01
USD 1,570,000	State of Minnesota 5% 1/8/2032	1,865,670	0.02
USD 785,000	State of Minnesota 5% 1/8/2035	923,176	0.01
USD 2,745,000	State of New Jersey 5% 1/6/2027	3,126,212	0.03
USD 3,475,000	State of New Jersey 5% 1/6/2032	3,841,665	0.04
USD 3,800,000	State of Washington 5% 1/7/2031	4,427,836	0.05
USD 950,000	State of Washington 5% 1/7/2032	1,107,800	0.01
USD 575,000	Steele Creek CLO 2014-1 Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 21/8/2026	562,736	0.01
USD 1,045,000	Stewart Park CLO Ltd '2015-1A E' '144A' FRN 15/4/2026	966,549	0.01
USD 3,560,000	STRIPs 2012-1 Ltd '2012-1A B' '144A' 0.5% 25/12/2044	3,168,400	0.04
USD 289,953	STRIPs 2012-1 Ltd '2012-1A A' '144A' 1.5% 25/12/2044	284,154	0.00
USD 2,146,627	Structured Asset Mortgage Investments II Trust '2005-AR8 A1A' FRN 25/2/2036	1,751,105	0.02
USD 3,078,704	Structured Asset Mortgage Investments II Trust '2006-AR2 A1' FRN 25/2/2036	2,447,791	0.03
USD 1,352,000	SunGard Data Systems Inc 6.625% 1/11/2019	1,409,460	0.02
USD 1,600,000	Symphony CLO Ltd '2012-10AR CR' '144A' FRN 23/7/2023	1,604,132	0.02
USD 3,180,000	Symphony CLO Ltd '2012-10AR ER' '144A' FRN 23/7/2023	3,183,578	0.04
USD 1,800,000	Symphony CLO Ltd 4.144% 23/7/2023	1,797,312	0.02
USD 370,000	Symphony CLO VII Ltd '2011-7A B' '144A' FRN 28/7/2021	370,732	0.00
USD 360,000	Symphony CLO VII Ltd '2011-7A F' '144A' FRN 28/7/2021	360,814	0.00
USD 1,370,000	Symphony CLO VIII LP '2012-8AR ER' '144A' FRN 9/1/2023	1,374,370	0.02
USD 4,000,000	Symphony CLO XII Ltd '2013-12A A' '144A' FRN 15/10/2025	3,983,240	0.04
USD 810,000	Symphony CLO XV Ltd '2014-15A C' '144A' FRN 17/10/2026	810,056	0.01

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,275,000	Symphony CLO XV Ltd '2014-15A D' '144A' FRN 17/10/2026	1,252,941	0.01
USD 425,000	Symphony CLO XV Ltd '2014-15A E' '144A' FRN 17/10/2026	387,507	0.00
USD 445,000	Tenet Healthcare Corp 6% 1/10/2020	479,209	0.01
USD 952,000	Tenet Healthcare Corp 8.125% 1/4/2022	1,054,340	0.01
USD 2,363,072	Thornburg Mortgage Securities Trust '2007-3 4A1' FRN 25/6/2047	2,284,992	0.03
USD 5,000,000	TICP CLO I Ltd '2014-1A A1' '144A' FRN 26/4/2026	4,970,788	0.05
USD 290,000	TICP CLO I Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 20/7/2027	284,853	0.00
USD 290,000	TICP CLO I Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 20/7/2027	275,183	0.00
USD 750,000	TICP CLO II Ltd '2014-2A B' '144A' FRN 20/7/2026	739,234	0.01
USD 2,095,000	TICP CLO III Ltd '2014-3A A' '144A' FRN 20/1/2027	2,094,250	0.02
USD 615,000	TICP CLO III Ltd '2014-3A C' '144A' FRN 20/1/2027	615,238	0.01
USD 500,000	TICP CLO III Ltd '2014-3A D1' '144A' FRN 20/1/2027	483,249	0.01
USD 525,000	TICP CLO III Ltd '2014-3A D2' '144A' FRN 20/1/2027	520,309	0.01
USD 3,511,000	Time Warner Cable Inc 4% 1/9/2021	3,540,252	0.04
USD 3,215,000	Time Warner Cable Inc 4.125% 15/2/2021	3,285,095	0.04
USD 1,631,000	Time Warner Cable Inc 5% 1/2/2020	1,755,004	0.02
USD 1,096,000	T-Mobile USA Inc 5.25% 1/9/2018	1,124,770	0.01
USD 640,000	T-Mobile USA Inc 6.633% 28/4/2021	672,000	0.01
USD 620,000	T-Mobile USA Inc 6.731% 28/4/2022	652,550	0.01
USD 195,000	T-Mobile USA Inc 6.836% 28/4/2023	205,725	0.00
USD 1,855,000	Tobacco Settlement Financing Corp/NJ 5% 1/6/2041	1,404,254	0.02
USD 1,525,000	TransDigm Inc 6% 15/7/2022	1,511,885	0.02
USD 1,400,000	Treman Park CLO LLC '2015-1A D' '144A' FRN 20/4/2027	1,383,775	0.02
USD 11,930,000	Triaxx Prime CDO 2006-1 Ltd '2006-1A A2' '144A' FRN 3/3/2039	2,356,649	0.03
USD 1,260,000	Tricon American Homes Trust '2015-SFR1 A' '144A' FRN 17/5/2032	1,245,843	0.01
USD 2,114,044	U.S. Residential Opportunity Fund IV Trust '2015-11V A' '144A' 3.721% 27/2/2035	2,113,729	0.02
USD 215,623	UAL 2007-1 Pass Through Trust 6.636% 2/7/2022	229,908	0.00
USD 4,085,987	UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust '2012-C2 XA' '144A' FRN 10/5/2063	281,578	0.00
USD 3,274,698	United Airlines 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/8/2021	3,377,032	0.04
USD 1,383,000	United Rentals North America Inc 4.625% 15/7/2023	1,353,611	0.02
USD 945,000	United Rentals North America Inc 5.75% 15/11/2024	930,825	0.01
USD 699,000,000	United States Treasury Bill 3/9/2015 (Zero Coupon)	699,000,350	7.71
USD 670,000,000	United States Treasury Bill 10/9/2015 (Zero Coupon)	669,998,660	7.39
USD 328,000,000	United States Treasury Bill 17/9/2015 (Zero Coupon)	327,999,836	3.62
USD 185,000,000	United States Treasury Bill 24/9/2015 (Zero Coupon)	184,999,723	2.04
USD 608,000,000	United States Treasury Bill 27/11/2015 (Zero Coupon)	607,925,824	6.70
USD 7,822,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2019	7,951,842	0.09

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 100,580,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2020	102,126,685	1.13
USD 80,186,900	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.25% 15/1/2025* †	78,143,854	0.86
USD 76,322,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.375% 15/7/2025 †	75,576,522	0.83
USD 89,595,000	United States Treasury Note/Bond 0.625% 31/8/2017	89,451,508	0.99
USD 57,285,000	United States Treasury Note/Bond 1.375% 31/8/2020	56,978,436	0.63
USD 1,565,000	United States Treasury Note/Bond 1.625% 31/7/2020 †	1,575,148	0.02
USD 57,310,000	United States Treasury Note/Bond 1.875% 31/8/2022	57,332,386	0.63
USD 254,625,500	United States Treasury Note/Bond 2% 15/8/2025 †	251,462,573	2.77
USD 1,198,000	United States Treasury Note/Bond 2.5% 15/2/2045	1,105,342	0.01
USD 66,995,000	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/8/2045 †	67,136,318	0.74
USD 2,054,000	UnitedHealth Group Inc 2.7% 15/7/2020	2,084,631	0.02
USD 2,029,000	UnitedHealth Group Inc 3.35% 15/7/2022	2,083,597	0.02
USD 1,370,000	University of Arizona 5% 1/8/2039	1,526,153	0.02
USD 1,060,000	University of Kentucky 5% 1/10/2027	1,266,557	0.01
USD 2,500,000	University of Massachusetts Building Authority 5% 1/11/2044	2,825,188	0.03
USD 242,992	US Airways 2012-1 Class C Pass Through Trust 9.125% 1/10/2015	244,462	0.00
USD 3,058,541	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.95% 15/11/2025	3,085,915	0.03
USD 908,891	US Airways 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/11/2021	941,839	0.01
USD 3,770,904	US Residential Opportunity Fund III Trust '2015-1111 A' '144A' 3.721% 27/1/2035	3,770,833	0.04
USD 1,402,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2014-1 M1' '144A' FRN 25/9/2044	1,402,000	0.02
USD 937,000	Venture X CLO Ltd '2012-10A C' '144A' FRN 20/7/2022	938,168	0.01
USD 750,000	Venture XI CLO Ltd '2012-11AR CR' '144A' FRN 14/11/2022	748,724	0.01
USD 1,075,000	Venture XI CLO Ltd '2012-11AR DR' '144A' FRN 14/11/2022	1,066,600	0.01
USD 625,000	Venture XI CLO Ltd '2012-11AR ER' '144A' FRN 14/11/2022	625,669	0.01
USD 375,000	Venture XII CLO Ltd '2012-12A D' '144A' FRN 28/2/2024	365,703	0.00
USD 850,000	VENTURE XIII CLO Ltd '2013-13A D' '144A' FRN 10/6/2025	824,082	0.01
USD 2,045,000	Venture XIX CLO Ltd '2014-19A A' '144A' FRN 15/1/2027	2,050,014	0.02
USD 1,095,000	Venture XIX CLO Ltd '2014-19A B' '144A' FRN 15/1/2027	1,090,067	0.01
USD 670,000	Venture XIX CLO Ltd '2014-19A C' '144A' FRN 15/1/2027	672,401	0.01
USD 2,500,000	Venture XVI CLO Ltd '2014-16A A3L' '144A' FRN 15/4/2026	2,426,401	0.03
USD 521,000	Venture XVII CLO Ltd '2014-17A C' '144A' FRN 15/7/2026	510,106	0.01
USD 779,000	Venture XVIII CLO Ltd '2014-18A C' '144A' FRN 15/10/2026	772,624	0.01
USD 475,000	Venture XVIII CLO Ltd '2014-18A D' '144A' FRN 15/10/2026	458,416	0.01
USD 1,430,000	Venture XX CLO Ltd '2015-20A B1' '144A' FRN 15/4/2027	1,420,446	0.02

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 730,000	Venture XX CLO Ltd '2015-20A C' '144A' FRN 15/4/2027	729,024	0.01
USD 330,000	Venture XX CLO Ltd '2015-20A D' '144A' FRN 15/4/2027	320,659	0.00
USD 1,470,000	Venture XXI CLO Ltd 3.783% 15/7/2027	1,399,000	0.02
USD 2,500,000	Vibrant CLO II Ltd '2013-2A B' '144A' FRN 24/7/2024	2,421,961	0.03
USD 885,000	VNDO 2013-PENN Mortgage Trust '2013-PENN E' '144A' FRN 13/12/2029	878,511	0.01
USD 1,260,000	Voya 2012-4 Ltd '2012-4A A1' '144A' FRN 15/10/2023	1,261,169	0.01
USD 835,000	Voya 2012-4 Ltd '2012-4A C' '144A' FRN 15/10/2023	841,285	0.01
USD 624,000	Voya CLO 2013-1 Ltd '2013-1A A1' '144A' FRN 15/4/2024	618,116	0.01
USD 1,000,000	Voya CLO 2013-3 Ltd '2013-3A A1' '144A' FRN 18/1/2026	993,918	0.01
USD 685,000	Voya CLO 2013-3 Ltd '2013-3A B' '144A' FRN 18/1/2026	676,734	0.01
USD 915,000	Voya CLO 2014-3 Ltd '2014-3A C' '144A' FRN 25/7/2026	878,747	0.01
USD 510,000	Voya CLO 2014-4 Ltd '2014-4A A2A' '144A' FRN 14/10/2026	510,017	0.01
USD 295,000	Voya CLO 2014-4 Ltd '2014-4A B' '144A' FRN 14/10/2026	293,088	0.00
USD 775,000	Voya CLO 2014-4 Ltd '2014-4A C' '144A' FRN 14/10/2026	764,617	0.01
USD 425,000	Voya CLO 2014-4 Ltd '2014-4A D' '144A' FRN 14/10/2026	398,907	0.00
USD 275,000	Voya CLO 2015-1 Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 18/4/2027	258,070	0.00
USD 2,520,000	Voya CLO Ltd '2012-2AR BR' '144A' FRN 15/10/2022	2,520,441	0.03
USD 3,090,000	Voya CLO Ltd '2012-2AR CR' '144A' FRN 15/10/2022	3,089,822	0.03
USD 1,480,000	Voya CLO Ltd '2012-2AR DR' '144A' FRN 15/10/2022	1,479,756	0.02
USD 520,000	Voya CLO Ltd '2012-2AR ER' '144A' FRN 15/10/2022	519,219	0.01
USD 1,855,000	Voya CLO Ltd '2013-2A A1' '144A' FRN 25/4/2025	1,839,336	0.02
USD 5,010,000	Voya CLO Ltd '2014-4A A1' '144A' FRN 14/10/2026	5,000,249	0.06
USD 692,590	Wachovia Asset Securitization Issuance II LLC Trust '2007-HE2A A' '144A' FRN 25/7/2037	613,529	0.01
USD 1,116,063	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2006-WL7A H' '144A' FRN 15/9/2021	1,091,530	0.01
USD 3,253,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2006-C28 AJ' FRN 15/10/2048	3,309,339	0.04
USD 690,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C32 AMFL' '144A' FRN 15/6/2049	673,489	0.01
USD 1,590,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C33 AJ' FRN 15/2/2051	1,639,992	0.02
USD 690,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2006-C29 AM' 5.339% 15/11/2048	717,073	0.01
USD 1,106,047	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust '2007-OA5 1A' FRN 25/6/2047	918,994	0.01
USD 3,515,000	Washington Health Care Facilities Authority 5% 1/10/2038	3,884,585	0.04
USD 4,000,000	Washington Mill CLO Ltd '2014-1A A1' '144A' FRN 20/4/2026	3,996,677	0.04
USD 2,821,865	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2007-OA1 Trust '2007-OA1 2A' FRN 25/12/2046	1,919,822	0.02

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,285,261	Washington Mutural Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust '2006-HE5 2A2' FRN 25/10/2036	2,302,685	0.03
USD 1,838,000	Wells Fargo & Co FRN 15/6/2024 (Perpetual)	1,847,190	0.02
USD 10,147,000	Wells Fargo & Co 2.6% 22/7/2020	10,170,252	0.11
USD 1,390,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2014-TISH SCH2' '144A' FRN 15/1/2027	1,372,899	0.02
USD 12,705,107	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-C27 XA' FRN 15/2/2048	894,859	0.01
USD 8,716,612	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-NXS1 XA' FRN 15/5/2048	691,188	0.01
USD 3,400,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-NXS1 XB' FRN 15/5/2048	131,697	0.00
USD 2,069,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-C27 C' 3.894% 15/2/2048	1,913,941	0.02
USD 360,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2012-C8 C' FRN 15/8/2045	380,766	0.00
USD 10,272,135	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2012-C8 XA' '144A' FRN 15/8/2045	937,466	0.01
USD 508,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2014-LC14 D' '144A' FRN 15/3/2047	471,811	0.01
USD 10,089,779	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2014-LC14 XA' FRN 15/3/2047	786,443	0.01
USD 17,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2014-C22 B' FRN 15/9/2057	17,578	0.00
USD 10,911,265	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2014-C22 XA' FRN 15/9/2057	664,502	0.01
USD 15,027,733	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2014-C23 XA' FRN 15/10/2057	666,240	0.01
USD 280,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2012-C8 B' 4.311% 15/8/2045	293,731	0.00
USD 490,000	WhiteHorse IX Ltd '2014-9A C' '144A' FRN 17/7/2026	467,433	0.01
USD 1,215,000	Wisconsin Health & Educational Facilities Authority 5% 15/8/2039	1,317,072	0.01
USD 670,000	World Financial Network Credit Card Master Trust '2012-D B' 3.34% 17/4/2023	693,284	0.01
USD 845,000	World Financial Network Credit Card Master Trust '2012-C C' 4.55% 15/8/2022	882,559	0.01
USD 300,000	XPO Logistics Inc '144A' 6.5% 15/6/2022	295,125	0.00
USD 945,000	Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc '144A' 6% 1/4/2023	945,586	0.01
USD 1,430,000	Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc 10.125% 1/7/2020	1,576,575	0.02
EUR 2,400,000	ZF North America Capital Inc 2.25% 26/4/2019	2,673,722	0.03
EUR 8,000,000	ZF North America Capital Inc 2.75% 27/4/2023	8,510,046	0.09
USD 430,000	Zigurat CLO I Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 17/10/2026	426,919	0.00
		7,156,978,210	78.89

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ベトナム		
USD 500,000	Vietnam Joint Stock Commercial Bank for Industry and Trade 8% 17/5/2017	515,000	0.01
USD 1,000,000	Vingroup JSC 5% 3/4/2017	1,248,750	0.01
USD 2,110,000	Vingroup JSC 11.625% 7/5/2018	2,236,600	0.02
		4,000,350	0.04
債券合計		9,294,570,330	102.45
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		9,324,484,523	102.78

その他の譲渡可能な有価証券

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	債券		
	ルクセンブルグ		
EUR 6,695,189	Atalaya Luxco Pikco 11.5% 30/5/2016 (Perpetual)	7,632,523	0.08
	米国		
USD 5,368,047	American Homes 4 Rent '2015-SFR1 XS' '144A' FRN 17/4/2052	-	0.00
USD 15,173,778	Boca Hotel Portfolio Trust '2013-BOCA XCP' '144A' FRN 15/8/2018	593	0.00
USD 32,058	City of Detroit MI 'B1' 4% 1/4/2044	19,375	0.00
USD 10,218	City of Detroit MI 'B2' 4% 1/4/2044	6,175	0.00
USD 2,391	Lehman Brothers Holdings Inc (Defaulted) 31/12/2049 (Zero Coupon)	188	0.00
USD 2,391	Lehman Brothers Special Finance (Defaulted) 31/12/2049 (Zero Coupon)	86	0.00
USD 9	Lehman XS Trust Series '2006-12N A2A2' (Defaulted) FRN 25/8/2046	9	0.00
		26,426	0.00
債券合計		7,658,949	0.08
その他の譲渡可能な有価証券合計		7,658,949	0.08
投資有価証券合計		9,332,143,472	102.86
その他の純負債		(260,015,530)	(2.86)
純資産合計(米ドル)		9,072,127,942	100.00

* 貸付有価証券。詳細については注記13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15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。

事後通告証券契約 2015年8月31日現在

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
	米国		
USD (175,336,000)	Fannie Mae Pool '2.5 9/15' 2.5% TBA	(178,089,319)	(1.96)
USD 158,700,000	Fannie Mae Pool '3 10/15' 3% TBA	164,446,670	1.81
USD 180,000,000	Fannie Mae Pool '3 9/15' 3% TBA	186,876,558	2.06
USD (216,714,000)	Fannie Mae Pool '3 9/15' 3% TBA	(218,057,692)	(2.40)
USD (223,700,000)	Fannie Mae Pool '3 10/15' 3% TBA	(224,536,493)	(2.48)
USD (204,058,000)	Fannie Mae Pool '3.5 9/15' 3.5% TBA	(211,765,924)	(2.33)
USD 482,600,000	Fannie Mae Pool '3.5 10/15' 3.5% TBA	499,622,846	5.51
USD 117,710,000	Fannie Mae Pool '3.5 9/15' 3.5% TBA	124,064,492	1.37
USD (447,231,000)	Fannie Mae Pool '4 9/15' 4% TBA	(475,563,084)	(5.24)
USD (130,100,000)	Fannie Mae Pool '4 10/15' 4% TBA	(138,036,913)	(1.52)
USD (76,548,000)	Fannie Mae Pool '4.5 10/15' 4.5% TBA	(82,872,147)	(0.91)
USD (176,274,667)	Fannie Mae Pool '4.5 9/15' 4.5% TBA	(191,103,764)	(2.11)
USD (10,569,000)	Freddie Mac Gold Pool '3 9/15' 3% TBA	(10,602,853)	(0.12)
USD (3,000,000)	Freddie Mac Gold Pool '3.5 9/15' 3.5% TBA	(3,106,553)	(0.03)
USD (6,537,000)	Freddie Mac Gold Pool '3.5 9/15' 3.5% TBA	(6,880,448)	(0.08)
USD 700,000	Ginnie Mae I Pool '3 9/15' 3% TBA	710,090	0.01
USD 907,000	Ginnie Mae II Pool '3.5 9/15' 3.5% TBA	945,494	0.01
USD 174,822,000	Ginnie Mae II Pool '4 9/15' 4% TBA	185,451,300	2.04
USD 438,000,000	Ginnie Mae II Pool '4 10/15' 4% TBA	464,083,207	5.11
USD 23,700,000	Ginnie Mae II Pool '4 11/15' 4% TBA	25,078,950	0.28
T B A 合計		(89,335,583)	(0.98)

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

未決済先渡為替予約 2015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)
BRL	1,734,321	USD	495,379	Goldman Sachs	2/9/2015	(22,968)
BRL	7,331,046	USD	2,091,000	UBS	2/9/2015	(94,100)
BRL	4,391,820	USD	1,202,000	BNP Paribas	2/9/2015	(5,714)
BRL	12,457,370	USD	3,530,000	BNY Mellon	2/9/2015	(136,742)
BRL	17,080,715	USD	4,824,000	Morgan Stanley	2/9/2015	(171,391)
BRL	27,230,504	USD	7,903,000	RBS Plc	2/9/2015	(485,695)
BRL	17,880,609	USD	5,211,333	Deutsche Bank	2/9/2015	(340,841)
BRL	9,297,998	USD	2,614,000	Citibank	2/9/2015	(81,322)
BRL	6,178,064	USD	1,743,000	Credit Suisse	2/9/2015	(60,160)
USD	1,744,000	BRL	6,188,584	UBS	2/9/2015	58,294
USD	8,482,000	BRL	30,059,593	RBS Plc	2/9/2015	294,080
USD	2,118,000	BRL	7,542,198	BNY Mellon	2/9/2015	63,584
USD	4,797,000	BRL	16,543,202	Deutsche Bank	2/9/2015	290,805
USD	9,858,712	BRL	33,776,654	BNP Paribas	2/9/2015	658,304
USD	2,614,000	BRL	9,182,982	JP Morgan	2/9/2015	112,651
EUR	7,214,000	USD	8,070,736	Morgan Stanley	3/9/2015	31,813
EUR	139,851,000	USD	156,627,779	Goldman Sachs	3/9/2015	448,687
JPY	4,561,655,000	USD	37,749,545	Barclays	3/9/2015	(91,251)
JPY	8,382,391,000	USD	66,989,395	RBS Plc	3/9/2015	2,210,608
USD	644,888	EUR	580,000	State Street	3/9/2015	(6,551)
USD	7,167,780	EUR	6,499,000	HSBC Bank Plc	3/9/2015	(131,703)
USD	1,741,555	EUR	1,560,716	Goldman Sachs	3/9/2015	(11,395)
USD	1,178,460,228	EUR	1,061,109,000	UBS	3/9/2015	(13,345,703)
USD	318,527,906	GBP	204,622,000	HSBC Bank Plc	3/9/2015	3,432,227
USD	17,851,638	GBP	11,435,000	Goldman Sachs	3/9/2015	242,979
USD	70,484,089	JPY	8,758,656,000	Bank of America	3/9/2015	(1,822,132)
USD	70,444,067	JPY	8,758,656,000	UBS	3/9/2015	(1,862,155)
USD	166,736	JPY	20,600,000	HSBC Bank Plc	3/9/2015	(3,325)
				Standard Chartered		
USD	5,619,200	ZAR	71,340,953	Bank London	3/9/2015	271,629
ZAR	72,074,629	USD	5,619,200	BNP Paribas	3/9/2015	(216,634)
COP	2,758,926,528	USD	868,800	BNY Mellon	4/9/2015	16,143
COP	11,029,416,000	USD	3,475,200	BNP Paribas	4/9/2015	62,552
EUR	3,394,000	USD	3,764,998	Credit Suisse	4/9/2015	47,097
EUR	4,185,600	USD	4,635,971	UBS	4/9/2015	65,239
EUR	2,488,600	USD	2,723,706	BNP Paribas	4/9/2015	71,456
USD	4,344,000	COP	12,516,975,360	Credit Suisse	4/9/2015	329,104
USD	3,790,928	EUR	3,394,000	Goldman Sachs	4/9/2015	(21,167)
USD	7,387,173	EUR	6,674,200	BNP Paribas	4/9/2015	(109,198)
BRL	12,312,720	USD	3,528,000	Goldman Sachs	7/9/2015	(179,965)
MYR	18,421,396	USD	4,357,000	UBS	8/9/2015	32,734
RUB	146,297,180	USD	2,539,000	Societe Generale	8/9/2015	(369,563)
USD	3,528,000	BRL	12,318,012	JP Morgan	8/9/2015	179,691

未決済先渡為替予約 2015年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	4,357,000	MYR	16,918,231	JP Morgan	8/9/2015	325,464
USD	2,539,000	RUB	147,350,865	Societe Generale	8/9/2015	353,938
CNY	101,230,842	USD	16,218,000	Citibank	9/9/2015	(372,525)
CNY	101,194,644	USD	16,218,000	Bank of America	9/9/2015	(378,191)
CNY	101,207,879	USD	16,218,000	Goldman Sachs	9/9/2015	(376,119)
CNY	101,195,941	USD	16,218,000	Deutsche Bank	9/9/2015	(377,988)
CNY	101,205,114	USD	16,218,000	UBS	9/9/2015	(376,552)
USD	20,982,356	CNH	136,888,888	UBS	9/9/2015	(239,196)
USD	8,030,471	CNH	51,888,888	Barclays	9/9/2015	(13,737)
USD	7,727,000	CNH	49,520,327	Deutsche Bank	9/9/2015	49,984
USD	58,461,171	CNH	372,967,084	HSBC Bank Plc	9/9/2015	640,989
USD	9,271,829	CNH	59,421,608	JP Morgan	9/9/2015	59,842
USD	5,630,000	CNY	35,179,489	Citibank	9/9/2015	123,420
USD	4,101,705	JPY	508,888,888	Bank of America	9/9/2015	(99,836)
USD	529,969	RUB	30,714,368	Deutsche Bank	9/9/2015	74,657
IDR	8,991,882,900	USD	645,505	Deutsche Bank	10/9/2015	(8,022)
IDR	1,000,000,000	USD	73,395	HSBC Bank Plc	10/9/2015	(2,499)
INR	333,888,888	USD	5,117,855	UBS	10/9/2015	(104,485)
USD	2,208,621	IDR	30,317,573,751	Deutsche Bank	10/9/2015	59,245
USD	747,308	IDR	10,170,857,725	Citibank	10/9/2015	26,241
USD	218,296,778	INR	14,060,822,907	UBS	10/9/2015	7,172,327
USD	2,417,967	THB	85,438,878	BNY Mellon	10/9/2015	35,331
CLP	7,208,473,506	USD	10,456,800	Credit Suisse	11/9/2015	(111,897)
MYR	12,618,583	USD	3,137,000	JP Morgan	11/9/2015	(128,794)
USD	7,842,600	CLP	5,351,659,530	Credit Suisse	11/9/2015	162,417
USD	2,614,200	CLP	1,773,551,706	Deutsche Bank	11/9/2015	68,970
USD	7,059,392	JPY	842,442,918	Goldman Sachs	11/9/2015	103,674
USD	6,289,144	MXN	105,677,913	Credit Suisse	11/9/2015	35,550
USD	3,137,000	MYR	12,469,575	UBS	11/9/2015	164,317
CAD	3,457,208	USD	2,614,000	Goldman Sachs	14/9/2015	(18,120)
KRW	4,114,525,800	USD	3,486,000	JP Morgan	14/9/2015	(11,267)
KRW	5,093,481,750	USD	4,357,500	BNP Paribas	14/9/2015	(56,036)
MXN	60,439,226	USD	3,556,800	Goldman Sachs	14/9/2015	18,958
MXN	74,517,664	USD	4,420,000	JP Morgan	14/9/2015	(11,321)
MXN	148,129,358	USD	8,789,000	UBS	14/9/2015	(25,241)
MXN	57,571,556	USD	3,416,300	Morgan Stanley	14/9/2015	(10,201)
MYR	17,732,990	USD	4,357,000	Goldman Sachs	14/9/2015	(127,781)
MYR	6,969,912	USD	1,739,000	BNP Paribas	14/9/2015	(76,715)
RUB	134,240,384	USD	2,346,245	BNP Paribas	14/9/2015	(359,533)
USD	2,614,000	CAD	3,458,084	Goldman Sachs	14/9/2015	17,463
USD	34,134,783	INR	2,198,280,037	JP Morgan	14/9/2015	1,158,377
USD	8,715,000	KRW	10,220,952,000	Goldman Sachs	14/9/2015	83,368

未決済先渡為替予約 2015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	2,647,000	MXN	45,515,019	Deutsche Bank Standard Chartered	14/9/2015	(45,799)
USD	3,135,000	MYR	12,862,905	Bank London	14/9/2015	67,269
USD	12,120,100	RUB	693,693,919	HSBC Bank Plc	14/9/2015	1,853,668
MXN	375,823,869	USD	22,818,000	Bank of America	15/9/2015	(584,822)
USD	13,390,777	JPY	1,669,380,000	Goldman Sachs	15/9/2015	(393,634)
AUD	23,420,000	USD	17,429,433	Citibank	16/9/2015	(817,945)
AUD	17,599,000	USD	13,001,678	Goldman Sachs	16/9/2015	(518,946)
AUD	71,802,000	USD	53,062,933	Bank of America	16/9/2015	(2,134,746)
CAD	4,064,945	GBP	2,000,000	HSBC Bank Plc	16/9/2015	(27,369)
CHF	4,483,324	USD	4,810,000	HSBC Bank Plc	16/9/2015	(166,125)
CNH	31,669,000	USD	5,000,000	Citibank	16/9/2015	(94,597)
EUR	2,000,000	PLN	8,497,844	BNY Mellon	16/9/2015	(13,434)
EUR	1,320,000	PLN	5,528,043	BNP Paribas	16/9/2015	12,553
EUR	4,335,000	PLN	18,208,084	Goldman Sachs	16/9/2015	27,000
EUR	1,880,000	USD	2,084,944	HSBC Bank Plc	16/9/2015	27,015
EUR	38,900,000	USD	42,986,417	Citibank	16/9/2015	713,164
EUR	43,465,000	USD	47,993,966	Bank of America	16/9/2015	833,856
EUR	19,870,000	USD	21,947,866	BNP Paribas	16/9/2015	373,746
EUR	23,440,000	USD	26,704,841	JP Morgan	16/9/2015	(372,754)
EUR	1,765,000	USD	1,969,237	RBS Plc	16/9/2015	13,533
EUR	53,674,000	USD	59,659,543	Goldman Sachs	16/9/2015	636,891
GBP	2,000,000	USD	3,080,600	Toronto Dominion	16/9/2015	(1,038)
GBP	13,760,000	USD	21,436,704	Bank of America	16/9/2015	(249,317)
IDR	151,492,999,116	USD	10,859,713	Deutsche Bank	16/9/2015	(151,402)
JPY	2,601,004,945	USD	21,730,000	BNP Paribas	16/9/2015	(252,581)
JPY	237,838,200	USD	2,000,000	BNY Mellon	16/9/2015	(36,086)
JPY	242,718,780	USD	2,000,000	Morgan Stanley	16/9/2015	4,215
JPY	277,566,297	USD	2,290,000	JP Morgan	16/9/2015	1,963
JPY	1,752,373,460	USD	14,200,000	Goldman Sachs	16/9/2015	269,968
JPY	5,663,621,250	USD	45,750,000	Deutsche Bank	16/9/2015	1,016,527
JPY	138,668,660	USD	1,145,000	Bank of America	16/9/2015	36
NOK	207,855,521	EUR	23,684,000	Bank of America	16/9/2015	(1,775,036)
NOK	15,896,173	USD	1,915,000	Morgan Stanley	16/9/2015	(15,987)
NOK	16,343,420	USD	2,000,000	Deutsche Bank	16/9/2015	(47,557)
PLN	3,805,634	EUR	905,000	Goldman Sachs	16/9/2015	(4,464)
PLN	8,467,900	EUR	2,000,000	BNY Mellon	16/9/2015	5,470
PLN	8,466,058	EUR	2,000,000	Morgan Stanley	16/9/2015	4,980
PLN	12,090,316	EUR	2,885,000	Deutsche Bank	16/9/2015	(25,259)
PLN	4,036,790	EUR	960,000	Citibank	16/9/2015	(4,769)
PLN	3,805,543	EUR	905,000	JP Morgan	16/9/2015	(4,489)
SGD	3,227,484	USD	2,300,000	Citibank	16/9/2015	(16,629)
SGD	2,640,179	USD	1,890,000	UBS	16/9/2015	(22,134)

未決済先渡為替予約 2015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	37,921,162	AUD	49,049,833	HSBC Bank Plc	16/9/2015	3,130,779
USD	3,080,000	CAD	4,070,436	HSBC Bank Plc	16/9/2015	23,684
USD	4,810,000	CHF	4,535,963	Barclays	16/9/2015	111,601
USD	5,000,000	CNH	31,181,500	HSBC Bank Plc	16/9/2015	170,109
				Royal Bank		
USD	6,311,903	EUR	5,605,000	of Canada	16/9/2015	15,343
USD	55,250,551	EUR	50,590,000	Goldman Sachs	16/9/2015	(1,581,371)
USD	22,517,876	EUR	19,555,000	RBS Plc	16/9/2015	550,130
USD	35,327,113	EUR	31,576,532	State Street	16/9/2015	(145,412)
USD	980,253	EUR	880,000	BNP Paribas	16/9/2015	(8,324)
USD	23,711,730	EUR	21,177,000	Citibank	16/9/2015	(78,142)
USD	9,386,974	EUR	8,220,000	Deutsche Bank	16/9/2015	152,769
USD	10,740,492	GBP	6,880,000	Goldman Sachs	16/9/2015	146,799
USD	10,740,926	GBP	6,880,000	BNP Paribas	16/9/2015	147,233
USD	13,532,646	IDR	182,638,882,464	Deutsche Bank	16/9/2015	622,782
USD	4,772,932	IDR	64,434,579,983	UBS	16/9/2015	218,362
USD	3,435,000	JPY	402,198,997	Westpac	16/9/2015	113,900
USD	47,456,491	JPY	5,893,075,060	Goldman Sachs	16/9/2015	(1,204,717)
USD	1,000,000	JPY	123,944,650	State Street	16/9/2015	(23,455)
USD	2,000,000	NOK	16,375,161	Barclays	16/9/2015	43,765
USD	2,300,000	SGD	3,224,830	JP Morgan	16/9/2015	18,507
USD	1,890,000	SGD	2,657,246	HSBC Bank Plc	16/9/2015	10,060
CAD	3,000,000	MXN	38,099,087	Deutsche Bank	17/9/2015	(984)
CAD	3,400,000	MXN	43,125,649	HSBC Bank Plc	17/9/2015	2,037
CAD	7,200,000	MXN	89,634,402	JP Morgan	17/9/2015	104,308
KRW	2,043,231,750	USD	1,743,000	BNP Paribas	17/9/2015	(17,987)
MXN	42,731,380	CAD	3,400,000	Deutsche Bank	17/9/2015	(25,359)
MXN	83,158,586	CAD	6,600,000	JP Morgan	17/9/2015	(36,838)
MXN	45,184,518	CAD	3,600,000	Morgan Stanley	17/9/2015	(30,427)
MXN	29,488,140	USD	1,800,000	Deutsche Bank	17/9/2015	(55,784)
MXN	29,394,000	USD	1,800,000	Bank of America	17/9/2015	(61,352)
USD	2,614,500	KRW	3,122,758,800	Bank of America	17/9/2015	(21,912)
USD	3,600,000	MXN	58,841,710	Deutsche Bank	17/9/2015	119,527
COP	6,703,306,330	USD	2,085,120	Credit Suisse	18/9/2015	64,365
COP	2,199,106,560	USD	695,040	Morgan Stanley	18/9/2015	10,127
USD	2,780,160	COP	8,311,649,741	BNP Paribas	18/9/2015	114,942
USD	1,851,965	MXN	31,886,611	Morgan Stanley	18/9/2015	(33,981)
USD	2,518,570	MXN	41,424,073	JP Morgan	18/9/2015	68,526
USD	8,729,379	MXN	137,918,954	Bank of America	18/9/2015	572,108
CAD	4,705,200	MXN	60,441,588	Deutsche Bank	21/9/2015	(41,150)
CAD	3,136,800	MXN	40,115,535	Goldman Sachs	21/9/2015	(16,857)
MXN	98,634,323	CAD	7,842,000	UBS	21/9/2015	(55,692)
USD	5,122,456	EUR	4,424,025	Goldman Sachs	21/9/2015	152,221
USD	11,397,025	EUR	10,333,585	RBS Plc	21/9/2015	(212,389)

未決済先渡為替予約 2015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)
PLN	31,286,985	EUR	7,487,900	Citibank	22/9/2015	(92,569)
CLP	3,713,928,478	USD	5,294,544	Credit Suisse	24/9/2015	28,871
COP	10,057,520,960	USD	3,128,000	Credit Suisse	24/9/2015	96,633
JPY	323,375,311	USD	2,609,250	RBS Plc	24/9/2015	61,364
USD	5,294,544	CLP	3,760,926,378	Credit Suisse	24/9/2015	(96,236)
USD	3,128,000	COP	9,567,175,680	Credit Suisse	24/9/2015	60,581
USD	2,609,250	JPY	323,064,080	Morgan Stanley	24/9/2015	(58,793)
USD	3,529,678	KRW	4,256,791,945	HSBC Bank Plc	24/9/2015	(61,710)
USD	14,115,882	MXN	231,003,779	Goldman Sachs	25/9/2015	460,137
USD	3,684,000	SGD	5,184,670	BNY Mellon	25/9/2015	17,654
COP	14,110,492,500	USD	4,446,000	BNY Mellon	28/9/2015	77,710
COP	7,608,047,000	USD	2,614,000	BNP Paribas	28/9/2015	(174,921)
TRY	84,420,000	USD	29,563,999	Goldman Sachs	28/9/2015	(802,473)
USD	2,667,600	COP	8,640,356,400	Morgan Stanley	28/9/2015	(102,429)
USD	2,614,000	COP	7,694,230,580	Credit Suisse	28/9/2015	147,292
USD	6,082,000	MYR	25,526,154	BNY Mellon	28/9/2015	(17,699)
USD	29,830,389	TRY	84,420,000	Goldman Sachs	28/9/2015	1,068,862
CLP	3,676,865,400	USD	5,304,000	BNY Mellon	30/9/2015	(36,658)
CLP	2,459,288,000	USD	3,536,000	Credit Suisse	30/9/2015	(12,915)
COP	12,462,240,960	USD	4,344,000	Credit Suisse	30/9/2015	(348,865)
USD	4,344,000	COP	12,475,881,120	Credit Suisse	30/9/2015	344,492
USD	5,314,050	ZAR	70,132,929	Barclays	30/9/2015	81,687
ZAR	35,983,796	USD	2,687,000	Citibank	30/9/2015	(2,379)
COP	24,665,933,760	USD	7,956,000	BNY Mellon	1/10/2015	(48,811)
MXN	74,269,702	USD	4,420,000	UBS	2/10/2015	(31,832)
MXN	74,734,686	USD	4,420,000	JP Morgan	2/10/2015	(4,358)
MXN	544,246,092	USD	31,824,000	Deutsche Bank	2/10/2015	332,363
USD	1,202,000	BRL	4,437,166	BNP Paribas	2/10/2015	5,949
USD	5,304,000	BRL	19,505,990	Morgan Stanley	2/10/2015	46,102
USD	33,584,000	BRL	122,667,668	BNY Mellon	2/10/2015	518,561
USD	37,771,894	JPY	4,561,655,000	Barclays	5/10/2015	92,255
SEK	1,087,734	USD	125,761	Morgan Stanley	20/10/2015	2,626
USD	275,102	AUD	368,000	UBS	20/10/2015	14,548
USD	76,077	CNH	476,000	Citibank	20/10/2015	2,606
USD	1,544,042	CNH	9,662,000	BNY Mellon	20/10/2015	52,691
USD	579,537	CNY	3,623,000	RBS Plc	20/10/2015	18,006
USD	11,547,862	CNY	72,380,000	JP Morgan	20/10/2015	329,644
USD	18,807,957	DKK	126,355,217	HSBC Bank Plc	20/10/2015	(229,197)
USD	455,552	HKD	3,531,000	Commonwealth Bank of Australia	20/10/2015	5
USD	5,197,407	HKD	40,313,000	State Street	20/10/2015	(3,522)
USD	13,324,401	MXN	214,370,000	Goldman Sachs	20/10/2015	676,657
USD	10,176,615	MXN	162,144,000	BNP Paribas	20/10/2015	610,184
USD	7,110,477	NZD	10,691,000	HSBC Bank Plc	20/10/2015	326,567

未決済先渡為替予約 2015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	1,561,184	SEK	13,157,893	HSBC Bank Plc	20/10/2015	8,138
USD	3,706,500	MYR	15,774,401	BNP Paribas	26/10/2015	(60,703)
TRY	55,425,000	USD	22,917,097	Deutsche Bank	28/10/2015	(4,213,875)
USD	20,302,198	TRY	55,425,000	BNP Paribas	28/10/2015	1,598,976
MYR	960,615	USD	244,905	JP Morgan	9/11/2015	(15,647)
AUD	27,850,000	USD	19,991,259	JP Morgan	13/11/2015	(296,894)
AUD	42,340,000	USD	30,958,077	UBS	13/11/2015	(1,016,984)
HUF	9,417,544,632	USD	33,367,742	Goldman Sachs	13/11/2015	279,173
IDR	226,437,000,000	USD	16,313,905	HSBC Bank Plc	13/11/2015	(698,377)
IDR	237,290,730,000	USD	17,120,543	Deutsche Bank	13/11/2015	(756,521)
INR	1,040,400,000	USD	16,065,473	Goldman Sachs	13/11/2015	(625,303)
INR	1,128,530,000	USD	17,439,808	Deutsche Bank	13/11/2015	(691,736)
MXN	339,150,092	USD	19,905,938	Deutsche Bank	13/11/2015	67,577
MXN	124,349,908	USD	7,300,891	BNP Paribas	13/11/2015	22,429
NOK	190,300,000	USD	22,851,804	Barclays	13/11/2015	(140,048)
NOK	684,170,000	USD	82,825,036	Deutsche Bank	13/11/2015	(1,171,319)
TRY	56,540,000	USD	18,818,506	HSBC Bank Plc	13/11/2015	170,990
USD	98,352,251	AUD	133,230,000	Westpac	13/11/2015	4,137,519
USD	9,850,291	BRL	35,530,000	BNP Paribas	13/11/2015	403,951
USD	9,509,725	BRL	34,080,000	Deutsche Bank	13/11/2015	448,895
USD	22,937,425	EUR	20,590,000	Barclays	13/11/2015	(214,912)
USD	119,962,081	EUR	109,272,001	UBS	13/11/2015	(2,908,349)
USD	43,865,777	JPY	5,428,477,686	UBS	13/11/2015	(997,184)
USD	9,895,651	TRY	28,260,000	BNP Paribas	13/11/2015	404,262
USD	9,918,126	TRY	28,280,000	Deutsche Bank	13/11/2015	420,020
ZAR	300,700,000	USD	22,674,660	Barclays	13/11/2015	(418,719)
ZAR	589,810,000	USD	45,189,243	JP Morgan	13/11/2015	(1,535,180)
				Standard Chartered		
MYR	5,581,125	USD	1,353,000	Bank London	20/11/2015	(21,721)
USD	1,353,000	MYR	5,581,125	JP Morgan	20/11/2015	21,721
RUB	142,030,000	USD	2,000,000	JP Morgan	25/11/2015	50,466
USD	1,000,000	RUB	69,020,000	Societe Generale	25/11/2015	3,568
TRY	56,313,000	USD	21,004,476	Deutsche Bank	2/12/2015	(2,194,327)
USD	20,126,162	TRY	56,313,000	Deutsche Bank	2/12/2015	1,316,013
GBP	6,980,000	USD	10,751,434	Goldman Sachs	16/12/2015	(8,940)
GBP	6,980,000	USD	10,750,596	Deutsche Bank	16/12/2015	(8,103)
USD	2,330,000	AUD	3,268,005	JP Morgan	16/12/2015	22,641
				Royal Bank		
USD	2,330,000	CAD	3,077,210	of Canada	16/12/2015	19,915
				Royal Bank		
USD	2,330,000	EUR	2,068,370	of Canada	16/12/2015	2,801
USD	2,330,000	GBP	1,513,144	Morgan Stanley	16/12/2015	1,212
TRY	146,380,000	USD	55,880,825	Deutsche Bank	2/2/2016	(7,870,603)

未決済先渡為替予約 2015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	51,590,728	TRY	146,380,000	Deutsche Bank	2/2/2016	3,580,505
TRY	50,000,000	USD	18,680,415	Deutsche Bank	5/2/2016	(2,295,863)
USD	17,925,644	TRY	50,000,000	BNP Paribas	5/2/2016	1,541,092
CNY	26,322,000	USD	4,000,000	JP Morgan	26/2/2016	24,543
CNY	30,617,600	USD	4,600,000	HSBC Bank Plc	26/2/2016	81,326
USD	7,184,615	CNY	47,273,585	HSBC Bank Plc	26/2/2016	(43,353)
USD	1,415,385	CNY	9,379,754	BNY Mellon	26/2/2016	(18,747)
未実現純評価損						(12,331,731)
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	104,247,389	USD	76,165,219	BNY Mellon	15/9/2015	(2,221,649)
USD	623,275	AUD	854,256	BNY Mellon	15/9/2015	17,343
未実現純評価損						(2,204,306)
ヘッジを使用したカナダ・ドル建投資証券クラス						
CAD	106,467,078	USD	81,412,655	BNY Mellon	15/9/2015	(1,470,958)
USD	4,596	CAD	6,032	BNY Mellon	15/9/2015	67
未実現純評価損						(1,470,891)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	165,733,001	USD	168,609,684	BNY Mellon	15/9/2015	3,051,330
USD	1,460,507	CHF	1,411,092	BNY Mellon	15/9/2015	(1,068)
未実現純評価益						3,050,262
ヘッジを使用した中国人民元建投資証券クラス						
CNY	30,418	USD	4,744	BNY Mellon	15/9/2015	(32)
USD	27	CNY	179	BNY Mellon	15/9/2015	-
未実現純評価損						(32)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	1,942,261,513	USD	2,144,300,852	BNY Mellon	15/9/2015	37,562,980
USD	51,814,954	EUR	45,883,843	BNY Mellon	15/9/2015	270,545
未実現純評価益						37,833,525
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	562,748,516	USD	877,132,135	BNY Mellon	15/9/2015	(10,618,647)
USD	292,661	GBP	187,954	BNY Mellon	15/9/2015	3,252
未実現純評価損						(10,615,395)
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	12,303,271	USD	1,586,403	BNY Mellon	15/9/2015	966
USD	12,351	HKD	95,767	BNY Mellon	15/9/2015	(5)
未実現純評価益						961

未決済先渡為替予約 2015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)
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	45,275,926,202	USD	362,490,829	BNY Mellon	15/9/2015	11,359,044
USD	2,485,437	JPY	294,559,226	BNY Mellon	15/9/2015	53,189
未実現純評価益						11,412,233
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	634,652,596	USD	166,641,179	BNY Mellon	15/9/2015	2,165,576
USD	6,057,841	PLN	22,695,678	BNY Mellon	15/9/2015	21,219
未実現純評価益						2,186,795
ヘッジを使用したスウェーデン・クローネ建投資証券クラス						
SEK	874,455,881	USD	100,786,847	BNY Mellon	15/9/2015	2,337,187
USD	2,149,502	SEK	18,120,372	BNY Mellon	15/9/2015	12,560
未実現純評価損						2,349,747
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	14,887,135	USD	10,609,954	BNY Mellon	15/9/2015	(77,161)
USD	534,740	SGD	751,972	BNY Mellon	15/9/2015	2,712
未実現純評価損						(74,449)
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 - 9,008,005,953米ドル)						30,136,719

注：当該取引による未実現純評価益は、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

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 2015年8月31日現在

契約数	通貨	契約 / 摘要	満期日	基礎となるエクスポージャー額 (米ドル)	未実現評価益 / (損) (米ドル)
3,023	AUD	Australian 3 Year Bond	2015年9月	241,043,153	2,271,030
1	AUD	Australian 10 Year Bond	2015年9月	91,712	3,357
264	CAD	Banker's Acceptance	2015年9月	49,211,023	100,645
337	EUR	Euro Schatz	2015年9月	42,112,224	(13,248)
267	EUR	EURO STOXX 50 Index	2015年9月	9,770,158	(679,124)
54	EUR	DAX Index	2015年9月	15,490,088	(1,965,996)
51	EUR	FTSE MIB Index	2015年9月	6,270,820	(105,998)
(69)	EUR	Euro Bund	2015年9月	11,926,107	29,554
(111)	EUR	30 Year Euro-BUXL	2015年9月	19,164,283	36,751
(489)	EUR	Euro-BTP	2015年9月	74,408,624	(1,816,455)
(820)	EUR	Short-Term Euro-BTP Index	2015年9月	103,509,628	(700,215)
(3,464)	EUR	Euro BOBL	2015年9月	506,634,546	(2,260,321)
(136)	JPY	Nikkei 225 (OSE)	2015年9月	21,151,936	328,080
(265)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2015年9月	323,595,965	(1,234,834)
809	KRW	Korean 10 Year Bond	2015年9月	84,993,731	1,236,843
416	USD	Nikkei 225 (CME)	2015年9月	39,218,400	(3,100,342)
(10)	USD	CBOE Volatility Index	2015年9月	257,000	(26,500)
(52)	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	2015年9月	4,459,780	(110,220)
(500)	USD	S&P 500 E Mini Index	2015年9月	49,175,000	2,370,662
268	CAD	Banker's Acceptance	2015年12月	50,001,922	28,899
(23)	EUR	Euro BOBL	2015年12月	3,316,640	258
(3,047)	GBP	Long Gilt	2015年12月	549,864,304	3,311,663
(169)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2015年12月	27,061,125	27,186
(281)	USD	US Long Bond (CBT)	2015年12月	43,879,906	478,193
(1,489)	USD	90 Day Euro \$	2015年12月	370,537,650	(67,225)
(1,652)	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2015年12月	361,168,500	696,351
(9,459)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2015年12月	1,132,641,347	2,663,471
(10,030)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2015年12月	1,279,295,156	441,851
2,275	GBP	90 Day Sterling	2016年3月	434,668,535	744,655
(3,864)	USD	90 Day Euro \$	2016年3月	960,204,000	(1,165,626)
(536)	CAD	Banker's Acceptance	2016年9月	99,953,536	(472,405)
(1,588)	GBP	90 Day Sterling	2016年12月	302,277,211	(132,471)
(2,423)	USD	90 Day Euro \$	2016年12月	598,783,875	(505,923)
合計				7,816,137,885	412,546

注：当該取引による未実現純評価益412,546米ドルは、純資産計算書に含まれている（注記2c参照）。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

金利スワップ 2015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)
BRL 114,653,149	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、12.3%の固定金利を支払う	Bank of America	4/1/2016	329,152	329,152
BRL 68,170,000	ファンドは13.61%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2017	(139,392)	(139,392)
BRL 149,234,927	ファンドは13.91%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2017	(143,755)	(143,755)
BRL 64,101,972	ファンドは14.045%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2017	(33,102)	(33,102)
BRL 70,121,306	ファンドは14.15%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2017	(11,869)	(11,869)
KRW 24,503,582,000	ファンドは1.935%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	10/2/2017	99,294	99,294
CNY 150,262,000	ファンドは2.245%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Bank of America	22/5/2017	(29,658)	(29,658)
CNY 76,580,000	ファンドは2.25%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Bank of America	7/7/2017	(18,716)	(18,716)
CNY 75,775,902	ファンドは2.12%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Bank of America	9/7/2017	(49,093)	(49,093)
MXN 395,424,874	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.3260004%の固定金利を支払う	Bank of America	25/8/2017	(11,562)	(11,562)
MXN 395,424,875	ファンドは4.435%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	28/8/2017	(1,731)	(1,731)
ZAR 759,610,000	ファンドは7.45%の固定金利を受け取り、3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を支払う	Bank of America	29/8/2017	(27,546)	(27,546)
CNY 425,000,000	ファンドは2.42%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Bank of America	16/9/2017	136,226	136,226
MXN 63,367,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.3499988%の固定金利を支払う	Bank of America	17/11/2017	14,633	14,633
PLN 234,384,580	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、1.81%の固定金利を支払う	Bank of America	9/3/2018	(896)	(896)
MXN 82,177,874	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.6900008%の固定金利を支払う	Bank of America	16/3/2018	(2,990)	(2,990)
KRW 90,000,000,000	ファンドは1.6875%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	16/9/2018	(20,374)	(20,374)
MXN 48,534,715	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.8499992%の固定金利を支払う	Bank of America	1/11/2018	4,793	4,793
MXN 49,805,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、5.04%の固定金利を支払う	Bank of America	18/11/2019	25,322	25,322
BRL 10,376,000	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、11.41%の固定金利を支払う	Bank of America	4/1/2021	458,189	458,189
BRL 6,184,982	ファンドは12.05%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	4/1/2021	(185,716)	(185,716)
MXN 50,305,756	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.2924988%の固定金利を支払う	Bank of America	13/1/2025	(162,309)	(162,309)
MXN 173,842,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.3260004%の固定金利を支払う	Bank of America	16/7/2025	7,820	7,820
MXN 86,921,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.3260004%の固定金利を支払う	Bank of America	18/7/2025	7,734	7,734

金利スワップ 2015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)
MXN 90,735,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIEの変動金利を受け取り、6.3100008%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	7,464	7,464
MXN 90,735,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIEの変動金利を受け取り、6.3100008%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	7,464	7,464
KRW 19,058,342,000	ファンドは1.9125%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Barclays	10/2/2017	72,054	72,054
SGD 50,000,000	ファンドは6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を受け取り、1.5075%の固定金利を支払う	Barclays	16/9/2017	307,441	307,441
SGD 41,000,000	ファンドは6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を受け取り、1.505%の固定金利を支払う	Barclays	16/9/2017	253,526	253,526
SGD 2,500,000	ファンドは6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を受け取り、1.5475%の固定金利を支払う	Barclays	16/9/2017	13,982	13,982
PLN 77,550,000	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、1.71%の固定金利を支払う	Barclays	6/3/2018	49,839	49,839
MXN 80,656,062	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIEの変動金利を受け取り、4.5500004%の固定金利を支払う	Barclays	21/3/2018	14,155	14,155
USD 31,910,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.772%の固定金利を支払う	Barclays	14/7/2020	(315,523)	(315,523)
KRW 10,391,437,839	ファンドは1.9125%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Barclays	7/8/2020	25,909	25,909
USD 4,536,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.339%の固定金利を支払う	Barclays	30/7/2025	(61,275)	(61,275)
USD 4,535,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.34%の固定金利を支払う	Barclays	30/7/2025	(61,676)	(61,676)
USD 9,040,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.339%の固定金利を支払う	Barclays	30/7/2025	(122,118)	(122,118)
USD 6,343,600	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.256%の固定金利を支払う	Barclays	20/8/2025	(34,186)	(34,186)
USD 4,865,000	ファンドは2.14%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Barclays	25/8/2025	(26,097)	(26,097)
USD 5,820,000	ファンドは2.128%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Barclays	25/8/2025	(37,642)	(37,642)
USD 8,763,045	ファンドは2.13%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Barclays	25/8/2025	(55,066)	(55,066)
USD 5,840,000	ファンドは2.134%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Barclays	25/8/2025	(34,550)	(34,550)
USD 20,700,000	ファンドは2.036%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Barclays	26/8/2025	(309,625)	(309,625)
JPY 2,200,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、1.4787%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2034	(1,083,566)	(1,083,566)
USD 10,965,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.41231%の固定金利を支払う	Barclays	24/4/2045	510,804	510,804
USD 6,030,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.41692%の固定金利を支払う	Barclays	24/4/2045	275,093	275,093
EUR 2,700,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、1.5%の固定金利を支払う	Barclays	21/8/2045	39,169	39,169
PLN 82,360,000	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、1.71%の固定金利を支払う	BNP Paribas	6/3/2018	52,930	52,930
INR 7,300,000,000	ファンドは1日INR MIBORの変動金利を受け取り、7.37%の固定金利を支払う	Citibank	2/7/2016	(98,493)	(98,493)

金利スワップ 2015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)
BRL 66,121,877	ファンドは13.565%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2017	(145,969)	(145,969)
BRL 66,133,997	ファンドは13.395%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2017	(187,530)	(187,530)
MXN 530,555,625	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.33%の固定金利を支払う	Citibank	24/8/2017	21,627	21,627
MXN 353,703,750	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.3260004%の固定金利を支払う	Citibank	25/8/2017	3,877	3,877
HKD 581,085,000	ファンドは3ヶ月HKD HIBORの変動金利を受け取り、1.045%の固定金利を支払う	Citibank	16/9/2017	1,005	1,005
HKD 540,000,000	ファンドは3ヶ月HKD HIBORの変動金利を受け取り、1.01%の固定金利を支払う	Citibank	16/9/2017	49,326	49,326
MXN 80,656,064	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.5699984%の固定金利を支払う	Citibank	21/3/2018	11,799	11,799
PLN 76,440,000	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、2.253%の固定金利を支払う	Citibank	19/6/2018	(222,220)	(222,220)
HUF 204,220,000	ファンドは6ヶ月HUF BUBORの変動金利を受け取り、1.91%の固定金利を支払う	Citibank	26/6/2018	(3,824)	(3,824)
HUF 3,003,975,000	ファンドは6ヶ月HUF BUBORの変動金利を受け取り、1.855%の固定金利を支払う	Citibank	27/7/2018	(38,349)	(38,349)
MXN 74,505,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.7199996%の固定金利を支払う	Citibank	14/11/2018	26,691	26,691
MXN 52,477,735	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、5.0500008%の固定金利を支払う	Citibank	15/11/2019	25,136	25,136
KRW 27,482,794,161	ファンドは1.912%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Citibank	7/8/2020	67,974	67,974
KRW 5,283,063,385	ファンドは2.29%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Citibank	15/7/2025	77,251	77,251
MXN 86,921,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.33%の固定金利を支払う	Citibank	17/7/2025	1,719	1,719
GBP 17,880,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、1.1545%の固定金利を支払う	Citigroup	2/1/2018	(18,957)	(18,957)
GBP 31,620,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、2.38%の固定金利を支払う	Citigroup	21/7/2065	(4,098,334)	(4,098,334)
BRL 72,027,993	ファンドは12.3%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Credit Suisse	4/1/2016	(206,782)	(206,782)
BRL 211,316,463	ファンドは11.65%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Credit Suisse	4/1/2016	(909,541)	(909,541)
BRL 71,812,483	ファンドは11.36%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Credit Suisse	4/1/2016	(371,256)	(371,256)
BRL 9,699,650	ファンドは11.12%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Credit Suisse	4/1/2016	(58,946)	(58,946)
GBP 91,100,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、1.6%の固定金利を支払う	Credit Suisse	13/8/2017	(1,518,482)	(1,518,482)
MXN 623,965,251	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.3260004%の固定金利を支払う	Credit Suisse	25/8/2017	(3,911)	(3,911)
MXN 52,524,131	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.2955012%の固定金利を支払う	Credit Suisse	29/1/2025	(77,337)	(77,337)

金利スワップ 2015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 9,420,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.359%の固定金利を支払う	Credit Suisse	31/7/2025	(147,110)	(147,110)
USD 4,693,500	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.34625%の固定金利を支払う	Credit Suisse	3/8/2025	(66,666)	(66,666)
USD 6,343,593	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.25375%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/8/2025	(35,010)	(35,010)
BRL 10,173,000	ファンドは11.255%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Deutsche Bank	4/1/2016	(57,113)	(57,113)
USD 5,690,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.644%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	26/11/2016	(2,387)	(2,387)
CNY 87,254,200	ファンドは2.26%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Deutsche Bank	8/7/2017	(19,140)	(19,140)
CNY 75,775,901	ファンドは2.18%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Deutsche Bank	9/7/2017	(35,132)	(35,132)
MXN 78,885,265	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.2950008%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	14/11/2024	(141,922)	(141,922)
MXN 34,297,942	ファンドは5.85%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Deutsche Bank	14/11/2024	(60,498)	(60,498)
USD 4,693,500	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.37%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	31/7/2025	(77,970)	(77,970)
MXN 336,807,890	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.3072%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/8/2025	32,156	32,156
USD 3,171,807	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.255%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/8/2025	(17,865)	(17,865)
BRL 37,408,064	ファンドは11.85%の固定金利を受け取り、6ヶ月BRL BROISの変動金利を支払う	Goldman Sachs	4/1/2016	(147,462)	(147,462)
INR 20,700,000,000	ファンドは1日INR MIBORの変動金利を受け取り、7.34%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	9/7/2016	(208,595)	(208,595)
AUD 114,604,000	ファンドは2.245%の固定金利を受け取り、3ヶ月AUD BBSWの変動金利を支払う	Goldman Sachs	27/6/2017	271,562	271,562
AUD 224,399,000	ファンドは2.23%の固定金利を受け取り、3ヶ月AUD BBSWの変動金利を支払う	Goldman Sachs	27/6/2017	508,589	508,589
AUD 236,070,000	ファンドは2.25%の固定金利を受け取り、3ヶ月AUD BBSWの変動金利を支払う	Goldman Sachs	1/7/2017	566,075	566,075
CAD 45,000,000	ファンドは0.775%の固定金利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	24/7/2017	61,745	61,745
SGD 160,000,000	ファンドは6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を受け取り、1.685%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	16/9/2017	588,991	588,991
HKD 678,915,000	ファンドは3ヶ月HKD HIBORの変動金利を受け取り、1.050625%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	16/9/2017	(8,605)	(8,605)
PLN 113,197,658	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、1.7425%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	23/3/2018	53,387	53,387
PLN 103,580,000	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、1.895%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	22/7/2018	(27,820)	(27,820)
HUF 14,202,025,000	ファンドは6ヶ月HUF BUBORの変動金利を受け取り、1.83%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	27/7/2018	(145,109)	(145,109)
KRW 180,000,000,000	ファンドは1.65%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	16/9/2018	(207,518)	(207,518)
INR 4,800,000,000	ファンドは6.83%の固定金利を受け取り、6ヶ月INR MIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	9/7/2020	206,523	206,523
CAD 18,000,000	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、1.215%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	24/7/2020	(96,130)	(96,130)

金利スワップ 2015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)
BRL 6,563,249	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、11.07%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	4/1/2021	329,975	329,975
MXN 113,542	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.2974992%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	28/1/2025	(200)	(200)
MXN 94,069,294	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.3260004%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	16/7/2025	6,439	6,439
MXN 261,414,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.3099984%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	6/8/2025	(6,513)	(6,513)
SGD 36,500,000	ファンドは2.715%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	Goldman Sachs	16/9/2025	(664,131)	(664,131)
SGD 160,000,000	ファンドは6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を受け取り、1.66%の固定金利を支払う	HSBC	16/9/2017	644,600	644,600
THB 1,577,170,915	ファンドは1.895%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB BKIBORの変動金利を支払う	HSBC	16/9/2018	5,847	5,847
INR 439,656,250	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、7.15%の固定金利を支払う	HSBC	4/6/2020	(104,690)	(104,690)
BRL 4,139,904	ファンドは11.84%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	HSBC	4/1/2021	(138,401)	(138,401)
SGD 36,500,000	ファンドは2.685%の固定金利を受け取り、6ヶ月SGD SGDOWの変動金利を支払う	HSBC	16/9/2025	(732,853)	(732,853)
BRL 124,600,000	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、12.14%の固定金利を支払う	JP Morgan	4/1/2016	368,148	368,148
BRL 35,215,000	ファンドは11.85%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	4/1/2016	(132,232)	(132,232)
BRL 53,799,000	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、12.13%の固定金利を支払う	JP Morgan	4/1/2016	160,630	160,630
BRL 16,850,000	ファンドは11.91%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	4/1/2016	(37,166)	(37,166)
BRL 52,592,000	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、11.83%の固定金利を支払う	JP Morgan	4/1/2016	204,685	204,685
BRL 37,408,064	ファンドは11.85%の固定金利を受け取り、6ヶ月BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	4/1/2016	(140,121)	(140,121)
BRL 40,747,875	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、11.8%の固定金利を支払う	JP Morgan	4/1/2016	130,908	130,908
BRL 78,394,986	ファンドは13.93%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2017	(72,812)	(72,812)
KRW 35,000,000,000	ファンドは1.815%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	JP Morgan	13/3/2017	95,259	95,259
CNY 148,972,197	ファンドは2.24%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	JP Morgan	27/5/2017	(30,624)	(30,624)
CNY 76,585,000	ファンドは2.285%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	JP Morgan	7/7/2017	(10,496)	(10,496)
ZAR 759,610,000	ファンドは7.52%の固定金利を受け取り、3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を支払う	JP Morgan	25/8/2017	10,624	10,624
ZAR 506,410,000	ファンドは7.495%の固定金利を受け取り、3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を支払う	JP Morgan	28/8/2017	(3,183)	(3,183)
PLN 237,920,000	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、1.73%の固定金利を支払う	JP Morgan	6/3/2018	122,103	122,103
PLN 101,802,342	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、1.755%の固定金利を支払う	JP Morgan	23/3/2018	39,627	39,627
HUF 11,558,895,000	ファンドは6ヶ月HUF BUBORの変動金利を受け取り、1.905%の固定金利を支払う	JP Morgan	26/6/2018	(210,725)	(210,725)

金利スワップ 2015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)
HUF 11,558,885,000	フアンドは6ヶ月HUF BUBORの変動金利を受け取り、1.92%の固定金利を支払う	JP Morgan	26/6/2018	(227,895)	(227,895)
BRL 9,435,000	フアンドは12.05%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	4/1/2021	(285,828)	(285,828)
BRL 2,871,751	フアンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、11.08%の固定金利を支払う	JP Morgan	4/1/2021	134,181	134,181
BRL 51,114	フアンドは11.72%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	4/1/2021	(1,832)	(1,832)
BRL 35,060,653	フアンドは14.15%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	2/1/2017	(5,935)	(5,935)
BRL 54,788,965	フアンドは13.57%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	2/1/2017	(119,997)	(119,997)
MXN 530,555,625	フアンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.33%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	24/8/2017	24,670	24,670
ZAR 402,708,000	フアンドは7.59%の固定金利を受け取り、3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を支払う	Morgan Stanley	26/8/2017	23,538	23,538
PLN 170,050,420	フアンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、1.84%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	9/3/2018	(33,777)	(33,777)
PLN 223,860,000	フアンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、2.023%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	3/6/2018	(285,932)	(285,932)
PLN 344,590,000	フアンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、2.26%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	18/6/2018	(1,017,779)	(1,017,779)
PLN 114,415,000	フアンドは3.05%の固定金利を受け取り、6ヶ月PLN WIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	18/6/2025	1,208,452	1,208,452
MXN 80,380,706	フアンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.3260004%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	16/7/2025	9,274	9,274
MXN 174,450,000	フアンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.33%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/7/2025	(644)	(644)
KRW 47,645,854,000	フアンドは1.9395%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	10/2/2017	195,658	195,658
KRW 18,718,014,000	フアンドは1.9125%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	10/2/2017	70,768	70,768
KRW 34,325,686,000	フアンドは1.96%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	11/2/2017	150,125	150,125
KRW 17,121,255,000	フアンドは1.8675%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	24/7/2020	13,521	13,521
KRW 11,171,915,000	フアンドは1.8425%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	24/7/2020	(2,243)	(2,243)
KRW 4,558,595,000	フアンドは2.2625%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	9/7/2025	57,298	57,298
KRW 11,325,370,000	フアンドは2.25375%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	9/7/2025	134,849	134,849
KRW 4,647,978,308	フアンドは2.2675%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	10/7/2025	60,183	60,183
KRW 2,323,989,153	フアンドは2.285%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	13/7/2025	33,113	33,113

金利スワップ 2015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)
KRW 2,323,989,154	ファンドは2.275%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	14/7/2025	31,352	31,352
EUR 5,400,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、1.55%の固定金利を支払う	UBS	22/2/2046	52,673	52,673
EUR 5,400,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、1.54%の固定金利を支払う	UBS	23/2/2046	68,245	68,245
EUR 5,400,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、1.52%の固定金利を支払う	UBS	24/2/2046	99,178	99,178
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 4,192,069,664米ドル)				(6,933,676)	(6,933,676)

注：当該取引による時価合計(6,933,676)米ドルは、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

クレジット・デフォルト・スワップ 2015年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (860,000)	ファンドはTransocean Inc 7.375% 15/4/2018に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2019	(140,298)	(212,511)
USD (720,000)	ファンドはTransocean Inc 7.375% 15/4/2018に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2019	(120,570)	(177,916)
EUR (349,000)	ファンドはShell International Finance BV 5.2% 22/3/2017に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/3/2020	(1,962)	6,376
USD 2,100,000	ファンドはConocoPhillips 5.9% 15/10/2032に係るデフォルト・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	20/3/2020	(1,158)	(34,773)
EUR 1,040,000	ファンドはContinental AG 3.125% 9/9/2020に係るデフォルト・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	20/6/2020	13,201	(14,829)
USD (16,583,472)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2020	(109,434)	(319,414)
EUR (1,040,000)	ファンドはBayerische Motoren Werke AG 5% 6/8/2018に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2020	(10,460)	19,705
EUR 1,950,000	ファンドはCredit Suisse Group AG 0.99% 29/7/2019に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2020	(4,556)	(26,185)
EUR (4,085,000)	ファンドはSky Plc 6% 21/5/2027に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/9/2020	(302)	50,855
EUR (3,900,000)	ファンドはHSBC Bank Plc 3.75% 30/11/2016に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/9/2020	7,732	45,028

クレジット・デフォルト・スワップ 2015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 16,583,472	ファンドは Mexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2020	122,046	372,343
USD (4,351,000)	ファンドは Mexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/9/2020	(31,880)	(97,692)
EUR 3,900,000	ファンドは Credit Suisse Group AG 0.99% 29/7/2019に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2020	(6,285)	(52,371)
EUR (1,950,000)	ファンドは HSBC Bank Plc 3.75% 30/11/2016に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/9/2020	5,253	22,514
USD 1,880,000	ファンドは Transocean Inc 7.375% 15/4/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2017	154,854	172,616
EUR 202,000	ファンドは ITRAXX.EUR.22.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2019	482	(3,528)
EUR 209,000	ファンドは ITRAXX.EUR.22.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2019	304	(3,650)
EUR 99,000	ファンドは ITRAXX.EUR.22.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2019	187	(1,729)
USD 1,100,000	ファンドは Kohl's Corp 6.25% 15/12/2017に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	(4,821)	9,603
USD 1,100,000	ファンドは Ford Motor Company 6.5% 1/8/2018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	20/3/2020	117	(183,134)
USD 1,100,000	ファンドは CBS Corp 4.625% 15/5/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	9,594	(3,666)
USD 1,100,000	ファンドは Eastman Chemical Co 7.6% 1/2/2027に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	(3,116)	(12,539)
USD 1,100,000	ファンドは Westvaco Corp 7.95% 15/2/2031に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	(29,608)	(35,697)
USD 1,100,000	ファンドは Block Financial LLC 5.5% 1/11/2022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	20/3/2020	11,030	(172,768)
USD 1,100,000	ファンドは Xerox Corp 6.35% 15/5/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	15,832	9,268
USD 1,100,000	ファンドは Arrow Electronics Inc 6.875% 1/6/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	(9,739)	(17,730)

クレジット・デフォルト・スワップ 2015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 1,100,000	ファンドはAvnet Inc 4.875% 1/12/2022に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	(13,717)	(16,963)
USD 1,100,000	ファンドはDow Chemical Co/The 7.375% 1/11/2029に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	(2,727)	(8,340)
USD 1,100,000	ファンドはExpedia Inc 7.456% 15/8/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	(7,917)	(10,690)
USD 1,100,000	ファンドはInternational Paper Co 7.5% 15/8/2021に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	(7,509)	(15,978)
USD 1,100,000	ファンドはComputer Sciences Corp 6.5% 15/3/2018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	20/3/2020	(31,582)	(203,982)
USD 1,100,000	ファンドはFirstEnergy Corp 7.375% 15/11/2031に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	(10,721)	(3,667)
USD 1,100,000	ファンドはPitney Bowes Inc 6.25% 15/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	8,262	5,016
USD (1,100,000)	ファンドはTransocean Inc 7.375% 15/4/2018に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/3/2020	(45,151)	(287,908)
EUR (195,000)	ファンドはShell International Finance BV 5.2% 22/3/2017に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/3/2020	(1,342)	3,563
USD (500,000)	ファンドはTransocean Inc 7.375% 15/4/2018に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/3/2020	(16,295)	(130,867)
USD 2,500,000	ファンドはTransocean Inc 7.375% 15/4/2018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	20/3/2020	(1,325)	298,447
USD (3,200,000)	ファンドはTransocean Inc 7.375% 15/4/2018に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/3/2020	(5,196)	(837,552)
EUR (100,000)	ファンドはShell International Finance BV 5.2% 22/3/2017に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/3/2020	(647)	1,827
USD (700,000)	ファンドはTransocean Inc 7.375% 15/4/2018に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/3/2020	(50,121)	(183,214)

クレジット・デフォルト・スワップ 2015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 1,100,000	ファンドはGap Inc/The 5.95% 12/4/2021に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	(11,282)	(8,418)
USD 1,100,000	ファンドはValero Energy Corp 8.75% 15/6/2030に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	(18,075)	(1,825)
USD 1,100,000	ファンドはHewlett-Packard Co 5.4% 1/3/2017に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	13,386	7,774
USD 1,100,000	ファンドはQuest Diagnostics Inc 6.95% 1/7/2037に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	(15,676)	(12,344)
EUR (200,000)	ファンドはShell International Finance BV 5.2% 22/3/2017に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/3/2020	(1,376)	3,654
USD 1,100,000	ファンドはYum! Brands Inc 6.25% 15/3/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/3/2020	(2,865)	(8,004)
USD (15,701,400)	ファンドはCDX.NA.HY.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2020	(400,724)	707,882
USD 17,617,050	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Barclays	20/6/2020	384,610	(794,248)
USD (15,701,400)	ファンドはCDX.NA.HY.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2020	(400,724)	707,882
USD (15,953,850)	ファンドはCDX.NA.HY.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2020	(508,296)	719,264
EUR (1,610,000)	ファンドはITRAXX.X0.23.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2020	16,153	135,676
EUR 5,885,000	ファンドはContinental AG 3.125% 9/9/2020に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2020	93,801	(83,912)
EUR 7,795,000	ファンドはITRAXX.EUR.23.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2020	42,829	(117,258)
EUR (5,885,000)	ファンドはBayerische Motoren Werke AG 5% 6/8/2018に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2020	(84,387)	111,506
USD 17,558,640	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Barclays	20/6/2020	377,394	(791,614)
USD 34,729,200	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Barclays	20/6/2020	714,095	(1,565,732)
USD 16,592,400	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Barclays	20/6/2020	359,139	(748,052)

クレジット・デフォルト・スワップ 2015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 11,959,200	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Barclays	20/6/2020	255,502	(539,169)
USD 17,273,520	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Barclays	20/6/2020	352,886	(778,760)
USD (121,418,550)	ファンドはCDX.NA.HY.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2020	(2,748,696)	5,474,038
USD 18,329,850	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Barclays	20/6/2020	412,163	(826,383)
USD 11,385,000	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Barclays	20/6/2020	277,037	(513,282)
USD (1,287,000)	ファンドはCDX.NA.HY.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2020	(37,823)	58,023
USD 18,753,000	ファンドはCDX.NA.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2020	129,879	(158,172)
USD 8,709,000	ファンドはCDX.NA.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2020	45,930	(73,456)
USD 8,710,000	ファンドはCDX.NA.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2020	48,877	(73,465)
USD (21,601,800)	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Barclays	20/6/2020	202,231	973,896
EUR 9,275,000	ファンドはITRAXX.EUR.23.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2020	54,502	(139,521)
USD 9,647,550	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Barclays	20/6/2020	128,555	(434,950)
USD 13,063,231	ファンドはCDX.NA.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2020	73,608	(110,182)
USD (18,892,170)	ファンドはCDX.NA.HY.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2020	(204,757)	851,735
USD (19,199,070)	ファンドはCDX.NA.HY.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2020	(225,363)	865,571
USD 19,269,360	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Barclays	20/6/2020	201,097	(868,740)
USD 9,647,550	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Barclays	20/6/2020	135,977	(434,950)
USD 19,269,360	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Barclays	20/6/2020	184,456	(868,740)

クレジット・デフォルト・スワップ 2015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 15,719,000	ファンドはITRAXX.EUR.23.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2020	35,891	(236,457)
EUR 1,610,000	ファンドはGroupe Auchan SA 6% 15/4/2019に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/9/2020	1,570	(48,689)
EUR (6,715,000)	ファンドはBritish Telecommunications Plc 5.75% 7/12/2028に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/9/2020	(38,471)	94,586
USD 9,456,847	ファンドはSouth Africa (Republic of) 5.5% 9/3/2020に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/9/2020	150,911	640,973
EUR (880,000)	ファンドはVolkswagen AG 5.375% 22/5/2018に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/9/2020	(3,662)	11,545
EUR (9,275,000)	ファンドはBritish Telecommunications Plc 5.75% 7/12/2028に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/9/2020	(57,117)	130,645
EUR (1,800,000)	ファンドはVolkswagen AG 5.375% 22/5/2018に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/9/2020	(7,127)	23,614
USD 1,500,000	ファンドはCaterpillar Inc 1.5% 26/6/2017に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(4,570)	(23,621)
USD 1,500,000	ファンドはHalliburton Company 8.75% 15/2/2021に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(3,024)	(20,920)
USD 1,500,000	ファンドはHalliburton Company 8.75% 15/2/2021に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(6,059)	(20,920)
EUR 356,000	ファンドはITRAXX.EUR.22.V17に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2019	622	(6,218)
EUR (533,000)	ファンドはShell International Finance BV 5.2% 22/3/2017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	20/3/2020	(3,974)	9,738
EUR (352,000)	ファンドはShell International Finance BV 5.2% 22/3/2017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	20/3/2020	(2,409)	6,431
EUR 1,720,000	ファンドはITRAXX.EUR.23.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	BNP Paribas	20/6/2020	7,216	(25,874)
EUR 5,930,000	ファンドはITRAXX.EUR.23.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	BNP Paribas	20/6/2020	22,792	(89,203)

クレジット・デフォルト・スワップ 2015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 (1,610,000)	ファンドはITRAXX.X0.23.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2020	13,123	135,676
EUR 1,570,000	ファンドはITRAXX.EUR.23.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	BNP Paribas	20/6/2020	5,675	(23,617)
EUR 6,715,000	ファンドはITRAXX.EUR.23.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	BNP Paribas	20/6/2020	27,862	(101,012)
USD (6,964,000)	ファンドは Mexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	(25,387)	(156,360)
USD (4,307,000)	ファンドは Mexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	(31,557)	(96,704)
USD (4,404,000)	ファンドは Mexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	(16,055)	(98,882)
USD (4,405,000)	ファンドは Mexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	(16,059)	(98,904)
USD (5,150,000)	ファンドは Mexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	2,265	(115,631)
USD (4,470,000)	ファンドは Mexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	(4,433)	(100,363)
USD (16,822,700)	ファンドは Mexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	(157,828)	(377,714)
USD (4,470,000)	ファンドは Mexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	(7,568)	(100,363)
USD (4,405,000)	ファンドは Mexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	(16,059)	(98,904)
EUR (200,000)	ファンドはShell International Finance BV 5.2% 22/3/2017に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/3/2020	(1,758)	3,654
USD (350,000)	ファンドは AK Steel Corp 7.625% 15/5/2020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	20/3/2020	(63,333)	(105,527)

クレジット・デフォルト・スワップ 2015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 (200,000)	ファンドはShell International Finance BV 5.2% 22/3/2017に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/3/2020	(1,294)	3,654
EUR (200,000)	ファンドはShell International Finance BV 5.2% 22/3/2017に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/3/2020	(1,294)	3,654
EUR (350,000)	ファンドはShell International Finance BV 5.2% 22/3/2017に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/3/2020	(2,446)	6,395
USD 1,400,000	ファンドはBoyd Gaming Corporation 7.125% 1/2/2016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	20/6/2020	(76,594)	(152,154)
EUR (26,500,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.23.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	Citibank	20/6/2020	(96,156)	264,033
EUR (8,719,000)	ファンドはBP Capital Markets Plc 4.2% 15/6/2018に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/9/2020	(95,661)	65,684
USD 1,390,000	ファンドはBoyd Gaming Corporation 7.125% 1/2/2016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	20/9/2020	(10,107)	(148,564)
EUR 23,000	ファンドはAbengoa SA 8.5% 31/3/2016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	20/9/2020	(487)	13,153
USD (4,427,383)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/9/2020	8,096	(99,407)
EUR 4,840,000	ファンドはGroupe Auchan SA 6% 15/4/2019に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/9/2020	(5,415)	(146,370)
EUR 13,000	ファンドはAbengoa SA 8.5% 31/3/2016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	20/9/2020	(275)	7,434
USD (4,427,384)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/9/2020	12,219	(99,407)
EUR 3,220,000	ファンドはGroupe Auchan SA 6% 15/4/2019に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/9/2020	(7,405)	(97,379)
EUR (320,000)	ファンドはGlencore International AG 6.5% 27/2/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/9/2020	(11,756)	(43,393)

クレジット・デフォルト・スワップ 2015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 (7,000,000)	ファンドはBP Capital Markets Plc 4.2% 15/6/2018に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/9/2020	(44,269)	52,734
EUR (1,570,000)	ファンドはSky Plc 6% 21/5/2027に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/9/2020	(984)	19,545
EUR (320,000)	ファンドはGlencore International AG 6.5% 27/2/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/9/2020	(11,756)	(43,393)
EUR (12,200,000)	ファンドはITRAXX.X0.21.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citigroup Global Markets	20/6/2019	(60,433)	1,441,024
EUR (8,230,000)	ファンドはITRAXX.X0.21.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citigroup Global Markets	20/6/2019	(40,768)	972,101
EUR 358,000	ファンドはITRAXX.EUR.22.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup Global Markets	20/12/2019	553	(6,253)
EUR (39,609,060)	ファンドはITRAXX.EUR.23.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	Citigroup Global Markets	20/6/2020	(154,092)	595,828
EUR (2,100,000)	ファンドはITRAXX.X0.23.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citigroup Global Markets	20/6/2020	(2,305)	176,969
EUR (1,610,000)	ファンドはITRAXX.X0.23.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citigroup Global Markets	20/6/2020	(525)	135,676
USD 3,800,000	ファンドはBoeing Co/The 8.75% 15/8/2021に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/9/2019	(20,939)	(125,082)
EUR 524,000	ファンドはITRAXX.EUR.22.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2019	964	(9,152)
USD 9,511,500	ファンドはCDX.NA.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2020	(7,056)	(80,225)
USD (19,199,070)	ファンドはCDX.NA.HY.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2020	(209,043)	865,571
EUR 4,085,000	ファンドはITRAXX.EUR.23.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2020	11,299	(61,450)
EUR (3,220,000)	ファンドはITRAXX.EUR.23.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	Credit Suisse	20/6/2020	13,445	48,438
EUR 3,540,000	ファンドはITRAXX.EUR.23.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2020	6,187	(53,251)
EUR 2,160,000	ファンドはITRAXX.EUR.23.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2020	3,718	(32,492)

クレジット・デフォルト・スワップ 2015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 (20,879,100)	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Credit Suisse	20/6/2020	(270,138)	941,314
EUR (4,835,000)	ファンドはITRAXX.EUR.23.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	Credit Suisse	20/6/2020	13,597	72,732
USD 20,178,000	ファンドはCDX.NA.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2020	85,723	(170,191)
USD 9,511,500	ファンドはCDX.NA.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2020	10,562	(80,225)
USD (20,897,190)	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Credit Suisse	20/6/2020	(86,128)	942,130
USD 15,178,000	ファンドはCDX.NA.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2020	147,545	(128,019)
USD (20,839,500)	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Credit Suisse	20/6/2020	(137,989)	939,529
USD 56,411,666	ファンドはCDX.NA.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2020	472,651	(475,805)
USD (1,287,000)	ファンドはCDX.NA.HY.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2020	(28,681)	58,023
EUR (7,795,000)	ファンドはVolkswagen AG 5.375% 22/5/2018に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/9/2020	(52,101)	102,263
EUR (720,000)	ファンドはGlencore International AG 6.5% 27/2/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/9/2020	(19,068)	(97,634)
EUR (110,000)	ファンドはGlencore International AG 6.5% 27/2/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/9/2020	(3,605)	(14,916)
USD 1,500,000	ファンドはOccidental Petroleum Corporation 4.125% 1/6/2016に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2020	(1,810)	(9,099)
USD 1,998,674	ファンドはABX.HE.AAA.06-2に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、.11%の固定金利を支払う	Credit Suisse	25/5/2046	(138,255)	368,089
USD (1,770,000)	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	11/5/2063	(9,922)	(24,615)
USD (2,541,100)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	Deutsche Bank	20/9/2020	(22,038)	(57,054)

クレジット・デフォルト・スワップ 2015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 (2,541,300)	ファンドは Mexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	Deutsche Bank	20/9/2020	(22,039)	(57,059)
USD (245,000)	ファンドは Transocean Inc 7.375% 15/4/2018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	20/6/2019	(44,623)	(52,553)
USD 3,200,000	ファンドは ConocoPhillips 5.9% 15/10/2032に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/3/2020	17,074	(52,988)
USD (1,100,000)	ファンドは Transocean Inc 7.375% 15/4/2018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	20/3/2020	16,632	(287,908)
EUR 3,930,000	ファンドは Continental AG 3.125% 9/9/2020に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2020	60,604	(56,036)
EUR 3,600,000	ファンドは ITRAXX.EUR.23.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2020	17,751	(54,154)
EUR (3,930,000)	ファンドは Bayerische Motoren Werke AG 5% 6/8/2018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	20/6/2020	(54,145)	74,464
USD 2,200,000	ファンドは Mexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/9/2020	(4,811)	49,396
EUR 30,000	ファンドは Louis Dreyfus Commodities BV 4% 4/12/2020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	20/9/2020	291	(2,827)
USD (4,933,000)	ファンドは Mexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/9/2020	(4,892)	(110,759)
EUR 50,000	ファンドは Louis Dreyfus Commodities BV 4% 4/12/2020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	20/9/2020	484	(4,712)
EUR 42,000	ファンドは Abengoa SA 8.5% 31/3/2016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	20/9/2020	(1,342)	24,018
EUR 23,000	ファンドは Abengoa SA 8.5% 31/3/2016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	20/9/2020	(239)	13,153
USD 500,000	ファンドは AK Steel Corp 7.625% 15/5/2020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	20/12/2016	26,876	19,583

クレジット・デフォルト・スワップ 2015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 (720,000)	ファンドはTransocean Inc 7.375% 15/4/2018に係るデフォルト・プロテ クションを提供し、1%の固定金利を受け取 る	JP Morgan	20/12/2019	(113,979)	(177,916)
USD (500,000)	ファンドはAK Steel Corp 7.625% 15/5/2020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	20/12/2019	(97,334)	(145,112)
USD 1,600,000	ファンドはGeneral Mills Inc 5.7% 15/2/2017に係るデフォルト・プロテ クションを受け取り、1%の固定金利を支払 う	JP Morgan	20/3/2020	(8,201)	(51,639)
USD 16,583,472	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォ ルト・プロテクションを受け取り、1%の固 定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	139,797	319,414
USD 1,300,000	ファンドはBoyd Gaming Corporation 7.125% 1/2/2016に係るデフォルト・プロ テクションを受け取り、5%の固定金利を 支払う	JP Morgan	20/6/2020	(64,885)	(141,286)
EUR (1,610,000)	ファンドはITRAXX.EUR.23.V1に係るデフ ォルト・プロテクションを提供し、1%の固 定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2020	(2,595)	24,219
USD 4,790,000	ファンドはSouth Africa (Republic of) 5.5% 9/3/2020に係るデフォルト・プロ テクションを受け取り、1%の固定金利を支 払う	JP Morgan	20/9/2020	64,735	324,660
USD (1,000,000)	ファンドはFreeport-McMoran Inc 3.55% 1/3/2022に係るデフォルト・プロテ クションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	10,729	(201,699)
USD (2,472,300)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォ ルト・プロテクションを提供し、1%の固定 金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	(20,246)	(55,510)
USD (33,515,600)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォ ルト・プロテクションを提供し、1%の固定 金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	(305,755)	(752,515)
USD (16,583,472)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォ ルト・プロテクションを提供し、1%の固定 金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	(140,745)	(372,343)
USD (2,472,100)	ファンドはMexico (United Mexican States)5.95% 19/3/2019に係るデフォ ルト・プロテクションを提供し、1%の固定 金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	(20,244)	(55,505)
EUR 1,025,000	ファンドはGlencore International AG 6.5% 27/2/2019に係るデフォルト・プロ テクションを受け取り、1%の固定金利を 支払う	JP Morgan	20/9/2020	55,024	138,994
EUR (1,720,000)	ファンドはVolkswagen AG 5.375% 22/5/2018に係るデフォルト・プロテ クションを提供し、1%の固定金利を受け取 る	JP Morgan	20/9/2020	(6,993)	22,565

クレジット・デフォルト・スワップ 2015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 3,835,000	ファンドはSouth Africa (Republic of) 5.5% 9/3/2020に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/9/2020	48,447	259,932
USD 1,500,000	ファンドはExpedia Inc 7.456% 15/8/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(5,878)	(1,943)
USD 1,500,000	ファンドはEastman Chemical Company 7.6% 1/2/2027に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(3,527)	(7,813)
USD 1,500,000	ファンドはExpedia Inc 7.456% 15/8/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(3,643)	(1,943)
USD 1,500,000	ファンドはEi Du Pont de Nemours & Co 6% 15/7/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(4,431)	(25,392)
USD 1,500,000	ファンドはDow Chemical Company/The 7.375% 1/11/2029に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(5,458)	(38)
USD 1,500,000	ファンドはBoeing Co 8.75% 15/8/2021に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(1,042)	(57,133)
USD 1,500,000	ファンドはBoeing Co 8.75% 15/8/2021に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(1,844)	(57,133)
USD 1,500,000	ファンドはYum! Brands Inc 6.25% 15/3/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(8,064)	1,060
USD 1,500,000	ファンドはDow Chemical Company/The 7.375% 1/11/2029に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(1,737)	(38)
USD 1,500,000	ファンドはYum! Brands Inc 6.25% 15/3/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(4,362)	1,060
USD 1,500,000	ファンドはEi Du Pont De Nemours & Co 6% 15/7/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(2,145)	(25,393)
USD 1,500,000	ファンドはEastman Chemical Company 7.6% 1/2/2027に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(1,276)	(7,813)
EUR 1,800,000	ファンドはITRAXX.EUR.23.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/6/2020	5,144	(27,077)
EUR 880,000	ファンドはITRAXX.EUR.23.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/6/2020	3,080	(13,238)

クレジット・デフォルト・スワップ 2015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 349,000	ファンドはITRAXX.EUR.22.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	Morgan Stanley	20/12/2019	650	(6,095)
EUR 199,000	ファンドはITRAXX.EUR.22.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	Morgan Stanley	20/12/2019	674	(3,476)
EUR 199,000	ファンドはITRAXX.EUR.22.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	Morgan Stanley	20/12/2019	350	(3,476)
EUR 202,000	ファンドはITRAXX.EUR.22.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	Morgan Stanley	20/12/2019	306	(3,528)
USD 3,100,000	ファンドはStaples Inc 2.75% 12/1/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/3/2020	(28,401)	61,973
EUR 7,450,000	ファンドはITRAXX.EUR.23.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	Morgan Stanley	20/6/2020	30,281	(112,068)
USD (4,039,695)	ファンドはCDX.NA.HY.24.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	Morgan Stanley	20/6/2020	(38,047)	182,126
EUR (5,995,000)	ファンドはBayerische Motoren Werke AG 5% 6/8/2018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	20/6/2020	(80,419)	113,590
EUR 5,995,000	ファンドはContinental AG 3.125% 9/9/2020に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2020	96,953	(85,480)
USD 800,000	ファンドはTesoro Corp 4.25% 1/10/2017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	20/9/2020	6,501	(119,203)
EUR (1,180,000)	ファンドはGlencore International AG 6.5% 27/2/2019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	20/9/2020	(33,917)	(160,012)
EUR (2,480,000)	ファンドはGlencore International AG 6.5% 27/2/2019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	20/9/2020	(138,452)	(336,297)
EUR (1,980,000)	ファンドはGlencore International AG 6.5% 27/2/2019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	20/9/2020	(97,175)	(268,495)
USD 2,200,000	ファンドはCMBX.NA.7.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	17/1/2047	17,004	93,994
USD (1,820,000)	ファンドはCMBX.NA.7.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	17/1/2047	(65,610)	(77,759)
USD (1,800,000)	ファンドはCMBX.NA.7.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	17/1/2047	(67,173)	(76,904)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 1,339,223,604米ドル)				(2,404,523)	1,178,947

注：当該取引による時価合計1,178,947米ドルは、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

トータル・リターン・スワップ 2015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 (16,930)	ファンドは3ヶ月EUR BBA EURIBOR + 30bpsを受け取り、Banco Santander SAを支払う	BNP Paribas	27/7/2016	16,989	18,986
USD (1,000,000)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR + 250bpsを受け取り、Bangkok Dusit Medical Servicesを支払う	Credit Suisse	17/9/2015	30,991	30,991
USD 7,975,296	ファンドはInterest Only 2010 FN 30 Year + Obpsを受け取り、1ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを支払う	Credit Suisse	12/1/2041	4,572	4,572
USD 4,073,681	ファンドはInterest Only 2010 FN 30 Year + Obpsを受け取り、1ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを支払う	Credit Suisse	12/1/2041	2,270	2,270
USD 3,839,740	ファンドはInterest Only 2010 FN 30 Year + Obpsを受け取り、1ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを支払う	Credit Suisse	12/1/2041	1,956	1,956
USD 7,975,296	ファンドはInterest Only 2010 FN 30 Year + Obpsを受け取り、1ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを支払う	Credit Suisse	12/1/2041	4,572	4,572
USD 3,839,740	ファンドはInterest Only 2010 FN 30 Year + Obpsを受け取り、1ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	12/1/2041	(1,956)	(1,956)
USD 4,073,367	ファンドはInterest Only 2010 FN 30 Year + Obpsを受け取り、1ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	12/1/2041	2,341	2,341
USD 3,987,648	ファンドはInterest Only 2010 FN 30 Year + Obpsを受け取り、1ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	12/1/2041	2,292	2,292
USD 3,987,648	ファンドはInterest Only 2010 FN 30 Year + Obpsを受け取り、1ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	12/1/2041	2,292	2,292
USD 15,919,193	ファンドはInterest Only 2010 FN 30 Year + Obpsを受け取り、1ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを支払う	JP Morgan	12/1/2041	9,149	9,149
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 56,318,448米ドル)				75,468	77,465

注：当該取引による時価合計77,465米ドルは、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

インフレーション・スワップ 2015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 (米ドル)	時価 (米ドル)
GBP 25,983,000	ファンドはUKRPI + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.105%の固定金利を受け取る	Citibank	12/8/2025	265,984	265,984
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 39,912,244米ドル)				265,984	265,984

注：当該取引による時価合計265,984米ドルは、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

売建コール・オプション 2015年8月31日現在

コールの対象となる契約数	発行者/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)
(54,020,000)	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.28	30/10/2015	(1,540,972)	(2,298,551)
(12,153,000)	OTC USD/KRW	BNP Paribas	USD 1,175	1/9/2015	(53,376)	(98,974)
(7,427,000)	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 3.65	3/9/2015	(38,450)	(96,752)
(12,000,000)	OTC USD/SGD	BNP Paribas	USD 1.41	28/9/2015	(1,236)	(124,536)
(15,905,000)	OTC USD/SGD	BNP Paribas	USD 1.395	28/9/2015	(70,494)	(268,858)
(15,905,000)	OTC USD/SGD	BNP Paribas	USD 1.455	28/9/2015	49,146	(29,424)
(4,000,000)	OTC USD/TWD	BNP Paribas	USD 32	8/10/2015	(59,956)	(81,076)
(12,153,000)	OTC USD/KRW	BNP Paribas	USD 1,210	30/10/2015	(33,858)	(153,930)
(11,119,000)	OTC USD/CNY	BNP Paribas	USD 6.8	15/12/2015	3,714	(63,890)
(8,414,000)	OTC USD/KRW	Deutsche Bank	USD 1,135	1/9/2015	5,234	(349,753)
(49,000,000)	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.28	21/9/2015	(1,356,173)	(1,946,133)
(27,000,000)	OTC USD/CNY	Deutsche Bank	USD 6.7	5/2/2016	(62,667)	(287,577)
(18,815,000)	OTC USD/TWD	HSBC	USD 31.5	8/10/2015	(448,982)	(618,129)
(3,460,000)	OTC USD/CAD	HSBC	USD 1.35	29/10/2015	(8,328)	(37,738)
(2,210,000)	OTC USD/BRL	HSBC	USD 3.6	9/11/2015	(40,207)	(127,612)
(14,085,000)	OTC USD/CNH	HSBC	USD 6.875	26/11/2015	13,274	(48,607)
(7,427,000)	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.45	3/9/2015	(300,504)	(455,728)
(9,210,000)	OTC USD/SGD	JP Morgan	USD 1.42	10/9/2015	903	(32,990)
(5,314,050)	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 13.25	26/10/2015	(35,950)	(182,139)
(7,401,000)	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.75	8/10/2015	(88,481)	(177,432)
(11,119,000)	OTC USD/CNY	Standard Chartered Bank London	USD 6.8	13/11/2015	21,882	(42,130)
(7,413,000)	OTC USD/MYR	Standard Chartered Bank London	USD 4.125	18/11/2015	(53,833)	(261,375)
(30,113)	Nikkei 225 Index	Citibank	JPY 22,381.92	11/9/2015	4,478	(23)
(313)	2 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98.25	11/9/2015	(37,673)	(131,069)
(421)	Apple Inc	Exchange Traded	USD 130	15/1/2016	(20,260)	(113,038)
(2,352)	DAX Index	Exchange Traded	EUR 11,000	18/9/2015	280,120	(182,935)
(74)	Lyondellbasell Industries NV	Exchange Traded	USD 90	15/1/2016	(8,971)	(36,630)
(210)	S&P 500 E Mini	Exchange Traded	USD 2,040	18/9/2015	24,962	(105,000)
(6,595)	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 202	18/9/2015	(825,043)	(1,253,050)
(6,597)	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 206	18/9/2015	15,824	(438,701)
(7,095)	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 215	19/12/2015	2,478,931	(858,495)
(187)	United Rentals Inc	Exchange Traded	USD 72.5	18/12/2015	(12,736)	(63,580)
(95)	Whiting Petroleum Corp	Exchange Traded	USD 20	18/12/2015	(4,807)	(24,463)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 489,026,012米ドル)					(2,204,489)	(10,990,318)

注：売建コール・オプションは、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

売建プット・オプション 2015年8月31日現在

プットの対象 となる契約数	発行者/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)
(128,931,000)	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.02	24/9/2015	317,714	(18,101)
(28,000,000)	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1	18/9/2015	31,203	(3,742)
(13,645,000)	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.07	9/10/2015	88,843	(32,904)
(20,300,000)	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.08	9/10/2015	146,915	(86,617)
(128,931,000)	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.07	24/9/2015	(98,991)	(183,474)
(14,025,000)	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 16.5	26/10/2015	(16,704)	(117,852)
(14,036,000)	OTC USD/JPY	HSBC	USD 115	24/9/2015	33,013	(10,176)
(16,056,000)	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.05	10/9/2015	62,683	(2,146)
(13,645,000)	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.12	9/10/2015	225,394	(187,093)
(20,300,000)	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.04	9/10/2015	155,254	(18,149)
(9,550,000)	OTCEUR/PLN	Morgan Stanley	EUR 4.02	22/9/2015	23,283	(944)
(7,413,000)	OTC USD/MYR	Standard Chartered Bank London	USD 4.13	18/11/2015	78,244	(129,298)
(421)	Apple Inc	Exchange Traded	USD 80	15/1/2016	38,105	(66,518)
(612)	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 99.13	14/12/2015	48,739	(3,825)
(1,000)	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 99.38	14/12/2015	95,265	(40,625)
(1,510)	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 98.75	14/3/2016	615,816	(23,594)
(221)	iShares IBOX \$ High Yield Corporate Bond ETF	Exchange Traded	USD 92	18/9/2015	(34,755)	(141,440)
(73)	Lyondellbasell Industries NV	Exchange Traded	USD 85	18/9/2015	(10,453)	(30,295)
(74)	Lyondellbasell Industries NV	Exchange Traded	USD 70	15/1/2016	6,846	(24,235)
(244)	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 190	19/12/2015	(91,662)	(176,534)
(187)	United Rentals Inc	Exchange Traded	USD 57.5	18/12/2015	822	(45,347)
(95)	Whiting Petroleum Corp	Exchange Traded	USD 16	18/12/2015	(8,845)	(28,975)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 357,858,910米ドル)					1,706,729	(1,371,884)

注：売建プット・オプションは、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建プット・オプション 2015年8月31日現在

プットの対象 となる契約数	発行者/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)
128,931,000	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.07	24/9/2015	(1,386,460)	183,473
28,000,000	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.04	18/9/2015	(130,170)	5,661
20,300,000	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.04	9/10/2015	(100,464)	18,149
13,645,000	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.115	9/10/2015	(90,247)	187,093
10,437,000	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 123.5	9/9/2015	162,942	218,258
8,028,000	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.05	10/9/2015	(11,138)	1,073
17,680,000	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.11	11/9/2015	(26,383)	91,086
28,000,000	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1	18/9/2015	(2,455)	3,742
128,931,000	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.02	24/9/2015	16,645	18,101
9,350,000	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 17	26/10/2015	29,583	204,129
18,050,000	OTCEUR/PLN	HSBC	EUR 4.12	23/9/2015	(174,659)	12,853
9,358,000	OTC USD/JPY	HSBC	USD 118.5	24/9/2015	(62,034)	36,141
10,000,000	OTC USD/CAD	HSBC	USD 1.28	29/10/2015	(14,570)	34,430
8,028,000	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.1	10/9/2015	(102,214)	20,792
20,300,000	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.08	9/10/2015	(237,629)	86,617
13,645,000	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.065	9/10/2015	(160,065)	32,904
9,550,000	OTCEUR/PLN	Morgan Stanley	EUR 4.1	22/9/2015	(80,374)	3,615
10,584	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98.75	11/9/2015	(2,003,925)	132,300
3,388	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98.25	11/9/2015	(196,030)	21,175
1,647	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98.5	11/9/2015	(34,308)	10,294
360	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98.625	11/9/2015	(97,330)	2,250
2,857	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98.5	11/12/2015	(775,268)	339,269
247	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98.25	11/12/2015	(42,923)	10,806
440	2 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98	11/9/2015	(204,208)	5,500
244	Energy Select Sector SPDR Fund	Exchange Traded	USD 64	18/9/2015	17,302	55,022
37	Euro Bund	Exchange Traded	EUR 153	25/9/2015	(19,900)	25,350
500	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 99.5	14/12/2015	(78,930)	62,500
755	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 99	14/3/2016	(463,608)	28,312
755	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 98.5	14/3/2016	(204,076)	4,719
300	PowerShares QQQ Trust Series 1	Exchange Traded	USD 103	18/9/2015	2,820	65,250
281	SPDR S&P Oil & Gas Exploration	Exchange Traded	USD 36	4/9/2015	9,787	29,084
566	Transocean Ltd	Exchange Traded	USD 12	18/9/2015	(18,868)	32,262
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 1,888,866,828米ドル)					(6,479,157)	1,982,210

注：買建プット・オプションは、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建コール・オプション 2015年8月31日現在

コールの対象 となる契約数	発行者 / 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)
450,000,000	OTC USD/CAD	Barclays	USD 1.365	8/9/2015	(548,550)	355,950
12,153,000	OTC USD/KRW	BNP Paribas	USD 1,175	1/9/2015	(33,980)	98,974
8,414,000	OTC USD/KRW	BNP Paribas	USD 1,135	1/9/2015	248,348	349,753
7,427,000	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 3.45	3/9/2015	242,202	455,728
49,000,000	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.28	21/9/2015	1,423,793	1,946,133
15,905,000	OTC USD/SGD	BNP Paribas	USD 1.395	28/9/2015	58,912	268,858
15,905,000	OTC USD/SGD	BNP Paribas	USD 1.455	28/9/2015	(7,157)	29,424
7,413,000	OTC USD/CNH	BNP Paribas	USD 6.54	15/12/2015	(20,682)	83,470
31,595,000	OTC USD/SAR	BNP Paribas	USD 3.79	15/8/2016	94,058	279,900
45,380,000	OTC USD/SAR	BNP Paribas	USD 3.778	16/8/2016	133,145	466,688
53,770,000	OTC USD/JPY	Citibank	USD 127.5	18/12/2015	(334,503)	275,249
45,890,000	OTC USD/SAR	Citibank	USD 3.778	16/8/2016	45,615	471,933
37,690,000	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.28	30/10/2015	1,003,308	1,603,710
16,330,000	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.28	30/10/2015	480,918	694,842
8,414,000	OTC USD/KRW	Deutsche Bank	USD 1,180	30/10/2015	(18,393)	187,161
18,000,000	OTC USD/CNY	Deutsche Bank	USD 6.45	5/2/2016	107,172	371,592
12,000,000	OTC USD/SGD	HSBC	USD 1.41	28/9/2015	7,536	124,536
4,000,000	OTC USD/TWD	HSBC	USD 32	8/10/2015	63,676	81,076
9,390,000	OTC USD/CNH	HSBC	USD 6.5475	26/11/2015	(39,513)	87,862
9,000,000	OTC USD/CNY	HSBC	USD 6.7	5/2/2016	15,534	95,859
7,427,000	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.65	3/9/2015	75,956	96,752
7,401,000	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.55	8/10/2015	189,020	404,650
18,815,000	OTC USD/TWD	Morgan Stanley	USD 31.5	8/10/2015	500,535	618,129
46,240,000	OTC USD/CHF	RBS	USD 1.043	9/8/2016	(189,815)	593,490
7,413,000	OTC USD/CNY	Standard Chartered Bank London	USD 6.5	13/11/2015	(33,662)	70,690
9,210,000	OTC USD/SGD	UBS	USD 1.42	10/9/2015	(44,374)	32,990
77,162	Nikkei 225 Index	Citibank	JPY 21,750	11/9/2015	(40,915)	206
30,113	Nikkei 225 Index	Citibank	JPY 21,345.72	11/9/2015	(41,313)	199
2,053	Barrick Gold Corp	Exchange Traded	USD 20	15/1/2016	(90,303)	8,212
281	Barrick Gold Corp	Exchange Traded	USD 12	15/1/2016	(4,524)	4,215
1,764	DAX Index	Exchange Traded	EUR 10,600	18/9/2015	(561,471)	861,841
300	Exxon Mobil Corp	Exchange Traded	USD 78	18/9/2015	(13,380)	16,050
281	iShares China Large-Cap ETF	Exchange Traded	USD 42	18/9/2015	(35,903)	1,686
604	Nikkei 225 Index	Exchange Traded	JPY 21,250	11/9/2015	(2,501,825)	19,945
140	S&P 500 E Mini	Exchange Traded	USD 2,005	18/9/2015	(21,105)	161,875
4,398	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 199	18/9/2015	(26,828)	1,482,126
4,397	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 195	18/9/2015	1,336,248	2,587,635
21,285	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 220	19/12/2015	(4,280,414)	1,160,032
222	Valero Energy Corp	Exchange Traded	USD 72.5	18/9/2015	(48,640)	1,332
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 416,875,443米ドル)					(2,911,274)	16,450,753

注：買建コール・オプションは、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

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 2015年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 164,840,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/12/2015より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、25/3/2016より2.57%の固定金利を半年毎に支払う。	Bank of America	23/9/2015	(1,247,196)	71,524
USD 95,156,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは22/12/2015より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、22/3/2016より3.55%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	18/9/2015	(248,488)	15
USD 47,578,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは22/12/2015より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、22/3/2016より3.1%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	18/9/2015	(477,759)	7,536
USD 10,245,000	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21/3/2016より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、21/6/2016より3.3%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	17/12/2015	(178,335)	46,543
USD 10,245,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/12/2015より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、19/12/2020より3.18%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	17/6/2020	(224,880)	(224,880)
USD 10,245,000	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3.18%の固定金利を19/12/2020より半年ごとに受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を19/9/2020より四半期毎に支払う。	Citibank	17/6/2020	252,887	252,888
KRW 22,575,222,776	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1.92%の固定金利を11/11/2017より毎年受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を11/11/2017より毎年支払う。	Deutsche Bank	9/11/2015	43,983	104,139
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 45,722,385米ドル)				(2,079,788)	257,765

注：買建スワップションは、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

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 2015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 (20,570,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/6/2016より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、29/12/2016より0.45%の固定金利を毎年支払う。	Bank of America	24/12/2015	(10,940)	(71,343)
EUR (20,570,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/12/2016より0.85%の固定金利を毎年受け取り、29/6/2016より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Bank of America	24/12/2015	52,356	(8,047)
EUR (10,900,000)	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22/2/2017より1.85%の固定金利を毎年受け取り、22/8/2016より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	18/2/2016	(68,431)	(347,610)
USD (23,789,000)	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22/3/2016より2.65%の固定金利を半年毎に受け取り、22/12/2015より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	18/9/2015	417,735	(402,986)
EUR (20,570,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは28/6/2016より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、28/12/2016より0.45%の固定金利を毎年支払う。	Citibank	23/12/2015	(5,895)	(70,996)
EUR (20,570,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは28/12/2016より0.85%の固定金利を毎年受け取り、28/6/2016より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Citibank	23/12/2015	57,253	(7,848)
USD (61,500,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは28/9/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、28/12/2017より2.2%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	26/6/2017	(609,526)	(1,627,351)
USD (61,500,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは28/12/2017より3.2%の固定金利を半年毎に受け取り、28/9/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	26/6/2017	744,273	(1,371,327)
KRW (22,575,222,776)	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11/11/2017より3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を毎年受け取り、11/11/2017より1.63%の固定金利を毎年支払う。	Deutsche Bank	9/11/2015	(11,432)	(23,878)
USD (87,900,000)	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23/11/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、23/3/2018より2.2%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	21/8/2017	(324,703)	(2,412,328)
USD (87,900,000)	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23/2/2018より3.2%の固定金利を半年毎に受け取り、23/11/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	21/8/2017	15,558	(2,159,967)

売建スワップション 2015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 (7,375,000)	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21/12/2016より2%の固定金利を毎年受け取り、21/6/2016より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	17/12/2015	152,084	(88,068)
USD (61,500,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは21/12/2017より3.2%の固定金利を半年毎に受け取り、21/9/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	19/6/2017	540,462	(1,353,738)
USD (61,500,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは21/9/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、21/12/2017より2.2%の固定金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	19/6/2017	(395,814)	(1,619,664)
EUR (21,700,000)	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22/2/2017より1.85%の固定金利を毎年受け取り、22/8/2016より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	UBS	18/2/2016	(120,583)	(692,031)
EUR (21,700,000)	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23/2/2017より1.85%の固定金利を毎年受け取り、23/8/2016より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	UBS	19/2/2016	(142,042)	(695,443)
EUR (21,700,000)	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24/2/2017より1.85%の固定金利を毎年受け取り、24/8/2016より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	UBS	22/2/2016	(183,910)	(704,924)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 227,073,576米ドル)				106,445	(13,657,549)

注：売建スワップションは、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

金融デリバティブ商品の要約	時価 (米ドル)
スワップ	
クレジット・デフォルト・スワップ	1,178,947
通貨スワップ	265,984
金利スワップ	(6,933,676)
トータル・リターン・スワップ	77,465
スワップの時価	(5,411,280)
買建オプション/スワップション	
買建コール・オプション	16,450,753
買建プット・オプション	1,982,210
買建スワップション	257,765
買建オプション/スワップションの時価	18,690,728
売建オプション/スワップション	
売建コール・オプション	(10,990,318)
売建プット・オプション	(1,371,884)
売建スワップション	(13,657,549)
売建オプション/スワップションの時価	(26,019,751)
事後通告証券契約の時価	(89,335,583)
	未実現評価益 (米ドル)
未決済上場先物取引	412,546
未決済先渡為替予約	30,136,719

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表 2015年8月31日現在

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
債券			
オーストラリア			
AUD 831,005	Apollo Trust '2009-1 A3' FRN 3/10/2040	597,251	0.04
AUD 958,303	Crusade ABS Trust '2012-1 A' FRN 12/7/2023	682,005	0.05
AUD 540,395	National Rmbs Trust '2012-2 A1' FRN 20/6/2044	388,672	0.03
AUD 3,178,943	TORRENS Series Trust '2013-1 A' FRN 12/4/2044	2,256,905	0.15
USD 2,867,576	Virgin Australia 2013-1A Trust '144A' 5% 23/10/2023	2,971,526	0.20
USD 3,216,423	Virgin Australia 2013-1B Trust '144A' 6% 23/10/2020	3,300,855	0.22
USD 10,000,000	Westpac Banking Corp '144A' 1.375% 30/5/2018	9,955,585	0.66
		20,152,799	1.35
パミューダ			
USD 4,922,000	Aircastle Ltd 6.75% 15/4/2017	5,205,015	0.35
カナダ			
USD 2,211,905	Air Canada 2013-1 Class B Pass Through Trust '144A' 5.375% 15/5/2021	2,272,732	0.15
USD 17,000,000	Bank of Nova Scotia/The '144A' 1.95% 30/1/2017	17,229,169	1.15
USD 13,030,000	Royal Bank of Canada 1.2% 19/9/2017	12,997,809	0.87
		32,499,710	2.17
ケイマン諸島			
USD 1,950,000	Seagate HDD Cayman 3.75% 15/11/2018	2,011,387	0.13
USD 750,000	XLIT Ltd 2.3% 15/12/2018	754,876	0.05
		2,766,263	0.18
キプロス			
EUR 2,875,000	Cyprus Government International Bond '144A' 3.75% 1/11/2015*	3,233,136	0.22
EUR 1,996,000	Cyprus Government International Bond '144A' 4.625% 3/2/2020	2,300,640	0.15
EUR 1,295,000	Cyprus Government International Bond 4.75% 25/6/2019	1,528,968	0.10
		7,062,744	0.47
フランス			
EUR 1,611,708	AUTO ABS FCT Compartiment '2013-2 A' FRN 27/1/2023	1,818,874	0.12
EUR 278,689	Cars Alliance Auto Loans France V' 2012-F1V A' FRN 25/2/2024	313,018	0.02
EUR 1,071	FCT Copernic '2012-1 A1' FRN 25/9/2029	1,204	0.00
		2,133,096	0.14
香港			
USD 1,700,000	AIA Group Ltd '144A' 2.25% 11/3/2019	1,694,224	0.11
アイスランド			
USD 492,000	Iceland Government International Bond '144A' 4.875% 16/6/2016	506,729	0.04
USD 2,670,000	Iceland Government International Bond 4.875% 16/6/2016	2,750,874	0.18
		3,257,603	0.22

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	インドネシア		
USD 151,000	Indonesia Government International Bond '144A' 6.625% 17/2/2037	165,157	0.01
USD 305,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III '144A' 4.325% 28/5/2025	290,131	0.02
		455,288	0.03
	アイルランド		
EUR 58,950	Talisman-6 Finance Plc FRN 22/10/2016	65,423	0.00
	イタリア		
EUR 803,264	Asset Backed European Securitisation Transaction Nine Srl FRN 10/12/2028	902,736	0.06
EUR 2,479,715	Asset Backed European Securitisation Transaction Ten Srl 0.552% 10/12/2028	2,791,310	0.19
EUR 1,125,899	Berica ABS Srl '2012-2 A1' FRN 30/11/2051	1,262,744	0.08
EUR 609,517	Sunrise Srl '2014-1 A' FRN 27/5/2031	685,477	0.05
		5,642,267	0.38
	ルクセンブルグ		
USD 395,000	Actavis Funding SCS 2.45% 15/6/2019	392,481	0.02
EUR 620,908	Compartment VCL 19 0.767% 1/11/2019	698,098	0.05
EUR 945,000	ECAR '2013-1 B' 1.478% 18/11/2020	1,064,411	0.07
USD 406,000	Pentair Finance SA 1.35% 1/12/2015	406,635	0.03
		2,561,625	0.17
	メキシコ		
USD 2,786,000	Kansas City Southern de Mexico SA de CV FRN 28/10/2016	2,770,164	0.19
MXN 4,080,000	Mexican Bonos 4.75% 14/6/2018	241,444	0.02
USD 54,000	Mexico Government International Bond 4% 2/10/2023	54,743	0.00
USD 204,000	Mexico Government International Bond 4.75% 8/3/2044	191,559	0.01
USD 83,000	Mexico Government International Bond 5.55% 21/1/2045	87,078	0.01
USD 24,000	Mexico Government International Bond 6.05% 11/1/2040	27,060	0.00
		3,372,048	0.23
	オランダ		
USD 3,215,000	ING Bank NV '144A' 1.8% 16/3/2018	3,209,505	0.21
USD 1,583,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 3.75% 1/6/2018	1,600,809	0.11
		4,810,314	0.32
	パナマ		
USD 1,252,000	Carnival Corp 1.875% 15/12/2017	1,252,073	0.08
	ポルトガル		
EUR 1,985,108	Atlantes Ltd / Atlantes Finance Plc FRN 20/3/2033	2,241,899	0.15
EUR 1,795,598	TAGUS-Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta II Electricity Receivables 2.98% 16/2/2018	2,026,728	0.14
		4,268,627	0.29
	ロシア連邦		
RUB 2,395,000	Russian Federal Bond - OFZ 7% 16/8/2023	27,472	0.00

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	スロベニア		
EUR 2,007,000	Slovenia Government Bond 2.25% 25/3/2022	2,377,698	0.16
USD 9,240,000	Slovenia Government International Bond '144A' 4.75% 10/5/2018*	9,865,548	0.66
		12,243,246	0.82
	スウェーデン		
USD 4,600,000	Swedbank AB '144A' 1.6% 2/3/2018	4,592,930	0.31
	スイス		
USD 6,130,000	Credit Suisse/New York NY 1.7% 27/4/2018	6,094,425	0.41
USD 6,170,000	UBS AG/Stamford CT 1.375% 1/6/2017	6,143,633	0.41
USD 5,585,000	UBS AG/Stamford CT 1.8% 26/3/2018	5,572,411	0.37
		17,810,469	1.19
	英国		
USD 3,219,000	AXIS Specialty Finance Plc 2.65% 1/4/2019	3,228,316	0.22
USD 6,900,000	Barclays Plc 2% 16/3/2018	6,872,731	0.46
USD 555,000	BAT International Finance Plc '144A' 2.125% 7/6/2017	560,206	0.04
GBP 460,834	First Flexible No 7 Plc FRN 15/9/2033	697,344	0.05
GBP 643,220	Fosse Master Issuer Plc '2012-1X 2A3' FRN 18/10/2054	992,138	0.07
GBP 45,234	Gosforth Funding plc '2012-1 A' FRN 19/12/2047	70,018	0.00
GBP 1,261,229	Precise Mortgage Funding Plc '2014-1 A' FRN 12/9/2047	1,906,402	0.13
GBP 3,993,451	Precise Mortgage Funding Plc '2014-2 A' FRN 12/12/2047	6,073,261	0.40
GBP 980,125	Rochester Financing No1 Plc FRN 16/7/2046	1,515,738	0.10
GBP 185,536	Silk Road Finance Number Three Plc '2012-1 A' FRN 21/6/2055	288,154	0.02
USD 6,490,000	Sky Plc '144A' 2.625% 16/9/2019	6,484,328	0.43
USD 2,269,000	Sky Plc '144A' 6.1% 15/2/2018	2,475,782	0.16
USD 4,800,000	Standard Chartered Plc '144A' 1.5% 8/9/2017	4,807,387	0.32
EUR 2,488,815	Taurus Plc '2013-GMF1 D' FRN 21/5/2024	2,872,640	0.19
GBP 807,600	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.542% 30/3/2021	1,300,619	0.09
GBP 1,080,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28/3/2024	1,702,590	0.11
		41,847,654	2.79
	米国		
USD 2,470,000	AbbVie Inc 1.75% 6/11/2017	2,469,886	0.16
USD 3,440,000	AbbVie Inc 1.8% 14/5/2018	3,422,840	0.23
USD 730,000	AbbVie Inc 2.5% 14/5/2020	722,958	0.05
USD 1,990,000	Actavis Inc 1.875% 1/10/2017	1,983,916	0.13
USD 2,361,000	AES Corp/VA FRN 1/6/2019	2,343,292	0.16
USD 5,545,000	Air Lease Corp 2.125% 15/1/2018	5,503,412	0.37
USD 3,280,000	Air Lease Corp 2.625% 4/9/2018	3,276,271	0.22
USD 1,900,000	Air Lease Corp 3.375% 15/1/2019	1,919,817	0.13
USD 529,735	Aircraft Lease Securitisation Ltd '2007-1A G3' '144A' FRN 10/5/2032	526,801	0.03
USD 6,500,000	Ally Financial Inc 3.25% 13/2/2018	6,491,875	0.43
USD 3,330,000	Ally Financial Inc 5.5% 15/2/2017	3,456,540	0.23

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 696,000	Ally Financial Inc 6.25% 1/12/2017	742,980	0.05
USD 1,659,105	American Airlines 2013-2 Class B Pass Through Trust '144A' 5.6% 15/7/2020	1,706,804	0.11
USD 600,000	American Capital Ltd '144A' 6.5% 15/9/2018	618,750	0.04
USD 1,047,109	American Credit Acceptance Receivables Trust '2014-4 A' '144A' 1.33% 10/7/2018	1,046,475	0.07
USD 1,351,258	American Homes 4 Rent '2014-SFR1 A' '144A' FRN 17/6/2031	1,337,243	0.09
USD 4,550,000	Americredit Automobile Receivables Trust '2014-4 C' 2.47% 9/11/2020	4,585,649	0.31
USD 1,680,000	AmeriCredit Automobile Receivables Trust '2013-2 B' 1.19% 8/5/2018	1,680,448	0.11
USD 360,000	AmeriCredit Automobile Receivables Trust '2012-4 B' 1.31% 8/11/2017	360,171	0.02
USD 1,520,000	AmeriCredit Automobile Receivables Trust '2011-3 D' 4.04% 10/7/2017	1,527,874	0.10
USD 250,000	Anthem Inc 5.875% 15/6/2017	268,142	0.02
USD 1,845,107	Apidos CDO V '2007-5A A1S' '144A' FRN 15/4/2021	1,824,542	0.12
USD 7,878,016	Apidos Cinco CDO Ltd '2007-CA A2A' '144A' FRN 14/5/2020	7,798,766	0.52
USD 270,407	Arran Residential Mortgages Funding Plc '2011-1A A2C' '144A' FRN 19/11/2047	271,568	0.02
USD 6,875,000	Associated Banc-Corp 2.75% 15/11/2019	6,905,728	0.46
USD 1,230,000	AT&T Inc 2.45% 30/6/2020	1,206,300	0.08
USD 6,000,000	Atrium V '144A' FRN 20/7/2020	5,836,754	0.39
USD 1,000,000	Avalon IV Capital Ltd '2012-1AR CR' '144A' FRN 17/4/2023	1,004,904	0.07
USD 4,234,914	B2R Mortgage Trust '2015-1 A1' '144A' 2.524% 15/5/2048	4,202,470	0.28
USD 3,500,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2007-5 AM' FRN 10/2/2051	3,698,116	0.25
USD 82,408	Banc of America Mortgage 2003-J Trust '2003-J 2A1' FRN 25/11/2033	82,707	0.01
USD 3,190,000	Bank of America Corp 0.558% 15/6/2021	3,193,461	0.21
USD 3,000,000	Bank of America Corp 2.6% 15/1/2019	3,023,458	0.20
USD 3,500,000	Bank of America Corp 2.65% 1/4/2019	3,534,788	0.24
USD 6,406,000	Bank of America Corp 6.5% 1/8/2016	6,709,478	0.45
USD 280,000	Baxalta Inc '144A' 2% 22/6/2018	278,863	0.02
USD 49,464	Bear Stearns ALT-A Trust '2004-13 A1' FRN 25/11/2034	48,902	0.00
USD 18,053	Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust '2007-PW17 A3' 5.736% 11/6/2050	18,033	0.00
USD 95,406	BNC Mortgage Loan Trust '2007-3 A2' FRN 25/7/2037	94,514	0.01
USD 5,555,000	Cabela's Credit Card Master Note Trust '2015-1A A1' 2.26% 15/3/2023	5,574,848	0.37
USD 380,000	Cablevision Systems Corp 8.625% 15/9/2017	416,100	0.03
USD 2,220,000	Capital One Financial Corp 3.15% 15/7/2016	2,256,913	0.15
USD 5,500,000	Capital One Multi-Asset Execution Trust '2015-A2 A2' 2.08% 15/3/2023	5,516,401	0.37
USD 4,895,000	Capital One NA/Mclean VA 2.35% 17/8/2018	4,898,353	0.33
USD 18,840,000	CarMax Auto Owner Trust '2015-2 A3' 1.37% 16/3/2020	18,831,145	1.26

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,250,000	CarMax Auto Owner Trust '2014-4 B' 2.2% 15/9/2020	3,279,806	0.22
USD 6,500,000	Case New Holland Industrial Inc 7.875% 1/12/2017	7,101,250	0.47
USD 9,000,000	CCO Safari II LLC '144A' 3.579% 23/7/2020	8,997,021	0.60
USD 3,985,000	CDGJ Commercial Mortgage Trust '2014-BXCH A' '144A' FRN 15/12/2027	3,988,551	0.27
USD 1,730,000	Celgene Corp 2.125% 15/8/2018	1,732,735	0.12
USD 7,430,000	Chase Issuance Trust '2012-A4 A4' 1.58% 16/8/2021	7,373,982	0.49
USD 13,000,000	Chase Issuance Trust '2015-A2 A2' 1.59% 18/2/2020	13,068,633	0.87
USD 735,000	Chesapeake Energy Corp 6.5% 15/8/2017	696,412	0.05
USD 1,900,000	Chesapeake Funding LLC '2014-1A B' '144A' FRN 7/3/2026	1,898,850	0.13
USD 500,000	Chesapeake Funding LLC '2014-1A C' '144A' FRN 7/3/2026	498,845	0.03
USD 1,150,000	Chesapeake Funding LLC '2014-1A D' '144A' FRN 7/3/2026	1,147,389	0.08
USD 423,572	CHL Mortgage Pass-Through Trust '2005-HYB8 2A1' FRN 20/12/2035	389,946	0.03
USD 4,500,000	CHS/Community Health Systems Inc 5.125% 15/8/2018	4,638,780	0.31
USD 5,000,000	CIFC Funding 2012-II Ltd '2012-2A A1R' '144A' FRN 5/12/2024	4,998,095	0.33
USD 3,670,000	CIT Group Inc 4.25% 15/8/2017	3,734,225	0.25
USD 5,250,000	CIT Group Inc 5.25% 15/3/2018	5,479,687	0.37
USD 5,790,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-SSHP A' '144A' FRN 15/9/2017	5,796,166	0.39
USD 5,000,000	Citigroup Inc 1.7% 27/4/2018	4,955,265	0.33
USD 315,000	CNH Industrial Capital LLC 3.875% 1/11/2015	315,787	0.02
USD 1,665,000	CNH Industrial Capital LLC 6.25% 1/11/2016	1,731,600	0.12
USD 3,195,000	COBALT CMBS Commercial Mortgage Trust '2007-C3 AM' FRN 15/5/2046	3,400,672	0.23
USD 3,000,000	Colony American Homes '2015-1A A' '144A' FRN 17/7/2032	2,970,856	0.20
USD 14,059,390	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 1.162% 10/5/2048	944,264	0.06
USD 2,235,000	Commercial Mortgage Trust '2014-KYO F' '144A' FRN 11/6/2027	2,222,304	0.15
USD 158,900	Commercial Mortgage Trust '2013-FL3 A' '144A' FRN 13/10/2028	158,277	0.01
USD 2,800,000	Commercial Mortgage Trust '2014-FL5 B' '144A' FRN 15/10/2031	2,806,356	0.19
USD 1,305,000	Commercial Mortgage Trust '2007-CD5 AJ' FRN 15/11/2044	1,395,237	0.09
USD 2,085,000	Commercial Mortgage Trust '2007-CD5 AJA' FRN 15/11/2044	2,220,539	0.15
USD 1,592,624	Commercial Mortgage Trust '2012-CR2 XA' FRN 15/8/2045	144,227	0.01
USD 12,407,567	Commercial Mortgage Trust '2013-CR7 XA' FRN 10/3/2046	912,788	0.06
USD 6,928,763	Commercial Mortgage Trust '2013-CR11 XA' FRN 10/10/2046	468,565	0.03
USD 36,335,865	Commercial Mortgage Trust '2015-LC21 XA' FRN 10/7/2048	1,995,675	0.13

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,323,556	Commercial Mortgage Trust '2013-SFS A1' '144A' 1.873% 12/4/2035	1,302,992	0.09
USD 5,905,000	Commercial Mortgage Trust '2012-9W57 A' '144A' 2.365% 10/2/2029	5,993,711	0.40
USD 5,500,000	Commercial Mortgage Trust '2015-CR22 A2' 2.856% 10/3/2048	5,629,016	0.38
USD 5,620,000	Commercial Mortgage Trust '2013-CR12 A2' 2.904% 10/10/2046	5,788,490	0.39
USD 10,700,000	Commercial Mortgage Trust '2015-LC21 A2' 2.976% 10/7/2048	11,070,932	0.74
USD 233,077	Commercial Mortgage Trust '2010-C1 A1' '144A' 3.156% 10/7/2046	232,994	0.02
USD 1,259,290	Commercial Mortgage Trust '2007-GG11 A4' 5.736% 10/12/2049	1,327,684	0.09
USD 580,000	CommScope Inc '144A' 4.375% 15/6/2020	586,525	0.04
USD 625,000	Computer Sciences Corp 2.5% 15/9/2015	625,145	0.04
USD 402,381	Continental Airlines 1997-4 Class A Pass Through Trust 6.9% 2/1/2018	420,991	0.03
USD 126,234	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	134,084	0.01
USD 1,707,101	Continental Airlines 2009-1 Pass Through Trust 9% 8/7/2016	1,820,197	0.12
USD 3,031,792	Continental Airlines 2009-2 Class B Pass Through Trust 9.25% 10/5/2017	3,298,969	0.22
USD 608,905	Continental Airlines 2010-1 Class B Pass Through Trust 6% 12/1/2019	628,314	0.04
USD 2,000,000	Continental Airlines 2012-3 Class C Pass Thru Certificates 6.125% 29/4/2018	2,087,500	0.14
USD 42,580,000	Core Industrial Trust '2015-CALW XA' '144A' FRN 10/2/2034	1,997,641	0.13
USD 6,607	Countrywide Asset-Backed Certificates '2007-7 2A2' FRN 25/10/2047	6,617	0.00
USD 1,360,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust '2013-1A B' '144A' 1.83% 15/4/2021	1,359,614	0.09
USD 5,860,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust '2015-1A A' '144A' 2% 15/7/2022	5,881,219	0.39
USD 1,315,000	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2006-C2 AM' FRN 15/3/2039	1,328,715	0.09
USD 5,000,000	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2007-C4 A1AM' FRN 15/9/2039	5,317,598	0.35
USD 200,000	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2007-C4 AJ' FRN 15/9/2039	205,529	0.01
USD 181,194	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2007-C5 AAB' FRN 15/9/2040	185,779	0.01
USD 56,729	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2008-C1 A2' FRN 15/2/2041	57,257	0.00
USD 3,060,338	Crusade Global Trust '2006-2 A1'FRN 15/11/2037	3,047,497	0.20
USD 3,000,000	CSMC Trust '2015-DEAL A' '144A' FRN 15/4/2029	3,000,289	0.20
USD 2,495,000	CVS Health Corp 1.9% 20/7/2018	2,499,745	0.17
USD 81,880	CWABS Asset-Backed Certificates Trust '2005-17 1AF2' FRN 25/5/2036	132,524	0.01
USD 800,000	DBRR Trust '2011-C32 A3A' '144A' FRN 17/6/2049	834,075	0.06

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 8,000,000	DBUBS 2011-LC2 Mortgage Trust '2011-LC2A A3FL' '144A' FRN 12/7/2044	8,104,116	0.54
USD 1,115,000	Del Coronado Trust '2013-HDC A' '144A' FRN 15/3/2026	1,113,790	0.07
USD 750,000	Delta Air Lines 2010-2 Class B Pass Through Trust 6.75% 23/11/2015	760,313	0.05
USD 925,840	Delta Air Lines 2012-1 Class B Pass Through Trust '144A' 6.875% 7/5/2019	1,009,165	0.07
USD 818,000	DIRECTV Holdings LLC / DIRECTV Financing Co Inc 3.125% 15/2/2016	825,599	0.05
USD 710,000	DISH DBS Corp 4.625% 15/7/2017	725,975	0.05
USD 628,000	DR Horton Inc 3.75% 1/3/2019	631,140	0.04
USD 665,000	DR Horton Inc 4.75% 15/5/2017	691,600	0.05
USD 4,000,000	Dryden XVI-Leveraged Loan CDO 2006 '2006-16A B' '144A' FRN 20/10/2020	3,910,669	0.26
USD 5,000,000	Dryden XXV Senior Loan Fund '2012-25A A' '144A' FRN 15/1/2025	4,989,668	0.33
USD 3,000,000	Eaton Electric Holdings LLC 6.1% 1/7/2017	3,246,479	0.22
USD 2,545,000	Enterprise Products Operating LLC FRN 1/8/2066	2,503,644	0.17
USD 2,900,000	ERAC USA Finance LLC '144A' 6.375% 15/10/2017	3,171,539	0.21
USD 1,470,000	Exelon Corp 1.55% 9/6/2017	1,467,339	0.10
USD 1,209,532	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2014-C02 1M1' FRN 25/5/2024	1,198,999	0.08
USD 37,185	Fannie Mae Pool '255316' 5% 1/7/2019	38,882	0.00
USD 132,698	Fannie Mae Pool 'AD0454' 5% 1/11/2021	138,755	0.01
USD 429,716	Fannie Mae Pool 'AE0812' 5% 1/7/2025	450,273	0.03
USD 3,791,237	Fannie Mae Pool 'AL4364' FRN 1/9/2042	3,990,396	0.27
USD 7,055,943	Fannie Mae Pool 'AX0000' FRN 1/9/2044	7,282,555	0.49
USD 74,773	Fannie Mae REMICS '2008-29 CA' 4.5% 25/9/2035	77,603	0.00
USD 5,730,442	Fannie Mae-Aces '2013-M5 X2' FRN 25/1/2022	586,342	0.04
USD 263,550,672	Fannie Mae-Aces '2014-M13 X2' FRN 25/8/2024	3,109,107	0.21
USD 187,460	Federal Express Corp 2012 Pass Through Trust '144A' 2.625% 15/1/2018	189,008	0.01
USD 111,636,849	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/9/2024	6,214,265	0.41
USD 555,000	Fifth Third Bancorp 3.625% 25/1/2016	561,027	0.04
USD 13,550,000	Ford Motor Credit Co LLC 1.724% 6/12/2017	13,437,230	0.90
USD 570,000	Ford Motor Credit Co LLC 3.984% 15/6/2016	581,320	0.04
USD 600,000	Ford Motor Credit Co LLC 4.207% 15/4/2016	610,441	0.04
USD 7,860,000	Forest Laboratories LLC '144A' 4.375% 1/2/2019	8,225,278	0.55
USD 13,573,055	Freddie Mac Non Gold Pool '849692' FRN 1/5/2045	13,982,396	0.93
USD 4,370,875	Freddie Mac REMICS '4390 CA' 3.5% 15/6/2050	4,590,903	0.31
USD 6,203,037	Freddie Mac REMICS '4286 MP' 4% 15/12/2043	6,716,518	0.45
USD 411,772	Freddie Mac REMICS '3817 MA' 4.5% 15/10/2037	442,221	0.03
USD 612,684	Freddie Mac REMICS '3986 M' 4.5% 15/9/2041	670,345	0.04
USD 547,366	Freddie Mac REMICS '3959 MA' 4.5% 15/11/2041	596,939	0.04

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 884,569	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2014-DN4 M1' FRN 25/10/2024	884,681	0.06
USD 2,700,000	GATX Corp 1.25% 4/3/2017	2,683,944	0.18
USD 3,500,000	General Motors Financial Co Inc 2.4% 10/4/2018	3,462,559	0.23
USD 1,847,000	General Motors Financial Co Inc 2.75% 15/5/2016	1,860,594	0.12
USD 2,117,000	General Motors Financial Co Inc 3% 25/9/2017	2,131,622	0.14
USD 375,000	General Motors Financial Co Inc 3.25% 15/5/2018	377,870	0.03
USD 1,550,000	Genworth Holdings Inc 6.515% 22/5/2018	1,584,875	0.11
USD 1,650,000	Genworth Holdings Inc 7.7% 15/6/2020	1,724,250	0.11
USD 3,508,299	GMAC Commercial Mortgage Securities Inc Series 2006-C1 Trust '2006-C1 A1A' FRN 10/11/2045	3,512,553	0.23
USD 5,150,000	Goldman Sachs Group Inc/The 2.6% 23/4/2020	5,132,838	0.34
USD 12,343,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.625% 7/2/2016	12,486,148	0.83
USD 2,295,000	Goldman Sachs Group Inc/The 5.35% 15/1/2016	2,332,125	0.16
USD 13,303,113	Government National Mortgage Association '2012-120 IO' FRN 16/2/2053	889,167	0.06
USD 4,000,000	GRACE Mortgage Trust '2014-GRCE A' '144A' 3.369% 10/6/2028	4,150,218	0.28
USD 1,122,272	Granite Master Issuer Plc '2007-2 2A1' FRN 17/12/2054	1,114,640	0.07
USD 283,884	Granite Master Issuer Plc '2007-2 4A1' FRN 17/12/2054	282,152	0.02
USD 982,187	Granite Master Issuer Plc '2006-1A A5' '144A' FRN 20/12/2054	977,079	0.07
USD 780,867	Granite Master Issuer Plc '2006-1X A5' FRN 20/12/2054	776,806	0.05
USD 785,903	Granite Master Issuer Plc '2006-2 A4' FRN 20/12/2054	781,109	0.05
USD 3,930,207	Granite Master Issuer Plc '2006-3 A3' FRN 20/12/2054	3,906,233	0.26
USD 1,042,459	Granite Master Issuer Plc '2006-3 A4' FRN 20/12/2054	1,036,100	0.07
USD 6,329,171	Granite Master Issuer Plc '2007-1 4A1' FRN 20/12/2054	6,301,955	0.42
USD 1,645,000	GS Mortgage Securities Trust '2014-GSFL D' '144A' FRN 15/7/2031	1,638,555	0.11
USD 5,357,729	GS Mortgage Securities Trust '2007-GG10 A1A' FRN 10/8/2045	5,721,650	0.38
USD 1,940,000	HCA Inc 3.75% 15/3/2019	1,961,825	0.13
USD 2,235,000	HCA Inc 6.5% 15/2/2016	2,279,700	0.15
USD 2,240,000	HCP Inc 6.7% 30/1/2018	2,474,776	0.17
USD 3,330,000	Health Care REIT Inc 2.25% 15/3/2018	3,338,555	0.22
USD 2,785,000	Hilton USA Trust '2013-HLT EFX' '144A' FRN 5/11/2030	2,804,552	0.19
USD 10,000	Hilton USA Trust '2013-HLT DFX' '144A' 4.407% 5/11/2030	10,133	0.00
USD 6,145,000	HSBC USA Inc 1.7% 5/3/2018	6,117,655	0.41
USD 3,370,000	Huntington Bancshares Inc/OH 2.6% 2/8/2018	3,401,486	0.23
USD 1,330,000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 3.5% 15/3/2017	1,333,325	0.09
USD 4,250,000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.875% 15/3/2019	4,311,625	0.29
USD 6,018,108	ING IM CLO 2012-1 Ltd '2012-1RA A1R' '144A' FRN 14/3/2022	6,017,126	0.40

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,070,000	International Lease Finance Corp '144A' 6.75% 1/9/2016	2,157,975	0.14
USD 1,030,000	International Lease Finance Corp '144A' 7.125% 1/9/2018	1,139,386	0.08
USD 2,583,000	Interpublic Group of Cos Inc/The 2.25% 15/11/2017	2,589,310	0.17
USD 2,720,000	Invitation Homes Trust '2014-SFR3 A' '144A' FRN 17/12/2031	2,700,876	0.18
USD 5,513,614	Invitation Homes Trust '2015-SFR2 A' '144A' FRN 17/6/2032	5,493,834	0.37
USD 1,635,000	Iowa Finance Authority 5% 1/12/2019	1,724,974	0.11
USD 700,000	Johnson Controls Inc 5.5% 15/1/2016	712,269	0.05
USD 4,275,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 A' '144A' FRN 15/11/2031	4,274,639	0.29
USD 9,585,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-CSMO A' '144A' FRN 15/1/2032	9,575,429	0.64
USD 3,843,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2007-LDPX AM' FRN 15/1/2049	3,952,585	0.26
USD 168,309	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2007-LD11 ASB' FRN 15/6/2049	173,340	0.01
USD 177,667	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2010-C1 A1' '144A' 3.853% 15/6/2043	177,392	0.01
USD 51,098,143	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C21 XA' FRN 15/8/2047	3,748,458	0.25
USD 1,328,000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.95% 15/2/2018	1,426,275	0.10
USD 1,015,000	Kinder Morgan Inc/DE 2% 1/12/2017	1,005,839	0.07
USD 1,690,000	Kinder Morgan Inc/DE 3.05% 1/12/2019	1,658,441	0.11
USD 1,763,000	Kinder Morgan Inc/DE 7% 15/6/2017	1,895,579	0.13
USD 431,924	Lanark Master Issuer Plc '2012-2A 1A' '144A' FRN 22/12/2054	433,729	0.03
USD 3,168,000	LB Commercial Mortgage Trust '2007-C3 AM' FRN 15/7/2044	3,385,133	0.23
USD 1,893,194	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2006-C4 A4' FRN 15/6/2038	1,932,289	0.13
USD 2,250,000	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2006-C4 AM' FRN 15/6/2038	2,317,579	0.15
USD 4,400,000	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2007-C7 AM' FRN 15/9/2045	4,797,729	0.32
USD 2,225,551	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2007-C1 A4' 5.424% 15/2/2040	2,318,982	0.15
USD 7,045,000	LCM XII LP 1.547% 19/10/2022	7,038,610	0.47
USD 2,715,120	Leek Finance Number Eighteen Plc FRN 21/9/2038	2,828,517	0.19
USD 1,618,000	Lennar Corp 4.75% 15/12/2017	1,678,675	0.11
USD 860,000	Leucadia National Corp 8.125% 15/9/2015	862,150	0.06
USD 4,430,000	LFRF '2015-1' '144A' 3.5% 31/12/2049	4,430,000	0.30
USD 1,007,000	Lubrizol Corp 8.875% 1/2/2019	1,222,869	0.08
USD 4,550,000	M/I Homes Inc 8.625% 15/11/2018	4,714,938	0.31
USD 2,000,000	Manitowoc Co Inc/The 8.5% 1/11/2020	2,101,250	0.14
USD 3,750,000	Maxim Integrated Products Inc 2.5% 15/11/2018	3,780,212	0.25
EUR 1,750,000	MBNA Credit Card Master Note Trust '2005-B3 B3' FRN 19/3/2018	1,957,736	0.13

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,421,857	Merrill Lynch Mortgage Trust '2007-C1 A1A' FRN 12/6/2050	1,480,703	0.10
USD 1,489,000	Morgan Stanley 4.75% 22/3/2017	1,566,517	0.10
USD 200,000	Morgan Stanley 5.45% 9/1/2017	210,493	0.01
USD 13,726,084	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2013-C13 XA' FRN 15/11/2046	931,390	0.06
USD 6,585,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2014-C19 A2' 3.101% 15/12/2047	6,819,854	0.46
USD 950,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-T27 AM' FRN 11/6/2042	1,003,683	0.07
USD 4,555,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-HQ11 A4FL' FRN 12/2/2044	4,517,770	0.30
USD 450,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-HQ12 AM' FRN 12/4/2049	472,697	0.03
USD 4,119,574	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-IQ15 A4' FRN 11/6/2049	4,372,147	0.29
USD 2,980,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-IQ13 AM' 5.406% 15/3/2044	3,122,368	0.21
USD 4,100,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-HQ13 A3' 5.569% 15/12/2044	4,338,645	0.29
USD 804,649	Navient Private Education Loan Trust '2014-CTA A' '144A' FRN 16/9/2024	799,046	0.05
USD 2,000,000	Navient Private Education Loan Trust '2014-AA A2B' '144A' FRN 15/2/2029	2,007,608	0.13
USD 7,180,000	NextGear Floorplan Master Owner Trust '2014-1A A' '144A' 1.92% 15/10/2019	7,200,086	0.48
USD 915,000	NextGear Floorplan Master Owner Trust '2014-1A B' '144A' 2.61% 15/10/2019	910,320	0.06
USD 214,675	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	223,531	0.01
USD 2,783,000	Omnicom Group Inc 5.9% 15/4/2016	2,859,832	0.19
USD 5,285,000	OneMain Financial Issuance Trust '2014-1A A' '144A' 2.43% 18/6/2024	5,351,274	0.36
USD 8,445,000	OneMain Financial Issuance Trust '2014-2A A' '144A' 2.47% 18/9/2024	8,482,665	0.57
USD 2,160,000	OneMain Financial Issuance Trust '2014-2A B' '144A' 3.02% 18/9/2024	2,167,582	0.14
USD 5,005,000	OneMain Financial Issuance Trust 3.19% 18/3/2026	5,064,044	0.34
USD 5,000,000	OneMain Financial Issuance Trust '2014-1A B' '144A' 3.24% 18/6/2024	5,046,188	0.34
USD 3,500,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-1A B' '144A' 3.85% 18/3/2026	3,571,365	0.24
USD 3,000,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 2.5% 15/3/2016	3,017,094	0.20
USD 5,143,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 2.875% 17/7/2018	5,213,631	0.35
USD 555,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 3.75% 11/5/2017	572,464	0.04
USD 1,750,000	Prestige Auto Receivables Trust 1.74% 15/5/2019	1,758,127	0.12
USD 1,915,000	Prestige Auto Receivables Trust '2014-1A C' '144A' 2.39% 15/5/2020	1,927,031	0.13
USD 6,095,000	Pricoa Global Funding I '144A' 2.2% 16/5/2019	6,119,279	0.41
USD 1,000,000	Prologis LP 4.5% 15/8/2017	1,053,391	0.07

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,919,528	PUMA Global Trust No 5 '144A' FRN 21/2/2038	2,915,679	0.19
USD 5,986,000	QVC Inc 3.125% 1/4/2019	5,931,276	0.40
USD 12,000,000	Regatta Funding Ltd '2007-1A A3L' 144A' FRN 15/6/2020	11,787,710	0.79
USD 1,440,000	Regions Financial Corp 2% 15/5/2018	1,434,098	0.10
USD 3,634,000	Reynolds American Inc '144A' 2.3% 21/8/2017	3,663,034	0.24
USD 1,935,000	Reynolds American Inc 2.3% 12/6/2018	1,949,338	0.13
USD 305,000	Reynolds American Inc 3.25% 12/6/2020	309,770	0.02
USD 1,344,000	Reynolds American Inc '144A' 3.5% 4/8/2016	1,368,483	0.09
USD 1,110,000	Reynolds American Inc 6.75% 15/6/2017	1,199,657	0.08
USD 1,785,000	Sabine Pass LNG LP 7.5% 30/11/2016	1,836,319	0.12
USD 3,500,000	Santander Bank NA 8.75% 30/5/2018	4,029,883	0.27
USD 922,184	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-S5 R' '144A' 1.43% 18/6/2019	917,573	0.06
USD 1,065,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2013-1 C' 1.76% 15/1/2019	1,066,866	0.07
USD 3,905,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2012-AA C' '144A' 1.78% 15/11/2018	3,912,437	0.26
USD 2,505,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-4 B' 1.82% 15/5/2019	2,519,811	0.17
USD 247,816	Santander Drive Auto Receivables Trust '2012-6 C' 1.94% 15/3/2018	248,814	0.02
USD 2,980,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-3 C' 2.13% 17/8/2020	2,996,906	0.20
USD 2,400,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2013-5 C' 2.25% 17/6/2019	2,420,136	0.16
USD 3,475,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-5 C' 2.46% 15/6/2020	3,498,208	0.23
USD 240,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2012-5 C' 2.7% 15/8/2018	241,806	0.02
USD 2,757,493	Santander Drive Auto Receivables Trust '2012-4 C' 2.94% 15/12/2017	2,780,324	0.19
USD 2,950,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2013-A C' '144A' 3.12% 15/10/2019	3,001,159	0.20
USD 5,420,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2012-2A E' '144A' 5.95% 15/4/2019	5,602,177	0.37
USD 490,000	Santander Holdings USA Inc/PA 3% 24/9/2015	490,645	0.03
USD 2,916,409	Silver Bay Realty Trust '2014-1 A' '144A' FRN 17/9/2031	2,875,277	0.19
USD 297,037	SLM Private Credit Student Loan Trust '2004-B A2' FRN 15/6/2021	295,642	0.02
USD 238,992	SLM Private Credit Student Loan Trust '2003-B A2' FRN 15/3/2022	235,699	0.02
USD 1,786,023	SLM Private Education Loan Trust '2013-C A1' '144A' FRN 15/2/2022	1,786,094	0.12
USD 542,769	SLM Private Education Loan Trust '2012-C A1' '144A' FRN 15/8/2023	543,236	0.04
USD 1,943,903	SLM Private Education Loan Trust '2011-C A1' '144A' FRN 15/12/2023	1,946,351	0.13
USD 2,255,000	SLM Private Education Loan Trust '2014-A A2B' '144A' FRN 15/1/2026	2,255,165	0.15
USD 1,600,000	SLM Private Education Loan Trust '2011-B A3' '144A' FRN 16/6/2042	1,686,816	0.11

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,400,000	SLM Private Education Loan Trust '2011-A A3' '144A' FRN 15/1/2043	1,482,321	0.10
USD 1,620,000	SLM Private Education Loan Trust '2014-A A2A' '144A' 2.59% 15/1/2026	1,646,387	0.11
USD 3,405,000	SLM Private Education Loan Trust '2011-B A2' '144A' 3.74% 15/2/2029	3,564,771	0.24
USD 1,910,000	SLM Private Education Loan Trust '2011-C A2B' '144A' 4.54% 17/10/2044	2,042,444	0.14
USD 2,644,542	SLM Student Loan Trust '2013-4 A' FRN 25/6/2027	2,600,644	0.17
USD 4,238,850	SoFi Professional Loan Program LLC '2015-A A1' '144A' FRN 25/3/2033	4,235,436	0.28
USD 3,208,245	SoFi Professional Loan Program LLC '2014-B A2' '144A' 2.55% 27/8/2029	3,227,252	0.22
USD 1,000,000	Sound Point CLO I Ltd '2012-1A C' '144A' FRN 20/10/2023	1,002,563	0.07
USD 217,102	Soundview Home Loan Trust '2003-2 A2' FRN 25/11/2033	215,279	0.01
USD 5,025,254	SpringCastle America Funding LLC '2014-AA A' '144A' 2.7% 25/5/2023	5,046,866	0.34
USD 5,530,000	Springleaf Funding Trust 3.16% 15/11/2024	5,584,556	0.37
USD 8,500,000	Sprint Communications Inc '144A'9% 15/11/2018	9,490,250	0.63
USD 600,000	Standard Pacific Corp 10.75% 15/9/2016	657,000	0.04
USD 170,000	State of California 3.95% 1/11/2015	171,018	0.01
USD 334,654	STRIPs 2012-1 Ltd '2012-1A A' '144A' 1.5% 25/12/2044	327,961	0.02
USD 3,593,460	SWAY Residential Trust '2014-1 A' '144A' FRN 17/1/2032	3,565,223	0.24
USD 8,475,000	Synchrony Credit Card Master Note Trust '2014-1 A' 1.61% 15/11/2020	8,498,222	0.57
USD 1,610,000	Synchrony Financial 1.875% 15/8/2017	1,604,307	0.11
USD 510,000	Toll Brothers Finance Corp 8.91% 15/10/2017	577,575	0.04
USD 182,989	UAL 2009-1 Pass Through Trust 10.4% 1/11/2016	196,210	0.01
USD 276,059	UAL 2009-2A Pass Through Trust 9.75% 15/1/2017	296,233	0.02
USD 244,444	UAL 2009-2B Pass Through Trust '144A' 12% 15/1/2016	254,221	0.02
USD 40,000,000	United States Treasury Bill 23/6/2016 (Zero Coupon)	39,902,920	2.66
USD 45,000,000	United States Treasury Note/Bond 0.375% 31/10/2016*	44,950,782	3.00
USD 177,385,000	United States Treasury Note/Bond 0.5% 31/8/2016*	177,537,441	11.85
USD 7,355,000	United States Treasury Note/Bond 0.625% 15/12/2016*	7,365,199	0.49
USD 35,000,000	United States Treasury Note/Bond 0.875% 15/9/2016	35,164,063	2.35
USD 33,825,000	United States Treasury Note/Bond 0.875% 15/7/2018	33,703,442	2.25
USD 11,835,000	United States Treasury Note/Bond 1% 15/8/2018	11,831,764	0.79
USD 7,000,000	United Technologies Corp (Step-up coupon) 1.778% 4/5/2018	6,974,727	0.47
USD 1,786,736	US Airways 2012-1 Class B Pass Through Trust 8% 1/10/2019	2,007,845	0.13
USD 229,469	US Airways 2012-1 Class C Pass Through Trust 9.125% 1/10/2015	230,857	0.02
USD 3,330,000	Ventas Realty LP 1.55% 26/9/2016	3,336,141	0.22

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

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,000,000	Ventas Realty LP / Ventas Capital Corp 2% 15/2/2018	4,014,664	0.27
USD 2,220,000	Verizon Communications Inc 6.1% 15/4/2018	2,447,609	0.16
USD 718,630	VFC LLC '2014-2 A' '144A' 2.75% 20/7/2030	718,617	0.05
USD 6,710,000	Voya Financial Inc 2.9% 15/2/2018	6,844,257	0.46
USD 1,360,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2005-C22 AM' FRN 15/12/2044	1,362,759	0.09
USD 500,679	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2006-C23 A4' FRN 15/1/2045	501,410	0.03
USD 2,427,276	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C34 A1A' FRN 15/5/2046	2,556,675	0.17
USD 8,220,061	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2006-C28 A4FL' '144A' FRN 15/10/2048	8,150,269	0.54
USD 2,390,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2006-C28 AM' FRN 15/10/2048	2,485,845	0.17
USD 2,728,365	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C32 A1A' FRN 15/6/2049	2,869,956	0.19
USD 550,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C33 AJ' FRN 15/2/2051	567,293	0.04
USD 1,135,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C33 AM' FRN 15/2/2051	1,213,133	0.08
USD 3,190,800	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C34 A3' 5.678% 15/5/2046	3,377,425	0.23
USD 4,300,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C32 AMFX' '144A' 5.703% 15/6/2049	4,534,464	0.30
USD 1,895,000	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc '144A' 1.75% 15/9/2017	1,894,124	0.13
USD 126,690	Wells Fargo Resecuritization Trust '2012-10 A' '144A' 1.75% 20/8/2021	126,690	0.01
USD 2,400,000	Westbrook CLO Ltd '2006-1A A2' '144A' FRN 20/12/2020	2,348,748	0.16
USD 2,000,000	Westbrook CLO Ltd '2006-1X B' FRN 20/12/2020	1,955,753	0.13
USD 1,665,000	Western Union Co/The 2.375% 10/12/2015	1,670,523	0.11
USD 2,705,458	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2012-C8 XA' '144A' FRN 15/8/2045	246,908	0.02
USD 32,375,181	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2013-C15 XA' FRN 15/8/2046	1,029,320	0.07
USD 3,000,000	WG Horizons CLO I '2006-1A A2' '144A' FRN 24/5/2019	2,920,248	0.19
USD 660,000	World Financial Network Credit Card Master Trust '2012-D B' 3.34% 17/4/2023	682,937	0.05
USD 1,080,000	Zimmer Biomet Holdings Inc 2% 1/4/2018	1,073,322	0.07
USD 1,110,000	Zoetis Inc 1.15% 1/2/2016	1,109,703	0.07
		1,244,254,789	83.08
債券合計		1,417,975,679	94.68
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		1,417,975,679	94.68
投資有価証券合計		1,417,975,679	94.68
その他の純資産		79,689,564	5.32
純資産合計(米ドル)		1,497,665,243	100.00

* 貸付有価証券。詳細については注記13を参照のこと。

事後通告証券契約 2015年8月31日現在

保有高	銘柄	評価額 (米ドル)	%
T B A			
	米国		
USD 5,250,000	Fannie Mae Pool '2 9/15' 2% TBA	5,186,218	0.35
USD 8,140,000	Fannie Mae Pool '2.5 9/15' 2.5% TBA	8,267,823	0.55
USD 12,605,000	Fannie Mae Pool '3 9/15' 3% TBA	13,086,550	0.87
USD 9,400,000	Fannie Mae Pool '3 10/15' 3% TBA	9,740,383	0.65
USD 29,395,000	Fannie Mae Pool '3.5 9/15' 3.5% TBA	30,981,869	2.07
USD 5,855,000	Fannie Mae Pool '4 9/15' 4% TBA	6,133,662	0.41
USD 5,000,000	Fannie Mae Pool '4.5 9/15' 4.5% TBA	5,200,059	0.35
T B A 合計		78,596,564	5.25

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約 2015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)
BRL	427,122	USD	122,000	Goldman Sachs	2/9/2015	(5,656)
BRL	255,938	USD	73,000	UBS	2/9/2015	(3,285)
BRL	168,073	USD	46,000	BNP Paribas	2/9/2015	(219)
BRL	409,364	USD	116,000	BNY Mellon	2/9/2015	(4,494)
BRL	216,215	USD	61,000	Credit Suisse	2/9/2015	(2,105)
BRL	730,230	USD	211,000	RBS Plc	2/9/2015	(12,093)
BRL	327,290	USD	92,000	Morgan Stanley	2/9/2015	(2,850)
BRL	327,244	USD	92,000	Citibank	2/9/2015	(2,862)
USD	60,000	BRL	212,910	UBS	2/9/2015	2,006
USD	221,000	BRL	784,273	RBS Plc	2/9/2015	7,372
USD	70,000	BRL	249,270	BNY Mellon	2/9/2015	2,101
USD	74,000	BRL	254,116	Deutsche Bank	2/9/2015	4,781
USD	296,000	BRL	1,015,469	BNP Paribas	2/9/2015	19,397
USD	92,000	BRL	323,196	JP Morgan	2/9/2015	3,965
USD	187,400	ZAR	2,379,217	Standard Chartered Bank London	3/9/2015	9,059
ZAR	2,403,688	USD	187,400	BNP Paribas	3/9/2015	(7,224)
COP	97,807,248	USD	30,800	BNY Mellon	4/9/2015	572
COP	391,006,000	USD	123,200	BNP Paribas	4/9/2015	2,218
EUR	31,500	USD	34,889	UBS	4/9/2015	491
EUR	31,500	USD	34,476	BNP Paribas	4/9/2015	905
USD	154,000	COP	443,741,760	Credit Suisse	4/9/2015	11,667
USD	69,101	EUR	63,000	BNP Paribas	4/9/2015	(1,660)
MYR	646,884	USD	153,000	UBS	8/9/2015	1,149
RUB	5,358,660	USD	93,000	Societe Generale	8/9/2015	(13,537)
USD	153,000	MYR	594,099	JP Morgan	8/9/2015	11,429
USD	93,000	RUB	5,397,255	Societe Generale	8/9/2015	12,964
USD	33,933	RUB	1,966,606	Deutsche Bank	9/9/2015	4,780
CLP	253,132,074	USD	367,200	Credit Suisse	11/9/2015	(3,929)
MYR	442,475	USD	110,000	JP Morgan	11/9/2015	(4,516)
USD	275,400	CLP	187,928,370	Credit Suisse	11/9/2015	5,703
USD	91,800	CLP	62,279,874	Deutsche Bank	11/9/2015	2,422
USD	232,333	JPY	27,725,847	Goldman Sachs	11/9/2015	3,412
USD	110,000	MYR	437,250	UBS	11/9/2015	5,762
CAD	121,677	USD	92,000	Goldman Sachs	14/9/2015	(638)
KRW	143,996,600	USD	122,000	JP Morgan	14/9/2015	(394)
KRW	178,257,250	USD	152,500	BNP Paribas	14/9/2015	(1,961)
MXN	1,984,734	USD	116,800	Goldman Sachs	14/9/2015	622
MXN	2,461,443	USD	146,000	JP Morgan	14/9/2015	(374)
MXN	5,106,134	USD	303,000	UBS	14/9/2015	(907)
MXN	2,008,434	USD	119,200	Morgan Stanley	14/9/2015	(375)
MYR	622,710	USD	153,000	Goldman Sachs	14/9/2015	(4,487)
MYR	244,488	USD	61,000	BNP Paribas	14/9/2015	(2,691)
USD	92,000	CAD	121,708	Goldman Sachs	14/9/2015	615
USD	305,000	KRW	357,704,000	Goldman Sachs	14/9/2015	2,918
USD	87,000	MXN	1,495,960	Deutsche Bank	14/9/2015	(1,505)

未決済先渡為替予約 2015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	110,000	MYR	451,330	Standard Chartered Bank London	14/9/2015	2,360
KRW	71,507,250	USD	61,000	BNP Paribas	17/9/2015	(630)
USD	91,500	KRW	109,287,600	Bank of America	17/9/2015	(767)
COP	237,640,234	USD	73,920	Credit Suisse	18/9/2015	2,282
COP	77,960,960	USD	24,640	Morgan Stanley	18/9/2015	359
MXN	1,821,025	USD	110,518	Barclays	18/9/2015	(2,812)
MXN	2,634,512	USD	160,177	JP Morgan	18/9/2015	(4,358)
USD	98,560	COP	294,657,933	BNP Paribas	18/9/2015	4,075
USD	256,247	MXN	4,411,995	Morgan Stanley	18/9/2015	(4,702)
USD	437,686	MXN	6,765,537	Bank of America	18/9/2015	37,536
CAD	165,000	MXN	2,119,541	Deutsche Bank	21/9/2015	(1,443)
CAD	110,000	MXN	1,406,755	Goldman Sachs	21/9/2015	(591)
MXN	3,458,868	CAD	275,000	UBS	21/9/2015	(1,953)
USD	1,012,104	EUR	917,666	RBS Plc	21/9/2015	(18,861)
PLN	1,031,214	EUR	246,800	Citibank	22/9/2015	(3,051)
CAD	4,969,193	USD	3,750,000	HSBC Bank Plc	23/9/2015	(18,897)
CAD	4,887,907	USD	3,740,000	JP Morgan	23/9/2015	(69,929)
EUR	3,410,000	GBP	2,411,238	JP Morgan	23/9/2015	118,489
GBP	4,777,989	EUR	6,700,000	JP Morgan	23/9/2015	(170,657)
GBP	2,390,000	USD	3,696,054	BNY Mellon	23/9/2015	(16,119)
USD	3,750,000	CAD	4,960,795	HSBC Bank Plc	23/9/2015	25,202
USD	3,740,000	CAD	4,926,160	JP Morgan	23/9/2015	41,208
CLP	122,300,628	USD	174,351	Credit Suisse	24/9/2015	950
COP	356,900,520	USD	111,000	Credit Suisse	24/9/2015	3,429
JPY	11,370,962	USD	91,750	RBS Plc	24/9/2015	2,158
USD	174,351	CLP	123,848,283	Credit Suisse	24/9/2015	(3,169)
USD	111,000	COP	339,500,160	Credit Suisse	24/9/2015	2,150
USD	91,750	JPY	11,360,018	Morgan Stanley	24/9/2015	(2,067)
USD	116,267	KRW	140,217,737	HSBC Bank Plc	24/9/2015	(2,033)
COP	463,367,500	USD	146,000	BNY Mellon	28/9/2015	2,552
COP	267,766,000	USD	92,000	BNP Paribas	28/9/2015	(6,156)
USD	87,600	COP	283,736,400	Morgan Stanley	28/9/2015	(3,364)
USD	92,000	COP	270,799,240	Credit Suisse	28/9/2015	5,184
USD	215,000	MYR	902,355	BNY Mellon	28/9/2015	(626)
CLP	121,660,988	USD	175,500	BNY Mellon	30/9/2015	(1,213)
CLP	81,373,500	USD	117,000	Credit Suisse	30/9/2015	(427)
COP	441,801,360	USD	154,000	Credit Suisse	30/9/2015	(12,368)
USD	154,000	COP	442,284,920	Credit Suisse	30/9/2015	12,213
USD	188,600	ZAR	2,489,075	Barclays	30/9/2015	2,899
ZAR	1,191,871	USD	89,000	Citibank	30/9/2015	(79)
COP	818,477,440	USD	264,000	BNY Mellon	1/10/2015	(1,620)
MXN	2,453,253	USD	146,000	UBS	2/10/2015	(1,052)
MXN	2,468,612	USD	146,000	JP Morgan	2/10/2015	(144)
MXN	18,035,497	USD	1,054,600	Deutsche Bank	2/10/2015	11,014
USD	879,000	BRL	3,220,568	Goldman Sachs	2/10/2015	10,886
USD	235,000	BRL	848,350	BNY Mellon	2/10/2015	6,325

未決済先渡為替予約 2015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	175,600	BRL	645,787	Morgan Stanley	2/10/2015	1,526
USD	46,000	BRL	169,808	BNP Paribas	2/10/2015	228
EUR	441,000	USD	484,659	Goldman Sachs	20/10/2015	11,017
EUR	336,000	USD	370,564	Standard Chartered Bank London	20/10/2015	7,094
EUR	151,000	USD	165,524	Citibank	20/10/2015	4,197
EUR	1,000,000	USD	1,101,321	RBS Plc	20/10/2015	22,661
USD	4,858,392	AUD	6,499,000	UBS	20/10/2015	256,924
USD	27,004,608	EUR	24,467,788	UBS	20/10/2015	(496,749)
USD	13,271,187	GBP	8,530,000	HSBC Bank Plc	20/10/2015	139,269
USD	2,173,698	EUR	1,903,000	Deutsche Bank	2/11/2015	34,293
未実現純評価損						(38,809)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	9,762,406	USD	10,777,878	BNY Mellon	15/9/2015	188,843
未実現純評価益						188,843
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	1,243,107	USD	885,958	BNY Mellon	15/9/2015	(6,448)
未実現純評価損						(6,448)
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 - 117,144,431米ドル)						143,586

注：当該取引による未実現純評価益は、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

金利スワップ 2015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)
BRL 2,130,000	ファンドは13.61%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2017	(4,356)	(4,356)
BRL 2,110,870	ファンドは14.045%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2017	(1,090)	(1,090)
BRL 4,914,286	ファンドは13.91%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2017	(4,734)	(4,734)
BRL 1,784,649	ファンドは14.15%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2017	(302)	(302)
CNY 16,698,500	ファンドは2.25%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Bank of America	10/7/2017	(4,118)	(4,118)
MXN 13,103,830	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.3260004%の固定金利を支払う	Bank of America	25/8/2017	(383)	(383)
MXN 13,103,830	ファンドは4.435%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	28/8/2017	(57)	(57)
ZAR 25,015,000	ファンドは7.45%の固定金利を受け取り、3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を支払う	Bank of America	29/8/2017	(907)	(907)
MXN 6,155,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.3260004%の固定金利を支払う	Bank of America	16/7/2025	277	277
MXN 3,077,500	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.3260004%の固定金利を支払う	Bank of America	18/7/2025	274	274
MXN 2,978,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.3100008%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	245	245
MXN 2,978,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.3100008%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	245	245
USD 1,050,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.772%の固定金利を支払う	Barclays	14/7/2020	(10,382)	(10,382)
KRW 127,865,000	ファンドは1.9125%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Barclays	7/8/2020	319	319
USD 161,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.339%の固定金利を支払う	Barclays	30/7/2025	(2,175)	(2,175)
USD 320,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.339%の固定金利を支払う	Barclays	30/7/2025	(4,323)	(4,323)
USD 160,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.34%の固定金利を支払う	Barclays	30/7/2025	(2,176)	(2,176)
USD 222,800	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.256%の固定金利を支払う	Barclays	20/8/2025	(1,201)	(1,201)
USD 190,000	ファンドは2.128%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Barclays	25/8/2025	(1,229)	(1,229)
USD 160,000	ファンドは2.14%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Barclays	25/8/2025	(858)	(858)
USD 190,000	ファンドは2.134%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Barclays	25/8/2025	(1,124)	(1,124)
USD 289,921	ファンドは2.13%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Barclays	25/8/2025	(1,822)	(1,822)
BRL 2,179,402	ファンドは13.565%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2017	(4,811)	(4,811)
BRL 2,179,802	ファンドは13.395%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2017	(6,181)	(6,181)
MXN 17,581,875	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.33%の固定金利を支払う	Citibank	24/8/2017	717	717
MXN 11,721,250	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.3260004%の固定金利を支払う	Citibank	25/8/2017	128	128
KRW 338,164,000	ファンドは1.912%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Citibank	7/8/2020	836	836
KRW 180,733,861	ファンドは2.29%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Citibank	15/7/2025	2,643	2,643

金利スワップ(続き) 2015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)
MXN 3,077,500	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.33%の固定金利を支払う	Citibank	17/7/2025	61	61
MXN 9,181,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.309984%の固定金利を支払う	Citibank	6/8/2025	161	161
MXN 20,677,340	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.3260004%の固定金利を支払う	Credit Suisse	25/8/2017	(130)	(130)
USD 334,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.359%の固定金利を支払う	Credit Suisse	31/7/2025	(5,216)	(5,216)
USD 166,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.34625%の固定金利を支払う	Credit Suisse	3/8/2025	(2,358)	(2,358)
USD 222,800	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.25375%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/8/2025	(1,229)	(1,229)
EUR 31,100,000	ファンドは0.49361%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Deutsche Bank	4/7/2019	303,634	303,634
EUR 31,100,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.44988%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	4/7/2019	(244,675)	(244,675)
USD 166,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.37%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	31/7/2025	(2,758)	(2,758)
MXN 11,053,204	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.3072%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/8/2025	1,055	1,055
USD 111,400	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.255%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/8/2025	(627)	(627)
BRL 1,995,221	ファンドは13.93%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2017	(1,853)	(1,853)
ZAR 25,015,000	ファンドは7.52%の固定金利を受け取り、3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を支払う	JP Morgan	25/8/2017	350	350
ZAR 16,680,000	ファンドは7.495%の固定金利を受け取り、3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を支払う	JP Morgan	28/8/2017	(105)	(105)
BRL 892,324	ファンドは14.15%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	2/1/2017	(151)	(151)
MXN 17,581,875	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.33%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	24/8/2017	818	818
ZAR 13,260,000	ファンドは7.59%の固定金利を受け取り、3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を支払う	Morgan Stanley	26/8/2017	775	775
MXN 6,176,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.3260004%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	16/7/2025	712	712
MXN 6,176,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.33%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/7/2025	(23)	(23)
KRW 409,045,000	ファンドは1.8425%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	24/7/2020	(82)	(82)
KRW 626,875,000	ファンドは1.8675%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	24/7/2020	495	495
KRW 155,950,000	ファンドは2.2625%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	9/7/2025	1,960	1,960
KRW 387,440,000	ファンドは2.25375%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	9/7/2025	4,613	4,613
KRW 159,007,569	ファンドは2.2675%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	10/7/2025	2,059	2,059
KRW 79,503,785	ファンドは2.285%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	13/7/2025	1,133	1,133
KRW 79,503,785	ファンドは2.275%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	UBS	14/7/2025	1,072	1,072
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 98,367,270米ドル)				13,146	13,146

注: 当該取引による時価合計13,146米ドルは、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

クレジット・デフォルト・スワップ 2015年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (575,434)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2020	(3,797)	(11,083)
USD 575,434	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2020	4,235	12,920
USD (146,000)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/9/2020	(1,070)	(3,278)
USD 305,000	ファンドはCDX.NA.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2020	1,712	(2,572)
USD 304,000	ファンドはCDX.NA.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2020	1,604	(2,564)
USD 3,263,000	ファンドはCDX.NA.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2020	22,599	(27,522)
USD 456,309	ファンドはCDX.NA.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2020	2,571	(3,849)
USD 14,850,000	ファンドはCDX.NA.HY.24.V2に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2020	(225,187)	(669,498)
USD 297,651	ファンドはSouth Africa (Republic of) 5.5% 9/3/2020に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/9/2020	4,750	20,174
USD (330,000)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	145	(7,409)
USD (146,000)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	(247)	(3,278)
USD (146,000)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	(145)	(3,278)
USD (156,000)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	(569)	(3,503)
USD (156,000)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	(569)	(3,503)
USD (156,000)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	(569)	(3,503)
USD (246,000)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	(897)	(5,523)
USD (144,000)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	(1,055)	(3,233)
USD (583,700)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	20/9/2020	(5,476)	(13,106)
USD 500,000	ファンドはGenworth Holdings Inc 6.515% 22/5/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2020	10,794	66,592
USD (145,316)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/9/2020	401	(3,263)

クレジット・デフォルト・スワップ(続き) 2015年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ド ル)
USD (145,317)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/9/2020	266	(3,263)
USD 533,000	ファンドはGenworth Holdings Inc 6.515% 22/5/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2018	(1,700)	29,389
USD 512,000	ファンドはGenworth Holdings Inc 6.515% 22/5/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2018	3,882	28,231
USD 512,000	ファンドはGenworth Holdings Inc 6.515% 22/5/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2018	3,633	28,231
USD 311,000	ファンドはCDX.NA.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2020	345	(2,623)
USD 714,000	ファンドはCDX.NA.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2020	3,033	(6,022)
USD 311,000	ファンドはCDX.NA.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2020	(231)	(2,623)
USD (89,600)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	Deutsche Bank	20/9/2020	(777)	(2,012)
USD (89,500)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019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	Deutsche Bank	20/9/2020	(776)	(2,009)
USD 575,434	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	4,851	11,083
USD 1,160,000	ファンドはGenworth Holdings Inc 6.515% 22/5/2018に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	22,350	154,492
USD 125,000	ファンドはSouth Africa (Republic of) 5.5% 9/3/2020に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/9/2020	1,579	8,472
USD (1,163,000)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	(10,610)	(26,112)
USD (575,434)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	(4,884)	(12,920)
USD (87,100)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	(713)	(1,956)
USD (87,100)	ファンドはMexico (United Mexican States) 5.95% 19/3/2019に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	(713)	(1,956)
USD 160,000	ファンドはSouth Africa (Republic of) 5.5% 9/3/2020に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/9/2020	2,162	10,845
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 31,147,973米ドル)				(169,073)	(461,032)

注：当該取引による時価合計(461,032)米ドルは、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

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 2015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 (米ドル)	時価 (米ド ル)
KRW 846,158,536	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11/11/2017より1.92%の固定金利を毎年受け取り、11/11/2017より3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を毎年支払う	Deutsche Bank	9/11/2015	1,649	3,904
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 715,416米ドル)				1,649	3,904

注：買建スワップションは、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

売建スワップション 2015年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 損 (米ドル)	時価 (米ド ル)
KRW (846,158,536)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/11/2017より3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を毎年受け取り、11/11/2017より1.63%の固定金利を毎年支払う	Deutsche Bank	9/11/2015	(429)	(895)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 715,416米ドル)				(429)	(895)

注：売建スワップションは、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

売建コール・オプション 2015年8月31日現在

コールの対象 となる契約数	発行者/摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価損 (米ドル)	時価 (米ドル)
(11)	2 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	98.25米ドル	11/9/2015	(1,324)	(4,606)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 7,355,709米ドル)					(1,324)	(4,606)

注：売建コール・オプションは、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

買建プット・オプション 2015年8月31日現在

プットの対象 となる契約数	発行者/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)
367,000	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	123.5米ドル	9/9/2015	5,730	7,675
586,000	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	1.11ユーロ	11/9/2015	(875)	3,019
11	2 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	98米ドル	11/9/2015	(5,105)	137
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 1,139,867米ドル)					(250)	10,831

注：買建プット・オプションは、純資産計算書に含まれている(注記2c参照)。

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 2015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)
(6)	EUR	Euro Bund	2015年9月	1,037,053	(22,695)
(9)	EUR	Euro BOBL	2015年9月	1,316,314	(8,491)
1,512	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2015年12月	330,561,000	(466,131)
(1)	USD	US Long Bond (CBT)	2015年12月	156,156	3,264
(3)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2015年12月	480,375	(5,877)
(365)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2015年12月	46,554,609	(40,547)
(430)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2015年12月	51,489,141	60,422
合計				431,594,648	(480,055)

注：当該取引による未実現純評価損480,055米ドルは、純資産計算書に含まれている（注記2 c 参照）。

金融デリバティブ商品の要約	時価 (米ドル)
スワップ	
クレジット・デフォルト・スワップ	(461,032)
金利スワップ	13,146
スワップの時価	(447,886)
買建オプション/スワップション	
買建プット・オプション	10,831
買建スワップション	3,904
買建オプション/スワップションの時価	14,735
売建オプション/スワップション	
売建コール・オプション	(4,606)
売建スワップション	(895)
売建オプション/スワップションの時価	(5,501)
事後通告証券契約の時価	78,596,564
	未実現評価益 / (損) (米ドル)
未決済上場先物取引	(480,055)
未決済先渡為替予約	143,586

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

財務書類に対する注記

1. 組織

ブラックロック・グローバル・ファンズ（以下「当社」という。）は、オープンエンド型の変動資本投資法人（変動資本を有する会社型投資信託）としてルクセンブルク大公国の法律に基づき設立された公開有限責任会社（société anonyme）である。当社は、金融監督委員会（Commission de Surveillance du Secteur Financier、以下「CSSF」という。）により、2010年12月17日付の法律（随時、改正される）パートの規定に準拠した譲渡可能な有価証券への集合投資事業（以下「UCITS」という。）として認可され、当該法律によって規制されている。

当社は、分離された負債を有する個別の構成要素からなるアンブレラ構造である。各構成要素は他の構成要素から分離された負債を有し、当社は各構成要素の負債について第三者に対し全体として責任を負わない。各構成要素は、構成要素に該当する投資目的に従い管理され投資される個別の投資有価証券の組合せによって組成されている。

2015年8月31日現在、当社は69のサブファンド（以下それぞれを「ファンド」という。）における投資証券を発行しており、以下総称して「当ファンド」という。各ファンドは、それぞれ個別の資産プールである。各ファンドは、アペンディクスに詳述のとおり投資証券クラスに分類されており、それぞれ個別の投資証券により表象されている。

各投資証券クラスは当社に対して同等の権利を有しているが、特徴および手数料体系はそれぞれ異なる。これについては当社の英文目論見書において詳述されている。

2015年8月31日に終了した会計年度に生じた重要な事象

2015年1月27日付で、コンチネンタル・ヨーロピアン・フレキシブル・ファンドは、投資証券販売と他のファンドからの転換を再開した。当該ファンドは、2013年11月7日から投資証券販売と他のファンドからの転換を中止していた（ただし、限定的な状況において取締役が決定する場合を除く）。

2015年7月20日付で、当社の改訂英文目論見書が発行された。英文目論見書の改訂を知らせる通知書が投資主に送付された。

営業日の定義が改正され、営業日への言及はルクセンブルクの銀行が通常、営業日（クリスマスイブを除く）として取り扱う日および取締役が決定するその他の日を指すこととなった。当該定義は、ルクセンブルク籍ファンドの取引日をルクセンブルクの銀行の休業日に合わせるために改正された。

2015年7月23日付で、ユーロ建のヨーロピアン・ハイ・イールド・ボンド・ファンドが設定された。

投資証券クラスの設定と再開

当期に設定または再開された投資証券クラスはアペンディクスに開示されている。

2. 重要な会計方針の要約

この財務書類は、ルクセンブルクの投資法人のためにルクセンブルグの関係官庁が規定した財務書類の作成に関連する法律および規制上の要件に準拠して作成されており、以下の重要な会計方針を含む。

(a) 投資有価証券およびその他の資産の評価

当社の投資有価証券およびその他の資産は以下のとおり評価されている。

- 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は、評価日における最新の入手可能な市場価格に基づき評価される。当該投資有価証券またはその他の資産が複数の証券取引所または規制市場で上場または取引されている場合、取締役会はその裁量により、評価目的でかかる証券取引所または規制市場のいずれか1つを選択することができる。一部のファンドの純資産価額の計算時に該当する市場が終了している場合、または政府が外国投資に財務または取引費用を課す場合に有価証券価額の相違が生じることがある。そのため、取締役は、これらの投資有価証券の公正価値を見積るために公正価値の評価技法を利用した。かかる有価証券およびデリバティブは、適格者（取締役）が決定する実現性の高い価額で評価される。公正価値評価プロセスに固有の不確実性により、これらの見積価額は、当該有価証券にとっての整備された市場が存在する場合に使用されたであろう価額や最終的に回収されうる価額と著しく異なる可能性がある。

- ・ 上場されていない有価証券、またはいかなる証券取引所もしくはその他の規制市場において売買もしくは取引されていない有価証券(クローズドエンド型ファンドの有価証券を含む)および評価額が入手できないその他の市場における上場または非上場有価証券、または取締役が、市場価格が公正市場価格を反映していないと判断した有価証券に関しては、取締役が、処分価格または取得価格の予測額に基づき、慎重かつ誠実に価値を決定する。
- ・ 有価証券貸付：有価証券は貸付代理店の指示により第三者ブローカーに受渡しされるが、当ファンドのポートフォリオの一部として引き続き評価される。
- ・ 短期金融商品は、額面金額に利息を加えた金額が償却原価に基づいて評価され、その評価額は公正価値に近似している。
- ・ 現金、預金、要求払手形およびその他の債務は、入手できる見込みがない場合を除き額面金額で評価される。
- ・ 主として未収利息および未収配当金、売却投資有価証券未収金ならびに販売投資証券未収金を含む資産は、入手できる見込みがない場合を除き額面金額で評価される。
- ・ 特に未払利息、未払収益分配金、購入投資有価証券未払金および買戻し投資証券未払金を含む負債は、額面金額で評価される。

(b) 投資有価証券からの収益

当社は以下の方法で投資有価証券からの収益を認識している。

- ・ 受取利息は毎日発生し、定額法によるプレミアムの償却およびディスカウントの増加を含む。
- ・ 預金利息、定期預金、集団投資スキームによる収益および短期金融預金の利息は、発生主義で認識されている。
- ・ 受取配当金は、配当落ち日に発生し、源泉徴収税が控除された額で表示されている。
- ・ 有価証券貸付による収益は週次で発生する。
- ・ 社債がデフォルトしていることが確認された場合、デフォルトした有価証券にかかる利息の計上はその時点で停止される。関連当事者からデフォルトの確認をとった上で、未収金は償却される。
- ・ 投資有価証券明細表において、永久債の銘柄に含まれる日付は、当該債券の次の繰上償還可能日である。投資有価証券明細表の銘柄の欄に開示されている利率は期末における適用利率であるが、これらの債券は変動利付債であるため、情報提供の目的のみで表示されている。

保有資産のマイナス実効金利により生じる利息に関連するマイナス利回りに係る費用は、毎日計上され、基礎となる商品の残存期間にわたって損益および純資産変動計算書の「銀行利息」において認識される。

(c) デリバティブ商品

当期において、当ファンドは複数の先渡為替予約・先物取引を締結している。未決済の先渡為替予約・先物取引は、評価日に当該取引を決済した場合の金額で評価される。当該未決済取引から生じる超過額および不足額は未実現評価益/(損)に計上され、純資産計算書の資産または負債に(適宜)含められる。

当ファンドはカバード・コール・オプションおよびプット・オプションの売却、コール・オプションおよびプット・オプションの購入を実施できる。当ファンドはまたスプレッド・オプションにも投資することができる。スプレッド・オプションは、2つ以上の資産の価格の差異から価値が生じる種類のオプションである。当ファンドがオプションを売却および/または購入する時点で、当ファンドによる受取または支払プレミアムと同額が負債または資産として反映される。その後、売建オプションに係る負債および買建オプションに係る資産は、現在価値を反映するよう時価評価される。見積実現価額を最もよく反映する方法として、取締役は最終取引価格ではなく仲値または決済値に基づいて、市場で取引されるオプションを評価することに合意している。市場で取引されていないオプションは第三者の値付機関から入手する日次価格に基づいて評価している。有価証券がオプション行使によって売却される場合、受取(支払)プレミアムが売却有価証券から控除(に加算)される。オプションが失効する場合(または当ファンドが決済取引を行った場合)、当ファンドはオプションに係る損益を、受取または支払プレミアムの分だけ(もしくは決済取引のコストが受取または支払プレミアムを超過する分だけ)実現する。

当ファンドは1つの商品から発生する利益を他の投資より発生する利益と交換するために、スワップ契約を締結している。クレジット・デフォルト・スワップの場合、信用事由の発生による偶発的な支払い（当該契約にあらかじめ定義されている）の見返りとして、いくつかのプレミアムがプロテクションの売り手に支払われる。スワップは可能な限り、第三者の値付機関から入手し、実際のマーケット・メーカーに確認した日々の価格に基づいて時価評価される。こうした時価が入手できない場合、スワップはマーケット・メーカーから入手する日々の相場に基づいて値付される。いずれの場合も、価格の変動は損益および純資産変動計算書に未実現評価益／（損）の純変動額として計上される。スワップの満期または解約時における実現損益およびスワップに関連して稼得または負担した利息は、損益および純資産変動計算書上に表示される。

当期において、グローバル・マルチアセット・インカム・ファンドは複数の株式連動債への投資を開始した。一度または複数回の固定クーポンの支払いと引き換えに、元本をブローカーに支払う。満期時に、ファンドは当該元本に基礎となる株式の価値の変動を加減算した金額を受け取るようになる。

事後通告証券（To Be Announced Securities）（以下「TBA」という。）は、米国政府系機関が発行するモーゲージ担保証券に関連するものである。これらの機関は通常、モーゲージ・ローンプールし、組成されたプールの持分を販売する。TBAは、将来の決済に関して購入または売却される、これらの機関の将来のプールに関連しており、金利または償還日のいずれかが確定していない。TBAは、投資有価証券明細表に個別に開示されている。

当ファンドは通常、有価証券取得の目的でTBA購入契約を締結するが、適切と思われる場合は決済前に契約を処分することがある。TBAの売却による手取金は、契約上の決済日まで受領しない。TBA売却契約が残存している間、当該取引をカバーするために、相応の交付可能有価証券または相殺対象となる（売却契約日以前に交付可能な）TBA購入契約を保有する。

TBA売却契約が、相殺対象である購入契約の取得により終了する場合は、ファンドは、裏付けとなる有価証券の未実現利益または損失にかかわらず契約の利益または損失を実現する。ファンドが、契約に基づき有価証券を交付する場合、ファンドは、契約が締結された日に設定された価格で有価証券の売却による利益または損失を実現する。

2015年8月31日現在、当ファンドは未決済のTBAを有していた。これは、純資産計算書の「売却投資有価証券未収金」および「購入投資有価証券未払金」に含まれている。

(d) 為替換算

各ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券の取得原価は、購入時の為替レートで換算されている。各ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券およびその他の資産は、2015年8月31日におけるルクセンブルグでのファンドの評価時の為替レートで換算される。

(e) 結合財務書類

各ファンドの財務書類はファンドの基準通貨で表示されている。

2015年8月31日現在、以下のファンドはクロス・アンブレラ型投資有価証券を保有しており、その時価は結合純資産総額の0.09%に相当する。これらの投資有価証券は、結合経営成績の表示目的のために消去されていない。

ファンド	クロス・アンブレラ型投資有価証券	評価額 (単位：米ドル)
エマージング・マーケット・債券・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - エマージング・マーケット・コーポレート・債券	59,640,000
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - アジアン・タイガー・債券・ファンド	549
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - 米ドル・ハイ・イールド・債券・ファンド	51,310,149

当社の結合数値は米ドルで表示されており、各ファンドの財務書類の合計を含んでいる。純資産計算書の換算レートは、2015年8月31日におけるルクセンブルグでのファンドの評価時の為替レートである。

通貨	ユーロ	英ポンド	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民元
米ドル	0.8940	0.6494	121.1350	0.9659	6.4450

損益および純資産変動計算書の換算レートは、期中にわたり算定された平均レートである。

通貨	ユーロ	英ポンド	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民元
米ドル	0.8636	0.6445	118.2648	0.9530	6.2145

これらの数値は情報提供の目的のみで表示されており、小数第5位を四捨五入している。財務書類においては、小数第9位までの為替レートを適用している。

(f) 為替レート

下記の為替レートは、2015年8月31日現在、当ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券およびその他の資産およびその他の負債を換算するために使用された。

通貨	英ポンド	米ドル	ユーロ	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民元
U A E ディルハム	0.1768	0.2723	0.2424	32.9807	0.2630	1.7547
アルゼンチン・ペソ	0.0699	0.1076	0.0958	13.0331	0.1039	0.6934
豪ドル	0.4609	0.7098	0.6320	85.9810	0.6856	4.5746
ブラジル・リアル	0.1769	0.2724	0.2425	32.9959	0.2631	1.7555
カナダ・ドル	0.4876	0.7509	0.6685	90.9576	0.7253	4.8394
スイス・フラン	0.6723	1.0353	0.9218	125.4149	1.0000	6.6727
チリ・ペソ	0.0009	0.0014	0.0013	0.1740	0.0014	0.0093
オフショア中国人民元	0.1008	0.1552	0.1381	18.7952	0.1499	1.0000
中国人民元	0.1018	0.1568	0.1396	18.9977	0.1515	1.0108
コロンビア・ペソ	0.0002	0.0003	0.0003	0.0389	0.0003	0.0021
チェコ・コルナ	0.0270	0.0416	0.0370	5.0351	0.0401	0.2679
デンマーク・クローネ	0.0977	0.1505	0.1340	18.2305	0.1454	0.9700
エジプト・ポンド	0.0829	0.1277	0.1137	15.4705	0.1234	0.8231
ユーロ	0.7294	1.1232	1.0000	136.0532	1.0848	7.2387
英ポンド	1.0000	1.5399	1.3711	186.5358	1.4874	9.9247
香港ドル	0.0838	0.1290	0.1149	15.6292	0.1246	0.8316
ハンガリー・フォリント	0.0023	0.0036	0.0032	0.4328	0.0035	0.0230
インドネシア・ルピア	0.0001	0.0001	0.0001	0.0086	0.0001	0.0005
イスラエル・シェケル	0.1651	0.2542	0.2263	30.7899	0.2455	1.6382
インド・ルピー	0.0098	0.0150	0.0134	1.8223	0.0145	0.0970
アイスランド・クローナ	0.0050	0.0077	0.0069	0.9376	0.0075	0.0499
日本円	0.0054	0.0083	0.0074	1.0000	0.0080	0.0532
韓国ウォン	0.0005	0.0008	0.0008	0.1024	0.0008	0.0054
クウェート・ディナール	2.1498	3.3105	2.9475	401.0229	3.1976	21.3365
スリランカ・ルピー	0.0048	0.0074	0.0066	0.9000	0.0072	0.0479
モロッコ・ディルハム	0.0670	0.1032	0.0919	12.4970	0.0996	0.6649
メキシコ・ペソ	0.0385	0.0592	0.0527	7.1730	0.0572	0.3816
マレーシア・リングgit	0.1546	0.2381	0.2120	28.8418	0.2300	1.5345
ナイジェリア・ナイラ	0.0033	0.0050	0.0045	0.6080	0.0048	0.0323
ノルウェー・クローネ	0.0776	0.1195	0.1064	14.4753	0.1154	0.7702
ニュージーランド・ドル	0.4136	0.6368	0.5670	77.1447	0.6151	4.1045
ペルー・新ソル	0.2006	0.3088	0.2750	37.4104	0.2983	1.9904
フィリピン・ペソ	0.0139	0.0214	0.0190	2.5917	0.0207	0.1379
パキスタン・ルピー	0.0062	0.0096	0.0086	1.1634	0.0093	0.0619
ポーランド・ズロチ	0.1728	0.2661	0.2369	32.2328	0.2570	1.7149
カタール・リアル	0.1784	0.2746	0.2445	33.2690	0.2653	1.7701

通貨	英ポンド	米ドル	ユーロ	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民元
ルーマニア・レイ	0.1645	0.2534	0.2256	30.6926	0.2447	1.6330
ロシア・ルーブル	0.0096	0.0149	0.0132	1.7999	0.0144	0.0958
サウジ・リアル	0.1731	0.2666	0.2374	32.2978	0.2575	1.7184
スウェーデン・クローネ	0.0766	0.1179	0.1050	14.2813	0.1139	0.7598
シンガポール・ドル	0.4598	0.7080	0.6304	85.7616	0.6838	4.5630
スロバキア・コルナ	0.0242	0.0373	0.0332	4.5161	0.0360	0.2403
タイ・バーツ	0.0181	0.0279	0.0248	3.3794	0.0269	0.1798
新トルコ・リラ	0.2230	0.3434	0.3057	41.5947	0.3317	2.2131
台湾ドル	0.0200	0.0307	0.0274	3.7231	0.0297	0.1981
ウルグアイ・ペソ	0.0228	0.0351	0.0312	4.2496	0.0339	0.2261
米ドル	0.6494	1.0000	0.8904	121.1350	0.9659	6.4450
南アフリカ・ランド	0.0487	0.0750	0.0668	9.0816	0.0724	0.4832

人民元は、外国為替制限を受けており、自由に換金できる通貨ではない。中国人民元債券・ファンドに使用されている為替レートは、オフショア中国人民元（以下「CNH」という。）に関連するものであり、オンショア中国人民元（以下「CNY」という。）に関連するものではない。CNHの価値は、中国政府により随時適用される外国為替管理政策および還流制限ならびにその他外部の市場原理を含むがこれらに限定されない複数の要因により、CNYの価値と大幅に異なる可能性もある。

(g) 希薄化

取締役は、ファンドの投資証券1口当たり純資産価額を調整して当該ファンドが受ける「希薄化」の影響を軽減することがある。希薄化は、ファンドの原資産を購入または売却する実際のコストが、取引費用、税金および原資産の購入価格と売却価格間のスプレッドにより、当該ファンドの評価における原資産の帳簿価額を逸脱している場合に生じる。希薄化は、ファンドの価値に悪影響を及ぼし、その結果投資主に影響を与える可能性がある。投資証券1口当たり純資産価額を調整することにより、この影響を軽減または回避して、既存の投資主を希薄化による影響から保護することができる。いずれかの取引日において、当該ファンドの全投資証券クラスの総取引によって、当該ファンドに対して取締役が（当該ファンドの市場取引費用に関連して）随時設定する基準値を超える投資証券の純増減が生じた場合、取締役は当該ファンドの純資産価額を調整することがある。

英文目論見書のアペンディクスBの17(c)に従い、2015年8月31日現在、かかる希薄化調整は中国人民元債券・ファンドに適用されている。

運用会社はその裁量により希薄化調整の支払いを行うことを決定する場合がある。

投資証券1口当たりの公表/取引純資産価額は、3会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要に開示されており、希薄化調整が含まれている場合がある。この調整は、純資産計算書および損益および純資産変動計算書では認識されていない。

(h) 取引費用

取引費用は有価証券の取得、発行または処分に直接帰属する増分コストである。増分コストは事業体が有価証券を取得、発行または処分しなかった場合には発生していなかったであろうコストである。有価証券の当初認識時に、有価証券は、その取得または発行に直接帰属する取引費用を加えた時価で測定される。

有価証券の購入または売却にかかる取引費用は、保管銀行の取引手数料を除いて、各ファンドの純資産計算書の実現純評価益/(損)または未実現評価益/(損)の純変動額に含まれる。保管銀行の取引手数料はファンドの損益および純資産変動計算書の保管および預託報酬に含まれおり、注記18においても開示されている。

(i) その他の取引に係る外国通貨

その他の取引に係る外国通貨は、現金残高およびスポット取引に係る実現評価損益および未実現評価損益に関連している。

3. 子会社

インディア・ファンドは、その投資目的および投資方針に従い、当社の完全所有子会社であるブラックロック・インディア・エクイティズ(モーリシャス)リミテッド(以下「子会社」という。)のみを通じて、その総資産の少なくとも70%を在インド企業または主たる経済活動をインドで営んでいる企業の株式に投資している。

当子会社の資産および負債、収益および費用はすべて、当社の純資産計算書ならびに損益および純資産変動計算書において結合されている。当子会社が保有する投資有価証券はすべて、インディア・ファンドの投資有価証券明細表において開示されている。当子会社は、モーリシャス法に基づいて2004年9月1日に設立された。

現在、当子会社は、インド/モーリシャスの二重課税条約により税金免除の恩恵を受けている。子会社は、インド市場で取引される有価証券に投資しており、子会社は二重課税条約による恩恵を受けることを見込んでいる。子会社は毎年一定の検査を受け、モーリシャスの納税者居住性の確立および関連要件を含む条件を満たしていなければならない。子会社は、モーリシャス歳入庁(Mauritian Revenue Authorities)から納税者居住証明を取得しており、かつ、インドに支店または恒久的施設を有していないことから、有価証券の売却時にインドのキャピタル・ゲイン税は課されないが、インドの有価証券に係る受取利息について20.6%(2014年:20.6%)のインドの源泉徴収税が課される。

子会社については、英文目論見書及び519ページ(訳注:原文のページ)で詳述される。

4. 運用会社

ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーは、運用会社として従事するよう当社により任命されている。運用会社はルクセンブルグの公開有限責任会社(société anonyme)であり、2010年法第15章に従い、ファンドの運用会社として従事するよう権限を与えられている。

当社は、運用会社との間で運用会社契約を締結した。当該契約に基づき、運用会社は当社の日々の管理を委任されており、これにより当社の投資運用、管理事務および当ファンドのマーケティングに関連するすべての業務を直接または委任して行う責任を有する。

当社の合意のもと、運用会社は、英文目論見書に詳述されているとおり、その業務の一部を委任することを決定した。

ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーは、ブラックロック・グループ内の完全所有子会社である。同社は、CS SFにより規制されている。

5. 投資運用報酬

当期において、当社は運用会社であるブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーに対して投資運用報酬を支払った。

英文目論見書のアペンディクスEに記載されているとおり、当社は年率の投資運用報酬を支払う。投資運用報酬の水準は0.00%から1.75%の間であり、投資家が購入するファンドおよび投資証券クラスに応じて異なる。これらの報酬は、該当ファンドの純資産価額に基づき毎日発生し、毎月支払われる。投資顧問会社への報酬を含む特定の費用および報酬は、投資運用報酬より支払われる。クラスJおよびクラスX投資証券について請求される投資運用報酬はない。

投資運用報酬の減額は、損益および純資産変動計算書の投資運用報酬から別掲で開示されている。当期において、以下のファンドは投資運用報酬が減額されている。

ユーロ・リザーブ・ファンド

USドル・リザーブ・ファンド

2015年8月31日現在、未払投資運用報酬は、純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

6. 販売報酬

英文目論見書のアペンディクスEに記載されているとおり、当社は年間販売報酬を支払う。販売報酬の水準は、0.00%から1.25%の間である。クラスA、D、I、JおよびX投資証券では、販売報酬を支払わない。ユーロ・リザーブ・ファンドおよびUSドル・リザーブ・ファンドのクラスA、C、D、I、JおよびX投資証券では、販売報酬を支払わない。当該報酬は、該当ファンドの純資産価額(該当する場合、アペンディクスB第17(c)項に記載されているとおり、該当ファンドの純資産価額への希薄化調整を反映している)に基づき毎日発生し、毎月支払われる。

当社は、損益および純資産変動計算書において詳述されているとおり、販売報酬を支払う。

2015年8月31日現在、未払販売報酬は、純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

7. 管理事務代行報酬

当社は管理事務代行報酬を運用会社に支払っている。

管理事務代行報酬の水準は、運用会社との合意に基づく取締役の裁量によって変更される場合があり、当社が発行する様々なファンドと投資証券クラスのそれぞれに異なる比率で適用されることになる。ただし、取締役と運用会社の間で、現在支払われている管理事務代行報酬の上限を年率0.25%とすることが合意されている。管理事務代行報酬は、該当する投資証券クラスの純資産価額に基づき毎日発生し、毎月支払われる。

取締役および運用会社は、各ファンドの市場部門および競合他社と比較したファンドの業績といった複数の基準を考慮に入れ、ファンドの投資家が入手可能な類似する投資商品の市場全体について比較した場合に各ファンドの総費用比率が確実に優位性を保てることを目標とした料率で、管理事務代行報酬の水準を設定している。

管理事務代行報酬は、保管および預託報酬、販売報酬、有価証券貸付手数料、欧州連合の源泉徴収税還付請求に関連する法的費用とその税金ならびに投資レベルまたは当社レベルで課される税金を除き、当社が負担したすべての固定および変動の営業費用および管理費に充てる目的で運用会社が使用する。

2015年7月20日付で、当社は、欧州連合の源泉徴収税還付請求に関連する法的費用を支払い、関連するファンドに(その税金と併せて)対等かつ公正に配分する。当社の還付請求が認められる確率が高く、回収される税金は、当該還付請求提訴のための関連法的費用を大幅に上回ったため、関連法的費用は、当該日付以降は、管理事務代行報酬から支払われない。

また、管理事務代行報酬は、監査ならびに投資家による税金報告およびその他の税金に係る順守事項に関連するサービスに対してルクセンブルグにあるプライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コーポラティブ(以下「プライスウォーターハウスクーパース」という。)に支払われる報酬に充てるために使われる。2015年8月31日に終了した会計年度における報酬は1,070,222ユーロであった。プライスウォーターハウスクーパースによって提供されている投資家による税金報告に関連するサービスは、特定の課税管轄に居住する投資家に要求されている税金報告に関わるものである。当社に提供されているサービスについてプライスウォーターハウスクーパースに支払っている報酬はこれ以外にない。

これらの営業費用および管理費には、すべての第三者費用と、当社が、または当社が代行して随時負担したその他の回収可能な費用が含まれる。この費用には、ファンド経理報酬、名義書換事務代行報酬(副名義書換事務代行会社および関連するプラットフォームとの取引費用を含む)、コンサルタント、法律、税金および監査報酬等のすべての専門家費用、取締役報酬(ブラックロック・グループの従業員でない取締役に對する報酬)、交通費、合理的な範囲の立替経費、印刷費、公告費、翻訳費用および投資主への報告に関連するその他すべての費用、規則当局への届出およびライセンス手数料、コルレスおよびその他の銀行手数料、ソフトウェアのサポートおよび維持、営業費用およびインベスター・サービス・チームおよび様々なブラックロック・グループ会社によって提供されたその他のグローバル管理サービスに帰属する費用が含まれるが、これらに限定されない。

運用会社は、ファンドの総費用比率の競争優位性を維持する財務リスクを負っている。したがって、すべての期間において当社が運用会社に支払った管理事務代行報酬の金額のうち、期中に発生した実際の費用を超える額について運用会社は返還する義務を負わず、一方で期中に発生した実際の費用のうち、当社が運用会社に支払った管理事務代行報酬を超える額については、運用会社または他のブラックロック・グループ会社が負担しなければならない。

ブラックロック・グループの従業員でない取締役に、遂行した業務の報酬として税込みで年間55,000ユーロ支払われた。会長の報酬が税込みで年間60,000ユーロである。ブラックロック・グループの従業員である取締役は、取締役報酬を受ける権利を有していない。

特定の管轄地域に適用される税金も、ファンドに直接請求される(注記9参照)。

2015年8月31日現在、未払管理事務代行報酬は、純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

8. 保管および預託報酬

当期における当社の保管銀行は、ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン(インターナショナル)リミテッド、ルクセンブルグ支店である。保管銀行は、英文目論見書において詳述される取引手数料に加えて、有価証券の価額に基づき毎日発生する年間報酬を受領する。両カテゴリーの報酬および手数料の料率は、投資先の国によって異なり、場合によっては資産クラスに応じて異なる。債券や先進国の株式市場に対する投資は上記の幅の下限となり、新興市場に対する一部の投資は、上記の幅の上限となる。そのため、各ファンドの保管費用は、その時点における資産配分により左右されることになる。

保管および預託報酬はファンドに直接請求される。2015年8月31日現在、未払いである保管および預託報酬は純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

R Q F I I 保管銀行

保管銀行は、香港上海銀行(中国)株式会社を、人民元適格外国機関投資家(以下「R Q F I I」という。)保管銀行として指名した。R Q F I Iへの割当の潜在的な影響は英文目論見書において詳述されている。

9. 税金

ルクセンブルグ

現在のルクセンブルグの法律および慣習に基づき、当社はルクセンブルグにおける所得税もしくはキャピタル・ゲイン税が課されず、また、当社が支払う配当金はルクセンブルグの源泉徴収税の対象となっていない。しかし、当社は、純資産価額に対して年率0.05%のルクセンブルグにおける税金、またはリザーブ・ファンド、クラスI、クラスXおよびクラスJの投資証券の場合には純資産価額に対して年率0.01%の税金が課される。当該税金は、各ファンドの該当四半期末(暦年)の純資産価額に基づき、四半期毎に支払われる。ルクセンブルグにおいて、投資証券の発行に伴う印紙税またはその他の税金は支払われない。2015年8月31日に終了した会計年度において、ルクセンブルグの税金に関連する53,776,805米ドルが費用計上された。

ベルギー

当社は金融市場に関する2012年8月3日法第154条に基づき、ベルギーの金融サービス市場機構に登録されている。ベルギーにおいて一般向け販売のために登録されたファンドには、前年の12月31日現在、ベルギーの仲介業者を通じてベルギーで販売された口数の純資産価額に対して年率0.0925%の税金が課される。2015年8月31日に終了した会計年度において、ベルギーの税金に関連する3,183,954米ドルが費用計上された。

英国

報告型ファンド(Reporting Funds)

当社では英国報告型ファンドの形態が適用されている。このファンド形態に基づき、英国報告型ファンドの投資家は、分配のあるなしにかかわらずその保有高に応じた英国報告型ファンドの収益持分について課税されるが、その保有高の売却益にはキャピタル・ゲイン税が課される。現在、英国報告型ファンドであるファンドのリストは、www.blackrock.co.uk/reportingfundstatusより入手可能である。

その他の取引税

他の管轄地域において、当ファンドが保有する特定の資産に対し、金融取引税(以下「F T T」という。)またはその他の取引税といった税金が課される場合がある(例えば、英国の印紙税、フランスのF T T)。

源泉徴収税

当社が受け取る投資に係る配当金および利息は、その支払元の国において源泉徴収税が課せられる場合がある。当社が所得税を免除されているため、かかる源泉徴収税は通常、回収できない。しかしながら、最近の欧州連合における判例法によって、そのような回収不能の税金が減額される可能性が出てきた。市民権を有する国、居住国、あるいは住所を登録している国の法律に基づいて、投資証券の販売、購入、保有、買戻し、転換、売却において課せられる可能性がある税金について、投資家は熟知するとともに、専門家に適時に相談すべきである。投資家は、課税の水準および課税の標準ならびに課税の軽減が変更される可能性があることに留意する必要がある。源泉徴収税の負担の可能性については、英文目論見書においてさらに説明されている。

10. 投資顧問会社

運用会社であるブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーは、同社の投資運用機能を、英文目論見書に記載のとおり、以下の投資顧問会社(以下それぞれを「投資顧問会社」という。)に委託している。ブラックロック・フィナンシャル・マネジメント・インク(ユーエス)(以下「BFM」という。)、ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エル・エル・シー(ユーエス)(以下「BIMLLC」という。)、ブラックロック・インベストメント・マネジメント(ユーケー)リミテッド(以下「BIMUK」という。)およびブラックロック(シンガポール)リミテッド(以下「BSL」という。)

すべての投資顧問会社は、ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーにより直接任命されている。すべての副投資顧問会社は関連する投資顧問会社により任命されている。これらのうちの数社は、投資顧問会社として以下の会社に業務の一部を再委託している。ブラックロック・ジャパン株式会社(以下「BLKJap」という。)、ブラックロック・アセット・マネジメント・ノースアジア・リミテッド(以下「BAMNA」という。)およびブラックロック・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(以下「BLKAus」という。)

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
ASEANリーダーズ・ファンド	BIMUK	BAMNA
アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK	BAMNA
アジア・ドラゴン・ファンド	BIMUK	BAMNA
アジア・グロース・リーダーズ・ファンド	BIMUK	BAMNA
アジア・ローカル・ボンド・ファンド	BSL	BAMNA
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	BSL	BAMNA
チャイナ・ファンド	BIMUK	BAMNA
コンチネンタル・ヨーロッパ・フレキシブル・ファンド	BIMUK	-
エマージング・ヨーロッパ・ファンド	BIMUK	-
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	BSL、BIMUK、 BFM	-
エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	BSL、BIMUK、 BFM	-
エマージング・マーケット・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK、BIMLLC	-
エマージング・マーケット・ファンド	BIMUK、BIMLLC	-
エマージング・マーケット・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド	BSL、BIMUK、 BFM	-
エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド	BSL、BIMUK、 BFM	BAMNA
ユーロ・ボンド・ファンド	BIMUK	-
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	BIMUK	-
ユーロ・リザーブ・ファンド	BIMUK	-
ユーロ・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	BIMUK	-
ユーロ・マーケット・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・フォーカス・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド ⁽¹⁾	BIMUK	-
ヨーロッパ・スペシャル・シチュエーションズ・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・バリュー・ファンド	BIMUK	-
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	BSL、BIMUK、 BFM	BLKAUS
フレキシブル・マルチアセット・ファンド	BIMUK	-
グローバル・アロケーション・ファンド	BIMLLC	-
グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	BIMUK、BFM	BLKAUS
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	BIMLLC	-
グローバル・エンハンスト・エクイティ・イールド・ファンド	BIMUK	-
グローバル・エクイティ・ファンド	BIMLLC	-

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
グローバル・エクイティ・インカム・ファンド	B I M U K	-
グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド	B I M U K、B F M	B L K A u s
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	B S L、B I M U K、 B F M	-
グローバル・インフレーション・リンクド・ボンド・ファンド	B F M	B L K A u s
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	B S L、B I M U K、 B F M	-
グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	B I M L L C	-
グローバル・スモールキャップ・ファンド	B I M L L C	-
インドア・ファンド	B I M U K	B A M N A
ジャパン・フレキシブル・エクイティ・ファンド	B I M U K	B A M N A
ジャパン・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンド	B I M U K	B L K J a p
ラテン・アメリカン・ファンド	B I M L L C	-
ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド	B I M L L C、B I M U K	-
ニュー・エネルギー・ファンド	B I M U K	-
ノースアメリカン・エクイティ・インカム・ファンド	B I M L L C	-
パシフィック・エクイティ・ファンド	B I M U K	B A M N A
中国人民元ボンド・ファンド	B S L、B I M U K	B A M N A
スイス・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンド	B I M U K	-
ユナイテッド・キングダム・ファンド	B I M U K	-
USベーシック・バリュー・ファンド	B I M L L C	-
USドル・コア・ボンド・ファンド	B F M	-
USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	B F M	-
USドル・リザーブ・ファンド	B F M	-
USドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	B F M	B L K A u s
USフレキシブル・エクイティ・ファンド	B I M L L C	-
USガバメント・モーゲージ・ファンド	B F M	-
USグロース・ファンド	B I M L L C	-
USスモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンド	B I M L L C	-
ワールド・アグリカルチャー・ファンド	B I M U K	-
ワールド・ボンド・ファンド	B I M U K、B F M	B L K A u s
ワールド・エネルギー・ファンド	B I M U K	-
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	B I M U K	-
ワールド・ゴールド・ファンド	B I M U K	-
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	B I M L L C	-
ワールド・マイニング・ファンド	B I M U K	-

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	B S L、B I M U K、 B I M L L C	-
ワールド・テクノロジー・ファンド	B I M U K	-

(1) 当期において設定されたファンド。詳細については注記1を参照のこと。

11. 関連当事者との取引

運用会社、主販売会社、投資顧問会社および副投資顧問会社の最終的な持株会社は、米国デラウェア州で設立されたブラックロック・インクである。PNCファイナンシャル・サービスズ・グループ・インクがブラックロック・インクの主要株主となっている。当社のために有価証券の取引を手配する際、PNCグループの会社が、通常の条件で有価証券仲介、外国為替、銀行業務およびその他のサービスを提供していた、もしくは本人として取引をしていた可能性があり、差益が生じる可能性がある。かかる取引は、通常の業務過程において標準的な取引条件に基づいて行われる。ブローカーおよびエージェントに対する手数料は市場の慣例に従って支払われており、手数料がブローカーおよびエージェントによって一括されている、あるいはその他の手法によって割り引かれたり、現金により手数料が割り戻された場合、その差益は当社に還元されている。PNCグループのサービスは、手数料および取引条件が投資市場においてブラックロックと関連が無いその他のブローカーおよびエージェントとほぼ同様であることを前提として適切であると判断された場合に投資顧問会社によって利用可能であり、このことは、最高の成績を達成するという上述の方針と一貫性がある。当期において、運用会社、投資顧問会社、副投資顧問会社または当社の取締役の関連当事者であるブローカーを通じて当社に影響を及ぼす取引はなかった。

当期において、当社、運用会社、投資顧問会社、副投資顧問会社、当社の取締役、あるいはこれらの者またはこれらの関連当事者が重要な利害関係を有する企業との間で、通常の業務範囲外のあるいは標準的な取引条件外の取引は行われていない。

当期において、取締役によるファンドの投資証券の購入はなかった。

有価証券貸付契約に従って任命された有価証券貸付の代理人は、当社の関連当事者であるブラックロック・アドバイザーズ(ユークー)リミテッドである。ブラックロック・アドバイザーズ(ユークー)リミテッドは有価証券貸付取引に直接関連するすべての運用費用を負担する。

当ファンドは、ブラックロック・インクが提供している借手のデフォルトに対する補償から利益を得ている。当該補償により、全貸付有価証券の差替えが可能となる。ブラックロック・インクは、借手のデフォルトに対する補償費用を負担する。

詳細については注記13「効率的なポートフォリオ管理」を参照のこと。

12. コミッションの使用

1社または複数の投資顧問会社は、適用される法律または規制により認められている場合、コミッション・シェアリング契約または同様の契約を締結することがある。これらの契約は、契約を通じて入手するリサーチまたは売買執行サービスが投資顧問会社の投資に係る意思決定能力または売買執行力を向上させ、それにより投資収益増加の見込みが高まると投資顧問会社が判断する場合にのみ締結されることになる。投資顧問会社は主要な国際ブローカーとこれらの契約を締結し、ブローカーは投資顧問会社に対して提供するリサーチおよび売買執行サービスの支払いにおいて、投資顧問会社からの売買により発生するコミッションを使用するか、または投資顧問会社に提供される第三者リサーチに関して支払うことに同意する。すべての売買は引き続き最善の執行の要件に準拠しており、契約は継続して見直されている。

13. 効率的なポートフォリオ管理

当社は効率的にポートフォリオを管理する目的でデリバティブ契約を締結している。詳細については注記14「デリバティブ商品」および当ファンドの投資有価証券明細表を参照のこと。

当期において、当社は有価証券貸付の契約を締結している。当社は、有価証券貸付の代理人であるブラックロック・アドバイザーズ(ユークー)リミテッドは、その活動に関連して報酬を受け取る。当該報酬は、当該活動からの純収益の37.5%を超えてはならず、すべての営業費用はブラックロックの取り分から支払われる。

ブラックロック・アドバイザーズ(ユークー)リミテッドは、高格付の専門的金融機関(以下「取引相手方」という。)と有価証券貸付の契約を締結する裁量を有している。かかる取引相手方には、ブラックロック・アドバイザーズ(ユークー)リミテッドの関連会社が含まれる場合がある。当期に行われた有価証券貸付において、貸付有価証券を受け取った借主は次のとおりである。パークレイズ・バンクplc、パークレイズ・キャピタル・セキュリティーズ・リミテッド、BNPパリバ、シティグループ・グローバル・マーケット・リミテッド、クレディ・スイス・セキュリティーズ(ヨーロッパ)リミテッド、ドイツ銀行AG、ゴールドマン・サックス・インターナショナル、香港上海銀行plc、JPモルガン・セキュリティーズplc、マッコーリー銀行リミテッド、メリルリンチ・インターナショナル、モルガン・スタンレー・アンド・カンパニー・インターナショナルplc、野村インターナショナルplc、スカンジナビア・エンスキルダ銀行AB、ソシエテ・ジェネラル、ノヴァ・スコシア銀行およびUBS AGである。担保は、毎日時価評価され、有価証券貸付は要求時に返済される。当該貸付は、ETFおよびその他のUCITSの発行に関する欧州証券市場監督局(以下「ESMA」という。)のガイドラインを編入している、修正後のCSSF通達08/356の要件を反映した英文目論見書の規定を遵守している場合にのみ可能である。

有価証券貸付プログラムからの投資収益は損益および純資産変動計算書に個別に開示されている。

当該受入担保は、規制市場で上場が認められているまたは取引されている有価証券で構成される。この担保は保管銀行またはその代理店が保有している。受領した有価証券担保は基本財務書類には反映されていない。

2015年8月31日現在、関連するファンドの投資有価証券ポートフォリオにおいてアスタリスクで記されている貸付有価証券のファンドレベルでの評価額および保有担保の評価額は以下の表のとおりである。

2015年8月31日現在、貸付有価証券の評価額合計は6,762,895,633米ドルであり、有価証券担保の時価は7,626,692,642米ドルである。

(単位：米ドル)

ファンド	貸付有価証券の評価額	担保の時価
アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンド	76,265,199	84,875,613
アジア・ドラゴン・ファンド	93,962,724	104,887,837
アジア・グロース・リーダーズ・ファンド	9,646,999	10,905,723
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	102,230,571	111,820,238
チャイナ・ファンド	119,464,804	142,119,710
コンチネンタル・ヨーロッパ・フレキシブル・ファンド	3,981,978	4,363,792
エマージング・ヨーロッパ・ファンド	5,990,577	6,399,465
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	282,872,593	309,329,976
エマージング・マーケット・エクイティ・インカム・ファンド	7,795,888	8,724,489
エマージング・マーケット・ファンド	14,698,120	16,324,885
エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド	1,989,087	2,110,599
ユーロ・ボンド・ファンド	552,115,607	613,443,326
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	16,345,599	18,279,007
ユーロ・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	1,265,884,881	1,404,415,498

ファンド	貸付有価証券の評価額	担保の時価
ヨーロッパ・エクイティ・インカム・ファンド	1,073,813	1,178,478
ヨーロッパ・フォーカス・ファンド	94,677,043	114,819,310
ヨーロッパ・ファンド	54,720,052	60,932,598
ヨーロッパ・スペシャル・シチュエーションズ・ファンド	16,204,955	17,720,960
ヨーロッパ・バリュー・ファンド	9,549,552	10,573,021
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	297,250,615	326,676,450
フレキシブル・マルチアセット・ファンド	10,478,539	11,685,226
グローバル・アロケーション・ファンド	1,611,257,099	1,795,517,233
グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	47,523,270	51,802,859
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	79,081,051	91,365,919
グローバル・エンハンスト・エクイティ・イールド・ファンド	47,520,828	54,850,450
グローバル・エクイティ・ファンド	9,482,496	11,787,386
グローバル・エクイティ・インカム・ファンド	154,822,642	173,610,115
グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド	80,922,320	91,659,479
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	103,451,523	113,278,551
グローバル・インフレーション・リンクド・ボンド・ファンド	41,121,995	44,306,812
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	18,909,529	24,718,248
グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	5,135,432	5,691,499
グローバル・スモールキャップ・ファンド	41,154,619	47,326,683
ジャパン・フレキシブル・エクイティ・ファンド	47,592,551	58,193,591
ジャパン・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンド	110,853,284	127,440,557
ラテン・アメリカン・ファンド	24,147,167	29,200,220
ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド	234,099	273,686
ニュー・エネルギー・ファンド	68,948,675	76,820,947
ノースアメリカン・エクイティ・インカム・ファンド	740,460	843,485
パシフィック・エクイティ・ファンド	22,400,808	25,957,221
スイス・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンド	35,139,468	38,742,964
ユナイテッド・キングダム・ファンド	30,564,607	33,679,319
USベシック・バリュー・ファンド	14,117,378	15,846,274
USドル・コア・ボンド・ファンド	9,039,444	9,971,817
USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	112,237,610	124,066,916
USドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	103,217,947	113,515,515
USフレキシブル・エクイティ・ファンド	7,198,446	8,108,784
USグロース・ファンド	21,451,831	23,957,510

(単位:米ドル)

ファンド	貸付有価証券の評価額	担保の時価
USスモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンド	20,639,315	23,124,480
ワールド・アグリカルチャー・ファンド	12,875,495	14,806,118
ワールド・ボンド・ファンド	223,806,685	270,531,442
ワールド・エネルギー・ファンド	88,265,884	135,694,179
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	11,776,955	13,132,794
ワールド・ゴールド・ファンド	66,049,052	79,283,144
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	69,099,749	76,924,162
ワールド・マイニング・ファンド	376,306,030	429,605,568
ワールド・テクノロジー・ファンド	8,610,693	9,470,514

14. デリバティブ商品

当ファンドはデリバティブ商品を売買することがある。詳細については各ファンドの投資有価証券明細表を参照のこと。

投資有価証券明細表で開示されているとおり、基礎となるエクスポージャーはESMAが公表したガイドラインに従って算定されており、各金融商品の基礎となる資産における同等ポジションの市場価額を表している。債券先物の基礎となるエクスポージャーは、譲渡有価証券の最安値ではなく債券の市場価額に基づいて算定されている。

15. 差入れた有価証券または保証として引渡した有価証券および保証として受取った有価証券

ファンドが担保として差入れた、または保証として引渡した有価証券は当ファンドの投資有価証券明細表において開示されている。当該有価証券はファンドの投資有価証券明細表において「†」で記されており、2015年8月31日現在、その評価額は175,022,563米ドルである。

グローバル・エンハンスト・エクイティ・イールド・ファンドについて、売建コール・オプションの担保は、ブラックロック・インベストメント・マネジメント(ユークー)リミテッド、メリルリンチ・インターナショナルおよびバンク・オブ・ニューヨーク・メロン(インターナショナル)リミテッドの三者間契約に基づき差入れられる。担保はファンドの投資有価証券明細表において「^」で記されており、2015年8月31日現在、その評価額は56,003,772米ドルである。

ファンドが保証として受取った有価証券の詳細は、以下の表のとおりである。2015年8月31日現在、これらの有価証券の評価額は29,825,389米ドルである。

ファンド	額面金額	銘柄	評価額 (単位:米ドル)
グローバル・アロケーション・ファンド	1,358,000	Cooperative Centrale Raiffeisen 4.125% 14/1/2020	1,572,861
グローバル・アロケーション・ファンド	114,000	Cooperative Centrale Raiffeisen 5.25% 23/5/2041	190,777
グローバル・アロケーション・ファンド	712,000	Export-Import Bank of Korea 4.875% 14/1/2016	649,451
グローバル・アロケーション・ファンド	596,000	General Electric Capital Corp 4.875% 18/9/2037	913,146
グローバル・アロケーション・ファンド	605,000	IXIS Corporate & Investment Bank SA 5.875% 24/2/2020	967,014
グローバル・アロケーション・ファンド	1,137,000	KFW 3.75% 7/9/2016	1,621,162
グローバル・アロケーション・ファンド	904,000	Procter & Gamble Co/The 5.25% 19/1/2033	1,587,627
グローバル・アロケーション・ファンド	3,036,000	Royal Bank of Scotland Group Plc 7/6/2016 (Zero Coupon)	2,712,453
グローバル・アロケーション・ファンド	18,602,000	United States Treasury Bill 2.125% 15/7/2025	17,837,223
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	673,000	United States Treasury Bill 2.125% 15/8/2021	672,330
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	545,000	United States Treasury Bill 3.75% 15/11/2018	589,680
ワールド・ボンド・ファンド	421,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.5% 1/2/2018	511,665

16. 現金担保

当ファンドはさまざまな取引相手とデリバティブの取引を行っている。デリバティブの取引相手は、投資有価証券明細表に示されている。デリバティブの取引相手は以下のとおりである。バンク・オブ・アメリカ、バンク・オブ・アメリカ・メリルリンチ、パークレイズ、BNYメロン、BNPパリバ、ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・カンパニー、シティグループ、シティバンク、オーストラリア・コモンウェルス銀行、クレディ・スイス、ドイツ銀行、ゴールドマン・サックス、HSBC、JPモルガン、メリルリンチ、モルガン・スタンレー、RBS、ロイヤル・バンク・オブ・カナダ、ソシエテ・ジェネラル、スタンダードチャータード銀行ロンドン、ステート・ストリート、トロント・ドミニオン、UBSおよびウェストバックである。スワップ契約、先物取引、売建オプション(プットおよびコール)、買建オプション(プットおよびコール)およびスワップオプションに係る担保/証拠金について、取引相手が当社へのエクスポージャーを補う場合、担保/証拠金が支払われ、当社が取引相手へのエクスポージャーを補う場合、担保/証拠金が受取られる。「ブローカーに対する債権」は、ポートフォリオのクリアリング・ブローカーおよびさまざまな取引相手から受取った現金担保からなる。「ブローカーに対する債務」は、ポートフォリオのクリアリング・ブローカーおよびさまざまな取引相手に支払った現金担保からなる。

2015年8月31日現在の保有スワップ契約、店頭オプション取引および先物取引に関連するブローカーからの/(に対する)現金担保および証拠金残高は、以下の表のとおりである。

ファンド	通貨	ブローカーからのスワップ契約および店頭オプション取引現金担保残高	ブローカーに対するスワップ契約および店頭オプション取引現金担保残高	ブローカーからの先物取引証拠金残高	ブローカーに対する先物取引証拠金残高
アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンド	米ドル	-	-	-	(327)
アジア・ローカル・ボンド・ファンド	米ドル	67,000	-	-	-
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	米ドル	3,069,000	-	-	-
チャイナ・ファンド	米ドル	-	-	3,752,708	-
コンチネンタル・ヨーロッパ・フレキシブル・ファンド	ユーロ	-	-	20,217,583	-
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	米ドル	-	(5,890,000)	1,259,901	-
エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	米ドル	-	-	28,127	-
エマージング・マーケット・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド	米ドル	-	-	48,705	-
エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド	米ドル	720,000	-	-	(3,068)
ユーロ・ボンド・ファンド	ユーロ	-	(1,830,000)	8,130,000	-
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	ユーロ	245,000	-	969,631	-
ユーロ・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	ユーロ	-	(4,590,000)	18,177,091	-
ヨーロッパ・ファンド	ユーロ	-	-	13	-
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド ⁽¹⁾	ユーロ	-	-	43,730	-

ファンド	通貨	ブローカーからの スワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカーに 対するスワップ契 約および 店頭オプション 取引 現金担保残高	ブローカー からの 先物取引 証拠金残高	ブローカーに 対する 先物取引 証拠金残高
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	米ドル	4,140,000	-	66,960,926	-
フレキシブル・マルチアセッ ト・ファンド	ユーロ	1,869,000	(120,000)	5,944,381	-
グローバル・アロケーショ ン・ファンド	米ドル	-	(83,993,192)	-	(38,459,391)
グローバル・コーポレート・ ボンド・ファンド	米ドル	-	(540,000)	2,089,253	-
グローバル・ダイナミック・ エクイティ・ファンド	米ドル	1,280,000	(3,652,992)	-	(778,464)
グローバル・エンハンスト・ エクイティ・イールド・ファ ンド	米ドル	-	-	1,793,782	-
グローバル・ガバメント・ボ ンド・ファンド	米ドル	-	-	1,552,000	-
グローバル・ハイ・イールド ・ボンド・ファンド	米ドル	940,000	(5,864,000)	5,528,597	-
グローバル・インフレーショ ン・リンクド・ボンド・ファ ンド	米ドル	-	-	178,581	-
グローバル・マルチアセッ ト・インカム・ファンド	米ドル	-	-	20,910,119	-
インドア・ファンド	米ドル	-	-	1,971,684	-
ナチュラル・リソース・グ ロース・アンド・インカム・ ファンド	米ドル	-	-	7,493	-
パシフィック・エクイティ・ ファンド	米ドル	-	-	-	(133)
中国人民元ボンド・ファンド	オフショ ア中国人 民元	-	-	288,087	-
USドル・コア・ボンド・ ファンド	米ドル	-	-	1,208,194	-
USドル・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド	米ドル	4,060,000	(12,980,000)	718,292	-
USドル・ショート・デュ レーション・ボンド・ファン ド	米ドル	-	-	696,574	-
USガバメント・モーゲー ジ・ファンド	米ドル	-	-	137,805	-
ワールド・ボンド・ファンド	米ドル	-	(520,000)	4,113,501	-

(1) 当期において設定されたファンド。詳細については注記1を参照のこと。

17. 配当金

配当金の支払いに関連する取締役の現行の方針は投資証券クラスによって異なる。無分配投資証券クラスに関する現行の方針はすべての純投資利益を留保し再投資することである。そのため、当該利益は純資産価額に留保され、該当クラスの投資証券1口当たり純資産価額に反映される。分配型投資証券クラスの場合、当期の投資収益の純額または全額を分配する投資証券クラスについては当期の費用控除後のほぼすべての投資収益を分配する方針であり、総額を分配する投資証券クラスについては分配に費用控除前の資本金の一部が含まれることがある。取締役は、実現および未実現キャピタル・ゲイン（純額）の両方からの配当金を含めて配当を行うか否か、またどの程度含めるかについて決定することもできる。当ファンドの一部および/または投資証券クラスの一部（例えば、安定分配型投資証券および金利差分配型投資証券）は、収益、実現および未実現キャピタル・ゲイン（純額）だけでなく資本金からも分配を行うことができる。分配型投資証券クラスが実現または未実現キャピタル・ゲイン（純額）からの配当金を含めて配当を行う場合、もしくは費用控除前の総収益を分配するファンドの場合は、配当金に当初の資本金が含まれる可能性がある。ファンドの資本金から配当金が支払われる場合、資本金が減額されることになり、追加の増資が必要になる可能性がある。

ファンドが英国報告型であり報告収益が分配額を超過する場合は、当該剰余金がみなし配当金として処理され、投資家の税務上の立場に応じて課税されることになる。分配型投資証券クラスについては、当期の費用控除後のほぼすべての投資収益（総収益分配型投資証券、安定分配型投資証券については総収益、金利差分配型投資証券については総収益および金利差）を分配するという方針が採用されている。

分配型投資証券を発行するファンドについては、ファンドの種類により、配当金の支払頻度が決定され、通常、配当金は以下のとおり支払われる。

- ・ 債券分配型ファンドについては、配当原資となる収益がある場合、月次。
- ・ アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンド、アジア・タイガー・ボンド・ファンド、エマージング・マーケット・ボンド・ファンド、エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド、エマージング・マーケット・エクイティ・インカム・ファンド、エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド、ユーロ・ボンド・ファンド、ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド、ヨーロッパ・エクイティ・インカム・ファンド、ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド、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、グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド、グローバル・エンハンスト・エクイティ・イールド・ファンド、グローバル・エクイティ・インカム・ファンド、グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド、グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド、ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド、ノースアメリカン・エクイティ・インカム・ファンドおよび中国元ボンド・ファンド（および、取締役が随時決定するその他のファンド）については、配当原資となる収益がある場合、四半期毎。
- ・ 株式分配型ファンドについては、取締役の裁量により、年次。

毎月配当金を支払う分配型ファンドは、更に以下のとおり分類される。

- ・ 配当金が日次で算定される毎日分配型投資証券
- ・ 配当金が月次で算定される毎月分配型投資証券
- ・ 配当金が予想総収益額をもとに月次で算定される安定分配型投資証券
- ・ 配当金が通貨ヘッジ投資証券クラスから生じる予想総収益額および金利差をもとに月次で算定される金利差分配型投資証券

投資家は、毎日分配型投資証券、毎月分配型投資証券、安定分配型投資証券または金利差分配型投資証券のいずれを保有するか選択できる。

毎四半期分配型投資証券については、四半期毎に配当金が支払われる。

毎年分配型投資証券については、年次で配当金が支払われる。

配当金の宣言および支払ならびに投資主が利用可能な再投資の選択については、英文目論見書に記載されている。

18. 取引費用

投資目的を達成するため、ファンドはポートフォリオに係る売買に関連した取引費用を負担する。以下の表に開示されているのは、2015年8月31日に終了した会計年度に各ファンドが負担した、個別に特定が可能な取引費用である。当該費用には手数料、決済費用、ブローカー費用が含まれる。

ファンド	通貨	取引費用
A S E A Nリーダーズ・ファンド	米ドル	1,331,530
アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンド	米ドル	3,346,508
アジア・ドラゴン・ファンド	米ドル	6,308,900
アジア・グロース・リーダーズ・ファンド	米ドル	2,912,594
アジア・ローカル・ボンド・ファンド	米ドル	48,692
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	米ドル	94,827
チャイナ・ファンド	米ドル	8,958,465
コンチネンタル・ヨーロピアン・フレキシブル・ファンド	ユーロ	6,564,210
エマージング・ヨーロッパ・ファンド	ユーロ	4,047,856
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	米ドル	24,038
エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	米ドル	20,056
エマージング・マーケット・エクイティ・インカム・ファンド	米ドル	1,961,033
エマージング・マーケット・ファンド	米ドル	2,269,797
エマージング・マーケット・インベストメント・グレード・ボンド・ファンド	米ドル	9,567
エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド	米ドル	12,340
ユーロ・ボンド・ファンド	ユーロ	25,177
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	ユーロ	14,782
ユーロ・リザーブ・ファンド	ユーロ	5,406
ユーロ・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	ユーロ	16,843
ユーロ・マーケット・ファンド	ユーロ	13,087,365
ヨーロピアン・エクイティ・インカム・ファンド	ユーロ	12,315,517
ヨーロピアン・フォーカス・ファンド	ユーロ	10,588,791
ヨーロピアン・ファンド	ユーロ	23,251,114
ヨーロピアン・ハイ・イールド・ボンド・ファンド ⁽¹⁾	ユーロ	2,696
ヨーロピアン・スペシャル・シチュエーションズ・ファンド	ユーロ	4,550,430
ヨーロピアン・バリュウ・ファンド	ユーロ	12,151,947
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	米ドル	575,009
フレキシブル・マルチアセット・ファンド	ユーロ	440,264
グローバル・アロケーション・ファンド	米ドル	13,702,969
グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	米ドル	30,506
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	米ドル	1,063,304
グローバル・エンハンスト・エクイティ・イールド・ファンド	米ドル	832,509
グローバル・エクイティ・ファンド	米ドル	432,384
グローバル・エクイティ・インカム・ファンド	米ドル	1,806,761

ファンド	通貨	取引費用
グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド	米ドル	86,528
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	147,195
グローバル・インフレーション・リンクド・ボンド・ファンド	米ドル	11,268
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	米ドル	1,506,242
グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	米ドル	186,484
グローバル・スモールキャップ・ファンド	米ドル	1,014,461
インディア・ファンド	米ドル	2,151,949
ジャパン・フレキシブル・エクイティ・ファンド	日本円	36,050,992
ジャパン・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンド	日本円	105,065,371
ラテン・アメリカン・ファンド	米ドル	3,818,700
ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド	米ドル	45,006
ニュー・エネルギー・ファンド	米ドル	501,716
ノースアメリカン・エクイティ・インカム・ファンド	米ドル	49,796
パシフィック・エクイティ・ファンド	米ドル	734,579
中国人民元ボンド・ファンド	オフショア中国 人民元	62,059
スイス・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンド	スイス・フラン	1,079,957
ユナイテッド・キングダム・ファンド	英ポンド	998,974
USベシック・バリュー・ファンド	米ドル	1,032,739
USドル・コア・ボンド・ファンド	米ドル	108,279
USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	268,022
USドル・リザーブ・ファンド	米ドル	4,147
USドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	米ドル	11,278
USフレキシブル・エクイティ・ファンド	米ドル	422,402
USガバメント・モーゲージ・ファンド	米ドル	57,458
USグロース・ファンド	米ドル	286,977
USスモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンド	米ドル	441,617
ワールド・アグリカルチャー・ファンド	米ドル	135,431
ワールド・ボンド・ファンド	米ドル	36,078
ワールド・エネルギー・ファンド	米ドル	3,723,886
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	米ドル	1,262,674
ワールド・ゴールド・ファンド	米ドル	2,826,927
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	米ドル	1,218,190
ワールド・マイニング・ファンド	米ドル	3,836,146
ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	米ドル	26,896
ワールド・テクノロジー・ファンド	米ドル	240,883

(1) 当期において設定されたファンド。詳細については注記1を参照のこと。

すべての取引費用が個別に識別可能なわけではない。債券投資、先渡為替予約およびその他のデリバティブ契約では、取引費用は投資の売買価格に含まれることになる。一方、個別に識別可能でない取引費用は各ファンドのパフォーマンスに含まれることになる。マーケットインパクトのコストも個別に識別可能ではないため、上表において開示されていない。

19. 下引受けに係る収益

当社は、保管銀行の同意のもと下引受契約を締結することがある。下引受契約により、当社は報酬と引き換えに他の引受人による投資に先立ち、株式発行が担保される。当期において、受託引受契約に係る収益を受け取ったファンドは以下のとおりである。当該収益は純利益の一部として分類されている。

ファンド	受け取った収益
コンチネンタル・ヨーロピアン・フレキシブル・ファンド ⁽¹⁾	701,399ユーロ
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	13,849米ドル
ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	325米ドル

⁽¹⁾ 投資証券販売を再開したファンド。詳細については注記1を参照のこと。

20. 後発事象

2015年9月25日付で、グローバル・エクイティ・ファンドがグローバル・オポチュニティーズ・ファンドと併合した。

2015年9月30日付で、ワールド・エネルギー・ファンドのパフォーマンス・ベンチマークが、MSCIワールド・エネルギー・インデックスからMSCIワールド・エネルギー・10/40ネット・トータル・リターン・インデックスに、およびワールド・マイニング・ファンドのパフォーマンス・ベンチマークが、ユーロマネー・グローバル・マイニング・インデックスからユーロマネー・グローバル・マイニング・コンストレインド・ウェイツ・ネット・トータル・リターン・インデックスに変更された。

2015年11月6日付で、当社の改訂英文目論見書が発行された。英文目論見書の改訂を知らせる通知書が投資主に送付された。

2015年11月11日付で、スイス・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンドは、新規および既存の投資主に対する投資証券販売を以後の通知があるまで中止した。投資主は、従来通り払戻しはできる。

2015年12月10日、取締役会はブラックロック・インベストメント・マネジメント(ユークー)リミテッドを当社の主要販売会社に、およびブラックロック・チャンネル・アイランズ・リミテッドを当社の副販売会社に任命することを承認した。これは、2016年の第1四半期から発効となる。

2【ファンドの現況】

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(平成28年6月末現在)

【純資産額計算書】

資産総額	2,267,257,306円
負債総額	34,249,975円
純資産総額(-)	2,233,007,331円
発行済数量	2,490,743,928口
1 単位当たり純資産額(/)	0.8965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るときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

7 受益権の譲渡の対抗要件

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

8 受益権の再分割

委託会社は、受益権の再分割を行いません。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者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。

第二部 【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 2,435,000千円

発行する株式の総数 36,000株

発行済株式の総数 10,158株

直近5ヵ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、利益処分の承認、定款の変更等、会社法および定款の定めにしたがって重要事項の決定を行います。

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

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平成28年6月末現在、以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

種類		本数	純資産総額
公募投資信託	追加型株式投資信託	64本	509,421百万円
	単体型株式投資信託	0本	0百万円
私募投資信託		66本	3,461,596百万円
合計		130本	3,971,017百万円

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表の作成方法について

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

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第29期事業年度(自平成27年1月1日 至平成27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。

4．会社法第319条第1項に基づく平成26年11月18日付け臨時株主総会書面決議により、定款を一部変更し、決算期を3月31日から12月31日に変更いたしました。

したがって、前事業年度は平成26年4月1日から平成26年12月31日までの9ヶ月となっております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第28期 (平成26年12月31日現在)	第29期 (平成27年12月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	10,971	14,514
立替金	18	6
前払費用	121	146
未収入金	2 208	207
未収委託者報酬	1,102	1,077
未収運用受託報酬	2,606	2,742
未収収益	2 852	1,467
繰延税金資産	948	882
関係会社短期貸付金	2 -	130
その他流動資産	3	4
流動資産計	16,833	21,179
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1 1,391	1,223
器具備品	1 346	292
有形固定資産計	1,738	1,515
無形固定資産		
ソフトウェア	1	0
のれん	685	154
クライアント・リレーションシップ資産	230	-
無形固定資産計	916	155
投資その他の資産		
長期差入保証金	980	967
前払年金費用	315	409
長期前払費用	27	17
繰延税金資産	-	9
投資その他の資産計	1,323	1,404
固定資産計	3,978	3,075
資産合計	20,811	24,255

	第28期 (平成26年12月31日現在)	第29期 (平成27年12月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	159	80
未払金	2	
未払収益分配金	2	3
未払償還金	75	75
未払手数料	386	346
その他未払金	88	947
未払費用	2	1,091
未払消費税等	204	238
未払法人税等	1,001	561
賞与引当金	1,761	1,875
資産除去債務	42	-
役員賞与引当金	98	150
早期退職慰労引当金	36	7
流動負債計	5,104	5,377
固定負債		
退職給付引当金	51	53
資産除去債務	250	254
繰延税金負債	17	-
固定負債計	320	308
負債合計	5,425	5,685
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,435	2,435
資本剰余金		
資本準備金	2,316	2,316
その他資本剰余金	3,846	3,846
資本剰余金合計	6,162	6,162
利益剰余金		
利益準備金	336	336
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	6,452	9,634
利益剰余金合計	6,788	9,971
株主資本合計	15,386	18,569
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	-	-
評価・換算差額等合計	-	-
純資産合計	15,386	18,569
負債・純資産合計	20,811	24,255

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

		第28期 (自 平成26年4月1日 至 平成26年12月31日)	第29期 (自 平成27年1月1日 至 平成27年12月31日)
営業収益			
委託者報酬		3,449	4,339
運用受託報酬	1	5,762	10,063
その他営業収益	1	6,135	9,911
営業収益計		15,347	24,315
営業費用			
支払手数料		1,167	1,478
広告宣伝費		356	262
調査費			
調査費		256	398
委託調査費	1	2,678	4,371
調査費計		2,934	4,770
委託計算費		76	124
営業雑経費			
通信費		56	61
印刷費		58	74
諸会費		22	27
営業雑経費計		136	163
営業費用計		4,672	6,799
一般管理費			
給料			
役員報酬		262	548
給料・手当		2,665	3,631
賞与		1,355	2,231
給料計		4,282	6,411
退職給付費用		185	227
福利厚生費		531	731
事務委託費	1	1,007	1,954
交際費		37	54
寄付金		5	5
旅費交通費		163	208
租税公課		92	107
不動産賃借料		583	735
水道光熱費		75	75
固定資産減価償却費		186	214
のれん償却額		516	530
クライアント・リレーションシップ資産償却費		230	230
資産除去債務利息費用		2	3
諸経費		286	376
一般管理費計		8,187	11,869
営業利益		2,486	5,645

	第28期 (自 平成26年4月1日 至 平成26年12月31日)	第29期 (自 平成27年1月1日 至 平成27年12月31日)
営業外収益		
受取利息	0	6
有価証券売却益	142	-
為替差益	13	-
雑益	6	28
営業外収益計	163	34
営業外費用		
支払利息	49	-
為替差損	-	32
固定資産除却損	38	34
営業外費用計	88	66
経常利益	2,561	5,613
特別利益		
特別利益計	-	-
特別損失		
特別退職金	104	26
特別損失計	104	26
税引前当期純利益	2,457	5,586
法人税、住民税及び事業税	1,507	2,366
法人税等調整額	372	37
当期純利益	1,322	3,182

(3)【株主資本等変動計算書】

第28期（自 平成26年4月1日 至 平成26年12月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								評価・換算差額等		純資産 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他有価 証券評価差 額金	評価・換算 差額等合計	
		資本 準備金	その他資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計				
平成26年4月1日残高	2,435	2,316	3,846	6,162	336	5,129	5,465	14,063	40	40	14,103
事業年度中の変動額											
当期純利益						1,322	1,322	1,322			1,322
株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額（純額）									40	40	40
事業年度中の変動額合計	-	-	-	-	-	1,322	1,322	1,322	40	40	1,282
平成26年12月31日残高	2,435	2,316	3,846	6,162	336	6,452	6,788	15,386	-	-	15,386

第29期（自 平成27年1月1日 至 平成27年12月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								評価・換算差額等		純資産 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他有価 証券評価差 額金	評価・換算 差額等合計	
		資本 準備金	その他資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計				
平成27年1月1日残高	2,435	2,316	3,846	6,162	336	6,452	6,788	15,386	-	-	15,386
事業年度中の変動額											
当期純利益						3,182	3,182	3,182			3,182
株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額（純額）											
事業年度中の変動額合計	-	-	-	-	-	3,182	3,182	3,182	-	-	3,182
平成27年12月31日残高	2,435	2,316	3,846	6,162	336	9,634	9,971	18,569	-	-	18,569

【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. 固定資産の減価償却方法

(1) 有形固定資産

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

(2) 無形固定資産

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

のれん及びクライアント・リレーションシップ資産の償却方法については、その効果の及ぶ期間（5～9年）に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金の計上方法

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

(2) 退職給付引当金の計上方法

旧退職金制度

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

確定拠出年金制度

確定拠出年金制度（DC）による退職年金制度を有しております。

確定給付年金制度

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

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

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

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

- (3) 賞与引当金の計上方法
従業員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。
 - (4) 役員賞与引当金の計上方法
役員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。
 - (5) 早期退職慰労引当金の計上方法
早期退職慰労の支払に備えて、早期退職慰労支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。
4. 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。
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項
 - (1) 消費税等の処理方法
消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。
 - (2) 決算日の変更について
会社法第319条に基づく平成26年11月18日付け臨時株主総会書面決議により、定款を一部変更し、決算期を3月31日から12月31日に変更しました。
従って、前事業年度は平成26年4月1日から平成26年12月31日までの9ヶ月となっております。
 - (3) 連結納税制度の適用
当事業年度より、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。

〔注記事項〕

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成26年12月31日)	当事業年度 (平成27年12月31日)
建物附属設備	892 百万円	1,039 百万円
器具備品	702 百万円	649 百万円

2 関係会社に対する資産及び負債

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 (平成26年12月31日)	当事業年度 (平成27年12月31日)
未収入金	201 百万円	200 百万円
未収収益	510 百万円	379 百万円
短期貸付金	- 百万円	130 百万円
未払金	- 百万円	930 百万円
未払費用	316 百万円	201 百万円

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

	前事業年度 (平成26年12月31日)	当事業年度 (平成27年12月31日)
当座貸越極度額	1,000 百万円	1,000 百万円
借入実行残高	-	-
差引額	1,000 百万円	1,000 百万円

(損益計算書関係)

1 関係会社に対する営業収益及び営業費用

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成26年4月1日 至 平成26年12月31日)		(自 平成27年1月1日 至 平成27年12月31日)	
その他営業収益	3,611	百万円	4,286	百万円
委託調査費	353	百万円	467	百万円
事務委託費	1,210	百万円	613	百万円
運用受託報酬	0	百万円	1	百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成26年12月31日)

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度 (自 平成27年1月1日 至 平成27年12月31日)

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

営業債務である未払手数料はその全てが1年以内の支払期日となっております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成26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	10,971	10,971	-
(2) 未収委託者報酬	1,102	1,102	-
(3) 未収運用受託報酬	2,606	2,606	-
(4) 未収収益	852	852	-
(5) 長期差入保証金	980	971	9
資産計	16,514	16,504	9
(1) 未払手数料	386	386	-
(2) 未払費用	1,246	1,246	-
負債計	1,633	1,633	-

当事業年度 (平成27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	14,514	14,514	-
(2) 未収委託者報酬	1,077	1,077	-
(3) 未収運用受託報酬	2,742	2,742	-
(4) 未収収益	1,467	1,467	-
(5) 長期差入保証金	967	959	7
資産計	20,769	20,761	7
(1) 未払手数料	346	346	-
(2) 未払費用	1,091	1,091	-
負債計	1,437	1,437	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

資 産

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

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

(5) 長期差入保証金

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) 未払費用

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

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成26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	10,971	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,102	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,606	-	-	-
(4) 未収収益	852	-	-	-
(5) 長期差入保証金	26	904	40	10
合計	15,559	904	40	10

当事業年度（平成27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	14,514	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,077	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,742	-	-	-
(4) 未収収益	1,467	-	-	-
(5) 長期差入保証金	-	907	48	11
合計	19,801	907	48	11

(有価証券関係)

前事業年度（平成26年12月31日）

前事業年度中に売却したその他有価証券

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
その他	942	142	-

当事業年度（平成27年12月31日）

該当事項はありません。

(退職給付関係)

前事業年度(自平成26年4月1日 至 平成26年12月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:百万円)

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成26年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,580
勤務費用	164
利息費用	11
数理計算上の差異の発生額	52
退職給付の支払額	221
退職給付債務の期末残高	1,587

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位:百万円)

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成26年12月31日)
年金資産の期首残高	2,050
期待運用収益	13
数理計算上の差異の発生額	176
事業主からの拠出額	185
退職給付の支払額	221
年金資産の期末残高	2,205

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

(単位：百万円)

	前事業年度 (平成26年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,536
年金資産	2,205
	669
非積立型制度の退職給付債務	51
未積立退職給付債務	618
未認識数理計算上の差異	323
未認識過去勤務費用	31
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	263
退職給付引当金	51
前払年金費用	315
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	263

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成26年12月31日)
勤務費用	164
利息費用	11
期待運用収益	13
数理計算上の差異の費用処理額	20
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	138
特別退職金	104
合計	242

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	前事業年度 (平成26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68%、株式29%及びその他3%となっております。

長期期待運用収益率の算定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成26年12月31日)
割引率	0.7%
長期期待運用収益率	1.1%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、46百万円でありました。

当事業年度（自 平成27年1月1日 至 平成27年12月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	当事業年度 (自 平成27年1月 1日 至 平成27年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,587
勤務費用	223
利息費用	10
数理計算上の差異の発生額	10
退職給付の支払額	171
退職給付債務の期末残高	1,661

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	当事業年度 (自 平成27年1月 1日 至 平成27年12月31日)
年金資産の期首残高	2,205
期待運用収益	24
数理計算上の差異の発生額	9
事業主からの拠出額	256
退職給付の支払額	171
年金資産の期末残高	2,304

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

(単位：百万円)

	当事業年度 (平成27年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,607
年金資産	2,304
	697
非積立型制度の退職給付債務	53
未積立退職給付債務	643
未認識数理計算上の差異	261
未認識過去勤務費用	26
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	355
退職給付引当金	53
前払年金費用	409
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	355

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	当事業年度 (自 平成27年1月 1日 至 平成27年12月31日)
勤務費用	223
利息費用	10
期待運用収益	24
数理計算上の差異の費用処理額	4
過去勤務費用の処理額	41
確定給付制度に係る退職給付費用合計	164
特別退職金	26
合計	191

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	当事業年度 (平成27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70%、株式27%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 平成27年1月 1日 至 平成27年12月31日)
割引率	0.7%
長期期待運用収益率	1.2%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、64百万円 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	当事業年度
	(平成26年12月31日)	(平成27年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	231	155
賞与引当金	616	619
資産除去債務	104	82
資産調整勘定	73	46
未払事業税	74	105
早期退職慰労引当金	12	2
退職給付引当金	18	17
有形固定資産	0	0
その他	23	15
繰延税金資産合計	1,156	1,046
繰延税金負債		
無形固定資産	81	-
退職給付引当金	112	132
資産除去債務に対応する除去費用	31	21
繰延税金負債合計	225	153
繰延税金資産の純額	931	892

(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せん。

(単位：百万円)

	前事業年度	当事業年度
	(平成26年12月31日)	(平成27年12月31日)
流動資産 - 繰延税金資産	948	882
固定資産 - 繰延税金資産	-	9
固定負債 - 繰延税金負債	17	-

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	当事業年度
	(平成26年12月31日)	(平成27年12月31日)
法定実効税率	35.6%	35.6%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	3.4	3.0
損金不算入ののれん償却額	7.5	3.3
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-	1.2
その他	0.4	0.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率	46.0%	43.0%

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

当事業所の定期建物賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位：百万円)

	前事業年度	当事業年度
	(自平成26年4月1日 至平成26年12月31日)	(自平成27年1月1日 至平成27年12月31日)
期首残高	306	293
時の経過による調整額	2	3
資産除去債務の履行による減少額	-	42
見積りの変更による増減額	15	-
期末残高	293	254

4. 当該資産除去債務の見積りの変更

前事業年度において、一部の資産について資産の除去時点において必要とされる除去費用が、固定資産取得時における見積額を下回る見込みであることが明らかになったことから、見積もりの変更により資産除去債務を15百万円減少させております。

(セグメント情報等)

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成26年12月31日）

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：百万円）

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	3,449	5,762	6,135	15,347

(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
8,479	5,353	1,514	15,347

（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	3,611	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	1,690	投資運用業

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自平成27年1月1日 至 平成27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	4,339	10,063	9,911	24,315

(2) 地域ごとの情報

売上高

(単位:百万円)

日本	北米	その他	合計
13,272	8,558	2,483	24,315

(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位:百万円)

相手先	営業収益	関連するセグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	4,287	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	2,857	投資運用業

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成26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・ファイナンス・マネジメント・インク	米国 ニューヨーク州	13,067 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	0	未収収益	510
							受入 手数料	3,611		
							委託 調査費	353	未払費用	316
							事務 委託費	1,210		

当事業年度（自 平成27年1月1日 至 平成27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・ファイナンス・マネジメント・インク	米国 ニューヨーク州	13,482 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	1	未収収益	379
							受入 手数料	4,286		
							委託 調査費	467	未払費用	201
							事務 委託費	613		
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本 東京都	1万円	持株会社	(被所有) 直接 100	株式の 保有等	営業外収益	0	未収入金	200
									未収収益	0
									短期 貸付金	130
									その他 未払金	930

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成26年12月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年1月1日 至 平成27年12月31日）

該当事項はありません。

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

前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成26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・ルックス・フィンコ・S.a.r.l.	ルクセンブルグ大公国ルクセンブルグ市	2百万米ドル	資産運用会社等の事業の支配・管理	なし	ローン借入	資金の返済	2,737	長期借入金	-
							支払利息	49	未払利息	-
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	1,690	未収収益	183

当事業年度 (自 平成27年1月1日 至 平成27年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国カリフォルニア州	1,000米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	2,857	未収入金	3
							委託調査費	3	未収収益	736
							事務委託費	0	未払費用	1
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エルエルシー	米国デラウェア州	1,723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	543	未収収益	49
							委託調査費	1,449	未払費用	142
							事務委託費	74		

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 親会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(1株当たり情報)

項 目	前事業年度	当事業年度
	(自 平成26年4月 1日 至 平成26年12月31日)	(自 平成27年1月 1日 至 平成27年12月31日)
1株当たり純資産額	1,514,717 円 33 銭	1,828,038 円 62 銭
1株当たり当期純利益金額	130,237 円 41 銭	313,321 円 29 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	当事業年度
	(自 平成26年4月 1日 至 平成26年12月31日)	(自 平成27年1月 1日 至 平成27年12月31日)
当期純利益 (百万円)	1,322	3,182
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)	1,322	3,182
普通株式の期中平均株式数 (株)	10,158	10,158

独立監査人の監査報告書は、当事業年度(自 平成27年1月1日 至平成27年12月31日)を対象としております。

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行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
平成19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。
平成19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。
平成19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。
平成19年12月27日	事業を営むこと目的を変更するため、定款変更を行いました。
平成20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。
平成20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。
平成21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。
平成21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。
平成23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。
平成25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。
平成26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(平成28年3月末現在)
- ・事業の内容 : 銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

<参考:再信託受託会社の概要>

- ・名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・資本金 : 51,000百万円(平成28年3月末現在)
- ・事業の内容 : 銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。
- ・再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部(信託財産の管理)を原信託受託会社から再信託受託会社(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名称	資本金の額(百万円) (平成28年3月末現在)	事業の内容
藍澤證券株式会社	8,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
いよぎん証券株式会社*	3,000	
株式会社SBI証券	47,937	
SMB C日興証券株式会社	10,000	
高木証券株式会社	11,069	
マネックス証券株式会社	12,200	
三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社	8,000	
楽天証券株式会社	7,495	銀行法に基づき、銀行業を営んでおります。
株式会社伊予銀行*	20,948	

* いよぎん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 【参考情報】

当計算期間において、ファンドに係る金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は、以下の通り提出されております。

平成28年1月12日	臨時報告書
平成28年3月18日	有価証券報告書、有価証券届出書
平成28年4月8日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成28年2月26日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているブラックロック・ジャパン株式会社の平成27年1月1日から平成27年12月31日までの第29期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・ジャパン株式会社の平成27年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成28年8月3日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーの平成27年12月22日から平成28年6月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーの平成28年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。